

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年4月28日提出
【計算期間】	第28期(自 2021年2月2日至 2022年2月1日)
【ファンド名】	財形株投（一般財形30） 財形株投（一般財形50） 財形株投（年金・住宅財形30）
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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

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

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

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

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

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

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

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

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

3. 信託財産の安定した成長をめざして安定運用を行ないます。

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

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

- *1 バラ日本株式モデル
 バラ日本株式モデルは、日本株への投資から期待される収益（必然的にリスクを伴います。）の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指数、③業種指標、④ポートフォリオ（または個別銘柄）固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し数値化します。これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適なポートフォリオを求めます。
- *2 TOPIX(東証株価指数)
 TOPIX(東証株価指数)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

4.

お買付けは無手数料で、給与天引きで行ないます。

給与からの天引きですので、毎月定期的に積立いただけます。

5.

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

詳しくは、勤務先の事務局へお問い合わせください。

〈ファンドの仕組み〉

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



主な投資制限

「財形株投(一般財形 30)」

「財形株投(年金・住宅財形 30)」

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

「財形株投(一般財形 50)」

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

分配方針

「財形株投(一般財形 30)」 「財形株投(一般財形 50)」 「財形株投(年金・住宅財形 30)」

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

- ・TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標準または商標は、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に係る標準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に係る標準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遅延、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。

信託金限度額

- ・各ファンド毎に、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

1994年 2月 4日

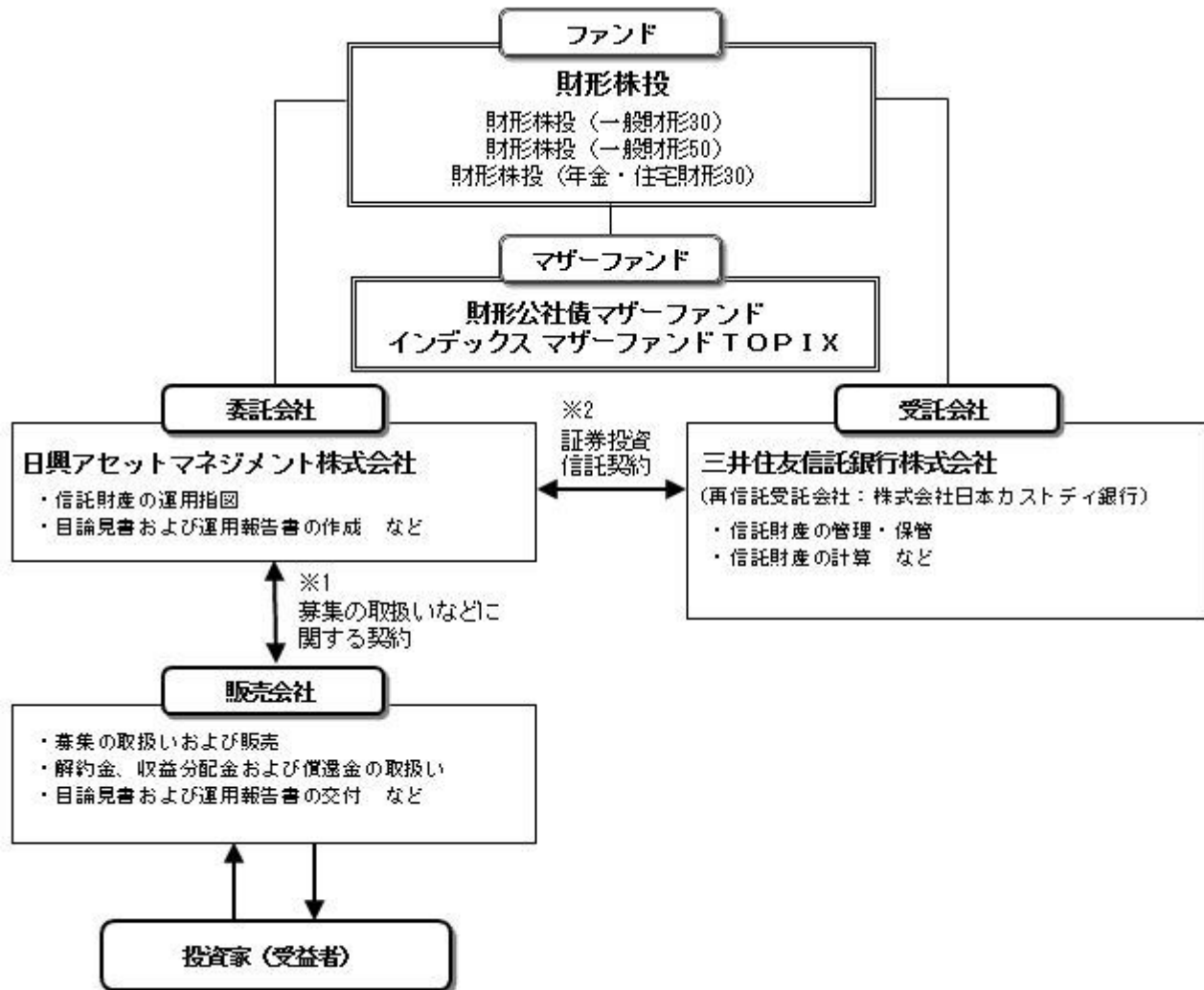
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

2018年3月20日

- ・ 投資対象ファンドに関する変更

(3) 【ファンドの仕組み】

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

<財形株投（一般財形30）>

<財形株投（年金・住宅財形30）>

・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。

・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

<財形株投（一般財形50）>

・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。

・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

（2）【投資対象】

<財形株投（一般財形30）>

<財形株投（一般財形50）>

<財形株投（年金・住宅財形30）>

「財形公社債マザーファンド」受益証券および「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第18条および第18条の2に定めるものに限りま。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7) コマーシャル・ペーパー

8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの

10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に

類する証券

- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 外国の者に対する権利で16)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 有価証券の貸付
 - 5) 外国為替予約取引
 - 6) 資金の借入

<インデックス マザーファンド T O P I X >

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
 - 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
 - 4) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 5) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
 - 6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 7) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 有価証券の貸付
- <財形公社債マザーファンド>
内外の公社債を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第13条および第13条の2に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
 - 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)
 - 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
 - 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引

- 3) 有価証券の貸付
4) 外国為替予約取引

投資対象とするマザーファンドの概要

< 財形公社債マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目的として安定運用を行いません。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資は行ないません。 ・ 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 ・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1994年2月4日設定）
決算日	毎年2月1日 （2月1日および2日のいずれかが休業日のときは、2月1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち2月1日に最も近い日を決算日とします。）

< インデックス マザーファンド TOPIX >

運用の基本方針

基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数） [*] の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「パーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行いません。 <ul style="list-style-type: none"> 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行いません。 株式の組入比率は、高位を保ちます。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

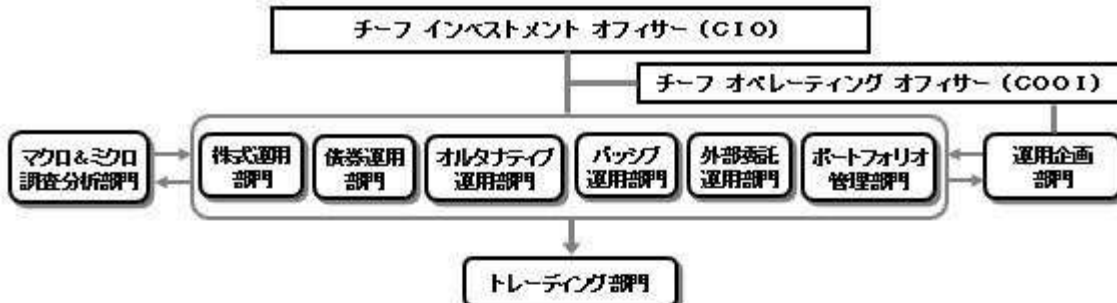
* T O P I X（東証株価指数）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

T O P I Xの指数値およびT O P I X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T O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xに係る標章または商標に関するすべ

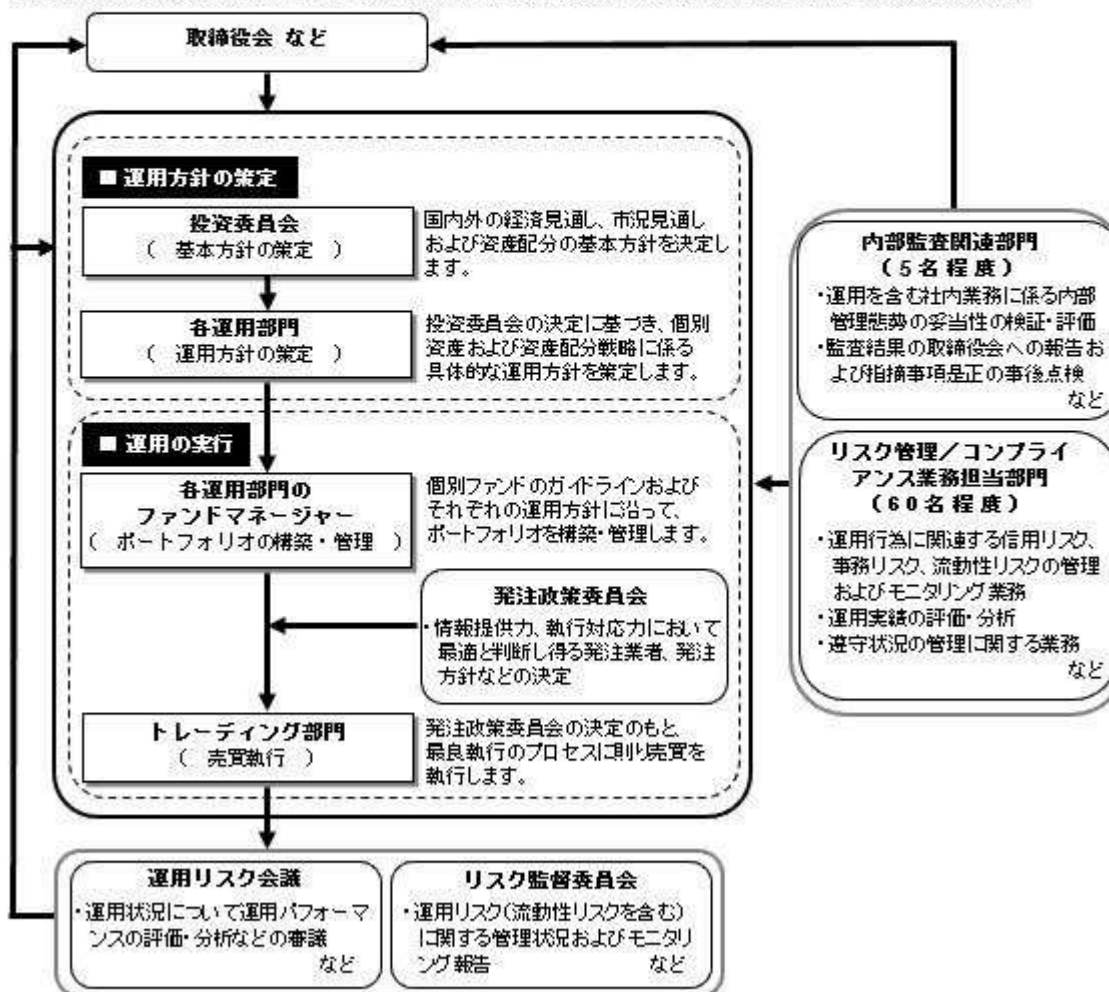
ての権利はJ P Xが有します。J P Xは、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2022年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< 財形株投（一般財形30） >

< 財形株投（一般財形50） >

< 財形株投（年金・住宅財形30） >

1) < 財形株投（一般財形30） >

< 財形株投（年金・住宅財形30） >

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

< 財形株投（一般財形50） >

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資

産総額の50%以下とします。

- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 5) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 6) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 7) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売り出しにより取得する株券
- ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
- ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 9) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 10) 信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 11) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 12) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 14) 信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価

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

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

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

<インデックス マザーファンド T O P I X >

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

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

3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

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

イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

ロ) 株式分割により取得する株券

ハ) 有償増資により取得する株券

ニ) 売り出しにより取得する株券

6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

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

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

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

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<財形公社債マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取

引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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せん。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項

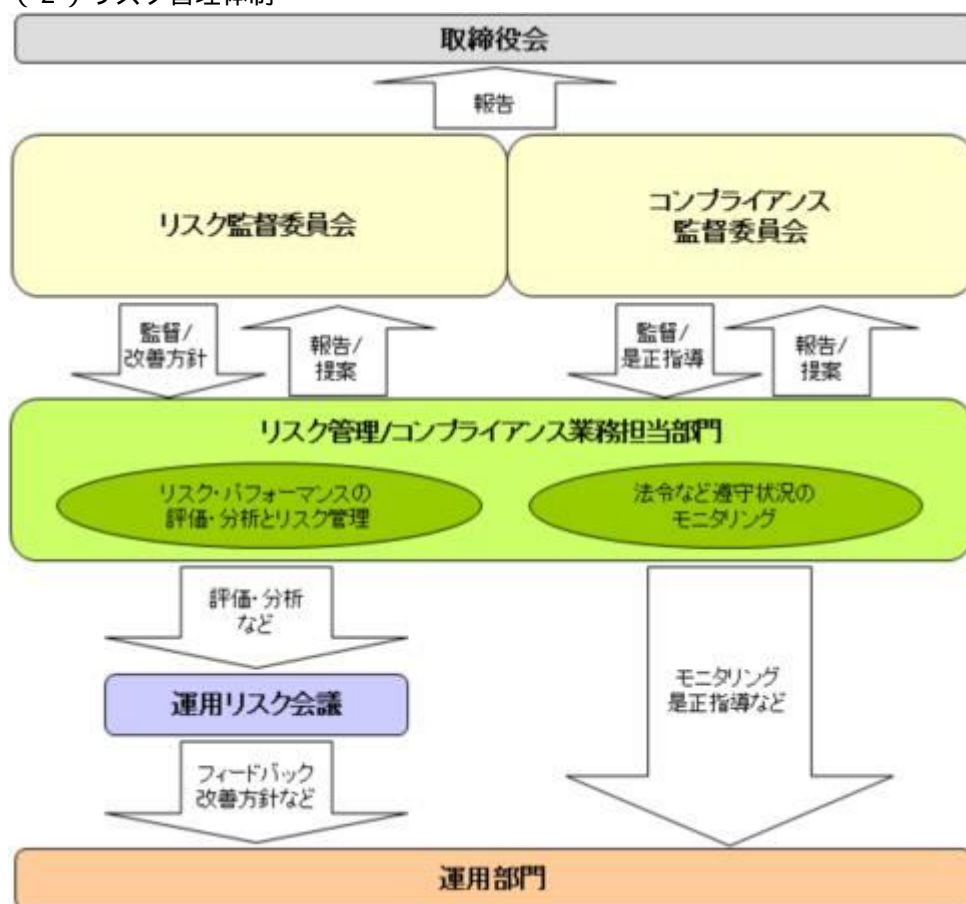
ファンドが投資対象とする投資信託証券(マザーファンドを含みます。)と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

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

（２）リスク管理体制



全社的なリスク管理

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

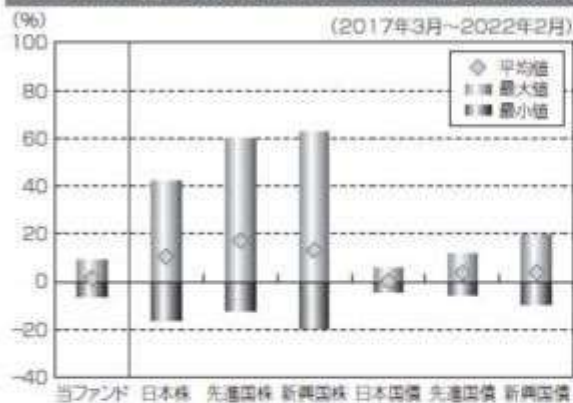
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行いません。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行いません。

上記体制は2022年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

「財形株投(一般財形 30)」

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

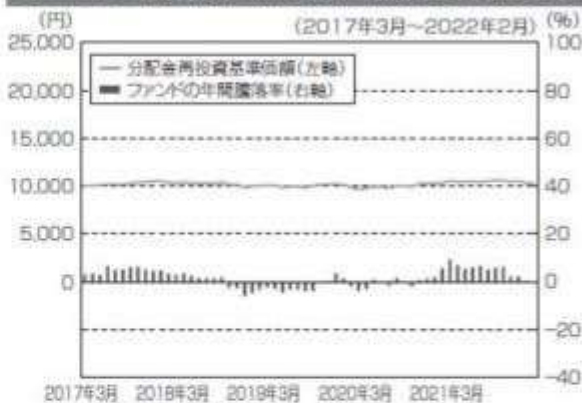
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.4%	10.3%	17.1%	13.2%	0.1%	3.6%	3.8%
最大値	9.1%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-6.0%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.0%	-5.4%	-9.4%

※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3月から2022年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



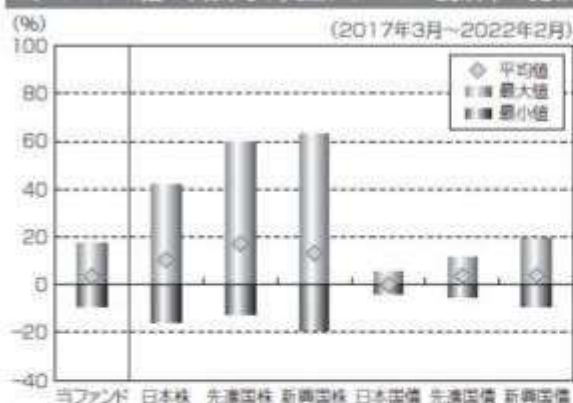
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

「財形株投(一般財形 50)」

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

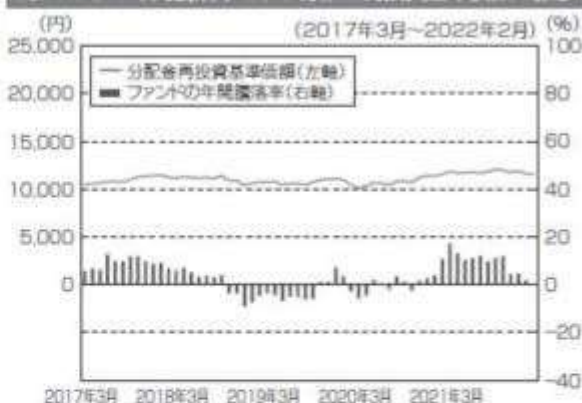
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.4%	10.3%	17.1%	13.2%	0.1%	3.6%	3.8%
最大値	17.2%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-9.2%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.0%	-5.4%	-9.4%

※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3月から2022年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



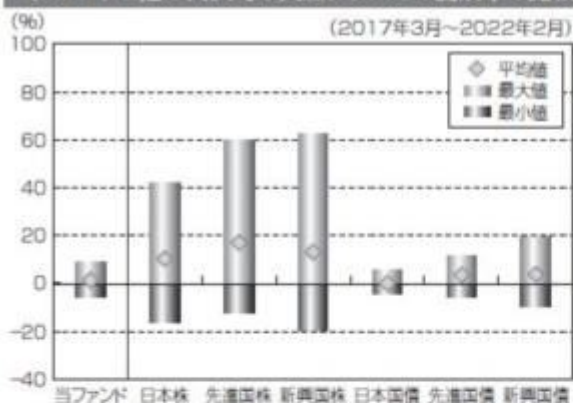
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

「財形株投(年金・住宅財形 30)」

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの平均騰落率、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	1.4%	10.3%	17.1%	13.2%	0.1%	3.6%	3.8%
最大値	9.2%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-5.9%	-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3月から2022年2月の5年間の各月末における最近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージングマーケットインデックス(配当込、円ベース)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

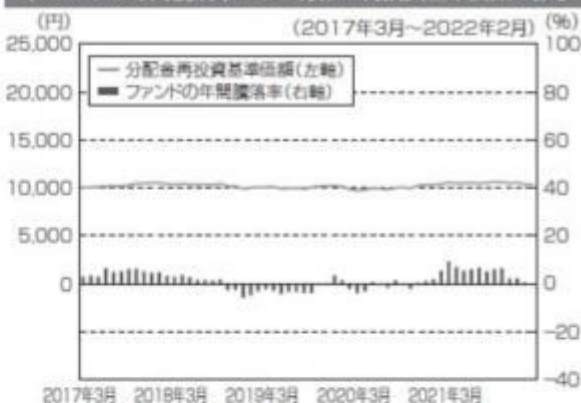
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万円当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4【手数料等及び税金】**(1)【申込手数料】**

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.572%（税抜0.52%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.52%	0.22%	0.25%	0.05%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

< 一般財形の場合 >

収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

< 年金・住宅財形の場合 >

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

(目的外解約)

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

個別元本

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

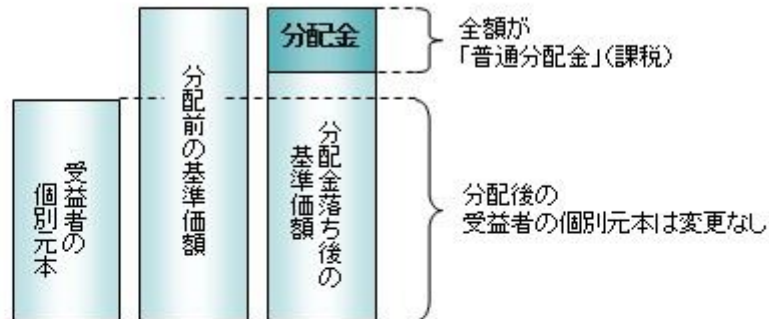
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場

合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

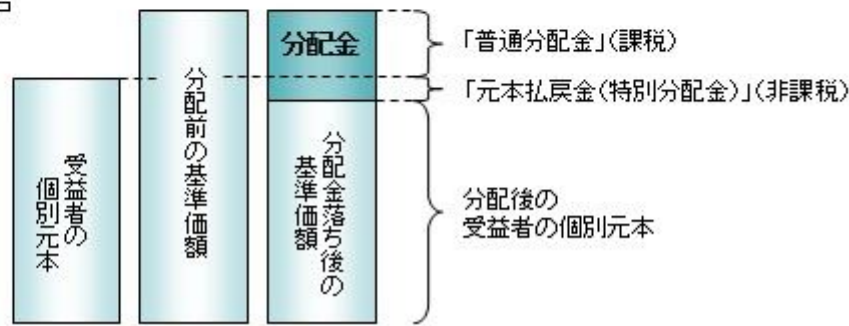
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2022年4月28日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【財形株投（一般財形30）】

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100,972,415	97.47
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,622,021	2.53
合計(純資産総額)		103,594,436	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	55,488,142	1.2739	70,686,345	1.2740	70,691,892	68.24
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	12,154,995	2.5025	30,417,875	2.4912	30,280,523	29.23

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.47
合 計	97.47

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	73	74	0.8775	0.8780
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	76	76	0.9341	0.9346
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	76	76	0.9788	0.9793
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	74	74	0.9931	0.9936
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	74	74	1.0043	1.0048
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	96	96	1.0543	1.0548
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	92	92	0.9991	0.9996
第26計算期間末 (2020年 2月 3日)	102	102	1.0087	1.0092
第27計算期間末 (2021年 2月 1日)	116	116	1.0311	1.0316
第28計算期間末 (2022年 2月 1日)	110	110	1.0303	1.0308
2021年 2月末日	116		1.0345	
3月末日	114		1.0511	
4月末日	113		1.0416	
5月末日	114		1.0443	
6月末日	115		1.0471	

7月末日	117		1.0408
8月末日	117		1.0483
9月末日	116		1.0589
10月末日	116		1.0533
11月末日	110		1.0422
12月末日	111		1.0504
2022年 1月末日	110		1.0313
2月末日	103		1.0277

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.54
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.51
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.84
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.51
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.18
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	5.19
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	1.01
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	2.27
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.03

(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19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	7,267,816	3,692,263
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	5,310,568	7,297,643
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	7,771,084	11,906,050
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	10,650,522	13,562,169
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	9,441,348	10,877,640
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	19,263,657	1,878,188
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	12,037,575	10,950,460
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	14,822,167	5,888,725
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	16,599,772	5,126,195
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	10,442,932	15,936,539

【財形株投（一般財形50）】

以下の運用状況は2022年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	186,210,711	97.41
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,947,005	2.59
合計（純資産総額）		191,157,716	100.00

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	37,611,949	2.5024	94,120,142	2.4912	93,698,887	49.02
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	72,615,247	1.2739	92,504,564	1.2740	92,511,824	48.40

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.41
合計	97.41

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	180	180	0.8230	0.8235
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	169	169	0.9212	0.9217
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	183	183	0.9993	0.9998
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	187	187	1.0263	1.0268
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	207	207	1.0525	1.0530
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	241	241	1.1549	1.1554
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	225	225	1.0635	1.0640
第26計算期間末 (2020年 2月 3日)	209	209	1.0921	1.0926
第27計算期間末 (2021年 2月 1日)	194	194	1.1429	1.1434
第28計算期間末 (2022年 2月 1日)	195	195	1.1566	1.1571
2021年 2月末日	196		1.1517	
3月末日	201		1.1827	
4月末日	200		1.1652	
5月末日	202		1.1714	
6月末日	204		1.1771	
7月末日	205		1.1644	
8月末日	210		1.1801	
9月末日	213		1.2026	
10月末日	196		1.1935	
11月末日	194		1.1723	
12月末日	199		1.1896	
2022年 1月末日	195		1.1576	
2月末日	191		1.1529	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
---	----	--------------

第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	11.83
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	11.99
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	8.53
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	2.75
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	2.60
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	9.78
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	7.87
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	2.74
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	4.70
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	1.24

(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19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	26,104,473	7,608,165
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	18,531,876	53,414,352
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	17,501,615	18,329,958
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	17,040,435	17,577,441
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	18,988,051	4,886,387
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	48,663,216	36,200,357
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	21,221,642	18,123,775
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,804,485	42,344,325
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	20,242,673	42,112,594
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	16,776,660	17,963,998

【財形株投（年金・住宅財形30）】

以下の運用状況は2022年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	232,180,545	97.43
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		6,122,989	2.57
合計（純資産総額）		238,303,534	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	128,550,979	1.2739	163,771,668	1.2740	163,773,947	68.72
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	27,459,296	2.5025	68,717,478	2.4912	68,406,598	28.71

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.43
合計	97.43

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（百万円）	1口当たり純資産額（円）
--	------------	--------------

期別	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	178	178	0.8795	0.8800
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	188	188	0.9360	0.9365
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	190	190	0.9807	0.9812
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	178	178	0.9949	0.9954
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	182	182	1.0057	1.0062
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	210	210	1.0558	1.0563
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	203	203	1.0016	1.0021
第26計算期間末 (2020年 2月 3日)	201	201	1.0109	1.0114
第27計算期間末 (2021年 2月 1日)	221	221	1.0324	1.0329
第28計算期間末 (2022年 2月 1日)	237	237	1.0325	1.0330
2021年 2月末日	223		1.0359	
3月末日	228		1.0525	
4月末日	227		1.0429	
5月末日	229		1.0457	
6月末日	231		1.0485	
7月末日	234		1.0422	
8月末日	237		1.0496	
9月末日	240		1.0602	
10月末日	239		1.0552	
11月末日	238		1.0443	
12月末日	241		1.0526	
2022年 1月末日	237		1.0335	
2月末日	238		1.0300	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.58
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.48
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.83
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.50
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.14
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	5.09
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.98
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	2.18
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.06

(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19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	20,751,257	20,707,336
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	17,559,108	18,995,836
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	20,521,555	27,814,502
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	20,768,810	35,315,828
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	22,112,907	19,936,078
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	34,698,129	17,021,386
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	22,034,865	18,046,134
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,763,698	25,689,628
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	21,694,209	6,452,657
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	19,721,443	4,395,546

（参考）

財形公社債マザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	210,357,960	64.34
地方債証券	日本	25,095,016	7.68
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		91,484,205	27.98
合計（純資産総額）		326,937,181	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	40,000,000	100.44	40,178,400	100.40	40,162,800	0.100	2028/12/20	12.28
日本	国債証券	第355回利付国債 (10年)	40,000,000	100.36	40,146,800	100.29	40,116,000	0.100	2029/6/20	12.27
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	40,000,000	100.23	40,094,000	100.15	40,062,000	0.100	2029/12/20	12.25
日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	40,000,000	100.08	40,033,200	100.00	40,000,000	0.100	2030/6/20	12.23
日本	国債証券	第134回利付国債 (5年)	30,000,000	100.17	30,052,160	100.17	30,052,160	0.100	2022/12/20	9.19
日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	20,000,000	99.82	19,964,800	99.82	19,965,000	0.100	2030/12/20	6.11
日本	地方債証券	平成24年度第3回 愛知県公募公債(10年)	15,000,000	100.22	15,033,216	100.22	15,033,216	0.891	2022/5/30	4.60
日本	地方債証券	第718回東京都公 募公債	10,000,000	100.67	10,067,200	100.61	10,061,800	0.600	2023/3/20	3.08

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	64.34
地方債証券	7.68
合計	72.02

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

インデックス マザーファンド TOPIX

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

株式	日本	42,136,367,910	99.74
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		110,518,664	0.26
合計(純資産総額)		42,246,886,574	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	113,460,000	0.27

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	827,400	2,181.92	1,805,326,600	2,138.50	1,769,394,900	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	102,300	12,494.01	1,278,138,000	11,810.00	1,208,163,000	2.86
日本	株式	キーエンス	電気機器	14,800	56,806.89	840,742,000	53,780.00	795,944,000	1.88
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,010,400	753.64	761,486,330	712.80	720,213,120	1.70
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	120,400	5,760.89	693,611,200	4,819.00	580,207,600	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	10,400	56,595.76	588,596,000	55,770.00	580,008,000	1.37
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	167,800	3,297.97	553,399,400	3,293.00	552,565,400	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	9,200	57,750.00	531,300,000	58,020.00	533,784,000	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	96,100	5,267.68	506,224,600	5,125.00	492,512,500	1.17
日本	株式	信越化学工業	化学	27,500	18,758.12	515,848,500	17,670.00	485,925,000	1.15
日本	株式	HOYA	精密機器	31,900	15,355.40	489,837,500	14,855.00	473,874,500	1.12
日本	株式	三菱商事	卸売業	120,500	4,058.20	489,013,800	3,871.00	466,455,500	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,500	4,352.88	485,346,700	4,121.00	459,491,500	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	128,600	3,575.41	459,798,000	3,525.00	453,315,000	1.07
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	128,400	3,499.13	449,289,200	3,501.00	449,528,400	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	78,600	5,819.26	457,394,400	5,650.00	444,090,000	1.05
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,800	21,531.12	447,847,500	21,205.00	441,064,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	117,000	3,718.21	435,030,800	3,756.00	439,452,000	1.04
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	112,500	3,837.04	431,667,300	3,743.00	421,087,500	1.00
日本	株式	日本電産	電気機器	42,300	10,064.98	425,749,000	9,883.00	418,050,900	0.99
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	18,400	22,340.00	411,056,000	21,130.00	388,792,000	0.92
日本	株式	村田製作所	電気機器	48,000	7,996.50	383,832,000	7,787.00	373,776,000	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	128,400	2,381.89	305,835,600	2,793.50	358,685,400	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	124,900	3,060.12	382,209,200	2,865.50	357,900,950	0.85

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	243,000	1,436.02	348,953,600	1,450.50	352,471,500	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	63,000	5,704.02	359,353,500	5,591.00	352,233,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	53,100	7,040.07	373,828,200	6,574.00	349,079,400	0.83
日本	株式	S M C	機械	4,800	63,190.00	303,312,000	68,050.00	326,640,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	205,900	1,635.92	336,837,100	1,525.00	313,997,500	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	14,300	22,835.00	326,540,500	21,155.00	302,516,500	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	2.31
		食料品	3.43
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.61
		医薬品	5.03
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.86
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.60
		機械	5.23
		電気機器	17.60
		輸送用機器	8.47
		精密機器	2.64
		その他製品	2.38
		電気・ガス業	1.17
		陸運業	3.07
		海運業	0.64
		空運業	0.43
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.05
		卸売業	5.71
		小売業	4.35
銀行業	5.41		
証券、商品先物取引業	0.78		
保険業	2.18		
その他金融業	1.14		
不動産業	1.97		

	サービス業	5.72
合計		99.74

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2022年03月	買建	6	日本円	115,920,000	113,460,000	0.27

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

参考情報

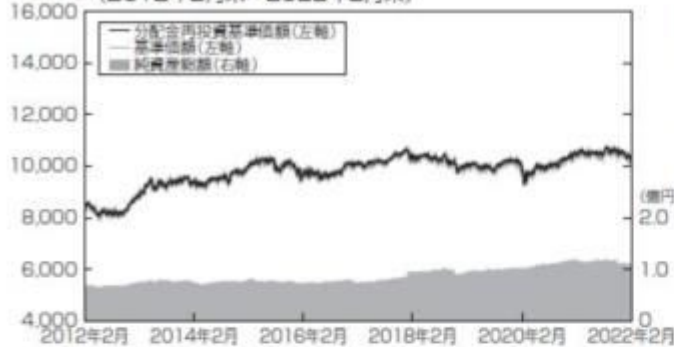
運用実績

2022年2月28日現在

基準価額・純資産の推移

【財形株投(一般財形 30)】

(円) (2012年2月末～2022年2月末)



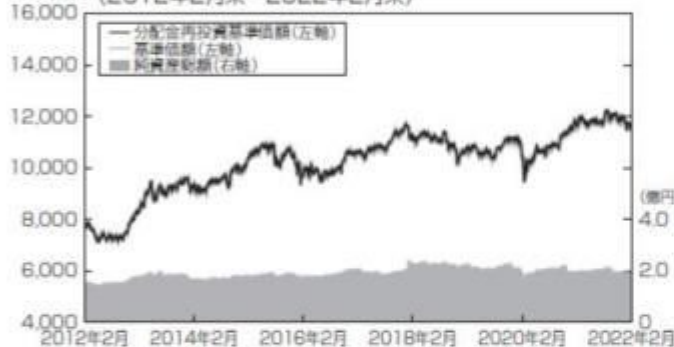
基準価額……………10,277円

純資産総額……………1.03億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2012年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

【財形株投(一般財形 50)】

(円) (2012年2月末～2022年2月末)



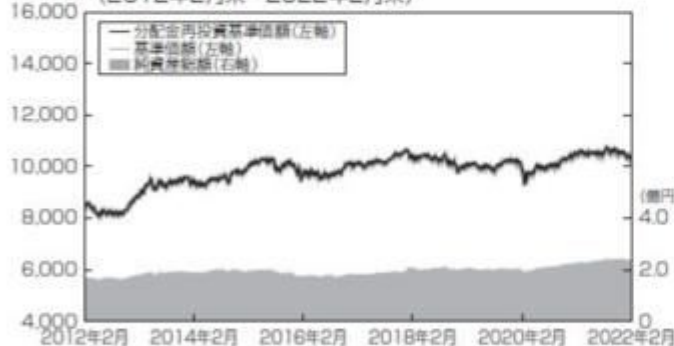
基準価額……………11,529円

純資産総額……………1.91億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2012年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

【財形株投(年金・住宅財形 30)】

(円) (2012年2月末～2022年2月末)



基準価額……………10,300円

純資産総額……………2.38億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2012年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

【財形株投(一般財形 30)】

2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	2022年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	135円

【財形株投(一般財形 50)】

2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	2022年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	135円

【財形株投(年金・住宅財形 30)】

2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	2022年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	135円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	財形株投 (一般財形 30)	財形株投 (一般財形 50)	財形株投 (年金・住宅財形 30)
財形公社債マザーファンド	68.24%	48.40%	68.72%
インデックス マザーファンド TOPIX	29.23%	49.02%	28.71%
現金その他	2.53%	2.59%	2.57%

※各ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>

財形公社債マザーファンド

銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1 第353回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2028年12月20日	12.28%
2 第355回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2029年6月20日	12.27%
3 第357回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2029年12月20日	12.25%

※財形公社債マザーファンドの対純資産総額比です。

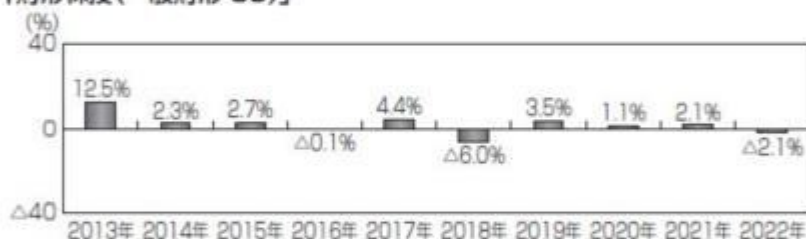
インデックス マザーファンド TOPIX

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.19%
2 ソニーグループ	電気機器	2.86%
3 キーエンス	電気機器	1.88%
4 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.70%
5 リクルートホールディングス	サービス業	1.37%

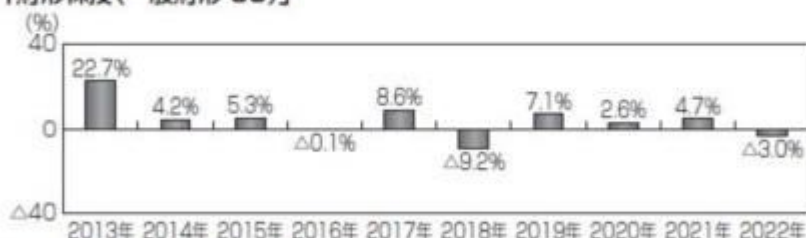
※インデックス マザーファンド TOPIXの対純資産総額比です。

年間収益率の推移

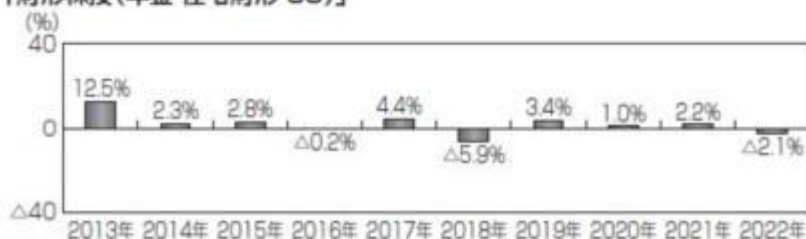
「財形株投(一般財形 30)」



「財形株投(一般財形 50)」



「財形株投(年金・住宅財形 30)」



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2022年は、2022年2月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

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

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

(2) 申込金額

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

(3) 申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

(4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(5) 受付の中止および取消

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

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

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

一般財形の場合(<一般財形30> <一般財形50>)

原則として、いつでも解約が可能です。

年金財形の場合(<年金・住宅財形30>)

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

住宅財形の場合(<年金・住宅財形30>)

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

(2) 解約制限

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

(3) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(4) 手取額

一般財形の場合(<一般財形30> <一般財形50>)

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

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

年金財形の場合(＜年金・住宅財形30＞)

1) 年金受取りを目的として解約される場合

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

2) 年金受取り以外の目的で解約される場合

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

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

住宅財形の場合(＜年金・住宅財形30＞)

1) 自宅用住宅の取得などを目的として解約される場合

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

2) 自宅用住宅の取得など以外の目的で解約される場合

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

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 解約単位

1口単位

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

(6) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(7) 受付の中止および取消

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

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

(2) 買取制限

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

(3) 買取価額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(5) 買取単位

1口単位

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

(6) 受付の中止および取消

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

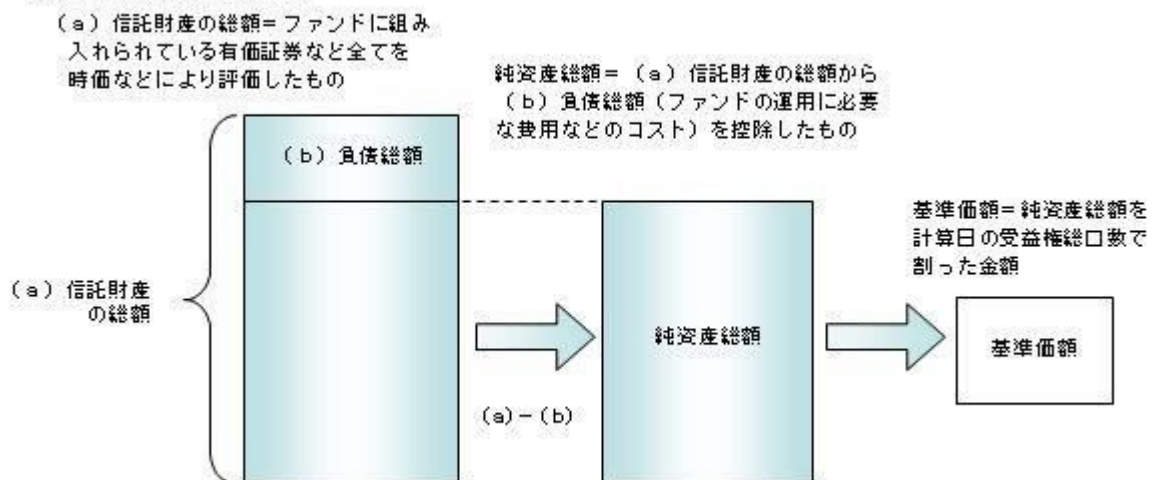
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

国内公社債

原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします(1994年2月4日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 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) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

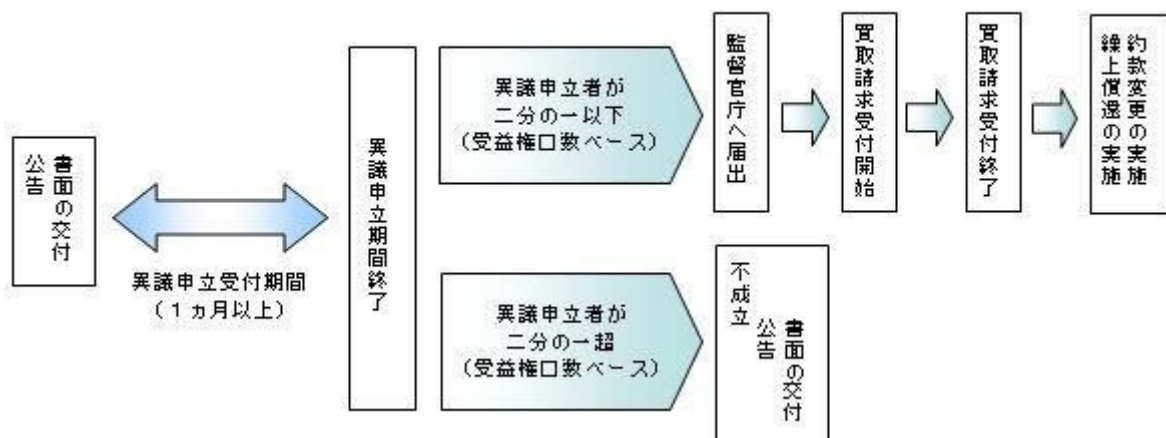
信託約款の変更

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

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期計算期間（2021年2月2日から2022年2月1日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【財形株投(一般財形30)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,857,740	3,659,967
親投資信託受益証券	113,308,714	107,773,662
流動資産合計	117,166,454	111,433,629
資産合計	117,166,454	111,433,629
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	56,345	53,599
未払受託者報酬	30,918	31,733
未払委託者報酬	879,742	903,075
その他未払費用	2,418	2,499
流動負債合計	969,423	990,906
負債合計	969,423	990,906
純資産の部		
元本等		
元本	112,691,772	107,198,165
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,505,259	3,244,558
(分配準備積立金)	6,917,561	5,933,642
元本等合計	116,197,031	110,442,723
純資産合計	116,197,031	110,442,723
負債純資産合計	117,166,454	111,433,629

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第27期		第28期	
	自	2020年 2月 4日	自	2021年 2月 2日
	至	2021年 2月 1日	至	2022年 2月 1日
営業収益				
受取利息		1		-
有価証券売買等損益		4,577,045		1,998,663
営業収益合計		4,577,046		1,998,663
営業費用				
支払利息		638		267
受託者報酬		59,561		63,543
委託者報酬		1,694,937		1,808,030
その他費用		4,655		4,984
営業費用合計		1,759,791		1,876,824
営業利益又は営業損失()		2,817,255		121,839
経常利益又は経常損失()		2,817,255		121,839
当期純利益又は当期純損失()		2,817,255		121,839
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		22,208		320,441
期首剰余金又は期首欠損金()		880,872		3,505,259
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		499,140
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		499,140
剰余金減少額又は欠損金増加額		114,315		507,640
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,519		507,640
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		76,796		-
分配金		56,345		53,599
期末剰余金又は期末欠損金()		3,505,259		3,244,558

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

		第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
1.	期首元本額	101,218,195円	112,691,772円
	期中追加設定元本額	16,599,772円	10,442,932円
	期中一部解約元本額	5,126,195円	15,936,539円
2.	受益権の総数	112,691,772口	107,198,165口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日		第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	16,056,868円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,973,906円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	23,030,774円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,043円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	56,345円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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27期(2021年 2月 1日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

親投資信託受益証券	4,678,354
合計	4,678,354

第28期(2022年2月1日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,271,512
合計	1,271,512

(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27期 2021年2月1日現在		第28期 2022年2月1日現在	
1口当たり純資産額	1.0311円	1口当たり純資産額	1.0303円
(1万口当たり純資産額)	(10,311円)	(1万口当たり純資産額)	(10,303円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	58,759,688	74,859,842	
	インデックス マザーファンド TOPIX	13,153,427	32,913,820	
合計		71,913,115	107,773,662	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【財形株投（一般財形50）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,757,873	6,448,145
親投資信託受益証券	189,270,146	190,505,512
流動資産合計	196,028,019	196,953,657
資産合計	196,028,019	196,953,657
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	84,977	84,384
未払受託者報酬	57,837	56,387
未払委託者報酬	1,644,256	1,603,114
未払利息	1	1
その他未払費用	4,569	4,459
流動負債合計	1,791,640	1,748,345
負債合計	1,791,640	1,748,345
純資産の部		
元本等		
元本	169,955,409	168,768,071
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,280,970	26,437,241
（分配準備積立金）	26,728,460	25,830,053
元本等合計	194,236,379	195,205,312
純資産合計	194,236,379	195,205,312
負債純資産合計	196,028,019	196,953,657

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第27期		第28期	
	自	2020年 2月 4日	自	2021年 2月 2日
	至	2021年 2月 1日	至	2022年 2月 1日
営業収益				
受取利息		4		-
有価証券売買等損益		13,044,495		6,065,400
営業収益合計		13,044,499		6,065,400
営業費用				
支払利息		1,338		585
受託者報酬		112,437		111,856
委託者報酬		3,196,662		3,180,164
その他費用		8,886		8,844
営業費用合計		3,319,323		3,301,449
営業利益又は営業損失()		9,725,176		2,763,951
経常利益又は経常損失()		9,725,176		2,763,951
当期純利益又は当期純損失()		9,725,176		2,763,951
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		737,695		926,513
期首剰余金又は期首欠損金()		17,674,346		24,280,970
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,511,774		3,005,488
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,511,774		3,005,488
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,807,654		2,602,271
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,807,654		2,602,271
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		84,977		84,384
期末剰余金又は期末欠損金()		24,280,970		26,437,241

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

		第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
1.	期首元本額	191,825,330円	169,955,409円
	期中追加設定元本額	20,242,673円	16,776,660円
	期中一部解約元本額	42,112,594円	17,963,998円
2.	受益権の総数	169,955,409口	168,768,071口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日		第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,536,158円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	42,725,294円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	25,277,279円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	69,538,731円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,091円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	84,977円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第27期(2021年 2月 1日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

親投資信託受益証券	12,336,605
合計	12,336,605

第28期(2022年2月1日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,055,990
合計	4,055,990

(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27期 2021年2月1日現在		第28期 2022年2月1日現在	
1口当たり純資産額	1.1429円	1口当たり純資産額	1.1566円
(1万口当たり純資産額)	(11,429円)	(1万口当たり純資産額)	(11,566円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	73,321,017	93,410,975	
	インデックス マザーファンド TOPIX	38,802,117	97,094,537	
合計		112,123,134	190,505,512	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【財形株投(年金・住宅財形30)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,582,418	7,801,478
親投資信託受益証券	215,786,245	231,607,629
流動資産合計	223,368,663	239,409,107
資産合計	223,368,663	239,409,107
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	107,278	114,941
未払受託者報酬	59,060	66,108
未払委託者報酬	1,678,851	1,879,222
未払利息	1	2
その他未払費用	4,663	5,241
流動負債合計	1,849,853	2,065,514
負債合計	1,849,853	2,065,514
純資産の部		
元本等		
元本	214,557,629	229,883,526
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,961,181	7,460,067
(分配準備積立金)	16,334,973	15,905,445
元本等合計	221,518,810	237,343,593
純資産合計	221,518,810	237,343,593
負債純資産合計	223,368,663	239,409,107

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第27期		第28期	
	自	2020年 2月 4日	自	2021年 2月 2日
	至	2021年 2月 1日	至	2022年 2月 1日
営業収益				
受取利息		4		1
有価証券売買等損益		8,351,784		3,655,547
営業収益合計		8,351,788		3,655,548
営業費用				
支払利息		1,346		706
受託者報酬		113,908		128,964
委託者報酬		3,238,355		3,666,027
その他費用		8,996		10,207
営業費用合計		3,362,605		3,805,904
営業利益又は営業損失()		4,989,183		150,356
経常利益又は経常損失()		4,989,183		150,356
当期純利益又は当期純損失()		4,989,183		150,356
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		21,192		58,065
期首剰余金又は期首欠損金()		2,178,497		6,961,181
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		969,047
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		969,047
剰余金減少額又は欠損金増加額		78,029		146,799
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		62,713		146,799
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,316		-
分配金		107,278		114,941
期末剰余金又は期末欠損金()		6,961,181		7,460,067

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

		第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
1.	期首元本額	199,316,077円	214,557,629円
	期中追加設定元本額	21,694,209円	19,721,443円
	期中一部解約元本額	6,452,657円	4,395,546円
2.	受益権の総数	214,557,629口	229,883,526口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日		第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	36,126,448円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	16,442,251円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	52,568,699円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,450円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	107,278円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第27期 2021年 2月 1日現在	第28期 2022年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第27期(2021年 2月 1日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

親投資信託受益証券	8,653,327
合計	8,653,327

第28期(2022年2月1日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,580,515
合計	2,580,515

(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27期 2021年2月1日現在		第28期 2022年2月1日現在	
1口当たり純資産額	1.0324円	1口当たり純資産額	1.0325円
(1万口当たり純資産額)	(10,324円)	(1万口当たり純資産額)	(10,325円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	126,272,820	160,871,572	
	インデックス マザーファンド TOPIX	28,268,416	70,736,057	
合計		154,541,236	231,607,629	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

財形公社債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）		
	2021年 2月 1日現在	2022年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	123,475,640	93,551,329
国債証券	164,731,161	210,474,004
地方債証券	38,358,570	25,110,082
未収利息	114,529	73,894
流動資産合計	326,679,900	329,209,309
資産合計	326,679,900	329,209,309
負債の部		
流動負債		
未払利息	27	24
流動負債合計	27	24
負債合計	27	24
純資産の部		
元本等		
元本	255,644,528	258,353,525
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	71,035,345	70,855,760
元本等合計	326,679,873	329,209,285
純資産合計	326,679,873	329,209,285
負債純資産合計	326,679,900	329,209,309

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</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>
-----------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 2月 1日現在	2022年 2月 1日現在
1.	期首	2020年 2月 4日	2021年 2月 2日
	期首元本額	243,658,790円	255,644,528円
	期首からの追加設定元本額	59,352,411円	36,468,014円
	期首からの一部解約元本額	47,366,673円	33,759,017円
	元本の内訳		
	財形株投（一般財形30）	62,432,858円	58,759,688円
	財形株投（一般財形50）	74,318,346円	73,321,017円
財形株投（年金・住宅財形30）	118,893,324円	126,272,820円	
計	255,644,528円	258,353,525円	
2.	受益権の総数	255,644,528口	258,353,525口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月 1日現在	2022年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2021年 2月 1日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,072,096
地方債証券	189,168
合計	1,261,264

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年 2月 1日現在		2022年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.278円	1口当たり純資産額	1.274円
(1千口当たり純資産額)	(1,278円)	(1千口当たり純資産額)	(1,274円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第134回利付国債（5年）	30,000,000	30,056,804	
	第353回利付国債（10年）	40,000,000	40,178,400	

	第355回利付国債(10年)	40,000,000	40,146,800	
	第357回利付国債(10年)	40,000,000	40,094,000	
	第359回利付国債(10年)	40,000,000	40,033,200	
	第361回利付国債(10年)	20,000,000	19,964,800	
国債証券 合計		210,000,000	210,474,004	
地方債証券	第718回東京都公募公債	10,000,000	10,067,200	
	平成24年度第3回愛知県公募公債(10年)	15,000,000	15,042,882	
地方債証券 合計		25,000,000	25,110,082	
	合計	235,000,000	235,584,086	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

インデックス マザーファンド TOPIX

貸借対照表

(単位:円)

	2021年 2月 1日現在	2022年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	981,509,609	111,518,846
株式	40,992,862,260	42,196,845,440
派生商品評価勘定	4,004,700	-
未収入金	-	43,314
未収配当金	55,032,124	63,025,784
前払金	-	5,490,000
流動資産合計	42,033,408,693	42,376,923,384
資産合計	42,033,408,693	42,376,923,384
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,763,300
前受金	2,208,000	-
未払金	817,164,014	11,349,260
未払解約金	113,183,506	47,000,000
未払利息	219	29
流動負債合計	932,555,739	64,112,589
負債合計	932,555,739	64,112,589
純資産の部		
元本等		
元本	17,381,724,461	16,909,899,311
剰余金		
剰余金又は欠損金()	23,719,128,493	25,402,911,484
元本等合計	41,100,852,954	42,312,810,795
純資産合計	41,100,852,954	42,312,810,795

2021年 2月 1日現在

2022年 2月 1日現在

負債純資産合計	42,033,408,693	42,376,923,384
---------	----------------	----------------

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)

		2021年 2月 1日現在	2022年 2月 1日現在
1.	期首	2020年 2月 4日	2021年 2月 2日
	期首元本額	18,667,515,485円	17,381,724,461円
	期首からの追加設定元本額	2,059,737,644円	1,944,445,849円
	期首からの一部解約元本額	3,345,528,668円	2,416,270,999円
	元本の内訳		
	インデックスファンドTSP	9,027,519,254円	8,563,473,897円
	財形株投(一般財形30)	14,175,557円	13,153,427円
	財形株投(一般財形50)	39,876,216円	38,802,117円
	財形株投(年金・住宅財形30)	26,998,468円	28,268,416円
	インデックスファンドTOPIX(日本株式)	7,727,142,604円	7,742,030,865円
	TOPIXインデックスファンド(個人型年金向け)	456,908,229円	484,756,519円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	25,298,128円	23,980,026円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	13,158,073円	-円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	9,268,925円	7,938,017円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	18,757,161円	-円

時間分散型バランスファンド(安定指向) 2017-02	8,791,308円	7,496,027円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2017-02	13,830,538円	-円
計	17,381,724,461円	16,909,899,311円
2. 受益権の総数	17,381,724,461口	16,909,899,311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	258,387,000円	506,962,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月 1日現在	2022年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	<p>売買目的有価証券</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

（2021年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	764,078,601
合計	764,078,601

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2021年 2月 1日現在）

(単位:円)

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

(2022年 2月 1日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	119,400,000	-	113,640,000	5,760,000
合計		119,400,000	-	113,640,000	5,760,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2021年 2月 1日現在		2022年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	2.3646円	1口当たり純資産額	2.5023円
(1万口当たり純資産額)	(23,646円)	(1万口当たり純資産額)	(25,023円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,165.00	2,532,000	
日本水産	22,300	537.00	11,975,100	
マルハニチロ	3,500	2,438.00	8,533,000	
雪国まいたけ	1,700	1,155.00	1,963,500	
カネコ種苗	600	1,492.00	895,200	
サカタのタネ	2,600	3,310.00	8,606,000	
ホクト	1,900	1,956.00	3,716,400	
ホクリヨウ	400	697.00	278,800	
住石ホールディングス	4,800	131.00	628,800	
日鉄鉱業	500	6,330.00	3,165,000	
三井松島ホールディングス	1,000	1,786.00	1,786,000	
I N P E X	88,800	1,115.00	99,012,000	
石油資源開発	2,600	2,664.00	6,926,400	
K & O エナジーグループ	1,000	1,542.00	1,542,000	
ヒノキヤグループ	500	2,014.00	1,007,000	
ショーボンドホールディングス	3,200	5,040.00	16,128,000	
ミライト・ホールディングス	7,100	1,881.00	13,355,100	
タマホーム	1,400	2,377.00	3,327,800	
サンヨーホームズ	300	728.00	218,400	
日本アクア	1,000	658.00	658,000	
ファーストコーポレーション	500	689.00	344,500	
ベステラ	500	1,207.00	603,500	
キャンディル	500	497.00	248,500	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,171.00	468,400	
第一カッター興業	600	1,404.00	842,400	
安藤・間	11,100	863.00	9,579,300	
東急建設	6,700	697.00	4,669,900	
コムシスホールディングス	7,100	2,724.00	19,340,400	
ビーアールホールディングス	3,100	358.00	1,109,800	
高松コンストラクショングループ	1,400	1,955.00	2,737,000	
東建コーポレーション	600	9,290.00	5,574,000	
ソネック	300	1,031.00	309,300	
ヤマウラ	1,200	974.00	1,168,800	
大成建設	14,800	3,770.00	55,796,000	
大林組	51,000	915.00	46,665,000	
清水建設	47,900	764.00	36,595,600	
飛鳥建設	1,400	1,035.00	1,449,000	
長谷工コーポレーション	15,200	1,428.00	21,705,600	
松井建設	2,000	686.00	1,372,000	
銭高組	200	4,050.00	810,000	

鹿島建設	37,400	1,362.00	50,938,800
不動テトラ	1,100	1,508.00	1,658,800
大末建設	600	1,273.00	763,800
鉄建建設	1,100	1,812.00	1,993,200
西松建設	3,100	3,725.00	11,547,500
三井住友建設	11,900	429.00	5,105,100
大豊建設	800	3,665.00	2,932,000
ナカノフード建設	1,200	340.00	408,000
奥村組	3,000	3,190.00	9,570,000
東鉄工業	2,400	2,419.00	5,805,600
イチケン	300	1,863.00	558,900
富士ピー・エス	700	482.00	337,400
浅沼組	600	5,370.00	3,222,000
戸田建設	21,100	731.00	15,424,100
熊谷組	2,600	2,880.00	7,488,000
北野建設	300	2,113.00	633,900
植木組	400	1,409.00	563,600
矢作建設工業	2,200	746.00	1,641,200
ピーエス三菱	1,700	599.00	1,018,300
日本ハウスホールディングス	3,700	440.00	1,628,000
大東建託	5,200	12,730.00	66,196,000
新日本建設	2,100	741.00	1,556,100
東亜道路工業	300	4,940.00	1,482,000
日本道路	500	8,290.00	4,145,000
東亜建設工業	1,300	2,409.00	3,131,700
日本国土開発	5,000	524.00	2,620,000
若築建設	900	1,652.00	1,486,800
東洋建設	5,700	569.00	3,243,300
五洋建設	20,300	626.00	12,707,800
世紀東急工業	2,500	813.00	2,032,500
福田組	600	4,245.00	2,547,000
住友林業	13,100	1,968.00	25,780,800
日本基礎技術	1,400	592.00	828,800
巴コーポレーション	2,400	487.00	1,168,800
大和ハウス工業	47,100	3,289.00	154,911,900
ライト工業	3,200	1,840.00	5,888,000
積水ハウス	55,300	2,282.50	126,222,250
日特建設	1,000	645.00	645,000
北陸電気工事	1,100	791.00	870,100
ユアテック	2,800	676.00	1,892,800
日本リーテック	1,100	1,329.00	1,461,900
四電工	600	1,583.00	949,800

中電工	2,200	2,105.00	4,631,000
関電工	8,200	843.00	6,912,600
きんでん	11,300	1,576.00	17,808,800
東京エネシス	1,700	918.00	1,560,600
トーエネック	500	3,130.00	1,565,000
住友電設	1,300	2,125.00	2,762,500
日本電設工業	2,800	1,489.00	4,169,200
エクシオグループ	7,600	2,292.00	17,419,200
新日本空調	1,400	2,024.00	2,833,600
九電工	3,900	2,833.00	11,048,700
三機工業	3,300	1,405.00	4,636,500
日揮ホールディングス	15,800	1,102.00	17,411,600
中外炉工業	600	1,598.00	958,800
ヤマト	1,500	690.00	1,035,000
太平電業	1,100	2,713.00	2,984,300
高砂熱学工業	4,600	1,870.00	8,602,000
三晃金属工業	200	2,479.00	495,800
朝日工業社	300	2,846.00	853,800
明星工業	3,300	706.00	2,329,800
大気社	2,500	2,816.00	7,040,000
ダイダン	1,100	2,196.00	2,415,600
日比谷総合設備	1,700	1,870.00	3,179,000
フィル・カンパニー	300	1,075.00	322,500
テスホールディングス	1,100	1,311.00	1,442,100
インフロニア・ホールディングス	21,800	1,048.00	22,846,400
東洋エンジニアリング	2,300	648.00	1,490,400
レイズネクスト	2,300	1,151.00	2,647,300
ニッポン	4,700	1,662.00	7,811,400
日清製粉グループ本社	18,400	1,607.00	29,568,800
日東富士製粉	200	3,810.00	762,000
昭和産業	1,500	2,684.00	4,026,000
鳥越製粉	1,400	645.00	903,000
中部飼料	1,800	1,012.00	1,821,600
フィード・ワン	2,100	702.00	1,474,200
東洋精糖	200	1,034.00	206,800
日本甜菜製糖	800	1,694.00	1,355,200
D M三井製糖ホールディングス	1,400	1,962.00	2,746,800
塩水港精糖	2,200	214.00	470,800
日新製糖	700	1,729.00	1,210,300
森永製菓	3,800	3,635.00	13,813,000
中村屋	400	3,365.00	1,346,000
江崎グリコ	4,500	3,685.00	16,582,500

名糖産業	700	1,639.00	1,147,300
井村屋グループ	1,000	2,207.00	2,207,000
不二家	900	2,247.00	2,022,300
山崎製パン	12,300	1,635.00	20,110,500
第一屋製パン	400	532.00	212,800
モロゾフ	600	2,736.00	1,641,600
亀田製菓	900	4,110.00	3,699,000
寿スピリッツ	1,600	4,665.00	7,464,000
カルビー	7,500	2,529.00	18,967,500
森永乳業	3,000	5,540.00	16,620,000
六甲バター	1,200	1,485.00	1,782,000
ヤクルト本社	12,100	5,910.00	71,511,000
明治ホールディングス	10,800	7,130.00	77,004,000
雪印メグミルク	3,900	2,016.00	7,862,400
プリマハム	2,000	2,506.00	5,012,000
日本ハム	6,200	4,335.00	26,877,000
林兼産業	500	508.00	254,000
丸大食品	1,600	1,529.00	2,446,400
S Foods	1,500	3,535.00	5,302,500
柿安本店	600	2,577.00	1,546,200
伊藤ハム米久ホールディングス	10,200	670.00	6,834,000
サッポロホールディングス	5,600	2,223.00	12,448,800
アサヒグループホールディングス	38,400	4,722.00	181,324,800
キリンホールディングス	60,100	1,845.00	110,884,500
宝ホールディングス	11,100	1,115.00	12,376,500
オエノンホールディングス	4,600	335.00	1,541,000
養命酒製造	400	1,752.00	700,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,500	1,348.00	15,502,000
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,445.00	48,450,500
ダイドーグループホールディングス	900	4,735.00	4,261,500
伊藤園	5,000	6,180.00	30,900,000
キーコーヒー	1,700	2,048.00	3,481,600
ユニカフェ	600	943.00	565,800
ジャパンフーズ	400	1,201.00	480,400
日清オイリオグループ	2,000	3,000.00	6,000,000
不二製油グループ本社	3,500	2,297.00	8,039,500
かどや製油	200	4,050.00	810,000
J - オイルミルズ	1,500	1,680.00	2,520,000
キッコーマン	11,800	8,290.00	97,822,000
味の素	36,100	3,189.00	115,122,900
ブルドックソース	700	1,993.00	1,395,100
キューピー	8,600	2,337.00	20,098,200

ハウス食品グループ本社	6,100	2,925.00	17,842,500
カゴメ	6,200	3,010.00	18,662,000
焼津水産化学工業	700	918.00	642,600
アリアケジャパン	1,500	6,060.00	9,090,000
ピエトロ	200	1,788.00	357,600
エバラ食品工業	300	2,802.00	840,600
やまみ	100	1,747.00	174,700
ニチレイ	7,500	2,627.00	19,702,500
東洋水産	7,900	4,520.00	35,708,000
イトアンドホールディングス	700	2,285.00	1,599,500
大冷	200	1,897.00	379,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	486.00	486,000
日清食品ホールディングス	6,400	8,030.00	51,392,000
永谷園ホールディングス	800	1,936.00	1,548,800
一正蒲鉾	700	777.00	543,900
フジッコ	1,500	1,944.00	2,916,000
ロック・フィールド	1,800	1,521.00	2,737,800
日本たばこ産業	87,600	2,300.50	201,523,800
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,369.00	1,369,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,898.00	2,087,800
なとり	900	2,001.00	1,800,900
イフジ産業	300	907.00	272,100
ピクルスコーポレーション	800	1,582.00	1,265,600
ファーマフーズ	1,600	1,616.00	2,585,600
ユーグレナ	8,400	727.00	6,106,800
紀文食品	1,000	906.00	906,000
ミヨシ油脂	600	1,127.00	676,200
理研ビタミン	1,700	1,670.00	2,839,000
片倉工業	1,800	2,296.00	4,132,800
ゲンゼ	1,100	3,935.00	4,328,500
東洋紡	6,300	1,269.00	7,994,700
ユニチカ	4,700	301.00	1,414,700
富士紡ホールディングス	700	3,760.00	2,632,000
倉敷紡績	1,300	1,870.00	2,431,000
シキボウ	800	909.00	727,200
日本毛織	4,700	870.00	4,089,000
ダイトウボウ	3,400	89.00	302,600
トーア紡コーポレーション	500	411.00	205,500
ダイドーリミテッド	2,800	140.00	392,000
帝国繊維	1,800	1,987.00	3,576,600
帝人	15,000	1,406.00	21,090,000
東レ	115,500	652.00	75,306,000

住江織物	400	1,819.00	727,600
日本フェルト	800	443.00	354,400
日東製網	200	1,451.00	290,200
アツギ	1,300	537.00	698,100
ダイニック	600	714.00	428,400
セーレン	3,300	2,080.00	6,864,000
ソトー	700	824.00	576,800
東海染工	200	1,142.00	228,400
小松マテーレ	2,600	1,234.00	3,208,400
ワコールホールディングス	3,900	1,996.00	7,784,400
ホギメディカル	2,100	3,085.00	6,478,500
クラウディアホールディングス	600	232.00	139,200
T S Iホールディングス	5,300	312.00	1,653,600
マツオカコーポレーション	500	1,179.00	589,500
ワールド	2,200	1,154.00	2,538,800
三陽商会	800	828.00	662,400
ナイガイ	800	285.00	228,000
オンワードホールディングス	9,800	287.00	2,812,600
ルックホールディングス	500	1,260.00	630,000
ゴールドウイン	2,900	5,810.00	16,849,000
デサント	3,100	3,540.00	10,974,000
キング	700	534.00	373,800
ヤマトインターナショナル	1,300	288.00	374,400
特種東海製紙	1,000	4,080.00	4,080,000
王子ホールディングス	66,700	597.00	39,819,900
日本製紙	7,700	1,137.00	8,754,900
三菱製紙	2,600	310.00	806,000
北越コーポレーション	10,500	734.00	7,707,000
中越パルプ工業	600	956.00	573,600
巴川製紙所	600	806.00	483,600
大王製紙	7,700	1,830.00	14,091,000
阿波製紙	600	330.00	198,000
レンゴー	15,000	849.00	12,735,000
トモク	1,000	1,726.00	1,726,000
ザ・パック	1,200	2,674.00	3,208,800
北の達人コーポレーション	5,800	232.00	1,345,600
クラレ	23,400	1,003.00	23,470,200
旭化成	105,700	1,086.00	114,790,200
共和レザー	1,000	667.00	667,000
昭和電工	13,900	2,379.00	33,068,100
住友化学	117,300	566.00	66,391,800
住友精化	700	3,035.00	2,124,500

日産化学	8,700	6,130.00	53,331,000
ラサ工業	600	1,568.00	940,800
クレハ	1,300	8,520.00	11,076,000
多木化学	600	5,210.00	3,126,000
テイカ	1,200	1,298.00	1,557,600
石原産業	2,700	1,120.00	3,024,000
片倉コープアグリ	300	1,145.00	343,500
日本曹達	2,000	3,260.00	6,520,000
東ソー	23,000	1,753.00	40,319,000
トクヤマ	5,100	1,810.00	9,231,000
セントラル硝子	2,600	2,094.00	5,444,400
東亜合成	8,900	1,113.00	9,905,700
大阪ソーダ	1,500	3,030.00	4,545,000
関東電化工業	3,600	1,072.00	3,859,200
デンカ	5,800	3,965.00	22,997,000
信越化学工業	27,400	19,110.00	523,614,000
日本カーバイド工業	600	1,371.00	822,600
堺化学工業	1,200	2,007.00	2,408,400
第一稀元素化学工業	1,500	1,077.00	1,615,500
エア・ウォーター	15,100	1,712.00	25,851,200
日本酸素ホールディングス	15,300	2,215.00	33,889,500
日本化学工業	500	2,618.00	1,309,000
東邦アセチレン	300	1,257.00	377,100
日本パーカラライジング	7,900	1,037.00	8,192,300
高压ガス工業	2,500	736.00	1,840,000
四国化成工業	2,100	1,397.00	2,933,700
戸田工業	400	3,380.00	1,352,000
ステラ ケミファ	800	2,467.00	1,973,600
保土谷化学工業	500	5,260.00	2,630,000
日本触媒	2,700	5,300.00	14,310,000
大日精化工業	1,300	2,260.00	2,938,000
カネカ	4,100	3,660.00	15,006,000
三菱瓦斯化学	14,800	2,113.00	31,272,400
三井化学	14,500	2,969.00	43,050,500
J S R	14,900	3,650.00	54,385,000
東京応化工業	2,600	6,600.00	17,160,000
大阪有機化学工業	1,400	3,100.00	4,340,000
三菱ケミカルホールディングス	106,700	880.20	93,917,340
K Hネオケム	2,600	2,878.00	7,482,800
ダイセル	23,100	832.00	19,219,200
住友ベークライト	2,500	5,450.00	13,625,000
積水化学工業	33,300	1,858.00	61,871,400

日本ゼオン	14,400	1,286.00	18,518,400
アイカ工業	4,400	3,150.00	13,860,000
宇部興産	7,500	2,026.00	15,195,000
積水樹脂	2,400	2,023.00	4,855,200
タキロンシーアイ	3,400	546.00	1,856,400
旭有機材	900	1,973.00	1,775,700
ニチバン	900	1,734.00	1,560,600
リケンテクノス	3,800	460.00	1,748,000
大倉工業	800	1,966.00	1,572,800
積水化成成品工業	2,000	455.00	910,000
群栄化学工業	400	3,475.00	1,390,000
タイガースポリマー	900	431.00	387,900
ミライアル	500	1,550.00	775,000
ダイキアクシス	700	690.00	483,000
ダイキョーニシカワ	3,400	589.00	2,002,600
竹本容器	700	766.00	536,200
森六ホールディングス	900	1,909.00	1,718,100
恵和	500	5,120.00	2,560,000
日本化薬	12,500	1,126.00	14,075,000
カーリットホールディングス	1,700	673.00	1,144,100
日本精化	1,300	2,068.00	2,688,400
扶桑化学工業	1,400	4,765.00	6,671,000
トリケミカル研究所	1,700	3,140.00	5,338,000
A D E K A	7,300	2,446.00	17,855,800
日油	5,400	5,230.00	28,242,000
新日本理化	2,900	245.00	710,500
ハリマ化成グループ	1,200	808.00	969,600
花王	36,000	5,729.00	206,244,000
第一工業製薬	600	2,942.00	1,765,200
石原ケミカル	800	1,249.00	999,200
日華化学	600	776.00	465,600
ニイタカ	300	2,175.00	652,500
三洋化成工業	1,000	5,170.00	5,170,000
有機合成薬品工業	1,200	269.00	322,800
大日本塗料	1,900	800.00	1,520,000
日本ペイントホールディングス	60,000	891.00	53,460,000
関西ペイント	16,500	2,331.00	38,461,500
神東塗料	1,400	154.00	215,600
中国塗料	3,800	873.00	3,317,400
日本特殊塗料	1,200	826.00	991,200
藤倉化成	2,000	482.00	964,000
太陽ホールディングス	2,300	3,300.00	7,590,000

D I C	6,700	2,892.00	19,376,400
サカタインクス	3,200	950.00	3,040,000
東洋インキＳＣホールディングス	3,300	1,886.00	6,223,800
T & K T O K A	1,200	788.00	945,600
富士フイルムホールディングス	28,600	7,658.00	219,018,800
資生堂	30,300	5,859.00	177,527,700
ライオン	19,700	1,517.00	29,884,900
高砂香料工業	1,100	2,781.00	3,059,100
マンダム	3,400	1,354.00	4,603,600
ミルボン	2,000	5,360.00	10,720,000
ファンケル	6,600	2,967.00	19,582,200
コーセー	3,100	10,900.00	33,790,000
コタ	1,000	1,578.00	1,578,000
シーボン	300	1,745.00	523,500
ポーラ・オルビスホールディングス	6,900	1,720.00	11,868,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,180.00	7,252,000
アジュバンホールディングス	400	1,067.00	426,800
新日本製薬	500	1,091.00	545,500
エステー	1,100	1,523.00	1,675,300
アグロ カネショウ	500	1,239.00	619,500
コニシ	2,600	1,615.00	4,199,000
長谷川香料	2,800	2,506.00	7,016,800
星光P M C	900	646.00	581,400
小林製薬	4,500	8,820.00	39,690,000
荒川化学工業	1,300	1,171.00	1,522,300
メック	1,200	3,245.00	3,894,000
日本高純度化学	400	2,533.00	1,013,200
タカラバイオ	4,300	2,284.00	9,821,200
J C U	1,800	4,920.00	8,856,000
新田ゼラチン	1,100	647.00	711,700
O A T アグリオ	400	1,900.00	760,000
デクセリアルズ	4,200	3,125.00	13,125,000
アース製薬	1,300	5,840.00	7,592,000
北興化学工業	1,500	778.00	1,167,000
大成ラミック	600	2,702.00	1,621,200
クミアイ化学工業	6,000	784.00	4,704,000
日本農薬	2,900	513.00	1,487,700
アキレス	1,000	1,225.00	1,225,000
有沢製作所	2,500	976.00	2,440,000
日東電工	9,900	8,690.00	86,031,000
レック	2,200	913.00	2,008,600
三光合成	1,900	354.00	672,600

きもと	3,000	210.00	630,000
藤森工業	1,500	4,060.00	6,090,000
前澤化成工業	1,000	1,238.00	1,238,000
未来工業	600	1,525.00	915,000
ウェーブロックホールディングス	600	706.00	423,600
J S P	1,000	1,540.00	1,540,000
エフピコ	3,000	3,350.00	10,050,000
天馬	1,300	2,505.00	3,256,500
信越ポリマー	3,000	1,087.00	3,261,000
東リ	3,700	214.00	791,800
ニフコ	5,400	3,295.00	17,793,000
バルカー	1,400	2,495.00	3,493,000
ユニ・チャーム	31,400	4,474.00	140,483,600
ショーエイコーポレーション	500	651.00	325,500
協和キリン	19,100	2,854.00	54,511,400
武田薬品工業	128,000	3,305.00	423,040,000
アステラス製薬	141,100	1,861.50	262,657,650
大日本住友製薬	10,100	1,175.00	11,867,500
塩野義製薬	20,500	7,091.00	145,365,500
わかもと製薬	2,100	299.00	627,900
日本新薬	4,300	7,490.00	32,207,000
中外製薬	50,900	3,718.00	189,246,200
科研製薬	2,500	4,145.00	10,362,500
エーザイ	19,500	5,739.00	111,910,500
ロート製薬	8,300	3,165.00	26,269,500
小野薬品工業	37,400	2,768.00	103,523,200
久光製薬	4,300	3,505.00	15,071,500
持田製薬	2,000	3,650.00	7,300,000
参天製薬	30,300	1,287.00	38,996,100
扶桑薬品工業	600	2,091.00	1,254,600
日本ケミファ	200	2,010.00	402,000
ツムラ	5,000	3,215.00	16,075,000
日医工	5,200	728.00	3,785,600
キッセイ薬品工業	2,800	2,343.00	6,560,400
生化学工業	2,900	927.00	2,688,300
栄研化学	2,900	1,686.00	4,889,400
日水製薬	600	969.00	581,400
鳥居薬品	900	2,839.00	2,555,100
J C R ファーマ	4,600	1,973.00	9,075,800
東和薬品	2,400	2,828.00	6,787,200
富士製薬工業	1,000	986.00	986,000
ゼリア新薬工業	3,000	1,902.00	5,706,000

第一三共	127,900	2,462.00	314,889,800
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	1,816.00	5,811,200
大幸薬品	2,500	616.00	1,540,000
ダイト	1,100	2,803.00	3,083,300
大塚ホールディングス	33,800	3,904.00	131,955,200
大正製薬ホールディングス	3,900	5,460.00	21,294,000
ペプチドリーム	8,600	2,048.00	17,612,800
あすか製薬ホールディングス	1,900	974.00	1,850,600
サワイグループホールディングス	3,600	4,300.00	15,480,000
日本コークス工業	14,200	129.00	1,831,800
ニチレキ	2,100	1,270.00	2,667,000
ユシロ化学工業	800	1,093.00	874,400
ビーピー・カストロール	500	1,305.00	652,500
富士石油	4,700	244.00	1,146,800
MORESCO	600	1,148.00	688,800
出光興産	18,100	2,919.00	52,833,900
Eneosホールディングス	244,500	451.90	110,489,550
コスモエネルギーホールディングス	4,700	2,269.00	10,664,300
横浜ゴム	9,400	1,666.00	15,660,400
TOYO TIRE	8,600	1,595.00	13,717,000
ブリヂストン	46,900	4,972.00	233,186,800
住友ゴム工業	14,700	1,158.00	17,022,600
藤倉コンポジット	1,400	806.00	1,128,400
オカモト	1,000	4,125.00	4,125,000
フコク	800	1,013.00	810,400
ニッタ	1,700	2,827.00	4,805,900
住友理工	3,200	600.00	1,920,000
三ツ星ベルト	2,000	2,084.00	4,168,000
バンドー化学	2,600	864.00	2,246,400
日東紡績	2,400	2,666.00	6,398,400
AGC	14,900	5,080.00	75,692,000
日本板硝子	8,000	486.00	3,888,000
石塚硝子	300	2,002.00	600,600
日本山村硝子	700	758.00	530,600
日本電気硝子	6,500	2,795.00	18,167,500
オハラ	700	1,077.00	753,900
住友大阪セメント	3,000	3,480.00	10,440,000
太平洋セメント	9,200	2,254.00	20,736,800
日本ヒューム	1,500	694.00	1,041,000
日本コンクリート工業	3,200	279.00	892,800
三谷セキサン	800	6,390.00	5,112,000
アジアパイルホールディングス	2,500	432.00	1,080,000

東海カーボン	13,700	1,183.00	16,207,100
日本カーボン	800	3,940.00	3,152,000
東洋炭素	1,100	2,957.00	3,252,700
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,580.00	4,122,000
TOTO	11,600	4,695.00	54,462,000
日本碍子	17,600	1,822.00	32,067,200
日本特殊陶業	12,400	2,080.00	25,792,000
ダントーホールディングス	1,300	257.00	334,100
MARUWA	600	14,300.00	8,580,000
品川リフラクトリーズ	400	3,795.00	1,518,000
黒崎播磨	300	4,395.00	1,318,500
ヨータイ	1,000	1,268.00	1,268,000
イソライト工業	800	1,197.00	957,600
東京窯業	1,900	301.00	571,900
ニッカトー	800	672.00	537,600
フジインコーポレーテッド	1,300	6,890.00	8,957,000
クニミネ工業	500	1,016.00	508,000
エーアンドエーマテリアル	200	898.00	179,600
ニチアス	3,800	2,571.00	9,769,800
ニチハ	2,200	2,650.00	5,830,000
日本製鉄	72,100	1,833.50	132,195,350
神戸製鋼所	30,100	539.00	16,223,900
合同製鐵	800	1,265.00	1,012,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	43,500	1,445.00	62,857,500
東京製鐵	5,500	1,105.00	6,077,500
共英製鋼	1,800	1,572.00	2,829,600
大和工業	3,100	3,510.00	10,881,000
東京鐵鋼	700	1,305.00	913,500
大阪製鐵	800	1,148.00	918,400
淀川製鋼所	2,100	2,418.00	5,077,800
丸一鋼管	5,700	2,525.00	14,392,500
モリ工業	500	2,523.00	1,261,500
大同特殊鋼	2,600	4,255.00	11,063,000
日本高周波鋼業	800	339.00	271,200
日本冶金工業	1,200	2,315.00	2,778,000
山陽特殊製鋼	1,700	2,083.00	3,541,100
愛知製鋼	900	2,524.00	2,271,600
日立金属	17,400	2,086.00	36,296,400
日本金属	500	1,000.00	500,000
大平洋金属	1,000	2,523.00	2,523,000
新日本電工	10,600	311.00	3,296,600
栗本鐵工所	700	1,544.00	1,080,800

虹技	300	939.00	281,700
日本鑄鉄管	200	1,003.00	200,600
三菱製鋼	1,100	1,011.00	1,112,100
日亜鋼業	2,000	270.00	540,000
日本精線	300	4,360.00	1,308,000
エンビプロ・ホールディングス	500	1,537.00	768,500
シンニッタン	1,900	222.00	421,800
新家工業	500	1,650.00	825,000
大紀アルミニウム工業所	2,500	1,415.00	3,537,500
日本軽金属ホールディングス	4,100	1,709.00	7,006,900
三井金属鉱業	4,400	3,160.00	13,904,000
東邦亜鉛	900	2,352.00	2,116,800
三菱マテリアル	10,700	1,997.00	21,367,900
住友金属鉱山	20,600	5,157.00	106,234,200
D O W Aホールディングス	4,400	4,880.00	21,472,000
古河機械金属	2,600	1,268.00	3,296,800
エス・サイエンス	11,600	23.00	266,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	802.00	1,684,200
東邦チタニウム	3,000	890.00	2,670,000
U A C J	2,500	2,581.00	6,452,500
C Kサンエツ	300	3,930.00	1,179,000
古河電気工業	5,000	2,351.00	11,755,000
住友電気工業	60,100	1,495.00	89,849,500
フジクラ	18,100	611.00	11,059,100
昭和電線ホールディングス	1,400	1,761.00	2,465,400
タツタ電線	2,900	451.00	1,307,900
カナレ電気	300	1,507.00	452,100
平河ヒューテック	1,000	1,105.00	1,105,000
リョービ	2,100	1,064.00	2,234,400
アーレスティ	1,900	371.00	704,900
アサヒホールディングス	6,400	2,165.00	13,856,000
稲葉製作所	1,000	1,281.00	1,281,000
宮地エンジニアリンググループ	500	3,190.00	1,595,000
トーカロ	4,100	1,314.00	5,387,400
アルファC o	700	1,081.00	756,700
S U M C O	24,800	2,093.00	51,906,400
川田テクノロジーズ	300	3,840.00	1,152,000
R S Technologies	500	5,780.00	2,890,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,576.00	315,200
信和	1,100	818.00	899,800
東洋製罐グループホールディングス	10,200	1,376.00	14,035,200
ホッカンホールディングス	900	1,406.00	1,265,400

コロナ	800	881.00	704,800
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,043.00	5,516,100
駒井ハルテック	300	2,346.00	703,800
高田機工	100	2,871.00	287,100
三和ホールディングス	15,200	1,200.00	18,240,000
文化シャッター	5,100	1,020.00	5,202,000
三協立山	2,100	612.00	1,285,200
アルインコ	1,200	948.00	1,137,600
東洋シャッター	400	561.00	224,400
LIXIL	25,400	2,538.00	64,465,200
日本フィルコン	1,200	501.00	601,200
ノーリツ	3,100	1,684.00	5,220,400
長府製作所	1,600	1,918.00	3,068,800
リンナイ	3,000	10,170.00	30,510,000
ダイニチ工業	800	681.00	544,800
日東精工	2,100	520.00	1,092,000
三洋工業	100	1,836.00	183,600
岡部	3,100	732.00	2,269,200
ジーテクト	1,900	1,347.00	2,559,300
東プレ	3,000	1,195.00	3,585,000
高周波熱錬	2,900	589.00	1,708,100
東京製網	1,100	854.00	939,400
サンコール	1,500	560.00	840,000
モリテック スチール	1,400	316.00	442,400
パイオラックス	2,300	1,758.00	4,043,400
エイチワン	1,600	639.00	1,022,400
日本発條	14,800	892.00	13,201,600
中央発條	800	770.00	616,000
アドバネクス	300	1,529.00	458,700
立川ブラインド工業	700	1,072.00	750,400
三益半導体工業	1,200	2,420.00	2,904,000
日本ドライケミカル	400	1,760.00	704,000
日本製鋼所	4,900	3,675.00	18,007,500
三浦工業	6,900	3,345.00	23,080,500
タクマ	5,400	1,424.00	7,689,600
ツガミ	3,600	1,325.00	4,770,000
オークマ	1,900	4,765.00	9,053,500
芝浦機械	1,800	2,956.00	5,320,800
アマダ	25,300	1,099.00	27,804,700
アイダエンジニアリング	4,200	1,029.00	4,321,800
滝澤鉄工所	600	1,170.00	702,000
F U J I	7,400	2,585.00	19,129,000

牧野フライス製作所	1,800	3,605.00	6,489,000
オーエスジー	7,500	1,967.00	14,752,500
ダイジェット工業	300	988.00	296,400
旭ダイヤモンド工業	4,400	595.00	2,618,000
D M G 森精機	9,600	1,718.00	16,492,800
ソディック	3,700	781.00	2,889,700
ディスコ	2,400	32,050.00	76,920,000
日東工器	900	1,637.00	1,473,300
日進工具	1,300	1,387.00	1,803,100
パンチ工業	1,400	480.00	672,000
富士ダイス	800	617.00	493,600
豊和工業	900	781.00	702,900
O K K	600	994.00	596,400
東洋機械金属	1,100	553.00	608,300
津田駒工業	400	579.00	231,600
島精機製作所	2,400	1,740.00	4,176,000
オプトラン	2,000	2,334.00	4,668,000
N C ホールディングス	500	1,637.00	818,500
イワキポンプ	1,000	985.00	985,000
フリー	1,500	1,260.00	1,890,000
ヤマシンフィルタ	3,400	403.00	1,370,200
日阪製作所	1,900	820.00	1,558,000
やまびこ	3,100	1,046.00	3,242,600
野村マイクロ・サイエンス	400	4,245.00	1,698,000
平田機工	800	5,780.00	4,624,000
ペガサスミシン製造	1,700	519.00	882,300
マルマエ	700	2,476.00	1,733,200
タツモ	800	1,365.00	1,092,000
ナプテスコ	9,200	3,575.00	32,890,000
三井海洋開発	1,800	1,140.00	2,052,000
レオン自動機	1,800	1,015.00	1,827,000
S M C	4,800	64,100.00	307,680,000
ホソカワミクロン	1,100	2,851.00	3,136,100
ユニオンツール	600	3,645.00	2,187,000
オイレス工業	2,200	1,584.00	3,484,800
日精エー・エス・ビー機械	600	2,958.00	1,774,800
サトーホールディングス	2,200	2,027.00	4,459,400
技研製作所	1,400	3,920.00	5,488,000
日本エアテック	700	1,090.00	763,000
カワタ	600	1,009.00	605,400
日精樹脂工業	1,100	1,007.00	1,107,700
オカダアイオン	600	1,427.00	856,200

ワイエイシイホールディングス	700	1,113.00	779,100
小松製作所	73,800	2,739.00	202,138,200
住友重機械工業	9,300	2,845.00	26,458,500
日立建機	6,500	2,927.00	19,025,500
日工	2,100	610.00	1,281,000
巴工業	700	2,176.00	1,523,200
井関農機	1,600	1,290.00	2,064,000
TOWA	1,400	2,548.00	3,567,200
丸山製作所	300	1,502.00	450,600
北川鉄工所	700	1,355.00	948,500
ローツェ	800	10,940.00	8,752,000
タカキタ	600	608.00	364,800
クボタ	78,900	2,396.00	189,044,400
荏原実業	800	2,158.00	1,726,400
三菱化工機	500	2,050.00	1,025,000
月島機械	2,900	1,078.00	3,126,200
帝国電機製作所	1,100	1,286.00	1,414,600
新東工業	3,500	685.00	2,397,500
澁谷工業	1,400	2,524.00	3,533,600
アイチ コーポレーション	2,300	800.00	1,840,000
小森コーポレーション	4,200	695.00	2,919,000
鶴見製作所	1,300	1,712.00	2,225,600
住友精密工業	300	1,804.00	541,200
日本ギア工業	600	256.00	153,600
酒井重工業	300	2,679.00	803,700
荏原製作所	6,800	5,630.00	38,284,000
石井鐵工所	200	2,994.00	598,800
西島製作所	1,400	909.00	1,272,600
北越工業	1,600	894.00	1,430,400
ダイキン工業	20,700	23,885.00	494,419,500
オルガノ	500	8,270.00	4,135,000
トーヨーカネツ	600	2,525.00	1,515,000
栗田工業	8,800	4,845.00	42,636,000
椿本チエイン	2,100	3,120.00	6,552,000
大同工業	800	890.00	712,000
木村化工機	1,400	736.00	1,030,400
アネスト岩田	2,600	786.00	2,043,600
ダイフク	8,900	7,940.00	70,666,000
サムコ	400	2,240.00	896,000
加藤製作所	900	811.00	729,900
油研工業	300	1,710.00	513,000
タダノ	8,500	953.00	8,100,500

フジテック	6,000	2,703.00	16,218,000
C K D	4,800	2,100.00	10,080,000
キトー	1,400	1,680.00	2,352,000
平和	4,600	1,840.00	8,464,000
理想科学工業	1,400	2,066.00	2,892,400
S A N K Y O	3,500	3,015.00	10,552,500
日本金銭機械	1,900	637.00	1,210,300
マースグループホールディングス	1,000	1,622.00	1,622,000
フクシマガリレイ	1,100	4,155.00	4,570,500
オーイズミ	800	383.00	306,400
ダイコク電機	800	1,207.00	965,600
竹内製作所	2,500	2,787.00	6,967,500
アマノ	4,300	2,305.00	9,911,500
J U K I	2,400	742.00	1,780,800
サンデン	2,800	188.00	526,400
ジャノメ	1,400	721.00	1,009,400
マックス	2,100	1,789.00	3,756,900
グローリー	4,200	2,170.00	9,114,000
新晃工業	1,500	1,811.00	2,716,500
大和冷機工業	2,300	1,119.00	2,573,700
セガサミーホールディングス	16,200	1,940.00	31,428,000
日本ピストンリング	700	1,281.00	896,700
リケン	700	2,567.00	1,796,900
T P R	2,200	1,425.00	3,135,000
ツバキ・ナカシマ	3,600	1,390.00	5,004,000
ホシザキ	4,800	8,420.00	40,416,000
大豊工業	1,300	725.00	942,500
日本精工	30,700	694.00	21,305,800
N T N	35,600	213.00	7,582,800
ジェイテクト	15,600	968.00	15,100,800
不二越	1,400	4,160.00	5,824,000
日本トムソン	4,500	604.00	2,718,000
T H K	9,200	2,853.00	26,247,600
ユーシン精機	1,300	693.00	900,900
前澤給装工業	1,200	972.00	1,166,400
イーグル工業	2,100	1,087.00	2,282,700
前澤工業	1,000	650.00	650,000
日本ピラー工業	1,700	3,365.00	5,720,500
キッツ	5,500	660.00	3,630,000
マキタ	19,800	3,999.00	79,180,200
三井E & Sホールディングス	6,100	347.00	2,116,700
日立造船	13,900	742.00	10,313,800

三菱重工業	25,600	3,021.00	77,337,600
I H I	10,200	2,254.00	22,990,800
スター精密	2,500	1,434.00	3,585,000
日清紡ホールディングス	10,000	973.00	9,730,000
イビデン	8,600	6,220.00	53,492,000
コニカミノルタ	35,800	476.00	17,040,800
ブラザー工業	19,900	2,060.00	40,994,000
ミネベアミツミ	28,100	2,823.00	79,326,300
日立製作所	78,300	5,802.00	454,296,600
東芝	28,500	4,779.00	136,201,500
三菱電機	162,700	1,440.50	234,369,350
富士電機	9,800	6,090.00	59,682,000
東洋電機製造	600	958.00	574,800
安川電機	17,500	4,790.00	83,825,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,198.00	2,396,000
明電舎	2,800	2,573.00	7,204,400
オリジン	400	1,233.00	493,200
山洋電気	700	5,280.00	3,696,000
デンヨー	1,400	1,665.00	2,331,000
P H C ホールディングス	1,900	1,592.00	3,024,800
東芝テック	1,800	4,295.00	7,731,000
芝浦メカトロニクス	300	8,530.00	2,559,000
マブチモーター	3,800	3,575.00	13,585,000
日本電産	42,200	10,020.00	422,844,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	383.00	344,700
トレックス・セミコンダクター	800	2,656.00	2,124,800
東光高岳	900	1,430.00	1,287,000
ダイヘン	1,800	4,160.00	7,488,000
ヤーマン	2,700	908.00	2,451,600
J V C ケンウッド	14,500	175.00	2,537,500
ミマキエンジニアリング	1,500	784.00	1,176,000
I - P E X	800	1,706.00	1,364,800
日新電機	3,800	1,453.00	5,521,400
大崎電気工業	3,000	459.00	1,377,000
オムロン	13,600	8,506.00	115,681,600
日東工業	2,100	1,542.00	3,238,200
I D E C	2,000	2,421.00	4,842,000
正興電機製作所	500	1,000.00	500,000
不二電機工業	400	1,093.00	437,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,432.00	12,889,600
サクサホールディングス	400	1,295.00	518,000
メルコホールディングス	400	3,650.00	1,460,000

テクノメディカ	400	1,606.00	642,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,051.00	525,500	
日本電気	20,700	4,940.00	102,258,000	
富士通	14,700	14,660.00	215,502,000	
沖電気工業	6,600	881.00	5,814,600	
岩崎通信機	600	824.00	494,400	
電気興業	900	2,300.00	2,070,000	
サンケン電気	1,500	4,970.00	7,455,000	
ナカヨ	200	1,138.00	227,600	
アイホン	1,000	2,125.00	2,125,000	
ルネサスエレクトロニクス	88,300	1,292.00	114,083,600	
セイコーエプソン	20,300	1,778.00	36,093,400	
ワコム	12,600	888.00	11,188,800	
アルバック	3,200	5,820.00	18,624,000	
アクセル	700	1,132.00	792,400	
E I Z O	1,300	3,645.00	4,738,500	
日本信号	4,000	891.00	3,564,000	
京三製作所	3,600	418.00	1,504,800	
能美防災	2,100	2,063.00	4,332,300	
ホーチキ	1,200	1,187.00	1,424,400	
星和電機	800	571.00	456,800	
エレコム	3,700	1,381.00	5,109,700	
パナソニック	173,700	1,256.50	218,254,050	
シャープ	18,700	1,265.00	23,655,500	
アンリツ	10,500	1,617.00	16,978,500	
富士通ゼネラル	4,500	2,308.00	10,386,000	
ソニーグループ	102,000	12,770.00	1,302,540,000	代用有価証券 30,000株
T D K	23,600	4,560.00	107,616,000	
帝国通信工業	800	1,332.00	1,065,600	
タムラ製作所	6,500	640.00	4,160,000	
アルプスアルパイン	14,500	1,263.00	18,313,500	
池上通信機	600	647.00	388,200	
鈴木	800	849.00	679,200	
メイコー	1,300	3,890.00	5,057,000	
日本トリム	400	3,030.00	1,212,000	
ローランド ディー . ジー .	1,000	2,663.00	2,663,000	
フォスター電機	1,800	742.00	1,335,600	
S M K	500	2,160.00	1,080,000	
ヨコオ	1,200	2,609.00	3,130,800	
ホシデン	4,000	1,158.00	4,632,000	
ヒロセ電機	2,500	17,040.00	42,600,000	

日本航空電子工業	3,800	1,817.00	6,904,600
TOA	1,800	783.00	1,409,400
マクセル	3,300	1,247.00	4,115,100
古野電気	2,000	1,011.00	2,022,000
ユニデンホールディングス	400	3,365.00	1,346,000
スミダコーポレーション	1,600	980.00	1,568,000
アイコム	600	2,350.00	1,410,000
リオン	700	2,289.00	1,602,300
本多通信工業	1,600	451.00	721,600
横河電機	16,300	1,880.00	30,644,000
新電元工業	700	3,375.00	2,362,500
アズビル	9,500	4,505.00	42,797,500
東亜ディーケーケー	800	896.00	716,800
日本光電工業	6,700	3,030.00	20,301,000
チノー	600	1,630.00	978,000
共和電業	1,500	381.00	571,500
日本電子材料	800	2,520.00	2,016,000
堀場製作所	3,000	6,120.00	18,360,000
アドバンテスト	12,100	9,750.00	117,975,000
小野測器	800	483.00	386,400
エスベック	1,300	2,034.00	2,644,200
キーエンス	14,700	59,410.00	873,327,000
日置電機	800	6,430.00	5,144,000
シスメックス	13,800	10,695.00	147,591,000
日本マイクロニクス	2,800	1,558.00	4,362,400
メガチップス	1,500	4,200.00	6,300,000
OBARA GROUP	700	3,285.00	2,299,500
澤藤電機	200	1,492.00	298,400
原田工業	900	968.00	871,200
コーセル	1,800	807.00	1,452,600
イリソ電子工業	1,400	4,480.00	6,272,000
オブテックスグループ	2,700	1,503.00	4,058,100
千代田インテグレ	700	1,831.00	1,281,700
アイ・オー・データ機器	500	779.00	389,500
レーザーテック	7,200	23,265.00	167,508,000
スタンレー電気	11,300	2,619.00	29,594,700
岩崎電気	600	2,305.00	1,383,000
ウシオ電機	8,400	1,756.00	14,750,400
岡谷電機産業	1,500	314.00	471,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	296.00	503,200
エノモト	500	1,712.00	856,000
日本セラミック	1,600	2,415.00	3,864,000

遠藤照明	800	964.00	771,200
古河電池	1,200	1,254.00	1,504,800
双信電機	900	594.00	534,600
山一電機	1,300	2,046.00	2,659,800
図研	1,100	3,025.00	3,327,500
日本電子	3,400	6,030.00	20,502,000
カシオ計算機	11,900	1,459.00	17,362,100
ファナック	14,300	22,870.00	327,041,000
日本シイエムケイ	3,400	568.00	1,931,200
エンプラス	400	2,581.00	1,032,400
大真空	2,300	1,241.00	2,854,300
ローム	7,300	9,800.00	71,540,000
浜松ホトニクス	11,700	5,780.00	67,626,000
三井ハイテック	1,600	8,260.00	13,216,000
新光電気工業	4,800	5,180.00	24,864,000
京セラ	22,900	6,825.00	156,292,500
太陽誘電	7,900	5,700.00	45,030,000
村田製作所	47,800	8,861.00	423,555,800
双葉電子工業	3,000	668.00	2,004,000
北陸電気工業	700	1,269.00	888,300
ニチコン	5,200	1,192.00	6,198,400
日本ケミコン	1,600	1,625.00	2,600,000
K O A	2,600	1,433.00	3,725,800
市光工業	2,100	488.00	1,024,800
小糸製作所	9,000	5,560.00	50,040,000
ミツバ	3,200	388.00	1,241,600
S C R E E Nホールディングス	2,800	11,180.00	31,304,000
キャノン電子	1,600	1,598.00	2,556,800
キャノン	80,900	2,720.50	220,088,450
リコー	45,300	980.00	44,394,000
象印マホービン	4,500	1,442.00	6,489,000
M U T O Hホールディングス	300	2,020.00	606,000
東京エレクトロン	10,300	55,370.00	570,311,000
トヨタ紡織	6,600	2,034.00	13,424,400
芦森工業	400	895.00	358,000
ユニプレス	2,600	787.00	2,046,200
豊田自動織機	13,200	8,790.00	116,028,000
モリタホールディングス	2,600	1,258.00	3,270,800
三櫻工業	2,300	812.00	1,867,600
デンソー	35,800	8,536.00	305,588,800
東海理化電機製作所	4,200	1,513.00	6,354,600
川崎重工業	11,900	2,169.00	25,811,100

名村造船所	5,300	194.00	1,028,200
日本車輛製造	600	1,985.00	1,191,000
三菱ロジスネクスト	2,200	964.00	2,120,800
近畿車輛	300	1,010.00	303,000
日産自動車	192,200	594.20	114,205,240
いすゞ自動車	51,100	1,398.00	71,437,800
トヨタ自動車	824,600	2,227.00	1,836,384,200
日野自動車	20,300	1,006.00	20,421,800
三菱自動車工業	60,700	307.00	18,634,900
エフテック	1,300	528.00	686,400
レシップホールディングス	800	546.00	436,800
G M B	400	790.00	316,000
ファルテック	300	688.00	206,400
武蔵精密工業	3,600	1,691.00	6,087,600
日産車体	2,400	685.00	1,644,000
新明和工業	4,500	881.00	3,964,500
極東開発工業	2,900	1,468.00	4,257,200
トピー工業	1,400	1,076.00	1,506,400
ティラド	500	2,674.00	1,337,000
タチエス	2,900	1,181.00	3,424,900
N O K	7,900	1,217.00	9,614,300
フタバ産業	4,300	408.00	1,754,400
K Y B	1,700	2,963.00	5,037,100
大同メタル工業	3,300	617.00	2,036,100
プレス工業	8,200	383.00	3,140,600
ミクニ	2,400	430.00	1,032,000
太平洋工業	3,400	1,068.00	3,631,200
河西工業	2,400	295.00	708,000
アイシン	11,900	4,125.00	49,087,500
マツダ	51,200	873.00	44,697,600
今仙電機製作所	1,100	585.00	643,500
本田技研工業	128,100	3,301.00	422,858,100
スズキ	37,200	4,766.00	177,295,200
S U B A R U	46,700	2,068.50	96,598,950
安永	900	857.00	771,300
ヤマハ発動機	21,300	2,668.00	56,828,400
T B K	1,800	399.00	718,200
エクセディ	2,500	1,636.00	4,090,000
豊田合成	5,200	2,362.00	12,282,400
愛三工業	2,600	707.00	1,838,200
盟和産業	200	1,003.00	200,600
日本プラスト	1,400	543.00	760,200

ヨロズ	1,600	953.00	1,524,800
エフ・シー・シー	2,700	1,453.00	3,923,100
シマノ	6,500	25,860.00	168,090,000
テイ・エス テック	6,800	1,503.00	10,220,400
ジャムコ	1,100	796.00	875,600
テルモ	46,000	4,191.00	192,786,000
クリエートメディック	400	966.00	386,400
日機装	5,000	826.00	4,130,000
日本エム・ディ・エム	1,000	1,590.00	1,590,000
島津製作所	21,000	4,105.00	86,205,000
JMS	1,400	603.00	844,200
長野計器	1,200	1,319.00	1,582,800
ブイ・テクノロジー	700	3,400.00	2,380,000
東京計器	1,000	1,000.00	1,000,000
愛知時計電機	600	1,801.00	1,080,600
インターアクション	900	1,945.00	1,750,500
オーバル	1,600	258.00	412,800
東京精密	2,700	4,855.00	13,108,500
マニー	6,500	1,638.00	10,647,000
ニコン	24,900	1,228.00	30,577,200
トプコン	7,700	1,423.00	10,957,100
オリンパス	85,400	2,536.00	216,574,400
理研計器	1,300	5,570.00	7,241,000
タムロン	1,300	2,497.00	3,246,100
HOYA	31,800	14,780.00	470,004,000
シード	900	516.00	464,400
ノーリツ鋼機	1,500	2,061.00	3,091,500
エー・アンド・デイ	1,500	971.00	1,456,500
朝日インテック	17,800	1,980.00	35,244,000
シチズン時計	19,500	481.00	9,379,500
リズム	600	1,311.00	786,600
大研医器	1,300	522.00	678,600
メニコン	5,400	2,534.00	13,683,600
シンシア	200	511.00	102,200
松風	700	1,765.00	1,235,500
セイコーホールディングス	2,400	2,135.00	5,124,000
ニプロ	12,200	1,066.00	13,005,200
中本パックス	500	1,713.00	856,500
スノーピーク	2,100	2,289.00	4,806,900
パラマウントベッドホールディングス	3,100	1,893.00	5,868,300
トランザクション	900	1,095.00	985,500
粧美堂	600	404.00	242,400

ニホンフラッシュ	1,400	1,038.00	1,453,200
前田工織	1,800	3,345.00	6,021,000
永大産業	2,100	303.00	636,300
アートネイチャー	1,300	687.00	893,100
バンダイナムコホールディングス	14,600	8,100.00	118,260,000
アイフィスジャパン	400	650.00	260,000
共立印刷	3,600	139.00	500,400
SHOEI	1,500	4,360.00	6,540,000
フランスベッドホールディングス	2,300	893.00	2,053,900
パイロットコーポレーション	2,700	4,050.00	10,935,000
萩原工業	1,100	1,181.00	1,299,100
フジシールインターナショナル	3,900	2,133.00	8,318,700
タカラトミー	7,000	1,119.00	7,833,000
広済堂ホールディングス	1,100	756.00	831,600
エステールホールディングス	600	629.00	377,400
タカノ	700	659.00	461,300
プロネクサス	1,300	1,075.00	1,397,500
ホクシン	1,700	150.00	255,000
ウッドワン	500	978.00	489,000
大建工業	1,000	2,081.00	2,081,000
凸版印刷	24,700	2,183.00	53,920,100
大日本印刷	19,200	2,706.00	51,955,200
共同印刷	500	2,637.00	1,318,500
NISSHA	3,300	1,451.00	4,788,300
光村印刷	100	1,406.00	140,600
TAKARA & COMPANY	1,000	1,837.00	1,837,000
アシックス	14,400	2,244.00	32,313,600
ツツミ	500	1,808.00	904,000
ローランド	1,200	4,250.00	5,100,000
小松ウオール工業	500	1,815.00	907,500
ヤマハ	9,400	5,160.00	48,504,000
河合楽器製作所	500	2,963.00	1,481,500
クリナップ	1,600	524.00	838,400
ピジョン	9,900	2,245.00	22,225,500
兼松サステック	100	1,653.00	165,300
キングジム	1,500	875.00	1,312,500
リンテック	3,400	2,652.00	9,016,800
イトーキ	3,300	339.00	1,118,700
任天堂	9,200	56,720.00	521,824,000
三菱鉛筆	2,700	1,194.00	3,223,800
タカラスタンダード	3,400	1,359.00	4,620,600
コクヨ	7,900	1,676.00	13,240,400

ナカバヤシ	1,400	509.00	712,600
オカムラ	5,700	1,227.00	6,993,900
美津濃	1,700	2,168.00	3,685,600
東京電力ホールディングス	122,200	330.00	40,326,000
中部電力	49,700	1,148.00	57,055,600
関西電力	61,800	1,078.00	66,620,400
中国電力	25,500	879.00	22,414,500
北陸電力	14,900	537.00	8,001,300
東北電力	38,200	740.00	28,268,000
四国電力	14,800	793.00	11,736,400
九州電力	33,600	820.00	27,552,000
北海道電力	14,200	506.00	7,185,200
沖縄電力	3,400	1,395.00	4,743,000
電源開発	13,900	1,738.00	24,158,200
エフオン	1,100	529.00	581,900
イーレックス	2,400	1,509.00	3,621,600
レノバ	3,200	1,591.00	5,091,200
東京瓦斯	31,200	2,288.00	71,385,600
大阪瓦斯	29,400	1,983.00	58,300,200
東邦瓦斯	7,500	3,200.00	24,000,000
北海道瓦斯	800	1,498.00	1,198,400
広島ガス	2,800	360.00	1,008,000
西部ガスホールディングス	1,900	2,156.00	4,096,400
静岡ガス	4,200	994.00	4,174,800
メタウォーター	1,700	2,064.00	3,508,800
SBSホールディングス	1,200	3,480.00	4,176,000
東武鉄道	16,000	2,722.00	43,552,000
相鉄ホールディングス	5,300	2,101.00	11,135,300
東急	41,100	1,512.00	62,143,200
京浜急行電鉄	21,100	1,176.00	24,813,600
小田急電鉄	24,300	2,024.00	49,183,200
京王電鉄	8,500	5,170.00	43,945,000
京成電鉄	11,300	3,170.00	35,821,000
富士急行	1,900	3,960.00	7,524,000
東日本旅客鉄道	28,700	6,910.00	198,317,000
西日本旅客鉄道	19,800	4,871.00	96,445,800
東海旅客鉄道	13,500	15,505.00	209,317,500
西武ホールディングス	21,400	1,124.00	24,053,600
鴻池運輸	2,600	1,151.00	2,992,600
西日本鉄道	4,500	2,561.00	11,524,500
ハマキョウレックス	1,100	2,846.00	3,130,600
サカイ引越センター	800	4,350.00	3,480,000

近鉄グループホールディングス	15,500	3,345.00	51,847,500
阪急阪神ホールディングス	19,300	3,470.00	66,971,000
南海電気鉄道	6,900	2,305.00	15,904,500
京阪ホールディングス	6,900	2,688.00	18,547,200
神戸電鉄	400	3,230.00	1,292,000
名古屋鉄道	12,700	1,808.00	22,961,600
山陽電気鉄道	1,200	2,006.00	2,407,200
アルプス物流	1,100	962.00	1,058,200
ヤマトホールディングス	21,600	2,495.00	53,892,000
山九	4,100	4,150.00	17,015,000
丸運	900	240.00	216,000
丸全昭和運輸	1,300	3,215.00	4,179,500
センコーグループホールディングス	7,800	932.00	7,269,600
トナミホールディングス	400	3,655.00	1,462,000
ニッコンホールディングス	5,100	2,153.00	10,980,300
日本石油輸送	200	2,645.00	529,000
福山通運	2,500	3,610.00	9,025,000
セイノーホールディングス	10,400	1,130.00	11,752,000
エスライン	400	889.00	355,600
神奈川中央交通	400	3,310.00	1,324,000
日立物流	3,000	5,160.00	15,480,000
丸和運輸機関	3,300	1,202.00	3,966,600
C & F ロジホールディングス	1,600	1,340.00	2,144,000
九州旅客鉄道	11,900	2,433.00	28,952,700
S Gホールディングス	29,100	2,378.00	69,199,800
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,300	6,650.00	35,245,000
日本郵船	12,900	9,240.00	119,196,000
商船三井	8,500	9,280.00	78,880,000
川崎汽船	4,800	7,300.00	35,040,000
NSユナイテッド海運	900	3,300.00	2,970,000
飯野海運	7,400	537.00	3,973,800
乾汽船	1,100	2,370.00	2,607,000
日本航空	35,400	2,173.00	76,924,200
ANAホールディングス	39,300	2,405.50	94,536,150
パスコ	300	1,314.00	394,200
ランコム	400	7,870.00	3,148,000
日新	1,300	1,597.00	2,076,100
三菱倉庫	4,900	2,754.00	13,494,600
三井倉庫ホールディングス	1,700	2,360.00	4,012,000
住友倉庫	5,400	2,051.00	11,075,400
澁澤倉庫	900	2,120.00	1,908,000
東陽倉庫	2,600	312.00	811,200

日本トランスシティ	3,400	645.00	2,193,000
ケイヒン	200	1,296.00	259,200
中央倉庫	900	965.00	868,500
川西倉庫	400	1,075.00	430,000
安田倉庫	1,100	962.00	1,058,200
ファイブホールディングス	400	623.00	249,200
東洋埠頭	400	1,422.00	568,800
宇徳	1,200	723.00	867,600
上組	8,400	2,220.00	18,648,000
サンリツ	400	834.00	333,600
キムラユニティー	400	1,328.00	531,200
キューソー流通システム	800	870.00	696,000
近鉄エクスプレス	2,900	2,885.00	8,366,500
東海運	1,300	308.00	400,400
エーアイティー	1,000	1,459.00	1,459,000
内外トランスライン	600	1,845.00	1,107,000
日本コンセプト	500	1,335.00	667,500
NEC ネットエスアイ	5,300	1,657.00	8,782,100
クロスキャット	500	1,564.00	782,000
システナ	22,700	349.00	7,922,300
デジタルアーツ	900	6,620.00	5,958,000
日鉄ソリューションズ	2,300	3,215.00	7,394,500
キューブシステム	800	919.00	735,200
WOW WORLD	200	1,092.00	218,400
コア	700	1,510.00	1,057,000
ラクーンホールディングス	1,400	1,229.00	1,720,600
ソリトンシステムズ	800	1,278.00	1,022,400
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,630.00	2,541,000
T I S	15,200	3,025.00	45,980,000
J N S ホールディングス	800	404.00	323,200
グリー	7,300	871.00	6,358,300
G M O ペパボ	200	2,240.00	448,000
コーエーテクモホールディングス	5,100	3,980.00	20,298,000
三菱総合研究所	700	3,760.00	2,632,000
ボルテージ	500	338.00	169,000
電算	200	2,213.00	442,600
A G S	800	805.00	644,000
ファインデックス	1,400	952.00	1,332,800
ブレインパッド	1,400	1,136.00	1,590,400
K L a b	3,100	444.00	1,376,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	954.00	2,194,200
ネクソン	36,000	2,231.00	80,316,000

アイスタイル	4,100	193.00	791,300
エムアップホールディングス	2,000	803.00	1,606,000
エイチーム	1,200	715.00	858,000
エニグモ	1,800	645.00	1,161,000
テクノスジャパン	1,200	454.00	544,800
コロプラ	5,300	646.00	3,423,800
オルトプラス	1,300	310.00	403,000
ブロードリーフ	7,900	348.00	2,749,200
クロス・マーケティンググループ	700	881.00	616,700
デジタルハーツホールディングス	800	1,717.00	1,373,600
システム情報	1,200	909.00	1,090,800
メディアドゥ	600	2,561.00	1,536,600
じげん	4,700	291.00	1,367,700
ブイキューブ	1,700	814.00	1,383,800
エンカレッジ・テクノロジー	400	535.00	214,000
サイバーリンクス	600	874.00	524,400
フィックスターズ	1,800	720.00	1,296,000
CARTA HOLDINGS	700	1,917.00	1,341,900
オブティム	1,100	977.00	1,074,700
セレス	600	1,920.00	1,152,000
SHIFT	800	19,510.00	15,608,000
ティーガイア	1,400	1,653.00	2,314,200
セック	200	2,193.00	438,600
テクマトリックス	2,700	1,433.00	3,869,100
プロシップ	500	1,340.00	670,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,437.00	9,991,700
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	9,890.00	30,659,000
ザッパラス	600	473.00	283,800
システムリサーチ	400	1,765.00	706,000
インターネットイニシアティブ	4,300	3,855.00	16,576,500
さくらインターネット	1,800	500.00	900,000
ヴィンクス	500	815.00	407,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	3,440.00	1,376,000
SRAホールディングス	800	2,844.00	2,275,200
システムインテグレータ	500	518.00	259,000
朝日ネット	1,400	611.00	855,400
eBASE	1,900	519.00	986,100
アバント	1,700	1,101.00	1,871,700
アドソル日進	600	1,544.00	926,400
ODKソリューションズ	300	630.00	189,000
フリービット	800	887.00	709,600
コムチュア	1,800	2,804.00	5,047,200

サイバーコム	200	1,088.00	217,600
アステリア	1,200	874.00	1,048,800
アイル	900	1,245.00	1,120,500
マークラインズ	800	2,492.00	1,993,600
メディカル・データ・ビジョン	2,100	1,014.00	2,129,400
g u m i	2,300	562.00	1,292,600
ショーケース	400	457.00	182,800
モバイルファクトリー	400	940.00	376,000
テラスカイ	600	1,461.00	876,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,191.00	833,700
P C Iホールディングス	700	990.00	693,000
パイプドHD	300	2,447.00	734,100
アイビーシー	300	627.00	188,100
ネオジャパン	500	1,055.00	527,500
P R T I M E S	400	2,685.00	1,074,000
ラクス	5,500	2,350.00	12,925,000
ランドコンピュータ	300	828.00	248,400
ダブルスタンダード	500	2,467.00	1,233,500
オープンドア	1,000	1,498.00	1,498,000
マイネット	600	483.00	289,800
アカツキ	700	2,740.00	1,918,000
ベネフィットジャパン	100	2,040.00	204,000
U b i c o mホールディングス	400	2,241.00	896,400
カナミックネットワーク	1,800	458.00	824,400
ノムラシステムコーポレーション	900	249.00	224,100
チェンジ	3,000	1,463.00	4,389,000
シンクロ・フード	900	294.00	264,600
オークネット	900	1,483.00	1,334,700
キャピタル・アセット・プランニング	400	786.00	314,400
セグエグループ	500	576.00	288,000
エイトレッド	300	2,063.00	618,900
マクロミル	3,500	1,101.00	3,853,500
ビーグリー	400	1,133.00	453,200
オロ	500	2,301.00	1,150,500
ユーザーローカル	500	1,463.00	731,500
テモナ	400	444.00	177,600
ニーズウェル	500	589.00	294,500
マネーフォワード	2,400	5,230.00	12,552,000
サインポスト	600	885.00	531,000
電算システムホールディングス	700	2,634.00	1,843,800
ソルクシーズ	1,400	410.00	574,000
フェイス	400	663.00	265,200

プロトコーポレーション	1,700	1,327.00	2,255,900
ハイマックス	400	1,170.00	468,000
野村総合研究所	30,900	3,925.00	121,282,500
サイバネットシステム	1,100	646.00	710,600
C Eホールディングス	900	502.00	451,800
日本システム技術	300	2,126.00	637,800
インタージホールディングス	1,800	1,769.00	3,184,200
東邦システムサイエンス	500	929.00	464,500
ソースネクスト	7,200	157.00	1,130,400
インフォコム	1,800	1,848.00	3,326,400
シンプレクス・ホールディングス	1,900	1,996.00	3,792,400
HEROZ	500	977.00	488,500
ラクスル	1,800	3,720.00	6,696,000
I P S	500	1,822.00	911,000
F I G	2,100	275.00	577,500
システムサポート	600	967.00	580,200
イーソル	1,000	513.00	513,000
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,351.00	2,702,000
E d u L a b	200	754.00	150,800
東海ソフト	300	906.00	271,800
ウイングアーク1 s t	900	1,326.00	1,193,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	2,068.00	827,200
サーバーワークス	300	2,263.00	678,900
東名	200	912.00	182,400
ヴィッツ	200	1,278.00	255,600
トピラシステムズ	400	859.00	343,600
S a n s a n	5,700	1,257.00	7,164,900
L i n k - U	300	742.00	222,600
ギフトィ	1,500	1,190.00	1,785,000
ベース	300	4,240.00	1,272,000
J M D C	1,500	5,260.00	7,890,000
フォーカスシステムズ	1,200	913.00	1,095,600
クレスコ	1,200	1,792.00	2,150,400
フジ・メディア・ホールディングス	15,300	1,150.00	17,595,000
オービック	5,000	18,800.00	94,000,000
ジャストシステム	2,300	4,985.00	11,465,500
T D C ソフト	1,400	1,017.00	1,423,800
Zホールディングス	232,100	578.90	134,362,690
トレンドマイクロ	8,500	6,090.00	51,765,000
I Dホールディングス	900	829.00	746,100
日本オラクル	2,600	8,360.00	21,736,000
アルファシステムズ	400	3,600.00	1,440,000

フューチャー	3,400	1,474.00	5,011,600
C A C H o l d i n g s	900	1,326.00	1,193,400
S B テクノロジー	700	2,380.00	1,666,000
トーセ	400	706.00	282,400
オービックビジネスコンサルタント	1,500	4,295.00	6,442,500
伊藤忠テクノソリューションズ	7,200	3,045.00	21,924,000
アイティフォー	2,000	755.00	1,510,000
東計電算	200	4,685.00	937,000
エクスネット	200	952.00	190,400
大塚商会	8,600	4,685.00	40,291,000
サイボウズ	2,100	1,434.00	3,011,400
電通国際情報サービス	2,300	3,480.00	8,004,000
A C C E S S	1,900	580.00	1,102,000
デジタルガレージ	2,600	3,910.00	10,166,000
E M システムズ	2,600	639.00	1,661,400
ウェザーニューズ	500	7,950.00	3,975,000
C I J	900	808.00	727,200
ビジネスエンジニアリング	200	3,460.00	692,000
日本エンタープライズ	1,600	170.00	272,000
WOWOW	800	1,633.00	1,306,400
スカラ	1,300	656.00	852,800
インテリジェント ウェイブ	800	515.00	412,000
I M A G I C A G R O U P	1,500	609.00	913,500
ネットワンシステムズ	6,100	2,715.00	16,561,500
システムソフト	3,900	99.00	386,100
アルゴグラフィックス	1,200	3,085.00	3,702,000
マーベラス	2,500	715.00	1,787,500
エイベックス	2,800	1,286.00	3,600,800
日本ユニシス	5,000	2,981.00	14,905,000
兼松エレクトロニクス	800	3,740.00	2,992,000
都築電気	800	1,652.00	1,321,600
T B S ホールディングス	9,700	1,723.00	16,713,100
日本テレビホールディングス	13,200	1,192.00	15,734,400
朝日放送グループホールディングス	1,600	692.00	1,107,200
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,492.00	5,669,600
スカパーJ S A T ホールディングス	13,600	429.00	5,834,400
テレビ東京ホールディングス	1,200	1,976.00	2,371,200
日本BS放送	600	1,099.00	659,400
ビジョン	2,800	1,021.00	2,858,800
スマートバリュー	500	462.00	231,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,600	2,493.00	3,988,800
コネクシオ	1,300	1,374.00	1,786,200

クロップス	300	873.00	261,900
日本電信電話	167,300	3,301.00	552,257,300
K D D I	116,600	3,675.00	428,505,000
ソフトバンク	242,200	1,444.00	349,736,800
光通信	1,800	13,710.00	24,678,000
エムティーアイ	1,600	570.00	912,000
GMOインターネット	5,600	2,451.00	13,725,600
ファイバーゲート	700	1,139.00	797,300
アйдママーケティングコミュニケーション	500	285.00	142,500
K A D O K A W A	8,700	2,365.00	20,575,500
学研ホールディングス	2,300	1,043.00	2,398,900
ゼンリン	2,700	973.00	2,627,100
昭文社ホールディングス	900	426.00	383,400
インプレスホールディングス	1,500	208.00	312,000
アイネット	800	1,263.00	1,010,400
松竹	1,100	11,720.00	12,892,000
東宝	9,400	4,480.00	42,112,000
東映	500	16,970.00	8,485,000
エヌ・ティ・ティ・データ	42,500	2,206.00	93,755,000
ピー・シー・エー	1,000	1,557.00	1,557,000
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,789.00	1,073,400
D T S	3,000	2,478.00	7,434,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,400	5,650.00	41,810,000
シーイーシー	1,800	1,054.00	1,897,200
カブコン	15,100	2,777.00	41,932,700
アイ・エス・ビー	800	916.00	732,800
ジャステック	900	1,035.00	931,500
S C S K	11,000	1,919.00	21,109,000
日本システムウエア	600	2,104.00	1,262,400
アイネス	1,500	1,487.00	2,230,500
T K C	2,700	3,010.00	8,127,000
富士ソフト	1,700	4,875.00	8,287,500
N S D	5,100	1,976.00	10,077,600
コナミホールディングス	5,800	6,050.00	35,090,000
福井コンピュータホールディングス	700	2,977.00	2,083,900
J B C Cホールディングス	1,100	1,497.00	1,646,700
ミロク情報サービス	1,400	1,170.00	1,638,000
ソフトバンクグループ	95,900	5,067.00	485,925,300
ハウスイ	200	879.00	175,800
高千穂交易	600	1,493.00	895,800
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,409.00	422,700
伊藤忠食品	400	4,825.00	1,930,000

エレマテック	1,400	1,033.00	1,446,200
JALUX	500	2,555.00	1,277,500
あらた	1,300	4,025.00	5,232,500
トーメンデバイス	300	6,700.00	2,010,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,620.00	2,810,000
フィールズ	1,500	485.00	727,500
双日	17,700	1,777.00	31,452,900
アルフレッサ ホールディングス	17,800	1,615.00	28,747,000
横浜冷凍	4,700	851.00	3,999,700
神栄	300	826.00	247,800
ラサ商事	900	960.00	864,000
アルコニックス	2,100	1,311.00	2,753,100
神戸物産	12,500	3,520.00	44,000,000
ハイパー	500	466.00	233,000
あい ホールディングス	2,300	1,764.00	4,057,200
ディーブイエックス	500	1,012.00	506,000
ダイワボウホールディングス	7,800	1,605.00	12,519,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	2,511.00	9,541,800
ラクト・ジャパン	600	1,874.00	1,124,400
グリムス	700	2,108.00	1,475,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	775.00	2,170,000
八洲電機	1,200	942.00	1,130,400
メディアスホールディングス	900	886.00	797,400
レスターホールディングス	1,500	1,938.00	2,907,000
ジューテックホールディングス	400	1,125.00	450,000
大光	800	688.00	550,400
OCHIホールディングス	500	1,310.00	655,000
TOKAIホールディングス	7,800	885.00	6,903,000
黒谷	500	618.00	309,000
Cominix	300	734.00	220,200
三洋貿易	1,600	996.00	1,593,600
ビューティガレージ	300	2,993.00	897,900
ウイン・パートナーズ	1,100	982.00	1,080,200
ミタチ産業	400	909.00	363,600
シップヘルスケアホールディングス	5,100	2,547.00	12,989,700
明治電機工業	400	1,207.00	482,800
デリカフーズホールディングス	900	543.00	488,700
スターティアホールディングス	400	759.00	303,600
コメダホールディングス	3,600	2,120.00	7,632,000
ピーバンドットコム	300	641.00	192,300
アセンテック	600	706.00	423,600
富士興産	500	995.00	497,500

協栄産業	200	1,642.00	328,400
フルサト・マルカホールディングス	1,600	2,156.00	3,449,600
ヤマエグループホールディングス	1,100	1,026.00	1,128,600
小野建	1,500	1,641.00	2,461,500
南陽	300	1,901.00	570,300
佐島電機	1,100	929.00	1,021,900
エコートレーディング	300	590.00	177,000
伯東	1,000	2,220.00	2,220,000
コンドーテック	1,300	1,009.00	1,311,700
中山福	900	387.00	348,300
ナガイレーベン	2,100	2,095.00	4,399,500
三菱食品	1,500	2,799.00	4,198,500
松田産業	1,200	2,296.00	2,755,200
第一興商	3,000	3,220.00	9,660,000
メディパルホールディングス	17,200	2,054.00	35,328,800
S P K	600	1,296.00	777,600
萩原電気ホールディングス	600	1,940.00	1,164,000
アズワン	2,300	5,800.00	13,340,000
スズデン	500	1,881.00	940,500
シモジマ	900	1,012.00	910,800
ドウシシャ	1,500	1,520.00	2,280,000
小津産業	300	1,942.00	582,600
高速	900	1,525.00	1,372,500
たけびし	600	1,433.00	859,800
リックス	300	1,517.00	455,100
丸文	1,500	745.00	1,117,500
ハピネット	1,300	1,495.00	1,943,500
橋本総業ホールディングス	400	1,923.00	769,200
日本ライフライン	4,700	1,014.00	4,765,800
タカショー	1,400	650.00	910,000
I D O M	5,000	663.00	3,315,000
進和	900	1,988.00	1,789,200
エスケイジャパン	600	416.00	249,600
ダイトロン	700	1,963.00	1,374,100
シークス	2,400	1,289.00	3,093,600
田中商事	400	635.00	254,000
オーハシテクニカ	900	1,381.00	1,242,900
白銅	600	2,680.00	1,608,000
ダイコー通産	200	1,191.00	238,200
伊藤忠商事	112,100	3,677.00	412,191,700
丸紅	158,100	1,168.00	184,660,800
高島	200	2,290.00	458,000

長瀬産業	8,800	1,813.00	15,954,400
蝶理	900	1,749.00	1,574,100
豊田通商	16,100	4,595.00	73,979,500
三共生興	2,000	566.00	1,132,000
兼松	6,000	1,246.00	7,476,000
ツカモトコーポレーション	300	1,308.00	392,400
三井物産	124,500	2,834.00	352,833,000
日本紙パルプ商事	800	3,945.00	3,156,000
カメイ	1,800	1,001.00	1,801,800
東都水産	100	3,935.00	393,500
OUGホールディングス	200	2,660.00	532,000
スターゼン	1,200	2,032.00	2,438,400
山善	6,700	1,006.00	6,740,200
椿本興業	300	4,195.00	1,258,500
住友商事	101,100	1,765.50	178,492,050
内田洋行	700	4,530.00	3,171,000
三菱商事	120,100	3,856.00	463,105,600
第一実業	800	4,175.00	3,340,000
キャノンマーケティングジャパン	4,000	2,342.00	9,368,000
西華産業	800	1,530.00	1,224,000
佐藤商事	1,300	1,096.00	1,424,800
菱洋エレクトロ	900	2,136.00	1,922,400
東京産業	1,500	712.00	1,068,000
ユアサ商事	1,500	2,926.00	4,389,000
神鋼商事	400	3,570.00	1,428,000
トルク	900	209.00	188,100
阪和興業	3,200	3,165.00	10,128,000
正栄食品工業	1,100	3,925.00	4,317,500
カナデン	1,300	1,011.00	1,314,300
菱電商事	1,200	1,706.00	2,047,200
岩谷産業	3,900	5,350.00	20,865,000
ナイス	600	1,729.00	1,037,400
ニチモウ	200	2,531.00	506,200
極東貿易	500	2,588.00	1,294,000
アステナホールディングス	2,300	393.00	903,900
三愛石油	4,000	907.00	3,628,000
稲畑産業	3,500	1,713.00	5,995,500
G S I クレオス	800	1,188.00	950,400
明和産業	1,600	1,126.00	1,801,600
クワザワホールディングス	800	606.00	484,800
ワキタ	3,400	1,013.00	3,444,200
東邦ホールディングス	5,100	1,779.00	9,072,900

サンゲツ	4,200	1,564.00	6,568,800
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,005.00	2,311,500
シナネンホールディングス	600	3,065.00	1,839,000
伊藤忠エネクス	3,400	1,000.00	3,400,000
サンリオ	5,000	2,269.00	11,345,000
サンワテクノス	1,000	1,333.00	1,333,000
リョーサン	1,700	2,234.00	3,797,800
新光商事	2,500	856.00	2,140,000
トーヨー	800	1,049.00	839,200
三信電気	800	1,482.00	1,185,600
東陽テクニカ	1,500	1,034.00	1,551,000
モスフードサービス	2,100	3,005.00	6,310,500
加賀電子	1,500	2,946.00	4,419,000
ソーダニッカ	1,700	848.00	1,441,600
立花エレテック	1,300	1,568.00	2,038,400
フォーバル	800	889.00	711,200
PALTAC	2,200	4,425.00	9,735,000
三谷産業	1,900	300.00	570,000
太平洋興発	700	639.00	447,300
西本Wismettacホールディングス	400	2,904.00	1,161,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,964.00	392,800
コア商事ホールディングス	1,000	594.00	594,000
国際紙パルプ商事	3,700	309.00	1,143,300
ヤマタネ	700	1,604.00	1,122,800
丸紅建材リース	100	1,789.00	178,900
日鉄物産	1,100	5,110.00	5,621,000
泉州電業	400	6,210.00	2,484,000
トラスコ中山	3,300	2,438.00	8,045,400
オートバックスセブン	5,400	1,404.00	7,581,600
モリト	1,100	709.00	779,900
加藤産業	2,300	3,305.00	7,601,500
北恵	400	832.00	332,800
イノテック	1,000	1,419.00	1,419,000
イエローハット	2,700	1,631.00	4,403,700
JKホールディングス	1,300	1,089.00	1,415,700
日伝	1,300	2,163.00	2,811,900
北沢産業	1,300	226.00	293,800
杉本商事	800	2,136.00	1,708,800
因幡電機産業	4,200	2,629.00	11,041,800
東テク	500	2,395.00	1,197,500
ミスミグループ本社	20,100	3,625.00	72,862,500
アルテック	1,200	279.00	334,800

タキヒヨー	500	1,395.00	697,500
蔵王産業	300	1,825.00	547,500
スズケン	6,200	3,410.00	21,142,000
ジェコス	1,100	792.00	871,200
グローセル	1,800	434.00	781,200
ローソン	3,600	5,090.00	18,324,000
サンエー	1,200	4,105.00	4,926,000
カワチ薬品	1,200	2,296.00	2,755,200
エービーシー・マート	2,500	5,280.00	13,200,000
ハードオフコーポレーション	600	738.00	442,800
アスクル	3,600	1,438.00	5,176,800
ゲオホールディングス	2,200	1,141.00	2,510,200
アダストリア	1,800	1,740.00	3,132,000
ジーフット	1,500	313.00	469,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	370.00	148,000
くら寿司	1,700	3,505.00	5,958,500
キャンドウ	600	1,951.00	1,170,600
アイケイ	500	394.00	197,000
パルグループホールディングス	1,400	1,645.00	2,303,000
エディオン	7,200	1,058.00	7,617,600
サーラコーポレーション	3,200	627.00	2,006,400
ワッツ	800	674.00	539,200
ハローズ	700	2,761.00	1,932,700
フジオフードグループ本社	1,500	1,309.00	1,963,500
あみやき亭	400	2,894.00	1,157,600
大黒天物産	500	4,455.00	2,227,500
ハニーズホールディングス	1,400	1,047.00	1,465,800
ファーマライズホールディングス	500	707.00	353,500
アルペン	1,200	2,007.00	2,408,400
ハブ	800	584.00	467,200
クオールホールディングス	2,000	1,342.00	2,684,000
ジーンズホールディングス	1,100	6,890.00	7,579,000
ビックカメラ	9,500	1,003.00	9,528,500
DCMホールディングス	9,900	1,090.00	10,791,000
MonotaRO	20,300	1,850.00	37,555,000
東京一番フーズ	600	587.00	352,200
アーランドサービスホールディングス	1,200	2,170.00	2,604,000
J.フロント リテイリング	19,300	1,013.00	19,550,900
ドトール・日レスホールディングス	2,800	1,573.00	4,404,400
マツキヨココカラ&カンパニー	9,900	3,930.00	38,907,000
ブロンコビリー	1,000	2,174.00	2,174,000
ZOZO	11,000	3,050.00	33,550,000

トレジャー・ファクトリー	500	837.00	418,500
物語コーポレーション	800	6,210.00	4,968,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,200	887.00	25,013,400
H a m e e	600	1,105.00	663,000
マーケットエンタープライズ	200	738.00	147,600
ウエルシアホールディングス	8,500	3,065.00	26,052,500
クリエイティブSDホールディングス	2,300	3,105.00	7,141,500
丸善C H Iホールディングス	1,700	359.00	610,300
ミサワ	400	643.00	257,200
ティーライフ	300	1,335.00	400,500
シュッピン	1,400	1,083.00	1,516,200
オイシックス・ラ・大地	2,300	2,451.00	5,637,300
ネクステージ	3,300	2,887.00	9,527,100
ジョイフル本田	4,900	1,528.00	7,487,200
鳥貴族ホールディングス	700	1,707.00	1,194,900
ホットランド	1,300	1,252.00	1,627,600
すかいらーくホールディングス	20,800	1,494.00	31,075,200
S F Pホールディングス	900	1,378.00	1,240,200
綿半ホールディングス	1,200	1,283.00	1,539,600
ヨシックスホールディングス	300	1,928.00	578,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,600	1,053.00	4,843,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,081.00	972,900
B E E N O S	800	1,841.00	1,472,800
あさひ	1,300	1,404.00	1,825,200
日本調剤	1,000	1,425.00	1,425,000
コスモス薬品	1,600	14,320.00	22,912,000
トーエル	800	858.00	686,400
セブン&アイ・ホールディングス	62,700	5,838.00	366,042,600
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	8,700	727.00	6,324,900
ツルハホールディングス	3,500	9,140.00	31,990,000
サンマルクホールディングス	1,400	1,506.00	2,108,400
フェリシモ	400	1,197.00	478,800
トリドールホールディングス	4,000	2,292.00	9,168,000
T O K Y O B A S E	1,500	437.00	655,500
ウイルプラスホールディングス	300	1,004.00	301,200
J Mホールディングス	1,100	1,649.00	1,813,900
サツドラホールディングス	900	632.00	568,800
アレンザホールディングス	1,200	1,077.00	1,292,400
串カツ田中ホールディングス	500	1,971.00	985,500
パロックジャパンリミテッド	1,100	894.00	983,400
クスリのアオキホールディングス	1,600	6,760.00	10,816,000

FOOD & LIFE COMPANIE	9,400	3,455.00	32,477,000
メディカルシステムネットワーク	1,600	561.00	897,600
藤久ホールディングス	400	703.00	281,200
はるやまホールディングス	900	504.00	453,600
ノジマ	2,600	2,453.00	6,377,800
カッパ・クリエイト	2,400	1,325.00	3,180,000
ライトオン	1,300	688.00	894,400
良品計画	18,500	1,654.00	30,599,000
三城ホールディングス	1,800	248.00	446,400
アドヴァングループ	1,700	956.00	1,625,200
アルビス	500	2,185.00	1,092,500
コナカ	2,000	343.00	686,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,675.00	335,000
G - 7ホールディングス	1,800	1,453.00	2,615,400
イオン北海道	2,800	1,077.00	3,015,600
コジマ	2,700	528.00	1,425,600
ヒマラヤ	700	992.00	694,400
コーナン商事	2,300	3,460.00	7,958,000
エコス	600	2,029.00	1,217,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	32,100	1,515.00	48,631,500
西松屋チェーン	3,500	1,486.00	5,201,000
ゼンショーホールディングス	7,900	2,761.00	21,811,900
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,341.00	1,475,100
ハークスレイ	700	461.00	322,700
サイゼリヤ	2,400	2,697.00	6,472,800
V Tホールディングス	6,200	445.00	2,759,000
魚力	400	2,029.00	811,600
フジ・コーポレーション	800	1,161.00	928,800
ユナイテッドアローズ	1,700	1,812.00	3,080,400
ハイデイ日高	2,400	1,676.00	4,022,400
YU - WA Creation Holdi ngs	1,300	202.00	262,600
コロワイド	6,700	1,681.00	11,262,700
ピーシーデポコーポレーション	1,900	286.00	543,400
壱番屋	1,100	4,605.00	5,065,500
P L A N T	400	648.00	259,200
スギホールディングス	3,200	6,660.00	21,312,000
薬王堂ホールディングス	800	2,334.00	1,867,200
スクロール	2,500	889.00	2,222,500
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,743.00	2,614,500
木曽路	2,200	2,181.00	4,798,200
S R Sホールディングス	2,600	790.00	2,054,000

千趣会	2,900	372.00	1,078,800
リテールパートナーズ	1,900	1,173.00	2,228,700
ケーヨー	3,000	858.00	2,574,000
上新電機	1,800	2,077.00	3,738,600
日本瓦斯	7,800	1,640.00	12,792,000
ロイヤルホールディングス	2,900	1,779.00	5,159,100
東天紅	200	948.00	189,600
いなげや	2,000	1,408.00	2,816,000
チヨダ	1,600	761.00	1,217,600
ライフコーポレーション	1,500	3,075.00	4,612,500
リンガーハット	2,100	2,225.00	4,672,500
MrMaxHD	2,000	608.00	1,216,000
AOKIホールディングス	3,200	581.00	1,859,200
オークワ	2,500	917.00	2,292,500
コメリ	2,400	2,669.00	6,405,600
青山商事	3,400	665.00	2,261,000
しまむら	1,900	10,410.00	19,779,000
はせがわ	1,100	296.00	325,600
高島屋	11,700	1,062.00	12,425,400
松屋	3,400	699.00	2,376,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,700	788.00	6,067,600
近鉄百貨店	600	2,621.00	1,572,600
丸井グループ	12,700	2,124.00	26,974,800
アクシアル リテイリング	1,200	3,285.00	3,942,000
イオン	61,700	2,594.50	160,080,650
イズミ	2,900	3,175.00	9,207,500
平和堂	2,900	1,932.00	5,602,800
フジ	1,900	1,878.00	3,568,200
ヤオコー	1,800	6,670.00	12,006,000
ゼビオホールディングス	2,200	896.00	1,971,200
ケーズホールディングス	14,700	1,123.00	16,508,100
Olympicグループ	800	698.00	558,400
日産東京販売ホールディングス	2,300	227.00	522,100
シルバーライフ	400	1,090.00	436,000
Genky DrugStores	700	3,565.00	2,495,500
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,147.00	458,800
ブックオフグループホールディングス	900	1,036.00	932,400
ギフト	300	2,366.00	709,800
アインホールディングス	2,100	5,800.00	12,180,000
元気寿司	500	2,473.00	1,236,500
ヤマダホールディングス	58,400	386.00	22,542,400
アーランドサカモト	2,500	1,544.00	3,860,000

ニトリホールディングス	6,400	16,305.00	104,352,000	
愛眼	1,000	176.00	176,000	
ケーユーホールディングス	800	982.00	785,600	
吉野家ホールディングス	5,700	2,383.00	13,583,100	
松屋フーズホールディングス	800	3,560.00	2,848,000	
サガミホールディングス	2,700	1,056.00	2,851,200	
関西フードマーケット	1,300	1,037.00	1,348,100	
王将フードサービス	1,100	5,860.00	6,446,000	
プレナス	1,800	1,968.00	3,542,400	
ミニストップ	1,400	1,467.00	2,053,800	
アークス	3,000	2,150.00	6,450,000	
パローホールディングス	3,500	2,200.00	7,700,000	
ベルク	700	5,360.00	3,752,000	
大庄	1,100	1,018.00	1,119,800	
ファーストリテイリング	2,100	65,670.00	137,907,000	
サンドラッグ	6,000	2,887.00	17,322,000	
サックスパー ホールディングス	1,600	515.00	824,000	
ヤマザワ	300	1,610.00	483,000	
やまや	300	2,442.00	732,600	
ベルーナ	3,500	732.00	2,562,000	
島根銀行	600	543.00	325,800	
じもとホールディングス	1,300	668.00	868,400	
めぶきフィナンシャルグループ	83,300	258.00	21,491,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,556.00	3,267,600	
九州フィナンシャルグループ	32,700	438.00	14,322,600	
ゆうちょ銀行	37,800	1,126.00	42,562,800	
富山第一銀行	3,700	307.00	1,135,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	91,500	469.00	42,913,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,500	805.00	8,452,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,498.00	2,247,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,600	2,632.00	6,843,200	
ひろぎんホールディングス	23,600	661.00	15,599,600	
おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,180.00	3,270,000	
十六フィナンシャルグループ	2,100	2,261.00	4,748,100	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	2,867.00	4,300,500	
新生銀行	10,500	2,145.00	22,522,500	
あおぞら銀行	9,000	2,658.00	23,922,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,006,900	698.60	703,420,340	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	183,700	491.80	90,343,660	
三井住友トラスト・ホールディングス	30,300	3,963.00	120,078,900	
三井住友フィナンシャルグループ	111,100	4,154.00	461,509,400	代用有価証券 13,000株

千葉銀行	53,500	741.00	39,643,500
群馬銀行	31,000	379.00	11,749,000
武蔵野銀行	2,300	1,837.00	4,225,100
千葉興業銀行	4,000	277.00	1,108,000
筑波銀行	6,800	188.00	1,278,400
七十七銀行	5,000	1,522.00	7,610,000
青森銀行	1,300	1,875.00	2,437,500
秋田銀行	1,000	1,736.00	1,736,000
山形銀行	1,800	963.00	1,733,400
岩手銀行	1,100	1,886.00	2,074,600
東邦銀行	13,600	212.00	2,883,200
東北銀行	800	1,015.00	812,000
みちのく銀行	1,200	856.00	1,027,200
ふくおかフィナンシャルグループ	13,500	2,237.00	30,199,500
静岡銀行	39,000	870.00	33,930,000
スルガ銀行	14,300	484.00	6,921,200
八十二銀行	36,000	417.00	15,012,000
山梨中央銀行	1,800	922.00	1,659,600
大垣共立銀行	3,200	2,026.00	6,483,200
福井銀行	1,400	1,411.00	1,975,400
清水銀行	700	1,603.00	1,122,100
富山銀行	300	1,984.00	595,200
滋賀銀行	3,000	2,195.00	6,585,000
南都銀行	2,500	1,931.00	4,827,500
百五銀行	15,300	351.00	5,370,300
京都銀行	5,700	5,450.00	31,065,000
紀陽銀行	5,400	1,438.00	7,765,200
ほくほくフィナンシャルグループ	10,000	884.00	8,840,000
山陰合同銀行	9,500	644.00	6,118,000
中国銀行	12,700	922.00	11,709,400
鳥取銀行	500	1,177.00	588,500
伊予銀行	21,000	586.00	12,306,000
百十四銀行	1,800	1,596.00	2,872,800
四国銀行	2,400	796.00	1,910,400
阿波銀行	2,400	2,264.00	5,433,600
大分銀行	1,000	1,927.00	1,927,000
宮崎銀行	1,000	2,114.00	2,114,000
佐賀銀行	900	1,494.00	1,344,600
琉球銀行	3,400	794.00	2,699,600
セブン銀行	47,900	245.00	11,735,500
みずほフィナンシャルグループ	205,300	1,560.00	320,268,000
高知銀行	600	764.00	458,400

山口フィナンシャルグループ	18,500	709.00	13,116,500
長野銀行	500	1,229.00	614,500
名古屋銀行	1,200	2,990.00	3,588,000
北洋銀行	24,500	248.00	6,076,000
愛知銀行	600	4,800.00	2,880,000
中京銀行	700	1,640.00	1,148,000
大光銀行	600	1,362.00	817,200
愛媛銀行	2,100	938.00	1,969,800
トマト銀行	500	1,066.00	533,000
京葉銀行	6,700	476.00	3,189,200
栃木銀行	8,200	225.00	1,845,000
北日本銀行	500	1,632.00	816,000
東和銀行	3,100	535.00	1,658,500
福島銀行	2,100	243.00	510,300
大東銀行	700	739.00	517,300
トモニホールディングス	12,400	329.00	4,079,600
フィデアホールディングス	1,500	1,402.00	2,103,000
池田泉州ホールディングス	19,300	186.00	3,589,800
F P G	5,600	755.00	4,228,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,110.00	1,443,000
マーキュリアホールディングス	600	520.00	312,000
S B Iホールディングス	19,800	2,956.00	58,528,800
ジャフコ グループ	6,000	1,789.00	10,734,000
大和証券グループ本社	120,300	692.00	83,247,600
野村ホールディングス	245,300	504.50	123,753,850
岡三証券グループ	12,600	381.00	4,800,600
丸三証券	4,800	525.00	2,520,000
東洋証券	5,300	151.00	800,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,500	403.00	7,455,500
光世証券	400	470.00	188,000
水戸証券	4,000	275.00	1,100,000
いちよし証券	3,100	666.00	2,064,600
松井証券	7,900	810.00	6,399,000
マネックスグループ	13,200	524.00	6,916,800
極東証券	2,100	745.00	1,564,500
岩井コスモホールディングス	1,500	1,368.00	2,052,000
アイザワ証券グループ	2,600	912.00	2,371,200
マネーパートナーズグループ	2,200	218.00	479,600
スパークス・グループ	7,400	256.00	1,894,400
かんぽ生命保険	16,200	1,980.00	32,076,000
S O M P Oホールディングス	26,400	5,322.00	140,500,800
アニコム ホールディングス	5,000	721.00	3,605,000

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	36,000	3,909.00	140,724,000
第一生命ホールディングス	79,100	2,528.00	199,964,800
東京海上ホールディングス	52,900	6,823.00	360,936,700
T & Dホールディングス	41,700	1,689.00	70,431,300
アドバンスクリエイト	800	1,029.00	823,200
全国保証	3,800	5,070.00	19,266,000
あんしん保証	600	284.00	170,400
ジェイリース	600	1,807.00	1,084,200
イントラスト	700	650.00	455,000
日本モーゲージサービス	900	1,083.00	974,700
C a s a	600	840.00	504,000
アルヒ	2,500	1,121.00	2,802,500
プレミアグループ	800	3,635.00	2,908,000
ネットプロテクションズホールディングス	3,600	1,209.00	4,352,400
クレディセゾン	10,300	1,273.00	13,111,900
芙蓉総合リース	1,700	7,580.00	12,886,000
みずほリース	2,500	3,190.00	7,975,000
東京センチュリー	3,100	5,530.00	17,143,000
日本証券金融	6,300	936.00	5,896,800
アイフル	27,100	342.00	9,268,200
リコーリース	1,400	3,755.00	5,257,000
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,188.00	10,454,400
アコム	31,700	308.00	9,763,600
ジャックス	1,800	3,060.00	5,508,000
オリエントコーポレーション	44,300	121.00	5,360,300
オリックス	97,500	2,358.50	229,953,750
三菱HCキャピタル	59,300	591.00	35,046,300
九州リースサービス	900	593.00	533,700
日本取引所グループ	40,600	2,363.50	95,958,100
イー・ギャランティ	2,400	1,861.00	4,466,400
アサックス	800	677.00	541,600
NECキャピタルソリューション	600	2,093.00	1,255,800
いちご	18,200	272.00	4,950,400
日本駐車場開発	18,500	134.00	2,479,000
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,340.00	1,206,000
S R Eホールディングス	400	5,090.00	2,036,000
A Dワークスグループ	4,100	137.00	561,700
ヒューリック	38,400	1,091.00	41,894,400
三栄建築設計	700	1,578.00	1,104,600
野村不動産ホールディングス	8,300	2,654.00	22,028,200
三重交通グループホールディングス	3,500	459.00	1,606,500
サムティ	2,600	2,041.00	5,306,600

ディア・ライフ	2,200	521.00	1,146,200
コーセーアールイー	600	594.00	356,400
地主	1,100	1,714.00	1,885,400
プレサンスコーポレーション	2,100	2,044.00	4,292,400
THEグローバル社	900	177.00	159,300
ハウスコム	300	1,228.00	368,400
日本管理センター	800	974.00	779,200
サンセイランディック	500	812.00	406,000
エストラスト	300	588.00	176,400
フージャースホールディングス	2,100	674.00	1,415,400
オープンハウスグループ	5,100	5,730.00	29,223,000
東急不動産ホールディングス	47,400	625.00	29,625,000
飯田グループホールディングス	13,400	2,326.00	31,168,400
イーランド	300	1,312.00	393,600
ムゲンエステート	1,300	485.00	630,500
ビーロッド	1,200	467.00	560,400
ファーストブラザーズ	400	782.00	312,800
And Doホールディングス	900	829.00	746,100
シーアールイー	500	1,695.00	847,500
プロパティエージェント	200	1,550.00	310,000
ケイアイスター不動産	700	7,030.00	4,921,000
アグレ都市デザイン	300	1,470.00	441,000
グッドコムアセット	800	1,071.00	856,800
ジェイ・エス・ビー	400	2,810.00	1,124,000
テンポイノベーション	500	814.00	407,000
グローバル・リンク・マネジメント	400	823.00	329,200
フェイスネットワーク	200	1,281.00	256,200
パーク24	8,700	1,708.00	14,859,600
パラカ	400	1,583.00	633,200
三井不動産	73,200	2,387.00	174,728,400
三菱地所	105,500	1,634.50	172,439,750
平和不動産	2,800	3,890.00	10,892,000
東京建物	15,900	1,684.00	26,775,600
ダイビル	4,100	2,194.00	8,995,400
京阪神ビルディング	2,500	1,339.00	3,347,500
住友不動産	33,700	3,464.00	116,736,800
テーオーシー	2,800	708.00	1,982,400
東京楽天地	300	3,830.00	1,149,000
スターツコーポレーション	2,200	2,474.00	5,442,800
フジ住宅	2,000	643.00	1,286,000
空港施設	1,700	538.00	914,600
明和地所	800	603.00	482,400

ゴールドクレスト	1,300	1,781.00	2,315,300
エスリード	600	1,685.00	1,011,000
日神グループホールディングス	2,500	490.00	1,225,000
日本エスコン	3,100	760.00	2,356,000
タカラレーベン	7,200	309.00	2,224,800
A V A N T I A	900	830.00	747,000
イオンモール	8,100	1,640.00	13,284,000
毎日コムネット	700	685.00	479,500
ファースト住建	600	1,173.00	703,800
カチタス	4,000	3,400.00	13,600,000
トーセイ	2,300	1,063.00	2,444,900
穴吹興産	400	1,915.00	766,000
サンフロンティア不動産	2,300	1,022.00	2,350,600
F Jネクストホールディングス	1,500	981.00	1,471,500
インテリックス	400	616.00	246,400
ランドビジネス	800	247.00	197,600
サンネクスタグループ	600	1,026.00	615,600
グランディハウス	1,200	498.00	597,600
日本空港ビルデング	6,100	4,955.00	30,225,500
明豊ファシリティワークス	800	792.00	633,600
日本工営	1,000	2,974.00	2,974,000
L I F U L L	4,900	226.00	1,107,400
ミクシィ	3,500	2,141.00	7,493,500
ジェイエシーリクルートメント	1,300	1,971.00	2,562,300
日本M & Aセンターホールディングス	25,500	1,720.00	43,860,000
メンバーズ	500	2,167.00	1,083,500
中広	400	389.00	155,600
UTグループ	2,200	3,270.00	7,194,000
アイティメディア	700	1,597.00	1,117,900
E・Jホールディングス	900	1,166.00	1,049,400
夢真ビーネックスグループ	5,000	1,552.00	7,760,000
コシダカホールディングス	4,300	607.00	2,610,100
アルトナー	300	862.00	258,600
パソナグループ	1,700	2,567.00	4,363,900
C D S	400	1,592.00	636,800
リンクアンドモチベーション	3,600	452.00	1,627,200
エス・エム・エス	5,300	2,993.00	15,862,900
サニーサイドアップグループ	600	714.00	428,400
パーソルホールディングス	15,500	2,913.00	45,151,500
リニカル	1,000	663.00	663,000
クックパッド	5,200	248.00	1,289,600
エスクリ	1,000	328.00	328,000

アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	580.00	464,000
学情	600	962.00	577,200
スタジオアリス	700	2,153.00	1,507,100
シミックホールディングス	900	1,600.00	1,440,000
エプロ	300	732.00	219,600
N J S	300	1,978.00	593,400
総合警備保障	6,200	4,155.00	25,761,000
カカクコム	11,400	2,376.00	27,086,400
アイロムグループ	500	1,494.00	747,000
セントケア・ホールディング	1,000	751.00	751,000
サイネックス	200	584.00	116,800
ルネサンス	1,200	1,040.00	1,248,000
ディップ	2,700	3,365.00	9,085,500
デジタルホールディングス	1,100	1,291.00	1,420,100
新日本科学	1,900	1,230.00	2,337,000
キャリアデザインセンター	400	1,064.00	425,600
ベネフィット・ワン	5,700	3,500.00	19,950,000
エムスリー	27,400	4,392.00	120,340,800
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	277.00	387,800
プラス	300	627.00	188,100
アウトソーシング	9,000	1,321.00	11,889,000
ウェルネット	1,700	434.00	737,800
ワールドホールディングス	600	2,322.00	1,393,200
ディー・エヌ・エー	5,900	1,756.00	10,360,400
博報堂D Yホールディングス	21,600	1,728.00	37,324,800
ぐるなび	2,700	371.00	1,001,700
タカミヤ	2,100	396.00	831,600
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	881.00	969,100
ファンコミュニケーションズ	3,900	378.00	1,474,200
ライク	500	1,775.00	887,500
ビジネス・ブレークスルー	700	418.00	292,600
エスプール	4,400	1,031.00	4,536,400
W D Bホールディングス	700	2,729.00	1,910,300
手間いらず	200	4,305.00	861,000
ティア	900	434.00	390,600
C D G	200	1,368.00	273,600
アドウェイズ	2,400	740.00	1,776,000
バリューコマース	1,200	3,825.00	4,590,000
インフォマート	17,000	665.00	11,305,000
J Pホールディングス	4,200	237.00	995,400
エコナックホールディングス	4,200	86.00	361,200
C Lホールディングス	300	1,157.00	347,100

プレステージ・インターナショナル	5,800	699.00	4,054,200
アミューズ	800	2,038.00	1,630,400
ドリームインキュベータ	500	1,970.00	985,000
クイック	1,000	1,535.00	1,535,000
T A C	800	215.00	172,000
電通グループ	16,000	4,015.00	64,240,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	976.00	780,800
ぴあ	600	3,170.00	1,902,000
イオンファンタジー	600	1,933.00	1,159,800
シーティーエス	1,700	786.00	1,336,200
ネクシィーズグループ	600	674.00	404,400
H . U . グループホールディングス	4,100	2,910.00	11,931,000
アルプス技研	1,300	1,774.00	2,306,200
日本空調サービス	1,600	766.00	1,225,600
オリエンタルランド	18,400	19,955.00	367,172,000
ダスキン	3,500	2,749.00	9,621,500
明光ネットワークジャパン	1,900	561.00	1,065,900
ファルコホールディングス	800	2,004.00	1,603,200
秀英予備校	200	420.00	84,000
ラウンドワン	4,400	1,343.00	5,909,200
リゾートトラスト	7,100	1,814.00	12,879,400
ビー・エム・エル	2,000	3,580.00	7,160,000
りらいあコミュニケーションズ	2,300	978.00	2,249,400
リソー教育	7,300	413.00	3,014,900
早稲田アカデミー	900	995.00	895,500
ユー・エス・エス	17,400	1,892.00	32,920,800
東京個別指導学院	1,500	599.00	898,500
サイバーエージェント	38,300	1,391.00	53,275,300
楽天グループ	80,000	975.00	78,000,000
クリーク・アンド・リバー社	800	1,829.00	1,463,200
モーニングスター	2,800	590.00	1,652,000
テー・オー・ダブリュ	2,800	296.00	828,800
山田コンサルティンググループ	800	1,080.00	864,000
セントラルスポーツ	600	2,398.00	1,438,800
フルキャストホールディングス	1,300	2,141.00	2,783,300
エン・ジャパン	2,500	2,771.00	6,927,500
リソルホールディングス	200	4,310.00	862,000
テクノプロ・ホールディングス	9,300	2,954.00	27,472,200
アトラグループ	500	252.00	126,000
インターワークス	600	394.00	236,400
アイ・アールジャパンホールディングス	700	5,010.00	3,507,000
K e e P e r 技研	1,000	1,898.00	1,898,000

ファーストロジック	300	740.00	222,000
三機サービス	300	962.00	288,600
Gunosy	900	736.00	662,400
デザインワン・ジャパン	600	189.00	113,400
イー・ガーディアン	700	2,825.00	1,977,500
リブセンス	1,200	170.00	204,000
ジャパンマテリアル	4,800	1,680.00	8,064,000
ベクトル	2,200	993.00	2,184,600
ウチヤマホールディングス	900	311.00	279,900
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,186.00	1,423,200
キャリアリンク	600	1,662.00	997,200
I B J	1,300	745.00	968,500
アサンテ	700	1,620.00	1,134,000
バリューHR	700	2,377.00	1,663,900
M & Aキャピタルパートナーズ	1,300	4,650.00	6,045,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,512.00	907,200
E R Iホールディングス	500	1,170.00	585,000
アビスト	200	2,895.00	579,000
シグマクシス・ホールディングス	1,000	2,190.00	2,190,000
ウィルグループ	1,200	1,236.00	1,483,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	181.00	452,500
メドピア	1,200	2,947.00	3,536,400
レアジョブ	300	761.00	228,300
リクルートホールディングス	120,000	5,650.00	678,000,000
エラン	2,100	1,008.00	2,116,800
土木管理総合試験所	900	318.00	286,200
ネットマーケティング	800	437.00	349,600
日本郵政	203,100	975.70	198,164,670
ベルシステム24ホールディングス	2,300	1,382.00	3,178,600
鎌倉新書	1,800	523.00	941,400
S M N	400	572.00	228,800
一蔵	300	390.00	117,000
グローバルキッズCOMPANY	300	794.00	238,200
エアトリ	1,000	2,735.00	2,735,000
アトラエ	1,100	2,038.00	2,241,800
ストライク	600	4,195.00	2,517,000
ソラスト	3,800	1,036.00	3,936,800
セラク	500	1,199.00	599,500
インソース	1,500	1,923.00	2,884,500
ベйкаレント・コンサルティング	1,100	43,900.00	48,290,000
Orchestra Holdings	300	2,755.00	826,500
アイモバイル	500	1,132.00	566,000

キャリアインデックス	500	735.00	367,500
MS - J a p a n	700	862.00	603,400
船場	400	736.00	294,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,900	1,625.00	7,962,500
フルテック	300	1,315.00	394,500
ツナググループ・ホールディングス	500	253.00	126,500
GameWith	600	429.00	257,400
ソウルドアウト	400	980.00	392,000
MS&Consulting	300	677.00	203,100
ウェルビー	1,000	1,225.00	1,225,000
エル・ティー・エス	200	2,368.00	473,600
ミダックホールディングス	700	2,550.00	1,785,000
日総工産	1,200	768.00	921,600
キュービーネットホールディングス	800	1,658.00	1,326,400
RPAホールディングス	2,300	340.00	782,000
スプリックス	500	1,486.00	743,000
マネジメントソリューションズ	800	3,110.00	2,488,000
プロレド・パートナーズ	400	831.00	332,400
and factory	500	360.00	180,000
テノ・ホールディングス	200	605.00	121,000
フロンティア・マネジメント	400	653.00	261,200
ピアラ	300	549.00	164,700
コプロ・ホールディングス	300	1,113.00	333,900
ギークス	300	1,391.00	417,300
カーブスホールディングス	4,400	685.00	3,014,000
フォーラムエンジニアリング	1,000	843.00	843,000
Fast Fitness Japan	200	2,111.00	422,200
ダイレクトマーケティングミックス	1,800	1,444.00	2,599,200
ポピンズホールディングス	400	2,552.00	1,020,800
LITALICO	1,300	3,030.00	3,939,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	727.00	581,600
リログループ	8,500	2,036.00	17,306,000
東祥	1,200	1,450.00	1,740,000
TREホールディングス	2,200	1,461.00	3,214,200
人・夢・技術グループ	700	1,772.00	1,240,400
エイチ・アイ・エス	3,500	1,847.00	6,464,500
ラックランド	500	2,820.00	1,410,000
共立メンテナンス	2,800	3,975.00	11,130,000
イチネンホールディングス	1,600	1,256.00	2,009,600
建設技術研究所	900	2,333.00	2,099,700
スペース	1,100	872.00	959,200
燦ホールディングス	600	1,541.00	924,600

スバル興業	100	7,910.00	791,000	
東京テアトル	800	1,216.00	972,800	
タナベ経営	500	630.00	315,000	
ナガワ	500	9,510.00	4,755,000	
東京都競馬	1,200	4,225.00	5,070,000	
常磐興産	800	1,338.00	1,070,400	
カナモト	2,800	2,213.00	6,196,400	
西尾レントオール	1,400	2,779.00	3,890,600	
アゴーラ ホスピタリティグループ	12,800	21.00	268,800	
トランス・コスモス	2,000	3,115.00	6,230,000	
乃村工藝社	6,700	906.00	6,070,200	
藤田観光	800	2,312.00	1,849,600	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,352.00	1,352,000	
日本管財	1,600	2,814.00	4,502,400	
トーカイ	1,300	1,797.00	2,336,100	
セコム	15,300	8,062.00	123,348,600	
セントラル警備保障	800	2,296.00	1,836,800	
丹青社	3,200	714.00	2,284,800	
メイテック	1,900	6,590.00	12,521,000	
応用地質	1,800	2,109.00	3,796,200	
船井総研ホールディングス	3,200	2,449.00	7,836,800	
進学会ホールディングス	500	306.00	153,000	
オオバ	1,100	724.00	796,400	
いであ	400	1,702.00	680,800	
学究社	500	1,514.00	757,000	
ベネッセホールディングス	5,200	2,240.00	11,648,000	
イオンディライト	1,900	3,090.00	5,871,000	
ナック	700	969.00	678,300	
ダイセキ	2,800	4,480.00	12,544,000	
ステップ	500	1,795.00	897,500	
合計	17,719,100		42,196,845,440	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年 2月28日現在です。

【財形株投（一般財形30）】

【純資産額計算書】

資産総額	103,726,572円
負債総額	132,136円
純資産総額(-)	103,594,436円
発行済口数	100,802,297口
1口当たり純資産額(/)	1.0277円

【財形株投（一般財形50）】

【純資産額計算書】

資産総額	191,392,746円
負債総額	235,030円
純資産総額(-)	191,157,716円
発行済口数	165,802,882口
1口当たり純資産額(/)	1.1529円

【財形株投（年金・住宅財形30）】

【純資産額計算書】

資産総額	238,590,023円
負債総額	286,489円
純資産総額(-)	238,303,534円
発行済口数	231,357,209口
1口当たり純資産額(/)	1.0300円

(参考)

財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	326,937,191円
負債総額	10円
純資産総額（ - ）	326,937,181円
発行済口数	256,654,368口
1口当たり純資産額（ / ）	1.274円

インデックス マザーファンド TOPIX

純資産額計算書

資産総額	42,310,208,141円
負債総額	63,321,567円
純資産総額（ - ）	42,246,886,574円
発行済口数	16,958,594,493口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4912円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2022年2月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2022年2月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2022年2月末現在）

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

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	881	241,565
株式投資信託	814	206,378
単位型	305	10,971
追加型	509	195,407
公社債投資信託	67	35,186
単位型	54	1,984
追加型	13	33,202

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

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

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

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

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

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

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(貸借対照表関係)

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

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

（変動事由の概要）

2019年8月13日の取締役会決議による自己株式の取得 88,800株

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(変動事由の概要)

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

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

に含まれております。

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

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

(関連当事者情報)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

第63期中間会計期間
(2021年9月30日)

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

負債合計

26,960

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

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

自己株式 2,067

株主資本合計 86,798

評価・換算差額等

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他	繰延ヘッジ	評価・換算	

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

注記事項

(重要な会計方針)

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

4 収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行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)

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

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

(2) 通貨関連

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

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

（持分法損益等）

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

（収益認識関係）

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

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

（ストックオプション等関係）

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

〔関連情報〕

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

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

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

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

定めるものを除きます。)。

- (3) 通常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
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円 (2021年3月末現在)

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

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 4月30日	有価証券届出書
2021年 4月30日	有価証券報告書
2021年11月 1日	有価証券届出書
2021年11月 1日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2021年6月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士 貞 廣 篤 典

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 竹 内 知 明

業務執行社員

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年3月9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」に掲げられている財形株投（一般財形30）の2021年2月2日から2022年2月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形30）の2022年2月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年3月9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」に掲げられている財形株投（一般財形50）の2021年2月2日から2022年2月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形50）の2022年2月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年3月9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」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2021年2月2日から2022年2月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（年金・住宅財形30）の2022年2月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月3日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。