

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月13日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスファンドTSP
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

インデックスファンドTSP（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2022年5月14日から2022年11月14日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

わが国の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。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々	中南米		
不動産投信			ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

・主として、「インデックス マザーファンド TOPIX」への投資を通じて、わが国の金融商品取引所に上場されている株式*1に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

*1 TOPIX（東証株価指数）を構成する上場株式となります。

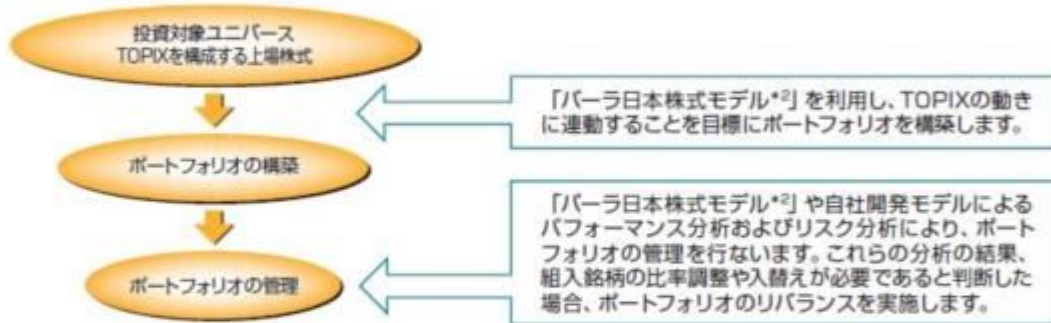
・中長期にわたって保有することで、日本経済の成長を享受することが期待できます。

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

2 株式の実質組入比率は高位を保ちます。

株式組入比率（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）は、原則として高位を維持します。したがって、基準価額は大きく変動することがあります。

<「インデックス マザーファンド TOPIX」の運用プロセス>



*2 市場の動きや株価指標、ポートフォリオ固有の特性などからリスク・リターンの分析や管理、ポートフォリオ構築を行なうツールです。

※上記は、2022年2月末現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

なお、当ファンドの基準価額とTOPIX（東証株価指数）の動きのカイ離は、主として株式の配当金、信託報酬の費用負担、組入銘柄の選定に伴う影響などにより生じます。

・TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。

・JPX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。

・JPX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。

・JPX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、JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

・当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

・JPX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。

・JPX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、JPXは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

ファンドの仕組み

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） 株式への実質投資割合には制限を設けません。
外貨建資産への投資は行ないません。

（配分方針） 毎決算時に、利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

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

（2）【ファンドの沿革】

1986年2月13日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

2001年10月26日

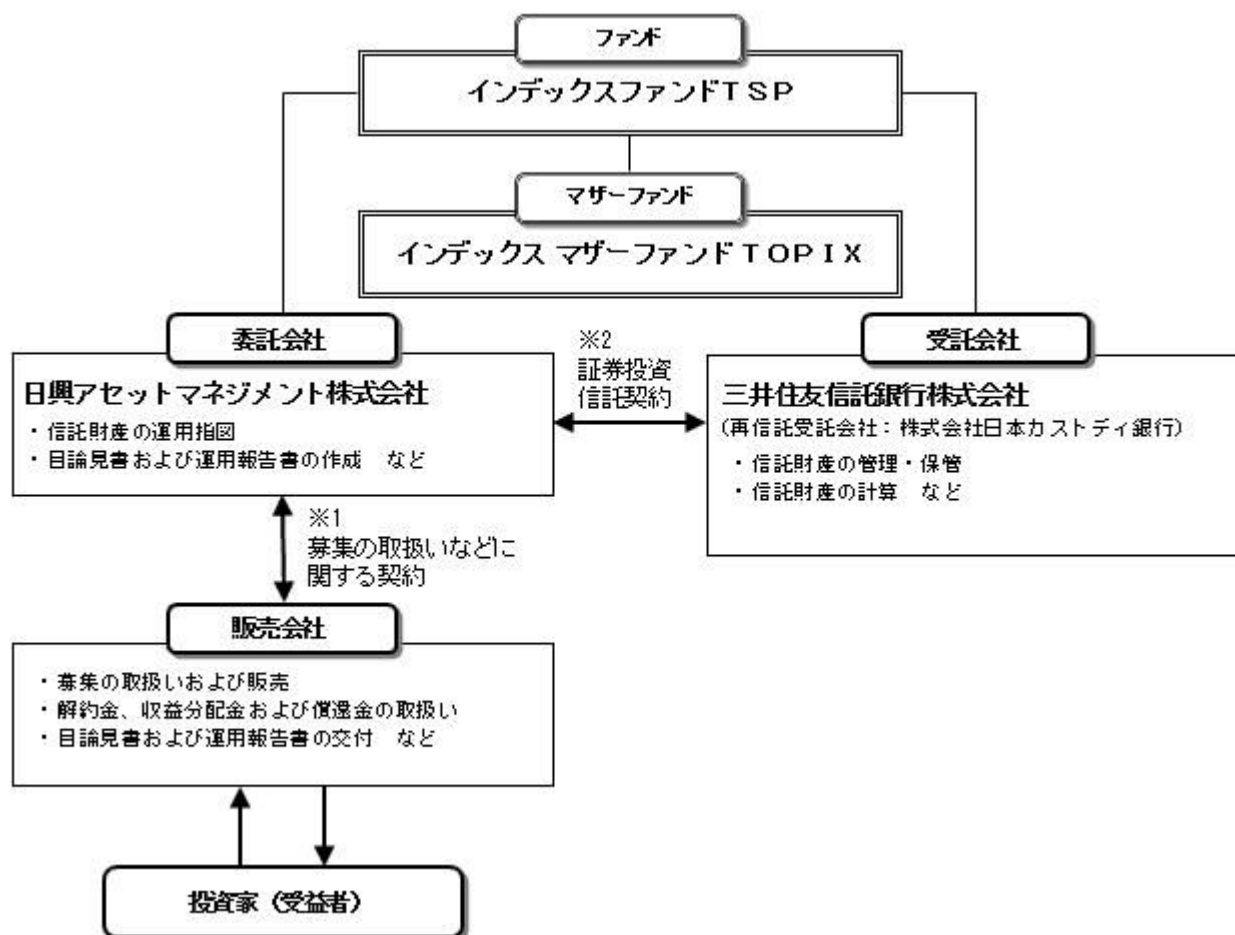
・ファミリーファンド方式の導入

2002年11月13日

・信託期間を無期限に変更

(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】

- ・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券に投資を行なうとともに、わが国の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざします。
- ・投資成果をT O P I X（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、株式（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）への投資にあたっては、「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ないます。
 - 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ないます。
 - 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ないます。
 - 株式の組入比率は、高位を保ちます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

<インデックスファンドT S P >

「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20条の2および第20条の6に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として「インデックス マザーファンド T O P I X」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、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、マザーファンドの受益証券を除きます。）
 - 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
- 5) 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せん。）
- 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せん。）
- 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

投資対象とするマザーファンドの概要

<インデックス マザーファンド T O P I X >

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、T O P I X（東証株価指数）*の動きに連動する投資成果をめざします。
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。

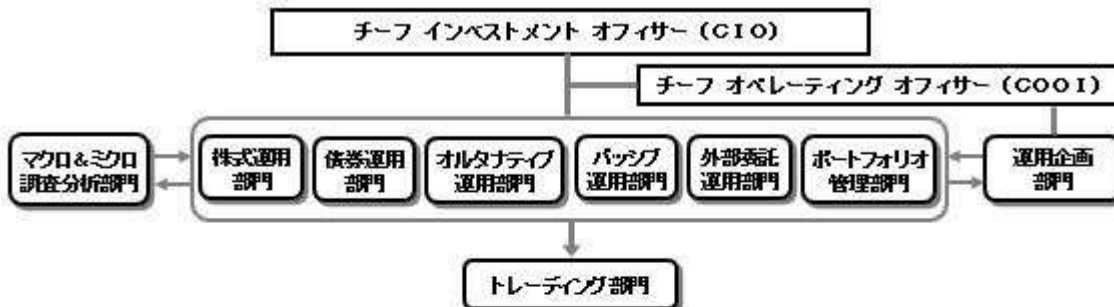
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行います。 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 資金の流入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行いません。 株式の組入比率は、高位を保ちます。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運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。

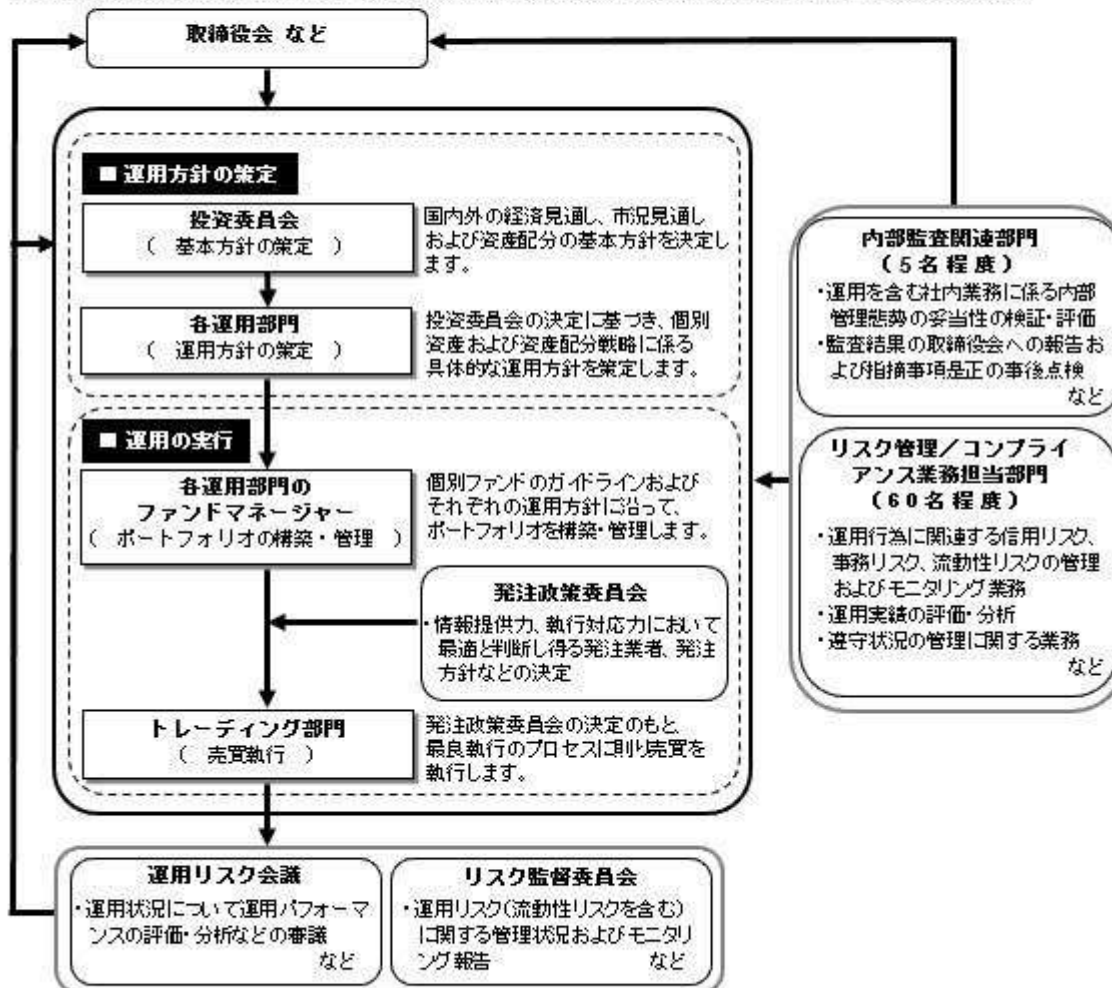
T O P I Xの指数値およびT O P I Xに係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ 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。



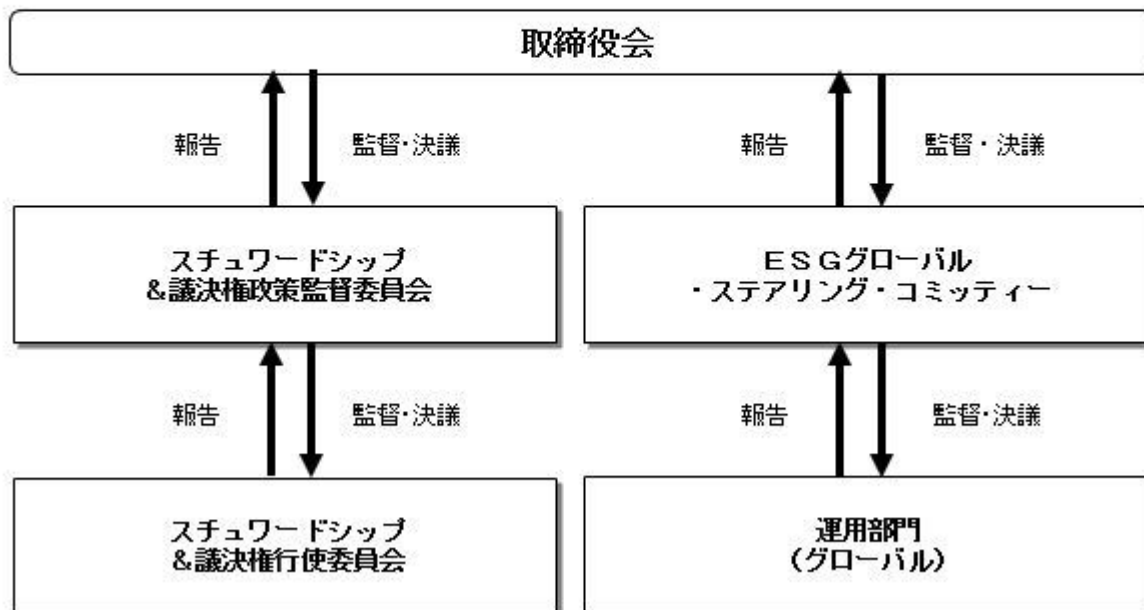
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「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

<分配金再投資コース>

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。

<分配金受取りコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスファンドTSP>

1) 株式への実質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て、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（マザーファンドの受益証券を除きます。）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) 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
- 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ます。）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
- 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17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17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 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。
- 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の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 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、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含み

ます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

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

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

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

11) 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。

12) 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、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。

- 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の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 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す。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

- ・ 一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

< T O P I X (東証株価指数) と基準価額の主な乖離要因 >

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

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

< 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。

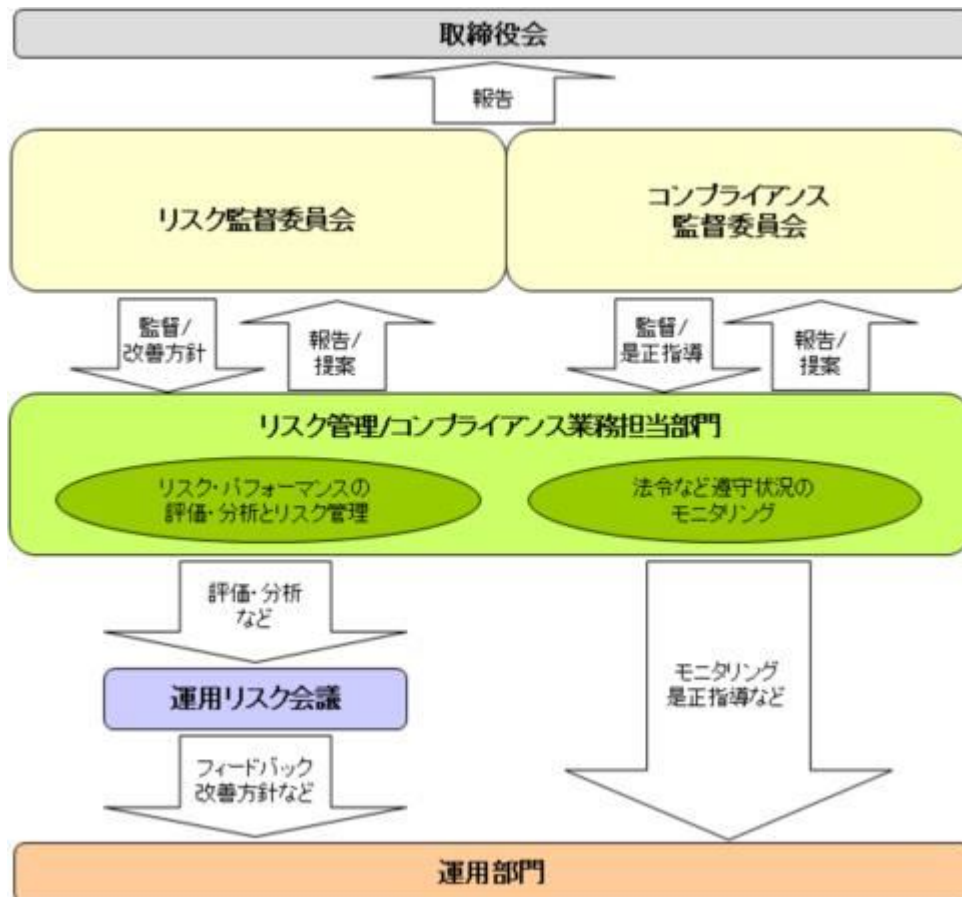
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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やインデックスと基準価額が乖離する可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2022年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)

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	9.6%	10.3%	17.1%	13.2%	0.1%	3.6%	3.8%
最大値	41.4%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-16.5%	-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。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。
 - ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
 - ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
 - ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- 申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

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%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

販売会社毎の純資産総額	信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
1,000億円以下の部分	0.52%	0.22%	0.20%	0.10%
1,000億円超の部分		0.17%	0.25%	

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

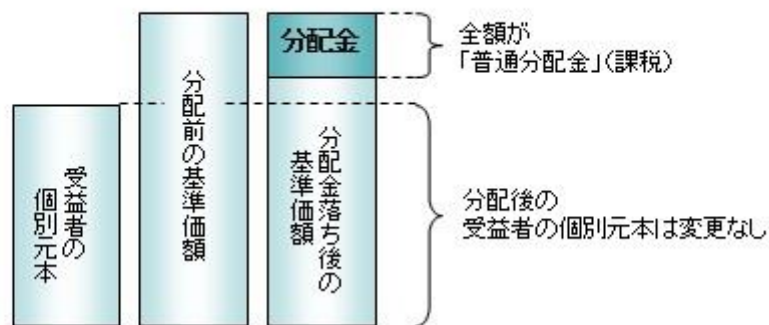
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

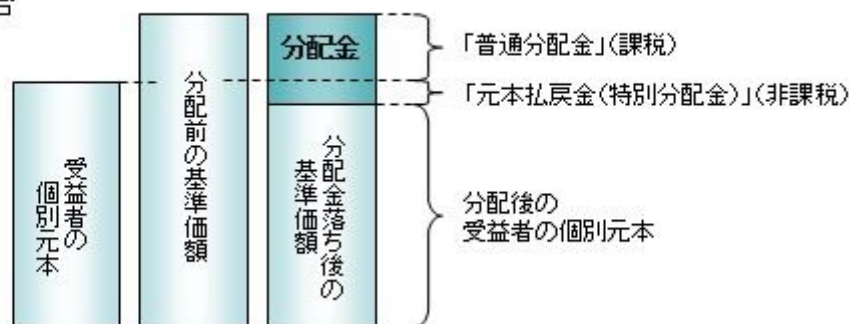
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2022年5月13日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスファンドTSP】

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	21,441,331,156	98.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		222,110,728	1.03
合計（純資産総額）		21,663,441,884	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	283,650,000	1.31

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	8,606,828,499	2.5478	21,928,477,650	2.4912	21,441,331,156	98.97

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.97
合計	98.97

【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	15	日本円	287,198,300	283,650,000	1.31

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第27計算期間末 (2013年 2月12日)	25,203	25,608	0.4980	0.5060
第28計算期間末 (2014年 2月12日)	26,006	26,338	0.6275	0.6355
第29計算期間末 (2015年 2月12日)	27,404	27,771	0.7464	0.7564
第30計算期間末 (2016年 2月12日)	20,550	20,885	0.6143	0.6243
第31計算期間末 (2017年 2月13日)	24,644	24,951	0.8013	0.8113
第32計算期間末 (2018年 2月13日)	23,554	23,873	0.8864	0.8984
第33計算期間末 (2019年 2月12日)	21,725	22,046	0.8132	0.8252
第34計算期間末 (2020年 2月12日)	21,993	22,338	0.8920	0.9060
第35計算期間末 (2021年 2月12日)	22,391	22,792	1.0041	1.0221
第36計算期間末 (2022年 2月14日)	21,932	22,238	1.0039	1.0179
2021年 2月末日	21,708		0.9684	
3月末日	22,964		1.0231	
4月末日	22,232		0.9937	
5月末日	22,539		1.0068	
6月末日	22,791		1.0182	
7月末日	22,390		0.9955	
8月末日	23,068		1.0264	
9月末日	23,514		1.0706	
10月末日	23,201		1.0549	
11月末日	22,233		1.0159	
12月末日	22,929		1.0510	
2022年 1月末日	21,856		0.9998	
2月末日	21,663		0.9813	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	0.0080
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	0.0080
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	0.0100
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	0.0100
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	0.0100
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	0.0120
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	0.0120
第34期	2019年 2月13日～2020年 2月12日	0.0140
第35期	2020年 2月13日～2021年 2月12日	0.0180
第36期	2021年 2月13日～2022年 2月14日	0.0140

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	26.15
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	27.61
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	20.54
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	16.36
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	32.07
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	12.12
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	6.90
第34期	2019年 2月13日～2020年 2月12日	11.41
第35期	2020年 2月13日～2021年 2月12日	14.59
第36期	2021年 2月13日～2022年 2月14日	1.37

(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27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	9,449,720,873	10,636,174,809
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	13,799,258,867	22,968,753,955
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	6,408,687,971	11,137,684,985
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	6,211,940,096	9,472,751,226
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	3,331,269,772	6,027,353,049
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	6,031,038,498	10,213,544,441
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	3,915,213,807	3,773,318,387
第34期	2019年 2月13日～2020年 2月12日	2,511,981,095	4,570,922,254
第35期	2020年 2月13日～2021年 2月12日	2,282,429,644	4,640,604,376
第36期	2021年 2月13日～2022年 2月14日	2,597,004,935	3,047,488,976

（参考）

インデックス マザーファンド T O P I X

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



基準価額……………9,813円

純資産総額……………216.63億円

※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点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

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
120円	120円	140円	180円	140円	4,880円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	100.3%
うち先物	1.6%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	1.3%
外貨建資産	0.0%

※当ファンドの実質組入比率です。

<株式組入上位5業種>

	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	輸送用機器	8.5%
3	情報・通信業	8.1%
4	化学	6.6%
5	サービス業	5.7%

※マザーファンドの対組入株式時価総額比です。

<株式組入上位10銘柄> (銘柄数:2,120銘柄)

	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%
6	東京エレクトロン	電気機器	1.37%
7	日本電信電話	情報・通信業	1.31%
8	任天堂	その他製品	1.26%
9	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.17%
10	信越化学工業	化学	1.15%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
 ※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。
 ※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 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に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(6) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(7) 申込代金の支払い

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

(8) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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。

(9) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(10) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額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。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

<買取請求による換金>

(1) 買取りの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 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。

(4) 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。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(6) 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、販売会社にお問い合わせください。

(7) 受付の中止および取消

- ・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
- ・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただ

し、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

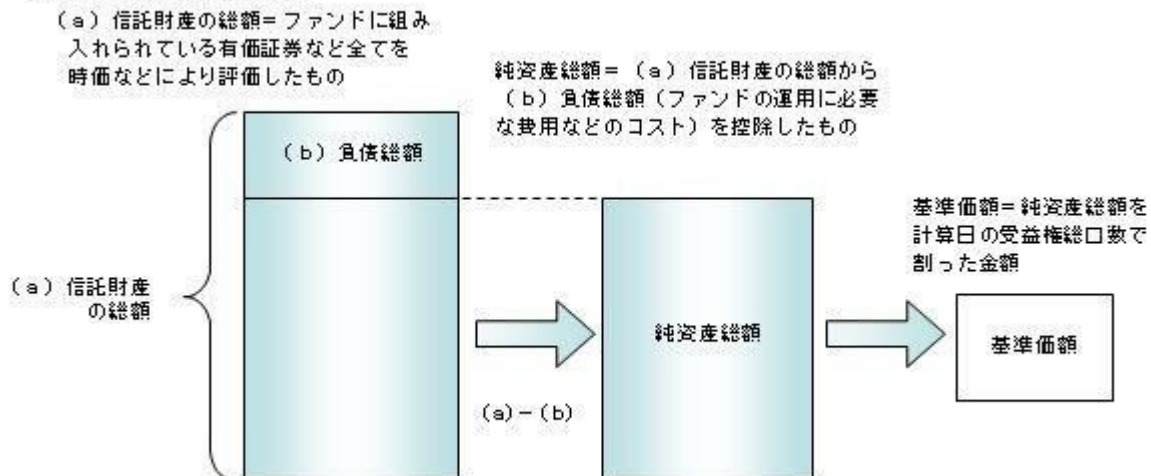
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

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。

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（1986年2月13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13日から翌年2月12日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回る事となった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) 対象インデックスが改廃の場合
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

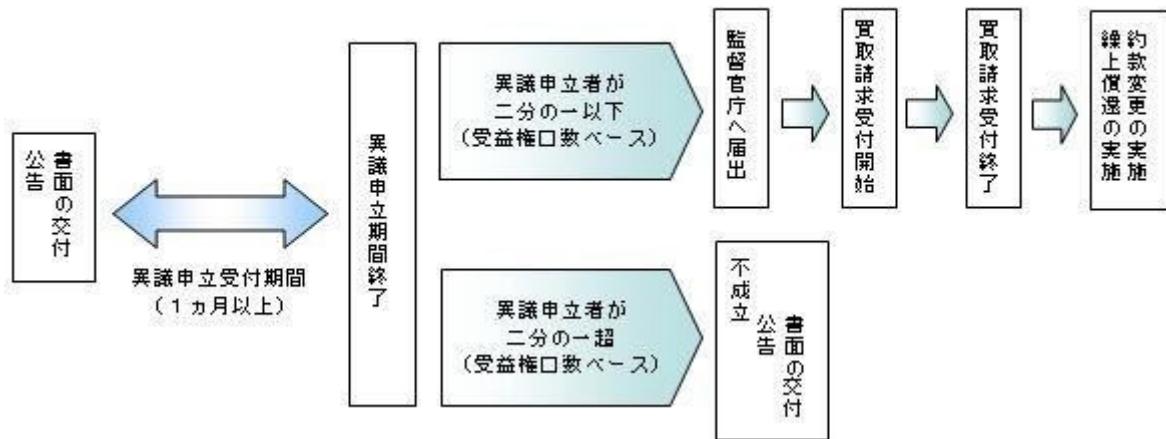
信託約款の変更

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期計算期間(2021年2月13日から2022年2月14日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスファンドTSP】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第35期 2021年 2月12日現在	第36期 2022年 2月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	232,249,414	522,833,701
親投資信託受益証券	22,175,677,856	21,777,460,360
派生商品評価勘定	5,185,150	4,324,500
未収入金	458,979,500	9,000,000
差入委託証拠金	30,240,000	19,800,000
流動資産合計	22,902,331,920	22,333,418,561
資産合計	22,902,331,920	22,333,418,561
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	6,195,500
前受金	7,040,000	4,255,000
未払金	-	2,189,400
未払収益分配金	401,375,135	305,873,884
未払解約金	41,002,048	14,596,948
未払受託者報酬	11,796,375	12,915,040
未払委託者報酬	49,545,017	54,243,427
未払利息	13	135
その他未払費用	471,797	516,540
流動負債合計	511,230,385	400,785,874
負債合計	511,230,385	400,785,874
純資産の部		
元本等		
元本	22,298,618,653	21,848,134,612
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,482,882	84,498,075
（分配準備積立金）	6,350,289,348	5,569,914,005
元本等合計	22,391,101,535	21,932,632,687
純資産合計	22,391,101,535	21,932,632,687
負債純資産合計	22,902,331,920	22,333,418,561

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第35期		第36期	
	自 2020年 2月13日	至 2021年 2月12日	自 2021年 2月13日	至 2022年 2月14日
営業収益				
受取利息		411		62
有価証券売買等損益		3,014,204,481		470,782,504
派生商品取引等損益		67,039,900		20,586,550
営業収益合計		3,081,244,792		491,369,116
営業費用				
支払利息		97,174		45,232
受託者報酬		22,484,902		25,269,982
委託者報酬		94,437,118		106,134,436
その他費用		899,455		1,010,682
営業費用合計		117,918,649		132,460,332
営業利益又は営業損失()		2,963,326,143		358,908,784
経常利益又は経常損失()		2,963,326,143		358,908,784
当期純利益又は当期純損失()		2,963,326,143		358,908,784
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()		76,078,865		99,542,011
期首剰余金又は期首欠損金()		2,663,548,549		92,482,882
剰余金増加額又は欠損金減少額		529,102,001		52,852,165
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		529,102,001		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		52,852,165
剰余金減少額又は欠損金増加額		411,100,443		14,329,861
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		14,329,861
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		411,100,443		-
分配金		401,375,135		305,873,884
期末剰余金又は期末欠損金()		92,482,882		84,498,075

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月13日から翌年2月12日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年 2月13日から2022年 2月14日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

		第35期 2021年 2月12日現在	第36期 2022年 2月14日現在
1.	期首元本額	24,656,793,385円	22,298,618,653円
	期中追加設定元本額	2,282,429,644円	2,597,004,935円
	期中一部解約元本額	4,640,604,376円	3,047,488,976円
2.	受益権の総数	22,298,618,653口	21,848,134,612口

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第35期 自 2020年 2月13日 至 2021年 2月12日		第36期 自 2021年 2月13日 至 2022年 2月14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	415,990,332円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 339,145,942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	2,623,414,676円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	11,903,034,125円	C 信託約款に定める収益調整金 12,353,155,678円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	3,712,259,475円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 5,536,641,947円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	18,654,698,608円	E 分配対象収益（A+B+C+D） 18,228,943,567円
F	分配対象収益(1万口当たり)	8,365円	F 分配対象収益(1万口当たり) 8,343円
G	分配金額	401,375,135円	G 分配金額 305,873,884円
H	分配金額(1万口当たり)	180円	H 分配金額(1万口当たり) 140円

（ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の状況に関する事項

	第35期 自 2020年 2月13日 至 2021年 2月12日	第36期 自 2021年 2月13日 至 2022年 2月14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35期 2021年 2月12日現在	第36期 2022年 2月14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 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第35期(2021年2月12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	3,094,174,089
合計	3,094,174,089

第36期(2022年2月14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	362,915,193
合計	362,915,193

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

第35期(2021年2月12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	515,360,000	-	520,560,000	5,200,000
合計		515,360,000	-	520,560,000	5,200,000

第36期(2022年2月14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	388,260,000	-	386,400,000	1,860,000
合計		388,260,000	-	386,400,000	1,860,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第35期 2021年 2月12日現在		第36期 2022年 2月14日現在	
1口当たり純資産額	1.0041円	1口当たり純資産額	1.0039円
(1万口当たり純資産額)	(10,041円)	(1万口当たり純資産額)	(10,039円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド TOPIX	8,546,883,972	21,777,460,360	
合計		8,546,883,972	21,777,460,360	

(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

「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。

当ファンドは、「インデックス マザーファンド T O P I X」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

インデックス マザーファンド T O P I X

貸借対照表

（単位：円）		
	2021年 2月12日現在	2022年 2月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	555,781,535	71,698,342
株式	42,868,520,230	42,965,078,130
派生商品評価勘定	9,644,700	-
未収入金	367,182	377,285
未収配当金	57,448,280	64,838,067
前払金	-	1,440,000
流動資産合計	43,491,761,927	43,103,431,824
資産合計	43,491,761,927	43,103,431,824
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,483,300
前受金	9,288,000	-
未払解約金	512,971,194	30,132,506
未払利息	32	18
流動負債合計	522,259,226	33,615,824
負債合計	522,259,226	33,615,824
純資産の部		
元本等		
元本	17,193,201,813	16,903,182,316
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	25,776,300,888	26,166,633,684
元本等合計	42,969,502,701	43,069,816,000
純資産合計	42,969,502,701	43,069,816,000
負債純資産合計	43,491,761,927	43,103,431,824

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</p> <p>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</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 2月12日現在	2022年 2月14日現在
1.	期首	2020年 2月13日	2021年 2月13日
	期首元本額	18,664,275,035円	17,193,201,813円
	期首からの追加設定元本額	2,076,202,654円	1,926,950,157円
	期首からの一部解約元本額	3,547,275,876円	2,216,969,654円
	元本の内訳		
	インデックスファンドTSP	8,873,110,538円	8,546,883,972円
	財形株投（一般財形30）	14,240,080円	12,793,178円
	財形株投（一般財形50）	40,116,367円	37,947,934円
	財形株投（年金・住宅財形30）	27,122,417円	27,459,296円
	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	7,692,572,923円	7,752,005,779円
	TOPIXインデックスファンド（個人型年金向け）	457,323,608円	486,087,664円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	25,135,591円	24,570,449円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	12,932,357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	17,193,201,813円	16,903,182,316円
2.	受益権の総数	17,193,201,813口	16,903,182,316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	293,172,000円	506,809,000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13日 至 2021年 2月12日	自 2021年 2月13日 至 2022年 2月14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12日現在	2022年 2月14日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
-------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

(2021年 2月12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	4,803,274,347
合計	4,803,274,347

(2022年 2月14日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,581,689
合計	6,581,689

(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12日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	106,032,000	-	115,680,000	9,648,000
合計		106,032,000	-	115,680,000	9,648,000

(2022年 2月14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	-	115,920,000	3,480,000
合計		119,400,000	-	115,920,000	3,480,000

（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12日現在		2022年 2月14日現在	
1口当たり純資産額	2.4992円	1口当たり純資産額	2.5480円
(1万口当たり純資産額)	(24,992円)	(1万口当たり純資産額)	(25,480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	3,235.00	2,588,000	
日本水産	22,300	554.00	12,354,200	
マルハニチロ	3,500	2,633.00	9,215,500	
雪国まいたけ	1,700	1,247.00	2,119,900	
カネコ種苗	600	1,565.00	939,000	
サカタのタネ	2,600	3,395.00	8,827,000	
ホクト	1,900	1,974.00	3,750,600	
ホクリヨウ	400	687.00	274,800	

住石ホールディングス	4,800	140.00	672,000
日鉄鉱業	500	6,410.00	3,205,000
三井松島ホールディングス	1,000	1,799.00	1,799,000
I N P E X	88,800	1,218.00	108,158,400
石油資源開発	2,600	2,934.00	7,628,400
K & O エナジーグループ	1,000	1,571.00	1,571,000
ヒノキヤグループ	500	2,396.00	1,198,000
ショーボンドホールディングス	3,200	5,110.00	16,352,000
ミライト・ホールディングス	7,100	1,931.00	13,710,100
タマホーム	1,400	2,408.00	3,371,200
サンヨーホームズ	300	750.00	225,000
日本アクア	1,000	561.00	561,000
ファーストコーポレーション	500	722.00	361,000
ベステラ	500	1,281.00	640,500
キャンディル	500	495.00	247,500
ダイセキ環境ソリューション	400	1,125.00	450,000
第一カッター興業	600	1,377.00	826,200
安藤・間	11,100	898.00	9,967,800
東急建設	6,700	725.00	4,857,500
コムシスホールディングス	7,100	2,751.00	19,532,100
ビーアールホールディングス	3,100	354.00	1,097,400
高松コンストラクショングループ	1,400	2,009.00	2,812,600
東建コーポレーション	600	9,170.00	5,502,000
ソネック	300	1,011.00	303,300
ヤマウラ	1,200	995.00	1,194,000
大成建設	14,800	3,830.00	56,684,000
大林組	51,000	974.00	49,674,000
清水建設	47,900	791.00	37,888,900
飛鳥建設	1,400	1,093.00	1,530,200
長谷工コーポレーション	15,200	1,527.00	23,210,400
松井建設	2,000	748.00	1,496,000
銭高組	200	4,105.00	821,000
鹿島建設	37,400	1,548.00	57,895,200
不動テトラ	1,100	1,543.00	1,697,300
大末建設	600	1,345.00	807,000
鉄建建設	1,100	1,882.00	2,070,200
西松建設	3,100	3,830.00	11,873,000
三井住友建設	11,900	442.00	5,259,800
大豊建設	800	3,655.00	2,924,000
ナカノフドー建設	1,200	341.00	409,200
奥村組	3,000	3,255.00	9,765,000
東鉄工業	2,400	2,470.00	5,928,000

イチケン	300	1,952.00	585,600
富士ピー・エス	700	491.00	343,700
浅沼組	600	5,410.00	3,246,000
戸田建設	21,100	771.00	16,268,100
熊谷組	2,600	3,005.00	7,813,000
北野建設	300	2,176.00	652,800
植木組	400	1,556.00	622,400
矢作建設工業	2,200	777.00	1,709,400
ピーエス三菱	1,700	612.00	1,040,400
日本ハウスホールディングス	3,700	452.00	1,672,400
大東建託	5,200	13,460.00	69,992,000
新日本建設	2,100	763.00	1,602,300
東亜道路工業	300	5,010.00	1,503,000
日本道路	500	9,830.00	4,915,000
東亜建設工業	1,300	2,607.00	3,389,100
日本国土開発	5,000	530.00	2,650,000
若築建設	900	1,900.00	1,710,000
東洋建設	5,700	581.00	3,311,700
五洋建設	20,300	612.00	12,423,600
世紀東急工業	2,500	806.00	2,015,000
福田組	600	4,570.00	2,742,000
住友林業	13,100	2,084.00	27,300,400
日本基礎技術	1,400	677.00	947,800
巴コーポレーション	2,400	501.00	1,202,400
大和ハウス工業	47,100	3,421.00	161,129,100
ライト工業	3,200	1,921.00	6,147,200
積水ハウス	55,300	2,391.50	132,249,950
日特建設	1,000	722.00	722,000
北陸電気工事	1,100	803.00	883,300
ユアテック	2,800	709.00	1,985,200
日本リーテック	1,100	1,478.00	1,625,800
四電工	600	1,594.00	956,400
中電工	2,200	2,164.00	4,760,800
関電工	8,200	876.00	7,183,200
きんでん	11,300	1,643.00	18,565,900
東京エネシス	1,700	973.00	1,654,100
トーエネック	500	3,330.00	1,665,000
住友電設	1,300	2,192.00	2,849,600
日本電設工業	2,800	1,528.00	4,278,400
エクシオグループ	7,600	2,394.00	18,194,400
新日本空調	1,400	2,029.00	2,840,600
九電工	3,900	3,120.00	12,168,000

三機工業	3,300	1,472.00	4,857,600
日揮ホールディングス	15,800	1,123.00	17,743,400
中外炉工業	600	1,566.00	939,600
ヤマト	1,500	705.00	1,057,500
太平電業	1,100	2,759.00	3,034,900
高砂熱学工業	4,600	1,980.00	9,108,000
三晃金属工業	200	2,532.00	506,400
朝日工業社	300	3,075.00	922,500
明星工業	3,300	720.00	2,376,000
大気社	2,500	3,040.00	7,600,000
ダイダン	1,100	2,279.00	2,506,900
日比谷総合設備	1,700	1,889.00	3,211,300
フィル・カンパニー	300	1,158.00	347,400
テスホールディングス	1,100	1,316.00	1,447,600
インフロニア・ホールディングス	21,800	1,058.00	23,064,400
東洋エンジニアリング	2,300	606.00	1,393,800
レイズネクスト	2,300	1,143.00	2,628,900
ニッポン	4,700	1,695.00	7,966,500
日清製粉グループ本社	18,400	1,687.00	31,040,800
日東富士製粉	200	4,250.00	850,000
昭和産業	1,500	2,697.00	4,045,500
鳥越製粉	1,400	657.00	919,800
中部飼料	1,800	1,050.00	1,890,000
フィード・ワン	2,100	706.00	1,482,600
東洋精糖	200	1,113.00	222,600
日本甜菜製糖	800	1,717.00	1,373,600
D M三井製糖ホールディングス	1,400	2,018.00	2,825,200
塩水港精糖	2,200	217.00	477,400
日新製糖	700	1,762.00	1,233,400
森永製菓	3,800	3,680.00	13,984,000
中村屋	400	3,400.00	1,360,000
江崎グリコ	4,500	3,790.00	17,055,000
名糖産業	700	1,676.00	1,173,200
井村屋グループ	1,000	2,317.00	2,317,000
不二家	900	2,282.00	2,053,800
山崎製パン	12,300	1,670.00	20,541,000
第一屋製パン	400	556.00	222,400
モロゾフ	600	2,719.00	1,631,400
亀田製菓	900	4,080.00	3,672,000
寿スピリッツ	1,600	5,830.00	9,328,000
カルビー	7,500	2,496.00	18,720,000
森永乳業	3,000	5,660.00	16,980,000

六甲バター	1,200	1,550.00	1,860,000
ヤクルト本社	12,100	6,060.00	73,326,000
明治ホールディングス	10,800	6,910.00	74,628,000
雪印メグミルク	3,900	1,974.00	7,698,600
プリマハム	2,000	2,402.00	4,804,000
日本ハム	6,200	4,355.00	27,001,000
林兼産業	500	510.00	255,000
丸大食品	1,600	1,558.00	2,492,800
S Foods	1,500	3,270.00	4,905,000
柿安本店	600	2,578.00	1,546,800
伊藤ハム米久ホールディングス	10,200	676.00	6,895,200
サッポロホールディングス	5,600	2,274.00	12,734,400
アサヒグループホールディングス	38,400	4,849.00	186,201,600
キリンホールディングス	60,100	1,898.00	114,069,800
宝ホールディングス	11,100	1,168.00	12,964,800
オエノンホールディングス	4,600	343.00	1,577,800
養命酒製造	400	1,773.00	709,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,500	1,494.00	17,181,000
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,525.00	49,322,500
ダイドーグループホールディングス	900	4,965.00	4,468,500
伊藤園	5,000	6,570.00	32,850,000
キーコーヒー	1,700	2,080.00	3,536,000
ユニカフェ	600	980.00	588,000
ジャパンフーズ	400	1,225.00	490,000
日清オイリオグループ	2,000	2,986.00	5,972,000
不二製油グループ本社	3,500	2,253.00	7,885,500
かどや製油	200	3,880.00	776,000
J - オイルミルズ	1,500	1,714.00	2,571,000
キッコーマン	11,800	8,790.00	103,722,000
味の素	36,100	3,218.00	116,169,800
ブルドックソース	700	2,009.00	1,406,300
キューピー	8,600	2,424.00	20,846,400
ハウス食品グループ本社	6,100	2,970.00	18,117,000
カゴメ	6,200	2,955.00	18,321,000
焼津水産化学工業	700	918.00	642,600
アリアケジャパン	1,500	5,610.00	8,415,000
ピエトロ	200	1,810.00	362,000
エバラ食品工業	300	2,843.00	852,900
やまみ	100	1,776.00	177,600
ニチレイ	7,500	2,664.00	19,980,000
東洋水産	7,900	4,900.00	38,710,000
イトアンドホールディングス	700	2,336.00	1,635,200

大冷	200	1,904.00	380,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	531.00	531,000
日清食品ホールディングス	6,400	8,960.00	57,344,000
永谷園ホールディングス	800	1,967.00	1,573,600
一正蒲鉾	700	772.00	540,400
フジッコ	1,500	1,955.00	2,932,500
ロック・フィールド	1,800	1,573.00	2,831,400
日本たばこ産業	87,600	2,347.50	205,641,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,448.00	1,448,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,861.00	2,047,100
なとり	900	2,056.00	1,850,400
イフジ産業	300	927.00	278,100
ピクルスコーポレーション	800	1,579.00	1,263,200
ファーマフーズ	1,600	1,656.00	2,649,600
ユーグレナ	8,400	776.00	6,518,400
紀文食品	1,000	982.00	982,000
ミヨシ油脂	600	1,128.00	676,800
理研ビタミン	1,700	1,743.00	2,963,100
片倉工業	1,800	2,320.00	4,176,000
ゲンゼ	1,100	3,835.00	4,218,500
東洋紡	6,300	1,280.00	8,064,000
ユニチカ	4,700	311.00	1,461,700
富士紡ホールディングス	700	3,755.00	2,628,500
倉敷紡績	1,300	1,936.00	2,516,800
シキボウ	800	915.00	732,000
日本毛織	4,700	900.00	4,230,000
ダイトウボウ	3,400	91.00	309,400
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	146.00	408,800
帝国繊維	1,800	1,981.00	3,565,800
帝人	15,000	1,408.00	21,120,000
東レ	115,500	676.60	78,147,300
住江織物	400	1,927.00	770,800
日本フェルト	800	447.00	357,600
日東製網	200	1,465.00	293,000
アツギ	1,300	597.00	776,100
ダイニック	600	738.00	442,800
セーレン	3,300	2,083.00	6,873,900
ソトー	700	851.00	595,700
東海染工	200	1,156.00	231,200
小松マテーレ	2,600	1,260.00	3,276,000
ワコールホールディングス	3,900	2,067.00	8,061,300

ホギメディカル	2,100	3,215.00	6,751,500
クラウドシアホールディングス	600	235.00	141,000
T S Iホールディングス	5,300	327.00	1,733,100
マツオカコーポレーション	500	1,196.00	598,000
ワールド	2,200	1,248.00	2,745,600
三陽商会	800	888.00	710,400
ナイガイ	800	285.00	228,000
オンワードホールディングス	9,800	297.00	2,910,600
ルックホールディングス	500	1,384.00	692,000
ゴールドウイン	2,900	6,350.00	18,415,000
デサント	3,100	3,305.00	10,245,500
キング	700	533.00	373,100
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	4,250.00	4,250,000
王子ホールディングス	66,700	618.00	41,220,600
日本製紙	7,700	1,164.00	8,962,800
三菱製紙	2,600	320.00	832,000
北越コーポレーション	10,500	737.00	7,738,500
中越パルプ工業	600	999.00	599,400
巴川製紙所	600	867.00	520,200
大王製紙	7,700	1,798.00	13,844,600
阿波製紙	600	336.00	201,600
レンゴー	15,000	871.00	13,065,000
トモク	1,000	1,744.00	1,744,000
ザ・パック	1,200	2,704.00	3,244,800
北の達人コーポレーション	5,800	232.00	1,345,600
クラレ	23,400	1,096.00	25,646,400
旭化成	105,700	1,129.00	119,335,300
共和レザー	1,000	668.00	668,000
昭和電工	13,900	2,298.00	31,942,200
住友化学	117,300	569.00	66,743,700
住友精化	700	3,260.00	2,282,000
日産化学	8,700	6,400.00	55,680,000
ラサ工業	600	1,609.00	965,400
クレハ	1,300	9,060.00	11,778,000
多木化学	600	5,110.00	3,066,000
テイカ	1,200	1,356.00	1,627,200
石原産業	2,700	1,096.00	2,959,200
片倉コープアグリ	300	1,178.00	353,400
日本曹達	2,000	3,470.00	6,940,000
東ソー	23,000	1,855.00	42,665,000
トクヤマ	5,100	1,899.00	9,684,900

セントラル硝子	2,600	2,090.00	5,434,000
東亜合成	8,900	1,096.00	9,754,400
大阪ソーダ	1,500	3,130.00	4,695,000
関東電化工業	3,600	1,145.00	4,122,000
デンカ	5,800	3,655.00	21,199,000
信越化学工業	27,400	18,760.00	514,024,000
日本カーバイド工業	600	1,393.00	835,800
堺化学工業	1,200	2,020.00	2,424,000
第一稀元素化学工業	1,500	1,045.00	1,567,500
エア・ウォーター	15,100	1,715.00	25,896,500
日本酸素ホールディングス	15,300	2,254.00	34,486,200
日本化学工業	500	2,550.00	1,275,000
東邦アセチレン	300	1,235.00	370,500
日本パーカラライジング	7,900	1,003.00	7,923,700
高压ガス工業	2,500	747.00	1,867,500
四国化成工業	2,100	1,412.00	2,965,200
戸田工業	400	2,863.00	1,145,200
ステラ ケミファ	800	2,439.00	1,951,200
保土谷化学工業	500	4,530.00	2,265,000
日本触媒	2,700	5,710.00	15,417,000
大日精化工業	1,300	2,214.00	2,878,200
カネカ	4,100	3,820.00	15,662,000
三菱瓦斯化学	14,800	2,097.00	31,035,600
三井化学	14,500	3,005.00	43,572,500
J S R	14,900	3,575.00	53,267,500
東京応化工業	2,600	6,390.00	16,614,000
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	832.00	88,774,400
K Hネオケム	2,600	2,859.00	7,433,400
ダイセル	23,100	884.00	20,420,400
住友ベークライト	2,500	5,090.00	12,725,000
積水化学工業	33,300	1,999.00	66,566,700
日本ゼオン	14,400	1,378.00	19,843,200
アイカ工業	4,400	3,210.00	14,124,000
宇部興産	7,500	2,153.00	16,147,500
積水樹脂	2,400	1,973.00	4,735,200
タキロンシーアイ	3,400	560.00	1,904,000
旭有機材	900	2,099.00	1,889,100
ニチバン	900	1,759.00	1,583,100
リケンテクノス	3,800	471.00	1,789,800
大倉工業	800	1,996.00	1,596,800
積水化成成品工業	2,000	455.00	910,000

群栄化学工業	400	3,550.00	1,420,000
タイガースポリマー	900	448.00	403,200
ミライアル	500	1,571.00	785,500
ダイキアクシス	700	709.00	496,300
ダイキョーニシカワ	3,400	590.00	2,006,000
竹本容器	700	786.00	550,200
森六ホールディングス	900	1,962.00	1,765,800
恵和	500	4,960.00	2,480,000
日本化薬	12,500	1,171.00	14,637,500
カーリットホールディングス	1,700	715.00	1,215,500
日本精化	1,300	1,968.00	2,558,400
扶桑化学工業	1,400	4,670.00	6,538,000
トリケミカル研究所	1,700	2,935.00	4,989,500
A D E K A	7,300	2,592.00	18,921,600
日油	5,400	5,260.00	28,404,000
新日本理化	2,900	246.00	713,400
ハリマ化成グループ	1,200	811.00	973,200
花王	36,000	5,189.00	186,804,000
第一工業製薬	600	2,792.00	1,675,200
石原ケミカル	800	1,320.00	1,056,000
日華化学	600	786.00	471,600
ニイタカ	300	2,325.00	697,500
三洋化成工業	1,000	5,130.00	5,130,000
有機合成薬品工業	1,200	270.00	324,000
大日本塗料	1,900	822.00	1,561,800
日本ペイントホールディングス	60,000	851.00	51,060,000
関西ペイント	16,500	2,305.00	38,032,500
神東塗料	1,400	153.00	214,200
中国塗料	3,800	898.00	3,412,400
日本特殊塗料	1,200	857.00	1,028,400
藤倉化成	2,000	459.00	918,000
太陽ホールディングス	2,300	3,170.00	7,291,000
D I C	6,700	2,705.00	18,123,500
サカタインクス	3,200	973.00	3,113,600
東洋インキ S C ホールディングス	3,300	1,907.00	6,293,100
T & K T O K A	1,200	881.00	1,057,200
富士フイルムホールディングス	28,600	7,555.00	216,073,000
資生堂	30,300	6,411.00	194,253,300
ライオン	19,700	1,520.00	29,944,000
高砂香料工業	1,100	2,750.00	3,025,000
マンダム	3,400	1,288.00	4,379,200
ミルボン	2,000	5,890.00	11,780,000

ファンケル	6,600	3,160.00	20,856,000
コーセー	3,100	11,580.00	35,898,000
コタ	1,000	1,542.00	1,542,000
シーボン	300	1,811.00	543,300
ポーラ・オルビスホールディングス	6,900	1,841.00	12,702,900
ノエビアホールディングス	1,400	5,120.00	7,168,000
アジュバンホールディングス	400	1,136.00	454,400
新日本製薬	500	1,363.00	681,500
エステー	1,100	1,550.00	1,705,000
アグロ カネショウ	500	1,300.00	650,000
コニシ	2,600	1,588.00	4,128,800
長谷川香料	2,800	2,386.00	6,680,800
星光PMC	900	625.00	562,500
小林製薬	4,500	9,560.00	43,020,000
荒川化学工業	1,300	1,125.00	1,462,500
メック	1,200	2,987.00	3,584,400
日本高純度化学	400	2,536.00	1,014,400
タカラバイオ	4,300	2,374.00	10,208,200
JCU	1,800	4,565.00	8,217,000
新田ゼラチン	1,100	672.00	739,200
OATアグリオ	400	1,902.00	760,800
デクセリアルズ	4,200	3,060.00	12,852,000
アース製薬	1,300	5,830.00	7,579,000
北興化学工業	1,500	829.00	1,243,500
大成ラミック	600	2,792.00	1,675,200
クミアイ化学工業	6,000	805.00	4,830,000
日本農薬	2,900	534.00	1,548,600
アキレス	1,000	1,275.00	1,275,000
有沢製作所	2,500	1,000.00	2,500,000
日東電工	9,900	8,680.00	85,932,000
レック	2,200	958.00	2,107,600
三光合成	1,900	362.00	687,800
きもと	3,000	210.00	630,000
藤森工業	1,500	4,090.00	6,135,000
前澤化成工業	1,000	1,271.00	1,271,000
未来工業	600	1,538.00	922,800
ウェーブロックホールディングス	600	709.00	425,400
JSP	1,000	1,592.00	1,592,000
エフピコ	3,000	3,370.00	10,110,000
天馬	1,300	2,561.00	3,329,300
信越ポリマー	3,000	1,087.00	3,261,000
東リ	3,700	226.00	836,200

ニフコ	5,400	3,575.00	19,305,000
バルカー	1,400	2,503.00	3,504,200
ユニ・チャーム	31,400	4,203.00	131,974,200
ショーエイコーポレーション	500	667.00	333,500
協和キリン	19,100	2,888.00	55,160,800
武田薬品工業	128,000	3,499.00	447,872,000
アステラス製薬	141,100	1,983.50	279,871,850
大日本住友製薬	10,100	1,245.00	12,574,500
塩野義製薬	20,500	7,769.00	159,264,500
わかもと製薬	2,100	299.00	627,900
日本新薬	4,300	7,750.00	33,325,000
中外製薬	50,900	3,955.00	201,309,500
科研製薬	2,500	4,235.00	10,587,500
エーザイ	19,500	5,792.00	112,944,000
ロート製薬	8,300	3,445.00	28,593,500
小野薬品工業	37,400	2,859.00	106,926,600
久光製薬	4,300	3,680.00	15,824,000
持田製薬	2,000	3,785.00	7,570,000
参天製薬	30,300	1,289.00	39,056,700
扶桑薬品工業	600	2,200.00	1,320,000
日本ケミファ	200	2,226.00	445,200
ツムラ	5,000	3,280.00	16,400,000
日医工	5,200	771.00	4,009,200
キッセイ薬品工業	2,800	2,395.00	6,706,000
生化学工業	2,900	908.00	2,633,200
栄研化学	2,900	1,789.00	5,188,100
日水製薬	600	992.00	595,200
鳥居薬品	900	2,834.00	2,550,600
JCRファーマ	4,600	2,072.00	9,531,200
東和薬品	2,400	2,890.00	6,936,000
富士製薬工業	1,000	1,015.00	1,015,000
ゼリア新薬工業	3,000	1,939.00	5,817,000
第一三共	127,900	2,381.50	304,593,850
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	1,858.00	5,945,600
大幸薬品	2,500	651.00	1,627,500
ダイト	1,100	2,897.00	3,186,700
大塚ホールディングス	33,800	3,964.00	133,983,200
大正製薬ホールディングス	3,900	5,710.00	22,269,000
ペプチドリーム	8,600	2,075.00	17,845,000
あすか製薬ホールディングス	1,900	1,043.00	1,981,700
サワイグループホールディングス	3,600	4,605.00	16,578,000
日本コークス工業	14,200	143.00	2,030,600

ニチレキ	2,100	1,299.00	2,727,900
ユシロ化学工業	800	1,086.00	868,800
ビーピー・カストロール	500	1,280.00	640,000
富士石油	4,700	281.00	1,320,700
MORESCO	600	1,152.00	691,200
出光興産	18,100	3,125.00	56,562,500
ENEOSホールディングス	244,500	473.50	115,770,750
コスモエネルギーホールディングス	4,700	2,585.00	12,149,500
横浜ゴム	9,400	1,660.00	15,604,000
TOYO TIRE	8,600	1,532.00	13,175,200
ブリヂストン	46,900	4,789.00	224,604,100
住友ゴム工業	14,700	1,138.00	16,728,600
藤倉コンポジット	1,400	738.00	1,033,200
オカモト	1,000	4,085.00	4,085,000
フコク	800	960.00	768,000
ニッタ	1,700	2,795.00	4,751,500
住友理工	3,200	594.00	1,900,800
三ツ星ベルト	2,000	2,110.00	4,220,000
バンドー化学	2,600	871.00	2,264,600
日東紡績	2,400	3,130.00	7,512,000
AGC	14,900	5,610.00	83,589,000
日本板硝子	8,000	492.00	3,936,000
石塚硝子	300	2,050.00	615,000
日本山村硝子	700	812.00	568,400
日本電気硝子	6,500	2,887.00	18,765,500
オハラ	700	1,106.00	774,200
住友大阪セメント	3,000	3,530.00	10,590,000
太平洋セメント	9,200	2,310.00	21,252,000
日本ヒューム	1,500	700.00	1,050,000
日本コンクリート工業	3,200	290.00	928,000
三谷セキサン	800	6,730.00	5,384,000
アジアパイルホールディングス	2,500	441.00	1,102,500
東海カーボン	13,700	1,198.00	16,412,600
日本カーボン	800	4,110.00	3,288,000
東洋炭素	1,100	2,806.00	3,086,600
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,530.00	4,077,000
TOTO	11,600	4,875.00	56,550,000
日本碍子	17,600	1,865.00	32,824,000
日本特殊陶業	12,400	2,159.00	26,771,600
ダントーホールディングス	1,300	364.00	473,200
MARUWA	600	14,230.00	8,538,000
品川リフラクトリーズ	400	3,890.00	1,556,000

黒崎播磨	300	4,385.00	1,315,500
ヨータイ	1,000	1,251.00	1,251,000
イソライト工業	800	1,198.00	958,400
東京窯業	1,900	309.00	587,100
ニッカトー	800	576.00	460,800
フジミインコーポレーテッド	1,300	6,480.00	8,424,000
クニミネ工業	500	1,007.00	503,500
エーアンドエーマテリアル	200	908.00	181,600
ニチアス	3,800	2,638.00	10,024,400
ニチハ	2,200	2,631.00	5,788,200
日本製鉄	72,100	2,044.00	147,372,400
神戸製鋼所	30,100	601.00	18,090,100
合同製鐵	800	1,351.00	1,080,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	43,500	1,674.00	72,819,000
東京製鐵	5,500	1,160.00	6,380,000
共英製鋼	1,800	1,636.00	2,944,800
大和工業	3,100	3,780.00	11,718,000
東京鐵鋼	700	1,390.00	973,000
大阪製鐵	800	1,213.00	970,400
淀川製鋼所	2,100	2,732.00	5,737,200
丸一鋼管	5,700	2,943.00	16,775,100
モリ工業	500	2,510.00	1,255,000
大同特殊鋼	2,600	4,315.00	11,219,000
日本高周波鋼業	800	353.00	282,400
日本冶金工業	1,200	2,840.00	3,408,000
山陽特殊製鋼	1,700	2,191.00	3,724,700
愛知製鋼	900	2,587.00	2,328,300
日立金属	17,400	2,086.00	36,296,400
日本金属	500	1,124.00	562,000
大平洋金属	1,000	3,245.00	3,245,000
新日本電工	10,600	364.00	3,858,400
栗本鐵工所	700	1,578.00	1,104,600
虹技	300	962.00	288,600
日本鑄鉄管	200	1,002.00	200,400
三菱製鋼	1,100	1,206.00	1,326,600
日亜鋼業	2,000	280.00	560,000
日本精線	300	4,390.00	1,317,000
エンビプロ・ホールディングス	500	1,331.00	665,500
シンニッタン	1,900	228.00	433,200
新家工業	500	1,691.00	845,500
大紀アルミニウム工業所	2,500	1,576.00	3,940,000
日本輕金属ホールディングス	4,100	1,832.00	7,511,200

三井金属鉱業	4,400	3,395.00	14,938,000
東邦亜鉛	900	2,682.00	2,413,800
三菱マテリアル	10,700	2,108.00	22,555,600
住友金属鉱山	20,600	5,684.00	117,090,400
DOWAホールディングス	4,400	5,140.00	22,616,000
古河機械金属	2,600	1,296.00	3,369,600
エス・サイエンス	11,600	25.00	290,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	877.00	1,841,700
東邦チタニウム	3,000	925.00	2,775,000
UACJ	2,500	2,285.00	5,712,500
CKサンエツ	300	4,170.00	1,251,000
古河電気工業	5,000	2,330.00	11,650,000
住友電気工業	60,100	1,579.50	94,927,950
フジクラ	18,100	651.00	11,783,100
昭和電線ホールディングス	1,400	1,888.00	2,643,200
タツタ電線	2,900	458.00	1,328,200
カナレ電気	300	1,522.00	456,600
平河ヒューテック	1,000	1,169.00	1,169,000
リョービ	2,100	1,117.00	2,345,700
アーレスティ	1,900	386.00	733,400
アサヒホールディングス	6,400	2,227.00	14,252,800
稲葉製作所	1,000	1,306.00	1,306,000
宮地エンジニアリンググループ	500	3,645.00	1,822,500
トーカロ	4,100	1,312.00	5,379,200
アルファC o	700	1,100.00	770,000
SUMCO	24,800	2,123.00	52,650,400
川田テクノロジーズ	300	3,955.00	1,186,500
RS Technologies	500	5,870.00	2,935,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,526.00	305,200
信和	1,100	858.00	943,800
東洋製罐グループホールディングス	10,200	1,578.00	16,095,600
ホッカンホールディングス	900	1,407.00	1,266,300
コロナ	800	897.00	717,600
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,117.00	5,715,900
駒井ハルテック	300	2,315.00	694,500
高田機工	100	2,875.00	287,500
三和ホールディングス	15,200	1,245.00	18,924,000
文化シャッター	5,100	1,060.00	5,406,000
三協立山	2,100	614.00	1,289,400
アルインコ	1,200	908.00	1,089,600
東洋シャッター	400	549.00	219,600
LIXIL	25,400	2,563.00	65,100,200

日本ファイルコン	1,200	526.00	631,200
ノーリツ	3,100	1,632.00	5,059,200
長府製作所	1,600	1,973.00	3,156,800
リンナイ	3,000	9,810.00	29,430,000
ダイニチ工業	800	703.00	562,400
日東精工	2,100	538.00	1,129,800
三洋工業	100	1,828.00	182,800
岡部	3,100	749.00	2,321,900
ジーテクト	1,900	1,446.00	2,747,400
東プレ	3,000	1,192.00	3,576,000
高周波熱錬	2,900	595.00	1,725,500
東京製綱	1,100	857.00	942,700
サンコール	1,500	511.00	766,500
モリテック スチール	1,400	323.00	452,200
パイオラックス	2,300	1,702.00	3,914,600
エイチワン	1,600	664.00	1,062,400
日本発條	14,800	878.00	12,994,400
中央発條	800	793.00	634,400
アドバネクス	300	1,514.00	454,200
立川ブラインド工業	700	1,067.00	746,900
三益半導体工業	1,200	2,379.00	2,854,800
日本ドライケミカル	400	1,790.00	716,000
日本製鋼所	4,900	3,555.00	17,419,500
三浦工業	6,900	3,345.00	23,080,500
タクマ	5,400	1,440.00	7,776,000
ツガミ	3,600	1,311.00	4,719,600
オークマ	1,900	4,775.00	9,072,500
芝浦機械	1,800	2,964.00	5,335,200
アマダ	25,300	1,055.00	26,691,500
アイダエンジニアリング	4,200	1,000.00	4,200,000
滝澤鉄工所	600	1,210.00	726,000
F U J I	7,400	2,520.00	18,648,000
牧野フライス製作所	1,800	3,710.00	6,678,000
オーエスジー	7,500	1,966.00	14,745,000
ダイジェット工業	300	1,015.00	304,500
旭ダイヤモンド工業	4,400	587.00	2,582,800
D M G 森精機	9,600	1,725.00	16,560,000
ソディック	3,700	784.00	2,900,800
ディスコ	2,400	33,550.00	80,520,000
日東工器	900	1,605.00	1,444,500
日進工具	1,300	1,367.00	1,777,100
パンチ工業	1,400	492.00	688,800

富士ダイス	800	623.00	498,400
豊和工業	900	850.00	765,000
OKK	600	765.00	459,000
東洋機械金属	1,100	570.00	627,000
島精機製作所	2,400	1,817.00	4,360,800
オプトラン	2,000	2,284.00	4,568,000
NCホールディングス	500	1,750.00	875,000
イワキポンプ	1,000	1,012.00	1,012,000
フリー	1,500	1,265.00	1,897,500
ヤマシンフィルタ	3,400	375.00	1,275,000
日阪製作所	1,900	840.00	1,596,000
やまびこ	3,100	1,073.00	3,326,300
野村マイクロ・サイエンス	400	4,210.00	1,684,000
平田機工	800	5,500.00	4,400,000
ペガサスミシン製造	1,700	529.00	899,300
マルマエ	700	2,395.00	1,676,500
タツモ	800	1,424.00	1,139,200
ナプテスコ	9,200	3,345.00	30,774,000
三井海洋開発	1,800	1,174.00	2,113,200
レオン自動機	1,800	1,018.00	1,832,400
S M C	4,800	63,190.00	303,312,000
ホソカワミクロン	1,100	2,822.00	3,104,200
ユニオンツール	600	3,605.00	2,163,000
オイレス工業	2,200	1,586.00	3,489,200
日精エー・エス・ビー機械	600	3,010.00	1,806,000
サトーホールディングス	2,200	2,075.00	4,565,000
技研製作所	1,400	3,795.00	5,313,000
日本エアージェット	700	1,055.00	738,500
カワタ	600	1,029.00	617,400
日精樹脂工業	1,100	1,025.00	1,127,500
オカダアイヨン	600	1,446.00	867,600
ワイエイシイホールディングス	700	1,062.00	743,400
小松製作所	73,800	2,805.00	207,009,000
住友重機械工業	9,300	2,934.00	27,286,200
日立建機	6,500	2,991.00	19,441,500
日工	2,100	624.00	1,310,400
巴工業	700	2,253.00	1,577,100
井関農機	1,600	1,338.00	2,140,800
T O W A	1,400	2,284.00	3,197,600
丸山製作所	300	1,520.00	456,000
北川鉄工所	700	1,362.00	953,400
ローツェ	800	10,240.00	8,192,000

タカキタ	600	619.00	371,400
クボタ	78,900	2,358.00	186,046,200
荏原実業	800	2,137.00	1,709,600
三菱化工機	500	2,004.00	1,002,000
月島機械	2,900	1,038.00	3,010,200
帝国電機製作所	1,100	1,388.00	1,526,800
新東工業	3,500	704.00	2,464,000
澁谷工業	1,400	2,497.00	3,495,800
アイチ コーポレーション	2,300	853.00	1,961,900
小森コーポレーション	4,200	711.00	2,986,200
鶴見製作所	1,300	1,780.00	2,314,000
住友精密工業	300	2,005.00	601,500
日本ギア工業	600	275.00	165,000
酒井重工業	300	3,015.00	904,500
荏原製作所	6,800	5,590.00	38,012,000
石井鐵工所	200	3,030.00	606,000
西島製作所	1,400	949.00	1,328,600
北越工業	1,600	890.00	1,424,000
ダイキン工業	20,700	21,530.00	445,671,000
オルガノ	500	7,890.00	3,945,000
トーヨーカネツ	600	2,401.00	1,440,600
栗田工業	8,800	4,930.00	43,384,000
椿本チエイン	2,100	3,330.00	6,993,000
大同工業	800	914.00	731,200
木村化工機	1,400	794.00	1,111,600
アネスト岩田	2,600	803.00	2,087,800
ダイフク	8,900	8,590.00	76,451,000
サムコ	400	2,276.00	910,400
加藤製作所	900	824.00	741,600
油研工業	300	1,766.00	529,800
タダノ	8,500	998.00	8,483,000
フジテック	6,000	2,670.00	16,020,000
C K D	4,800	2,076.00	9,964,800
キトー	1,400	1,680.00	2,352,000
平和	4,600	1,943.00	8,937,800
理想科学工業	1,400	2,264.00	3,169,600
S A N K Y O	3,500	3,200.00	11,200,000
日本金銭機械	1,900	675.00	1,282,500
マースグループホールディングス	1,000	1,615.00	1,615,000
フクシマガリレイ	1,100	4,060.00	4,466,000
オーイズミ	800	396.00	316,800
ダイコク電機	800	1,255.00	1,004,000

竹内製作所	2,500	2,720.00	6,800,000
アマノ	4,300	2,252.00	9,683,600
JUKI	2,400	703.00	1,687,200
サンデン	2,800	195.00	546,000
ジャノメ	1,400	721.00	1,009,400
マックス	2,100	1,691.00	3,551,100
グローリー	4,200	2,107.00	8,849,400
新晃工業	1,500	1,781.00	2,671,500
大和冷機工業	2,300	1,120.00	2,576,000
セガサミーホールディングス	16,200	2,103.00	34,068,600
日本ピストンリング	700	1,362.00	953,400
リケン	700	2,602.00	1,821,400
T P R	2,200	1,438.00	3,163,600
ツバキ・ナカシマ	3,600	1,393.00	5,014,800
ホシザキ	4,800	8,470.00	40,656,000
大豊工業	1,300	723.00	939,900
日本精工	30,700	736.00	22,595,200
NTN	35,600	230.00	8,188,000
ジェイテクト	15,600	1,050.00	16,380,000
不二越	1,400	4,245.00	5,943,000
日本トムソン	4,500	615.00	2,767,500
THK	9,200	2,882.00	26,514,400
ユーシン精機	1,300	690.00	897,000
前澤給装工業	1,200	991.00	1,189,200
イーグル工業	2,100	1,048.00	2,200,800
前澤工業	1,000	651.00	651,000
日本ピラー工業	1,700	2,870.00	4,879,000
キッツ	5,500	681.00	3,745,500
マキタ	19,800	4,088.00	80,942,400
三井E & Sホールディングス	6,100	362.00	2,208,200
日立造船	13,900	767.00	10,661,300
三菱重工業	25,600	3,302.00	84,531,200
I H I	10,200	2,690.00	27,438,000
スター精密	2,500	1,462.00	3,655,000
日清紡ホールディングス	10,000	1,025.00	10,250,000
イビデン	8,600	5,630.00	48,418,000
コニカミノルタ	35,800	492.00	17,613,600
ブラザー工業	19,900	2,140.00	42,586,000
ミネベアミツミ	28,100	2,604.00	73,172,400
日立製作所	78,300	5,818.00	455,549,400
東芝	28,500	4,489.00	127,936,500
三菱電機	162,700	1,420.50	231,115,350

富士電機	9,800	6,100.00	59,780,000
東洋電機製造	600	962.00	577,200
安川電機	17,500	4,750.00	83,125,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,285.00	2,570,000
明電舎	2,800	2,484.00	6,955,200
オリジン	400	1,246.00	498,400
山洋電気	700	4,900.00	3,430,000
デンヨー	1,400	1,721.00	2,409,400
P H C ホールディングス	1,900	1,673.00	3,178,700
東芝テック	1,800	4,965.00	8,937,000
芝浦メカトロニクス	300	8,220.00	2,466,000
マブチモーター	3,800	3,705.00	14,079,000
日本電産	42,200	10,065.00	424,743,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	375.00	337,500
トレックス・セミコンダクター	800	2,633.00	2,106,400
東光高岳	900	1,442.00	1,297,800
ダイヘン	1,800	4,005.00	7,209,000
ヤーマン	2,700	932.00	2,516,400
J V C ケンウッド	14,500	191.00	2,769,500
ミマキエンジニアリング	1,500	757.00	1,135,500
I - P E X	800	1,568.00	1,254,400
日新電機	3,800	1,451.00	5,513,800
大崎電気工業	3,000	490.00	1,470,000
オムロン	13,600	7,983.00	108,568,800
日東工業	2,100	1,609.00	3,378,900
I D E C	2,000	2,259.00	4,518,000
正興電機製作所	500	1,076.00	538,000
不二電機工業	400	1,074.00	429,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,341.00	12,407,300
サクサホールディングス	400	1,365.00	546,000
メルコホールディングス	400	3,840.00	1,536,000
テクノメディカ	400	1,543.00	617,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,023.00	511,500
日本電気	20,700	5,190.00	107,433,000
富士通	14,700	16,000.00	235,200,000
沖電気工業	6,600	889.00	5,867,400
岩崎通信機	600	825.00	495,000
電気興業	900	2,348.00	2,113,200
サンケン電気	1,500	4,945.00	7,417,500
ナカヨ	200	1,137.00	227,400
アイホン	1,000	2,157.00	2,157,000
ルネサスエレクトロニクス	88,300	1,398.00	123,443,400

セイコーエプソン	20,300	1,793.00	36,397,900	
ワコム	12,600	867.00	10,924,200	
アルバック	3,200	5,820.00	18,624,000	
アクセル	700	1,163.00	814,100	
E I Z O	1,300	3,735.00	4,855,500	
日本信号	4,000	885.00	3,540,000	
京三製作所	3,600	425.00	1,530,000	
能美防災	2,100	2,005.00	4,210,500	
ホーチキ	1,200	1,214.00	1,456,800	
星和電機	800	500.00	400,000	
エレコム	3,700	1,507.00	5,575,900	
パナソニック	173,700	1,222.50	212,348,250	
シャープ	18,700	1,332.00	24,908,400	
アンリツ	10,500	1,603.00	16,831,500	
富士通ゼネラル	4,500	2,481.00	11,164,500	
ソニーグループ	102,000	12,495.00	1,274,490,000	代用有価証券 30,000株
T D K	23,600	4,505.00	106,318,000	
帝国通信工業	800	1,381.00	1,104,800	
タムラ製作所	6,500	619.00	4,023,500	
アルプスアルパイン	14,500	1,275.00	18,487,500	
池上通信機	600	654.00	392,400	
鈴木	800	838.00	670,400	
メイコー	1,300	3,995.00	5,193,500	
日本トリム	400	2,809.00	1,123,600	
ローランド ディー . ジー .	1,000	2,586.00	2,586,000	
フォスター電機	1,800	816.00	1,468,800	
S M K	500	2,174.00	1,087,000	
ヨコオ	1,200	2,729.00	3,274,800	
ホシデン	4,000	1,207.00	4,828,000	
ヒロセ電機	2,500	17,130.00	42,825,000	
日本航空電子工業	3,800	1,830.00	6,954,000	
T O A	1,800	780.00	1,404,000	
マクセル	3,300	1,240.00	4,092,000	
古野電気	2,000	1,050.00	2,100,000	
ユニデンホールディングス	400	3,495.00	1,398,000	
スミダコーポレーション	1,600	883.00	1,412,800	
アイコム	600	2,412.00	1,447,200	
リオン	700	2,157.00	1,509,900	
本多通信工業	1,600	475.00	760,000	
横河電機	16,300	1,880.00	30,644,000	
新電元工業	700	3,060.00	2,142,000	
アズビル	9,500	4,220.00	40,090,000	

東亜ディーケーケー	800	918.00	734,400
日本光電工業	6,700	3,100.00	20,770,000
チノー	600	1,574.00	944,400
共和電業	1,500	377.00	565,500
日本電子材料	800	2,105.00	1,684,000
堀場製作所	3,000	5,960.00	17,880,000
アドバンテスト	12,100	9,250.00	111,925,000
小野測器	800	498.00	398,400
エスベック	1,300	2,016.00	2,620,800
キーエンス	14,700	56,820.00	835,254,000
日置電機	800	6,430.00	5,144,000
シスメックス	13,800	9,168.00	126,518,400
日本マイクロニクス	2,800	1,638.00	4,586,400
メガチップス	1,500	3,920.00	5,880,000
O B A R A G R O U P	700	3,195.00	2,236,500
澤藤電機	200	1,485.00	297,000
原田工業	900	980.00	882,000
コーセル	1,800	803.00	1,445,400
イリソ電子工業	1,400	4,500.00	6,300,000
オブテックスグループ	2,700	1,460.00	3,942,000
千代田インテグレ	700	1,869.00	1,308,300
アイ・オー・データ機器	500	1,301.00	650,500
レーザーテック	7,200	22,040.00	158,688,000
スタンレー電気	11,300	2,730.00	30,849,000
岩崎電気	600	2,289.00	1,373,400
ウシオ電機	8,400	1,802.00	15,136,800
岡谷電機産業	1,500	313.00	469,500
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	292.00	496,400
エノモト	500	1,585.00	792,500
日本セラミック	1,600	2,470.00	3,952,000
遠藤照明	800	1,017.00	813,600
古河電池	1,200	1,239.00	1,486,800
双信電機	900	566.00	509,400
山一電機	1,300	2,028.00	2,636,400
図研	1,100	2,964.00	3,260,400
日本電子	3,400	6,750.00	22,950,000
カシオ計算機	11,900	1,431.00	17,028,900
ファナック	14,300	22,835.00	326,540,500
日本シイエムケイ	3,400	620.00	2,108,000
エンプラス	400	2,661.00	1,064,400
大真空	2,300	1,123.00	2,582,900
ローム	7,300	9,360.00	68,328,000

浜松ホトニクス	11,700	5,770.00	67,509,000
三井ハイテック	1,600	8,300.00	13,280,000
新光電気工業	4,800	4,945.00	23,736,000
京セラ	22,900	6,717.00	153,819,300
太陽誘電	7,900	5,210.00	41,159,000
村田製作所	47,800	7,996.00	382,208,800
双葉電子工業	3,000	670.00	2,010,000
北陸電気工業	700	1,286.00	900,200
ニチコン	5,200	1,261.00	6,557,200
日本ケミコン	1,600	1,996.00	3,193,600
K O A	2,600	1,441.00	3,746,600
市光工業	2,100	486.00	1,020,600
小糸製作所	9,000	5,780.00	52,020,000
ミツバ	3,200	390.00	1,248,000
S C R E E Nホールディングス	2,800	11,340.00	31,752,000
キャノン電子	1,600	1,603.00	2,564,800
キャノン	80,900	2,812.50	227,531,250
リコー	45,300	1,023.00	46,341,900
象印マホービン	4,500	1,472.00	6,624,000
M U T O Hホールディングス	300	2,092.00	627,600
東京エレクトロン	10,300	56,580.00	582,774,000
トヨタ紡織	6,600	2,151.00	14,196,600
芦森工業	400	907.00	362,800
ユニプレス	2,600	812.00	2,111,200
豊田自動織機	13,200	9,180.00	121,176,000
モリタホールディングス	2,600	1,251.00	3,252,600
三櫻工業	2,300	732.00	1,683,600
デンソー	35,800	8,376.00	299,860,800
東海理化電機製作所	4,200	1,536.00	6,451,200
川崎重工業	11,900	2,177.00	25,906,300
名村造船所	5,300	206.00	1,091,800
日本車輛製造	600	2,053.00	1,231,800
三菱ロジスネクスト	2,200	973.00	2,140,600
近畿車輛	300	1,054.00	316,200
日産自動車	192,200	614.50	118,106,900
いすゞ自動車	51,100	1,536.00	78,489,600
トヨタ自動車	824,600	2,182.00	1,799,277,200
日野自動車	20,300	1,071.00	21,741,300
三菱自動車工業	60,700	319.00	19,363,300
エフテック	1,300	555.00	721,500
レシップホールディングス	800	561.00	448,800
G M B	400	806.00	322,400

ファルテック	300	703.00	210,900
武蔵精密工業	3,600	1,787.00	6,433,200
日産車体	2,400	671.00	1,610,400
新明和工業	4,500	929.00	4,180,500
極東開発工業	2,900	1,478.00	4,286,200
トピー工業	1,400	1,115.00	1,561,000
ティラド	500	2,603.00	1,301,500
タチエス	2,900	1,158.00	3,358,200
N O K	7,900	1,264.00	9,985,600
フタバ産業	4,300	408.00	1,754,400
K Y B	1,700	3,005.00	5,108,500
大同メタル工業	3,300	638.00	2,105,400
プレス工業	8,200	387.00	3,173,400
ミクニ	2,400	439.00	1,053,600
太平洋工業	3,400	1,059.00	3,600,600
河西工業	2,400	305.00	732,000
アイシン	11,900	4,360.00	51,884,000
マツダ	51,200	894.00	45,772,800
今仙電機製作所	1,100	592.00	651,200
本田技研工業	128,100	3,575.00	457,957,500
スズキ	37,200	4,814.00	179,080,800
S U B A R U	46,700	1,967.50	91,882,250
安永	900	873.00	785,700
ヤマハ発動機	21,300	2,715.00	57,829,500
T B K	1,800	407.00	732,600
エクセディ	2,500	1,674.00	4,185,000
豊田合成	5,200	2,246.00	11,679,200
愛三工業	2,600	736.00	1,913,600
盟和産業	200	1,014.00	202,800
日本プラスト	1,400	555.00	777,000
ヨロズ	1,600	971.00	1,553,600
エフ・シー・シー	2,700	1,427.00	3,852,900
シマノ	6,500	29,150.00	189,475,000
テイ・エス テック	6,800	1,561.00	10,614,800
ジャムコ	1,100	823.00	905,300
テルモ	46,000	3,813.00	175,398,000
クリエートメディック	400	961.00	384,400
日機装	5,000	842.00	4,210,000
日本エム・ディ・エム	1,000	1,592.00	1,592,000
島津製作所	21,000	4,155.00	87,255,000
J M S	1,400	606.00	848,400
長野計器	1,200	1,320.00	1,584,000

ブイ・テクノロジー	700	3,375.00	2,362,500
東京計器	1,000	1,035.00	1,035,000
愛知時計電機	600	1,852.00	1,111,200
インターアクション	900	1,972.00	1,774,800
オーバル	1,600	267.00	427,200
東京精密	2,700	4,720.00	12,744,000
マニー	6,500	1,624.00	10,556,000
ニコン	24,900	1,297.00	32,295,300
トプコン	7,700	1,523.00	11,727,100
オリンパス	85,400	2,204.50	188,264,300
理研計器	1,300	5,020.00	6,526,000
タムロン	1,300	2,407.00	3,129,100
H O Y A	31,800	15,355.00	488,289,000
シード	900	511.00	459,900
ノーリツ鋼機	1,500	1,971.00	2,956,500
エー・アンド・デイ	1,500	927.00	1,390,500
朝日インテック	17,800	1,838.00	32,716,400
シチズン時計	19,500	518.00	10,101,000
リズム	600	1,363.00	817,800
大研医器	1,300	529.00	687,700
メニコン	5,400	2,948.00	15,919,200
シンシア	200	534.00	106,800
松風	700	1,903.00	1,332,100
セイコーホールディングス	2,400	2,316.00	5,558,400
ニプロ	12,200	1,086.00	13,249,200
中本パックス	500	1,719.00	859,500
スノーピーク	2,100	2,291.00	4,811,100
パラマウントベッドホールディングス	3,100	1,933.00	5,992,300
トランザクション	900	1,029.00	926,100
粧美堂	600	432.00	259,200
ニホンフラッシュ	1,400	1,056.00	1,478,400
前田工織	1,800	3,185.00	5,733,000
永大産業	2,100	313.00	657,300
アートネイチャー	1,300	711.00	924,300
バンダイナムコホールディングス	14,600	7,958.00	116,186,800
アイフィスジャパン	400	678.00	271,200
共立印刷	3,600	144.00	518,400
S H O E I	1,500	4,540.00	6,810,000
フランスベッドホールディングス	2,300	913.00	2,099,900
パイロットコーポレーション	2,700	4,230.00	11,421,000
萩原工業	1,100	1,216.00	1,337,600
フジシールインターナショナル	3,900	1,900.00	7,410,000

タカラトミー	7,000	1,282.00	8,974,000
広済堂ホールディングス	1,100	837.00	920,700
エステールホールディングス	600	658.00	394,800
タカノ	700	718.00	502,600
プロネクサス	1,300	1,079.00	1,402,700
ホクシン	1,700	155.00	263,500
ウッドワン	500	1,019.00	509,500
大建工業	1,000	2,250.00	2,250,000
凸版印刷	24,700	2,287.00	56,488,900
大日本印刷	19,200	2,925.00	56,160,000
共同印刷	500	2,752.00	1,376,000
N I S S H A	3,300	1,472.00	4,857,600
光村印刷	100	1,471.00	147,100
T A K A R A & C O M P A N Y	1,000	1,876.00	1,876,000
アシックス	14,400	2,450.00	35,280,000
ツツミ	500	1,795.00	897,500
ローランド	1,200	4,220.00	5,064,000
小松ウオール工業	500	1,880.00	940,000
ヤマハ	9,400	5,500.00	51,700,000
河合楽器製作所	500	2,979.00	1,489,500
クリナップ	1,600	550.00	880,000
ピジョン	9,900	2,214.00	21,918,600
兼松サステック	100	1,690.00	169,000
キングジム	1,500	887.00	1,330,500
リンテック	3,400	2,624.00	8,921,600
イトーキ	3,300	361.00	1,191,300
任天堂	9,200	57,750.00	531,300,000
三菱鉛筆	2,700	1,248.00	3,369,600
タカラスタANDARD	3,400	1,375.00	4,675,000
コクヨ	7,900	1,689.00	13,343,100
ナカバヤシ	1,400	517.00	723,800
オカムラ	5,700	1,211.00	6,902,700
美津濃	1,700	2,316.00	3,937,200
東京電力ホールディングス	122,200	366.00	44,725,200
中部電力	49,700	1,142.00	56,757,400
関西電力	61,800	1,127.00	69,648,600
中国電力	25,500	904.00	23,052,000
北陸電力	14,900	551.00	8,209,900
東北電力	38,200	745.00	28,459,000
四国電力	14,800	810.00	11,988,000
九州電力	33,600	843.00	28,324,800
北海道電力	14,200	506.00	7,185,200

沖縄電力	3,400	1,419.00	4,824,600
電源開発	13,900	1,890.00	26,271,000
エフオン	1,100	526.00	578,600
イーレックス	2,400	1,640.00	3,936,000
レノバ	3,200	1,459.00	4,668,800
東京瓦斯	31,200	2,348.00	73,257,600
大阪瓦斯	29,400	2,101.00	61,769,400
東邦瓦斯	7,500	3,215.00	24,112,500
北海道瓦斯	800	1,511.00	1,208,800
広島ガス	2,800	358.00	1,002,400
西部ガスホールディングス	1,900	2,251.00	4,276,900
静岡ガス	4,200	900.00	3,780,000
メタウォーター	1,700	2,020.00	3,434,000
SBSホールディングス	1,200	3,160.00	3,792,000
東武鉄道	16,000	2,917.00	46,672,000
相鉄ホールディングス	5,300	2,226.00	11,797,800
東急	41,100	1,585.00	65,143,500
京浜急行電鉄	21,100	1,253.00	26,438,300
小田急電鉄	24,300	2,123.00	51,588,900
京王電鉄	8,500	5,360.00	45,560,000
京成電鉄	11,300	3,355.00	37,911,500
富士急行	1,900	4,150.00	7,885,000
東日本旅客鉄道	28,700	7,155.00	205,348,500
西日本旅客鉄道	19,800	5,098.00	100,940,400
東海旅客鉄道	13,500	15,980.00	215,730,000
西武ホールディングス	21,400	1,240.00	26,536,000
鴻池運輸	2,600	1,207.00	3,138,200
西日本鉄道	4,500	2,637.00	11,866,500
ハマキョウレックス	1,100	2,857.00	3,142,700
サカイ引越センター	800	4,470.00	3,576,000
近鉄グループホールディングス	15,500	3,595.00	55,722,500
阪急阪神ホールディングス	19,300	3,555.00	68,611,500
南海電気鉄道	6,900	2,382.00	16,435,800
京阪ホールディングス	6,900	2,928.00	20,203,200
神戸電鉄	400	3,390.00	1,356,000
名古屋鉄道	12,700	2,025.00	25,717,500
山陽電気鉄道	1,200	1,996.00	2,395,200
アルプス物流	1,100	1,028.00	1,130,800
ヤマトホールディングス	21,600	2,190.00	47,304,000
山九	4,100	4,115.00	16,871,500
丸運	900	242.00	217,800
丸全昭和運輸	1,300	3,195.00	4,153,500

センコーグループホールディングス	7,800	927.00	7,230,600
トナミホールディングス	400	3,770.00	1,508,000
ニッコンホールディングス	5,100	2,172.00	11,077,200
日本石油輸送	200	2,650.00	530,000
福山通運	2,500	3,840.00	9,600,000
セイノーホールディングス	10,400	1,186.00	12,334,400
エスライン	400	909.00	363,600
神奈川中央交通	400	3,460.00	1,384,000
日立物流	3,000	5,840.00	17,520,000
丸和運輸機関	3,300	1,091.00	3,600,300
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	2,576.00	30,654,400
S Gホールディングス	29,100	2,447.00	71,207,700
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,300	6,740.00	35,722,000
日本郵船	12,900	9,760.00	125,904,000
商船三井	8,500	9,110.00	77,435,000
川崎汽船	4,800	7,280.00	34,944,000
NSユナイテッド海運	900	3,925.00	3,532,500
飯野海運	7,400	768.00	5,683,200
乾汽船	1,100	2,440.00	2,684,000
日本航空	35,400	2,401.00	84,995,400
ANAホールディングス	39,300	2,648.50	104,086,050
パスコ	300	1,300.00	390,000
ランコム	400	7,620.00	3,048,000
日新	1,300	1,681.00	2,185,300
三菱倉庫	4,900	2,762.00	13,533,800
三井倉庫ホールディングス	1,700	2,336.00	3,971,200
住友倉庫	5,400	2,079.00	11,226,600
澁澤倉庫	900	2,215.00	1,993,500
東陽倉庫	2,600	318.00	826,800
日本トランスシティ	3,400	650.00	2,210,000
ケイヒン	200	1,392.00	278,400
中央倉庫	900	980.00	882,000
川西倉庫	400	1,104.00	441,600
安田倉庫	1,100	975.00	1,072,500
ファイズホールディングス	400	565.00	226,000
東洋埠頭	400	1,465.00	586,000
上組	8,400	2,178.00	18,295,200
サンリツ	400	854.00	341,600
キムラユニティー	400	1,378.00	551,200
キューソー流通システム	800	925.00	740,000
近鉄エクスプレス	2,900	3,070.00	8,903,000

東海運	1,300	309.00	401,700
エーアイティー	1,000	1,419.00	1,419,000
内外トランスライン	600	1,919.00	1,151,400
日本コンセプト	500	1,404.00	702,000
NEC ネットズエスアイ	5,300	1,778.00	9,423,400
クロスキャット	500	1,634.00	817,000
システナ	22,700	372.00	8,444,400
デジタルアーツ	900	6,370.00	5,733,000
日鉄ソリューションズ	2,300	3,675.00	8,452,500
キューブシステム	800	933.00	746,400
WOW WORLD	200	1,155.00	231,000
コア	700	1,527.00	1,068,900
ラクーンホールディングス	1,400	1,225.00	1,715,000
ソリトンシステムズ	800	1,472.00	1,177,600
ソフトクリエイイトホールディングス	700	3,900.00	2,730,000
T I S	15,200	2,697.00	40,994,400
J N Sホールディングス	800	430.00	344,000
グリー	7,300	821.00	5,993,300
G M Oペパボ	200	2,355.00	471,000
コーエーテクモホールディングス	5,100	4,055.00	20,680,500
三菱総合研究所	700	3,755.00	2,628,500
ボルテージ	500	349.00	174,500
電算	200	2,285.00	457,000
A G S	800	802.00	641,600
ファインデックス	1,400	740.00	1,036,000
ブレインパッド	1,400	1,118.00	1,565,200
K L a b	3,100	418.00	1,295,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	998.00	2,295,400
ネクソン	36,000	2,398.00	86,328,000
アイスタイル	4,100	199.00	815,900
エムアップホールディングス	2,000	768.00	1,536,000
エイチーム	1,200	743.00	891,600
エニグモ	1,800	662.00	1,191,600
テクノスジャパン	1,200	450.00	540,000
コロブラ	5,300	648.00	3,434,400
オルトプラス	1,300	312.00	405,600
ブロードリーフ	7,900	331.00	2,614,900
クロス・マーケティンググループ	700	827.00	578,900
デジタルハーツホールディングス	800	1,521.00	1,216,800
システム情報	1,200	972.00	1,166,400
メディアドゥ	600	2,561.00	1,536,600
じげん	4,700	303.00	1,424,100

ブイキューブ	1,700	786.00	1,336,200
エンカレッジ・テクノロジー	400	540.00	216,000
サイバーリンクス	600	855.00	513,000
フィックスターズ	1,800	723.00	1,301,400
CARTA HOLDINGS	700	1,964.00	1,374,800
オブティム	1,100	974.00	1,071,400
セレス	600	1,502.00	901,200
SHIFT	800	19,970.00	15,976,000
ティーガイア	1,400	1,716.00	2,402,400
セック	200	2,152.00	430,400
テクマトリックス	2,700	1,580.00	4,266,000
プロシップ	500	1,415.00	707,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,402.00	9,848,200
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	10,620.00	32,922,000
ザッパラス	600	495.00	297,000
システムリサーチ	400	1,775.00	710,000
インターネットイニシアティブ	4,300	3,530.00	15,179,000
さくらインターネット	1,800	520.00	936,000
ヴィンクス	500	955.00	477,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	4,200.00	1,680,000
SRAホールディングス	800	2,881.00	2,304,800
システムインテグレータ	500	541.00	270,500
朝日ネット	1,400	594.00	831,600
eBASE	1,900	610.00	1,159,000
アバント	1,700	1,078.00	1,832,600
アドソル日進	600	1,657.00	994,200
ODKソリューションズ	300	653.00	195,900
フリービット	800	899.00	719,200
コムチュア	1,800	2,719.00	4,894,200
サイバーコム	200	1,034.00	206,800
アステリア	1,200	851.00	1,021,200
アイル	900	1,260.00	1,134,000
マークラインズ	800	2,529.00	2,023,200
メディカル・データ・ビジョン	2,100	945.00	1,984,500
gumi	2,300	571.00	1,313,300
ショーケース	400	451.00	180,400
モバイルファクトリー	400	914.00	365,600
テラスカイ	600	1,500.00	900,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,242.00	869,400
PCIホールディングス	700	953.00	667,100
パイブドHD	300	2,597.00	779,100
アイビーシー	300	635.00	190,500

ネオジャパン	500	1,039.00	519,500
P R T I M E S	400	2,853.00	1,141,200
ラクス	5,500	1,911.00	10,510,500
ランドコンピュータ	300	863.00	258,900
ダブルスタンダード	500	2,378.00	1,189,000
オープンドア	1,000	1,832.00	1,832,000
マイネット	600	498.00	298,800
アカツキ	700	2,856.00	1,999,200
ベネフィットジャパン	100	1,928.00	192,800
U b i c o mホールディングス	400	1,922.00	768,800
カナミックネットワーク	1,800	436.00	784,800
ノムラシステムコーポレーション	900	269.00	242,100
チェンジ	3,000	1,503.00	4,509,000
シンクロ・フード	900	322.00	289,800
オークネット	900	1,465.00	1,318,500
キャピタル・アセット・プランニング	400	777.00	310,800
セグエグループ	500	559.00	279,500
エイトレッド	300	2,096.00	628,800
マクロミル	3,500	1,096.00	3,836,000
ビーグリー	400	1,150.00	460,000
オロ	500	2,231.00	1,115,500
ユーザーローカル	500	1,530.00	765,000
テモナ	400	417.00	166,800
ニーズウェル	500	623.00	311,500
マネーフォワード	2,400	5,180.00	12,432,000
サインポスト	600	891.00	534,600
電算システムホールディングス	700	2,709.00	1,896,300
ソルクシーズ	1,400	407.00	569,800
フェイス	400	689.00	275,600
プロトコーポレーション	1,700	1,245.00	2,116,500
ハイマックス	400	1,183.00	473,200
野村総合研究所	30,900	3,935.00	121,591,500
サイバネットシステム	1,100	619.00	680,900
C Eホールディングス	900	468.00	421,200
日本システム技術	300	2,098.00	629,400
インテージホールディングス	1,800	1,750.00	3,150,000
東邦システムサイエンス	500	922.00	461,000
ソースネクスト	7,200	158.00	1,137,600
インフォコム	1,800	2,005.00	3,609,000
シンプレクス・ホールディングス	1,900	1,874.00	3,560,600
H E R O Z	500	897.00	448,500
ラクスル	1,800	3,675.00	6,615,000

I P S	500	1,933.00	966,500
F I G	2,100	290.00	609,000
システムサポート	600	1,036.00	621,600
イーソル	1,000	515.00	515,000
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,347.00	2,694,000
東海ソフト	300	908.00	272,400
ウイングアーク1 s t	900	1,350.00	1,215,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,852.00	740,800
サーバーワークス	300	2,374.00	712,200
東名	200	964.00	192,800
ヴィッツ	200	1,208.00	241,600
トピラシステムズ	400	826.00	330,400
S a n s a n	5,700	1,130.00	6,441,000
L i n k - U	300	744.00	223,200
ギフトィ	1,500	1,026.00	1,539,000
ベース	300	4,435.00	1,330,500
J M D C	1,500	5,570.00	8,355,000
フォーカスシステムズ	1,200	925.00	1,110,000
クレスコ	1,200	1,718.00	2,061,600
フジ・メディア・ホールディングス	15,300	1,280.00	19,584,000
オービック	5,000	18,630.00	93,150,000
ジャストシステム	2,300	5,460.00	12,558,000
T D C ソフト	1,400	1,116.00	1,562,400
Zホールディングス	232,100	564.80	131,090,080
トレンドマイクロ	8,500	5,960.00	50,660,000
I Dホールディングス	900	858.00	772,200
日本オラクル	2,600	8,240.00	21,424,000
アルファシステムズ	400	3,970.00	1,588,000
フューチャー	3,400	1,407.00	4,783,800
C A C H o l d i n g s	900	1,357.00	1,221,300
S Bテクノロジー	700	2,453.00	1,717,100
トーセ	400	733.00	293,200
オービックビジネスコンサルタント	1,500	4,220.00	6,330,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,200	2,984.00	21,484,800
アイティフォー	2,000	798.00	1,596,000
東計電算	200	4,870.00	974,000
エクスネット	200	985.00	197,000
大塚商会	8,600	4,330.00	37,238,000
サイボウズ	2,100	1,426.00	2,994,600
電通国際情報サービス	2,300	3,535.00	8,130,500
A C C E S S	1,900	589.00	1,119,100
デジタルガレージ	2,600	3,870.00	10,062,000

E Mシステムズ	2,600	695.00	1,807,000
ウェザーニューズ	500	7,790.00	3,895,000
C I J	900	803.00	722,700
ビジネスエンジニアリング	200	3,700.00	740,000
日本エンタープライズ	1,600	171.00	273,600
WOWOW	800	1,768.00	1,414,400
スカラ	1,300	660.00	858,000
インテリジェント ウェイブ	800	574.00	459,200
I M A G I C A G R O U P	1,500	615.00	922,500
ネットワンシステムズ	6,100	2,824.00	17,226,400
システムソフト	3,900	97.00	378,300
アルゴグラフィックス	1,200	3,080.00	3,696,000
マーベラス	2,500	723.00	1,807,500
エイベックス	2,800	1,346.00	3,768,800
日本ユニシス	5,000	3,160.00	15,800,000
兼松エレクトロニクス	800	3,910.00	3,128,000
都築電気	800	1,417.00	1,133,600
T B S ホールディングス	9,700	1,924.00	18,662,800
日本テレビホールディングス	13,200	1,368.00	18,057,600
朝日放送グループホールディングス	1,600	760.00	1,216,000
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,667.00	6,334,600
スカパーJ S A Tホールディングス	13,600	452.00	6,147,200
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,135.00	2,562,000
日本BS放送	600	1,085.00	651,000
ビジョン	2,800	1,065.00	2,982,000
スマートバリュー	500	452.00	226,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,600	2,475.00	3,960,000
コネクシオ	1,300	1,390.00	1,807,000
クロップス	300	871.00	261,300
日本電信電話	167,300	3,298.00	551,755,400
K D D I	116,600	3,718.00	433,518,800
ソフトバンク	242,200	1,436.00	347,799,200
光通信	1,800	14,490.00	26,082,000
エムティーアイ	1,600	528.00	844,800
G M O インターネット	5,600	2,590.00	14,504,000
ファイバーゲート	700	1,117.00	781,900
アйдママーケティングコミュニケーション	500	288.00	144,000
K A D O K A W A	8,700	2,378.00	20,688,600
学研ホールディングス	2,300	1,016.00	2,336,800
ゼンリン	2,700	1,062.00	2,867,400
昭文社ホールディングス	900	456.00	410,400
インプレスホールディングス	1,500	206.00	309,000

アイネット	800	1,275.00	1,020,000
松竹	1,100	12,300.00	13,530,000
東宝	9,400	4,770.00	44,838,000
東映	500	17,550.00	8,775,000
エヌ・ティ・ティ・データ	42,500	2,171.00	92,267,500
ピー・シー・エー	1,000	1,410.00	1,410,000
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,600.00	960,000
D T S	3,000	2,687.00	8,061,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,400	5,680.00	42,032,000
シーイーシー	1,800	1,070.00	1,926,000
カブコン	15,100	2,769.00	41,811,900
アイ・エス・ピー	800	907.00	725,600
ジャステック	900	1,040.00	936,000
S C S K	11,000	1,926.00	21,186,000
日本システムウエア	600	2,105.00	1,263,000
アイネス	1,500	1,501.00	2,251,500
T K C	2,700	3,150.00	8,505,000
富士ソフト	1,700	5,000.00	8,500,000
N S D	5,100	2,143.00	10,929,300
コナミホールディングス	5,800	6,730.00	39,034,000
福井コンピュータホールディングス	700	3,005.00	2,103,500
J B C Cホールディングス	1,100	1,461.00	1,607,100
ミロク情報サービス	1,400	1,361.00	1,905,400
ソフトバンクグループ	95,900	5,268.00	505,201,200
ハウスイ	200	826.00	165,200
高千穂交易	600	1,561.00	936,600
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,498.00	449,400
伊藤忠食品	400	5,070.00	2,028,000
エレマテック	1,400	1,061.00	1,485,400
J A L U X	500	2,556.00	1,278,000
あらた	1,300	3,920.00	5,096,000
トーメンデバイス	300	6,340.00	1,902,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,400.00	2,700,000
フィールズ	1,500	547.00	820,500
双日	17,700	1,928.00	34,125,600
アルフレッサ ホールディングス	17,800	1,748.00	31,114,400
横浜冷凍	4,700	878.00	4,126,600
神栄	300	863.00	258,900
ラサ商事	900	1,021.00	918,900
アルコニックス	2,100	1,347.00	2,828,700
神戸物産	12,500	3,690.00	46,125,000
ハイパー	500	501.00	250,500

あい ホールディングス	2,300	1,744.00	4,011,200
ディーブイエックス	500	1,070.00	535,000
ダイワボウホールディングス	7,800	1,759.00	13,720,200
マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	2,639.00	10,028,200
ラクト・ジャパン	600	1,995.00	1,197,000
グリムス	700	2,059.00	1,441,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	809.00	2,265,200
八洲電機	1,200	960.00	1,152,000
メディアスホールディングス	900	882.00	793,800
レスターホールディングス	1,500	1,989.00	2,983,500
ジューテックホールディングス	400	1,200.00	480,000
大光	800	694.00	555,200
OCHIホールディングス	500	1,326.00	663,000
TOKAIホールディングス	7,800	900.00	7,020,000
黒谷	500	649.00	324,500
Cominix	300	737.00	221,100
三洋貿易	1,600	1,023.00	1,636,800
ビューティガレージ	300	3,050.00	915,000
ウイン・パートナーズ	1,100	1,020.00	1,122,000
ミタチ産業	400	865.00	346,000
シップヘルスケアホールディングス	5,100	2,378.00	12,127,800
明治電機工業	400	1,252.00	500,800
デリカフーズホールディングス	900	550.00	495,000
スターティアホールディングス	400	731.00	292,400
コメダホールディングス	3,600	2,141.00	7,707,600
ピーバンドットコム	300	607.00	182,100
アセンテック	600	711.00	426,600
富士興産	500	951.00	475,500
協栄産業	200	1,565.00	313,000
フルサト・マルカホールディングス	1,600	2,100.00	3,360,000
ヤマエグループホールディングス	1,100	1,060.00	1,166,000
小野建	1,500	1,639.00	2,458,500
南陽	300	1,948.00	584,400
佐島電機	1,100	913.00	1,004,300
エコートレーディング	300	599.00	179,700
伯東	1,000	2,295.00	2,295,000
コンドーテック	1,300	1,025.00	1,332,500
中山福	900	393.00	353,700
ナガイレーベン	2,100	2,108.00	4,426,800
三菱食品	1,500	3,170.00	4,755,000
松田産業	1,200	2,287.00	2,744,400
第一興商	3,000	3,485.00	10,455,000

メディバルホールディングス	17,200	2,121.00	36,481,200
S P K	600	1,313.00	787,800
萩原電気ホールディングス	600	2,044.00	1,226,400
アズワン	2,300	6,340.00	14,582,000
スズデン	500	2,050.00	1,025,000
シモジマ	900	1,018.00	916,200
ドウシシャ	1,500	1,545.00	2,317,500
小津産業	300	1,999.00	599,700
高速	900	1,515.00	1,363,500
たけびし	600	1,441.00	864,600
リックス	300	1,573.00	471,900
丸文	1,500	723.00	1,084,500
ハピネット	1,300	1,573.00	2,044,900
橋本総業ホールディングス	400	2,042.00	816,800
日本ライフライン	4,700	1,034.00	4,859,800
タカショー	1,400	666.00	932,400
I D O M	5,000	662.00	3,310,000
進和	900	2,024.00	1,821,600
エスケイジャパン	600	423.00	253,800
ダイトロン	700	1,865.00	1,305,500
シークス	2,400	1,333.00	3,199,200
田中商事	400	650.00	260,000
オーハシテクニカ	900	1,372.00	1,234,800
白銅	600	2,658.00	1,594,800
ダイコー通産	200	1,193.00	238,600
伊藤忠商事	112,100	3,837.00	430,127,700
丸紅	158,100	1,221.50	193,119,150
高島	200	2,409.00	481,800
長瀬産業	8,800	1,880.00	16,544,000
蝶理	900	1,777.00	1,599,300
豊田通商	16,100	4,945.00	79,614,500
三共生興	2,000	566.00	1,132,000
兼松	6,000	1,365.00	8,190,000
ツカモトコーポレーション	300	1,346.00	403,800
三井物産	124,500	3,060.00	380,970,000
日本紙パルプ商事	800	4,075.00	3,260,000
カメイ	1,800	1,048.00	1,886,400
東都水産	100	3,935.00	393,500
O U Gホールディングス	200	2,750.00	550,000
スターゼン	1,200	2,118.00	2,541,600
山善	6,700	1,017.00	6,813,900
椿本興業	300	4,185.00	1,255,500

住友商事	101,100	1,884.50	190,522,950
内田洋行	700	4,680.00	3,276,000
三菱商事	120,100	4,058.00	487,365,800
第一実業	800	4,265.00	3,412,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	2,531.00	10,124,000
西華産業	800	1,602.00	1,281,600
佐藤商事	1,300	1,212.00	1,575,600
菱洋エレクトロ	900	2,104.00	1,893,600
東京産業	1,500	719.00	1,078,500
ユアサ商事	1,500	2,926.00	4,389,000
神鋼商事	400	3,755.00	1,502,000
トルク	900	220.00	198,000
阪和興業	3,200	3,410.00	10,912,000
正栄食品工業	1,100	4,135.00	4,548,500
カナデン	1,300	1,000.00	1,300,000
菱電商事	1,200	1,734.00	2,080,800
岩谷産業	3,900	5,290.00	20,631,000
ナイス	600	1,849.00	1,109,400
ニチモウ	200	2,870.00	574,000
極東貿易	500	2,388.00	1,194,000
アステナホールディングス	2,300	410.00	943,000
三愛石油	4,000	935.00	3,740,000
稲畑産業	3,500	2,393.00	8,375,500
G S Iクレオス	800	1,174.00	939,200
明和産業	1,600	1,118.00	1,788,800
クワザワホールディングス	800	602.00	481,600
ワキタ	3,400	1,020.00	3,468,000
東邦ホールディングス	5,100	1,897.00	9,674,700
サンゲツ	4,200	1,577.00	6,623,400
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,068.00	2,456,400
シナネンホールディングス	600	3,360.00	2,016,000
伊藤忠エネクス	3,400	1,043.00	3,546,200
サンリオ	5,000	2,498.00	12,490,000
サンワテクノス	1,000	1,327.00	1,327,000
リョーサン	1,700	2,332.00	3,964,400
新光商事	2,500	868.00	2,170,000
トーホー	800	1,113.00	890,400
三信電気	800	1,641.00	1,312,800
東陽テクニカ	1,500	1,074.00	1,611,000
モスフードサービス	2,100	3,060.00	6,426,000
加賀電子	1,500	3,310.00	4,965,000
ソーダニッカ	1,700	888.00	1,509,600

立花エレテック	1,300	1,602.00	2,082,600
フォーバル	800	896.00	716,800
PALTAC	2,200	4,410.00	9,702,000
三谷産業	1,900	313.00	594,700
太平洋興発	700	647.00	452,900
西本Wismettacホールディングス	400	2,923.00	1,169,200
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,981.00	396,200
コア商事ホールディングス	1,000	639.00	639,000
国際紙パルプ商事	3,700	323.00	1,195,100
ヤマタネ	700	1,626.00	1,138,200
丸紅建材リース	100	1,796.00	179,600
日鉄物産	1,100	5,370.00	5,907,000
泉州電業	400	6,190.00	2,476,000
トラスコ中山	3,300	2,488.00	8,210,400
オートバックスセブン	5,400	1,427.00	7,705,800
モリト	1,100	730.00	803,000
加藤産業	2,300	3,205.00	7,371,500
北恵	400	884.00	353,600
イノテック	1,000	1,406.00	1,406,000
イエローハット	2,700	1,650.00	4,455,000
JKホールディングス	1,300	1,072.00	1,393,600
日伝	1,300	2,253.00	2,928,900
北沢産業	1,300	230.00	299,000
杉本商事	800	2,125.00	1,700,000
因幡電機産業	4,200	2,605.00	10,941,000
東テク	500	2,512.00	1,256,000
ミスミグループ本社	20,100	3,530.00	70,953,000
アルテック	1,200	294.00	352,800
タキヒヨー	500	1,459.00	729,500
蔵王産業	300	1,844.00	553,200
スズケン	6,200	3,595.00	22,289,000
ジェコス	1,100	821.00	903,100
グローセル	1,800	444.00	799,200
ローソン	3,600	4,900.00	17,640,000
サンエー	1,200	3,995.00	4,794,000
カワチ薬品	1,200	2,334.00	2,800,800
エービーシー・マート	2,500	5,220.00	13,050,000
ハードオフコーポレーション	600	798.00	478,800
アスクル	3,600	1,655.00	5,958,000
ゲオホールディングス	2,200	1,370.00	3,014,000
アダストリア	1,800	1,744.00	3,139,200
ジーフット	1,500	325.00	487,500

シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	381.00	152,400
くら寿司	1,700	3,710.00	6,307,000
キャンドウ	600	2,056.00	1,233,600
アイケイ	500	415.00	207,500
パルグループホールディングス	1,400	1,650.00	2,310,000
エディオン	7,200	1,175.00	8,460,000
サーラコーポレーション	3,200	640.00	2,048,000
ワッツ	800	700.00	560,000
ハローズ	700	2,839.00	1,987,300
フジオフードグループ本社	1,500	1,370.00	2,055,000
あみやき亭	400	2,950.00	1,180,000
大黒天物産	500	4,740.00	2,370,000
ハニーズホールディングス	1,400	1,035.00	1,449,000
ファーマライズホールディングス	500	722.00	361,000
アルペン	1,200	2,198.00	2,637,600
ハブ	800	599.00	479,200
クオールホールディングス	2,000	1,311.00	2,622,000
ジinzホールディングス	1,100	6,650.00	7,315,000
ビックカメラ	9,500	1,038.00	9,861,000
D C Mホールディングス	9,900	1,110.00	10,989,000
MonotaRO	20,300	2,017.00	40,945,100
東京一番フーズ	600	596.00	357,600
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,238.00	2,685,600
J.フロント リテイリング	19,300	1,092.00	21,075,600
ドトール・日レスホールディングス	2,800	1,620.00	4,536,000
マツキヨココカラ&カンパニー	9,900	4,060.00	40,194,000
ブロンコビリー	1,000	2,263.00	2,263,000
Z O Z O	11,000	3,185.00	35,035,000
トレジャー・ファクトリー	500	957.00	478,500
物語コーポレーション	800	6,740.00	5,392,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,200	953.00	26,874,600
Hamee	600	1,076.00	645,600
マーケットエンタープライズ	200	703.00	140,600
ウエルシアホールディングス	8,500	3,135.00	26,647,500
クリエイティブSDホールディングス	2,300	3,110.00	7,153,000
丸善C H Iホールディングス	1,700	374.00	635,800
ミサワ	400	657.00	262,800
ティーライフ	300	1,356.00	406,800
シュッピン	1,400	1,172.00	1,640,800
オイシックス・ラ・大地	2,300	2,476.00	5,694,800
ネクステージ	3,300	2,582.00	8,520,600
ジョイフル本田	4,900	1,547.00	7,580,300

鳥貴族ホールディングス	700	1,865.00	1,305,500
ホットランド	1,300	1,291.00	1,678,300
すかいらーくホールディングス	20,800	1,535.00	31,928,000
SFPホールディングス	900	1,430.00	1,287,000
綿半ホールディングス	1,200	1,299.00	1,558,800
ヨシックスホールディングス	300	2,170.00	651,000
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	1,068.00	4,912,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,104.00	993,600
B E E N O S	800	1,578.00	1,262,400
あさひ	1,300	1,415.00	1,839,500
日本調剤	1,000	1,402.00	1,402,000
コスモス薬品	1,600	14,800.00	23,680,000
トーエル	800	879.00	703,200
セブン&アイ・ホールディングス	62,700	5,704.00	357,640,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,700	772.00	6,716,400
ツルハホールディングス	3,500	9,200.00	32,200,000
サンマルクホールディングス	1,400	1,613.00	2,258,200
フェリシモ	400	1,231.00	492,400
トリドールホールディングス	4,000	2,384.00	9,536,000
T O K Y O B A S E	1,500	447.00	670,500
ウイルプラスホールディングス	300	903.00	270,900
J Mホールディングス	1,100	1,735.00	1,908,500
サツドラホールディングス	900	634.00	570,600
アレンザホールディングス	1,200	1,092.00	1,310,400
串カツ田中ホールディングス	500	2,109.00	1,054,500
パロックジャパンリミテッド	1,100	897.00	986,700
クスリのアオキホールディングス	1,600	6,780.00	10,848,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E	9,400	3,805.00	35,767,000
メディカルシステムネットワーク	1,600	523.00	836,800
藤久ホールディングス	400	740.00	296,000
はるやまホールディングス	900	534.00	480,600
ノジマ	2,600	2,539.00	6,601,400
カップ・クリエイト	2,400	1,376.00	3,302,400
ライトオン	1,300	722.00	938,600
良品計画	18,500	1,766.00	32,671,000
三城ホールディングス	1,800	253.00	455,400
アドヴァングループ	1,700	937.00	1,592,900
アルビス	500	2,243.00	1,121,500
コナカ	2,000	360.00	720,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,695.00	339,000
G - 7ホールディングス	1,800	1,556.00	2,800,800

イオン北海道	2,800	1,181.00	3,306,800
コジマ	2,700	552.00	1,490,400
ヒマラヤ	700	1,019.00	713,300
コーナン商事	2,300	3,580.00	8,234,000
エコス	600	2,035.00	1,221,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	32,100	1,936.00	62,145,600
西松屋チェーン	3,500	1,453.00	5,085,500
ゼンショーホールディングス	7,900	2,697.00	21,306,300
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,383.00	1,521,300
ハークスレイ	700	486.00	340,200
サイゼリヤ	2,400	2,904.00	6,969,600
V Tホールディングス	6,200	469.00	2,907,800
魚力	400	2,078.00	831,200
フジ・コーポレーション	800	1,166.00	932,800
ユナイテッドアローズ	1,700	1,769.00	3,007,300
ハイデイ日高	2,400	1,761.00	4,226,400
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	1,300	202.00	262,600
コロワイド	6,700	1,746.00	11,698,200
ピーシーデポコーポレーション	1,900	290.00	551,000
壱番屋	1,100	4,700.00	5,170,000
P L A N T	400	657.00	262,800
スギホールディングス	3,200	6,480.00	20,736,000
薬王堂ホールディングス	800	2,437.00	1,949,600
スクロール	2,500	899.00	2,247,500
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,753.00	2,629,500
木曽路	2,200	2,259.00	4,969,800
S R S ホールディングス	2,600	833.00	2,165,800
千趣会	2,900	375.00	1,087,500
リテールパートナーズ	1,900	1,249.00	2,373,100
ケーヨー	3,000	858.00	2,574,000
上新電機	1,800	2,095.00	3,771,000
日本瓦斯	7,800	1,731.00	13,501,800
ロイヤルホールディングス	2,900	1,926.00	5,585,400
東天紅	200	955.00	191,000
いなげや	2,000	1,395.00	2,790,000
チヨダ	1,600	757.00	1,211,200
ライフコーポレーション	1,500	3,035.00	4,552,500
リンガーハット	2,100	2,301.00	4,832,100
M r M a x H D	2,000	614.00	1,228,000
A O K I ホールディングス	3,200	619.00	1,980,800
オークワ	2,500	945.00	2,362,500

コメリ	2,400	2,756.00	6,614,400
青山商事	3,400	745.00	2,533,000
しまむら	1,900	10,370.00	19,703,000
はせがわ	1,100	304.00	334,400
高島屋	11,700	1,144.00	13,384,800
松屋	3,400	740.00	2,516,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,700	888.00	6,837,600
近鉄百貨店	600	2,719.00	1,631,400
丸井グループ	12,700	2,299.00	29,197,300
アクシアル リテイリング	1,200	3,225.00	3,870,000
イオン	61,700	2,611.00	161,098,700
イズミ	2,900	3,260.00	9,454,000
平和堂	2,900	1,955.00	5,669,500
フジ	1,900	1,886.00	3,583,400
ヤオコー	1,800	6,570.00	11,826,000
ゼビオホールディングス	2,200	960.00	2,112,000
ケーズホールディングス	14,700	1,266.00	18,610,200
Olympicグループ	800	711.00	568,800
日産東京販売ホールディングス	2,300	237.00	545,100
シルバーライフ	400	1,101.00	440,400
Genky DrugStores	700	3,550.00	2,485,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,040.00	416,000
ブックオフグループホールディングス	900	1,049.00	944,100
ギフト	300	2,379.00	713,700
アインホールディングス	2,100	6,270.00	13,167,000
元気寿司	500	2,574.00	1,287,000
ヤマダホールディングス	58,400	405.00	23,652,000
アークランドサカモト	2,500	1,526.00	3,815,000
ニトリホールディングス	6,400	16,580.00	106,112,000
愛眼	1,000	181.00	181,000
ケーユーホールディングス	800	1,007.00	805,600
吉野家ホールディングス	5,700	2,425.00	13,822,500
松屋フーズホールディングス	800	3,655.00	2,924,000
サガミホールディングス	2,700	1,230.00	3,321,000
関西フードマーケット	1,300	1,089.00	1,415,700
王将フードサービス	1,100	5,980.00	6,578,000
プレナス	1,800	2,078.00	3,740,400
ミニストップ	1,400	1,461.00	2,045,400
アークス	3,000	2,143.00	6,429,000
バローホールディングス	3,500	2,222.00	7,777,000
ベルク	700	5,310.00	3,717,000
大庄	1,100	1,048.00	1,152,800

ファーストリテイリング	2,100	62,320.00	130,872,000	
サンドラッグ	6,000	3,035.00	18,210,000	
サックスパー ホールディングス	1,600	532.00	851,200	
ヤマザワ	300	1,632.00	489,600	
やまや	300	2,549.00	764,700	
ペルーナ	3,500	749.00	2,621,500	
島根銀行	600	571.00	342,600	
じもとホールディングス	1,300	702.00	912,600	
めぶきフィナンシャルグループ	83,300	288.00	23,990,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,962.00	4,120,200	
九州フィナンシャルグループ	32,700	457.00	14,943,900	
ゆうちょ銀行	37,800	1,184.00	44,755,200	
富山第一銀行	3,700	326.00	1,206,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	91,500	503.00	46,024,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,500	869.00	9,124,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,564.00	2,346,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,600	2,818.00	7,326,800	
ひろぎんホールディングス	23,600	720.00	16,992,000	
おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,370.00	3,555,000	
十六フィナンシャルグループ	2,100	2,446.00	5,136,600	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	3,355.00	5,032,500	
新生銀行	10,500	2,228.00	23,394,000	
あおぞら銀行	9,000	2,724.00	24,516,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,006,900	753.70	758,900,530	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	183,700	542.10	99,583,770	
三井住友トラスト・ホールディングス	30,300	4,239.00	128,441,700	
三井住友フィナンシャルグループ	111,100	4,353.00	483,618,300	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	53,500	792.00	42,372,000	
群馬銀行	31,000	408.00	12,648,000	
武蔵野銀行	2,300	1,974.00	4,540,200	
千葉興業銀行	4,000	295.00	1,180,000	
筑波銀行	6,800	222.00	1,509,600	
七十七銀行	5,000	1,621.00	8,105,000	
青森銀行	1,300	1,994.00	2,592,200	
秋田銀行	1,000	1,848.00	1,848,000	
山形銀行	1,800	1,020.00	1,836,000	
岩手銀行	1,100	2,004.00	2,204,400	
東邦銀行	13,600	226.00	3,073,600	
東北銀行	800	1,048.00	838,400	
みちのく銀行	1,200	915.00	1,098,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,500	2,400.00	32,400,000	

静岡銀行	39,000	920.00	35,880,000
スルガ銀行	14,300	474.00	6,778,200
八十二銀行	36,000	450.00	16,200,000
山梨中央銀行	1,800	1,013.00	1,823,400
大垣共立銀行	3,200	2,115.00	6,768,000
福井銀行	1,400	1,518.00	2,125,200
清水銀行	700	1,653.00	1,157,100
富山銀行	300	2,320.00	696,000
滋賀銀行	3,000	2,328.00	6,984,000
南都銀行	2,500	2,177.00	5,442,500
百五銀行	15,300	372.00	5,691,600
京都銀行	5,700	5,740.00	32,718,000
紀陽銀行	5,400	1,606.00	8,672,400
ほくほくフィナンシャルグループ	10,000	990.00	9,900,000
山陰合同銀行	9,500	702.00	6,669,000
中国銀行	12,700	955.00	12,128,500
鳥取銀行	500	1,297.00	648,500
伊予銀行	21,000	642.00	13,482,000
百十四銀行	1,800	1,811.00	3,259,800
四国銀行	2,400	836.00	2,006,400
阿波銀行	2,400	2,407.00	5,776,800
大分銀行	1,000	2,079.00	2,079,000
宮崎銀行	1,000	2,278.00	2,278,000
佐賀銀行	900	1,592.00	1,432,800
琉球銀行	3,400	874.00	2,971,600
セブン銀行	47,900	254.00	12,166,600
みずほフィナンシャルグループ	205,300	1,636.00	335,870,800
高知銀行	600	808.00	484,800
山口フィナンシャルグループ	18,500	760.00	14,060,000
長野銀行	500	1,334.00	667,000
名古屋銀行	1,200	3,360.00	4,032,000
北洋銀行	24,500	273.00	6,688,500
愛知銀行	600	4,940.00	2,964,000
中京銀行	700	1,737.00	1,215,900
大光銀行	600	1,600.00	960,000
愛媛銀行	2,100	1,019.00	2,139,900
トマト銀行	500	1,097.00	548,500
京葉銀行	6,700	540.00	3,618,000
栃木銀行	8,200	251.00	2,058,200
北日本銀行	500	1,786.00	893,000
東和銀行	3,100	594.00	1,841,400
福島銀行	2,100	251.00	527,100

大東銀行	700	768.00	537,600
トモニホールディングス	12,400	362.00	4,488,800
フィデアホールディングス	1,500	1,439.00	2,158,500
池田泉州ホールディングス	19,300	198.00	3,821,400
F P G	5,600	863.00	4,832,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,121.00	1,457,300
マーキュリアホールディングス	600	551.00	330,600
S B I ホールディングス	19,800	3,100.00	61,380,000
ジャフコ グループ	6,000	1,699.00	10,194,000
大和証券グループ本社	120,300	700.50	84,270,150
野村ホールディングス	245,300	546.50	134,056,450
岡三証券グループ	12,600	390.00	4,914,000
丸三証券	4,800	551.00	2,644,800
東洋証券	5,300	159.00	842,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,500	409.00	7,566,500
光世証券	400	477.00	190,800
水戸証券	4,000	281.00	1,124,000
いちよし証券	3,100	677.00	2,098,700
松井証券	7,900	817.00	6,454,300
マネックスグループ	13,200	534.00	7,048,800
極東証券	2,100	773.00	1,623,300
岩井コスモホールディングス	1,500	1,412.00	2,118,000
アイザワ証券グループ	2,600	948.00	2,464,800
マネーパートナーズグループ	2,200	225.00	495,000
スパークス・グループ	7,400	254.00	1,879,600
かんぽ生命保険	16,200	2,106.00	34,117,200
S O M P O ホールディングス	26,400	5,589.00	147,549,600
アニコム ホールディングス	5,000	814.00	4,070,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	36,000	4,169.00	150,084,000
第一生命ホールディングス	79,100	2,698.00	213,411,800
東京海上ホールディングス	52,900	7,040.00	372,416,000
T & D ホールディングス	41,700	1,800.00	75,060,000
アドバンスクリエイト	800	1,009.00	807,200
全国保証	3,800	4,870.00	18,506,000
あんしん保証	600	291.00	174,600
ジェイリース	600	1,903.00	1,141,800
イントラスト	700	587.00	410,900
日本モーゲージサービス	900	1,040.00	936,000
C a s a	600	839.00	503,400
アルヒ	2,500	1,079.00	2,697,500
プレミアグループ	800	3,875.00	3,100,000
ネットプロテクションズホールディングス	3,600	879.00	3,164,400

クレディセゾン	10,300	1,341.00	13,812,300
芙蓉総合リース	1,700	7,900.00	13,430,000
みずほリース	2,500	3,280.00	8,200,000
東京センチュリー	3,100	5,790.00	17,949,000
日本証券金融	6,300	913.00	5,751,900
アイフル	27,100	357.00	9,674,700
リコーリース	1,400	3,810.00	5,334,000
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,264.00	11,123,200
アコム	31,700	326.00	10,334,200
ジャックス	1,800	3,245.00	5,841,000
オリエントコーポレーション	44,300	126.00	5,581,800
オリックス	97,500	2,370.00	231,075,000
三菱HCキャピタル	59,300	605.00	35,876,500
九州リースサービス	900	606.00	545,400
日本取引所グループ	40,600	2,320.00	94,192,000
イー・ギャランティ	2,400	2,023.00	4,855,200
アサックス	800	683.00	546,400
NECキャピタルソリューション	600	2,145.00	1,287,000
いちご	18,200	274.00	4,986,800
日本駐車場開発	18,500	141.00	2,608,500
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,250.00	1,125,000
SREホールディングス	400	4,135.00	1,654,000
ADワークスグループ	4,100	140.00	574,000
ヒューリック	38,400	1,086.00	41,702,400
三栄建築設計	700	1,655.00	1,158,500
野村不動産ホールディングス	8,300	2,799.00	23,231,700
三重交通グループホールディングス	3,500	470.00	1,645,000
サムティ	2,600	2,140.00	5,564,000
ディア・ライフ	2,200	521.00	1,146,200
コーセーアールイー	600	595.00	357,000
地主	1,100	1,745.00	1,919,500
プレサンスコーポレーション	2,100	2,041.00	4,286,100
THEグローバル社	900	179.00	161,100
ハウスコム	300	1,251.00	375,300
日本管理センター	800	991.00	792,800
サンセイランディック	500	851.00	425,500
エストラスト	300	590.00	177,000
フージャースホールディングス	2,100	694.00	1,457,400
オープンハウスグループ	5,100	5,800.00	29,580,000
東急不動産ホールディングス	47,400	665.00	31,521,000
飯田グループホールディングス	13,400	2,423.00	32,468,200
イーランド	300	1,427.00	428,100

ムゲンエステート	1,300	487.00	633,100
ビーロット	1,200	492.00	590,400
ファーストブラザーズ	400	836.00	334,400
And Doホールディングス	900	875.00	787,500
シーアールイー	500	1,701.00	850,500
プロパティエージェント	200	1,529.00	305,800
ケイアイスター不動産	700	5,870.00	4,109,000
アグレ都市デザイン	300	1,246.00	373,800
グッドコムアセット	800	1,135.00	908,000
ジェイ・エス・ビー	400	3,040.00	1,216,000
テンポイノベーション	500	865.00	432,500
グローバル・リンク・マネジメント	400	821.00	328,400
フェイスネットワーク	200	1,282.00	256,400
パーク24	8,700	1,790.00	15,573,000
パラカ	400	1,685.00	674,000
三井不動産	73,200	2,608.00	190,905,600
三菱地所	105,500	1,786.00	188,423,000
平和不動産	2,800	4,045.00	11,326,000
東京建物	15,900	1,738.00	27,634,200
ダイビル	4,100	2,195.00	8,999,500
京阪神ビルディング	2,500	1,445.00	3,612,500
住友不動産	33,700	3,591.00	121,016,700
テーオーシー	2,800	726.00	2,032,800
東京楽天地	300	3,840.00	1,152,000
スターツコーポレーション	2,200	2,532.00	5,570,400
フジ住宅	2,000	664.00	1,328,000
空港施設	1,700	572.00	972,400
明和地所	800	601.00	480,800
ゴールドクレスト	1,300	1,868.00	2,428,400
エスリード	600	1,753.00	1,051,800
日神グループホールディングス	2,500	486.00	1,215,000
日本エスコン	3,100	760.00	2,356,000
タカラレーベン	7,200	321.00	2,311,200
A V A N T I A	900	849.00	764,100
イオンモール	8,100	1,665.00	13,486,500
毎日コムネット	700	705.00	493,500
ファースト住建	600	1,157.00	694,200
カチタス	4,000	3,465.00	13,860,000
トーセイ	2,300	1,052.00	2,419,600
穴吹興産	400	2,000.00	800,000
サンフロンティア不動産	2,300	1,071.00	2,463,300
F Jネクストホールディングス	1,500	987.00	1,480,500

インテリックス	400	644.00	257,600
ランドビジネス	800	244.00	195,200
サンネクスタグループ	600	1,027.00	616,200
グランディハウス	1,200	589.00	706,800
日本空港ビルデング	6,100	5,400.00	32,940,000
明豊ファシリティワークス	800	716.00	572,800
日本工営	1,000	2,990.00	2,990,000
LIFULL	4,900	232.00	1,136,800
ミクシィ	3,500	2,255.00	7,892,500
ジェイエシーリクルートメント	1,300	2,000.00	2,600,000
日本M&Aセンターホールディングス	25,500	1,833.00	46,741,500
メンバーズ	500	2,854.00	1,427,000
中広	400	395.00	158,000
UTグループ	2,200	3,485.00	7,667,000
アイティメディア	700	1,611.00	1,127,700
E・Jホールディングス	900	1,124.00	1,011,600
夢真ビーネックスグループ	5,000	1,690.00	8,450,000
コシダカホールディングス	4,300	654.00	2,812,200
アルトナー	300	867.00	260,100
パソナグループ	1,700	2,583.00	4,391,100
CDS	400	1,606.00	642,400
リンクアンドモチベーション	3,600	454.00	1,634,400
エス・エム・エス	5,300	3,315.00	17,569,500
サニーサイドアップグループ	600	732.00	439,200
パーソルホールディングス	15,500	3,040.00	47,120,000
リニカル	1,000	706.00	706,000
クックパッド	5,200	260.00	1,352,000
エスクリ	1,000	381.00	381,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	592.00	473,600
学情	600	986.00	591,600
スタジオアリス	700	2,170.00	1,519,000
シミックホールディングス	900	1,593.00	1,433,700
エプコ	300	709.00	212,700
NJS	300	1,969.00	590,700
総合警備保障	6,200	4,225.00	26,195,000
カカクコム	11,400	2,601.00	29,651,400
アイロムグループ	500	1,970.00	985,000
セントケア・ホールディング	1,000	823.00	823,000
サイネックス	200	609.00	121,800
ルネサンス	1,200	1,098.00	1,317,600
ディップ	2,700	3,550.00	9,585,000
デジタルホールディングス	1,100	1,447.00	1,591,700

新日本科学	1,900	1,606.00	3,051,400
キャリアデザインセンター	400	1,233.00	493,200
ベネフィット・ワン	5,700	2,750.00	15,675,000
エムスリー	27,400	4,082.00	111,846,800
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	298.00	417,200
プラス	300	635.00	190,500
アウトソーシング	9,000	1,391.00	12,519,000
ウェルネット	1,700	442.00	751,400
ワールドホールディングス	600	2,130.00	1,278,000
ディー・エヌ・エー	5,900	1,685.00	9,941,500
博報堂D Yホールディングス	21,600	1,604.00	34,646,400
ぐるなび	2,700	405.00	1,093,500
タカミヤ	2,100	387.00	812,700
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	953.00	1,048,300
ファンコミュニケーションズ	3,900	383.00	1,493,700
ライク	500	1,823.00	911,500
ビジネス・ブレークスルー	700	428.00	299,600
エスプール	4,400	1,024.00	4,505,600
WDBホールディングス	700	2,755.00	1,928,500
手間いらず	200	4,800.00	960,000
ティア	900	436.00	392,400
C D G	200	1,369.00	273,800
アドウェイズ	2,400	677.00	1,624,800
バリューコマース	1,200	3,520.00	4,224,000
インフォマート	17,000	645.00	10,965,000
J Pホールディングス	4,200	232.00	974,400
エコナックホールディングス	4,200	87.00	365,400
C Lホールディングス	300	1,222.00	366,600
プレステージ・インターナショナル	5,800	719.00	4,170,200
アミューズ	800	2,152.00	1,721,600
ドリームインキュベータ	500	2,404.00	1,202,000
クイック	1,000	1,635.00	1,635,000
T A C	800	227.00	181,600
電通グループ	16,000	4,305.00	68,880,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	1,181.00	944,800
ぴあ	600	3,390.00	2,034,000
イオンファンタジー	600	2,180.00	1,308,000
シーティーエス	1,700	804.00	1,366,800
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	3,045.00	12,484,500
アルプス技研	1,300	1,980.00	2,574,000
日本空調サービス	1,600	783.00	1,252,800

オリエンタルランド	18,400	22,340.00	411,056,000
ダスキン	3,500	2,789.00	9,761,500
明光ネットワークジャパン	1,900	570.00	1,083,000
ファルコホールディングス	800	2,000.00	1,600,000
秀英予備校	200	428.00	85,600
ラウンドワン	4,400	1,475.00	6,490,000
リゾートトラスト	7,100	1,933.00	13,724,300
ビー・エム・エル	2,000	3,505.00	7,010,000
りらいあコミュニケーションズ	2,300	1,075.00	2,472,500
リソー教育	7,300	401.00	2,927,300
早稲田アカデミー	900	1,013.00	911,700
ユー・エス・エス	17,400	1,939.00	33,738,600
東京個別指導学院	1,500	620.00	930,000
サイバーエージェント	38,300	1,497.00	57,335,100
楽天グループ	80,000	985.00	78,800,000
クリーク・アンド・リバー社	800	1,764.00	1,411,200
モーニングスター	2,800	561.00	1,570,800
テー・オー・ダブリュー	2,800	293.00	820,400
山田コンサルティンググループ	800	1,130.00	904,000
セントラルスポーツ	600	2,409.00	1,445,400
フルキャストホールディングス	1,300	2,255.00	2,931,500
エン・ジャパン	2,500	2,957.00	7,392,500
リソルホールディングス	200	4,390.00	878,000
テクノプロ・ホールディングス	9,300	3,405.00	31,666,500
アトラグループ	500	260.00	130,000
インターワークス	600	378.00	226,800
アイ・アールジャパンホールディングス	700	4,200.00	2,940,000
Keeper 技研	1,000	2,038.00	2,038,000
ファーストロジック	300	787.00	236,100
三機サービス	300	1,016.00	304,800
Gunosy	900	741.00	666,900
デザインワン・ジャパン	600	192.00	115,200
イー・ガーディアン	700	2,633.00	1,843,100
リブセンス	1,200	153.00	183,600
ジャパンマテリアル	4,800	1,670.00	8,016,000
ベクトル	2,200	1,054.00	2,318,800
ウチヤマホールディングス	900	334.00	300,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,072.00	1,286,400
キャリアリンク	600	1,577.00	946,200
I B J	1,300	783.00	1,017,900
アサンテ	700	1,606.00	1,124,200
バリューHR	700	2,379.00	1,665,300

M & Aキャピタルパートナーズ	1,300	4,965.00	6,454,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,514.00	908,400
E R Iホールディングス	500	1,152.00	576,000
アビスト	200	2,936.00	587,200
シグマクシス・ホールディングス	1,000	2,189.00	2,189,000
ウィルグループ	1,200	1,240.00	1,488,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	192.00	480,000
メドピア	1,200	2,557.00	3,068,400
レアジョブ	300	785.00	235,500
リクルートホールディングス	120,000	5,764.00	691,680,000
エラン	2,100	983.00	2,064,300
土木管理総合試験所	900	333.00	299,700
ネットマーケティング	800	414.00	331,200
日本郵政	203,100	1,020.50	207,263,550
ベルシステム24ホールディングス	2,300	1,398.00	3,215,400
鎌倉新書	1,800	528.00	950,400
S MN	400	585.00	234,000
一蔵	300	384.00	115,200
グローバルキッズCOMPANY	300	810.00	243,000
エアトリ	1,000	2,978.00	2,978,000
アトラエ	1,100	1,951.00	2,146,100
ストライク	600	4,280.00	2,568,000
ソラスト	3,800	1,025.00	3,895,000
セラク	500	1,179.00	589,500
インソース	1,500	1,900.00	2,850,000
ベिकाレント・コンサルティング	1,100	41,400.00	45,540,000
Orchestra Holdings	300	2,724.00	817,200
アイモバイル	500	1,200.00	600,000
キャリアインデックス	500	743.00	371,500
MS - Japan	700	880.00	616,000
船場	400	766.00	306,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,900	1,574.00	7,712,600
フルテック	300	1,338.00	401,400
ツナググループ・ホールディングス	500	293.00	146,500
GameWith	600	435.00	261,000
ソウルドアウト	400	1,350.00	540,000
MS&Consulting	300	688.00	206,400
ウェルビー	1,000	1,181.00	1,181,000
エル・ティー・エス	200	2,010.00	402,000
ミダックホールディングス	700	2,450.00	1,715,000
日総工産	1,200	816.00	979,200
キュービーネットホールディングス	800	1,681.00	1,344,800

R P Aホールディングス	2,300	346.00	795,800	
スプリックス	500	1,502.00	751,000	
マネジメントソリューションズ	800	3,295.00	2,636,000	
プロレド・パートナーズ	400	825.00	330,000	
and factory	500	391.00	195,500	
テノ・ホールディングス	200	567.00	113,400	
フロンティア・マネジメント	400	794.00	317,600	
ピアラ	300	564.00	169,200	
コプロ・ホールディングス	300	1,069.00	320,700	
ギークス	300	1,220.00	366,000	
カーブスホールディングス	4,400	703.00	3,093,200	
フォーラムエンジニアリング	1,000	882.00	882,000	
Fast Fitness Japan	200	2,059.00	411,800	
ダイレクトマーケティングミックス	1,800	1,432.00	2,577,600	
ポピンズホールディングス	400	2,392.00	956,800	
L I T A L I C O	1,300	3,165.00	4,114,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	675.00	540,000	
リログループ	8,500	1,870.00	15,895,000	
東祥	1,200	1,672.00	2,006,400	
T R Eホールディングス	2,200	1,395.00	3,069,000	
人・夢・技術グループ	700	1,806.00	1,264,200	
エイチ・アイ・エス	3,500	2,099.00	7,346,500	
ラックランド	500	2,790.00	1,395,000	
共立メンテナンス	2,800	4,350.00	12,180,000	
イチネンホールディングス	1,600	1,294.00	2,070,400	
建設技術研究所	900	2,371.00	2,133,900	
スペース	1,100	911.00	1,002,100	
燦ホールディングス	600	1,506.00	903,600	
スバル興業	100	7,950.00	795,000	
東京テアトル	800	1,252.00	1,001,600	
タナベ経営	500	647.00	323,500	
ナガワ	500	9,810.00	4,905,000	
東京都競馬	1,200	4,360.00	5,232,000	
常磐興産	800	1,375.00	1,100,000	
カナモト	2,800	2,294.00	6,423,200	
西尾レントオール	1,400	2,877.00	4,027,800	
アゴーラ ホスピタリティィー グループ	12,800	21.00	268,800	
トランス・コスモス	2,000	3,185.00	6,370,000	
乃村工藝社	6,700	955.00	6,398,500	
藤田観光	800	2,347.00	1,877,600	
K N T - C Tホールディングス	1,000	1,541.00	1,541,000	
日本管財	1,600	2,801.00	4,481,600	

トーカイ	1,300	1,821.00	2,367,300	
セコム	15,300	8,421.00	128,841,300	
セントラル警備保障	800	2,393.00	1,914,400	
丹青社	3,200	744.00	2,380,800	
メイテック	1,900	6,970.00	13,243,000	
応用地質	1,800	2,126.00	3,826,800	
船井総研ホールディングス	3,200	2,339.00	7,484,800	
進学会ホールディングス	500	337.00	168,500	
オオバ	1,100	738.00	811,800	
いであ	400	1,740.00	696,000	
学究社	500	1,593.00	796,500	
ベネッセホールディングス	5,200	2,318.00	12,053,600	
イオンディライト	1,900	3,010.00	5,719,000	
ナック	700	981.00	686,700	
ダイセキ	2,800	4,675.00	13,090,000	
ステップ	500	1,848.00	924,000	
合 計	17,717,300		42,965,078,130	

(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。

【インデックスファンドTSP】

【純資産額計算書】

資産総額	21,683,744,955円
負債総額	20,303,071円
純資産総額（ - ）	21,663,441,884円
発行済口数	22,077,126,792口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9813円

（参考）

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

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている

振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

に含まれております。

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

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第62期(2021年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

退職給付引当金	1,395
---------	-------

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
------	-----

利息費用	1
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	6
----------------	---

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	6
--------------	---

退職給付の支払額	86
----------	----

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

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

退職給付債務	1,429
--------	-------

未積立退職給付債務	1,429
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	27
-------------	----

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

退職給付引当金	1,456
---------	-------

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	2
----------------	---

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第61期 (2020年3月31日)		第62期 (2021年3月31日)	
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
(単位：百万円)		(単位：百万円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	822	賞与引当金	929
投資有価証券評価損	102	投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	427	退職給付引当金	446
固定資産減価償却費	96	固定資産減価償却費	90
その他	744	その他	978
繰延税金資産小計	3,624	繰延税金資産小計	3,972
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,194	繰延税金資産合計	2,541
繰延税金負債		繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172	繰延ヘッジ利益	51
繰延税金負債合計	172	その他有価証券評価差額金	645
繰延税金資産の純額	2,022	繰延税金負債合計	696
		繰延税金資産の純額	1,845
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率 (調整)	30.6%	法定実効税率 (調整)	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.3%
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	9.6%	受取配当金等永久に益金に参入されな い項目	5.7%
その他	1.0%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%

(関連当事者情報)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	30,151百万円
負債合計	5,919百万円
純資産合計	24,231百万円
営業収益	19,946百万円
税引前当期純利益	7,020百万円
当期純利益	5,194百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

第63期中間会計期間
(2021年9月30日)

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

負債合計

26,960

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

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

自己株式		2,067
------	--	-------

株主資本合計		86,798
--------	--	--------

評価・換算差額等

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他	繰延ヘッジ	評価・換算	

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

注記事項

（重要な会計方針）

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

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

(会計方針の変更)

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

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

(2) 通貨関連

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

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

（持分法損益等）

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

（収益認識関係）

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

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

（ストックオプション等関係）

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

[関連情報]

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

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

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

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

定めるものを除きます。)。

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円 (2021年3月末現在)

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

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
アイザワ証券株式会社	3,000百万円 (2021年10月1日現在)	
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
池田泉州 T T 証券株式会社	1,250百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
O K B 証券株式会社 1	1,500百万円	

光世証券株式会社	12,000百万円	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。
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東武証券株式会社	420百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
西日本シティ T T 証券株式会社 1	3,000百万円	
浜銀 T T 証券株式会社 1	3,307百万円	
ばんせい証券株式会社	1,558百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸三証券株式会社	10,000百万円	
みずほ証券株式会社 1	125,167百万円	
三菱 U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
明和証券株式会社 1	511百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社神奈川銀行	6,191百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
ソニー銀行株式会社	36,000百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社徳島大正銀行	11,036百万円	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	
PayPay銀行株式会社	37,250百万円	
株式会社三井住友銀行 1	1,770,996百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	

株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	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。
全国信用協同組合連合会	111,875百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

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・計算事務などを行いません。

(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【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

載。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021年6月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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23日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスファンドTSPの2021年2月13日から2022年2月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスファンドTSPの2022年2月14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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、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 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 三 上 和 彦
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、

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