

【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】	2023年2月28日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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】	年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

（７）【申込期間】

2023年3月1日から2023年8月31日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

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

年1回

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

日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

主として、TOPIX(東証株価指数)に採用されているわが国の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、株価指数先物取引(TOPIX先物取引)などを活用する場合があります。

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

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

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

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

主な投資制限

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

分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、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に係る標章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に係る標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ・JPXは、TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・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。

信託金限度額

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

(2)【ファンドの沿革】

2004年11月30日

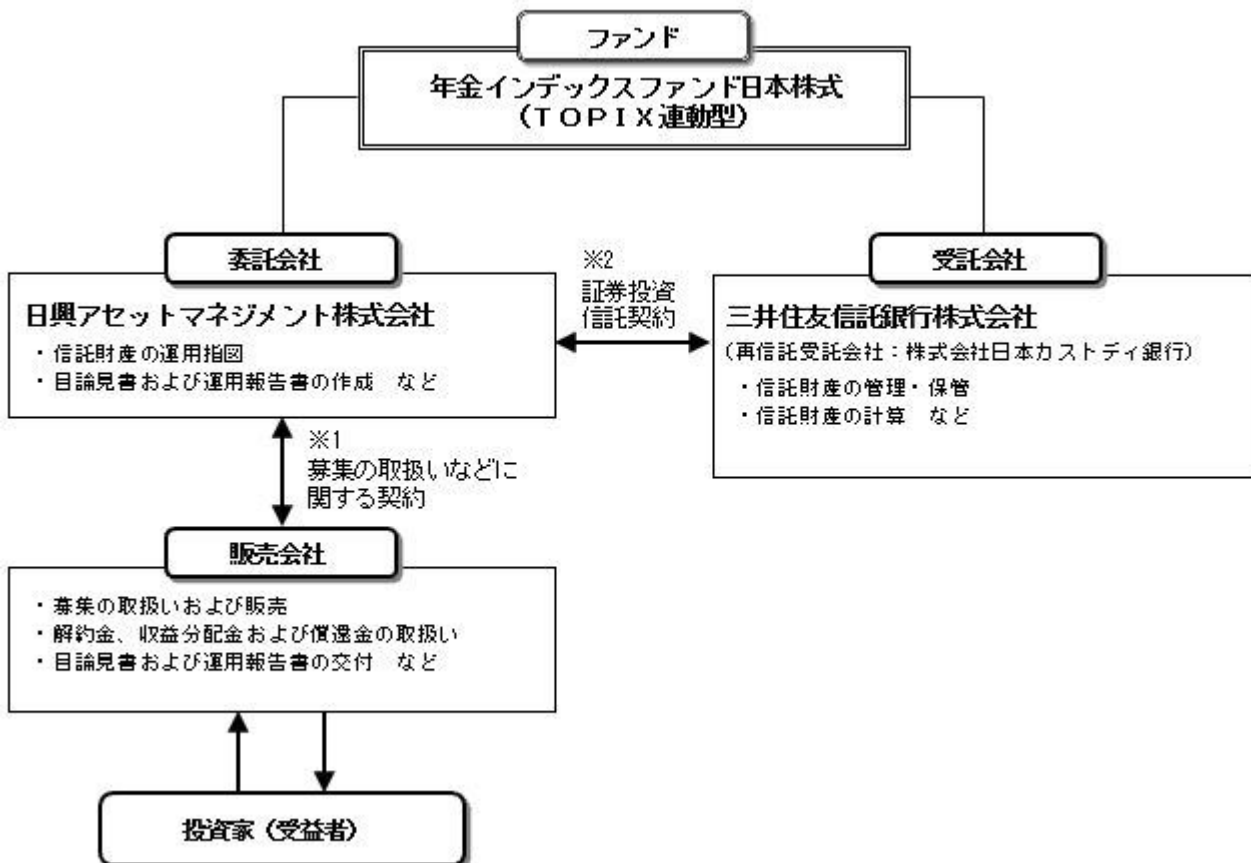
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2014年5月31日

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

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。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12月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

- ・主として、TOPIX（東証株価指数）に採用されているわが国の株式に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、株価指数先物取引など（TOPIX先物取引）を活用する場合があります。
- ・株式の実質組入比率は高位を保つことを原則とします。
- ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入

総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

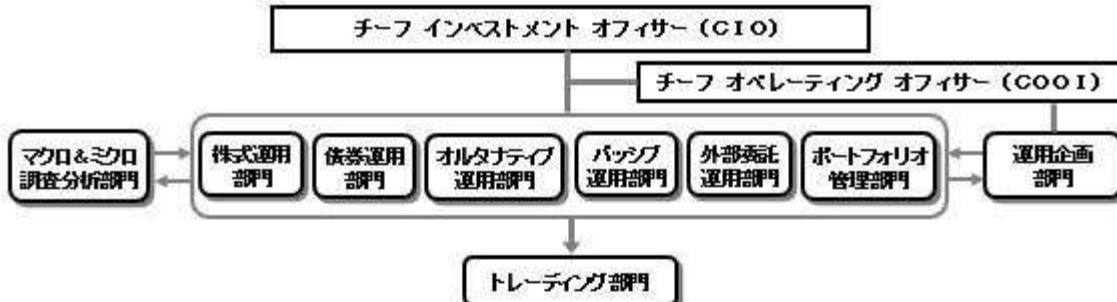
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

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

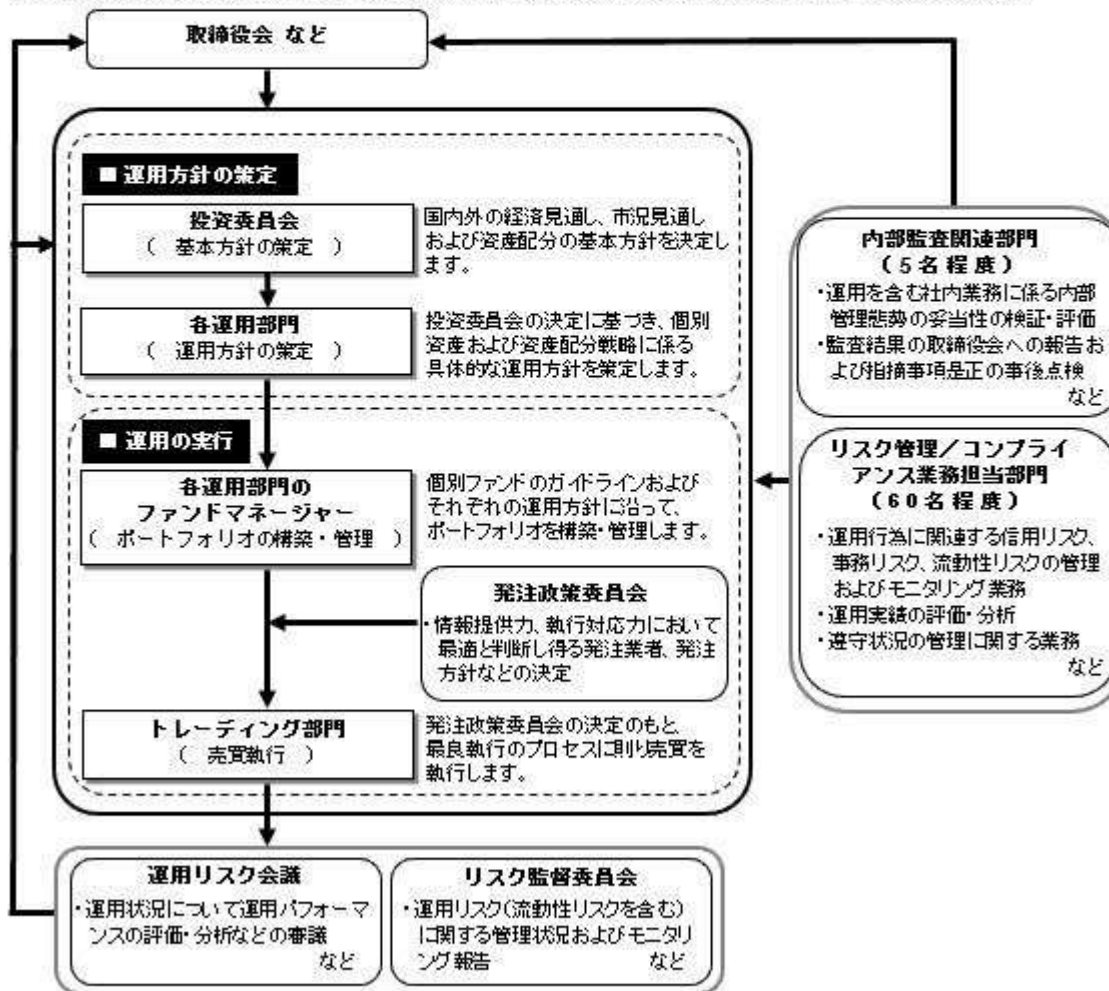
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 資金の借入

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行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12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

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

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

3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

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

- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 14) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 15) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

有価証券の貸付などにおけるリスク

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

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

- ・ T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行

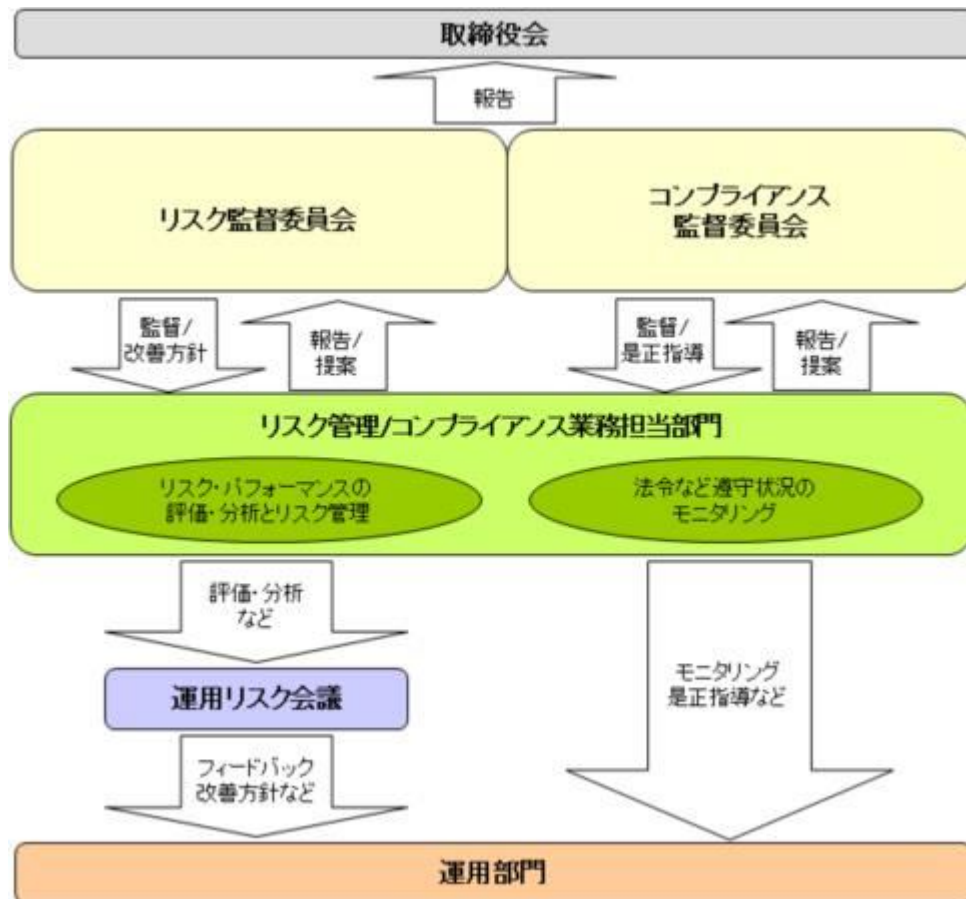
なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

- ・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
- ・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとTOPIX(東証株価指数)の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

<その他の留意事項>

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

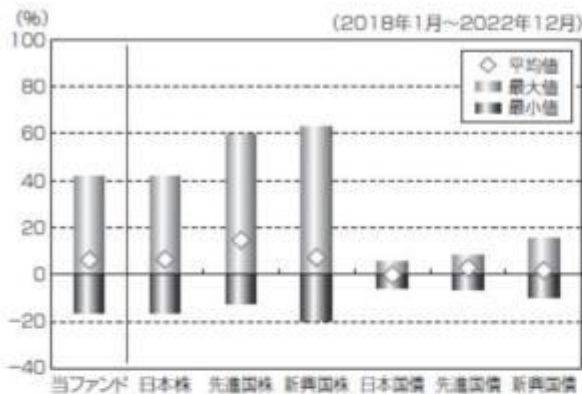
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)**当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較****(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))**

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.3%	6.5%	14.7%	7.3%	-0.1%	2.9%	1.8%
最大値	41.9%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-16.1%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-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2018年1月から2022年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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、2018年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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等の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等の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等の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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRC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・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%（税抜0.14%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.140%	0.052%	0.065%	0.023%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

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

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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

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

厚生年金基金および企業年金基金の場合

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

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

規約型企業年金の場合

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

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

上記以外の場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

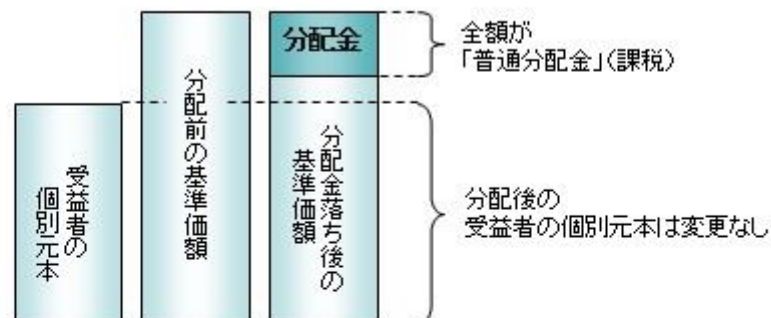
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

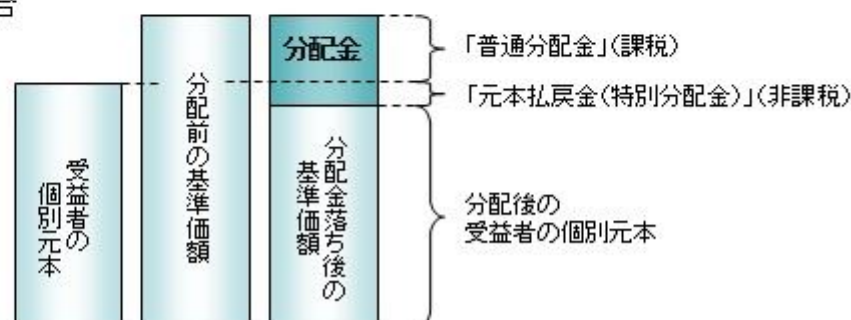
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2023年2月28日現在のもので、税法、確定給付企業年金法および確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【年金インデックスファンド日本株式(TOPPIX連動型)】

以下の運用状況は2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	81,457,649,320	98.14
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,540,943,115	1.86
合計（純資産総額）		82,998,592,435	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	1,551,030,000	1.87

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,640,900	2,111.30	3,464,442,012	1,812.50	2,974,131,250	3.58
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	211,400	11,991.73	2,535,052,100	10,035.00	2,121,399,000	2.56
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,868,700	728.87	1,362,039,369	889.00	1,661,274,300	2.00
日本	株式	キーエンス	電気機器	29,900	51,487.79	1,539,485,192	51,420.00	1,537,458,000	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	384,000	3,915.08	1,503,392,140	3,762.00	1,444,608,000	1.74
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	215,100	3,946.36	848,862,667	5,296.00	1,139,169,600	1.37
日本	株式	第一三共	医薬品	261,100	3,532.43	922,319,050	4,250.00	1,109,675,000	1.34
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	265,200	3,716.80	985,696,620	4,111.00	1,090,237,200	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	188,700	5,752.73	1,085,540,455	5,532.00	1,043,888,400	1.26
日本	株式	日立製作所	電気機器	151,500	6,720.61	1,018,172,717	6,691.00	1,013,686,500	1.22
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	173,300	5,385.11	933,240,170	5,644.00	978,105,200	1.18
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	227,400	4,699.42	1,068,648,210	4,177.00	949,849,800	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	231,600	4,466.96	1,034,549,671	3,982.00	922,231,200	1.11
日本	株式	三井物産	卸売業	231,300	3,235.19	748,300,954	3,853.00	891,198,900	1.07
日本	株式	三菱商事	卸売業	197,700	4,415.69	872,983,324	4,283.00	846,749,100	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	296,400	2,510.04	743,977,147	2,827.50	838,071,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	21,100	57,327.64	1,209,613,328	38,880.00	820,368,000	0.99
日本	株式	信越化学工業	化学	50,500	18,150.88	916,619,440	16,225.00	819,362,500	0.99

日本	株式	HOYA	精密機器	63,800	13,743.84	876,856,992	12,705.00	810,579,000	0.98
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	194,800	3,708.64	722,443,570	4,146.00	807,640,800	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	425,600	1,529.28	650,862,916	1,856.00	789,913,600	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	242,900	3,200.71	777,454,554	3,032.00	736,472,800	0.89
日本	株式	ダイキン工業	機械	36,000	20,840.83	750,269,962	20,200.00	727,200,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	481,500	1,481.87	713,525,172	1,488.00	716,472,000	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	32,500	19,222.26	624,723,680	19,160.00	622,700,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	109,000	5,419.08	590,680,012	5,660.00	616,940,000	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	90,600	8,226.77	745,345,952	6,588.00	596,872,800	0.72
日本	株式	ファナック	電気機器	29,300	21,134.76	619,248,468	19,835.00	581,165,500	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	287,200	2,063.20	592,551,206	2,006.50	576,266,800	0.69
日本	株式	S M C	機械	9,800	66,180.07	648,564,696	55,580.00	544,684,000	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.30
		建設業	1.94
		食料品	3.46
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.01
		医薬品	5.69
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.55
		機械	4.93
		電気機器	16.25
		輸送用機器	7.17
		精密機器	2.53
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.25
陸運業	3.08		
海運業	0.62		
空運業	0.51		
倉庫・運輸関連業	0.14		
情報・通信業	8.78		
卸売業	5.94		

	小売業	4.68
	銀行業	6.34
	証券、商品先物取引業	0.74
	保険業	2.50
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.93
	サービス業	5.27
合 計		98.14

【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 2023年03月	買建	82	日本円	1,566,565,100	1,551,030,000	1.87

(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9計算期間末 (2013年 5月31日)	18,870	18,886	1.1759	1.1769
第10計算期間末 (2014年 6月 2日)	18,195	18,210	1.2858	1.2868
第11計算期間末 (2015年 6月 1日)	27,517	27,532	1.7971	1.7981
第12計算期間末 (2016年 5月31日)	27,352	27,370	1.5035	1.5045
第13計算期間末 (2017年 5月31日)	33,130	33,149	1.7427	1.7437
第14計算期間末 (2018年 5月31日)	41,841	41,862	1.9775	1.9785
第15計算期間末 (2019年 5月31日)	40,637	40,661	1.7476	1.7486
第16計算期間末 (2020年 6月 1日)	58,379	58,411	1.8556	1.8566
第17計算期間末 (2021年 5月31日)	73,805	73,837	2.3196	2.3206
第18計算期間末 (2022年 5月31日)	79,224	79,258	2.3576	2.3586
2021年12月末日	79,140		2.4282	
2022年 1月末日	76,723		2.3106	
2月末日	75,844		2.3002	
3月末日	79,794		2.3987	
4月末日	78,301		2.3411	
5月末日	79,224		2.3576	

6月末日	78,450		2.3091
7月末日	81,105		2.3947
8月末日	82,030		2.4233
9月末日	78,773		2.2902
10月末日	83,380		2.4066
11月末日	86,158		2.4772
12月末日	82,998		2.3638

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	0.0010
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	0.0010
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	0.0010
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	0.0010
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	0.0010
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	0.0010
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	0.0010
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	0.0010
第17期	2020年 6月 2日～2021年 5月31日	0.0010
第18期	2021年 6月 1日～2022年 5月31日	0.0010
当中間期	2022年 6月 1日～2022年11月30日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	61.04
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	9.43
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	39.84
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	16.28
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	15.98
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	13.53
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	11.58
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	6.24
第17期	2020年 6月 2日～2021年 5月31日	25.06
第18期	2021年 6月 1日～2022年 5月31日	1.68
当中間期	2022年 6月 1日～2022年11月30日	5.07

(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】

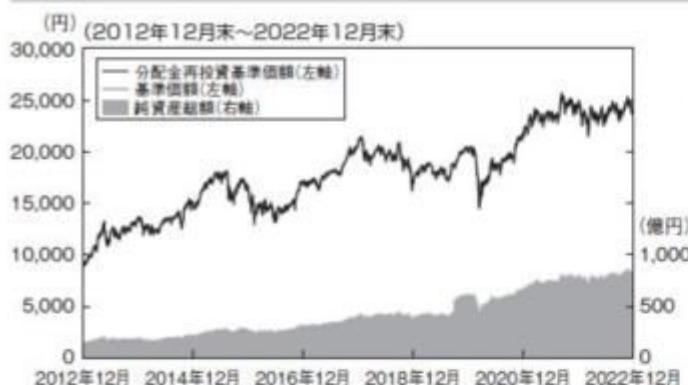
期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	4,667,083,142	5,475,394,820
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	5,541,023,939	7,437,910,957
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	6,052,501,542	4,891,151,568
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	7,174,553,570	4,294,430,475
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	5,730,325,471	4,911,678,612
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	6,496,323,254	4,348,409,754
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	6,092,908,576	3,998,730,448
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	14,798,267,469	6,589,455,296
第17期	2020年 6月 2日～2021年 5月31日	7,669,720,398	7,313,401,343
第18期	2021年 6月 1日～2022年 5月31日	8,929,522,774	7,143,557,850
当中間期	2022年 6月 1日～2022年11月30日	4,292,997,558	3,117,189,483

参考情報

運用実績

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額23,638円

純資産総額829.98億円

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

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2018年5月	2019年5月	2020年6月	2021年5月	2022年5月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	150円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	98.14%
株式先物	1.87%
現金その他	1.86%

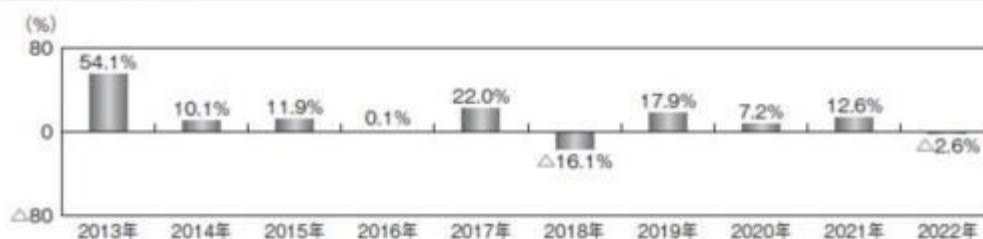
※対純資産総額比です。

<組入上位10銘柄>

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.58%
2	ソニーグループ	電気機器	2.56%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.00%
4	キーエンス	電気機器	1.85%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.74%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.37%
7	第一三共	医薬品	1.34%
8	武田薬品工業	医薬品	1.31%
9	任天堂	その他製品	1.26%
10	日立製作所	電気機器	1.22%

※対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

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

合は、当該規定に従うものとしします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

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

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

税法または確定給付企業年金法および確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

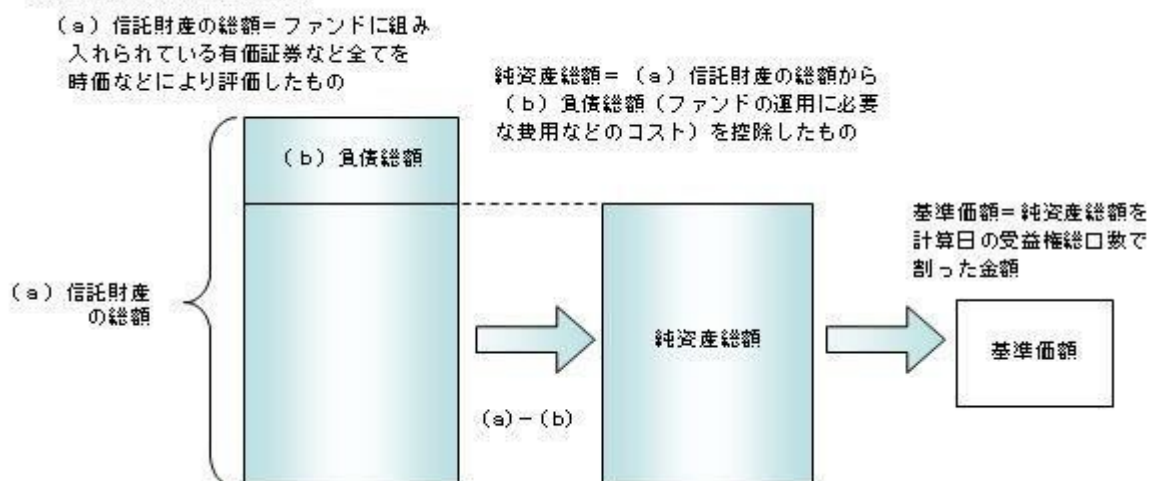
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

国内上場株式

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします(2004年11月30日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年6月1日から翌年5月31日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

信託約款の変更

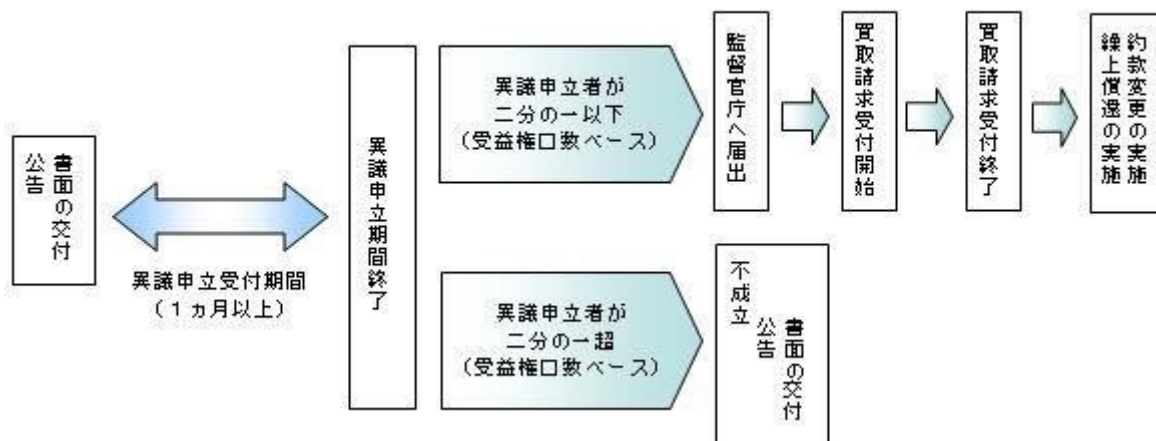
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4)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

異議の申立て

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

還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間（2021年6月1日から2022年5月31日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 2021年 5月31日現在	第18期 2022年 5月31日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,706,324,590	-
コール・ローン	957,210,910	11,398,889,598
株式	72,400,851,110	77,296,613,600
派生商品評価勘定	10,179,200	29,858,650
未収入金	64,435,700	735,897,310
未収配当金	626,003,355	840,727,250
未収利息	-	885,496
その他未収収益	9,902,167	36,016,079
流動資産合計	78,774,907,032	90,338,887,983
資産合計		
	78,774,907,032	90,338,887,983
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,044,900	6,812,600
前受金	19,605,000	37,106,500
未払金	8,675,900	735,915,670
未払収益分配金	31,818,315	33,604,280
未払解約金	140,236,477	130,698,420
未払受託者報酬	9,415,937	10,435,331
未払委託者報酬	46,909,914	51,775,146
未払利息	327	619
受入担保金	4,706,324,590	10,106,157,171
その他未払費用	1,555,106	1,705,688
流動負債合計	4,969,586,466	11,114,211,425
負債合計		
	4,969,586,466	11,114,211,425
純資産の部		
元本等		
元本	31,818,315,240	33,604,280,164
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,987,005,326	45,620,396,394
（分配準備積立金）	16,244,494,561	14,629,975,004
元本等合計	73,805,320,566	79,224,676,558
純資産合計		
	73,805,320,566	79,224,676,558
負債純資産合計		
	78,774,907,032	90,338,887,983

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2020年 6月 2日 至 2021年 5月31日	自	2021年 6月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益				
受取配当金		1,407,354,929		1,746,903,431
受取利息		350		2,351,392
有価証券売買等損益		13,058,063,312		526,181,708
派生商品取引等損益		123,431,550		13,380,450
その他収益		36,608,605		141,953,679
営業収益合計		14,625,458,746		1,346,943,560
営業費用				
支払利息		98,720		-
受託者報酬		17,501,873		20,787,229
委託者報酬		86,949,537		103,240,935
その他費用		7,354,062		10,030,482
営業費用合計		111,904,192		134,058,646
営業利益又は営業損失（ ）		14,513,554,554		1,212,884,914
経常利益又は経常損失（ ）		14,513,554,554		1,212,884,914
当期純利益又は当期純損失（ ）		14,513,554,554		1,212,884,914
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（ ）		1,622,735,466		374,519,117
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		26,917,916,540		41,987,005,326
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,581,535,838		12,318,304,528
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,581,535,838		12,318,304,528
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,371,447,825		9,489,674,977
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,371,447,825		9,489,674,977
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		31,818,315		33,604,280
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		41,987,005,326		45,620,396,394

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

（ 貸借対照表に関する注記 ）

		第17期 2021年 5月31日現在	第18期 2022年 5月31日現在
1.	期首元本額	31,461,996,185円	31,818,315,240円
	期中追加設定元本額	7,669,720,398円	8,929,522,774円
	期中一部解約元本額	7,313,401,343円	7,143,557,850円
2.	受益権の総数	31,818,315,240口	33,604,280,164口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	930,928,700円	822,518,180円
	4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	4,499,684,650円

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第17期 自 2020年 6月 2日 至 2021年 5月31日		第18期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月31日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	1,313,882,923円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 1,617,658,506円

B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	9,002,684,853円	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	42,588,488,423円	C 信託約款に定める収益調整金	49,267,576,302円
D 信託約款に定める分配準備積立金	5,959,745,100円	D 信託約款に定める分配準備積立金	13,045,920,778円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	58,864,801,299円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	63,931,155,586円
F 分配対象収益(1万口当たり)	18,500円	F 分配対象収益(1万口当たり)	19,024円
G 分配金額	31,818,315円	G 分配金額	33,604,280円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第17期 自 2020年 6月 2日 至 2021年 5月31日	第18期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月31日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第17期 2021年 5月31日現在	第18期 2022年 5月31日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(2)デリバティブ取引 「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。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

第17期（2021年 5月31日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	12,442,951,423
合計	12,442,951,423

第18期（2022年 5月31日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	477,771,249
合計	477,771,249

（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17期（2021年 5月31日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	1,421,915,000	-	1,427,090,000	5,175,000
	合計	1,421,915,000	-	1,427,090,000	5,175,000

第18期（2022年 5月31日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,943,167,300	-	1,966,270,000	23,102,700
	合計	1,943,167,300	-	1,966,270,000	23,102,700

（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17期 2021年 5月31日現在		第18期 2022年 5月31日現在	
1口当たり純資産額	2.3196円	1口当たり純資産額	2.3576円
(1万口当たり純資産額)	(23,196円)	(1万口当たり純資産額)	(23,576円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,400	3,330.00	4,662,000	貸付有価証券 900株
日本水産	39,800	521.00	20,735,800	

マルハニチロ	5,900	2,233.00	13,174,700	貸付有価証券 1,500株
雪国まいたけ	3,100	851.00	2,638,100	貸付有価証券 2,100株
カネコ種苗	1,200	1,806.00	2,167,200	
サカタのタネ	4,700	4,430.00	20,821,000	貸付有価証券 3,300株
ホクト	3,300	1,905.00	6,286,500	貸付有価証券 100株
ホクリヨウ	500	631.00	315,500	貸付有価証券 300株
住石ホールディングス	7,800	206.00	1,606,800	貸付有価証券 200株
日鉄鉱業	900	5,880.00	5,292,000	
三井松島ホールディングス	1,800	2,991.00	5,383,800	貸付有価証券 1,100株
I N P E X	150,100	1,679.00	252,017,900	貸付有価証券 111,900株
石油資源開発	4,900	3,155.00	15,459,500	
K & O エナジーグループ	1,700	1,573.00	2,674,100	
ショーボンドホールディングス	5,200	5,780.00	30,056,000	貸付有価証券 3,500株
ミライト・ホールディングス	13,500	1,616.00	21,816,000	貸付有価証券 700株
タマホーム	2,500	2,373.00	5,932,500	貸付有価証券 1,500株
サンヨーホームズ	700	741.00	518,700	貸付有価証券 300株
日本アクア	1,700	637.00	1,082,900	
ファーストコーポレーション	1,200	731.00	877,200	貸付有価証券 200株
ベステラ	900	1,220.00	1,098,000	貸付有価証券 500株
Robot Home	7,200	194.00	1,396,800	貸付有価証券 3,800株
キャンディル	1,000	532.00	532,000	貸付有価証券 400株
ダイセキ環境ソリューション	800	962.00	769,600	貸付有価証券 500株
第一カッター興業	900	1,303.00	1,172,700	
安藤・間	19,600	788.00	15,444,800	
東急建設	11,600	584.00	6,774,400	
コムシスホールディングス	13,500	2,424.00	32,724,000	貸付有価証券 600株
ピーアールホールディングス	5,400	321.00	1,733,400	貸付有価証券 2,600株
高松コンストラクショングループ	2,600	2,066.00	5,371,600	貸付有価証券 1,700株
東建コーポレーション	1,200	8,600.00	10,320,000	貸付有価証券 800株

ソネック	500	1,007.00	503,500	貸付有価証券 200株
ヤマウラ	2,000	933.00	1,866,000	貸付有価証券 1,300株
オリエンタル白石	14,300	238.00	3,403,400	
大成建設	26,200	3,850.00	100,870,000	貸付有価証券 2,400株
大林組	91,900	913.00	83,904,700	貸付有価証券 3,700株
清水建設	85,400	685.00	58,499,000	貸付有価証券 8,300株
飛鳥建設	2,600	1,005.00	2,613,000	
長谷工コーポレーション	26,800	1,540.00	41,272,000	貸付有価証券 2,300株
松井建設	3,400	684.00	2,325,600	
銭高組	400	3,615.00	1,446,000	
鹿島建設	67,300	1,386.00	93,277,800	貸付有価証券 400株
不動テトラ	2,100	1,578.00	3,313,800	
大末建設	1,100	1,555.00	1,710,500	
鉄建建設	2,000	1,788.00	3,576,000	
西松建設	5,800	4,110.00	23,838,000	貸付有価証券 1,600株
三井住友建設	22,100	435.00	9,613,500	
大豊建設	1,400	4,420.00	6,188,000	貸付有価証券 800株
佐田建設	2,000	472.00	944,000	
ナカノフドー建設	2,100	311.00	653,100	貸付有価証券 300株
奥村組	5,100	2,840.00	14,484,000	
東鉄工業	4,100	2,164.00	8,872,400	
イチケン	700	1,857.00	1,299,900	
富士ピー・エス	1,400	513.00	718,200	貸付有価証券 900株
浅沼組	1,100	5,240.00	5,764,000	
戸田建設	38,000	676.00	25,688,000	貸付有価証券 6,000株
熊谷組	4,800	2,628.00	12,614,400	
北野建設	600	2,144.00	1,286,400	
植木組	800	1,469.00	1,175,200	貸付有価証券 500株
矢作建設工業	4,000	786.00	3,144,000	
ピーエス三菱	3,200	602.00	1,926,400	
日本ハウスホールディングス	6,600	421.00	2,778,600	貸付有価証券 4,200株
大東建託	9,900	11,400.00	112,860,000	貸付有価証券 800株
新日本建設	4,100	741.00	3,038,100	

東亜道路工業	500	5,350.00	2,675,000	
日本道路	800	6,400.00	5,120,000	貸付有価証券 500株
東亜建設工業	2,200	2,355.00	5,181,000	
日本国土開発	8,100	510.00	4,131,000	貸付有価証券 200株
若築建設	1,500	1,996.00	2,994,000	
東洋建設	10,800	833.00	8,996,400	貸付有価証券 7,200株
五洋建設	36,500	634.00	23,141,000	
世紀東急工業	4,600	805.00	3,703,000	
福田組	1,000	4,565.00	4,565,000	貸付有価証券 600株
住友林業	22,300	1,980.00	44,154,000	貸付有価証券 16,200株
日本基礎技術	2,500	600.00	1,500,000	
巴コーポレーション	4,000	424.00	1,696,000	貸付有価証券 100株
大和ハウス工業	80,600	3,105.00	250,263,000	貸付有価証券 200株
ライト工業	5,600	1,681.00	9,413,600	
積水ハウス	95,900	2,282.50	218,891,750	貸付有価証券 47,400株
日特建設	2,000	773.00	1,546,000	
北陸電気工事	1,900	772.00	1,466,800	
ユアテック	5,500	681.00	3,745,500	貸付有価証券 100株
日本リーテック	1,900	1,075.00	2,042,500	
四電工	900	1,694.00	1,524,600	
中電工	4,100	2,070.00	8,487,000	
関電工	15,700	802.00	12,591,400	
きんでん	20,300	1,485.00	30,145,500	貸付有価証券 300株
東京エネシス	3,000	937.00	2,811,000	
トーエネック	1,000	3,405.00	3,405,000	
住友電設	2,400	2,337.00	5,608,800	
日本電設工業	4,500	1,586.00	7,137,000	
エクシオグループ	13,800	2,065.00	28,497,000	
新日本空調	2,200	1,826.00	4,017,200	
九電工	6,500	2,674.00	17,381,000	
三機工業	6,400	1,448.00	9,267,200	
日揮ホールディングス	28,100	1,809.00	50,832,900	
中外炉工業	900	1,686.00	1,517,400	
ヤマト	2,400	757.00	1,816,800	
太平電業	1,900	2,742.00	5,209,800	
高砂熱学工業	7,800	1,552.00	12,105,600	

三晃金属工業	400	2,781.00	1,112,400	
朝日工業社	1,200	1,603.00	1,923,600	
明星工業	5,200	726.00	3,775,200	貸付有価証券 3,600株
大気社	4,200	3,035.00	12,747,000	貸付有価証券 1,000株
ダイダン	1,900	2,044.00	3,883,600	
日比谷総合設備	2,800	1,890.00	5,292,000	
フィル・カンパニー	500	1,193.00	596,500	貸付有価証券 200株
テスホールディングス	2,700	1,356.00	3,661,200	貸付有価証券 1,800株
インフロニア・ホールディングス	37,400	932.00	34,856,800	貸付有価証券 4,300株
東洋エンジニアリング	4,100	620.00	2,542,000	貸付有価証券 2,800株
レイズネクスト	4,300	1,157.00	4,975,100	
ニッポン	8,000	1,562.00	12,496,000	貸付有価証券 900株
日清製粉グループ本社	31,000	1,506.00	46,686,000	貸付有価証券 1,900株
日東富士製粉	400	4,380.00	1,752,000	
昭和産業	2,600	2,398.00	6,234,800	
鳥越製粉	2,300	644.00	1,481,200	
中部飼料	3,400	1,026.00	3,488,400	貸付有価証券 100株
フィード・ワン	3,800	659.00	2,504,200	
東洋精糖	400	951.00	380,400	
日本甜菜製糖	1,600	1,666.00	2,665,600	
D M三井製糖ホールディングス	2,600	1,856.00	4,825,600	貸付有価証券 800株
塩水港精糖	3,600	212.00	763,200	貸付有価証券 2,600株
日新製糖	1,500	1,750.00	2,625,000	
森永製菓	6,600	3,920.00	25,872,000	貸付有価証券 200株
中村屋	700	3,045.00	2,131,500	貸付有価証券 400株
江崎グリコ	7,600	3,715.00	28,234,000	貸付有価証券 5,600株
名糖産業	1,200	1,620.00	1,944,000	貸付有価証券 900株
井村屋グループ	1,600	2,342.00	3,747,200	
不二家	1,700	2,342.00	3,981,400	貸付有価証券 1,100株
山崎製パン	20,300	1,498.00	30,409,400	貸付有価証券 4,800株
第一屋製パン	700	516.00	361,200	貸付有価証券 400株

モロゾフ	900	3,280.00	2,952,000	貸付有価証券 600株
亀田製菓	1,700	4,290.00	7,293,000	
寿スピリッツ	2,800	7,100.00	19,880,000	
カルビー	14,100	2,382.00	33,586,200	貸付有価証券 200株
森永乳業	5,400	4,625.00	24,975,000	
六甲バター	2,200	1,432.00	3,150,400	
ヤクルト本社	20,700	7,090.00	146,763,000	
明治ホールディングス	18,000	6,340.00	114,120,000	貸付有価証券 100株
雪印メグミルク	7,000	1,722.00	12,054,000	
プリマハム	3,900	2,109.00	8,225,100	
日本ハム	11,100	3,920.00	43,512,000	
林兼産業	800	507.00	405,600	
丸大食品	2,900	1,475.00	4,277,500	
S Foods	2,800	3,020.00	8,456,000	貸付有価証券 1,800株
柿安本店	1,100	2,437.00	2,680,700	貸付有価証券 300株
伊藤ハム米久ホールディングス	19,900	641.00	12,755,900	貸付有価証券 2,300株
サッポロホールディングス	9,500	2,794.00	26,543,000	貸付有価証券 2,200株
アサヒグループホールディングス	66,200	4,340.00	287,308,000	貸付有価証券 7,500株
キリンホールディングス	113,500	1,992.50	226,148,750	貸付有価証券 72,400株
宝ホールディングス	18,400	957.00	17,608,800	
オエノンホールディングス	8,500	299.00	2,541,500	貸付有価証券 100株
養命酒製造	800	1,754.00	1,403,200	貸付有価証券 600株
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	20,400	1,370.00	27,948,000	貸付有価証券 10,600株
サントリー食品インターナショナル	20,700	4,815.00	99,670,500	貸付有価証券 13,700株
ダイドーグループホールディングス	1,600	4,815.00	7,704,000	貸付有価証券 700株
伊藤園	9,400	5,470.00	51,418,000	貸付有価証券 6,300株
キーコーヒー	2,900	2,061.00	5,976,900	貸付有価証券 2,000株
ユニカフェ	1,000	932.00	932,000	貸付有価証券 700株
ジャパンフーズ	600	1,180.00	708,000	貸付有価証券 400株
日清オイリオグループ	3,600	2,971.00	10,695,600	
不二製油グループ本社	6,700	1,753.00	11,745,100	

かどや製油	300	3,450.00	1,035,000	貸付有価証券 200株
J - オイルミルズ	2,900	1,520.00	4,408,000	貸付有価証券 1,900株
キッコーマン	19,800	6,860.00	135,828,000	貸付有価証券 1,700株
味の素	63,300	3,134.00	198,382,200	貸付有価証券 100株
ブルドックソース	1,200	1,834.00	2,200,800	貸付有価証券 800株
キューピー	14,400	2,127.00	30,628,800	貸付有価証券 200株
ハウス食品グループ本社	10,300	2,690.00	27,707,000	貸付有価証券 1,300株
カゴメ	11,700	3,265.00	38,200,500	貸付有価証券 6,900株
焼津水産化学工業	1,300	914.00	1,188,200	
アリアケジャパン	2,800	4,895.00	13,706,000	
ピエトロ	400	1,803.00	721,200	貸付有価証券 200株
エバラ食品工業	700	2,996.00	2,097,200	貸付有価証券 400株
やまみ	300	1,564.00	469,200	貸付有価証券 100株
ニチレイ	12,400	2,268.00	28,123,200	
東洋水産	14,100	4,815.00	67,891,500	
イトアンドホールディングス	1,200	2,310.00	2,772,000	貸付有価証券 700株
大冷	300	1,900.00	570,000	貸付有価証券 200株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,600	553.00	884,800	貸付有価証券 900株
日清食品ホールディングス	10,600	8,420.00	89,252,000	
永谷園ホールディングス	1,400	1,993.00	2,790,200	貸付有価証券 900株
一正蒲鉾	1,300	832.00	1,081,600	貸付有価証券 900株
フジッコ	2,900	1,895.00	5,495,500	貸付有価証券 200株
ロック・フィールド	3,200	1,400.00	4,480,000	貸付有価証券 2,200株
日本たばこ産業	165,600	2,340.50	387,586,800	貸付有価証券 109,800株
ケンコーマヨネーズ	1,600	1,345.00	2,152,000	貸付有価証券 1,100株
わらべや日洋ホールディングス	1,900	1,648.00	3,131,200	貸付有価証券 1,300株
なとり	1,700	1,997.00	3,394,900	貸付有価証券 1,100株
イフジ産業	500	1,005.00	502,500	貸付有価証券 300株

ピククルスコーポレーション	1,500	1,327.00	1,990,500	
ファーマフーズ	3,900	1,581.00	6,165,900	貸付有価証券 2,600株
ユーグレナ	15,900	859.00	13,658,100	貸付有価証券 10,800株
紀文食品	2,400	982.00	2,356,800	
ミヨシ油脂	1,100	1,047.00	1,151,700	貸付有価証券 700株
理研ビタミン	2,800	1,613.00	4,516,400	貸付有価証券 1,000株
片倉工業	2,900	2,116.00	6,136,400	貸付有価証券 2,100株
グンゼ	1,800	3,665.00	6,597,000	
東洋紡	11,900	1,027.00	12,221,300	貸付有価証券 3,200株
ユニチカ	8,300	235.00	1,950,500	貸付有価証券 5,000株
富士紡ホールディングス	1,300	3,425.00	4,452,500	
倉敷紡績	2,300	1,929.00	4,436,700	
シキボウ	1,500	908.00	1,362,000	
日本毛織	8,000	920.00	7,360,000	貸付有価証券 6,000株
ダイトウボウ	6,600	92.00	607,200	貸付有価証券 3,900株
トーア紡コーポレーション	1,200	380.00	456,000	
ガイドーリミテッド	5,500	138.00	759,000	貸付有価証券 3,500株
帝国繊維	3,200	1,548.00	4,953,600	貸付有価証券 700株
帝人	27,100	1,325.00	35,907,500	
東レ	197,400	666.30	131,527,620	貸付有価証券 8,800株
住江織物	600	1,680.00	1,008,000	貸付有価証券 400株
日本フェルト	1,900	428.00	813,200	貸付有価証券 1,300株
イチカワ	300	1,389.00	416,700	貸付有価証券 100株
日東製網	300	1,360.00	408,000	貸付有価証券 100株
アツギ	2,300	528.00	1,214,400	
ダイニック	900	687.00	618,300	
セーレン	5,800	2,047.00	11,872,600	貸付有価証券 4,100株
ソトー	1,300	880.00	1,144,000	
東海染工	500	1,152.00	576,000	
小松マテーレ	4,700	1,337.00	6,283,900	
ワコールホールディングス	6,700	1,990.00	13,333,000	
ホギメディカル	3,900	3,055.00	11,914,500	

TSIホールディングス	9,500	328.00	3,116,000	
マツオカコーポレーション	900	1,007.00	906,300	
ワールド	3,900	1,421.00	5,541,900	
三陽商会	1,400	900.00	1,260,000	
ナイガイ	1,200	304.00	364,800	貸付有価証券 800株
オンワードホールディングス	17,100	261.00	4,463,100	貸付有価証券 4,200株
ルックホールディングス	1,000	1,573.00	1,573,000	
ゴールドウイン	5,100	7,920.00	40,392,000	貸付有価証券 300株
デサント	5,400	2,553.00	13,786,200	
キング	1,500	540.00	810,000	貸付有価証券 900株
ヤマトインターナショナル	2,400	285.00	684,000	貸付有価証券 1,800株
特種東海製紙	1,700	3,225.00	5,482,500	
王子ホールディングス	119,500	567.00	67,756,500	
日本製紙	13,000	943.00	12,259,000	貸付有価証券 9,100株
三菱製紙	4,100	300.00	1,230,000	貸付有価証券 1,300株
北越コーポレーション	18,600	609.00	11,327,400	貸付有価証券 11,300株
中越パルプ工業	1,100	907.00	997,700	貸付有価証券 700株
巴川製紙所	1,000	621.00	621,000	
大王製紙	13,500	1,419.00	19,156,500	貸付有価証券 100株
阿波製紙	900	317.00	285,300	貸付有価証券 400株
レンゴー	25,000	694.00	17,350,000	
トモク	1,600	1,457.00	2,331,200	貸付有価証券 1,000株
ザ・バック	2,000	2,323.00	4,646,000	
北の達人コーポレーション	10,800	179.00	1,933,200	貸付有価証券 7,400株
クラレ	41,800	1,075.00	44,935,000	貸付有価証券 28,800株
旭化成	190,800	1,043.00	199,004,400	貸付有価証券 25,700株
共和レザー	1,700	583.00	991,100	
昭和電工	26,400	2,490.00	65,736,000	
住友化学	210,800	531.00	111,934,800	貸付有価証券 2,900株
住友精化	1,200	2,903.00	3,483,600	
日産化学	14,600	7,280.00	106,288,000	貸付有価証券 300株
ラサ工業	1,100	1,925.00	2,117,500	

クレハ	2,300	10,210.00	23,483,000	貸付有価証券 900株
多木化学	1,100	4,520.00	4,972,000	貸付有価証券 700株
テイカ	1,900	1,230.00	2,337,000	
石原産業	5,300	1,037.00	5,496,100	
片倉コープアグリ	800	1,359.00	1,087,200	
日本曹達	3,500	4,000.00	14,000,000	
東ソー	39,300	1,875.00	73,687,500	貸付有価証券 300株
トクヤマ	9,200	1,674.00	15,400,800	
セントラル硝子	4,700	2,808.00	13,197,600	
東亜合成	15,200	1,024.00	15,564,800	
大阪ソーダ	2,500	2,996.00	7,490,000	
関東電化工業	5,900	929.00	5,481,100	
デンカ	10,400	3,195.00	33,228,000	
信越化学工業	49,100	18,335.00	900,248,500	貸付有価証券 1,800株
日本カーバイド工業	1,100	1,428.00	1,570,800	
堺化学工業	2,000	1,903.00	3,806,000	貸付有価証券 200株
第一稀元素化学工業	2,700	1,052.00	2,840,400	
エア・ウォーター	25,600	1,746.00	44,697,600	貸付有価証券 200株
日本酸素ホールディングス	26,200	2,424.00	63,508,800	貸付有価証券 400株
日本化学工業	900	2,099.00	1,889,100	
日本パーカライズン	13,500	920.00	12,420,000	
高压ガス工業	4,400	654.00	2,877,600	
四国化成工業	3,600	1,255.00	4,518,000	
戸田工業	700	2,638.00	1,846,600	貸付有価証券 400株
ステラ ケミファ	1,500	2,551.00	3,826,500	
保土谷化学工業	900	3,660.00	3,294,000	貸付有価証券 200株
日本触媒	4,500	5,280.00	23,760,000	
大日精化工業	2,300	1,854.00	4,264,200	
カネカ	6,900	3,310.00	22,839,000	貸付有価証券 100株
三菱瓦斯化学	25,200	2,091.00	52,693,200	貸付有価証券 100株
三井化学	24,800	3,155.00	78,244,000	
J S R	28,100	4,080.00	114,648,000	
東京応化工業	4,600	7,390.00	33,994,000	貸付有価証券 3,300株
大阪有機化学工業	2,300	2,780.00	6,394,000	

三菱ケミカルホールディングス	191,800	766.20	146,957,160	貸付有価証券 3,600株
KHネオケム	4,700	2,536.00	11,919,200	貸付有価証券 3,200株
ダイセル	41,500	831.00	34,486,500	
住友ベークライト	4,400	4,345.00	19,118,000	
積水化学工業	60,100	1,850.00	111,185,000	
日本ゼオン	24,200	1,368.00	33,105,600	
アイカ工業	7,500	2,794.00	20,955,000	貸付有価証券 800株
UBE	14,200	1,982.00	28,144,400	
積水樹脂	4,300	1,680.00	7,224,000	
タキロンシーアイ	6,500	524.00	3,406,000	貸付有価証券 100株
旭有機材	1,700	2,080.00	3,536,000	
ニチバン	1,700	1,615.00	2,745,500	
リケンテクノス	6,600	433.00	2,857,800	
大倉工業	1,400	1,701.00	2,381,400	貸付有価証券 900株
積水化成成品工業	3,500	405.00	1,417,500	貸付有価証券 100株
群栄化学工業	600	2,701.00	1,620,600	
タイガースポリマー	1,500	429.00	643,500	
ミライアル	1,000	1,837.00	1,837,000	貸付有価証券 100株
ダイキアクシス	1,300	767.00	997,100	貸付有価証券 800株
ダイキョーニシカワ	6,400	485.00	3,104,000	貸付有価証券 4,200株
竹本容器	1,100	816.00	897,600	貸付有価証券 600株
森六ホールディングス	1,500	1,885.00	2,827,500	
恵和	800	4,725.00	3,780,000	
日本化薬	21,700	1,113.00	24,152,100	貸付有価証券 1,000株
カーリットホールディングス	2,700	679.00	1,833,300	貸付有価証券 2,000株
日本精化	2,100	2,039.00	4,281,900	貸付有価証券 200株
扶桑化学工業	2,500	3,850.00	9,625,000	
トリケミカル研究所	3,100	2,575.00	7,982,500	
ADEKA	12,600	2,524.00	31,802,400	貸付有価証券 5,200株
日油	9,200	4,915.00	45,218,000	
新日本理化	4,700	253.00	1,189,100	貸付有価証券 200株
ハリマ化成グループ	2,100	766.00	1,608,600	

花王	65,000	5,196.00	337,740,000	貸付有価証券 45,200株
第一工業製薬	1,100	2,255.00	2,480,500	
石原ケミカル	1,500	1,300.00	1,950,000	貸付有価証券 900株
日華化学	1,000	817.00	817,000	貸付有価証券 700株
ニイタカ	600	2,190.00	1,314,000	貸付有価証券 400株
三洋化成工業	1,800	4,630.00	8,334,000	
有機合成薬品工業	2,200	282.00	620,400	貸付有価証券 1,400株
大日本塗料	3,600	756.00	2,721,600	貸付有価証券 2,500株
日本ペイントホールディングス	113,200	958.00	108,445,600	貸付有価証券 34,000株
関西ペイント	27,800	1,603.00	44,563,400	
中国塗料	6,700	852.00	5,708,400	
日本特殊塗料	2,000	944.00	1,888,000	
藤倉化成	3,800	478.00	1,816,400	貸付有価証券 100株
太陽ホールディングス	4,400	3,260.00	14,344,000	
D I C	11,500	2,478.00	28,497,000	
サカタインクス	6,000	918.00	5,508,000	
東洋インキ S C ホールディングス	6,000	1,908.00	11,448,000	貸付有価証券 4,200株
T & K T O K A	2,400	833.00	1,999,200	貸付有価証券 1,600株
富士フイルムホールディングス	54,100	7,107.00	384,488,700	
資生堂	57,300	5,426.00	310,909,800	貸付有価証券 5,300株
ライオン	32,600	1,439.00	46,911,400	貸付有価証券 24,400株
高砂香料工業	1,900	2,325.00	4,417,500	
マンダム	6,200	1,417.00	8,785,400	貸付有価証券 600株
ミルボン	3,800	5,110.00	19,418,000	貸付有価証券 400株
ファンケル	12,500	2,173.00	27,162,500	貸付有価証券 900株
コーセー	5,800	11,680.00	67,744,000	貸付有価証券 300株
コタ	2,200	1,437.00	3,161,400	
シーボン	500	1,751.00	875,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	13,100	1,578.00	20,671,800	貸付有価証券 8,500株
ノエビアホールディングス	2,400	5,510.00	13,224,000	貸付有価証券 800株
アジュバンホールディングス	700	1,022.00	715,400	

新日本製薬	1,300	1,331.00	1,730,300	
エステー	2,000	1,460.00	2,920,000	貸付有価証券 500株
アグロ カネショウ	1,100	1,302.00	1,432,200	貸付有価証券 600株
コニシ	4,800	1,607.00	7,713,600	
長谷川香料	5,300	2,471.00	13,096,300	貸付有価証券 100株
星光PMC	1,700	569.00	967,300	
小林製薬	8,600	8,650.00	74,390,000	貸付有価証券 3,100株
荒川化学工業	2,300	1,001.00	2,302,300	
メック	2,200	2,862.00	6,296,400	貸付有価証券 1,400株
日本高純度化学	700	2,344.00	1,640,800	
タカラバイオ	8,100	1,824.00	14,774,400	貸付有価証券 1,600株
JCU	3,200	3,705.00	11,856,000	
新田ゼラチン	1,800	630.00	1,134,000	貸付有価証券 600株
OATアグリオ	1,300	1,640.00	2,132,000	貸付有価証券 100株
デクセリアルズ	8,000	4,350.00	34,800,000	貸付有価証券 1,000株
アース製薬	2,500	5,130.00	12,825,000	貸付有価証券 200株
北興化学工業	2,700	1,009.00	2,724,300	
大成ラミック	900	2,670.00	2,403,000	
クミアイ化学工業	11,500	1,007.00	11,580,500	
日本農薬	5,500	703.00	3,866,500	
アキレス	2,000	1,342.00	2,684,000	
有沢製作所	4,300	1,094.00	4,704,200	
日東電工	18,600	9,350.00	173,910,000	貸付有価証券 100株
レック	3,800	701.00	2,663,800	貸付有価証券 2,600株
三光合成	3,500	340.00	1,190,000	
きもと	4,900	234.00	1,146,600	貸付有価証券 100株
藤森工業	2,500	3,565.00	8,912,500	
前澤化成工業	1,900	1,276.00	2,424,400	貸付有価証券 1,200株
未来工業	1,100	1,557.00	1,712,700	
ウェーブロックホールディングス	1,200	674.00	808,800	
JSP	1,800	1,417.00	2,550,600	貸付有価証券 1,100株
エフピコ	5,700	2,733.00	15,578,100	

天馬	2,400	2,314.00	5,553,600	貸付有価証券 500株
信越ポリマー	5,500	1,108.00	6,094,000	
東リ	7,000	207.00	1,449,000	
ニフコ	10,300	3,010.00	31,003,000	
バルカー	2,500	2,745.00	6,862,500	
ユニ・チャーム	59,300	4,422.00	262,224,600	貸付有価証券 38,900株
ショーエイコーポレーション	800	591.00	472,800	貸付有価証券 400株
協和キリン	32,700	2,777.00	90,807,900	貸付有価証券 14,400株
武田薬品工業	241,900	3,703.00	895,755,700	代用有価証券 21,400株 貸付有価証券 24,700株
アステラス製薬	263,100	2,062.50	542,643,750	貸付有価証券 8,400株
住友ファーマ	19,000	1,103.00	20,957,000	貸付有価証券 700株
塩野義製薬	36,700	6,877.00	252,385,900	
わかもと製薬	3,300	266.00	877,800	貸付有価証券 600株
日本新薬	7,200	7,970.00	57,384,000	貸付有価証券 200株
中外製薬	96,200	3,528.00	339,393,600	貸付有価証券 53,300株
科研製薬	4,500	3,600.00	16,200,000	貸付有価証券 100株
エーザイ	34,900	5,298.00	184,900,200	
ロート製薬	15,000	3,305.00	49,575,000	貸付有価証券 300株
小野薬品工業	62,600	3,404.00	213,090,400	貸付有価証券 13,400株
久光製薬	7,100	3,385.00	24,033,500	
持田製薬	3,600	3,100.00	11,160,000	
参天製薬	54,900	1,042.00	57,205,800	貸付有価証券 3,400株
扶桑薬品工業	1,000	2,213.00	2,213,000	
日本ケミファ	400	1,916.00	766,400	
ツムラ	9,000	2,939.00	26,451,000	
日医工	9,300	335.00	3,115,500	貸付有価証券 6,300株
キッセイ薬品工業	4,800	2,522.00	12,105,600	
生化学工業	5,400	794.00	4,287,600	
栄研化学	4,900	1,703.00	8,344,700	
日水製薬	1,100	989.00	1,087,900	
鳥居薬品	1,700	3,020.00	5,134,000	

JCRファーマ	8,700	2,365.00	20,575,500	貸付有価証券 2,900株
東和薬品	4,400	2,397.00	10,546,800	貸付有価証券 200株
富士製薬工業	1,700	926.00	1,574,200	
ゼリア新薬工業	4,900	1,986.00	9,731,400	貸付有価証券 1,900株
第一三共	229,400	3,419.00	784,318,600	貸付有価証券 9,400株
キョーリン製薬ホールディングス	5,800	1,663.00	9,645,400	
大幸薬品	4,700	604.00	2,838,800	貸付有価証券 3,100株
ダイト	1,900	2,617.00	4,972,300	
大塚ホールディングス	60,400	4,289.00	259,055,600	貸付有価証券 39,600株
大正製薬ホールディングス	6,200	4,960.00	30,752,000	貸付有価証券 900株
ペプチドリーム	16,100	1,611.00	25,937,100	貸付有価証券 2,600株
あすか製薬ホールディングス	3,100	982.00	3,044,200	
サワイグループホールディングス	6,200	3,800.00	23,560,000	貸付有価証券 500株
日本コークス工業	26,000	127.00	3,302,000	貸付有価証券 1,600株
ニチレキ	3,500	1,307.00	4,574,500	
ユシロ化学工業	1,300	1,035.00	1,345,500	
ピーピー・カストロール	1,000	1,249.00	1,249,000	
富士石油	7,300	323.00	2,357,900	
MORESCO	1,100	1,237.00	1,360,700	
出光興産	32,200	3,500.00	112,700,000	
Eneosホールディングス	462,800	521.20	241,211,360	
コスモエネルギーホールディングス	11,100	3,550.00	39,405,000	
横浜ゴム	15,700	1,654.00	25,967,800	貸付有価証券 9,500株
TOYO TIRE	15,200	1,724.00	26,204,800	貸付有価証券 4,800株
ブリヂストン	84,100	5,083.00	427,480,300	貸付有価証券 58,800株
住友ゴム工業	26,000	1,177.00	30,602,000	貸付有価証券 18,200株
藤倉コンポジット	2,500	892.00	2,230,000	貸付有価証券 1,600株
オカモト	1,600	3,835.00	6,136,000	
フコク	1,400	989.00	1,384,600	
ニッタ	3,000	2,816.00	8,448,000	
住友理工	6,100	563.00	3,434,300	貸付有価証券 100株
三ツ星ベルト	3,700	2,797.00	10,348,900	

バンドー化学	5,000	900.00	4,500,000	
日東紡績	4,100	2,632.00	10,791,200	
A G C	26,800	4,855.00	130,114,000	貸付有価証券 11,700株
日本板硝子	14,200	388.00	5,509,600	貸付有価証券 9,900株
石塚硝子	500	1,779.00	889,500	貸付有価証券 300株
日本山村硝子	1,200	762.00	914,400	
日本電気硝子	11,700	2,729.00	31,929,300	貸付有価証券 5,200株
オハラ	1,300	1,215.00	1,579,500	貸付有価証券 100株
住友大阪セメント	5,200	3,200.00	16,640,000	貸付有価証券 2,600株
太平洋セメント	17,500	1,925.00	33,687,500	貸付有価証券 7,800株
日本ヒューム	2,700	682.00	1,841,400	
日本コンクリート工業	5,600	280.00	1,568,000	貸付有価証券 700株
三谷セキサン	1,300	5,080.00	6,604,000	貸付有価証券 500株
アジアパイルホールディングス	4,500	461.00	2,074,500	
東海カーボン	24,400	1,087.00	26,522,800	貸付有価証券 4,300株
日本カーボン	1,600	4,235.00	6,776,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	1,900	2,863.00	5,439,700	貸付有価証券 200株
ノリタケカンパニーリミテド	1,600	4,220.00	6,752,000	
T O T O	19,700	4,355.00	85,793,500	貸付有価証券 600株
日本碍子	31,300	1,916.00	59,970,800	貸付有価証券 600株
日本特殊陶業	22,100	2,443.00	53,990,300	貸付有価証券 700株
ダントーホールディングス	2,100	278.00	583,800	貸付有価証券 600株
M A R U W A	1,100	15,760.00	17,336,000	
品川リフラクトリーズ	700	3,655.00	2,558,500	
黒崎播磨	500	4,290.00	2,145,000	
ヨータイ	2,000	1,554.00	3,108,000	
東京窯業	3,300	282.00	930,600	貸付有価証券 1,600株
ニッカトー	1,400	483.00	676,200	貸付有価証券 100株
フジインコーポレーテッド	2,500	5,860.00	14,650,000	
クニミネ工業	900	974.00	876,600	

エーアンドエーマテリアル	500	870.00	435,000	貸付有価証券 200株
ニチアス	6,700	2,260.00	15,142,000	貸付有価証券 200株
ニチハ	4,100	2,407.00	9,868,700	
日本製鉄	130,100	2,250.50	292,790,050	貸付有価証券 600株
神戸製鋼所	54,300	680.00	36,924,000	貸付有価証券 200株
中山製鋼所	4,400	426.00	1,874,400	貸付有価証券 100株
合同製鐵	1,500	1,287.00	1,930,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	74,300	1,587.00	117,914,100	貸付有価証券 19,200株
東京製鐵	9,400	1,505.00	14,147,000	貸付有価証券 500株
共英製鋼	3,100	1,307.00	4,051,700	貸付有価証券 2,300株
大和工業	5,200	4,290.00	22,308,000	
東京鐵鋼	1,200	1,206.00	1,447,200	貸付有価証券 900株
大阪製鐵	1,600	1,378.00	2,204,800	貸付有価証券 1,000株
淀川製鋼所	3,600	2,257.00	8,125,200	貸付有価証券 2,600株
丸一鋼管	9,100	2,980.00	27,118,000	貸付有価証券 3,100株
モリ工業	800	2,432.00	1,945,600	
大同特殊鋼	4,400	3,625.00	15,950,000	
日本高周波鋼業	1,300	339.00	440,700	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	2,100	2,209.00	4,638,900	貸付有価証券 1,000株
山陽特殊製鋼	2,800	2,101.00	5,882,800	
愛知製鋼	1,700	2,042.00	3,471,400	貸付有価証券 100株
日立金属	32,800	2,069.00	67,863,200	貸付有価証券 2,200株
日本金属	800	1,152.00	921,600	
大太平洋金属	1,900	2,794.00	5,308,600	貸付有価証券 400株
新日本電工	17,800	354.00	6,301,200	
栗本鐵工所	1,300	1,631.00	2,120,300	
虹技	500	985.00	492,500	
日本鑄鉄管	300	1,007.00	302,100	
三菱製鋼	1,900	949.00	1,803,100	
日垂鋼業	3,500	261.00	913,500	
日本精線	500	4,230.00	2,115,000	貸付有価証券 200株

エンビプロ・ホールディングス	2,000	934.00	1,868,000	貸付有価証券 1,400株
シンニッタン	3,400	221.00	751,400	貸付有価証券 700株
新家工業	600	1,478.00	886,800	
大紀アルミニウム工業所	4,000	1,335.00	5,340,000	貸付有価証券 2,800株
日本軽金属ホールディングス	7,700	1,577.00	12,142,900	貸付有価証券 1,100株
三井金属鉱業	8,200	3,405.00	27,921,000	
東邦亜鉛	1,600	2,334.00	3,734,400	貸付有価証券 1,100株
三菱マテリアル	18,400	1,980.00	36,432,000	貸付有価証券 600株
住友金属鉱山	35,200	5,416.00	190,643,200	
D O W Aホールディングス	7,500	4,715.00	35,362,500	貸付有価証券 100株
古河機械金属	4,800	1,231.00	5,908,800	
エス・サイエンス	16,700	30.00	501,000	貸付有価証券 11,300株
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,500	1,947.00	6,814,500	貸付有価証券 1,700株
東邦チタニウム	5,500	2,191.00	12,050,500	貸付有価証券 100株
U A C J	4,400	2,206.00	9,706,400	
C Kサンエツ	600	4,065.00	2,439,000	貸付有価証券 400株
古河電気工業	9,000	2,155.00	19,395,000	貸付有価証券 700株
住友電気工業	108,700	1,425.50	154,951,850	貸付有価証券 3,600株
フジクラ	33,900	793.00	26,882,700	
昭和電線ホールディングス	2,700	1,749.00	4,722,300	
東京特殊電線	400	2,308.00	923,200	貸付有価証券 200株
タツタ電線	5,400	471.00	2,543,400	
カナレ電気	500	1,694.00	847,000	貸付有価証券 300株
平河ヒューテック	1,700	1,107.00	1,881,900	
リョービ	3,300	1,092.00	3,603,600	
アーレスティ	3,300	372.00	1,227,600	
アサヒホールディングス	12,200	2,078.00	25,351,600	貸付有価証券 200株
稲葉製作所	1,600	1,298.00	2,076,800	貸付有価証券 1,100株
宮地エンジニアリンググループ	900	3,385.00	3,046,500	
トーカロ	7,800	1,369.00	10,678,200	
アルファC o	1,100	983.00	1,081,300	貸付有価証券 700株

SUMCO	49,100	2,097.00	102,962,700	貸付有価証券 30,800株
川田テクノロジーズ	600	3,420.00	2,052,000	
RS Technologies	1,000	6,080.00	6,080,000	
ジェイテックコーポレーション	400	2,310.00	924,000	貸付有価証券 100株
信和	2,000	785.00	1,570,000	
東洋製罐グループホールディングス	16,800	1,376.00	23,116,800	
ホッカンホールディングス	1,400	1,239.00	1,734,600	貸付有価証券 1,100株
コロナ	1,400	833.00	1,166,200	貸付有価証券 1,100株
横河ブリッジホールディングス	4,700	1,925.00	9,047,500	
駒井ハルテック	500	1,692.00	846,000	
高田機工	200	2,546.00	509,200	貸付有価証券 100株
三和ホールディングス	28,700	1,236.00	35,473,200	貸付有価証券 200株
文化シャッター	9,300	951.00	8,844,300	貸付有価証券 6,500株
三協立山	3,700	583.00	2,157,100	
アルインコ	2,100	851.00	1,787,100	貸付有価証券 1,400株
東洋シャッター	700	636.00	445,200	
LIXIL	47,900	2,459.00	117,786,100	貸付有価証券 3,000株
日本フィルコン	2,100	504.00	1,058,400	
ノーリツ	5,200	1,500.00	7,800,000	
長府製作所	3,100	1,797.00	5,570,700	
リンナイ	5,400	8,870.00	47,898,000	貸付有価証券 2,500株
ダイニチ工業	1,300	652.00	847,600	
日東精工	3,500	508.00	1,778,000	
三洋工業	300	1,793.00	537,900	
岡部	5,100	631.00	3,218,100	
ジーテクト	3,500	1,279.00	4,476,500	
東プレ	5,000	1,027.00	5,135,000	貸付有価証券 3,700株
高周波熱錬	4,900	640.00	3,136,000	貸付有価証券 200株
東京製綱	1,900	919.00	1,746,100	
サンコール	2,700	655.00	1,768,500	
モリテック スチール	2,400	319.00	765,600	貸付有価証券 200株
パイオラックス	4,100	1,840.00	7,544,000	
エイチワン	2,900	597.00	1,731,300	貸付有価証券 2,000株

日本発條	26,400	923.00	24,367,200	貸付有価証券 2,100株
中央発條	1,400	718.00	1,005,200	
アドバネクス	500	1,636.00	818,000	
立川ブラインド工業	1,200	1,108.00	1,329,600	
三益半導体工業	2,400	2,403.00	5,767,200	
日本ドライケミカル	700	1,571.00	1,099,700	貸付有価証券 400株
日本製鋼所	8,300	3,235.00	26,850,500	
三浦工業	12,400	2,903.00	35,997,200	貸付有価証券 1,100株
タクマ	9,300	1,426.00	13,261,800	
ツガミ	6,400	1,204.00	7,705,600	貸付有価証券 3,000株
オークマ	3,100	5,210.00	16,151,000	貸付有価証券 100株
芝浦機械	3,400	3,275.00	11,135,000	
アマダ	48,000	1,034.00	49,632,000	
アイダエンジニアリング	7,100	904.00	6,418,400	
滝澤鉄工所	1,000	1,303.00	1,303,000	
F U J I	12,800	2,214.00	28,339,200	
牧野フライス製作所	3,200	4,230.00	13,536,000	
オーエスジー	13,600	1,655.00	22,508,000	
ダイジェット工業	500	911.00	455,500	
旭ダイヤモンド工業	7,600	597.00	4,537,200	
D M G 森精機	17,200	1,896.00	32,611,200	貸付有価証券 9,300株
ソディック	6,600	786.00	5,187,600	
ディスコ	4,500	35,100.00	157,950,000	貸付有価証券 1,700株
日東工器	1,500	1,493.00	2,239,500	
日進工具	2,400	1,315.00	3,156,000	貸付有価証券 1,600株
パンチ工業	2,600	469.00	1,219,400	
富士ダイス	1,700	683.00	1,161,100	
豊和工業	1,600	805.00	1,288,000	
O K K	1,200	1,080.00	1,296,000	貸付有価証券 700株
石川製作所	900	1,459.00	1,313,100	貸付有価証券 500株
東洋機械金属	2,100	605.00	1,270,500	貸付有価証券 1,400株
エンシュウ	700	780.00	546,000	
島精機製作所	4,500	2,027.00	9,121,500	貸付有価証券 1,800株
オプトラン	3,800	1,996.00	7,584,800	貸付有価証券 1,300株

NCホールディングス	800	1,884.00	1,507,200	
イワキポンプ	1,900	970.00	1,843,000	
フリー	2,700	1,042.00	2,813,400	貸付有価証券 1,800株
ヤマシンフィルタ	5,200	308.00	1,601,600	貸付有価証券 1,300株
日阪製作所	3,300	831.00	2,742,300	貸付有価証券 2,500株
やまびこ	5,300	1,183.00	6,269,900	
野村マイクロ・サイエンス	1,000	4,205.00	4,205,000	貸付有価証券 600株
平田機工	1,400	4,285.00	5,999,000	貸付有価証券 900株
ペガサスミシン製造	3,200	562.00	1,798,400	貸付有価証券 2,100株
マルマエ	1,300	2,117.00	2,752,100	貸付有価証券 800株
タツモ	1,400	1,194.00	1,671,600	貸付有価証券 100株
ナプテスコ	16,600	3,070.00	50,962,000	貸付有価証券 11,300株
三井海洋開発	3,200	1,306.00	4,179,200	
レオン自動機	3,300	1,337.00	4,412,100	
S M C	9,000	66,610.00	599,490,000	貸付有価証券 200株
ホソカワミクロン	2,000	2,624.00	5,248,000	
ユニオンツール	1,100	3,650.00	4,015,000	貸付有価証券 700株
オイレス工業	4,100	1,548.00	6,346,800	貸付有価証券 2,800株
日精エー・エス・ビー機械	1,100	3,200.00	3,520,000	貸付有価証券 100株
サトーホールディングス	4,000	1,901.00	7,604,000	
技研製作所	2,700	3,535.00	9,544,500	
日本エアテック	1,400	1,074.00	1,503,600	貸付有価証券 900株
カワタ	1,000	1,014.00	1,014,000	
日精樹脂工業	1,900	918.00	1,744,200	貸付有価証券 1,400株
オカダアイヨン	1,000	1,535.00	1,535,000	貸付有価証券 600株
ワイエイシイホールディングス	1,200	1,778.00	2,133,600	
小松製作所	139,500	3,196.00	445,842,000	貸付有価証券 100株
住友重機械工業	16,800	3,030.00	50,904,000	
日立建機	12,300	3,025.00	37,207,500	貸付有価証券 100株
日工	4,000	617.00	2,468,000	

巴工業	1,100	2,444.00	2,688,400	貸付有価証券 800株
井関農機	2,600	1,216.00	3,161,600	貸付有価証券 800株
TOWA	2,600	1,846.00	4,799,600	貸付有価証券 1,800株
丸山製作所	500	1,547.00	773,500	
北川鉄工所	1,300	1,447.00	1,881,100	
ローツェ	1,500	10,840.00	16,260,000	
タカキタ	1,100	582.00	640,200	貸付有価証券 700株
クボタ	149,100	2,374.00	353,963,400	貸付有価証券 73,300株
荏原実業	1,400	2,388.00	3,343,200	
三菱化工機	900	2,085.00	1,876,500	
月島機械	5,100	932.00	4,753,200	貸付有価証券 100株
帝国電機製作所	2,000	1,626.00	3,252,000	貸付有価証券 1,400株
東京機械製作所	1,300	958.00	1,245,400	貸付有価証券 900株
新東工業	6,100	677.00	4,129,700	貸付有価証券 1,900株
澁谷工業	2,500	2,324.00	5,810,000	貸付有価証券 100株
アイチ コーポレーション	4,400	881.00	3,876,400	
小森コーポレーション	7,400	761.00	5,631,400	
鶴見製作所	2,200	1,805.00	3,971,000	
住友精密工業	500	2,645.00	1,322,500	
日本ギア工業	1,400	286.00	400,400	
酒井重工業	500	2,973.00	1,486,500	
荏原製作所	12,300	5,550.00	68,265,000	貸付有価証券 5,600株
石井鐵工所	400	2,911.00	1,164,400	
西島製作所	2,600	1,300.00	3,380,000	
北越工業	2,700	847.00	2,286,900	
ダイキン工業	35,500	20,685.00	734,317,500	代用有価証券 7,800株 貸付有価証券 1,300株
オルガノ	900	9,810.00	8,829,000	
トーヨーカネツ	1,100	2,767.00	3,043,700	
栗田工業	15,900	4,985.00	79,261,500	貸付有価証券 1,800株
楢本チエイン	4,000	3,160.00	12,640,000	貸付有価証券 300株
大同工業	1,300	834.00	1,084,200	
木村化工機	2,400	672.00	1,612,800	貸付有価証券 1,700株

アネスト岩田	4,800	850.00	4,080,000	貸付有価証券 2,200株
ダイフク	15,300	8,120.00	124,236,000	貸付有価証券 2,600株
サムコ	800	2,615.00	2,092,000	貸付有価証券 300株
加藤製作所	1,500	815.00	1,222,500	
油研工業	500	1,771.00	885,500	
タダノ	15,300	949.00	14,519,700	貸付有価証券 300株
フジテック	10,000	2,618.00	26,180,000	貸付有価証券 7,600株
C K D	8,200	1,870.00	15,334,000	貸付有価証券 100株
キトー	2,500	2,647.00	6,617,500	
平和	8,600	1,934.00	16,632,400	貸付有価証券 5,300株
理想科学工業	2,500	2,187.00	5,467,500	
S A N K Y O	6,700	4,280.00	28,676,000	貸付有価証券 4,400株
日本金銭機械	3,100	689.00	2,135,900	貸付有価証券 100株
マースグループホールディングス	2,000	1,681.00	3,362,000	貸付有価証券 1,300株
フクシマガリレイ	2,000	3,405.00	6,810,000	貸付有価証券 1,400株
オーイズミ	1,200	424.00	508,800	
ダイコク電機	1,400	1,160.00	1,624,000	貸付有価証券 900株
竹内製作所	4,700	2,340.00	10,998,000	
アマノ	8,100	2,501.00	20,258,100	
J U K I	4,300	686.00	2,949,800	貸付有価証券 900株
サンデン	4,700	208.00	977,600	貸付有価証券 1,800株
ジャノメ	2,500	690.00	1,725,000	
マックス	3,800	1,559.00	5,924,200	
グローリー	7,500	1,994.00	14,955,000	
新晃工業	2,900	1,575.00	4,567,500	貸付有価証券 1,500株
大和冷機工業	4,400	1,014.00	4,461,600	
セガサミーホールディングス	30,500	2,396.00	73,078,000	貸付有価証券 4,300株
日本ピストンリング	1,100	1,300.00	1,430,000	
リケン	1,200	2,336.00	2,803,200	
T P R	3,700	1,255.00	4,643,500	貸付有価証券 2,800株
ツバキ・ナカシマ	6,800	965.00	6,562,000	貸付有価証券 800株

ホンザキ	9,000	7,630.00	68,670,000	貸付有価証券 2,800株
大豊工業	2,500	706.00	1,765,000	
日本精工	54,500	733.00	39,948,500	貸付有価証券 700株
N T N	59,400	263.00	15,622,200	貸付有価証券 19,500株
ジェイテクト	27,300	981.00	26,781,300	
不二越	2,300	3,650.00	8,395,000	貸付有価証券 100株
日本トムソン	7,500	554.00	4,155,000	
T H K	17,400	2,640.00	45,936,000	貸付有価証券 600株
ユーシン精機	2,400	695.00	1,668,000	
前澤給装工業	2,100	833.00	1,749,300	貸付有価証券 1,400株
イーグル工業	3,600	1,010.00	3,636,000	貸付有価証券 100株
前澤工業	1,800	603.00	1,085,400	貸付有価証券 100株
日本ピラー工業	2,800	2,891.00	8,094,800	貸付有価証券 2,000株
キッツ	9,200	678.00	6,237,600	
マキタ	35,700	3,523.00	125,771,100	貸付有価証券 1,700株
三井E & Sホールディングス	11,200	361.00	4,043,200	貸付有価証券 7,600株
日立造船	24,900	787.00	19,596,300	
三菱重工業	46,200	4,890.00	225,918,000	貸付有価証券 3,900株
I H I	19,200	3,625.00	69,600,000	
サノヤスホールディングス	3,800	129.00	490,200	貸付有価証券 1,200株
スター精密	4,300	1,686.00	7,249,800	
日清紡ホールディングス	17,800	1,039.00	18,494,200	貸付有価証券 10,000株
イビデン	15,200	4,735.00	71,972,000	貸付有価証券 3,000株
コニカミノルタ	64,000	432.00	27,648,000	貸付有価証券 23,000株
ブラザー工業	35,900	2,377.00	85,334,300	貸付有価証券 6,500株
ミネベアミツミ	50,300	2,410.00	121,223,000	貸付有価証券 3,900株
日立製作所	148,000	6,725.00	995,300,000	
東芝	53,800	5,770.00	310,426,000	
三菱電機	294,000	1,416.00	416,304,000	
富士電機	17,600	6,090.00	107,184,000	貸付有価証券 500株

東洋電機製造	1,100	914.00	1,005,400	貸付有価証券 100株
安川電機	31,400	4,485.00	140,829,000	貸付有価証券 20,700株
シンフォニアテクノロジー	3,300	1,359.00	4,484,700	
明電舎	4,600	2,070.00	9,522,000	貸付有価証券 1,800株
オリジン	800	1,284.00	1,027,200	
山洋電気	1,200	5,540.00	6,648,000	貸付有価証券 200株
デンヨー	2,300	1,588.00	3,652,400	貸付有価証券 1,400株
PHCホールディングス	4,800	1,462.00	7,017,600	
東芝テック	3,300	4,060.00	13,398,000	貸付有価証券 400株
芝浦メカトロニクス	500	10,730.00	5,365,000	
マブチモーター	7,100	3,550.00	25,205,000	貸付有価証券 1,900株
日本電産	72,200	8,679.00	626,623,800	貸付有価証券 11,000株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,300	415.00	539,500	
トレックス・セミコンダクター	1,400	2,908.00	4,071,200	
東光高岳	1,700	1,784.00	3,032,800	貸付有価証券 300株
ダブル・スコープ	8,900	1,125.00	10,012,500	貸付有価証券 6,000株
ダイヘン	3,000	4,195.00	12,585,000	
ヤーマン	5,000	1,207.00	6,035,000	貸付有価証券 3,300株
JVCケンウッド	25,100	190.00	4,769,000	
ミマキエンジニアリング	2,900	575.00	1,667,500	
I - P E X	1,400	1,377.00	1,927,800	
日新電機	7,200	1,476.00	10,627,200	
大崎電気工業	5,300	505.00	2,676,500	
オムロン	25,600	7,426.00	190,105,600	貸付有価証券 100株
日東工業	3,900	2,203.00	8,591,700	
I D E C	3,800	2,660.00	10,108,000	
正興電機製作所	900	1,112.00	1,000,800	貸付有価証券 600株
不二電機工業	600	1,180.00	708,000	貸付有価証券 300株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,500	2,074.00	19,703,000	貸付有価証券 2,300株
サクサホールディングス	700	1,514.00	1,059,800	
メルコホールディングス	800	3,665.00	2,932,000	
テクノメディカ	700	1,592.00	1,114,400	貸付有価証券 400株

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	900	1,131.00	1,017,900	貸付有価証券 600株
日本電気	37,400	5,210.00	194,854,000	
富士通	27,700	19,345.00	535,856,500	
沖電気工業	12,100	750.00	9,075,000	
岩崎通信機	1,300	896.00	1,164,800	
電気興業	1,500	2,547.00	3,820,500	
サンケン電気	2,700	5,440.00	14,688,000	
ナカヨ	500	1,139.00	569,500	
アイホン	1,500	1,700.00	2,550,000	貸付有価証券 100株
ルネサスエレクトロニクス	167,200	1,524.00	254,812,800	貸付有価証券 20,400株
セイコーエプソン	35,600	2,157.00	76,789,200	貸付有価証券 2,000株
ワコム	23,900	971.00	23,206,900	貸付有価証券 1,500株
アルバック	6,100	5,480.00	33,428,000	貸付有価証券 2,000株
アクセル	1,200	843.00	1,011,600	貸付有価証券 100株
E I Z O	2,300	3,465.00	7,969,500	
ジャパンディスプレイ	105,200	65.00	6,838,000	貸付有価証券 71,600株
日本信号	7,000	897.00	6,279,000	
京三製作所	6,200	444.00	2,752,800	
能美防災	3,700	1,692.00	6,260,400	
ホーチキ	2,100	1,220.00	2,562,000	
星和電機	1,300	473.00	614,900	
エレコム	7,000	1,520.00	10,640,000	
パナソニック ホールディングス	328,200	1,184.00	388,588,800	貸付有価証券 6,600株
シャープ	31,200	1,049.00	32,728,800	貸付有価証券 22,600株
アンリツ	19,800	1,433.00	28,373,400	貸付有価証券 4,700株
富士通ゼネラル	8,400	2,483.00	20,857,200	貸付有価証券 200株
ソニーグループ	192,800	12,115.00	2,335,772,000	代用有価証券 13,000株 貸付有価証券 21,000株
T D K	44,600	4,465.00	199,139,000	
帝国通信工業	1,400	1,442.00	2,018,800	
タムラ製作所	11,400	552.00	6,292,800	貸付有価証券 7,900株
アルプスアルパイン	25,900	1,385.00	35,871,500	貸付有価証券 4,500株
池上通信機	900	602.00	541,800	

日本電波工業	3,100	1,129.00	3,499,900	貸付有価証券 2,100株
鈴木	1,500	831.00	1,246,500	
メイコー	3,300	4,590.00	15,147,000	
日本トリム	600	2,415.00	1,449,000	
ローランド ディー . ジー .	1,800	3,100.00	5,580,000	貸付有価証券 1,100株
フォスター電機	3,000	716.00	2,148,000	
S M K	700	2,177.00	1,523,900	
ヨコオ	2,100	2,420.00	5,082,000	
ホシデン	7,100	1,223.00	8,683,300	貸付有価証券 100株
ヒロセ電機	4,500	17,920.00	80,640,000	貸付有価証券 600株
日本航空電子工業	6,500	1,978.00	12,857,000	貸付有価証券 1,300株
T O A	3,300	816.00	2,692,800	
マクセル	5,800	1,260.00	7,308,000	
古野電気	3,700	1,009.00	3,733,300	
ユニデンホールディングス	700	3,405.00	2,383,500	
スミダコーポレーション	2,900	832.00	2,412,800	
アイコム	1,100	2,444.00	2,688,400	貸付有価証券 700株
リオン	1,100	2,589.00	2,847,900	貸付有価証券 600株
本多通信工業	2,600	516.00	1,341,600	貸付有価証券 1,800株
横河電機	29,100	2,318.00	67,453,800	貸付有価証券 800株
新電元工業	1,100	3,200.00	3,520,000	貸付有価証券 400株
アズビル	18,000	3,815.00	68,670,000	貸付有価証券 500株
東亜ディーケーケー	1,600	970.00	1,552,000	貸付有価証券 900株
日本光電工業	12,200	3,060.00	37,332,000	貸付有価証券 3,600株
チノー	1,000	1,694.00	1,694,000	貸付有価証券 700株
共和電業	2,700	346.00	934,200	貸付有価証券 200株
日本電子材料	1,500	1,948.00	2,922,000	
堀場製作所	5,400	6,680.00	36,072,000	貸付有価証券 3,700株
アドバンテスト	22,900	8,900.00	203,810,000	貸付有価証券 1,200株
小野測器	1,300	443.00	575,900	貸付有価証券 100株
エスベック	2,300	1,846.00	4,245,800	

キーエンス	27,900	51,590.00	1,439,361,000	貸付有価証券 1,800株
日置電機	1,500	7,160.00	10,740,000	
シスメックス	23,400	8,397.00	196,489,800	
日本マイクロニクス	4,900	1,476.00	7,232,400	
メガチップス	2,700	3,595.00	9,706,500	貸付有価証券 100株
OBARA GROUP	1,300	2,915.00	3,789,500	貸付有価証券 900株
澤藤電機	400	1,510.00	604,000	貸付有価証券 200株
原田工業	1,600	942.00	1,507,200	貸付有価証券 1,000株
コーセル	3,400	765.00	2,601,000	
イリソ電子工業	2,600	3,430.00	8,918,000	貸付有価証券 1,200株
オブテックスグループ	5,000	2,017.00	10,085,000	貸付有価証券 2,600株
千代田インテグレ	1,200	1,950.00	2,340,000	
レーザーテック	12,900	18,780.00	242,262,000	貸付有価証券 8,700株
スタンレー電気	20,400	2,342.00	47,776,800	貸付有価証券 14,200株
岩崎電気	1,000	2,543.00	2,543,000	
ウシオ電機	15,000	1,785.00	26,775,000	
岡谷電機産業	2,500	289.00	722,500	貸付有価証券 1,800株
ヘリオス テクノ ホールディング	2,800	294.00	823,200	
エノモト	800	1,650.00	1,320,000	貸付有価証券 100株
日本セラミック	2,900	2,102.00	6,095,800	
遠藤照明	1,400	788.00	1,103,200	
古河電池	2,200	1,197.00	2,633,400	貸付有価証券 1,500株
双信電機	1,600	597.00	955,200	貸付有価証券 700株
山一電機	2,100	1,877.00	3,941,700	貸付有価証券 200株
図研	2,000	2,844.00	5,688,000	
日本電子	6,100	6,300.00	38,430,000	貸付有価証券 1,300株
カシオ計算機	19,800	1,179.00	23,344,200	貸付有価証券 1,300株
ファナック	27,000	21,105.00	569,835,000	貸付有価証券 800株
日本シイエムケイ	5,600	475.00	2,660,000	貸付有価証券 800株
エンプラス	800	3,420.00	2,736,000	

大真空	3,900	1,026.00	4,001,400	貸付有価証券 2,600株
ローム	13,100	10,620.00	139,122,000	
浜松ホトニクス	21,000	6,030.00	126,630,000	
三井ハイテック	2,800	11,090.00	31,052,000	貸付有価証券 1,000株
新光電気工業	9,000	4,745.00	42,705,000	
京セラ	43,300	7,267.00	314,661,100	
太陽誘電	14,100	5,310.00	74,871,000	貸付有価証券 700株
村田製作所	86,100	8,300.00	714,630,000	貸付有価証券 3,000株
双葉電子工業	5,300	684.00	3,625,200	貸付有価証券 100株
北陸電気工業	1,200	1,193.00	1,431,600	
ニチコン	8,700	1,337.00	11,631,900	貸付有価証券 400株
日本ケミコン	2,900	1,822.00	5,283,800	貸付有価証券 200株
K O A	4,400	1,705.00	7,502,000	貸付有価証券 100株
市光工業	3,800	371.00	1,409,800	
小糸製作所	15,900	4,715.00	74,968,500	貸付有価証券 400株
ミツバ	5,100	405.00	2,065,500	貸付有価証券 3,800株
S C R E E Nホールディングス	5,000	11,870.00	59,350,000	貸付有価証券 400株
キャノン電子	2,800	1,547.00	4,331,600	貸付有価証券 100株
キャノン	152,900	3,242.00	495,701,800	貸付有価証券 100,100株
リコー	77,300	1,084.00	83,793,200	貸付有価証券 49,100株
象印マホービン	7,900	1,365.00	10,783,500	
M U T O Hホールディングス	400	2,176.00	870,400	貸付有価証券 300株
東京エレクトロン	19,500	58,980.00	1,150,110,000	貸付有価証券 900株
トヨタ紡織	11,400	2,087.00	23,791,800	貸付有価証券 200株
芦森工業	700	1,093.00	765,100	
ユニプレス	4,900	890.00	4,361,000	貸付有価証券 3,100株
豊田自動織機	22,800	8,300.00	189,240,000	
モリタホールディングス	4,900	1,301.00	6,374,900	
三櫻工業	4,300	642.00	2,760,600	
デンソー	62,700	7,877.00	493,887,900	

東海理化電機製作所	8,100	1,399.00	11,331,900	貸付有価証券 700株
川崎重工業	21,400	2,519.00	53,906,600	貸付有価証券 1,600株
名村造船所	8,400	405.00	3,402,000	貸付有価証券 6,200株
日本車輛製造	1,000	2,103.00	2,103,000	
三菱ロジスネクスト	4,100	855.00	3,505,500	貸付有価証券 1,000株
近畿車輛	500	1,176.00	588,000	
日産自動車	362,800	500.60	181,617,680	貸付有価証券 135,500株
いすゞ自動車	91,600	1,511.00	138,407,600	貸付有価証券 100株
トヨタ自動車	1,454,900	2,122.50	3,088,025,250	貸付有価証券 72,500株
日野自動車	38,400	718.00	27,571,200	貸付有価証券 800株
三菱自動車工業	113,900	385.00	43,851,500	貸付有価証券 78,100株
エフテック	2,000	573.00	1,146,000	
レシップホールディングス	1,300	581.00	755,300	
G M B	600	731.00	438,600	
ファルテック	600	614.00	368,400	
武蔵精密工業	7,000	1,398.00	9,786,000	貸付有価証券 4,200株
日産車体	4,500	593.00	2,668,500	
新明和工業	8,300	966.00	8,017,800	
極東開発工業	5,200	1,379.00	7,170,800	
トピー工業	2,400	1,330.00	3,192,000	
ティラド	800	2,817.00	2,253,600	
曙ブレーキ工業	17,100	146.00	2,496,600	貸付有価証券 100株
タチエス	5,200	1,151.00	5,985,200	
N O K	12,700	1,153.00	14,643,100	貸付有価証券 4,600株
フタバ産業	7,100	392.00	2,783,200	貸付有価証券 100株
K Y B	2,900	2,938.00	8,520,200	
大同メタル工業	5,900	522.00	3,079,800	貸付有価証券 300株
プレス工業	14,200	412.00	5,850,400	貸付有価証券 100株
ミクニ	3,900	367.00	1,431,300	貸付有価証券 600株
太平洋工業	6,100	1,066.00	6,502,600	
河西工業	4,000	277.00	1,108,000	貸付有価証券 800株

アイシン	22,500	4,225.00	95,062,500	貸付有価証券 600株
マツダ	92,500	1,089.00	100,732,500	貸付有価証券 500株
今仙電機製作所	2,000	594.00	1,188,000	貸付有価証券 100株
本田技研工業	230,800	3,187.00	735,559,600	代用有価証券 5,900株
スズキ	64,100	3,818.00	244,733,800	貸付有価証券 12,100株
S U B A R U	83,300	2,227.50	185,550,750	貸付有価証券 10,900株
安永	1,400	725.00	1,015,000	貸付有価証券 200株
ヤマハ発動機	40,100	2,613.00	104,781,300	
T B K	2,800	346.00	968,800	貸付有価証券 300株
エクセディ	4,700	1,692.00	7,952,400	貸付有価証券 300株
豊田合成	9,100	2,039.00	18,554,900	
愛三工業	4,800	730.00	3,504,000	貸付有価証券 200株
盟和産業	500	1,043.00	521,500	貸付有価証券 200株
日本プラスト	2,300	452.00	1,039,600	
ヨロズ	2,600	832.00	2,163,200	貸付有価証券 1,900株
エフ・シー・シー	5,000	1,333.00	6,665,000	
シマノ	11,700	22,785.00	266,584,500	貸付有価証券 8,000株
テイ・エス テック	13,000	1,310.00	17,030,000	貸付有価証券 200株
ジャムコ	1,900	914.00	1,736,600	
テルモ	87,100	4,170.00	363,207,000	
クリエートメディック	800	1,001.00	800,800	
日機装	8,300	797.00	6,615,100	
日本エム・ディ・エム	1,800	1,637.00	2,946,600	
島津製作所	37,700	4,735.00	178,509,500	貸付有価証券 700株
J M S	2,400	575.00	1,380,000	
クボテック	1,100	268.00	294,800	
長野計器	2,100	1,180.00	2,478,000	
ブイ・テクノロジー	1,300	2,913.00	3,786,900	
東京計器	2,000	1,314.00	2,628,000	貸付有価証券 1,300株
愛知時計電機	1,200	1,590.00	1,908,000	貸付有価証券 600株
インターアクション	1,600	2,164.00	3,462,400	貸付有価証券 1,000株

オーバル	2,900	324.00	939,600	貸付有価証券 300株
東京精密	4,900	4,990.00	24,451,000	貸付有価証券 2,400株
マニー	11,600	1,472.00	17,075,200	貸付有価証券 1,000株
ニコン	44,600	1,605.00	71,583,000	貸付有価証券 2,700株
トプコン	14,500	1,839.00	26,665,500	
オリンパス	153,100	2,690.50	411,915,550	
理研計器	2,200	4,195.00	9,229,000	貸付有価証券 1,300株
タムロン	2,200	2,457.00	5,405,400	
H O Y A	59,400	13,810.00	820,314,000	
シード	1,600	505.00	808,000	貸付有価証券 1,100株
ノーリツ鋼機	2,800	2,348.00	6,574,400	貸付有価証券 1,800株
A & D ホロンホールディングス	3,500	1,004.00	3,514,000	
朝日インテック	33,700	1,948.00	65,647,600	貸付有価証券 2,800株
シチズン時計	32,000	551.00	17,632,000	
リズム	1,000	1,819.00	1,819,000	
大研医器	2,500	523.00	1,307,500	
メニコン	9,700	2,695.00	26,141,500	貸付有価証券 3,600株
シンシア	400	450.00	180,000	
松風	1,100	1,659.00	1,824,900	貸付有価証券 800株
セイコーホールディングス	4,400	2,600.00	11,440,000	
ニプロ	21,900	1,024.00	22,425,600	貸付有価証券 4,000株
中本パックス	800	1,614.00	1,291,200	
スノーピーク	4,100	2,754.00	11,291,400	貸付有価証券 2,700株
パラマウントベッドホールディングス	5,900	2,004.00	11,823,600	貸付有価証券 1,000株
トランザクション	1,900	1,098.00	2,086,200	貸付有価証券 1,000株
粧美堂	1,100	414.00	455,400	貸付有価証券 500株
ニホンフラッシュ	2,500	928.00	2,320,000	
前田工織	3,000	2,628.00	7,884,000	貸付有価証券 2,000株
永大産業	3,600	268.00	964,800	貸付有価証券 500株
アートネイチャー	2,600	749.00	1,947,400	
バンダイナムコホールディングス	26,200	9,625.00	252,175,000	

アイフィスジャパン	900	699.00	629,100	貸付有価証券 200株
共立印刷	5,100	152.00	775,200	貸付有価証券 500株
S H O E I	2,800	4,830.00	13,524,000	貸付有価証券 300株
フランスベッドホールディングス	4,000	896.00	3,584,000	貸付有価証券 2,600株
パイロットコーポレーション	4,700	5,030.00	23,641,000	
萩原工業	1,900	1,147.00	2,179,300	
フジシールインターナショナル	6,700	1,552.00	10,398,400	貸付有価証券 1,600株
タカラトミー	12,700	1,284.00	16,306,800	
広済堂ホールディングス	1,900	1,060.00	2,014,000	
エステールホールディングス	700	644.00	450,800	貸付有価証券 400株
タカノ	1,100	865.00	951,500	貸付有価証券 700株
プロネクサス	2,400	1,100.00	2,640,000	貸付有価証券 1,600株
ホクシン	2,500	144.00	360,000	貸付有価証券 1,600株
ウッドワン	1,000	1,171.00	1,171,000	
大建工業	1,700	1,895.00	3,221,500	貸付有価証券 100株
凸版印刷	42,300	2,425.00	102,577,500	
大日本印刷	34,300	2,940.00	100,842,000	
共同印刷	800	2,633.00	2,106,400	貸付有価証券 500株
N I S S H A	5,700	1,493.00	8,510,100	
光村印刷	300	1,281.00	384,300	
T A K A R A & C O M P A N Y	1,800	1,808.00	3,254,400	貸付有価証券 1,200株
アシックス	24,800	2,230.00	55,304,000	貸付有価証券 4,000株
ツツミ	800	1,985.00	1,588,000	貸付有価証券 400株
ローランド	2,200	4,695.00	10,329,000	
小松ウオール工業	900	1,906.00	1,715,400	
ヤマハ	17,900	5,320.00	95,228,000	貸付有価証券 500株
河合楽器製作所	800	2,883.00	2,306,400	
クリナップ	2,800	557.00	1,559,600	
ピジョン	18,600	1,844.00	34,298,400	貸付有価証券 10,200株
兼松サステック	200	1,620.00	324,000	貸付有価証券 100株
キングジム	2,400	916.00	2,198,400	貸付有価証券 1,800株

リンテック	6,100	2,400.00	14,640,000	貸付有価証券 100株
イトーキ	5,700	396.00	2,257,200	貸付有価証券 100株
任天堂	17,400	57,420.00	999,108,000	貸付有価証券 2,100株
三菱鉛筆	4,400	1,349.00	5,935,600	貸付有価証券 100株
タカラスタンダード	5,400	1,226.00	6,620,400	
コクヨ	13,900	1,650.00	22,935,000	貸付有価証券 4,500株
ナカバヤシ	2,300	500.00	1,150,000	貸付有価証券 1,600株
グローブライド	2,400	2,352.00	5,644,800	
オカムラ	9,300	1,101.00	10,239,300	
美津濃	2,700	2,253.00	6,083,100	
東京電力ホールディングス	230,200	481.00	110,726,200	貸付有価証券 146,300株
中部電力	89,300	1,291.00	115,286,300	貸付有価証券 600株
関西電力	110,600	1,254.00	138,692,400	貸付有価証券 1,500株
中国電力	45,600	853.00	38,896,800	貸付有価証券 1,200株
北陸電力	26,800	525.00	14,070,000	貸付有価証券 200株
東北電力	68,900	713.00	49,125,700	貸付有価証券 6,300株
四国電力	26,300	774.00	20,356,200	貸付有価証券 200株
九州電力	60,400	837.00	50,554,800	貸付有価証券 500株
北海道電力	26,700	492.00	13,136,400	貸付有価証券 300株
沖縄電力	6,600	1,171.00	7,728,600	貸付有価証券 200株
電源開発	23,900	2,036.00	48,660,400	貸付有価証券 1,400株
エフオン	1,900	531.00	1,008,900	貸付有価証券 1,300株
イーレックス	4,200	2,055.00	8,631,000	貸付有価証券 1,400株
レノバ	6,000	1,908.00	11,448,000	貸付有価証券 4,100株
東京瓦斯	56,200	2,511.00	141,118,200	貸付有価証券 1,200株
大阪瓦斯	53,100	2,406.00	127,758,600	貸付有価証券 100株
東邦瓦斯	12,700	2,776.00	35,255,200	
北海道瓦斯	1,500	1,616.00	2,424,000	貸付有価証券 200株

広島ガス	5,300	321.00	1,701,300	貸付有価証券 3,900株
西部ガスホールディングス	3,100	1,906.00	5,908,600	貸付有価証券 100株
静岡ガス	7,500	820.00	6,150,000	
メタウォーター	3,200	2,026.00	6,483,200	
SBSホールディングス	2,300	3,000.00	6,900,000	
東武鉄道	28,700	2,887.00	82,856,900	貸付有価証券 100株
相鉄ホールディングス	9,400	2,225.00	20,915,000	
東急	73,600	1,462.00	107,603,200	貸付有価証券 7,000株
京浜急行電鉄	36,000	1,349.00	48,564,000	貸付有価証券 700株
小田急電鉄	41,100	1,701.00	69,911,100	貸付有価証券 2,700株
京王電鉄	14,300	4,305.00	61,561,500	貸付有価証券 1,300株
京成電鉄	19,200	3,360.00	64,512,000	
富士急行	3,300	4,030.00	13,299,000	貸付有価証券 2,300株
新京成電鉄	700	2,762.00	1,933,400	
東日本旅客鉄道	49,400	6,614.00	326,731,600	貸付有価証券 1,500株
西日本旅客鉄道	34,200	4,755.00	162,621,000	
東海旅客鉄道	23,000	15,970.00	367,310,000	
西武ホールディングス	38,100	1,346.00	51,282,600	貸付有価証券 9,000株
鴻池運輸	4,500	1,168.00	5,256,000	
西日本鉄道	7,800	2,742.00	21,387,600	貸付有価証券 5,200株
ハマキョウレックス	2,100	2,932.00	6,157,200	
サカイ引越センター	1,400	4,350.00	6,090,000	貸付有価証券 300株
近鉄グループホールディングス	27,900	3,765.00	105,043,500	貸付有価証券 14,600株
阪急阪神ホールディングス	34,800	3,455.00	120,234,000	貸付有価証券 900株
南海電気鉄道	12,500	2,404.00	30,050,000	貸付有価証券 1,300株
京阪ホールディングス	11,900	2,972.00	35,366,800	
神戸電鉄	700	3,330.00	2,331,000	貸付有価証券 400株
名古屋鉄道	29,400	2,117.00	62,239,800	貸付有価証券 11,100株
山陽電気鉄道	2,100	2,138.00	4,489,800	貸付有価証券 1,400株
アルプス物流	2,100	1,164.00	2,444,400	貸付有価証券 1,300株

ヤマトホールディングス	40,800	2,226.00	90,820,800	
山九	7,300	3,860.00	28,178,000	貸付有価証券 100株
丸運	1,400	236.00	330,400	貸付有価証券 900株
丸全昭和運輸	2,100	3,070.00	6,447,000	
センコーグループホールディングス	14,000	843.00	11,802,000	
トナミホールディングス	600	3,485.00	2,091,000	
ニッコンホールディングス	9,300	2,013.00	18,720,900	貸付有価証券 1,000株
日本石油輸送	300	2,590.00	777,000	
福山通運	4,100	3,245.00	13,304,500	貸付有価証券 600株
セイノーホールディングス	17,200	1,028.00	17,681,600	貸付有価証券 200株
エスライン	800	853.00	682,400	貸付有価証券 600株
神奈川中央交通	700	3,485.00	2,439,500	貸付有価証券 400株
日立物流	5,600	8,490.00	47,544,000	貸付有価証券 400株
丸和運輸機関	5,400	1,588.00	8,575,200	貸付有価証券 3,700株
C & F ロジホールディングス	2,600	1,065.00	2,769,000	貸付有価証券 200株
九州旅客鉄道	20,500	2,576.00	52,808,000	貸付有価証券 200株
S Gホールディングス	51,000	2,321.00	118,371,000	
NIPPON EXPRESSホールディングス	9,100	7,450.00	67,795,000	
日本郵船	24,400	10,700.00	261,080,000	
商船三井	46,100	3,445.00	158,814,500	貸付有価証券 8,500株
川崎汽船	9,000	10,240.00	92,160,000	
N S ユナイテッド海運	1,500	4,200.00	6,300,000	貸付有価証券 700株
飯野海運	12,200	661.00	8,064,200	貸付有価証券 700株
乾汽船	1,900	1,802.00	3,423,800	貸付有価証券 1,200株
日本航空	64,000	2,346.00	150,144,000	貸付有価証券 3,500株
A N A ホールディングス	70,900	2,542.00	180,227,800	貸付有価証券 49,600株
パスコ	500	1,311.00	655,500	
ランコム	800	6,450.00	5,160,000	
日新	2,200	1,696.00	3,731,200	
三菱倉庫	8,100	3,040.00	24,624,000	貸付有価証券 300株

三井倉庫ホールディングス	3,000	2,926.00	8,778,000	
住友倉庫	9,100	2,143.00	19,501,300	
滋澤倉庫	1,600	2,294.00	3,670,400	
東陽倉庫	4,600	306.00	1,407,600	貸付有価証券 300株
日本トランスシティ	5,600	533.00	2,984,800	貸付有価証券 2,300株
ケイヒン	500	1,420.00	710,000	
中央倉庫	1,600	1,008.00	1,612,800	貸付有価証券 1,100株
安田倉庫	2,100	965.00	2,026,500	貸付有価証券 1,600株
ファイズホールディングス	700	763.00	534,100	貸付有価証券 300株
東洋埠頭	900	1,350.00	1,215,000	
上組	15,000	2,553.00	38,295,000	
キムラユニティー	800	1,513.00	1,210,400	貸付有価証券 400株
キューソー流通システム	1,600	1,069.00	1,710,400	貸付有価証券 600株
近鉄エクスプレス	5,500	4,175.00	22,962,500	
東海運	1,900	299.00	568,100	貸付有価証券 1,400株
エーアイティー	1,800	1,615.00	2,907,000	
内外トランスライン	1,100	2,021.00	2,223,100	貸付有価証券 700株
日本コンセプト	1,000	1,534.00	1,534,000	
NEC ネットズエスアイ	10,000	1,825.00	18,250,000	
クロスキャット	1,600	849.00	1,358,400	貸付有価証券 700株
システナ	43,100	420.00	18,102,000	貸付有価証券 300株
デジタルアーツ	1,600	7,000.00	11,200,000	
日鉄ソリューションズ	5,000	3,770.00	18,850,000	
キューブシステム	1,500	943.00	1,414,500	貸付有価証券 700株
WOW WORLD	400	1,092.00	436,800	貸付有価証券 300株
コア	1,300	1,472.00	1,913,600	貸付有価証券 300株
手間いらず	400	5,790.00	2,316,000	貸付有価証券 200株
ラクーンホールディングス	2,600	1,462.00	3,801,200	貸付有価証券 100株
ソリトンシステムズ	1,500	1,283.00	1,924,500	貸付有価証券 400株
ソフトクリエイイトホールディングス	1,300	4,155.00	5,401,500	貸付有価証券 100株

T I S	27,200	3,375.00	91,800,000	貸付有価証券 100株
J N S ホールディングス	1,400	402.00	562,800	貸付有価証券 700株
グリー	13,700	874.00	11,973,800	貸付有価証券 9,300株
G M O ペパボ	300	2,156.00	646,800	貸付有価証券 200株
コーエーテクモホールディングス	9,600	4,560.00	43,776,000	貸付有価証券 6,000株
三菱総合研究所	1,400	4,125.00	5,775,000	
ボルテージ	900	354.00	318,600	
電算	400	2,299.00	919,600	貸付有価証券 200株
A G S	1,300	748.00	972,400	貸付有価証券 1,000株
ファインデックス	2,500	614.00	1,535,000	
ブレインパッド	2,600	1,108.00	2,880,800	貸付有価証券 100株
K L a b	5,400	504.00	2,721,600	貸付有価証券 1,200株
ポルトゥウィンホールディングス	4,400	1,029.00	4,527,600	
ネクソン	68,600	3,200.00	219,520,000	貸付有価証券 6,700株
アイスタイル	8,100	221.00	1,790,100	貸付有価証券 6,000株
エムアップホールディングス	3,500	1,195.00	4,182,500	貸付有価証券 100株
エイチーム	2,000	731.00	1,462,000	貸付有価証券 1,400株
エニグモ	3,300	552.00	1,821,600	貸付有価証券 800株
テクノスジャパン	2,300	514.00	1,182,200	
e n i s h	2,200	322.00	708,400	貸付有価証券 200株
コロプラ	10,000	636.00	6,360,000	
オルトプラス	2,300	327.00	752,100	貸付有価証券 1,100株
ブロードリーフ	15,000	390.00	5,850,000	貸付有価証券 1,100株
クロス・マーケティンググループ	1,200	804.00	964,800	貸付有価証券 700株
デジタルハーツホールディングス	1,400	1,867.00	2,613,800	貸付有価証券 200株
システム情報	2,300	1,015.00	2,334,500	貸付有価証券 500株
メディアドゥ	1,100	1,890.00	2,079,000	貸付有価証券 700株
じげん	8,600	372.00	3,199,200	貸付有価証券 200株

ブイキューブ	3,100	869.00	2,693,900	貸付有価証券 2,100株
エンカレッジ・テクノロジー	700	511.00	357,700	
サイバーリンクス	1,000	1,022.00	1,022,000	貸付有価証券 200株
フィックスターズ	3,000	853.00	2,559,000	
CARTA HOLDINGS	1,200	1,944.00	2,332,800	貸付有価証券 800株
オブティム	2,100	836.00	1,755,600	貸付有価証券 1,400株
セレス	1,100	1,353.00	1,488,300	貸付有価証券 500株
SHIFT	1,800	19,880.00	35,784,000	貸付有価証券 600株
ティーガイア	2,700	1,634.00	4,411,800	貸付有価証券 1,700株
セック	400	2,507.00	1,002,800	貸付有価証券 200株
テクマトリックス	5,100	1,619.00	8,256,900	
プロシップ	1,000	1,480.00	1,480,000	貸付有価証券 700株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	7,800	2,441.00	19,039,800	貸付有価証券 200株
GMOペイメントゲートウェイ	5,900	10,680.00	63,012,000	貸付有価証券 1,100株
ザッパラス	1,100	392.00	431,200	貸付有価証券 600株
システムリサーチ	900	2,072.00	1,864,800	
インターネットイニシアティブ	8,000	4,735.00	37,880,000	
さくらインターネット	3,200	558.00	1,785,600	貸付有価証券 2,200株
ヴィンクス	900	1,095.00	985,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	700	5,620.00	3,934,000	
SRAホールディングス	1,500	2,813.00	4,219,500	
システムインテグレータ	1,000	481.00	481,000	貸付有価証券 400株
朝日ネット	2,700	609.00	1,644,300	
eBASE	3,700	485.00	1,794,500	貸付有価証券 2,300株
アバント	3,200	1,332.00	4,262,400	
アドソル日進	1,100	1,578.00	1,735,800	貸付有価証券 700株
ODKソリューションズ	600	587.00	352,200	
フリービット	1,600	885.00	1,416,000	貸付有価証券 1,100株
コムチュア	3,400	2,839.00	9,652,600	
サイバーコム	500	1,160.00	580,000	貸付有価証券 200株

アステリア	2,200	993.00	2,184,600	貸付有価証券 800株
アイル	1,500	1,424.00	2,136,000	貸付有価証券 300株
マークラインズ	1,500	2,405.00	3,607,500	
メディカル・データ・ビジョン	3,800	952.00	3,617,600	貸付有価証券 2,500株
g u m i	4,200	512.00	2,150,400	貸付有価証券 2,800株
ショーケース	700	456.00	319,200	
モバイルファクトリー	700	1,036.00	725,200	貸付有価証券 400株
テラスカイ	1,100	1,391.00	1,530,100	貸付有価証券 700株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,300	1,446.00	1,879,800	
P C Iホールディングス	1,200	1,040.00	1,248,000	
パイブドHD	600	2,739.00	1,643,400	貸付有価証券 100株
アイビーシー	500	505.00	252,500	
ネオジャパン	900	1,241.00	1,116,900	貸付有価証券 300株
P R T I M E S	600	2,148.00	1,288,800	貸付有価証券 400株
ラクス	13,900	1,600.00	22,240,000	貸付有価証券 6,200株
ランドコンピュータ	700	921.00	644,700	貸付有価証券 400株
ダブルスタンダード	900	2,007.00	1,806,300	貸付有価証券 400株
オープンドア	1,800	1,971.00	3,547,800	貸付有価証券 1,200株
マイネット	1,200	512.00	614,400	貸付有価証券 500株
アカツキ	1,300	2,883.00	3,747,900	
ベネフィットジャパン	200	2,080.00	416,000	
U b i c o mホールディングス	800	2,711.00	2,168,800	貸付有価証券 500株
カナミックネットワーク	3,600	505.00	1,818,000	貸付有価証券 1,600株
ノムラシステムコーポレーション	1,600	227.00	363,200	貸付有価証券 400株
チェンジ	6,000	1,764.00	10,584,000	貸付有価証券 3,900株
シンクロ・フード	1,800	289.00	520,200	貸付有価証券 300株
オークネット	1,600	1,785.00	2,856,000	貸付有価証券 1,000株
キャピタル・アセット・プランニング	600	705.00	423,000	
セグエグループ	700	540.00	378,000	

エイトレッド	400	2,020.00	808,000	貸付有価証券 300株
マクロミル	6,100	1,004.00	6,124,400	貸付有価証券 100株
ビーグリー	700	1,500.00	1,050,000	貸付有価証券 100株
オロ	900	1,895.00	1,705,500	貸付有価証券 600株
ユーザーローカル	900	1,760.00	1,584,000	
テモナ	600	389.00	233,400	
ニーズウェル	800	688.00	550,400	貸付有価証券 100株
マネーフォワード	6,100	3,605.00	21,990,500	貸付有価証券 3,700株
サインポスト	1,000	889.00	889,000	貸付有価証券 700株
電算システムホールディングス	1,200	2,379.00	2,854,800	
ソルクシーズ	2,400	378.00	907,200	
フェイス	900	678.00	610,200	
プロトコーポレーション	3,200	996.00	3,187,200	
ハイマックス	800	1,291.00	1,032,800	
野村総合研究所	54,400	3,550.00	193,120,000	貸付有価証券 100株
サイバネットシステム	2,100	733.00	1,539,300	貸付有価証券 100株
C Eホールディングス	1,500	486.00	729,000	貸付有価証券 1,100株
日本システム技術	600	2,445.00	1,467,000	
インテージホールディングス	3,500	1,414.00	4,949,000	貸付有価証券 2,400株
東邦システムサイエンス	800	928.00	742,400	貸付有価証券 500株
ソースネクスト	13,100	243.00	3,183,300	貸付有価証券 8,200株
インフォコム	3,300	2,152.00	7,101,600	
シンプレクス・ホールディングス	4,900	1,911.00	9,363,900	
HEROZ	900	911.00	819,900	貸付有価証券 400株
ラクスル	3,500	2,140.00	7,490,000	貸付有価証券 2,300株
I P S	800	2,428.00	1,942,400	貸付有価証券 100株
F I G	3,400	310.00	1,054,000	貸付有価証券 2,100株
システムサポート	1,100	1,186.00	1,304,600	
イーソル	1,900	564.00	1,071,600	貸付有価証券 1,200株
アルテリア・ネットワークス	3,200	1,258.00	4,025,600	
東海ソフト	500	1,037.00	518,500	

ウイングアーク1st	2,300	1,396.00	3,210,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	700	1,634.00	1,143,800	貸付有価証券 200株
サーバーワークス	500	2,159.00	1,079,500	貸付有価証券 300株
東名	300	981.00	294,300	
ヴィッツ	300	1,196.00	358,800	
トピラシステムズ	700	805.00	563,500	
Sansan	9,900	1,020.00	10,098,000	貸付有価証券 6,900株
Link-U	600	657.00	394,200	貸付有価証券 400株
ギフトィ	2,600	1,095.00	2,847,000	貸付有価証券 1,800株
ベース	500	6,230.00	3,115,000	
JMDC	3,800	5,230.00	19,874,000	貸付有価証券 700株
フォーカスシステムズ	1,900	916.00	1,740,400	貸付有価証券 1,300株
クレスコ	2,200	2,168.00	4,769,600	
フジ・メディア・ホールディングス	27,600	1,096.00	30,249,600	貸付有価証券 200株
オービック	9,500	19,080.00	181,260,000	貸付有価証券 200株
ジャストシステム	4,300	4,710.00	20,253,000	貸付有価証券 1,400株
TDCソフト	2,500	1,061.00	2,652,500	
Zホールディングス	435,300	426.20	185,524,860	貸付有価証券 13,700株
トレンドマイクロ	15,200	7,570.00	115,064,000	貸付有価証券 4,100株
IDホールディングス	1,800	852.00	1,533,600	
日本オラクル	4,900	7,820.00	38,318,000	
アルファシステムズ	800	4,155.00	3,324,000	
フューチャー	6,400	1,652.00	10,572,800	
CAC Holdings	1,600	1,410.00	2,256,000	貸付有価証券 100株
SBテクノロジー	1,300	2,315.00	3,009,500	
トーセ	800	737.00	589,600	
オービックビジネスコンサルタント	2,900	4,470.00	12,963,000	貸付有価証券 1,900株
伊藤忠テクノソリューションズ	13,800	3,215.00	44,367,000	貸付有価証券 200株
アイティフォー	3,700	786.00	2,908,200	
東計電算	400	6,110.00	2,444,000	貸付有価証券 200株
エクスネット	500	1,006.00	503,000	
大塚商会	16,300	4,085.00	66,585,500	貸付有価証券 10,900株

サイボウズ	4,000	1,048.00	4,192,000	貸付有価証券 600株
電通国際情報サービス	3,900	4,105.00	16,009,500	貸付有価証券 2,800株
A C C E S S	3,400	579.00	1,968,600	
デジタルガレージ	5,000	3,865.00	19,325,000	貸付有価証券 3,400株
E Mシステムズ	5,000	894.00	4,470,000	貸付有価証券 500株
ウェザーニューズ	900	6,710.00	6,039,000	貸付有価証券 600株
C I J	2,300	800.00	1,840,000	
ビジネスエンジニアリング	600	2,010.00	1,206,000	貸付有価証券 400株
日本エンタープライズ	3,000	162.00	486,000	貸付有価証券 700株
WOWOW	1,300	1,519.00	1,974,700	貸付有価証券 800株
スカラ	2,500	765.00	1,912,500	
インテリジェント ウェイブ	1,500	641.00	961,500	
I M A G I C A G R O U P	2,400	703.00	1,687,200	
ネットワンシステムズ	11,100	2,778.00	30,835,800	
システムソフト	8,300	108.00	896,400	貸付有価証券 3,100株
アルゴグラフィックス	2,400	3,125.00	7,500,000	
マーベラス	4,800	713.00	3,422,400	貸付有価証券 300株
エイベックス	5,200	1,162.00	6,042,400	貸付有価証券 3,500株
B I P R O G Y	9,400	2,826.00	26,564,400	貸付有価証券 100株
兼松エレクトロニクス	1,600	3,960.00	6,336,000	
都築電気	1,400	1,377.00	1,927,800	
T B Sホールディングス	15,900	1,695.00	26,950,500	貸付有価証券 1,700株
日本テレビホールディングス	25,200	1,218.00	30,693,600	
朝日放送グループホールディングス	2,800	663.00	1,856,400	貸付有価証券 2,000株
テレビ朝日ホールディングス	7,300	1,452.00	10,599,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	25,600	465.00	11,904,000	貸付有価証券 100株
テレビ東京ホールディングス	1,900	2,021.00	3,839,900	
日本BS放送	1,000	1,055.00	1,055,000	貸付有価証券 100株
ビジョン	5,000	1,334.00	6,670,000	
スマートバリュー	900	543.00	488,700	貸付有価証券 300株
U S E N - N E X T H O L D I N G S	2,500	2,045.00	5,112,500	貸付有価証券 1,800株

コネクシオ	2,100	1,384.00	2,906,400	
日本通信	25,100	201.00	5,045,100	貸付有価証券 8,700株
クロップス	600	1,091.00	654,600	貸付有価証券 300株
日本電信電話	330,900	3,911.00	1,294,149,900	貸付有価証券 38,800株
K D D I	220,100	4,486.00	987,368,600	貸付有価証券 100株
ソフトバンク	457,300	1,480.00	676,804,000	貸付有価証券 13,800株
光通信	3,500	14,600.00	51,100,000	貸付有価証券 100株
エムティーアイ	2,600	459.00	1,193,400	貸付有価証券 1,400株
G M Oインターネット	10,600	2,521.00	26,722,600	貸付有価証券 4,600株
ファイバーゲート	1,400	1,034.00	1,447,600	貸付有価証券 700株
アйдママーケティングコミュニケーション	700	285.00	199,500	
K A D O K A W A	16,300	3,010.00	49,063,000	貸付有価証券 600株
学研ホールディングス	4,300	847.00	3,642,100	貸付有価証券 1,100株
ゼンリン	4,900	915.00	4,483,500	
昭文社ホールディングス	1,500	412.00	618,000	貸付有価証券 900株
インプレスホールディングス	2,400	216.00	518,400	貸付有価証券 1,700株
アイネット	1,400	1,259.00	1,762,600	
松竹	1,800	13,520.00	24,336,000	
東宝	17,800	5,090.00	90,602,000	
東映	900	18,460.00	16,614,000	貸付有価証券 100株
エヌ・ティ・ティ・データ	80,400	2,024.00	162,729,600	貸付有価証券 300株
ピー・シー・エー	1,800	1,234.00	2,221,200	貸付有価証券 1,100株
ビジネスブレイン太田昭和	1,000	1,505.00	1,505,000	貸付有価証券 200株
D T S	5,600	3,065.00	17,164,000	貸付有価証券 700株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	14,000	6,410.00	89,740,000	
シーイーシー	3,200	1,226.00	3,923,200	
カブコン	28,500	3,660.00	104,310,000	貸付有価証券 1,900株
アイ・エス・ピー	1,400	1,040.00	1,456,000	
ジャステック	1,800	1,165.00	2,097,000	貸付有価証券 300株
S C S K	20,900	2,153.00	44,997,700	

日本システムウエア	1,100	2,480.00	2,728,000	
アイネス	2,500	1,515.00	3,787,500	
T K C	4,800	3,370.00	16,176,000	
富士ソフト	3,000	7,310.00	21,930,000	貸付有価証券 1,800株
N S D	9,500	2,322.00	22,059,000	貸付有価証券 100株
コナミホールディングス	11,000	8,800.00	96,800,000	貸付有価証券 100株
福井コンピュータホールディングス	1,400	3,290.00	4,606,000	
J B C Cホールディングス	2,100	1,623.00	3,408,300	
ミロク情報サービス	2,700	1,245.00	3,361,500	貸付有価証券 100株
ソフトバンクグループ	181,100	5,379.00	974,136,900	代用有価証券 17,000株 貸付有価証券 11,700株
高千穂交易	1,100	1,830.00	2,013,000	貸付有価証券 700株
オルバヘルスケアホールディングス	500	1,801.00	900,500	
伊藤忠食品	700	4,680.00	3,276,000	貸付有価証券 400株
エレマテック	2,500	1,305.00	3,262,500	貸付有価証券 100株
あらた	2,300	4,015.00	9,234,500	
トーメンデバイス	500	6,050.00	3,025,000	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン デバイス	900	5,620.00	5,058,000	貸付有価証券 100株
フィールズ	2,700	1,085.00	2,929,500	
双日	31,900	2,039.00	65,044,100	貸付有価証券 22,400株
アルフレッサ ホールディングス	32,200	1,692.00	54,482,400	貸付有価証券 3,500株
横浜冷凍	7,800	841.00	6,559,800	
神栄	500	969.00	484,500	
ラサ商事	1,400	969.00	1,356,600	
アルコニックス	3,800	1,285.00	4,883,000	貸付有価証券 2,100株
神戸物産	21,800	3,125.00	68,125,000	貸付有価証券 14,900株
ハイパー	900	477.00	429,300	
あい ホールディングス	4,300	1,637.00	7,039,100	貸付有価証券 2,800株
ディーブイエックス	1,000	1,087.00	1,087,000	貸付有価証券 700株
ダイワボウホールディングス	13,500	1,730.00	23,355,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	7,200	2,852.00	20,534,400	貸付有価証券 400株

ラクト・ジャパン	1,000	1,998.00	1,998,000	貸付有価証券 700株
グリムス	1,400	1,519.00	2,126,600	貸付有価証券 200株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,000	699.00	3,495,000	
八洲電機	2,200	990.00	2,178,000	貸付有価証券 1,400株
メディアスホールディングス	1,800	1,065.00	1,917,000	貸付有価証券 1,100株
レスターホールディングス	2,900	2,045.00	5,930,500	
ジュテックホールディングス	700	1,014.00	709,800	貸付有価証券 400株
大光	1,500	716.00	1,074,000	貸付有価証券 900株
OCHIホールディングス	700	1,227.00	858,900	貸付有価証券 500株
TOKAIホールディングス	14,700	879.00	12,921,300	貸付有価証券 9,700株
黒谷	900	587.00	528,300	貸付有価証券 600株
Cominix	500	732.00	366,000	貸付有価証券 300株
三洋貿易	2,900	960.00	2,784,000	貸付有価証券 100株
ビューティガレージ	500	2,544.00	1,272,000	貸付有価証券 300株
ウイン・パートナーズ	2,200	1,037.00	2,281,400	貸付有価証券 1,400株
ミタチ産業	800	939.00	751,200	
シップヘルスケアホールディングス	9,100	2,295.00	20,884,500	貸付有価証券 1,300株
明治電機工業	1,000	1,098.00	1,098,000	
デリカフーズホールディングス	1,400	547.00	765,800	貸付有価証券 900株
スターティアホールディングス	700	786.00	550,200	
コメダホールディングス	6,600	2,221.00	14,658,600	
ピーバンドットコム	500	544.00	272,000	
アセンテック	1,100	753.00	828,300	貸付有価証券 700株
富士興産	800	1,147.00	917,600	
協栄産業	300	1,342.00	402,600	
フルサト・マルカホールディングス	2,800	3,770.00	10,556,000	
ヤマエグループホールディングス	1,800	1,169.00	2,104,200	
小野建	2,800	1,389.00	3,889,200	貸付有価証券 300株
南陽	600	1,850.00	1,110,000	貸付有価証券 400株
佐島電機	1,900	1,135.00	2,156,500	貸付有価証券 1,200株

エコトレーディング	400	571.00	228,400	貸付有価証券 300株
伯東	1,800	2,847.00	5,124,600	貸付有価証券 100株
コンドーテック	2,300	1,077.00	2,477,100	貸付有価証券 1,500株
中山福	1,500	331.00	496,500	貸付有価証券 500株
ナガイレーベン	3,800	1,922.00	7,303,600	
三菱食品	3,000	3,105.00	9,315,000	貸付有価証券 100株
松田産業	2,200	2,045.00	4,499,000	貸付有価証券 1,500株
第一興商	5,800	3,985.00	23,113,000	貸付有価証券 3,800株
メディパルホールディングス	29,600	1,803.00	53,368,800	貸付有価証券 3,800株
S P K	1,200	1,369.00	1,642,800	
萩原電気ホールディングス	1,100	2,053.00	2,258,300	
アズワン	4,300	6,280.00	27,004,000	
スズデン	1,000	2,017.00	2,017,000	
尾家産業	800	885.00	708,000	貸付有価証券 600株
シモジマ	1,800	968.00	1,742,400	貸付有価証券 1,200株
ドウシシャ	2,900	1,539.00	4,463,100	貸付有価証券 1,700株
小津産業	700	1,940.00	1,358,000	貸付有価証券 400株
高速	1,700	1,570.00	2,669,000	
たけびし	1,100	1,472.00	1,619,200	貸付有価証券 700株
リックス	700	1,945.00	1,361,500	貸付有価証券 400株
丸文	2,500	808.00	2,020,000	
ハピネット	2,400	1,582.00	3,796,800	貸付有価証券 1,600株
橋本総業ホールディングス	500	1,921.00	960,500	貸付有価証券 300株
日本ライフライン	9,100	920.00	8,372,000	
タカショー	2,400	753.00	1,807,200	貸付有価証券 1,600株
I D O M	9,200	675.00	6,210,000	貸付有価証券 500株
進和	1,800	2,175.00	3,915,000	
エスケイジャパン	800	450.00	360,000	貸付有価証券 400株
ダイترون	1,200	2,072.00	2,486,400	
シークス	4,000	1,069.00	4,276,000	

田中商事	800	623.00	498,400	
オーハシテクニカ	1,500	1,276.00	1,914,000	貸付有価証券 1,000株
白銅	1,000	2,506.00	2,506,000	貸付有価証券 700株
ダイコー通産	300	1,198.00	359,400	
伊藤忠商事	191,800	3,695.00	708,701,000	貸付有価証券 2,300株
丸紅	276,800	1,353.50	374,648,800	貸付有価証券 100株
高島	400	2,480.00	992,000	
長瀬産業	14,600	1,815.00	26,499,000	貸付有価証券 1,000株
蝶理	1,700	1,974.00	3,355,800	
豊田通商	28,200	4,925.00	138,885,000	貸付有価証券 1,000株
三共生興	3,900	552.00	2,152,800	
兼松	10,800	1,307.00	14,115,600	
ツカモトコーポレーション	500	1,276.00	638,000	貸付有価証券 300株
三井物産	224,900	3,232.00	726,876,800	貸付有価証券 600株
日本紙パルプ商事	1,500	3,590.00	5,385,000	貸付有価証券 500株
カメイ	3,400	1,057.00	3,593,800	
東都水産	200	4,495.00	899,000	
OUGホールディングス	400	2,768.00	1,107,200	貸付有価証券 200株
スターゼン	2,100	1,973.00	4,143,300	
山善	11,500	944.00	10,856,000	貸付有価証券 300株
椿本興業	500	3,610.00	1,805,000	貸付有価証券 300株
住友商事	183,300	1,850.00	339,105,000	貸付有価証券 12,200株
内田洋行	1,200	4,685.00	5,622,000	
三菱商事	208,200	4,433.00	922,950,600	貸付有価証券 100株
第一実業	1,200	3,265.00	3,918,000	
キャノンマーケティングジャパン	7,500	3,010.00	22,575,000	貸付有価証券 4,900株
西華産業	1,400	1,635.00	2,289,000	
佐藤商事	2,200	1,163.00	2,558,600	
菱洋エレクトロ	1,800	2,110.00	3,798,000	貸付有価証券 1,100株
東京産業	2,500	705.00	1,762,500	貸付有価証券 800株
ユアサ商事	2,600	3,205.00	8,333,000	貸付有価証券 100株

神鋼商事	700	3,815.00	2,670,500	
トルク	1,800	210.00	378,000	
阪和興業	5,500	2,987.00	16,428,500	
正栄食品工業	2,000	4,035.00	8,070,000	貸付有価証券 1,200株
カナデン	2,500	1,006.00	2,515,000	貸付有価証券 1,600株
菱電商事	2,400	1,645.00	3,948,000	貸付有価証券 1,600株
岩谷産業	6,900	5,360.00	36,984,000	
ナイス	1,000	1,664.00	1,664,000	
ニチモウ	400	2,455.00	982,000	
極東貿易	900	2,587.00	2,328,300	貸付有価証券 500株
アステナホールディングス	4,100	409.00	1,676,900	貸付有価証券 500株
三愛オブリ	7,000	959.00	6,713,000	
稲畑産業	6,100	2,216.00	13,517,600	貸付有価証券 1,600株
G S Iクレオス	1,500	1,275.00	1,912,500	貸付有価証券 700株
明和産業	2,800	698.00	1,954,400	貸付有価証券 1,900株
クワザワホールディングス	1,300	470.00	611,000	貸付有価証券 900株
ワキタ	5,800	1,102.00	6,391,600	貸付有価証券 600株
東邦ホールディングス	8,700	1,950.00	16,965,000	
サンゲツ	7,500	1,534.00	11,505,000	
ミツウロコグループホールディングス	3,800	946.00	3,594,800	貸付有価証券 2,900株
シナネンホールディングス	1,000	3,485.00	3,485,000	
伊藤忠エネクス	6,700	1,042.00	6,981,400	
サンリオ	8,800	2,618.00	23,038,400	貸付有価証券 1,300株
サンワテクノス	1,600	1,421.00	2,273,600	
リョーサン	3,200	2,486.00	7,955,200	
新光商事	4,200	897.00	3,767,400	貸付有価証券 100株
トーホー	1,300	1,157.00	1,504,100	貸付有価証券 900株
三信電気	1,300	1,597.00	2,076,100	
東陽テクニカ	3,000	1,079.00	3,237,000	
モスフードサービス	4,000	3,040.00	12,160,000	貸付有価証券 2,600株
加賀電子	2,600	3,110.00	8,086,000	貸付有価証券 100株
ソーダニッカ	2,700	630.00	1,701,000	貸付有価証券 2,000株

立花エレテック	2,100	1,562.00	3,280,200	貸付有価証券 1,400株
フォーバル	1,300	921.00	1,197,300	
PALTA C	4,200	4,395.00	18,459,000	
三谷産業	4,800	312.00	1,497,600	貸付有価証券 1,100株
太平洋興発	1,100	669.00	735,900	
西本Wismettacホールディングス	700	3,440.00	2,408,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	1,937.00	581,100	貸付有価証券 200株
コア商事ホールディングス	1,900	846.00	1,607,400	貸付有価証券 1,000株
国際紙バルブ商事	5,900	391.00	2,306,900	貸付有価証券 200株
ヤマタネ	1,300	1,624.00	2,111,200	
丸紅建材リース	200	1,889.00	377,800	
日鉄物産	2,000	5,360.00	10,720,000	
泉州電業	800	5,400.00	4,320,000	貸付有価証券 500株
トラスコ中山	6,300	1,844.00	11,617,200	貸付有価証券 300株
オートバックスセブン	9,700	1,363.00	13,221,100	貸付有価証券 6,800株
モリト	2,200	741.00	1,630,200	貸付有価証券 100株
加藤産業	3,600	3,140.00	11,304,000	
北恵	800	898.00	718,400	貸付有価証券 400株
イノテック	1,900	1,344.00	2,553,600	
イエローハット	5,000	1,618.00	8,090,000	貸付有価証券 3,500株
J Kホールディングス	2,200	923.00	2,030,600	貸付有価証券 1,600株
日伝	2,200	2,025.00	4,455,000	貸付有価証券 1,600株
北沢産業	2,300	213.00	489,900	
杉本商事	1,400	2,336.00	3,270,400	貸付有価証券 600株
因幡電機産業	7,700	2,604.00	20,050,800	
東テク	900	3,120.00	2,808,000	
ミスミグループ本社	38,000	2,917.00	110,846,000	
アルテック	1,900	240.00	456,000	
タキヒヨー	800	1,032.00	825,600	貸付有価証券 400株
蔵王産業	600	2,000.00	1,200,000	
スズケン	11,200	3,505.00	39,256,000	貸付有価証券 200株
ジェコス	2,000	829.00	1,658,000	

グローセル	3,400	411.00	1,397,400	貸付有価証券 2,300株
ローソン	6,700	4,560.00	30,552,000	貸付有価証券 4,600株
サンエー	2,200	3,935.00	8,657,000	
カワチ薬品	2,400	2,040.00	4,896,000	
エービーシー・マート	4,700	5,500.00	25,850,000	
ハードオフコーポレーション	1,300	863.00	1,121,900	
アスクル	6,900	1,450.00	10,005,000	貸付有価証券 4,600株
ゲオホールディングス	3,800	1,219.00	4,632,200	
アダストリア	3,300	2,134.00	7,042,200	
ジーフット	2,500	334.00	835,000	貸付有価証券 1,600株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	700	387.00	270,900	貸付有価証券 300株
くら寿司	3,200	2,960.00	9,472,000	貸付有価証券 2,100株
キャンドウ	1,100	2,372.00	2,609,200	貸付有価証券 700株
アイケイ	1,000	526.00	526,000	貸付有価証券 600株
パルグループホールディングス	2,700	1,614.00	4,357,800	
エディオン	13,900	1,208.00	16,791,200	貸付有価証券 6,100株
サーラコーポレーション	6,200	619.00	3,837,800	
ワッツ	1,400	741.00	1,037,400	貸付有価証券 900株
ハローズ	1,400	3,220.00	4,508,000	
フジオフードグループ本社	2,400	1,354.00	3,249,600	貸付有価証券 1,700株
あみやき亭	700	2,927.00	2,048,900	貸付有価証券 400株
大黒天物産	1,000	4,635.00	4,635,000	貸付有価証券 600株
ハニーズホールディングス	2,500	1,061.00	2,652,500	貸付有価証券 1,700株
ファーマライズホールディングス	700	728.00	509,600	貸付有価証券 400株
アルペン	2,300	1,928.00	4,434,400	貸付有価証券 1,500株
ハブ	1,200	520.00	624,000	貸付有価証券 800株
クオールホールディングス	3,700	1,254.00	4,639,800	貸付有価証券 2,500株
ジinzホールディングス	1,800	4,120.00	7,416,000	貸付有価証券 1,400株
ビックカメラ	18,000	1,135.00	20,430,000	貸付有価証券 12,300株
D C Mホールディングス	18,000	1,060.00	19,080,000	

MonotaRO	38,300	1,888.00	72,310,400	貸付有価証券 9,500株
東京一番フーズ	1,000	593.00	593,000	貸付有価証券 400株
アークランドサービスホールディングス	2,200	2,060.00	4,532,000	貸付有価証券 1,500株
J.フロント リテイリング	34,500	1,041.00	35,914,500	貸付有価証券 600株
ドトール・日レスホールディングス	5,000	1,499.00	7,495,000	貸付有価証券 100株
マツキヨココカラ&カンパニー	18,000	4,950.00	89,100,000	貸付有価証券 100株
ブロンコピリー	1,600	2,417.00	3,867,200	貸付有価証券 1,100株
ZOZO	20,800	2,745.00	57,096,000	
トレジャー・ファクトリー	900	1,051.00	945,900	貸付有価証券 600株
物語コーポレーション	1,500	5,310.00	7,965,000	貸付有価証券 1,000株
三越伊勢丹ホールディングス	48,000	1,077.00	51,696,000	貸付有価証券 200株
Hamee	1,100	1,230.00	1,353,000	貸付有価証券 500株
マーケットエンタープライズ	300	1,051.00	315,300	貸付有価証券 100株
ウエルシアホールディングス	16,000	2,595.00	41,520,000	貸付有価証券 900株
クリエイティブSDホールディングス	4,500	2,937.00	13,216,500	貸付有価証券 3,000株
丸善CHIホールディングス	3,600	393.00	1,414,800	貸付有価証券 2,400株
ミサワ	600	632.00	379,200	貸付有価証券 400株
ティーライフ	400	1,476.00	590,400	貸付有価証券 200株
シュッピン	2,500	1,463.00	3,657,500	貸付有価証券 1,600株
オイシックス・ラ・大地	4,400	1,904.00	8,377,600	貸付有価証券 1,500株
ネクステージ	6,200	2,052.00	12,722,400	貸付有価証券 800株
ジョイフル本田	9,100	1,596.00	14,523,600	貸付有価証券 6,200株
鳥貴族ホールディングス	1,000	1,898.00	1,898,000	貸付有価証券 500株
ホットランド	2,300	1,330.00	3,059,000	貸付有価証券 1,100株
すかいらーくホールディングス	37,700	1,544.00	58,208,800	貸付有価証券 26,300株
SFPホールディングス	1,500	1,530.00	2,295,000	貸付有価証券 900株

綿半ホールディングス	2,200	1,349.00	2,967,800	貸付有価証券 900株
ヨシックスホールディングス	600	2,137.00	1,282,200	貸付有価証券 400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8,900	1,048.00	9,327,200	貸付有価証券 5,700株
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,600	1,216.00	1,945,600	貸付有価証券 1,100株
B E E N O S	1,500	1,780.00	2,670,000	貸付有価証券 1,000株
あさひ	2,500	1,299.00	3,247,500	貸付有価証券 1,600株
日本調剤	1,900	1,227.00	2,331,300	貸付有価証券 1,200株
コスモス薬品	3,100	12,200.00	37,820,000	貸付有価証券 2,100株
トーエル	1,300	867.00	1,127,100	貸付有価証券 900株
セブン&アイ・ホールディングス	107,300	5,410.00	580,493,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,900	881.00	16,650,900	貸付有価証券 12,000株
ツルハホールディングス	6,600	7,040.00	46,464,000	貸付有価証券 3,400株
サンマルクホールディングス	2,400	1,513.00	3,631,200	
フェリシモ	700	1,199.00	839,300	貸付有価証券 400株
トリドールホールディングス	7,500	2,277.00	17,077,500	貸付有価証券 2,000株
T O K Y O B A S E	2,900	346.00	1,003,400	貸付有価証券 1,900株
ウイルプラスホールディングス	600	937.00	562,200	貸付有価証券 200株
J Mホールディングス	2,200	1,522.00	3,348,400	貸付有価証券 1,400株
サツドラホールディングス	1,400	659.00	922,600	貸付有価証券 1,000株
アレンザホールディングス	2,100	1,023.00	2,148,300	貸付有価証券 1,500株
串カツ田中ホールディングス	900	1,794.00	1,614,600	貸付有価証券 100株
パロックジャパンリミテッド	2,100	813.00	1,707,300	貸付有価証券 1,400株
クスリのアオキホールディングス	2,800	5,480.00	15,344,000	貸付有価証券 800株
F O O D & L I F E C O M P A N I E	16,300	2,809.00	45,786,700	貸付有価証券 800株
メディカルシステムネットワーク	2,700	436.00	1,177,200	
藤久ホールディングス	1,000	725.00	725,000	貸付有価証券 200株
はるやまホールディングス	1,600	477.00	763,200	貸付有価証券 1,100株

ノジマ	4,900	2,938.00	14,396,200	貸付有価証券 500株
カップ・クリエイト	4,300	1,389.00	5,972,700	貸付有価証券 2,900株
ライトオン	2,500	735.00	1,837,500	貸付有価証券 1,600株
良品計画	34,900	1,371.00	47,847,900	貸付有価証券 3,700株
パリミキホールディングス	3,800	273.00	1,037,400	貸付有価証券 400株
アドヴァングループ	2,800	790.00	2,212,000	貸付有価証券 2,100株
アルピス	900	2,221.00	1,998,900	貸付有価証券 500株
コナカ	3,500	337.00	1,179,500	貸付有価証券 400株
ハウス オブ ローゼ	400	1,670.00	668,000	貸付有価証券 300株
G - 7ホールディングス	3,400	1,423.00	4,838,200	
イオン北海道	4,400	1,068.00	4,699,200	貸付有価証券 1,100株
コジマ	5,300	621.00	3,291,300	貸付有価証券 3,600株
ヒマラヤ	1,000	943.00	943,000	貸付有価証券 700株
コーナン商事	4,300	3,660.00	15,738,000	
エコス	1,000	1,977.00	1,977,000	貸付有価証券 700株
パン・バシフィック・インターナショナル ホールディングス	60,600	1,983.00	120,169,800	貸付有価証券 41,500株
西松屋チェーン	6,200	1,467.00	9,095,400	貸付有価証券 4,400株
ゼンショーホールディングス	14,800	2,968.00	43,926,400	貸付有価証券 10,100株
幸楽苑ホールディングス	1,800	1,270.00	2,286,000	貸付有価証券 1,200株
ハークスレイ	1,500	544.00	816,000	貸付有価証券 800株
サイゼリヤ	4,500	2,406.00	10,827,000	貸付有価証券 3,000株
V Tホールディングス	11,400	458.00	5,221,200	貸付有価証券 7,700株
魚力	800	2,329.00	1,863,200	貸付有価証券 600株
フジ・コーポレーション	1,600	1,168.00	1,868,800	貸付有価証券 1,000株
ユナイテッドアローズ	3,200	2,029.00	6,492,800	貸付有価証券 2,100株
ハイデイ日高	4,400	1,962.00	8,632,800	貸付有価証券 2,800株
YU - WA Creation Holdings	2,200	245.00	539,000	

コロワイド	12,500	1,722.00	21,525,000	貸付有価証券 8,500株
ピーシーデポコーポレーション	3,600	351.00	1,263,600	貸付有価証券 2,400株
巻番屋	2,100	4,875.00	10,237,500	
P L A N T	700	653.00	457,100	
スギホールディングス	6,000	5,410.00	32,460,000	貸付有価証券 1,000株
薬王堂ホールディングス	1,500	1,976.00	2,964,000	
スクロール	4,700	843.00	3,962,100	
ヨンドシーホールディングス	2,600	1,736.00	4,513,600	貸付有価証券 1,800株
木曽路	4,100	2,080.00	8,528,000	貸付有価証券 2,800株
S R Sホールディングス	4,300	859.00	3,693,700	貸付有価証券 2,900株
千趣会	5,500	397.00	2,183,500	貸付有価証券 3,700株
リテールパートナーズ	4,300	1,123.00	4,828,900	貸付有価証券 2,600株
ケーヨー	5,600	973.00	5,448,800	
上新電機	3,100	1,883.00	5,837,300	貸付有価証券 2,300株
日本瓦斯	14,700	1,910.00	28,077,000	貸付有価証券 100株
ロイヤルホールディングス	5,000	2,244.00	11,220,000	貸付有価証券 3,700株
東天紅	400	938.00	375,200	
いなげや	3,300	1,201.00	3,963,300	貸付有価証券 1,400株
チヨダ	2,700	722.00	1,949,400	貸付有価証券 1,000株
ライフコーポレーション	2,500	2,602.00	6,505,000	貸付有価証券 500株
リンガーハット	3,600	2,261.00	8,139,600	貸付有価証券 2,300株
M r M a x H D	3,800	622.00	2,363,600	
A O K Iホールディングス	5,900	670.00	3,953,000	
オークワ	4,500	860.00	3,870,000	
コメリ	4,700	2,751.00	12,929,700	貸付有価証券 300株
青山商事	5,900	876.00	5,168,400	
しまむら	3,500	10,900.00	38,150,000	
はせがわ	1,800	274.00	493,200	
高島屋	21,000	1,280.00	26,880,000	貸付有価証券 1,600株
松屋	5,400	823.00	4,444,200	貸付有価証券 100株
エイチ・ツー・オー リテイリング	13,600	942.00	12,811,200	

近鉄百貨店	1,000	2,480.00	2,480,000	貸付有価証券 300株
丸井グループ	22,600	2,445.00	55,257,000	貸付有価証券 1,600株
アクシアル リテイリング	2,100	3,050.00	6,405,000	
井筒屋	1,600	341.00	545,600	貸付有価証券 1,100株
イオン	105,500	2,357.50	248,716,250	貸付有価証券 63,500株
イズミ	5,000	2,760.00	13,800,000	貸付有価証券 200株
平和堂	4,700	1,882.00	8,845,400	貸付有価証券 3,000株
フジ	7,200	2,266.00	16,315,200	貸付有価証券 5,500株
ヤオコー	3,400	6,450.00	21,930,000	貸付有価証券 2,300株
ゼビオホールディングス	4,100	864.00	3,542,400	貸付有価証券 2,700株
ケースホールディングス	26,500	1,288.00	34,132,000	貸付有価証券 13,700株
Olympicグループ	1,400	640.00	896,000	貸付有価証券 900株
日産東京販売ホールディングス	4,500	236.00	1,062,000	貸付有価証券 2,900株
シルバーライフ	600	1,515.00	909,000	貸付有価証券 400株
Genky DrugStores	1,300	3,455.00	4,491,500	貸付有価証券 900株
ナルミヤ・インターナショナル	700	889.00	622,300	貸付有価証券 400株
ブックオフグループホールディングス	1,900	988.00	1,877,200	貸付有価証券 1,300株
ギフトホールディングス	500	2,185.00	1,092,500	貸付有価証券 300株
アインホールディングス	3,800	5,780.00	21,964,000	貸付有価証券 2,700株
元気寿司	900	2,511.00	2,259,900	貸付有価証券 500株
ヤマダホールディングス	110,300	454.00	50,076,200	貸付有価証券 75,000株
アークランドサカモト	4,800	1,482.00	7,113,600	貸付有価証券 900株
ニトリホールディングス	12,000	13,010.00	156,120,000	貸付有価証券 1,200株
グルメ杵屋	2,400	1,015.00	2,436,000	貸付有価証券 1,600株
愛眼	2,200	192.00	422,400	貸付有価証券 1,400株
ケーユーホールディングス	1,600	1,159.00	1,854,400	
吉野家ホールディングス	10,600	2,386.00	25,291,600	貸付有価証券 7,200株

松屋フーズホールディングス	1,500	3,760.00	5,640,000	貸付有価証券 800株
サガミホールディングス	4,400	1,161.00	5,108,400	貸付有価証券 2,600株
関西フードマーケット	2,700	1,265.00	3,415,500	貸付有価証券 1,800株
王将フードサービス	2,000	6,330.00	12,660,000	貸付有価証券 1,300株
プレナス	3,400	1,948.00	6,623,200	
ミニストップ	2,300	1,411.00	3,245,300	貸付有価証券 1,500株
アークス	5,500	1,935.00	10,642,500	
パローホールディングス	6,400	1,861.00	11,910,400	
ベルク	1,300	5,240.00	6,812,000	
大庄	1,900	1,121.00	2,129,900	貸付有価証券 1,300株
ファーストリテイリング	4,100	61,950.00	253,995,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	11,400	2,792.00	31,828,800	貸付有価証券 400株
サクスパー ホールディングス	3,100	594.00	1,841,400	貸付有価証券 2,000株
ヤマザワ	600	1,517.00	910,200	貸付有価証券 400株
やまや	600	2,477.00	1,486,200	貸付有価証券 400株
ペルーナ	6,500	667.00	4,335,500	貸付有価証券 3,400株
島根銀行	1,100	525.00	577,500	
じもとホールディングス	2,200	570.00	1,254,000	
めぶきフィナンシャルグループ	131,800	243.00	32,027,400	貸付有価証券 900株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,600	1,886.00	6,789,600	貸付有価証券 100株
九州フィナンシャルグループ	56,100	377.00	21,149,700	
ゆうちょ銀行	71,600	985.00	70,526,000	貸付有価証券 49,200株
富山第一銀行	7,000	407.00	2,849,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	157,900	435.00	68,686,500	貸付有価証券 9,000株
西日本フィナンシャルホールディングス	16,900	754.00	12,742,600	
三十三フィナンシャルグループ	2,600	1,362.00	3,541,200	貸付有価証券 1,800株
第四北越フィナンシャルグループ	4,500	2,475.00	11,137,500	
ひろぎんホールディングス	40,800	605.00	24,684,000	貸付有価証券 5,000株
おきなわフィナンシャルグループ	2,600	2,139.00	5,561,400	
十六フィナンシャルグループ	3,700	2,229.00	8,247,300	貸付有価証券 500株

北國フィナンシャルホールディングス	2,700	4,080.00	11,016,000	
プロクレアホールディングス	3,100	1,897.00	5,880,700	貸付有価証券 1,600株
新生銀行	19,800	1,917.00	37,956,600	貸付有価証券 12,500株
あおぞら銀行	17,000	2,656.00	45,152,000	貸付有価証券 6,100株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,818,900	729.70	1,327,251,330	代用有価証券 184,400株
りそなホールディングス	328,700	478.50	157,282,950	貸付有価証券 92,100株
三井住友トラスト・ホールディングス	52,600	3,878.00	203,982,800	貸付有価証券 1,800株
三井住友フィナンシャルグループ	201,300	3,922.00	789,498,600	代用有価証券 4,400株
千葉銀行	90,900	661.00	60,084,900	貸付有価証券 1,900株
群馬銀行	51,500	350.00	18,025,000	貸付有価証券 7,500株
武蔵野銀行	4,100	1,719.00	7,047,900	
千葉興業銀行	6,800	260.00	1,768,000	貸付有価証券 100株
筑波銀行	11,900	183.00	2,177,700	貸付有価証券 100株
七十七銀行	8,500	1,694.00	14,399,000	貸付有価証券 6,300株
秋田銀行	1,900	1,525.00	2,897,500	
山形銀行	3,000	830.00	2,490,000	貸付有価証券 100株
岩手銀行	1,900	2,001.00	3,801,900	
東邦銀行	22,900	199.00	4,557,100	貸付有価証券 200株
東北銀行	1,300	979.00	1,272,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	23,100	2,199.00	50,796,900	貸付有価証券 1,400株
静岡銀行	66,300	751.00	49,791,300	貸付有価証券 7,300株
スルガ銀行	26,600	354.00	9,416,400	
八十二銀行	61,900	449.00	27,793,100	貸付有価証券 4,700株
山梨中央銀行	3,200	1,144.00	3,660,800	
大垣共立銀行	5,600	1,717.00	9,615,200	
福井銀行	2,500	1,318.00	3,295,000	貸付有価証券 900株
清水銀行	1,100	1,482.00	1,630,200	
富山銀行	500	1,853.00	926,500	貸付有価証券 300株
滋賀銀行	5,200	2,765.00	14,378,000	
南都銀行	4,300	1,929.00	8,294,700	

百五銀行	27,000	319.00	8,613,000	
京都銀行	9,900	5,510.00	54,549,000	貸付有価証券 2,600株
紀陽銀行	9,400	1,380.00	12,972,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	17,600	783.00	13,780,800	貸付有価証券 100株
山陰合同銀行	17,200	638.00	10,973,600	貸付有価証券 100株
中国銀行	23,000	920.00	21,160,000	
鳥取銀行	1,000	1,189.00	1,189,000	貸付有価証券 600株
伊予銀行	36,100	626.00	22,598,600	貸付有価証券 13,900株
百十四銀行	2,900	1,726.00	5,005,400	貸付有価証券 100株
四国銀行	4,300	798.00	3,431,400	貸付有価証券 3,000株
阿波銀行	4,300	1,996.00	8,582,800	貸付有価証券 900株
大分銀行	1,700	1,750.00	2,975,000	
宮崎銀行	1,700	2,022.00	3,437,400	
佐賀銀行	1,600	1,408.00	2,252,800	
琉球銀行	6,600	775.00	5,115,000	
セブン銀行	90,200	242.00	21,828,400	貸付有価証券 6,500株
みずほフィナンシャルグループ	372,000	1,519.00	565,068,000	貸付有価証券 1,600株
高知銀行	1,100	749.00	823,900	
山口フィナンシャルグループ	32,000	719.00	23,008,000	貸付有価証券 2,900株
長野銀行	900	1,258.00	1,132,200	
名古屋銀行	2,000	3,045.00	6,090,000	貸付有価証券 1,500株
北洋銀行	41,200	217.00	8,940,400	貸付有価証券 6,500株
愛知銀行	1,000	5,010.00	5,010,000	貸付有価証券 500株
中京銀行	1,000	1,617.00	1,617,000	貸付有価証券 500株
大光銀行	1,000	1,288.00	1,288,000	貸付有価証券 600株
愛媛銀行	4,100	807.00	3,308,700	貸付有価証券 400株
トマト銀行	900	1,008.00	907,200	
京葉銀行	12,700	456.00	5,791,200	
栃木銀行	14,200	269.00	3,819,800	貸付有価証券 100株
北日本銀行	900	1,567.00	1,410,300	貸付有価証券 600株

東和銀行	5,100	507.00	2,585,700	貸付有価証券 100株
福島銀行	3,400	223.00	758,200	
大東銀行	1,300	649.00	843,700	
トモニホールディングス	22,500	303.00	6,817,500	
フィデアホールディングス	2,800	1,243.00	3,480,400	
池田泉州ホールディングス	33,200	184.00	6,108,800	貸付有価証券 900株
F P G	10,300	950.00	9,785,000	貸付有価証券 2,800株
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,400	1,258.00	3,019,200	貸付有価証券 1,100株
マーキュリアホールディングス	1,600	624.00	998,400	
S B Iホールディングス	37,500	2,617.00	98,137,500	貸付有価証券 7,400株
ジャフコ グループ	11,600	1,572.00	18,235,200	
大和証券グループ本社	216,400	625.80	135,423,120	貸付有価証券 5,600株
野村ホールディングス	463,300	508.90	235,773,370	貸付有価証券 13,700株
岡三証券グループ	22,700	342.00	7,763,400	貸付有価証券 300株
丸三証券	9,000	484.00	4,356,000	貸付有価証券 6,200株
東洋証券	9,700	193.00	1,872,100	貸付有価証券 2,500株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	31,500	370.00	11,655,000	
光世証券	600	454.00	272,400	
水戸証券	7,700	269.00	2,071,300	貸付有価証券 400株
いちよし証券	5,500	633.00	3,481,500	貸付有価証券 100株
松井証券	14,900	818.00	12,188,200	
マネックスグループ	25,300	501.00	12,675,300	貸付有価証券 17,100株
極東証券	3,700	663.00	2,453,100	
岩井コスモホールディングス	2,900	1,211.00	3,511,900	
アイザワ証券グループ	4,400	691.00	3,040,400	
マネーパートナーズグループ	3,400	232.00	788,800	
スパークス・グループ	14,000	266.00	3,724,000	貸付有価証券 700株
小林洋行	1,200	230.00	276,000	
かんぽ生命保険	30,500	2,126.00	64,843,000	貸付有価証券 100株
S O M P Oホールディングス	45,400	5,848.00	265,499,200	貸付有価証券 5,000株
アニコム ホールディングス	9,300	666.00	6,193,800	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	64,300	4,093.00	263,179,900	貸付有価証券 4,000株

第一生命ホールディングス	144,500	2,633.50	380,540,750	貸付有価証券 43,500株
東京海上ホールディングス	88,800	7,466.00	662,980,800	貸付有価証券 12,100株
T & Dホールディングス	71,300	1,474.00	105,096,200	
アドバンスクリエイト	1,500	964.00	1,446,000	貸付有価証券 900株
全国保証	7,200	4,275.00	30,780,000	貸付有価証券 4,600株
あんしん保証	1,300	275.00	357,500	貸付有価証券 500株
ジェイリース	1,000	1,816.00	1,816,000	貸付有価証券 700株
イントラスト	1,400	538.00	753,200	
日本モーゲージサービス	1,700	983.00	1,671,100	貸付有価証券 1,100株
C a s a	1,100	843.00	927,300	貸付有価証券 700株
アルヒ	4,500	958.00	4,311,000	貸付有価証券 3,000株
プレミアグループ	1,500	4,075.00	6,112,500	
ネットプロテクションズホールディングス	9,200	605.00	5,566,000	貸付有価証券 5,800株
クレディセゾン	18,300	1,498.00	27,413,400	貸付有価証券 400株
芙蓉総合リース	2,800	7,370.00	20,636,000	貸付有価証券 100株
みずほリース	4,100	3,055.00	12,525,500	貸付有価証券 3,100株
東京センチュリー	5,100	4,315.00	22,006,500	貸付有価証券 3,500株
日本証券金融	11,900	860.00	10,234,000	
アイフル	50,900	348.00	17,713,200	貸付有価証券 800株
リコーリース	2,700	3,405.00	9,193,500	貸付有価証券 1,800株
イオンフィナンシャルサービス	16,500	1,202.00	19,833,000	貸付有価証券 6,200株
アコム	59,800	327.00	19,554,600	貸付有価証券 200株
ジャックス	3,100	3,345.00	10,369,500	
オリエントコーポレーション	82,100	123.00	10,098,300	貸付有価証券 54,900株
オリックス	180,300	2,451.50	442,005,450	貸付有価証券 1,800株
三菱H C キャピタル	102,800	613.00	63,016,400	貸付有価証券 11,800株
九州リースサービス	1,500	577.00	865,500	貸付有価証券 1,000株
日本取引所グループ	72,400	2,033.50	147,225,400	貸付有価証券 100株

イー・ギャランティ	4,500	2,168.00	9,756,000	貸付有価証券 2,400株
アサックス	1,500	605.00	907,500	貸付有価証券 1,000株
NECキャピタルソリューション	1,200	1,952.00	2,342,400	貸付有価証券 800株
いちご	33,800	296.00	10,004,800	貸付有価証券 1,500株
日本駐車場開発	31,100	161.00	5,007,100	
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	1,541.00	2,619,700	
SREホールディングス	800	1,939.00	1,551,200	貸付有価証券 200株
ADワークスグループ	7,500	150.00	1,125,000	貸付有価証券 4,900株
ヒューリック	68,200	1,054.00	71,882,800	貸付有価証券 48,000株
三栄建築設計	1,200	1,652.00	1,982,400	
野村不動産ホールディングス	15,700	3,225.00	50,632,500	貸付有価証券 1,800株
三重交通グループホールディングス	6,200	481.00	2,982,200	貸付有価証券 4,000株
サムティ	4,700	1,997.00	9,385,900	貸付有価証券 300株
ディア・ライフ	3,800	541.00	2,055,800	貸付有価証券 1,300株
コーセーアールイー	1,200	645.00	774,000	貸付有価証券 700株
地主	1,900	2,053.00	3,900,700	貸付有価証券 1,300株
プレサンスコーポレーション	3,500	1,518.00	5,313,000	
THEグローバル社	2,500	147.00	367,500	貸付有価証券 500株
ハウスコム	700	1,080.00	756,000	
日本管理センター	1,500	1,015.00	1,522,500	
サンセイランディック	1,100	883.00	971,300	貸付有価証券 700株
エストラスト	800	554.00	443,200	
フージャースホールディングス	3,900	808.00	3,151,200	
オープンハウスグループ	9,600	5,370.00	51,552,000	
東急不動産ホールディングス	84,800	664.00	56,307,200	
飯田グループホールディングス	25,300	2,035.00	51,485,500	貸付有価証券 3,100株
イーランド	500	1,448.00	724,000	
ムゲンエステート	2,500	497.00	1,242,500	
ビーロット	2,400	503.00	1,207,200	
ファーストブラザーズ	700	855.00	598,500	貸付有価証券 100株
And Doホールディングス	1,600	895.00	1,432,000	貸付有価証券 300株

シーアールイー	1,100	1,587.00	1,745,700	貸付有価証券 700株
プロパティエージェント	400	1,515.00	606,000	貸付有価証券 200株
ケイアイスター不動産	1,400	4,885.00	6,839,000	貸付有価証券 900株
アグレ都市デザイン	500	1,593.00	796,500	貸付有価証券 300株
グッドコムアセット	1,300	1,187.00	1,543,100	貸付有価証券 700株
ジェイ・エス・ピー	600	3,520.00	2,112,000	貸付有価証券 200株
ロードスターキャピタル	800	1,379.00	1,103,200	貸付有価証券 500株
テンポイノベーション	1,000	872.00	872,000	貸付有価証券 400株
グローバル・リンク・マネジメント	600	913.00	547,800	貸付有価証券 100株
フェイスネットワーク	500	1,336.00	668,000	
パーク24	18,000	2,030.00	36,540,000	貸付有価証券 3,300株
バラカ	900	1,796.00	1,616,400	貸付有価証券 400株
三井不動産	125,300	2,817.00	352,970,100	貸付有価証券 1,200株
三菱地所	181,700	1,909.00	346,865,300	貸付有価証券 100株
平和不動産	4,900	3,775.00	18,497,500	
東京建物	27,300	1,715.00	46,819,500	貸付有価証券 14,300株
京阪神ビルディング	4,200	1,241.00	5,212,200	貸付有価証券 800株
住友不動産	57,600	3,475.00	200,160,000	貸付有価証券 1,700株
テーオーシー	4,900	618.00	3,028,200	貸付有価証券 3,600株
東京楽天地	500	3,970.00	1,985,000	貸付有価証券 300株
スターツコーポレーション	4,200	2,433.00	10,218,600	
フジ住宅	3,500	655.00	2,292,500	貸付有価証券 2,300株
空港施設	3,300	530.00	1,749,000	
明和地所	1,600	615.00	984,000	
ゴールドクレスト	2,400	1,688.00	4,051,200	貸付有価証券 1,600株
エスリード	1,200	1,707.00	2,048,400	貸付有価証券 800株
日神グループホールディングス	5,000	455.00	2,275,000	貸付有価証券 3,200株
日本エスコン	5,600	764.00	4,278,400	貸付有価証券 2,400株

タカラレーベン	12,700	331.00	4,203,700	
A V A N T I A	1,500	850.00	1,275,000	貸付有価証券 1,000株
イオンモール	15,200	1,557.00	23,666,400	
毎日コムネット	1,300	691.00	898,300	貸付有価証券 800株
ファースト住建	1,200	1,119.00	1,342,800	貸付有価証券 800株
カチタス	7,500	2,925.00	21,937,500	貸付有価証券 100株
トーセイ	4,200	1,127.00	4,733,400	貸付有価証券 200株
穴吹興産	700	2,375.00	1,662,500	貸付有価証券 400株
サンフロンティア不動産	4,200	1,053.00	4,422,600	貸付有価証券 2,800株
F Jネクストホールディングス	3,000	1,065.00	3,195,000	貸付有価証券 300株
インテリックス	800	605.00	484,000	貸付有価証券 500株
ランドビジネス	1,600	237.00	379,200	
サンネクスタグループ	1,200	1,152.00	1,382,400	貸付有価証券 500株
グランディハウス	2,200	530.00	1,166,000	
日本空港ビルデング	10,400	5,300.00	55,120,000	貸付有価証券 6,800株
明豊ファシリティワークス	1,400	646.00	904,400	
日本工営	1,900	3,140.00	5,966,000	
L I F U L L	9,200	177.00	1,628,400	貸付有価証券 5,600株
ミクシィ	6,700	2,118.00	14,190,600	貸付有価証券 1,800株
ジェイエイシーリクルートメント	2,400	1,810.00	4,344,000	
日本M & Aセンターホールディングス	48,200	1,497.00	72,155,400	貸付有価証券 300株
メンバーズ	800	3,020.00	2,416,000	
中広	700	390.00	273,000	貸付有価証券 400株
UTグループ	4,200	2,433.00	10,218,600	貸付有価証券 100株
アイティメディア	1,400	1,777.00	2,487,800	貸付有価証券 200株
E・Jホールディングス	1,700	1,150.00	1,955,000	貸付有価証券 800株
夢真ビーネックスグループ	9,600	1,443.00	13,852,800	貸付有価証券 1,300株
コシダカホールディングス	7,900	757.00	5,980,300	貸付有価証券 1,200株
アルトナー	700	847.00	592,900	貸付有価証券 200株

パソナグループ	3,200	2,096.00	6,707,200	貸付有価証券 700株
C D S	800	2,167.00	1,733,600	
リンクアンドモチベーション	6,500	454.00	2,951,000	貸付有価証券 4,400株
エス・エム・エス	10,000	3,000.00	30,000,000	貸付有価証券 200株
サニーサイドアップグループ	1,100	644.00	708,400	貸付有価証券 100株
パーソルホールディングス	29,400	2,507.00	73,705,800	
リニカル	1,700	864.00	1,468,800	
クックパッド	9,300	222.00	2,064,600	貸付有価証券 3,800株
エスクリ	1,600	416.00	665,600	貸付有価証券 900株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,700	597.00	1,014,900	貸付有価証券 1,100株
学情	1,200	961.00	1,153,200	貸付有価証券 700株
スタジオアリス	1,300	2,263.00	2,941,900	貸付有価証券 900株
シミックホールディングス	1,500	1,442.00	2,163,000	貸付有価証券 1,100株
エプコ	600	733.00	439,800	貸付有価証券 100株
N J S	600	2,088.00	1,252,800	
総合警備保障	11,100	3,565.00	39,571,500	貸付有価証券 2,200株
カカクコム	21,600	2,556.00	55,209,600	貸付有価証券 5,400株
アイロムグループ	1,100	1,914.00	2,105,400	
セントケア・ホールディング	1,900	825.00	1,567,500	
サイネックス	500	594.00	297,000	
ルネサンス	2,000	921.00	1,842,000	貸付有価証券 1,400株
ディップ	5,200	3,765.00	19,578,000	貸付有価証券 200株
デジタルホールディングス	2,100	1,304.00	2,738,400	貸付有価証券 500株
新日本科学	3,600	1,653.00	5,950,800	貸付有価証券 1,200株
キャリアデザインセンター	700	1,112.00	778,400	貸付有価証券 500株
ベネフィット・ワン	10,700	2,016.00	21,571,200	貸付有価証券 7,300株
エムスリー	51,900	3,737.00	193,950,300	貸付有価証券 2,500株
ツカダ・グローバルホールディング	2,400	328.00	787,200	貸付有価証券 1,400株
プラス	500	822.00	411,000	

アウトソーシング	16,800	1,111.00	18,664,800	
ウェルネット	2,800	495.00	1,386,000	貸付有価証券 600株
ワールドホールディングス	1,200	2,353.00	2,823,600	貸付有価証券 300株
ディー・エヌ・エー	11,200	1,866.00	20,899,200	貸付有価証券 1,600株
博報堂D Yホールディングス	38,500	1,315.00	50,627,500	
ぐるなび	4,500	413.00	1,858,500	貸付有価証券 3,000株
タカミヤ	3,700	364.00	1,346,800	
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	796.00	1,432,800	
ファンコミュニケーションズ	6,900	411.00	2,835,900	貸付有価証券 100株
ライク	1,000	2,212.00	2,212,000	貸付有価証券 700株
ビジネス・ブレークスルー	1,200	443.00	531,600	
エスプール	8,300	1,225.00	10,167,500	
WDBホールディングス	1,400	2,280.00	3,192,000	貸付有価証券 900株
ティア	2,000	460.00	920,000	
C D G	300	1,285.00	385,500	貸付有価証券 200株
アドウェイズ	4,400	698.00	3,071,200	貸付有価証券 2,800株
バリューコマース	2,300	3,175.00	7,302,500	貸付有価証券 1,500株
インフォマート	32,300	494.00	15,956,200	貸付有価証券 100株
J Pホールディングス	7,500	227.00	1,702,500	貸付有価証券 300株
エコナックホールディングス	7,600	91.00	691,600	貸付有価証券 5,000株
C Lホールディングス	600	999.00	599,400	貸付有価証券 400株
プレステージ・インターナショナル	11,100	642.00	7,126,200	
アミューズ	1,600	2,151.00	3,441,600	
ドリームインキュベータ	900	2,460.00	2,214,000	貸付有価証券 500株
クイック	1,900	1,405.00	2,669,500	
T A C	1,800	233.00	419,400	貸付有価証券 100株
電通グループ	28,500	4,300.00	122,550,000	貸付有価証券 20,500株
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,400	1,750.00	2,450,000	貸付有価証券 900株
ぴあ	900	3,240.00	2,916,000	貸付有価証券 500株
イオンファンタジー	1,100	2,431.00	2,674,100	貸付有価証券 700株

シーティーエス	3,300	869.00	2,867,700	
ネクシィーズグループ	1,100	530.00	583,000	
H.U.グループホールディングス	7,700	2,673.00	20,582,100	
アルプス技研	2,400	1,885.00	4,524,000	貸付有価証券 100株
サニックス	5,300	241.00	1,277,300	貸付有価証券 3,200株
ダイオーズ	700	1,065.00	745,500	
日本空調サービス	3,100	801.00	2,483,100	
オリエンタルランド	32,400	19,200.00	622,080,000	貸付有価証券 200株
ダスキン	6,500	2,695.00	17,517,500	貸付有価証券 2,100株
明光ネットワークジャパン	3,500	595.00	2,082,500	貸付有価証券 1,400株
ファルコホールディングス	1,300	2,175.00	2,827,500	
秀英予備校	600	431.00	258,600	貸付有価証券 300株
ラウンドワン	8,200	1,501.00	12,308,200	貸付有価証券 2,400株
リゾートトラスト	12,800	2,129.00	27,251,200	貸付有価証券 2,200株
ビー・エム・エル	3,700	3,465.00	12,820,500	貸付有価証券 2,400株
りらいあコミュニケーションズ	4,300	1,102.00	4,738,600	
リソー教育	13,400	341.00	4,569,400	貸付有価証券 100株
早稲田アカデミー	1,700	1,128.00	1,917,600	貸付有価証券 1,100株
ユー・エス・エス	32,900	2,349.00	77,282,100	貸付有価証券 10,200株
東京個別指導学院	2,700	605.00	1,633,500	貸付有価証券 1,600株
サイバーエージェント	66,000	1,391.00	91,806,000	
楽天グループ	141,300	724.00	102,301,200	貸付有価証券 98,900株
クリーク・アンド・リパー社	1,600	2,096.00	3,353,600	
モーニングスター	5,200	532.00	2,766,400	
テー・オー・ダブリュー	5,600	344.00	1,926,400	
山田コンサルティンググループ	1,500	1,162.00	1,743,000	
セントラルスポーツ	1,100	2,427.00	2,669,700	貸付有価証券 700株
フルキャストホールディングス	2,500	2,288.00	5,720,000	
エン・ジャパン	5,100	1,996.00	10,179,600	貸付有価証券 500株
リソルホールディングス	400	4,600.00	1,840,000	貸付有価証券 200株
テクノプロ・ホールディングス	17,600	2,974.00	52,342,400	貸付有価証券 11,500株

アトラグループ	1,200	202.00	242,400	貸付有価証券 500株
インターワークス	1,200	382.00	458,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,400	4,415.00	6,181,000	貸付有価証券 800株
K e e P e r 技研	1,900	3,235.00	6,146,500	貸付有価証券 600株
ファーストロジック	500	765.00	382,500	
三機サービス	600	1,073.00	643,800	貸付有価証券 400株
G u n o s y	1,700	856.00	1,455,200	貸付有価証券 600株
デザインワン・ジャパン	1,200	184.00	220,800	
イー・ガーディアン	1,100	2,949.00	3,243,900	
リブセンス	2,400	163.00	391,200	貸付有価証券 1,300株
ジャパンマテリアル	9,000	1,794.00	16,146,000	
ベクトル	4,100	1,132.00	4,641,200	貸付有価証券 1,600株
ウチヤマホールディングス	1,500	301.00	451,500	貸付有価証券 1,000株
チャーム・ケア・コーポレーション	2,200	1,091.00	2,400,200	貸付有価証券 1,400株
キャリアリンク	1,100	2,058.00	2,263,800	貸付有価証券 700株
I B J	2,400	746.00	1,790,400	貸付有価証券 1,600株
アサンテ	1,300	1,503.00	1,953,900	貸付有価証券 900株
バリューHR	2,500	1,260.00	3,150,000	貸付有価証券 1,200株
M & A キャピタルパートナーズ	2,400	3,445.00	8,268,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,200	1,206.00	1,447,200	貸付有価証券 700株
E R I ホールディングス	900	1,335.00	1,201,500	
アビスト	500	2,910.00	1,455,000	貸付有価証券 200株
シグマクシス・ホールディングス	3,500	1,139.00	3,986,500	貸付有価証券 300株
ウィルグループ	2,200	1,179.00	2,593,800	貸付有価証券 1,400株
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,500	174.00	609,000	貸付有価証券 400株
メドピア	2,100	2,120.00	4,452,000	貸付有価証券 1,400株
レアジョブ	600	545.00	327,000	貸付有価証券 400株
リクルートホールディングス	216,100	4,734.00	1,023,017,400	代用有価証券 34,300株 貸付有価証券 7,500株

エラン	4,100	1,060.00	4,346,000	
土木管理総合試験所	1,300	329.00	427,700	
ネットマーケティング	1,500	688.00	1,032,000	貸付有価証券 800株
日本郵政	352,000	959.60	337,779,200	
ベルシステム24ホールディングス	4,200	1,431.00	6,010,200	貸付有価証券 700株
鎌倉新書	3,300	542.00	1,788,600	貸付有価証券 2,300株
S MN	700	606.00	424,200	貸付有価証券 200株
一蔵	600	487.00	292,200	
グローバルキッズCOMPANY	500	673.00	336,500	
エアトリ	1,800	2,967.00	5,340,600	貸付有価証券 1,200株
アトラエ	2,100	1,861.00	3,908,100	
ストライク	1,200	3,715.00	4,458,000	
ソラスト	7,200	700.00	5,040,000	
セラク	900	1,147.00	1,032,300	貸付有価証券 500株
インソース	3,100	2,256.00	6,993,600	貸付有価証券 1,800株
ベイクレント・コンサルティング	2,100	40,650.00	85,365,000	貸付有価証券 600株
Orchestra Holdings	600	2,646.00	1,587,600	
アイモバイル	1,300	1,426.00	1,853,800	貸付有価証券 700株
キャリアインデックス	1,100	508.00	558,800	
MS - Japan	1,200	867.00	1,040,400	貸付有価証券 800株
船場	800	688.00	550,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,300	1,527.00	14,201,100	
フルテック	500	1,355.00	677,500	貸付有価証券 200株
ツナググループ・ホールディングス	1,100	308.00	338,800	貸付有価証券 200株
GameWith	1,000	473.00	473,000	貸付有価証券 100株
MS&Consulting	600	742.00	445,200	
ウェルビー	1,900	832.00	1,580,800	
エル・ティー・エス	400	3,840.00	1,536,000	貸付有価証券 200株
ミダックホールディングス	1,300	2,852.00	3,707,600	貸付有価証券 900株
日総工産	2,300	609.00	1,400,700	貸付有価証券 1,500株
キュービーネットホールディングス	1,400	1,370.00	1,918,000	

R P Aホールディングス	4,300	411.00	1,767,300	貸付有価証券 2,800株
スプリックス	1,000	1,054.00	1,054,000	
マネジメントソリューションズ	1,400	4,990.00	6,986,000	貸付有価証券 100株
プロレド・パートナーズ	700	548.00	383,600	貸付有価証券 300株
and factory	1,000	414.00	414,000	
テノ・ホールディングス	400	679.00	271,600	貸付有価証券 100株
フロンティア・マネジメント	800	1,403.00	1,122,400	
ピアラ	500	871.00	435,500	貸付有価証券 300株
コプロ・ホールディングス	600	919.00	551,400	
ギークス	500	878.00	439,000	貸付有価証券 100株
カーブスホールディングス	8,100	703.00	5,694,300	貸付有価証券 5,100株
フォーラムエンジニアリング	1,900	951.00	1,806,900	
Fast Fitness Japan	500	1,788.00	894,000	貸付有価証券 100株
ダイレクトマーケティングミックス	3,100	1,810.00	5,611,000	貸付有価証券 2,300株
ポピンズ	700	2,050.00	1,435,000	
LITALICO	2,400	2,582.00	6,196,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,500	515.00	772,500	
リログループ	16,100	2,133.00	34,341,300	貸付有価証券 200株
東祥	2,200	1,333.00	2,932,600	貸付有価証券 1,400株
ビーウィズ	800	1,412.00	1,129,600	
TREホールディングス	5,000	2,246.00	11,230,000	
人・夢・技術グループ	1,200	2,462.00	2,954,400	
エイチ・アイ・エス	6,200	2,317.00	14,365,400	貸付有価証券 4,400株
ラックランド	900	3,075.00	2,767,500	貸付有価証券 600株
共立メンテナンス	5,200	4,980.00	25,896,000	貸付有価証券 3,500株
イチネンホールディングス	3,000	1,223.00	3,669,000	貸付有価証券 2,000株
建設技術研究所	1,600	2,472.00	3,955,200	
スペース	2,100	937.00	1,967,700	
燦ホールディングス	1,300	1,906.00	2,477,800	
スバル興業	200	8,610.00	1,722,000	
東京テアトル	1,300	1,235.00	1,605,500	貸付有価証券 900株
タナベ経営	1,100	700.00	770,000	

ナガワ	900	8,800.00	7,920,000	貸付有価証券 600株
東京都競馬	2,200	3,705.00	8,151,000	
常磐興産	1,300	1,311.00	1,704,300	貸付有価証券 900株
カナモト	5,000	1,895.00	9,475,000	貸付有価証券 3,100株
西尾レントオール	2,500	2,709.00	6,772,500	
アゴラ ホスピタリティー グループ	22,400	24.00	537,600	貸付有価証券 2,700株
トランス・コスモス	3,700	3,475.00	12,857,500	貸付有価証券 700株
乃村工藝社	12,600	911.00	11,478,600	貸付有価証券 500株
藤田観光	1,300	2,476.00	3,218,800	貸付有価証券 800株
KNT-CTホールディングス	1,800	1,770.00	3,186,000	貸付有価証券 1,100株
日本管財	3,200	2,581.00	8,259,200	貸付有価証券 2,000株
トーカイ	2,400	1,700.00	4,080,000	
セコム	29,000	8,497.00	246,413,000	貸付有価証券 2,400株
セントラル警備保障	1,400	2,252.00	3,152,800	貸付有価証券 900株
丹青社	5,700	819.00	4,668,300	貸付有価証券 100株
メイテック	3,500	6,910.00	24,185,000	
応用地質	3,000	1,732.00	5,196,000	
船井総研ホールディングス	5,700	2,138.00	12,186,600	貸付有価証券 2,000株
進学会ホールディングス	1,000	365.00	365,000	貸付有価証券 700株
オオバ	1,800	741.00	1,333,800	貸付有価証券 1,300株
いであ	700	1,807.00	1,264,900	貸付有価証券 400株
学究社	900	1,605.00	1,444,500	貸付有価証券 600株
ベネッセホールディングス	9,800	2,060.00	20,188,000	貸付有価証券 3,800株
イオンディライト	3,400	2,839.00	9,652,600	
ナック	1,500	956.00	1,434,000	貸付有価証券 1,000株
ダイセキ	5,400	4,715.00	25,461,000	貸付有価証券 900株
ステップ	1,100	1,776.00	1,953,600	貸付有価証券 700株
合 計	32,241,700		77,296,613,600	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年 6月 1日から2022年11月30日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2022年 5月31日現在	当中間計算期間末 2022年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,398,889,598	11,957,189,113
株式	77,296,613,600	84,399,433,200
派生商品評価勘定	29,858,650	46,152,350
未収入金	735,897,310	59,447,900
未収配当金	840,727,250	604,232,910
未収利息	885,496	851,338
その他未収収益	36,016,079	66,774,561
流動資産合計	90,338,887,983	97,134,081,372
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,812,600	4,593,150
前受金	37,106,500	43,807,600
未払金	735,915,670	60,125,290
未払収益分配金	33,604,280	-
未払解約金	130,698,420	126,136,452
未払受託者報酬	10,435,331	11,098,101
未払委託者報酬	51,775,146	54,793,411
未払利息	619	2,954
受入担保金	10,106,157,171	10,673,594,952
その他未払費用	1,705,688	1,791,523
流動負債合計	11,114,211,425	10,975,943,433
負債合計		
11,114,211,425		
純資産の部		
元本等		
元本	33,604,280,164	34,780,088,239
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	45,620,396,394	51,378,049,700
（分配準備積立金）	14,629,975,004	13,349,989,991
元本等合計	79,224,676,558	86,158,137,939
純資産合計		
79,224,676,558		
負債純資産合計		
90,338,887,983		
97,134,081,372		

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日	当中間計算期間 自 2022年 6月 1日 至 2022年11月30日
営業収益		
受取配当金	748,546,726	848,209,928
受取利息	-	5,212,612
有価証券売買等損益	173,818,461	3,180,022,329
派生商品取引等損益	51,581,100	88,890,550
その他収益	34,710,274	151,375,890
営業収益合計	905,494,361	4,263,286,085
営業費用		
支払利息	53,231	131,916
受託者報酬	10,351,898	11,098,101
委託者報酬	51,465,789	54,793,411
その他費用	5,230,696	1,791,523
営業費用合計	67,101,614	67,814,951
営業利益又は営業損失（ ）	838,392,747	4,195,471,134
経常利益又は経常損失（ ）	838,392,747	4,195,471,134
中間純利益又は中間純損失（ ）	838,392,747	4,195,471,134
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	303,023,342	114,453,815
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	41,987,005,326	45,620,396,394
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,964,719,307	5,907,810,078
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,964,719,307	5,907,810,078
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,708,880,922	4,231,174,091
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,708,880,922	4,231,174,091
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	43,778,213,116	51,378,049,700

（ 3 ）【中間注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

（ 中間貸借対照表に関する注記 ）

		前計算期間末 2022年 5月31日現在	当中間計算期間末 2022年11月30日現在
1.	期首元本額	31,818,315,240円	33,604,280,164円
	期中追加設定元本額	8,929,522,774円	4,292,997,558円
	期中一部解約元本額	7,143,557,850円	3,117,189,483円
2.	受益権の総数	33,604,280,164口	34,780,088,239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	822,518,180円	837,014,740円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。		
	株式	9,759,659,760円	10,106,743,310円

（ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

前中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日	当中間計算期間 自 2022年 6月 1日 至 2022年11月30日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2022年 5月31日現在	当中間計算期間末 2022年11月30日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

前計算期間末（2022年 5月31日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,943,167,300	-	1,966,270,000	23,102,700
合計		1,943,167,300	-	1,966,270,000	23,102,700

当中間計算期間末（2022年11月30日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	1,709,592,400	-	1,751,200,000	41,607,600
	合計	1,709,592,400	-	1,751,200,000	41,607,600

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

前計算期間末 2022年 5月31日現在		当中間計算期間末 2022年11月30日現在	
1口当たり純資産額	2.3576円	1口当たり純資産額	2.4772円
(1万口当たり純資産額)	(23,576円)	(1万口当たり純資産額)	(24,772円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年12月30日現在です。

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

【純資産額計算書】

資産総額	93,665,494,745円
負債総額	10,666,902,310円
純資産総額（ - ）	82,998,592,435円
発行済口数	35,112,689,338口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3638円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めた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12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2022年12月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2022年12月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク（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12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	866	229,546
株式投資信託	807	193,694
単位型	318	9,773
追加型	489	183,920
公社債投資信託	59	35,852
単位型	46	1,158
追加型	13	34,693

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）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」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63期事業年度（2021年4月1日から2022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64期中間会計期間（2022年4月1日から2022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62期 (2021年3月31日)		第63期 (2022年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,698		42,427
有価証券		17		170
前払費用		785		932
未収入金		225		96
未収委託者報酬		24,738		25,193
未収収益	3	891	3	1,048
関係会社短期貸付金		2,403		5,005
立替金		930		1,056
その他	2	361	2	998
流動資産合計		55,053		76,928
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	245	1	244
器具備品	1	190	1	153
有形固定資産合計		436		397
無形固定資産				
ソフトウェア		241		335

無形固定資産合計	241	335
投資その他の資産		
投資有価証券	22,903	23,969
関係会社株式	25,987	22,366
長期差入保証金	678	652
繰延税金資産	1,845	3,678
投資その他の資産合計	51,414	50,667
固定資産合計	52,092	51,399
資産合計	107,145	128,328

(単位：百万円)

	第62期 (2021年3月31日)		第63期 (2022年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	844		651
未払金	9,834		9,693
未払収益分配金	8		7
未払償還金	71		71
未払手数料	8,956		8,783
その他未払金	798		831
未払費用	3	4,660	3
未払法人税等		1,090	
未払消費税等	4	775	4
賞与引当金		3,034	
役員賞与引当金		55	
訴訟損失引当金		-	
その他		643	
流動負債合計		20,938	
固定負債			
退職給付引当金		1,456	
賞与引当金		156	
その他		544	
固定負債合計		2,157	
負債合計		23,095	
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		61,956	
利益剰余金合計		61,956	
自己株式		2,067	
株主資本合計		82,472	
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		1,461	

繰延ヘッジ損益	115	731
評価・換算差額等合計	1,577	1,618
純資産合計	84,049	91,035
負債純資産合計	107,145	128,328

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	78,975	94,938
その他営業収益	3,973	4,743
営業収益合計	82,948	99,682
営業費用		
支払手数料	34,050	42,026
広告宣伝費	953	987
公告費	1	1
調査費	17,813	23,000
調査費	966	1,042
委託調査費	16,825	21,932
図書費	22	25
委託計算費	545	598
営業雑経費	1,053	1,014
通信費	174	143
印刷費	331	308
協会費	51	52
諸会費	11	13
その他	483	494
営業費用計	54,419	67,628
一般管理費		
給料	10,383	11,759
役員報酬	243	156
役員賞与引当金繰入額	55	5
給料・手当	6,766	7,229
賞与	159	143
賞与引当金繰入額	3,158	4,225
交際費	14	22
寄付金	30	29
旅費交通費	57	66
租税公課	485	429
不動産賃借料	939	937
退職給付費用	388	394
退職金	10	169
固定資産減価償却費	138	172
福利費	1,084	1,171
諸経費	4,286	3,888
一般管理費計	17,817	19,042
営業利益	10,711	13,010

(単位：百万円)

	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		75		71
受取配当金	1	2,555	1	5,257
有価証券償還益		14		-
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		-		1,548
その他		62		58
営業外収益合計		2,710		6,936
営業外費用				
支払利息		122		177
デリバティブ費用		804		49
時効成立後支払分配金・償還金		25		9
為替差損		59		-
その他		42		39
営業外費用合計		1,054		275
経常利益		12,367		19,672
特別利益				
投資有価証券売却益		774		253
子会社有償減資払戻益		-		1,445
その他		0		-
特別利益合計		774		1,699
特別損失				
投資有価証券売却損		237		132
投資有価証券評価損		5		-
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		125		-
訴訟損失引当金繰入額		-		7,847
特別損失合計		369		7,980
税引前当期純利益		12,773		13,391
法人税、住民税及び事業税		3,722		3,435
法人税等還付税額		-	2	329
法人税等調整額		373		1,851
法人税等合計		3,348		1,255
当期純利益		9,424		12,136

(3) 【株主資本等変動計算書】

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						
	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	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

第63期（自 2021年4月1日 至 2022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	61,956	61,956	2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,944	6,944	-	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417

	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	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	889	847	41	41
当期変動額合計	889	847	41	6,985
当期末残高	2,350	731	1,618	91,035

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第63期				
	(自 2021年4月1日 至 2022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 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。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <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>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
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。</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。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 訴訟損失引当金 訴訟による損失に備えるため、損失見込額を計上しております。</p>				

4 収益の計上基準	<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</p> <p>資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

<p>第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31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。)等を当事業年度の期首から適用し、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、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の利益剰余金に加減し、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。)等を当事業年度の期首から適用し、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、当財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては、記載しておりません。</p>

（未適用の会計基準等）

- ・ 「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 2021年6月17日）
- (1) 概要
投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。
 - (2) 適用予定日
2023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
当該適用指針の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

（重要な会計上の見積り）

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

- 1 当事業年度の財務諸表に計上した金額
訴訟損失引当金を7,847百万円計上しております。
- 2 会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報
 - (1) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出方法
訴訟について将来発生しうる損失の見込額を算出し、訴訟損失引当金として計上しています。
 - (2) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出に用いた主要な仮定
原告が主張する損害額に基づき、将来発生することが予想される損失の見積を行っています。
 - (3) 翌事業年度の財務諸表に与える影響
当社では、現在までに想定しうる最善の仮定に基づき訴訟損失引当金を計上しておりますが、今後の経過により、翌事業年度において訴訟損失引当金の追加計上または取り崩しを行う可能性があります。

（貸借対照表関係）

第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,349百万円 器具備品 764百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,390百万円 器具備品 823百万円
2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 257百万円 (流動負債) 未払費用 1,247百万円	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 233百万円 (流動負債) 未払費用 2,314百万円
4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。	4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。
	5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエ クイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・ リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻 請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マ ネジメント・リミテッドは最大5百万豪ドルを提供 する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタ ル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供 義務を保証しております。

（損益計算書関係）

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
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。 受取配当金 2,498百万円	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。 受取配当金 5,194百万円 2 法人税等還付税額 過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を計上しています。

(株主資本等変動計算書関係)

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(1)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いません。

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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)	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	432,300	-	432,300	-	-
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	-	956,000	816,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,607,000	-	1,071,000	1,536,000	-
合計		5,827,300	-	3,387,300	2,440,000	-

(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 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)816,000株及び2017年度ストックオプション(1)847,000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、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
2022年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

(リース取引関係)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第63期 (自 2021年4月1日 至 2022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	911百万円	1年内	911百万円
1年超	5,236百万円	1年超	4,324百万円
合計	6,148百万円	合計	5,236百万円

(金融商品関係)

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・ドマネへ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「5 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	(453)	(453)	-

デリバティブ取引計	(642)	(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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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ードマネー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「5 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います。

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いますが、一部が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ついても、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)

	貸借対照表計上額(*4)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
デリバティブ取引(*1)				
株式関連(*2)	262	-	-	262
通貨関連(*3)	-	1,066	-	1,066
デリバティブ取引計	262	1,066	-	1,329

- (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 262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- (3) 通貨関連のデリバティブ取引の 1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- (4) 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。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

(2) 時価をもって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	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3 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	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

(有価証券関係)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、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	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,188	3,369	180
	小計	3,188	3,369	180
合計		24,123	20,735	3,387

(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。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格の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。

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	3,079	253	132
合計	3,079	253	132

(デリバティブ取引関係)

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	2,670	-	75	75
	買建	-	-	-	-
合計		2,670	-	75	75

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,713	-	112	112
合計		1,713	-	112	112

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第63期(2022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	2,306	-	262	262
	買建	-	-	-	-
合計		2,306	-	262	262

(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	4,708	-	293	293
合計		4,708	-	293	293

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		5,445	-	367
	豪ドル		222	-	20
	香港ドル		1,097	-	59
	人民元		5,185	-	324
	ユーロ		35	-	0
	合計		11,986	-	772

(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62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022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 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964

(退職給付関係)

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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	211
退職給付債務の期末残高	1,352

(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	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
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	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

(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	0.3%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	1,184,700	1,346,000
付与	0	0
失効	752,300	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 1,738百万円
- 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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	88,000
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	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
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 1,222百万円
 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62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の 内訳 (単位:百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の 内訳 (単位:百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 929	賞与引当金 1,341
投資有価証券評価損 97	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 52
退職給付引当金 446	退職給付引当金 427
固定資産減価償却費 90	固定資産減価償却費 87
その他 978	繰延ヘッジ損益 322
繰延税金資産小計 3,972	訴訟損失引当金 2,403
評価性引当金 1,430	その他 1,039
繰延税金資産合計 2,541	繰延税金資産小計 5,772
繰延税金負債	評価性引当金(注) 52
繰延ヘッジ利益 51	繰延税金資産合計 5,719
その他有価証券評価差額金 645	繰延税金負債
繰延税金負債合計 696	その他有価証券評価差額金 1,092
繰延税金資産の純額 1,845	その他 948
	繰延税金負債合計 2,041
	繰延税金資産の純額 3,678

(注) 関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した
 評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円
 減少しております。

2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 (調整)	法定実効税率 (調整)
30.6%	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.3%	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
5.7%	10.9%
その他	評価性引当金の減少
1.0%	10.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	その他
26.2%	0.1%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率
	9.4%

(関連当事者情報)

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)
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	-	資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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 Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	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	2,019 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86千)
							資金の返済(円貸建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(円貸建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	2,788 (SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	2,985 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	23 (SGD 266千)	未収収益	23 (SGD 266千)
減資(注2)	9,149 (SGD 110,000千)	-	-							
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注3)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	3,788 (USD 34,000千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万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 Asset Management International Limitedの行った110,000千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
- 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2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,450百万円
------	-----------

負債合計	6,257百万円
純資産合計	28,192百万円
営業収益	18,176百万円
税引前当期純利益	5,587百万円
当期純利益	3,956百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 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。

2 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 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 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事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度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。

(1株当たり情報)

項目	第62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	432円90銭	468円88銭
1株当たり当期純利益金額	48円45銭	62円50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62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,424	12,136
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)	9,424	12,136
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,509	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) 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	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) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000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62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	84,049	91,035
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)	84,049	91,035
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)	194,152	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64期中間会計期間 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		33,164
有価証券		481
未収委託者報酬		16,607
未収収益		1,063
関係会社短期貸付金		3,335
その他	2	3,967
流動資産合計		58,620
固定資産		
有形固定資産	1	404
無形固定資産		353
投資その他の資産		
投資有価証券		23,904
関係会社株式		22,366
長期差入保証金		416
繰延税金資産		4,029
投資その他の資産合計		50,718
固定資産合計		51,476
資産合計		110,097

(単位：百万円)

第64期中間会計期間
(2022年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,815
未払費用	3,556
未払法人税等	3,271
未払消費税等	3
賞与引当金	1,924
役員賞与引当金	110
その他	1,258
流動負債合計	18,282
固定負債	
退職給付引当金	1,445
賞与引当金	321
役員賞与引当金	16
その他	119
固定負債合計	1,903
負債合計	20,186
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	68,572
利益剰余金合計	68,572
自己株式	2,067
株主資本合計	89,088
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,064
繰延ヘッジ損益	1,242
評価・換算差額等合計	822
純資産合計	89,911
負債純資産合計	110,097

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第64期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	38,118
その他営業収益	1,728
営業収益合計	39,846

営業費用及び一般管理費	1	34,563
営業利益		5,283
営業外収益	2	1,046
営業外費用	3	516
経常利益		5,813
特別利益	4	4,602
特別損失	5	137
税引前中間純利益		10,277
法人税等	6	3,185
中間純利益		7,091

(3) 中間株主資本等変動計算書

第64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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	68,901	68,901	2,067	89,417
当中間期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
中間純利益				7,091	7,091		7,091
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	-	-	-	328	328	-	328
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	68,572	68,572	2,067	89,088

	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	2,350	731	1,618	91,035
当中間期変動額				
剰余金の配当				7,420
中間純利益				7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	285	510	795	795
当中間期変動額合計	285	510	795	1,124
当中間期末残高	2,064	1,242	822	89,911

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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</p> <p>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)</p> <p>市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 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 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>5 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(3) 成功報酬 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> <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 ヘッジ取引細則等に基づき、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>
<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>	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 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 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64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用) 「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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軽微であります。</p>

(表示方法の変更)

<p>第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)</p>
<p>(損益計算書) その他有価証券の為替リスクヘッジに係るヘッジ損益について、ヘッジ対象の損益認識時に繰延ヘッジ損益を純損益に計上するに当たり、前中間会計期間において、「営業外費用」に含めていましたが、金額的重要性が高まったことから、ヘッジの効果をより明瞭に表示するため当中間会計期間よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である特別利益あるいは特別損失として表示することとしております。</p>

(中間貸借対照表関係)

<p>第64期中間会計期間 (2022年9月30日)</p>	
<p>1</p>	<p>有形固定資産の減価償却累計額 2,264百万円</p>
<p>2</p>	<p>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。</p>

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

ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大470百万円（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64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	50百万円
無形固定資産	37百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	40百万円
受取配当金	131百万円
デリバティブ収益	685百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	156百万円
為替差損	351百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	120百万円
訴訟損失引当金戻入額	4,481百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	137百万円
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64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	

2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	88,000	-	88,000	-	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	816,000	-	599,000	217,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	-	667,000	869,000	-
合計		2,440,000	-	1,354,000	1,086,000	-

(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 2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)869,000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。

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
2022年5月27日 取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27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64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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	910百万円
1年超	3,870百万円
合計	4,780百万円

(金融商品関係)

第64期中間会計期間(2022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、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			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

有価証券 その他有価証券 投資信託	4,796	19,572	-	24,369
資産計	4,796	19,572	-	24,369
デリバティブ取引(1、2)				
株式関連	666	-	-	666
通貨関連	-	626	-	626
デリバティブ取引計	666	626	-	39

- (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666百万円は、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626百万円は、流動負債のその他に含まれております。

(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

資 産

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

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	17,183
関連会社株式	5,183

(有価証券関係)

第64期中間会計期間(2022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

(単位：百万円)

	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	17,633	13,768	3,865
	小計	17,633	13,768	3,865
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	6,735	7,625	889
	小計	6,735	7,625	889
合計		24,369	21,393	2,976

(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64期中間会計期間(2022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	7,428	-	666	666
合計		7,428	-	666	666

(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 シンガポール ドル	3,222	-	98	98
合計		3,222	-	98	98

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,241	-	357
	豪ドル		193	-	0
	ユーロ		319	-	8
	香港ドル		976	-	68
	人民元		6,254	-	94
合計			13,984	-	528

（持分法損益等）

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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	5,327百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,684百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,341百万円

（収益認識関係）

第64期中間会計期間(2022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. 収益の計上基準」に記載のとおりです。
- 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64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
1株当たり純資産額	463円09銭
1株当たり中間純利益金額	36円52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64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益(百万円)	7,091
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)	7,091
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	2016年度ストックオプション(2)217,000株、 2017年度ストックオプション(1)869,000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64期中間会計期間 (2022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)	89,911
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)	89,911
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2022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(2022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 (2022年3月末現在)	事業の内容
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業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。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	

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

2【関係業務の概要】

（1）受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

（2）販売会社

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

3【資本関係】

（1）受託会社

該当事項はありません。

（2）販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

（2）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
 ファンドの基本的性格など
 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
 目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

載。

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

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

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

ファンドは、大量の解約が発生し、短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

2022年6月13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

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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年8月24日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w C 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 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2021年6月1日から2022年5月31日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2022年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書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

2022年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年12月28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 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2022年6月1日から2022年11月30日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月1日から2022年11月30日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書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。