

【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7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】	バランスポートフォリオ
【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】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

本書は、ファンドコード「G01693」（インデックスポートフォリオ、バランスポートフォリオ）の「バランスポートフォリオ」を分離したものです。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

バランスポートフォリオ（以下「ファンド」といいます。）

2023年2月7日をもって、ミリオン（従業員積立投資プラン）としての取扱いを終了いたしました。これに伴ない、総称としての「ミリオン」を削除いたしました。

（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】

1兆円を上限とします。

（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。

（７）【申込期間】

2023年2月8日から2023年8月7日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<p>< 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。</p>
--

(9) 【払込期日】

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

(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

TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果に、内外公社債への投資による安定性を加味した運用を行ない、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単体型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単体型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

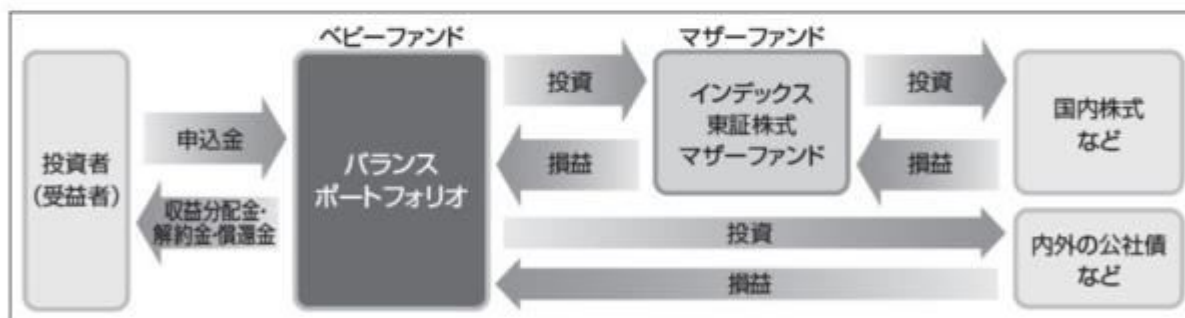
TOPIX*（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざす「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ないます。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。

*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。

※市況の急激な変化が生じたときなど、やむを得ない事情が発生した場合ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの仕組み

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



（主な投資制限）

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

（分配方針）

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

- ・ TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、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

- ・ 2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（2）【ファンドの沿革】

1987年11月27日

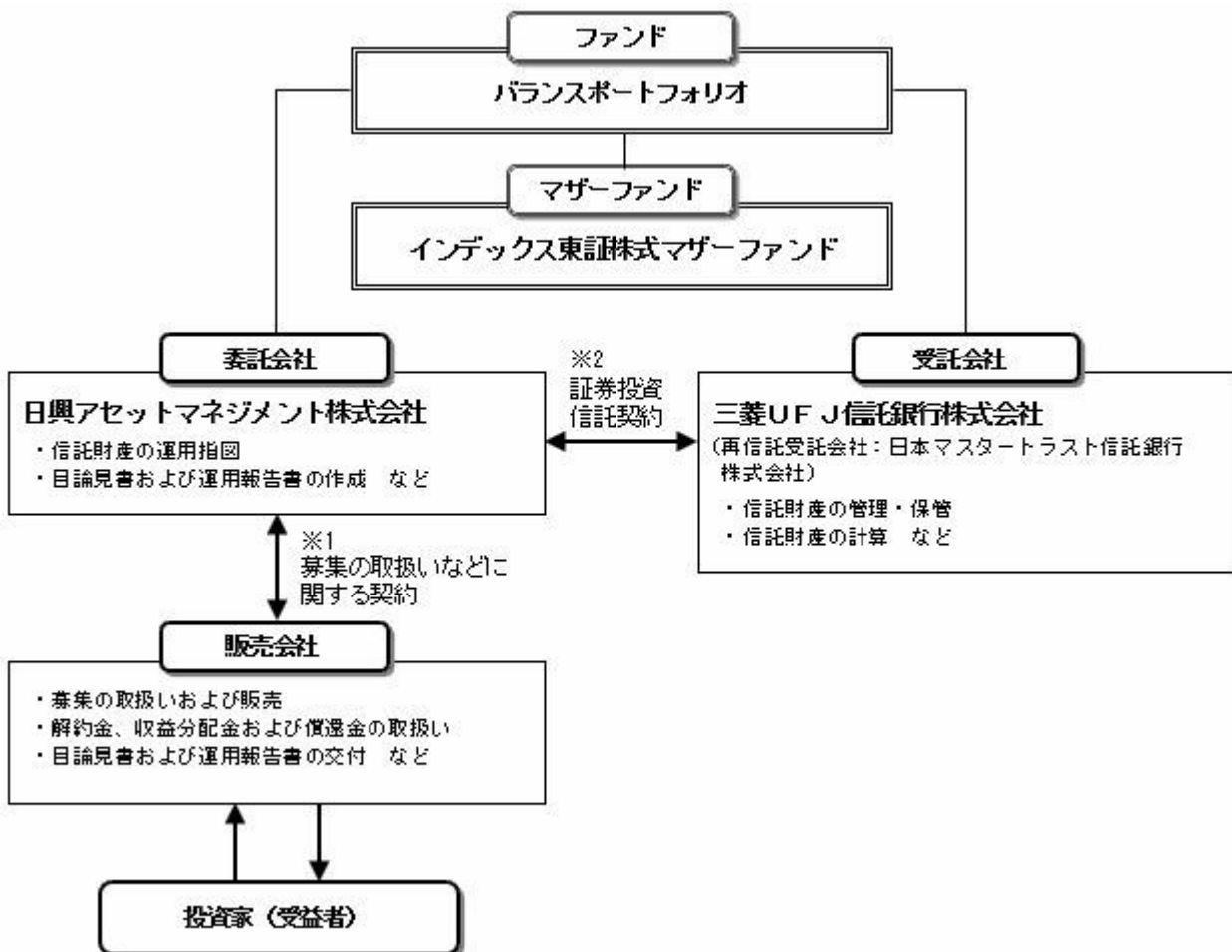
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

2023年 2月 7日

- ・ ミリオン（従業員積立投資プラン）としての取扱いを終了

（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11月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。

- ・株式以外の資産への実質投資割合(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。)は、原則として、信託財産の総額の75%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】

< バランスポートフォリオ >

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第17条の2に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)
 - 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
 - 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引

- 3) 有価証券の貸付
- 4) 外国為替予約取引
- 5) 資金の借入

<インデックス東証株式マザーファンド>

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13条の2および第13条の4に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 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。）
- 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) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

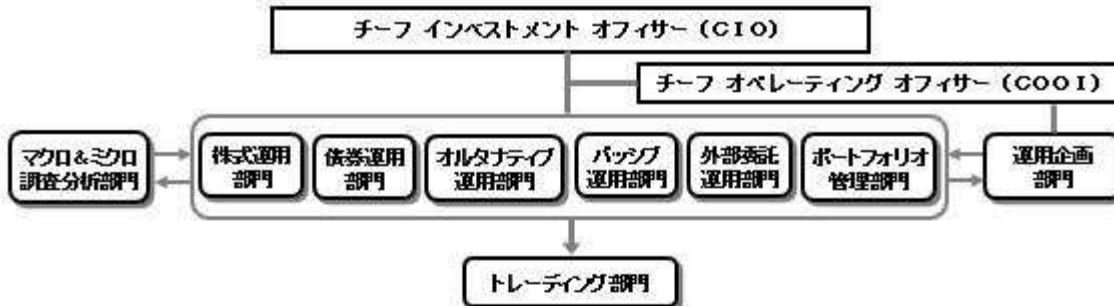
<インデックス東証株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

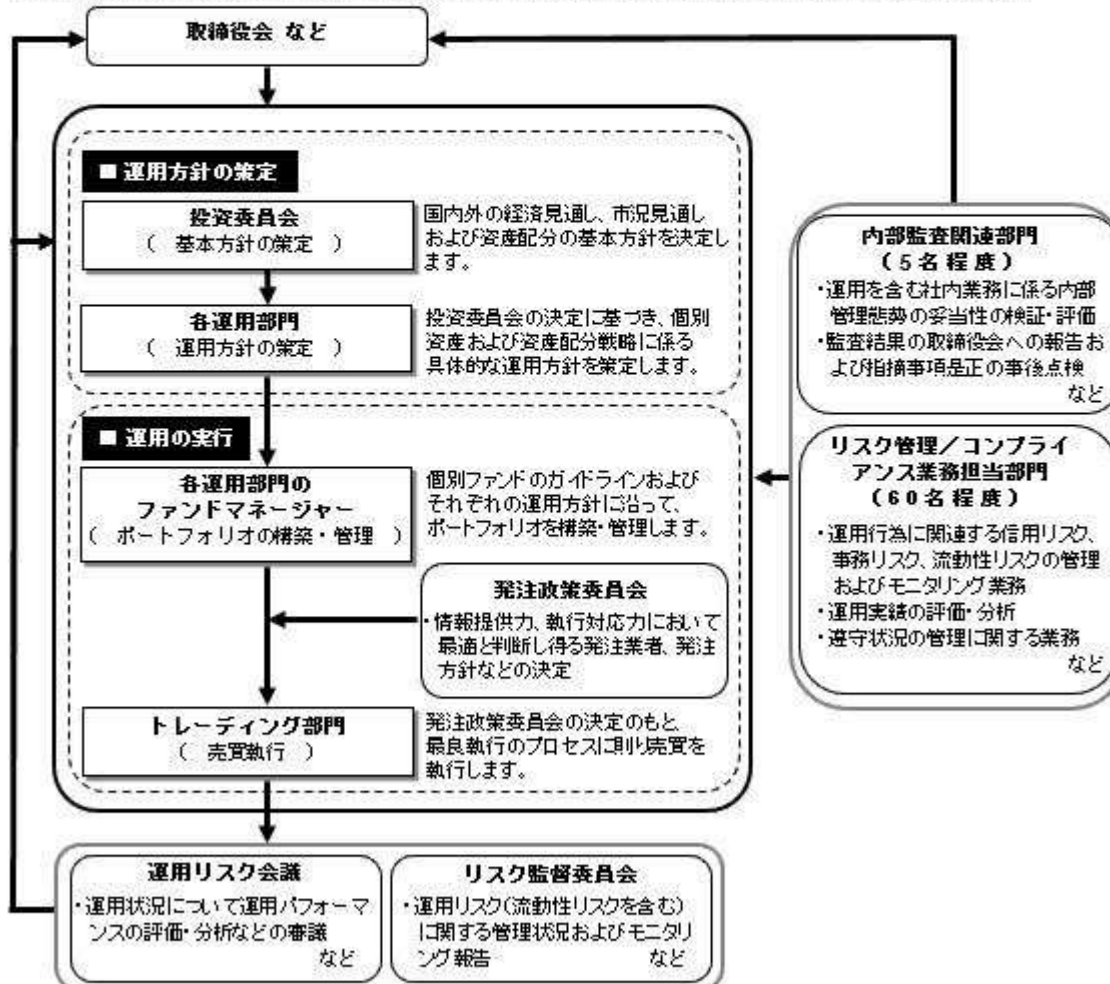
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をTOPIX（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バークレイ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行いません。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式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いません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1986年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2022年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< バランスポートフォリオ >

1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証

券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

5)信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

7)信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみな

した額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 9) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入れ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弁済される日からその翌営業日までとします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- <インデックス東証株式マザーファンド>
- 1) 株式への投資割合には制限を設けません。
 - 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
 - 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
 - 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこ

これらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 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。
- 9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

ります。

- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

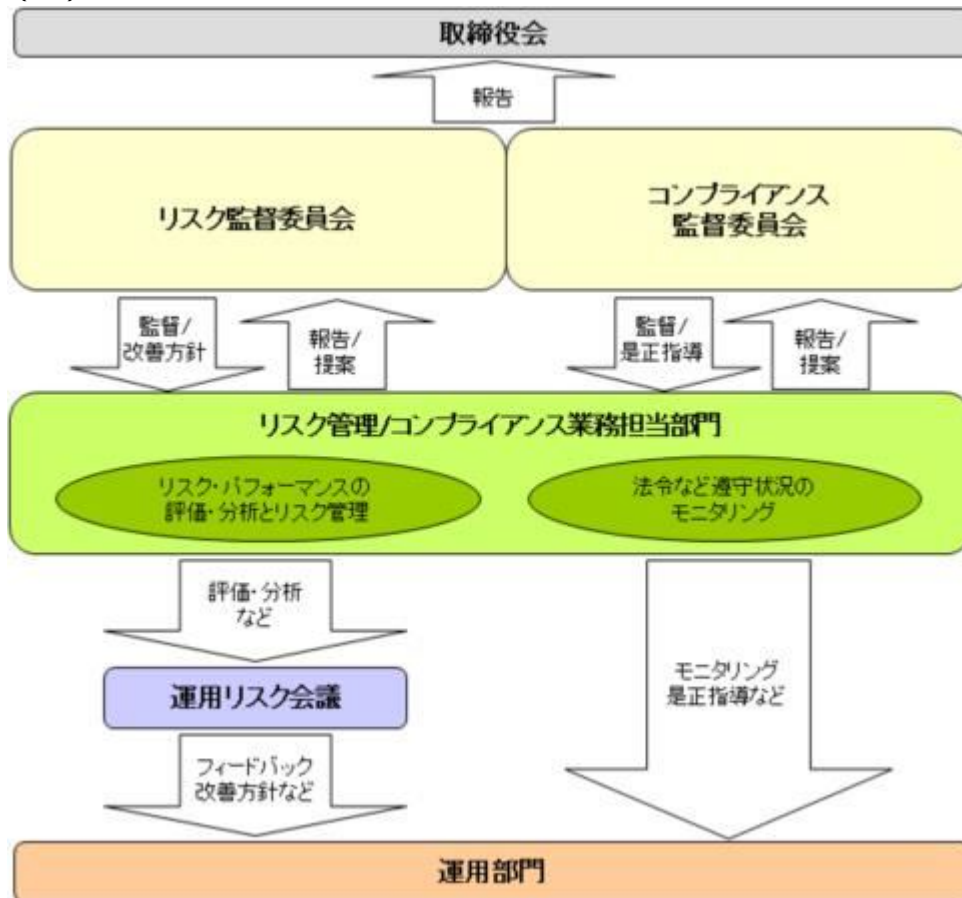
<その他の留意事項>

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

て、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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。

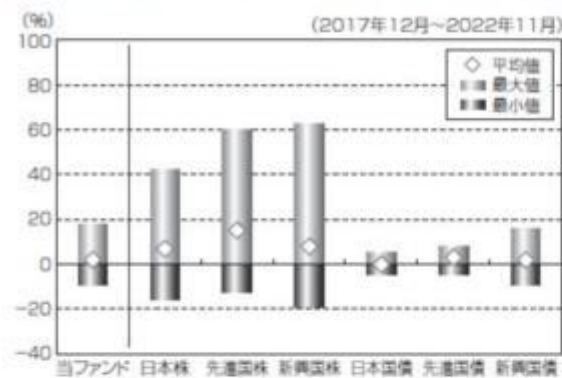
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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11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	1.9%	6.9%	15.1%	7.9%	-0.0%	3.1%	1.9%
最大値	17.9%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-9.3%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.5%	-4.5%	-9.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2017年12月から2022年11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グローバルレディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について**東証株価指数(TOPIX、配当込)**

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

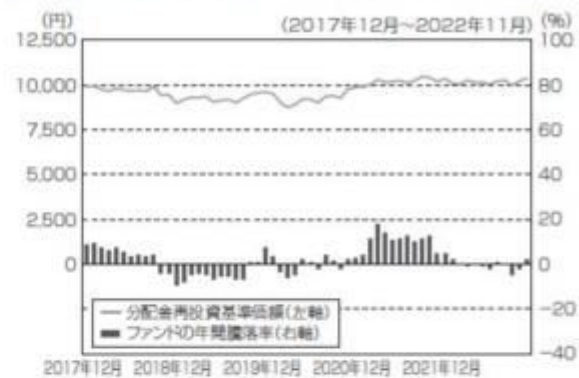
当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年12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。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権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0.572%（税抜0.52%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.52%	0.22%	0.22%	0.08%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

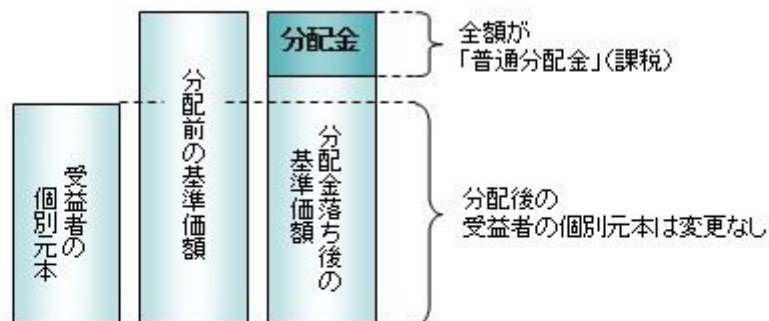
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

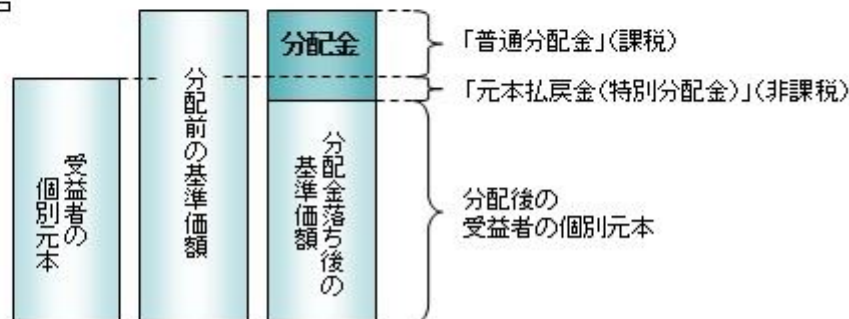
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 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7日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2022年11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(%)
-------	------	---------	---------

地方債証券	日本	54,278,875	31.51
親投資信託受益証券	日本	85,400,092	49.58
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		32,568,297	18.91
合計（純資産総額）		172,247,264	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	38,995,476	2.1330	83,177,351	2.1900	85,400,092			49.58
日本	地方債証券	平成24年度第10回静岡県公募公債	18,000,000	100.21	18,038,015	100.21	18,038,015	0.678	2023/3/22	10.47
日本	地方債証券	第401回大阪府公募公債（10年）	15,000,000	101.13	15,169,950	101.02	15,153,300	0.477	2025/10/29	8.80
日本	地方債証券	平成26年度第1回滋賀県公募公債	11,000,000	100.85	11,093,610	100.79	11,087,560	0.495	2024/11/28	6.44
日本	地方債証券	平成30年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	10,000,000	100.00	10,000,000	100.00	10,000,000	0.020	2023/10/31	5.81

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
地方債証券	31.51
親投資信託受益証券	49.58
合計	81.09

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第26計算期間末（2013年11月7日）	436	437	0.8067	0.8072

第27計算期間末	(2014年11月 7日)	382	382	0.8619	0.8624
第28計算期間末	(2015年11月 9日)	322	322	0.9300	0.9305
第29計算期間末	(2016年11月 7日)	271	271	0.8629	0.8634
第30計算期間末	(2017年11月 7日)	268	268	0.9920	0.9925
第31計算期間末	(2018年11月 7日)	218	218	0.9443	0.9448
第32計算期間末	(2019年11月 7日)	217	217	0.9565	0.9570
第33計算期間末	(2020年11月 9日)	213	213	0.9545	0.9550
第34計算期間末	(2021年11月 8日)	212	213	1.0465	1.0470
第35計算期間末	(2022年11月 7日)	174	174	1.0216	1.0221
	2021年11月末日	205		1.0177	
	12月末日	208		1.0335	
	2022年 1月末日	203		1.0070	
	2月末日	203		1.0034	
	3月末日	208		1.0257	
	4月末日	206		1.0121	
	5月末日	206		1.0144	
	6月末日	204		1.0026	
	7月末日	208		1.0197	
	8月末日	200		1.0250	
	9月末日	185		0.9960	
	10月末日	179		1.0207	
	11月末日	172		1.0352	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005
第35期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.58

第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	6.90
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	7.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	7.16
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	15.02
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	4.76
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	1.34
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.16
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	9.69
第35期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	2.33

(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26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	14,701,201	47,759,106
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	11,634,468	109,900,290
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	9,591,772	106,409,569
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	9,326,069	41,548,116
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	7,480,324	50,984,226
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	6,405,223	46,051,030
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	6,506,949	10,601,618
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	7,044,581	10,651,253
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	5,792,929	25,835,192
第35期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	5,294,402	37,920,322

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年11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。

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	8,376,074,820	98.47
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		129,932,334	1.53
合計（純資産総額）		8,506,007,154	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	99,500,000	1.17

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	160,300	1,990.08	319,009,824	2,010.50	322,283,150	3.79
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	20,600	9,580.00	197,348,000	11,255.00	231,853,000	2.73
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,900	47,920.00	138,968,000	57,140.00	165,706,000	1.95
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	37,500	4,035.81	151,342,875	3,820.00	143,250,000	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	188,400	695.30	130,994,520	755.10	142,260,840	1.67
日本	株式	第一三共	医薬品	25,500	4,395.93	112,096,215	4,518.00	115,209,000	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	18,400	6,036.00	111,062,400	5,894.00	108,449,600	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	14,800	6,360.00	94,128,000	7,299.00	108,025,200	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	25,900	3,719.00	96,322,100	4,050.00	104,895,000	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	16,900	5,758.00	97,310,200	5,952.00	100,588,800	1.18
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	21,000	4,126.00	86,646,000	4,673.00	98,133,000	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	22,200	4,380.00	97,236,000	4,329.00	96,103,800	1.13
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,100	38,390.00	80,619,000	45,090.00	94,689,000	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	22,600	4,292.00	96,999,200	4,111.00	92,908,600	1.09
日本	株式	三井物産	卸売業	22,600	3,189.00	72,071,400	3,983.00	90,015,800	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	19,300	4,052.00	78,203,600	4,605.00	88,876,500	1.04
日本	株式	HOYA	精密機器	6,300	14,145.00	89,113,500	14,060.00	88,578,000	1.04
日本	株式	信越化学工業	化学	5,000	14,855.00	74,275,000	17,570.00	87,850,000	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	29,000	2,608.86	75,656,940	2,827.00	81,983,000	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	23,700	3,257.00	77,190,900	3,356.00	79,537,200	0.94
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	18,500	3,794.00	70,189,000	4,287.00	79,309,500	0.93
日本	株式	ダイキン工業	機械	3,500	21,665.00	75,827,500	22,405.00	78,417,500	0.92
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	41,500	1,617.55	67,128,325	1,717.00	71,255,500	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	47,000	1,450.00	68,150,000	1,497.50	70,382,500	0.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	8,900	6,961.00	61,952,900	7,464.00	66,429,600	0.78
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	3,200	19,205.00	61,456,000	19,720.00	63,104,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	1,000	57,580.00	57,580,000	61,760.00	61,760,000	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	7,200	7,740.00	55,728,000	8,534.00	61,444,800	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	28,000	1,990.50	55,734,000	2,128.00	59,584,000	0.70

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	10,600	5,608.00	59,444,800	5,579.00	59,137,400	0.70
----	----	-----------------	-----	--------	----------	------------	----------	------------	------

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.32
		建設業	1.91
		食料品	3.45
		繊維製品	0.44
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.05
		医薬品	5.67
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.73
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.56
		機械	5.10
		電気機器	17.17
		輸送用機器	7.63
		精密機器	2.70
		その他製品	2.33
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	3.13
		海運業	0.59
		空運業	0.50
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.69
		卸売業	5.85
		小売業	4.42
		銀行業	5.47
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	2.32
その他金融業	1.10		
不動産業	2.09		
サービス業	5.31		
合 計			98.47

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2022年12月	買建	5	日本円	99,157,750	99,500,000	1.17

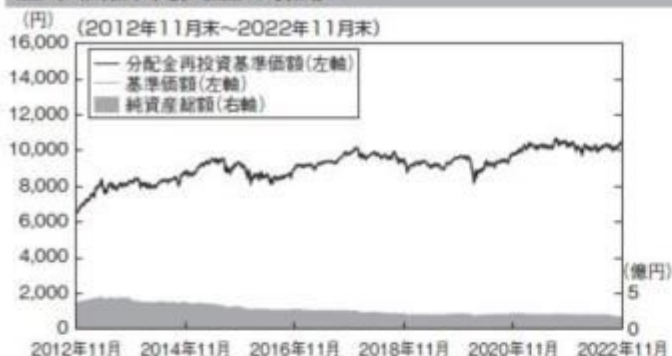
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

参考情報

運用実績

2022年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,352円

純資産総額…………… 1.72億円

※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11月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2018年11月	2019年11月	2020年11月	2021年11月	2022年11月	設定末累計
5円	5円	5円	5円	5円	175円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	48.82%
株式先物	0.58%
債券	31.51%
債券先物	0.00%
現金その他	19.67%

※当ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>

当ファンド

銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1 インデックス東証株式マザーファンド	積投資信託受益証券	—	—	49.58%
2 平成24年度第10回静岡県公債	地方債証券	0.678%	2023年3月22日	10.47%
3 第401回大阪府公債(10年)	地方債証券	0.477%	2025年10月29日	8.80%
4 平成26年度第1回滋賀県公債	地方債証券	0.495%	2024年11月28日	6.44%
5 平成30年度第1回鹿児島県公債(5年)	地方債証券	0.020%	2023年10月31日	5.81%

※当ファンドの対純資産総額比です。

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.79%
2 ソニーグループ	電気機器	2.73%
3 キーエンス	電気機器	1.95%
4 日本電信電話	情報・通信業	1.68%
5 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.67%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2022年は、2022年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

- (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。
- (6) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約価額
解約請求受付日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (5) 手取額
1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
- (6) 解約単位
1口単位
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (7) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができま

す。

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

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時まで、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、翌営業日の扱いとなります。

(3) 買取制限

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

(4) 買取価額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(6) 買取単位

1口単位

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

(7) 受付の中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（1987年11月27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11月8日から翌年11月7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) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

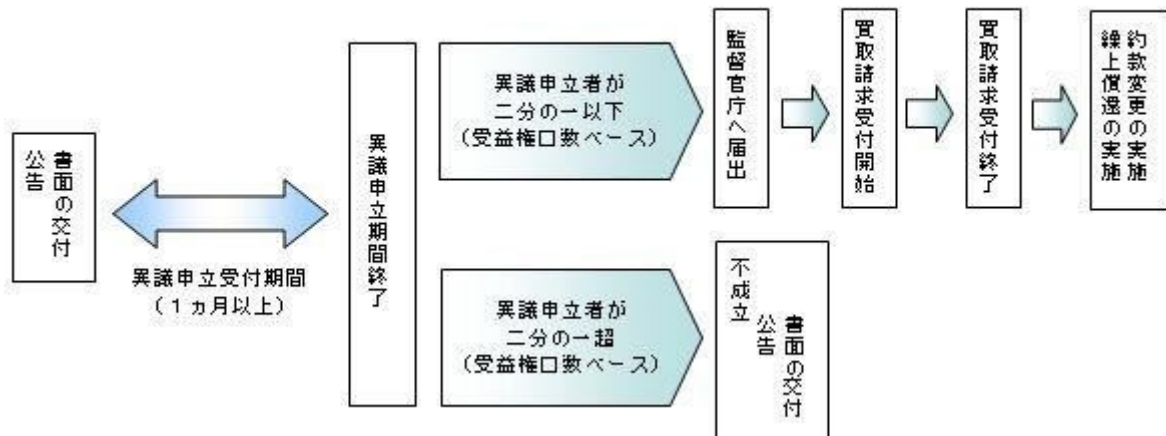
信託約款の変更

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期計算期間（2021年11月9日から2022年11月7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】

【バランスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第34期 2021年11月 8日現在	第35期 2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	52,712,505	34,220,691
地方債証券	54,614,090	54,309,050
親投資信託受益証券	107,506,555	87,250,478
未収利息	42,134	41,450
流動資産合計	214,875,284	175,821,669
資産合計	214,875,284	175,821,669
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	101,764	85,451
未払受託者報酬	93,519	87,485
未払委託者報酬	1,684,503	1,045,906
未払利息	28	51
その他未払費用	4,618	4,313
流動負債合計	1,884,432	1,223,206
負債合計	1,884,432	1,223,206
純資産の部		
元本等		
元本	203,529,299	170,903,379
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	9,461,553	3,695,084
(分配準備積立金)	34,724,773	28,311,942
元本等合計	212,990,852	174,598,463
純資産合計	212,990,852	174,598,463
負債純資産合計	214,875,284	175,821,669

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第34期		第35期	
	自	2020年11月10日	自	2021年11月9日
	至	2021年11月8日	至	2022年11月7日
営業収益				
受取利息		249,452		249,356
有価証券売買等損益		23,206,824		2,381,557
営業収益合計		23,456,276		2,132,201
営業費用				
支払利息		6,235		8,166
受託者報酬		186,258		178,194
委託者報酬		3,354,962		2,679,711
その他費用		9,203		8,790
営業費用合計		3,556,658		2,874,861
営業利益又は営業損失（ ）		19,899,618		5,007,062
経常利益又は経常損失（ ）		19,899,618		5,007,062
当期純利益又は当期純損失（ ）		19,899,618		5,007,062
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（ ）		1,404,604		974,474
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		10,178,761		9,461,553
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,247,064		90,075
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,166,470		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		80,594		90,075
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,738,505
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,738,505
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		101,764		85,451
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,461,553		3,695,084

(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>地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年11月 9日から2022年11月 7日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		第34期 2021年11月 8日現在	第35期 2022年11月 7日現在
1.	期首元本額	223,571,562円	203,529,299円
	期中追加設定元本額	5,792,929円	5,294,402円
	期中一部解約元本額	25,835,192円	37,920,322円
2.	受益権の総数	203,529,299口	170,903,379口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第34期 自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日		第35期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7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	203,202円	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	11,969,130円	0円

C 信託約款に定める収益調整金	31,576,641円	C 信託約款に定める収益調整金	27,276,041円
D 信託約款に定める分配準備積立金	22,654,205円	D 信託約款に定める分配準備積立金	28,397,393円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	66,403,178円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	55,673,434円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,262円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,257円
G 分配金額	101,764円	G 分配金額	85,451円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5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34期 自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日	第35期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7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34期 2021年11月 8日現在	第35期 2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(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 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。	(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34期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
地方債証券	210,040
親投資信託受益証券	20,507,883
合計	20,297,843

第35期（2022年11月 7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
地方債証券	301,140
親投資信託受益証券	1,636,203
合計	1,937,343

（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34期 2021年11月 8日現在	第35期 2022年11月 7日現在
1口当たり純資産額	1.0465円
	1口当たり純資産額
	1.0216円

(1万口当たり純資産額)	(10,465円)	(1万口当たり純資産額)	(10,216円)
--------------	-----------	--------------	-----------

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	第401回大阪府公募公債(10年)	15,000,000	15,169,950	
	平成24年度第10回静岡県公募公債	18,000,000	18,045,490	
	平成26年度第1回滋賀県公募公債	11,000,000	11,093,610	
	平成30年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	10,000,000	10,000,000	
地方債証券 合計		54,000,000	54,309,050	
親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	40,905,053	87,250,478	
親投資信託受益証券 合計		40,905,053	87,250,478	
	合計	94,905,053	141,559,528	

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	806,211	341,923
コール・ローン	47,909,393	79,759,350
株式	9,744,487,560	8,336,984,060
派生商品評価勘定	937,250	2,227,250
未収入金	-	288,900
未収配当金	82,395,476	89,892,001
流動資産合計	9,876,535,890	8,509,493,484
資産合計	9,876,535,890	8,509,493,484
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	675,550	21,100
前受金	385,000	510,000
未払解約金	1,364,283	7,693,246
未払利息	25	119
流動負債合計	2,424,858	8,224,465
負債合計	2,424,858	8,224,465
純資産の部		
元本等		
元本	4,516,043,644	3,985,739,219
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,358,067,388	4,515,529,800
元本等合計	9,874,111,032	8,501,269,019
純資産合計	9,874,111,032	8,501,269,019
負債純資産合計	9,876,535,890	8,509,493,484

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</p>
--------------------	--

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
1.	期首	2020年11月10日	2021年11月 9日
	期首元本額	5,384,177,187円	4,516,043,644円
	期首からの追加設定元本額	18,387,773円	27,259,776円
	期首からの一部解約元本額	886,521,316円	557,564,201円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	4,466,864,067円	3,944,834,166円
	バランスポートフォリオ	49,179,577円	40,905,053円
	計	4,516,043,644円	3,985,739,219円
2.	受益権の総数	4,516,043,644口	3,985,739,219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	102,746,700円	92,580,220円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日	自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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)

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	168,586,790
合計	168,586,790

(2022年11月 7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	222,850,024
合計	222,850,024

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	121,745,000	-	122,010,000	265,000
合計		121,745,000	-	122,010,000	265,000

(2022年11月 7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	133,345,000	-	135,555,000	2,210,000
合計		133,345,000	-	135,555,000	2,210,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年11月 8日現在		2022年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.186円	1口当たり純資産額	2.133円
(1千口当たり純資産額)	(2,186円)	(1千口当たり純資産額)	(2,133円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	200	3,640.00	728,000	
日本水産	4,200	502.00	2,108,400	
マルハニチロ	600	2,344.00	1,406,400	
雪国まいたけ	400	1,059.00	423,600	
カネコ種苗	100	1,418.00	141,800	
サカタのタネ	500	4,785.00	2,392,500	
ホクト	400	1,905.00	762,000	
ホクリヨウ	100	625.00	62,500	
住石ホールディングス	400	203.00	81,200	
日鉄鉱業	100	3,015.00	301,500	
三井松島ホールディングス	200	2,625.00	525,000	
I N P E X	15,500	1,611.00	24,970,500	
石油資源開発	500	3,920.00	1,960,000	
K & O エナジーグループ	200	2,222.00	444,400	
ショーボンドホールディングス	600	6,370.00	3,822,000	
ミライト・ワン	1,400	1,432.00	2,004,800	
タマホーム	300	2,296.00	688,800	
日本アクア	200	715.00	143,000	
ファーストコーポレーション	100	715.00	71,500	
ベステラ	100	967.00	96,700	
キャンディル	100	494.00	49,400	
ダイセキ環境ソリューション	100	774.00	77,400	
第一カッター興業	100	1,211.00	121,100	
安藤・間	2,400	869.00	2,085,600	
東急建設	1,200	622.00	746,400	
コムシスホールディングス	1,400	2,414.00	3,379,600	

ビーアールホールディングス	600	343.00	205,800
高松コンストラクショングループ	300	1,925.00	577,500
東建コーポレーション	100	7,660.00	766,000
ヤマウラ	200	983.00	196,600
オリエンタル白石	1,500	271.00	406,500
大成建設	2,900	4,060.00	11,774,000
大林組	10,500	957.00	10,048,500
清水建設	8,800	747.00	6,573,600
飛鳥建設	300	1,033.00	309,900
長谷工コーポレーション	3,000	1,539.00	4,617,000
松井建設	300	554.00	166,200
鹿島建設	6,500	1,403.00	9,119,500
不動テトラ	200	1,485.00	297,000
大末建設	100	1,180.00	118,000
鉄建建設	200	1,740.00	348,000
西松建設	500	3,720.00	1,860,000
三井住友建設	2,400	442.00	1,060,800
大豊建設	100	4,170.00	417,000
佐田建設	300	421.00	126,300
ナカノフドー建設	200	307.00	61,400
奥村組	500	2,842.00	1,421,000
東鉄工業	400	2,481.00	992,400
イチケン	100	1,780.00	178,000
富士ピー・エス	100	432.00	43,200
浅沼組	200	2,787.00	557,400
戸田建設	3,600	713.00	2,566,800
熊谷組	500	2,508.00	1,254,000
北野建設	100	2,489.00	248,900
植木組	100	1,222.00	122,200
矢作建設工業	400	725.00	290,000
ピーエス三菱	400	611.00	244,400
日本ハウスホールディングス	600	421.00	252,600
新日本建設	400	716.00	286,400
東亜道路工業	100	5,960.00	596,000
日本道路	100	6,100.00	610,000
東亜建設工業	300	2,408.00	722,400
日本国土開発	900	576.00	518,400
若築建設	100	2,536.00	253,600
東洋建設	900	892.00	802,800
五洋建設	4,100	730.00	2,993,000
世紀東急工業	600	800.00	480,000
福田組	100	4,645.00	464,500

住友林業	2,200	2,205.00	4,851,000
日本基礎技術	200	411.00	82,200
巴コーポレーション	300	349.00	104,700
大和ハウス工業	8,200	3,036.00	24,895,200
ライト工業	600	1,989.00	1,193,400
積水ハウス	9,100	2,433.50	22,144,850
日特建設	300	907.00	272,100
北陸電気工事	200	664.00	132,800
ユアテック	600	715.00	429,000
日本リーテック	200	725.00	145,000
四電工	100	1,665.00	166,500
中電工	500	2,054.00	1,027,000
関電工	1,600	860.00	1,376,000
きんでん	2,100	1,460.00	3,066,000
東京エネシス	300	936.00	280,800
トーエネック	100	3,425.00	342,500
住友電設	300	2,555.00	766,500
日本電設工業	500	1,612.00	806,000
エクシオグループ	1,400	2,128.00	2,979,200
新日本空調	200	1,864.00	372,800
九電工	700	3,250.00	2,275,000
三機工業	700	1,592.00	1,114,400
日揮ホールディングス	2,900	1,899.00	5,507,100
中外炉工業	100	1,571.00	157,100
ヤマト	200	666.00	133,200
太平電業	200	3,275.00	655,000
高砂熱学工業	700	1,821.00	1,274,700
朝日工業社	100	1,999.00	199,900
明星工業	500	715.00	357,500
大気社	300	3,515.00	1,054,500
ダイダン	200	2,113.00	422,600
日比谷総合設備	200	1,906.00	381,200
テスホールディングス	300	1,009.00	302,700
インフロニア・ホールディングス	3,100	1,019.00	3,158,900
東洋エンジニアリング	400	590.00	236,000
レイズネクスト	400	1,272.00	508,800
ニッポン	800	1,554.00	1,243,200
日清製粉グループ本社	2,700	1,566.00	4,228,200
日東富士製粉	100	4,360.00	436,000
昭和産業	300	2,529.00	758,700
鳥越製粉	200	619.00	123,800
中部飼料	400	1,014.00	405,600

フィード・ワン	400	674.00	269,600
日本甜菜製糖	200	1,625.00	325,000
D M三井製糖ホールディングス	300	1,920.00	576,000
塩水港精糖	300	196.00	58,800
日新製糖	100	1,696.00	169,600
森永製菓	600	3,685.00	2,211,000
中村屋	100	3,040.00	304,000
江崎グリコ	800	3,435.00	2,748,000
名糖産業	100	1,580.00	158,000
井村屋グループ	200	2,205.00	441,000
不二家	200	2,581.00	516,200
山崎製パン	2,000	1,487.00	2,974,000
モロゾフ	100	3,635.00	363,500
亀田製菓	200	4,225.00	845,000
寿スピリッツ	300	7,700.00	2,310,000
カルビー	1,300	2,892.00	3,759,600
森永乳業	500	4,150.00	2,075,000
六甲バター	200	1,355.00	271,000
ヤクルト本社	2,100	8,180.00	17,178,000
明治ホールディングス	1,800	6,180.00	11,124,000
雪印メグミルク	700	1,624.00	1,136,800
プリマハム	400	1,932.00	772,800
日本ハム	1,200	3,545.00	4,254,000
林兼産業	100	446.00	44,600
丸大食品	300	1,398.00	419,400
S Foods	300	2,727.00	818,100
柿安本店	100	2,173.00	217,300
伊藤ハム米久ホールディングス	2,300	667.00	1,534,100
サッポロホールディングス	1,000	3,310.00	3,310,000
アサヒグループホールディングス	6,800	4,249.00	28,893,200
キリンホールディングス	13,300	2,200.50	29,266,650
宝ホールディングス	2,000	1,020.00	2,040,000
オエノンホールディングス	800	270.00	216,000
養命酒製造	100	1,781.00	178,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,300	1,348.00	3,100,400
サントリー食品インターナショナル	2,100	5,050.00	10,605,000
ダイドーグループホールディングス	200	4,520.00	904,000
伊藤園	1,100	5,150.00	5,665,000
キーコーヒー	300	2,066.00	619,800
ユニカフェ	100	938.00	93,800
日清オイリオグループ	400	3,160.00	1,264,000
不二製油グループ本社	700	2,250.00	1,575,000

J・オイルミルズ	300	1,575.00	472,500
キッコーマン	1,900	7,710.00	14,649,000
味の素	7,200	4,120.00	29,664,000
ブルドックソース	100	1,648.00	164,800
キューピー	1,600	2,369.00	3,790,400
ハウス食品グループ本社	900	2,782.00	2,503,800
カゴメ	1,400	2,930.00	4,102,000
焼津水産化学工業	100	797.00	79,700
アリアケジャパン	300	5,360.00	1,608,000
エバラ食品工業	100	3,130.00	313,000
ニチレイ	1,400	2,593.00	3,630,200
東洋水産	1,500	5,790.00	8,685,000
イトアンドホールディングス	100	2,176.00	217,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	479.00	95,800
日清食品ホールディングス	1,000	9,890.00	9,890,000
永谷園ホールディングス	100	1,988.00	198,800
一正蒲鉾	100	735.00	73,500
フジッコ	300	1,903.00	570,900
ロック・フィールド	400	1,424.00	569,600
日本たばこ産業	19,300	2,796.00	53,962,800
ケンコーマヨネーズ	200	1,625.00	325,000
わらべや日洋ホールディングス	200	1,773.00	354,600
なとり	200	2,038.00	407,600
ファーマフーズ	500	1,234.00	617,000
ユーグレナ	1,900	888.00	1,687,200
紀文食品	200	893.00	178,600
ピクルスホールディングス	200	1,044.00	208,800
ミヨシ油脂	100	996.00	99,600
理研ビタミン	300	1,864.00	559,200
片倉工業	300	1,981.00	594,300
ゲンゼ	200	3,770.00	754,000
東洋紡	1,300	1,028.00	1,336,400
ユニチカ	1,000	274.00	274,000
富士紡ホールディングス	100	3,280.00	328,000
倉敷紡績	200	2,069.00	413,800
シキボウ	200	848.00	169,600
日本毛織	900	988.00	889,200
ダイトウボウ	700	84.00	58,800
トーア紡コーポレーション	200	346.00	69,200
ガイドーリミテッド	600	186.00	111,600
帝国繊維	300	1,565.00	469,500
帝人	2,900	1,229.00	3,564,100

東レ	20,000	723.90	14,478,000	
住江織物	100	1,815.00	181,500	
日本フェルト	200	395.00	79,000	
アツギ	200	370.00	74,000	
ダイニック	100	606.00	60,600	
セーレン	600	2,367.00	1,420,200	
ソトー	100	795.00	79,500	
小松マテーレ	400	796.00	318,400	
ワコールホールディングス	600	2,409.00	1,445,400	
ホギメディカル	400	3,255.00	1,302,000	
クラウディアホールディングス	100	289.00	28,900	
T S Iホールディングス	1,100	458.00	503,800	
マツオカコーポレーション	100	905.00	90,500	
ワールド	400	1,441.00	576,400	
三陽商会	100	1,211.00	121,100	
ナイガイ	100	258.00	25,800	
オンワードホールディングス	2,000	308.00	616,000	
ルックホールディングス	100	2,071.00	207,100	
ゴールドウイン	500	7,790.00	3,895,000	
デサント	500	3,515.00	1,757,500	
キング	200	435.00	87,000	
ヤマトインターナショナル	300	234.00	70,200	
特種東海製紙	200	2,928.00	585,600	
王子ホールディングス	12,400	514.00	6,373,600	
日本製紙	1,500	887.00	1,330,500	
三菱製紙	400	276.00	110,400	
北越コーポレーション	1,900	779.00	1,480,100	
中越パルプ工業	100	935.00	93,500	
巴川製紙所	100	795.00	79,500	
大王製紙	1,300	1,090.00	1,417,000	
阿波製紙	100	299.00	29,900	
レンゴー	2,700	863.00	2,330,100	
トーモク	200	1,564.00	312,800	
ザ・パック	200	2,354.00	470,800	
北の達人コーポレーション	1,300	279.00	362,700	
クラレ	4,700	1,020.00	4,794,000	
旭化成	18,600	962.60	17,904,360	
共和レザー	200	491.00	98,200	
昭和電工	2,900	2,175.00	6,307,500	
住友化学	22,200	472.00	10,478,400	
住友精化	100	3,015.00	301,500	
日産化学	1,400	6,520.00	9,128,000	

ラサ工業	100	2,272.00	227,200
クレハ	300	9,570.00	2,871,000
多木化学	100	5,030.00	503,000
テイカ	200	1,311.00	262,200
石原産業	500	1,040.00	520,000
片倉コープアグリ	100	1,223.00	122,300
日本曹達	300	4,240.00	1,272,000
東ソー	4,000	1,532.00	6,128,000
トクヤマ	1,000	1,750.00	1,750,000
セントラル硝子	500	3,455.00	1,727,500
東亜合成	1,500	1,149.00	1,723,500
大阪ソーダ	200	3,680.00	736,000
関東電化工業	600	973.00	583,800
デンカ	1,100	3,450.00	3,795,000
信越化学工業	5,100	15,780.00	80,478,000
日本カーバイド工業	100	1,323.00	132,300
堺化学工業	200	1,978.00	395,600
第一稀元素化学工業	300	1,258.00	377,400
エア・ウォーター	2,800	1,647.00	4,611,600
日本酸素ホールディングス	2,900	2,204.00	6,391,600
日本化学工業	100	1,862.00	186,200
東邦アセチレン	100	1,075.00	107,500
日本パーカライジング	1,500	955.00	1,432,500
高压ガス工業	400	633.00	253,200
四国化成工業	400	1,320.00	528,000
戸田工業	100	3,080.00	308,000
ステラ ケミファ	200	2,648.00	529,600
保土谷化学工業	100	2,836.00	283,600
日本触媒	500	5,280.00	2,640,000
大日精化工業	200	1,767.00	353,400
カネカ	700	3,705.00	2,593,500
三菱瓦斯化学	2,200	1,917.00	4,217,400
三井化学	2,500	2,779.00	6,947,500
J S R	2,800	2,723.00	7,624,400
東京応化工業	500	6,380.00	3,190,000
大阪有機化学工業	200	2,000.00	400,000
三菱ケミカルグループ	20,200	669.50	13,523,900
K Hネオケム	500	2,517.00	1,258,500
ダイセル	4,400	933.00	4,105,200
住友ベークライト	400	4,010.00	1,604,000
積水化学工業	6,200	1,878.00	11,643,600
日本ゼオン	1,800	1,302.00	2,343,600

アイカ工業	800	3,200.00	2,560,000
UBE	1,500	1,908.00	2,862,000
積水樹脂	400	1,662.00	664,800
タキロンシーアイ	600	507.00	304,200
旭有機材	200	2,575.00	515,000
ニチバン	200	1,705.00	341,000
リケンテクノス	600	490.00	294,000
大倉工業	100	1,874.00	187,400
積水化成成品工業	400	385.00	154,000
群栄化学工業	100	2,387.00	238,700
タイガースポリマー	100	393.00	39,300
ミライアル	100	1,583.00	158,300
ダイキアクシス	100	703.00	70,300
ダイキョーニシカワ	700	614.00	429,800
竹本容器	100	731.00	73,100
森六ホールディングス	200	1,703.00	340,600
恵和	100	3,575.00	357,500
日本化薬	2,300	1,161.00	2,670,300
カーリットホールディングス	300	665.00	199,500
日本精化	200	2,132.00	426,400
扶桑化学工業	300	3,260.00	978,000
トリケミカル研究所	400	2,164.00	865,600
ADEKA	1,000	2,216.00	2,216,000
日油	900	5,440.00	4,896,000
新日本理化	400	284.00	113,600
ハリマ化成グループ	200	821.00	164,200
花王	7,300	5,242.00	38,266,600
第一工業製薬	100	1,864.00	186,400
石原ケミカル	100	1,224.00	122,400
日華化学	100	865.00	86,500
ニイタカ	100	2,065.00	206,500
三洋化成工業	200	4,235.00	847,000
有機合成薬品工業	200	299.00	59,800
大日本塗料	400	733.00	293,200
日本ペイントホールディングス	13,200	997.00	13,160,400
関西ペイント	2,700	1,807.00	4,878,900
神東塗料	200	131.00	26,200
中国塗料	600	1,021.00	612,600
日本特殊塗料	200	860.00	172,000
藤倉化成	400	391.00	156,400
太陽ホールディングス	400	2,591.00	1,036,400
DIC	1,200	2,510.00	3,012,000

サカティンクス	700	1,039.00	727,300
東洋インキSCホールディングス	600	1,903.00	1,141,800
T&K TOKA	300	956.00	286,800
富士フィルムホールディングス	5,700	6,895.00	39,301,500
資生堂	6,200	5,102.00	31,632,400
ライオン	3,600	1,410.00	5,076,000
高砂香料工業	200	2,778.00	555,600
マンダム	700	1,378.00	964,600
ミルボン	400	6,090.00	2,436,000
ファンケル	1,300	2,577.00	3,350,100
コーセー	600	14,930.00	8,958,000
コタ	300	1,573.00	471,900
シーボン	100	1,590.00	159,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,500	1,650.00	2,475,000
ノエビアホールディングス	300	5,450.00	1,635,000
アジュバンホールディングス	100	910.00	91,000
新日本製薬	200	1,534.00	306,800
エステー	200	1,482.00	296,400
アグロ カネショウ	100	1,333.00	133,300
コニシ	500	1,762.00	881,000
長谷川香料	600	3,150.00	1,890,000
星光PMC	200	527.00	105,400
小林製薬	900	7,990.00	7,191,000
荒川化学工業	300	924.00	277,200
メック	200	2,378.00	475,600
日本高純度化学	100	2,310.00	231,000
タカラバイオ	800	1,738.00	1,390,400
JCU	300	2,810.00	843,000
新田ゼラチン	200	994.00	198,800
OATアグリオ	100	1,689.00	168,900
デクセリアルズ	900	3,155.00	2,839,500
アース製薬	300	5,330.00	1,599,000
北興化学工業	300	903.00	270,900
大成ラミック	100	2,978.00	297,800
クミアイ化学工業	1,200	965.00	1,158,000
日本農薬	600	864.00	518,400
アキレス	200	1,377.00	275,400
有沢製作所	500	1,218.00	609,000
日東電工	2,200	7,990.00	17,578,000
レック	400	831.00	332,400
三光合成	400	464.00	185,600
きもと	400	240.00	96,000

藤森工業	200	3,080.00	616,000
前澤化成工業	200	1,383.00	276,600
未来工業	100	1,473.00	147,300
ウェーブロックホールディングス	100	587.00	58,700
J S P	200	1,411.00	282,200
エフピコ	600	3,675.00	2,205,000
天馬	300	2,071.00	621,300
信越ポリマー	500	1,224.00	612,000
東リ	700	198.00	138,600
ニフコ	1,100	3,425.00	3,767,500
バルカー	300	2,674.00	802,200
ユニ・チャーム	6,200	4,456.00	27,627,200
ショーエイコーポレーション	100	563.00	56,300
協和キリン	3,600	3,220.00	11,592,000
武田薬品工業	26,500	3,866.00	102,449,000
アステラス製薬	28,700	2,060.50	59,136,350
住友ファーマ	2,200	1,015.00	2,233,000
塩野義製薬	3,800	6,600.00	25,080,000
わかもと製薬	300	218.00	65,400
日本新薬	700	7,930.00	5,551,000
中外製薬	9,400	3,370.00	31,678,000
科研製薬	500	3,695.00	1,847,500
エーザイ	3,600	8,692.00	31,291,200
ロート製薬	1,500	4,525.00	6,787,500
小野薬品工業	5,800	3,478.00	20,172,400
久光製薬	700	3,630.00	2,541,000
持田製薬	400	3,100.00	1,240,000
参天製薬	5,800	992.00	5,753,600
扶桑薬品工業	100	2,024.00	202,400
ツムラ	900	2,924.00	2,631,600
キッセイ薬品工業	500	2,539.00	1,269,500
生化学工業	600	903.00	541,800
栄研化学	500	1,858.00	929,000
鳥居薬品	200	2,905.00	581,000
J C R ファーマ	1,000	1,894.00	1,894,000
東和薬品	500	2,161.00	1,080,500
富士製薬工業	200	1,072.00	214,400
ゼリア新薬工業	400	2,192.00	876,800
第一三共	26,000	4,636.00	120,536,000
キョーリン製薬ホールディングス	600	1,770.00	1,062,000
大幸薬品	500	525.00	262,500
ダイト	200	2,494.00	498,800

大塚ホールディングス	6,800	4,548.00	30,926,400
大正製薬ホールディングス	700	5,260.00	3,682,000
ペプチドリーム	1,500	1,541.00	2,311,500
あすか製薬ホールディングス	300	1,147.00	344,100
サワイグループホールディングス	700	4,130.00	2,891,000
日本コークス工業	3,000	87.00	261,000
ニチレキ	400	1,287.00	514,800
ユシロ化学工業	200	794.00	158,800
ビーピー・カストロール	100	935.00	93,500
富士石油	700	305.00	213,500
MORESCO	100	1,038.00	103,800
出光興産	3,300	3,375.00	11,137,500
ENEOSホールディングス	54,100	504.20	27,277,220
コスモエネルギーホールディングス	1,100	3,845.00	4,229,500
横浜ゴム	1,700	2,305.00	3,918,500
TOYO TIRE	1,700	1,714.00	2,913,800
ブリヂストン	9,500	5,326.00	50,597,000
住友ゴム工業	2,900	1,258.00	3,648,200
藤倉コンポジット	200	806.00	161,200
オカモト	200	3,685.00	737,000
フコク	200	1,003.00	200,600
ニッタ	300	2,857.00	857,100
住友理工	600	613.00	367,800
三ツ星ベルト	400	3,245.00	1,298,000
バンドー化学	500	1,050.00	525,000
日東紡績	400	2,221.00	888,400
AGC	3,000	4,325.00	12,975,000
日本板硝子	1,500	554.00	831,000
日本山村硝子	100	575.00	57,500
日本電気硝子	1,200	2,454.00	2,944,800
オハラ	100	1,245.00	124,500
住友大阪セメント	400	3,105.00	1,242,000
太平洋セメント	1,900	2,026.00	3,849,400
日本ヒューム	300	616.00	184,800
日本コンクリート工業	600	236.00	141,600
三谷セキサン	100	3,680.00	368,000
アジアパイルホールディングス	500	493.00	246,500
東海カーボン	2,500	1,004.00	2,510,000
日本カーボン	200	4,230.00	846,000
東洋炭素	200	3,750.00	750,000
ノリタケカンパニーリミテド	100	4,060.00	406,000
TOTO	2,000	4,240.00	8,480,000

日本碍子	3,500	1,743.00	6,100,500
日本特殊陶業	2,300	2,708.00	6,228,400
ダントーホールディングス	200	246.00	49,200
MARUWA	100	17,660.00	1,766,000
品川リフラクトリーズ	100	3,960.00	396,000
黒崎播磨	100	4,735.00	473,500
ヨータイ	200	1,394.00	278,800
東京窯業	300	259.00	77,700
ニッカトー	100	457.00	45,700
フジミンコーポレーテッド	200	6,150.00	1,230,000
クニミネ工業	100	809.00	80,900
エーアンドエーマテリアル	100	848.00	84,800
ニチアス	800	2,212.00	1,769,600
ニチハ	400	2,754.00	1,101,600
日本製鉄	13,800	2,179.00	30,070,200
神戸製鋼所	6,200	642.00	3,980,400
中山製鋼所	500	666.00	333,000
合同製鐵	200	1,843.00	368,600
JFEホールディングス	8,200	1,480.00	12,136,000
東京製鐵	900	1,340.00	1,206,000
共英製鋼	400	1,316.00	526,400
大和工業	500	4,735.00	2,367,500
東京鐵鋼	100	1,403.00	140,300
大阪製鐵	100	1,093.00	109,300
淀川製鋼所	400	2,499.00	999,600
丸一鋼管	900	2,833.00	2,549,700
モリ工業	100	2,800.00	280,000
大同特殊鋼	400	4,305.00	1,722,000
日本高周波鋼業	100	315.00	31,500
日本冶金工業	200	3,695.00	739,000
山陽特殊製鋼	300	2,159.00	647,700
愛知製鋼	200	2,347.00	469,400
日立金属	2,900	2,172.00	6,298,800
日本金属	100	960.00	96,000
大太平洋金属	200	1,881.00	376,200
新日本電工	2,000	356.00	712,000
栗本鐵工所	100	1,747.00	174,700
三菱製鋼	200	952.00	190,400
日亜鋼業	300	232.00	69,600
エンビプロ・ホールディングス	200	776.00	155,200
シンニッタン	400	221.00	88,400
新家工業	100	2,066.00	206,600

大紀アルミニウム工業所	400	1,276.00	510,400
日本軽金属ホールディングス	800	1,498.00	1,198,400
三井金属鉱業	900	3,115.00	2,803,500
東邦亜鉛	200	2,171.00	434,200
三菱マテリアル	2,000	2,019.00	4,038,000
住友金属鉱山	3,600	4,482.00	16,135,200
DOWAホールディングス	700	4,805.00	3,363,500
古河機械金属	400	1,328.00	531,200
エス・サイエンス	1,600	27.00	43,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	500	4,460.00	2,230,000
東邦チタニウム	600	2,809.00	1,685,400
UACJ	400	2,212.00	884,800
CKサンエツ	100	4,125.00	412,500
古河電気工業	1,000	2,351.00	2,351,000
住友電気工業	10,600	1,585.50	16,806,300
フジクラ	3,300	901.00	2,973,300
昭和電線ホールディングス	300	1,646.00	493,800
東京特殊電線	100	2,202.00	220,200
タツタ電線	600	432.00	259,200
平河ビューテック	200	1,105.00	221,000
リョービ	300	1,306.00	391,800
アーレスティ	300	372.00	111,600
アサヒホールディングス	1,200	1,912.00	2,294,400
稲葉製作所	200	1,355.00	271,000
宮地エンジニアリンググループ	100	3,245.00	324,500
トーカロ	800	1,190.00	952,000
アルファC o	100	945.00	94,500
SUMCO	5,900	1,921.00	11,333,900
川田テクノロジーズ	100	3,545.00	354,500
RS Technologies	100	7,230.00	723,000
信和	200	799.00	159,800
東洋製罐グループホールディングス	2,000	1,533.00	3,066,000
ホッカンホールディングス	200	1,308.00	261,600
コロナ	200	845.00	169,000
横河ブリッジホールディングス	400	1,858.00	743,200
三和ホールディングス	2,800	1,226.00	3,432,800
文化シャッター	900	1,069.00	962,100
三協立山	400	546.00	218,400
アルインコ	200	968.00	193,600
東洋シャッター	100	492.00	49,200
LIXIL	4,500	1,943.00	8,743,500
日本フィルコン	200	454.00	90,800

ノーリツ	400	1,489.00	595,600
長府製作所	300	1,918.00	575,400
リンナイ	600	9,890.00	5,934,000
ダイニチ工業	200	663.00	132,600
日東精工	400	515.00	206,000
岡部	500	697.00	348,500
ジーテクト	300	1,489.00	446,700
東プレ	500	1,206.00	603,000
高周波熱錬	500	685.00	342,500
東京製網	200	891.00	178,200
サンコール	300	670.00	201,000
モリテック スチール	200	323.00	64,600
パイオラックス	400	1,884.00	753,600
エイチワン	300	605.00	181,500
日本発條	2,700	825.00	2,227,500
中央発條	200	695.00	139,000
立川ブラインド工業	100	1,079.00	107,900
三益半導体工業	300	2,282.00	684,600
日本ドライケミカル	100	1,497.00	149,700
日本製鋼所	800	3,165.00	2,532,000
三浦工業	1,200	3,065.00	3,678,000
タクマ	900	1,224.00	1,101,600
ツガミ	700	1,122.00	785,400
オークマ	300	5,020.00	1,506,000
芝浦機械	300	2,877.00	863,100
アマダ	4,800	1,052.00	5,049,600
アイダエンジニアリング	600	854.00	512,400
TAKISAWA	100	1,091.00	109,100
FUJI	1,300	1,991.00	2,588,300
牧野フライス製作所	300	4,545.00	1,363,500
オーエスジー	1,400	1,927.00	2,697,800
旭ダイヤモンド工業	900	766.00	689,400
DMG森精機	1,800	1,761.00	3,169,800
ソディック	800	769.00	615,200
ディスコ	500	35,750.00	17,875,000
日東工器	100	1,556.00	155,600
日進工具	300	1,124.00	337,200
パンチ工業	300	402.00	120,600
富士ダイス	100	575.00	57,500
豊和工業	200	886.00	177,200
ニデックオーケーケー	100	916.00	91,600
石川製作所	100	1,441.00	144,100

東洋機械金属	200	521.00	104,200
エンシュウ	100	734.00	73,400
島精機製作所	500	1,978.00	989,000
オプトラン	400	2,086.00	834,400
NCホールディングス	100	1,968.00	196,800
イワキポンプ	200	1,394.00	278,800
フリー	300	1,144.00	343,200
ヤマシンフィルタ	700	488.00	341,600
日阪製作所	300	830.00	249,000
やまびこ	500	1,154.00	577,000
野村マイクロ・サイエンス	100	3,760.00	376,000
平田機工	100	4,315.00	431,500
ペガサスマシン製造	300	897.00	269,100
マルマエ	100	1,781.00	178,100
タツモ	200	1,532.00	306,400
ナプテスコ	1,900	3,110.00	5,909,000
三井海洋開発	400	1,794.00	717,600
レオン自動機	300	1,167.00	350,100
S M C	1,000	60,990.00	60,990,000
ホソカワミクロン	200	2,705.00	541,000
ユニオンツール	100	3,550.00	355,000
オイレス工業	400	1,454.00	581,600
日精エー・エス・ビー機械	100	3,635.00	363,500
サトーホールディングス	400	1,852.00	740,800
技研製作所	300	3,090.00	927,000
日本エアータック	100	1,108.00	110,800
カワタ	100	846.00	84,600
日精樹脂工業	200	958.00	191,600
オカダアイヨン	100	1,455.00	145,500
ワイエイシイホールディングス	100	1,332.00	133,200
小松製作所	14,100	3,016.00	42,525,600
住友重機械工業	1,800	2,886.00	5,194,800
日立建機	1,200	2,974.00	3,568,800
日工	400	608.00	243,200
巴工業	100	2,383.00	238,300
井関農機	300	1,242.00	372,600
T O W A	300	1,751.00	525,300
丸山製作所	100	1,495.00	149,500
北川鉄工所	100	1,263.00	126,300
ローツェ	200	7,320.00	1,464,000
タカキタ	100	451.00	45,100
クボタ	15,900	2,096.50	33,334,350

荏原実業	100	2,281.00	228,100
三菱化工機	100	2,118.00	211,800
月島機械	400	991.00	396,400
帝国電機製作所	200	2,034.00	406,800
東京機械製作所	200	552.00	110,400
新東工業	600	682.00	409,200
澁谷工業	300	2,528.00	758,400
アイチ コーポレーション	400	789.00	315,600
小森コーポレーション	700	853.00	597,100
鶴見製作所	200	2,152.00	430,400
日本ギア工業	100	333.00	33,300
荏原製作所	1,200	4,980.00	5,976,000
西島製作所	300	1,293.00	387,900
北越工業	300	1,112.00	333,600
ダイキン工業	3,600	22,840.00	82,224,000
オルガノ	400	2,576.00	1,030,400
トーヨーカネツ	100	2,453.00	245,300
栗田工業	1,700	6,000.00	10,200,000
椿本チエイン	400	3,150.00	1,260,000
大同工業	100	747.00	74,700
木村化工機	200	718.00	143,600
アネスト岩田	500	883.00	441,500
ダイフク	1,600	6,900.00	11,040,000
サムコ	100	3,270.00	327,000
加藤製作所	200	738.00	147,600
タダノ	1,600	925.00	1,480,000
フジテック	1,100	3,040.00	3,344,000
C K D	800	1,850.00	1,480,000
キトー	300	2,720.00	816,000
平和	1,000	2,420.00	2,420,000
理想科学工業	300	2,331.00	699,300
S A N K Y O	600	4,915.00	2,949,000
日本金銭機械	300	716.00	214,800
マースグループホールディングス	200	1,865.00	373,000
フクシマガリレイ	200	3,900.00	780,000
オーイズミ	100	398.00	39,800
ダイコク電機	200	1,460.00	292,000
竹内製作所	500	3,045.00	1,522,500
アマノ	900	2,541.00	2,286,900
J U K I	500	661.00	330,500
サンデン	500	212.00	106,000
ジャノメ	300	634.00	190,200

マックス	400	2,039.00	815,600
グローリー	800	2,279.00	1,823,200
新晃工業	300	1,540.00	462,000
大和冷機工業	500	1,252.00	626,000
セガサミーホールディングス	2,400	2,007.00	4,816,800
日本ピストンリング	100	1,191.00	119,100
リケン	100	2,230.00	223,000
T P R	400	1,254.00	501,600
ツバキ・ナカシマ	700	1,216.00	851,200
ホシザキ	1,900	4,185.00	7,951,500
大豊工業	300	717.00	215,100
日本精工	5,500	776.00	4,268,000
N T N	5,800	289.00	1,676,200
ジェイテクト	2,700	1,023.00	2,762,100
不二越	200	3,990.00	798,000
日本トムソン	700	539.00	377,300
T H K	1,700	2,618.00	4,450,600
ユーシン精機	200	675.00	135,000
前澤給装工業	200	913.00	182,600
イーグル工業	300	1,122.00	336,600
前澤工業	200	614.00	122,800
日本ピラー工業	300	2,472.00	741,600
キッツ	1,100	904.00	994,400
マキタ	3,700	2,693.00	9,964,100
三井E & Sホールディングス	1,400	448.00	627,200
日立造船	2,500	871.00	2,177,500
三菱重工業	5,300	5,341.00	28,307,300
I H I	1,900	3,385.00	6,431,500
サノヤスホールディングス	400	122.00	48,800
スター精密	600	1,686.00	1,011,600
日清紡ホールディングス	2,400	1,021.00	2,450,400
イビデン	1,700	4,920.00	8,364,000
コニカミノルタ	6,700	532.00	3,564,400
ブラザー工業	4,000	2,505.00	10,020,000
ミネベアミツミ	5,200	2,184.00	11,356,800
日立製作所	15,100	7,049.00	106,439,900
東芝	5,800	5,118.00	29,684,400
三菱電機	31,100	1,315.50	40,912,050
富士電機	1,800	5,890.00	10,602,000
東洋電機製造	100	834.00	83,400
安川電機	3,600	4,200.00	15,120,000
シンフォニアテクノロジー	300	1,370.00	411,000

明電舎	500	1,995.00	997,500
オリジン	100	1,360.00	136,000
山洋電気	100	5,850.00	585,000
デンヨー	200	1,445.00	289,000
P H C ホールディングス	400	1,588.00	635,200
東芝テック	500	4,010.00	2,005,000
芝浦メカトロニクス	100	9,860.00	986,000
マブチモーター	700	4,095.00	2,866,500
日本電産	7,300	8,148.00	59,480,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	481.00	96,200
トレックス・セミコンダクター	100	2,959.00	295,900
東光高岳	200	1,792.00	358,400
ダブル・スコープ	1,000	1,823.00	1,823,000
ダイヘン	300	3,885.00	1,165,500
ヤーマン	600	1,101.00	660,600
J V C ケンウッド	2,800	330.00	924,000
ミマキエンジニアリング	300	724.00	217,200
I - P E X	200	1,318.00	263,600
日新電機	700	1,361.00	952,700
大崎電気工業	700	528.00	369,600
オムロン	2,800	6,791.00	19,014,800
日東工業	400	2,431.00	972,400
I D E C	400	3,005.00	1,202,000
正興電機製作所	100	983.00	98,300
不二電機工業	100	1,080.00	108,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000	2,342.00	2,342,000
サクサホールディングス	100	1,268.00	126,800
メルコホールディングス	100	2,996.00	299,600
テクノメディカ	100	1,574.00	157,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	100	1,165.00	116,500
日本電気	4,300	4,695.00	20,188,500
富士通	3,000	17,530.00	52,590,000
沖電気工業	1,400	729.00	1,020,600
岩崎通信機	100	795.00	79,500
電気興業	100	2,408.00	240,800
サンケン電気	300	5,360.00	1,608,000
ナカヨ	100	1,085.00	108,500
アイホン	200	1,835.00	367,000
ルネサスエレクトロニクス	19,600	1,262.00	24,735,200
セイコーエプソン	4,000	2,053.00	8,212,000
ワコム	2,400	611.00	1,466,400
アルバック	700	5,830.00	4,081,000

アクセル	100	1,316.00	131,600	
E I Z O	200	3,700.00	740,000	
日本信号	700	995.00	696,500	
京三製作所	600	401.00	240,600	
能美防災	400	1,565.00	626,000	
ホーチキ	200	1,352.00	270,400	
星和電機	100	424.00	42,400	
エレコム	700	1,386.00	970,200	
パナソニック ホールディングス	35,500	1,231.50	43,718,250	
シャープ	3,600	859.00	3,092,400	
アンリツ	2,100	1,459.00	3,063,900	
富士通ゼネラル	900	3,240.00	2,916,000	
ソニーグループ	21,100	10,845.00	228,829,500	代用有価証券 4,300株
T D K	4,800	4,845.00	23,256,000	
帝国通信工業	100	1,489.00	148,900	
タムラ製作所	1,300	749.00	973,700	
アルプスアルパイン	2,700	1,249.00	3,372,300	
池上通信機	100	535.00	53,500	
日本電波工業	400	1,668.00	667,200	
鈴木	200	873.00	174,600	
メイコー	300	2,634.00	790,200	
日本トリム	100	2,304.00	230,400	
ローランド ディー . ジー .	200	3,220.00	644,000	
フォスター電機	300	797.00	239,100	
S M K	100	2,620.00	262,000	
ヨコオ	200	2,055.00	411,000	
ティアック	300	114.00	34,200	
ホシデン	700	1,572.00	1,100,400	
ヒロセ電機	500	18,060.00	9,030,000	
日本航空電子工業	600	2,302.00	1,381,200	
T O A	300	754.00	226,200	
マクセル	600	1,353.00	811,800	
古野電気	400	1,035.00	414,000	
スミダコーポレーション	300	1,335.00	400,500	
アイコム	100	2,525.00	252,500	
リオン	100	1,874.00	187,400	
本多通信工業	100	702.00	70,200	
横河電機	3,300	2,510.00	8,283,000	
新電元工業	100	3,415.00	341,500	
アズビル	2,100	4,045.00	8,494,500	
東亜ディーケーケー	100	868.00	86,800	
日本光電工業	1,400	3,315.00	4,641,000	

チノー	100	1,763.00	176,300
共和電業	300	330.00	99,000
日本電子材料	200	1,436.00	287,200
堀場製作所	700	6,110.00	4,277,000
アドバンテスト	2,300	7,770.00	17,871,000
小野測器	100	373.00	37,300
エスベック	200	1,873.00	374,600
キーエンス	3,000	56,970.00	170,910,000
日置電機	200	6,820.00	1,364,000
シスメックス	2,600	7,868.00	20,456,800
日本マイクロニクス	500	1,397.00	698,500
メガチップス	200	2,584.00	516,800
O B A R A G R O U P	100	3,395.00	339,500
原田工業	100	777.00	77,700
コーセル	400	829.00	331,600
イリソ電子工業	300	4,740.00	1,422,000
オブテックスグループ	600	2,045.00	1,227,000
千代田インテグレ	100	2,294.00	229,400
レーザーテック	1,500	21,540.00	32,310,000
スタンレー電気	2,100	2,668.00	5,602,800
岩崎電気	100	2,555.00	255,500
ウシオ電機	1,600	1,639.00	2,622,400
岡谷電機産業	200	272.00	54,400
ヘリオス テクノ ホールディング	300	499.00	149,700
エノモト	100	1,681.00	168,100
日本セラミック	300	2,565.00	769,500
遠藤照明	100	741.00	74,100
古河電池	200	1,035.00	207,000
双信電機	100	408.00	40,800
山一電機	300	1,836.00	550,800
図研	300	3,200.00	960,000
日本電子	700	5,410.00	3,787,000
カシオ計算機	2,200	1,320.00	2,904,000
ファナック	2,900	19,925.00	57,782,500
日本シイエムケイ	600	534.00	320,400
エンプラス	100	4,405.00	440,500
大真空	400	938.00	375,200
ローム	1,400	10,460.00	14,644,000
浜松ホトニクス	2,400	6,640.00	15,936,000
三井ハイテック	300	7,500.00	2,250,000
新光電気工業	1,100	3,685.00	4,053,500
京セラ	4,600	6,732.00	30,967,200

太陽誘電	1,400	3,995.00	5,593,000
村田製作所	9,000	7,129.00	64,161,000
双葉電子工業	600	597.00	358,200
北陸電気工業	100	1,060.00	106,000
ニチコン	600	1,457.00	874,200
日本ケミコン	300	2,053.00	615,900
K O A	500	2,177.00	1,088,500
市光工業	400	412.00	164,800
小糸製作所	3,600	2,032.00	7,315,200
ミツバ	500	419.00	209,500
S C R E E Nホールディングス	500	8,040.00	4,020,000
キャノン電子	300	1,564.00	469,200
キャノン	16,400	3,182.00	52,184,800
リコー	7,800	1,035.00	8,073,000
象印マホービン	900	1,506.00	1,355,400
東京エレクトロン	2,100	39,390.00	82,719,000
イノテック	200	1,239.00	247,800
トヨタ紡織	1,300	1,955.00	2,541,500
芦森工業	100	1,040.00	104,000
ユニプレス	600	895.00	537,000
豊田自動織機	2,200	7,650.00	16,830,000
モリタホールディングス	500	1,224.00	612,000
三櫻工業	500	681.00	340,500
デンソー	6,100	7,415.00	45,231,500
東海理化電機製作所	800	1,584.00	1,267,200
川崎重工業	2,200	2,611.00	5,744,200
名村造船所	800	557.00	445,600
日本車輛製造	100	1,931.00	193,100
三菱ロジスネクスト	500	857.00	428,500
近畿車輛	100	966.00	96,600
日産自動車	42,400	488.50	20,712,400
いすゞ自動車	8,700	1,775.00	15,442,500
トヨタ自動車	163,700	1,993.00	326,254,100
日野自動車	3,900	628.00	2,449,200
三菱自動車工業	11,600	640.00	7,424,000
エフテック	200	520.00	104,000
レシップホールディングス	100	474.00	47,400
G M B	100	744.00	74,400
ファルテック	100	615.00	61,500
武蔵精密工業	700	1,689.00	1,182,300
日産車体	500	865.00	432,500
新明和工業	1,000	1,028.00	1,028,000

極東開発工業	500	1,373.00	686,500	
トピー工業	300	1,686.00	505,800	
ティラド	100	2,757.00	275,700	
タチエス	500	1,109.00	554,500	
N O K	1,200	1,236.00	1,483,200	
フタバ産業	800	377.00	301,600	
K Y B	300	3,460.00	1,038,000	
大同メタル工業	600	512.00	307,200	
プレス工業	1,400	421.00	589,400	
ミクニ	400	321.00	128,400	
太平洋工業	700	1,051.00	735,700	
河西工業	500	191.00	95,500	
アイシン	2,300	3,830.00	8,809,000	
マツダ	9,900	1,043.00	10,325,700	
今仙電機製作所	200	552.00	110,400	
本田技研工業	24,200	3,402.00	82,328,400	代用有価証券 4,700株
スズキ	5,500	5,041.00	27,725,500	
S U B A R U	9,400	2,510.00	23,594,000	
安永	200	706.00	141,200	
ヤマハ発動機	4,700	3,160.00	14,852,000	
T B K	300	280.00	84,000	
エクセディ	500	1,715.00	857,500	
豊田合成	900	2,364.00	2,127,600	
愛三工業	500	724.00	362,000	
盟和産業	100	935.00	93,500	
日本プラスト	300	428.00	128,400	
ヨロズ	300	895.00	268,500	
エフ・シー・シー	500	1,440.00	720,000	
シマノ	1,200	22,990.00	27,588,000	
テイ・エス テック	1,400	1,574.00	2,203,600	
ジャムコ	200	1,762.00	352,400	
テルモ	9,300	4,330.00	40,269,000	
クリエートメディック	100	870.00	87,000	
日機装	700	1,015.00	710,500	
日本エム・ディ・エム	200	1,009.00	201,800	
島津製作所	3,600	3,865.00	13,914,000	
J M S	200	501.00	100,200	
長野計器	200	1,061.00	212,200	
ブイ・テクノロジー	100	2,737.00	273,700	
東京計器	200	1,288.00	257,600	
愛知時計電機	100	1,344.00	134,400	
インターアクション	200	1,353.00	270,600	

オーバル	200	445.00	89,000
東京精密	700	4,240.00	2,968,000
マニー	1,300	2,055.00	2,671,500
ニコン	4,600	1,471.00	6,766,600
トプコン	1,600	1,604.00	2,566,400
オリンパス	18,700	3,063.00	57,278,100
理研計器	200	4,075.00	815,000
タムロン	200	3,040.00	608,000
H O Y A	6,400	13,475.00	86,240,000
シード	100	502.00	50,200
ノーリツ鋼機	300	2,677.00	803,100
A & D ホロンホールディングス	400	886.00	354,400
朝日インテック	4,000	2,422.00	9,688,000
シチズン時計	3,300	630.00	2,079,000
リズム	100	1,650.00	165,000
大研医器	200	457.00	91,400
メニコン	1,000	2,322.00	2,322,000
松風	100	2,308.00	230,800
セイコーグループ	500	3,260.00	1,630,000
ニプロ	2,500	1,087.00	2,717,500
K Y O R I T S U	600	121.00	72,600
中本パックス	100	1,492.00	149,200
スノーピーク	500	1,870.00	935,000
パラマウントベッドホールディングス	700	2,494.00	1,745,800
トランザクション	200	1,090.00	218,000
粧美堂	100	384.00	38,400
ニホンフラッシュ	300	948.00	284,400
前田工織	300	2,900.00	870,000
永大産業	400	214.00	85,600
アートネイチャー	300	765.00	229,500
バンダイナムコホールディングス	2,700	9,708.00	26,211,600
アイフィスジャパン	100	598.00	59,800
S H O E I	300	5,450.00	1,635,000
フランスベッドホールディングス	400	913.00	365,200
パイロットコーポレーション	500	5,770.00	2,885,000
萩原工業	200	1,010.00	202,000
フジシールインターナショナル	600	1,812.00	1,087,200
タカラトミー	1,400	1,253.00	1,754,200
広済堂ホールディングス	200	1,433.00	286,600
エステールホールディングス	100	614.00	61,400
タカノ	100	624.00	62,400
プロネクサス	300	939.00	281,700

ホクシン	300	144.00	43,200
ウッドワン	100	910.00	91,000
大建工業	200	1,995.00	399,000
凸版印刷	3,900	2,134.00	8,322,600
大日本印刷	3,500	2,894.00	10,129,000
共同印刷	100	2,502.00	250,200
N I S S H A	600	1,751.00	1,050,600
T A K A R A & C O M P A N Y	200	2,116.00	423,200
アシックス	2,800	2,389.00	6,689,200
ツツミ	100	1,955.00	195,500
ローランド	200	4,095.00	819,000
小松ウオール工業	100	1,808.00	180,800
ヤマハ	1,900	5,390.00	10,241,000
河合楽器製作所	100	2,648.00	264,800
クリナップ	400	602.00	240,800
ピジョン	1,900	1,899.00	3,608,100
キングジム	300	885.00	265,500
リンテック	600	2,206.00	1,323,600
イトーキ	600	431.00	258,600
任天堂	18,800	6,121.00	115,074,800
三菱鉛筆	400	1,415.00	566,000
タカラスタンダード	600	1,241.00	744,600
コクヨ	1,400	1,864.00	2,609,600
ナカバヤシ	400	517.00	206,800
グローブライド	200	2,356.00	471,200
オカムラ	900	1,456.00	1,310,400
美津濃	300	2,626.00	787,800
東京電力ホールディングス	26,900	453.00	12,185,700
中部電力	11,000	1,217.00	13,387,000
関西電力	11,500	1,110.00	12,765,000
中国電力	4,800	695.00	3,336,000
北陸電力	2,800	480.00	1,344,000
東北電力	7,300	601.00	4,387,300
四国電力	2,500	716.00	1,790,000
九州電力	6,900	717.00	4,947,300
北海道電力	2,900	440.00	1,276,000
沖縄電力	700	1,003.00	702,100
電源開発	2,200	2,108.00	4,637,600
エフオン	200	630.00	126,000
イーレックス	500	2,436.00	1,218,000
レノバ	800	3,200.00	2,560,000
東京瓦斯	6,300	2,549.00	16,058,700

大阪瓦斯	6,000	2,061.00	12,366,000
東邦瓦斯	1,200	2,625.00	3,150,000
北海道瓦斯	200	1,642.00	328,400
広島ガス	600	335.00	201,000
西部ガスホールディングス	300	1,634.00	490,200
静岡ガス	700	1,067.00	746,900
メタウォーター	400	1,889.00	755,600
SBSホールディングス	300	2,901.00	870,300
東武鉄道	3,300	3,285.00	10,840,500
相鉄ホールディングス	1,000	2,110.00	2,110,000
東急	8,300	1,681.00	13,952,300
京浜急行電鉄	3,400	1,496.00	5,086,400
小田急電鉄	4,500	1,689.00	7,600,500
京王電鉄	1,600	4,970.00	7,952,000
京成電鉄	1,900	3,870.00	7,353,000
富士急行	400	4,865.00	1,946,000
東日本旅客鉄道	5,100	7,947.00	40,529,700
西日本旅客鉄道	3,800	5,854.00	22,245,200
東海旅客鉄道	2,300	17,005.00	39,111,500
西武ホールディングス	3,600	1,321.00	4,755,600
鴻池運輸	500	1,531.00	765,500
西日本鉄道	800	2,787.00	2,229,600
ハマキョウレックス	200	3,265.00	653,000
サカイ引越センター	100	4,565.00	456,500
近鉄グループホールディングス	3,000	4,880.00	14,640,000
阪急阪神ホールディングス	4,000	4,215.00	16,860,000
南海電気鉄道	1,400	2,946.00	4,124,400
京阪ホールディングス	1,200	3,740.00	4,488,000
神戸電鉄	100	3,195.00	319,500
名古屋鉄道	3,300	2,236.00	7,378,800
山陽電気鉄道	200	2,207.00	441,400
アルプス物流	200	1,110.00	222,000
ヤマトホールディングス	3,800	2,225.00	8,455,000
山九	800	4,780.00	3,824,000
丸全昭和運輸	200	2,991.00	598,200
センコーグループホールディングス	1,500	989.00	1,483,500
トナミホールディングス	100	3,565.00	356,500
ニッコンホールディングス	900	2,343.00	2,108,700
福山通運	200	3,070.00	614,000
セイノーホールディングス	1,800	1,130.00	2,034,000
エスライン	100	760.00	76,000
神奈川中央交通	100	3,280.00	328,000

日立物流	700	8,900.00	6,230,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	700	1,469.00	1,028,300
C & F ロジホールディングス	300	1,172.00	351,600
九州旅客鉄道	2,100	2,952.00	6,199,200
S Gホールディングス	5,700	1,942.00	11,069,400
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	1,100	7,470.00	8,217,000
日本郵船	8,000	2,604.00	20,832,000
商船三井	5,200	2,948.00	15,329,600
川崎汽船	2,500	2,332.00	5,830,000
N Sユナイテッド海運	200	3,670.00	734,000
飯野海運	1,100	827.00	909,700
乾汽船	400	1,869.00	747,600
日本航空	7,300	2,830.00	20,659,000
A N Aホールディングス	8,100	2,978.00	24,121,800
パスコ	100	1,289.00	128,900
トランコム	100	7,430.00	743,000
日新	200	1,982.00	396,400
三菱倉庫	600	3,340.00	2,004,000
三井倉庫ホールディングス	300	3,555.00	1,066,500
住友倉庫	800	2,070.00	1,656,000
澁澤倉庫	100	2,061.00	206,100
東陽倉庫	400	252.00	100,800
日本トランスシティ	600	484.00	290,400
ケイヒン	100	1,471.00	147,100
中央倉庫	100	922.00	92,200
川西倉庫	100	1,000.00	100,000
安田倉庫	200	918.00	183,600
ファイズホールディングス	100	942.00	94,200
東洋埠頭	100	1,217.00	121,700
上組	1,500	2,818.00	4,227,000
サンリツ	100	702.00	70,200
キムラユニティー	100	790.00	79,000
キューソー流通システム	200	1,054.00	210,800
東海運	200	273.00	54,600
エーアイティー	200	1,461.00	292,200
内外トランスライン	100	2,038.00	203,800
日本コンセプト	100	1,784.00	178,400
N E C ネットズエスアイ	1,000	1,566.00	1,566,000
クロスキャット	200	1,338.00	267,600
システナ	5,000	403.00	2,015,000
デジタルアーツ	200	5,890.00	1,178,000
日鉄ソリューションズ	500	3,450.00	1,725,000

キューブシステム	200	985.00	197,000
コア	100	1,452.00	145,200
手間いらず	100	5,390.00	539,000
ラクーンホールディングス	300	1,218.00	365,400
ソリトンシステムズ	200	1,021.00	204,200
ソフトクリエイティブホールディングス	100	3,310.00	331,000
T I S	3,400	3,960.00	13,464,000
J N Sホールディングス	100	343.00	34,300
グリー	1,600	776.00	1,241,600
コーエーテクモホールディングス	1,900	2,278.00	4,328,200
三菱総合研究所	100	4,730.00	473,000
ボルテージ	100	336.00	33,600
A G S	100	605.00	60,500
ファインデックス	200	599.00	119,800
ブレインパッド	300	847.00	254,100
K L a b	600	467.00	280,200
ポルトトゥウィンホールディングス	500	914.00	457,000
ネクソン	7,700	2,416.00	18,603,200
アイスタイル	1,000	559.00	559,000
エムアップホールディングス	400	1,424.00	569,600
エイチーム	200	746.00	149,200
エニグモ	400	537.00	214,800
テクノスジャパン	300	468.00	140,400
e n i s h	200	476.00	95,200
コロプラ	1,100	697.00	766,700
ブロードリーフ	1,800	541.00	973,800
クロス・マーケティンググループ	100	860.00	86,000
デジタルハーツホールディングス	200	1,956.00	391,200
システム情報	300	963.00	288,900
メディアドゥ	100	2,002.00	200,200
じげん	900	351.00	315,900
ブイキューブ	300	781.00	234,300
エンカレッジ・テクノロジー	100	514.00	51,400
サイバーリンクス	100	1,298.00	129,800
フィックスターズ	300	1,116.00	334,800
C A R T A H O L D I N G S	100	1,683.00	168,300
オブティム	200	893.00	178,600
セレス	100	990.00	99,000
S H I F T	200	22,300.00	4,460,000
ティーガイア	300	1,639.00	491,700
テクマトリックス	600	1,641.00	984,600
プロシップ	100	1,533.00	153,300

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	900	2,198.00	1,978,200
GMOペイメントゲートウェイ	700	10,500.00	7,350,000
ザッパラス	100	368.00	36,800
システムリサーチ	100	1,972.00	197,200
インターネットイニシアティブ	1,700	2,294.00	3,899,800
さくらインターネット	300	520.00	156,000
ヴィンクス	100	1,485.00	148,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	100	4,485.00	448,500
SRAホールディングス	200	3,270.00	654,000
システムインテグレータ	100	447.00	44,700
朝日ネット	300	579.00	173,700
eBASE	400	566.00	226,400
アバントグループ	400	1,354.00	541,600
アドソル日進	100	1,424.00	142,400
ODKソリューションズ	100	590.00	59,000
フリービット	200	1,071.00	214,200
コムチュア	400	2,524.00	1,009,600
アステリア	200	781.00	156,200
アイル	200	1,820.00	364,000
マークライنز	200	2,526.00	505,200
メディカル・データ・ビジョン	400	1,009.00	403,600
gumi	500	920.00	460,000
ショーケース	100	354.00	35,400
モバイルファクトリー	100	985.00	98,500
テラスカイ	100	2,411.00	241,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	200	1,676.00	335,200
PCIホールディングス	100	1,018.00	101,800
ネオジャパン	100	1,016.00	101,600
PR TIMES	100	2,311.00	231,100
ラクス	1,400	1,636.00	2,290,400
ランドコンピュータ	100	828.00	82,800
ダブルスタンダード	100	2,540.00	254,000
オープンドア	200	1,918.00	383,600
マイネット	100	458.00	45,800
アカツキ	100	2,173.00	217,300
Ubicomホールディングス	100	2,129.00	212,900
カナミックネットワーク	400	599.00	239,600
ノムラシステムコーポレーション	200	122.00	24,400
チェンジ	700	1,851.00	1,295,700
シンクロ・フード	200	483.00	96,600
オークネット	200	2,151.00	430,200
マクロミル	700	1,118.00	782,600

ビーグリー	100	1,383.00	138,300
オロ	100	1,568.00	156,800
ユーザーローカル	100	1,527.00	152,700
ニーズウェル	100	671.00	67,100
マネーフォワード	700	4,320.00	3,024,000
サインポスト	100	704.00	70,400
電算システムホールディングス	100	2,332.00	233,200
ソルクシーズ	200	359.00	71,800
フェイス	100	547.00	54,700
プロトコーポレーション	400	1,164.00	465,600
ハイマックス	100	1,453.00	145,300
野村総合研究所	6,100	3,120.00	19,032,000
サイバネットシステム	200	974.00	194,800
C Eホールディングス	200	496.00	99,200
日本システム技術	100	1,473.00	147,300
インテージホールディングス	400	1,620.00	648,000
東邦システムサイエンス	100	1,010.00	101,000
ソースネクスト	1,500	299.00	448,500
インフォコム	400	1,994.00	797,600
シンプレクス・ホールディングス	500	2,138.00	1,069,000
HEROZ	100	1,082.00	108,200
ラクスル	400	2,866.00	1,146,400
メルカリ	1,300	2,746.00	3,569,800
I P S	100	2,939.00	293,900
F I G	300	400.00	120,000
システムサポート	100	1,424.00	142,400
イーソル	200	632.00	126,400
アルテリア・ネットワークス	300	1,198.00	359,400
ウイングアーク1st	300	2,229.00	668,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,654.00	165,400
サーバーワークス	100	2,518.00	251,800
トビラシステムズ	100	984.00	98,400
S a n s a n	1,100	1,389.00	1,527,900
L i n k - U	100	837.00	83,700
ギフトィ	300	2,243.00	672,900
ベース	100	4,025.00	402,500
J M D C	500	5,090.00	2,545,000
フォーカスシステムズ	200	1,004.00	200,800
クレスコ	200	1,650.00	330,000
フジ・メディア・ホールディングス	2,900	1,014.00	2,940,600
オービック	1,000	21,100.00	21,100,000
ジャストシステム	400	3,025.00	1,210,000

TDCソフト	300	1,248.00	374,400
Zホールディングス	42,500	345.40	14,679,500
トレンドマイクロ	1,700	7,160.00	12,172,000
IDホールディングス	200	904.00	180,800
日本オラクル	600	7,740.00	4,644,000
アルファシステムズ	100	4,090.00	409,000
フューチャー	700	1,568.00	1,097,600
CAC Holdings	200	1,485.00	297,000
SBテクノロジー	100	2,031.00	203,100
トーセ	100	772.00	77,200
オービックビジネスコンサルタント	600	3,910.00	2,346,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	3,185.00	5,096,000
アイティフォー	400	769.00	307,600
大塚商会	1,700	4,505.00	7,658,500
サイボウズ	400	1,923.00	769,200
電通国際情報サービス	400	4,510.00	1,804,000
ACCESS	300	788.00	236,400
デジタルガレージ	500	3,620.00	1,810,000
EMシステムズ	500	936.00	468,000
ウェザーニューズ	100	7,520.00	752,000
CIJ	300	798.00	239,400
ビジネスエンジニアリング	100	1,990.00	199,000
日本エンタープライズ	300	141.00	42,300
WOWOW	200	1,204.00	240,800
スカラ	300	732.00	219,600
インテリジェント ウェイブ	200	758.00	151,600
WOW WORLD GROUP	100	977.00	97,700
IMAGICA GROUP	200	846.00	169,200
ネットワンシステムズ	1,100	3,300.00	3,630,000
システムソフト	1,100	98.00	107,800
アルゴグラフィックス	300	3,630.00	1,089,000
マーベラス	500	695.00	347,500
エイベックス	500	1,635.00	817,500
BIPROGY	1,100	3,140.00	3,454,000
兼松エレクトロニクス	200	4,360.00	872,000
都築電気	100	1,335.00	133,500
TBSホールディングス	1,500	1,522.00	2,283,000
日本テレビホールディングス	2,600	1,047.00	2,722,200
朝日放送グループホールディングス	300	618.00	185,400
テレビ朝日ホールディングス	700	1,334.00	933,800
スカパーJ SATホールディングス	2,600	512.00	1,331,200
テレビ東京ホールディングス	200	1,820.00	364,000

日本BS放送	100	896.00	89,600
ビジョン	400	1,246.00	498,400
スマートバリュー	100	465.00	46,500
USEN-NEXT HOLDINGS	300	2,185.00	655,500
コネクシオ	200	1,089.00	217,800
日本通信	2,800	221.00	618,800
日本電信電話	38,300	4,004.00	153,353,200
KDDI	23,100	4,255.00	98,290,500
ソフトバンク	48,000	1,495.00	71,760,000
光通信	400	18,190.00	7,276,000
エムティーアイ	300	511.00	153,300
GMOインターネットグループ	1,100	2,556.00	2,811,600
ファイバーゲート	100	888.00	88,800
アйдママーケティングコミュニケーション	100	278.00	27,800
KADOKAWA	1,600	2,459.00	3,934,400
学研ホールディングス	500	961.00	480,500
ゼンリン	500	858.00	429,000
昭文社ホールディングス	100	296.00	29,600
インプレスホールディングス	300	209.00	62,700
アイネット	200	1,325.00	265,000
松竹	200	11,660.00	2,332,000
東宝	1,900	5,150.00	9,785,000
東映	100	17,790.00	1,779,000
エヌ・ティ・ティ・データ	9,400	2,087.00	19,617,800
ピー・シー・エー	200	1,127.00	225,400
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,777.00	177,700
DTS	700	3,485.00	2,439,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,500	6,720.00	10,080,000
シーイーシー	400	1,497.00	598,800
カブコン	3,000	4,225.00	12,675,000
アイ・エス・ビー	200	1,327.00	265,400
ジャステック	200	1,279.00	255,800
SCSK	2,400	2,157.00	5,176,800
NSW	100	2,139.00	213,900
アイネス	200	1,475.00	295,000
TKC	500	3,660.00	1,830,000
富士ソフト	300	8,030.00	2,409,000
NSD	1,100	2,553.00	2,808,300
コナミグループ	1,300	6,770.00	8,801,000
福井コンピュータホールディングス	200	3,255.00	651,000
JBCホールディングス	200	1,834.00	366,800
ミロク情報サービス	300	1,373.00	411,900

ソフトバンクグループ	17,300	6,601.00	114,197,300
高千穂交易	100	2,098.00	209,800
オルパヘルスケアホールディングス	100	1,438.00	143,800
伊藤忠食品	100	5,080.00	508,000
エレマテック	300	1,515.00	454,500
あらた	200	3,990.00	798,000
東京エレクトロン デバイス	100	6,750.00	675,000
円谷フィールズホールディングス	300	2,154.00	646,200
双日	3,400	2,414.00	8,207,600
アルフレッサ ホールディングス	3,200	1,603.00	5,129,600
横浜冷凍	900	905.00	814,500
神栄	100	787.00	78,700
ラサ商事	200	999.00	199,800
アルコニックス	400	1,414.00	565,600
神戸物産	2,400	3,130.00	7,512,000
ハイパー	100	461.00	46,100
あい ホールディングス	500	2,225.00	1,112,500
ディーブイエックス	100	971.00	97,100
ダイワボウホールディングス	1,300	1,920.00	2,496,000
マクニカホールディングス	800	3,415.00	2,732,000
ラクト・ジャパン	100	2,053.00	205,300
グリムス	100	1,750.00	175,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	500	759.00	379,500
八洲電機	300	997.00	299,100
メディアスホールディングス	200	697.00	139,400
レスターホールディングス	300	2,103.00	630,900
ジューテックホールディングス	100	1,048.00	104,800
大光	200	682.00	136,400
OCHIホールディングス	100	1,189.00	118,900
TOKAIホールディングス	1,500	891.00	1,336,500
黒谷	100	562.00	56,200
Cominix	100	729.00	72,900
三洋貿易	300	1,042.00	312,600
ビューティガレージ	100	2,624.00	262,400
ウイン・パートナーズ	200	959.00	191,800
ミタチ産業	100	960.00	96,000
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,753.00	3,028,300
明治電機工業	100	1,021.00	102,100
デリカフーズホールディングス	200	506.00	101,200
スターティアホールディングス	100	1,232.00	123,200
コメダホールディングス	800	2,450.00	1,960,000
ピーバンドットコム	100	513.00	51,300

アセンテック	100	508.00	50,800
富士興産	100	1,150.00	115,000
フルサト・マルカホールディングス	300	3,635.00	1,090,500
ヤマエグループホールディングス	200	1,480.00	296,000
小野建	300	1,471.00	441,300
南陽	100	1,808.00	180,800
佐島電機	200	1,301.00	260,200
エコートレーディング	100	535.00	53,500
伯東	200	3,470.00	694,000
コンドーテック	300	980.00	294,000
中山福	200	319.00	63,800
ナガイレーベン	400	1,980.00	792,000
三菱食品	300	3,130.00	939,000
松田産業	200	2,321.00	464,200
第一興商	600	4,200.00	2,520,000
メディバルホールディングス	3,300	1,769.00	5,837,700
S P K	100	1,411.00	141,100
萩原電気ホールディングス	100	2,281.00	228,100
アズワン	500	5,970.00	2,985,000
スズデン	100	2,391.00	239,100
尾家産業	100	840.00	84,000
シモジマ	200	1,017.00	203,400
ドウシシャ	300	1,506.00	451,800
小津産業	100	1,438.00	143,800
高速	200	1,626.00	325,200
たけびし	100	1,547.00	154,700
リックス	100	2,139.00	213,900
丸文	300	860.00	258,000
ハピネット	300	1,985.00	595,500
橋本総業ホールディングス	100	974.00	97,400
日本ライフライン	900	953.00	857,700
タカショー	300	666.00	199,800
I D O M	900	731.00	657,900
進和	200	1,891.00	378,200
エスケイジャパン	100	486.00	48,600
ダイترون	100	2,305.00	230,500
シークス	500	1,147.00	573,500
田中商事	100	528.00	52,800
オーハシテクニカ	200	1,425.00	285,000
白銅	100	2,475.00	247,500
伊藤忠商事	19,100	4,101.00	78,329,100
丸紅	24,900	1,425.50	35,494,950

高島	100	2,643.00	264,300
長瀬産業	1,500	1,967.00	2,950,500
蝶理	200	1,982.00	396,400
豊田通商	2,800	5,110.00	14,308,000
三共生興	500	471.00	235,500
兼松	1,200	1,490.00	1,788,000
ツカモトコーポレーション	100	1,197.00	119,700
三井物産	23,100	3,628.00	83,806,800
日本紙パルプ商事	200	4,740.00	948,000
カメイ	300	1,106.00	331,800
OUGホールディングス	100	2,373.00	237,300
スターゼン	200	2,044.00	408,800
山善	800	962.00	769,600
椿本興業	100	3,790.00	379,000
住友商事	19,500	2,177.00	42,451,500
内田洋行	100	4,600.00	460,000
三菱商事	19,700	4,403.00	86,739,100
第一実業	100	4,160.00	416,000
キャノンマーケティングジャパン	700	3,110.00	2,177,000
西華産業	100	1,634.00	163,400
佐藤商事	200	1,161.00	232,200
菱洋エレクトロ	300	2,260.00	678,000
東京産業	300	770.00	231,000
ユアサ商事	300	3,865.00	1,159,500
神鋼商事	100	4,275.00	427,500
トルク	200	214.00	42,800
阪和興業	600	3,795.00	2,277,000
正栄食品工業	200	4,150.00	830,000
カナデン	300	1,077.00	323,100
菱電商事	300	1,693.00	507,900
岩谷産業	700	5,490.00	3,843,000
ナイス	100	1,390.00	139,000
極東貿易	200	1,296.00	259,200
アステナホールディングス	600	411.00	246,600
三愛オブリ	900	1,230.00	1,107,000
稲畑産業	600	2,401.00	1,440,600
G S I クレオス	200	1,407.00	281,400
明和産業	400	706.00	282,400
クワザワホールディングス	100	401.00	40,100
ワキタ	600	1,178.00	706,800
東邦ホールディングス	800	1,973.00	1,578,400
サンゲツ	800	1,909.00	1,527,200

ミツウロコグループホールディングス	400	1,019.00	407,600
シナネンホールディングス	100	3,965.00	396,500
伊藤忠エネクス	800	1,012.00	809,600
サンリオ	900	4,460.00	4,014,000
サンワテクノス	200	1,488.00	297,600
リョーサン	300	2,788.00	836,400
新光商事	400	1,042.00	416,800
トーホー	100	1,663.00	166,300
三信電気	100	1,979.00	197,900
東陽テクニカ	400	1,291.00	516,400
モスフードサービス	500	3,095.00	1,547,500
加賀電子	300	4,465.00	1,339,500
ソーダニッカ	300	625.00	187,500
立花エレテック	200	1,659.00	331,800
フォーバル	100	938.00	93,800
PALTAC	500	4,100.00	2,050,000
三谷産業	600	298.00	178,800
太平洋興発	100	709.00	70,900
西本Wismettacホールディングス	100	4,050.00	405,000
コア商事ホールディングス	200	600.00	120,000
KPPグループホールディングス	800	816.00	652,800
ヤマタネ	100	1,638.00	163,800
日鉄物産	200	5,350.00	1,070,000
泉州電業	200	2,767.00	553,400
トラスコ中山	700	1,933.00	1,353,100
オートバックスセブン	1,100	1,406.00	1,546,600
モリト	200	750.00	150,000
加藤産業	400	3,490.00	1,396,000
北恵	100	750.00	75,000
イエローハット	600	1,732.00	1,039,200
JKホールディングス	300	1,060.00	318,000
日伝	200	1,668.00	333,600
北沢産業	200	188.00	37,600
杉本商事	100	1,961.00	196,100
因幡電機産業	800	2,732.00	2,185,600
東テク	100	3,375.00	337,500
ミスミグループ本社	4,800	3,150.00	15,120,000
アルテック	200	300.00	60,000
タキヒヨー	100	771.00	77,100
蔵王産業	100	1,710.00	171,000
スズケン	1,100	3,215.00	3,536,500
ジェコス	200	816.00	163,200

グローセル	400	430.00	172,000
ローソン	800	4,765.00	3,812,000
サンエー	200	4,210.00	842,000
カワチ薬品	200	2,066.00	413,200
エービーシー・マート	500	7,050.00	3,525,000
ハードオフコーポレーション	100	1,378.00	137,800
アスクル	700	1,568.00	1,097,600
ゲオホールディングス	300	2,052.00	615,600
アダストリア	400	2,052.00	820,800
ジーフット	100	291.00	29,100
くら寿司	400	3,395.00	1,358,000
キャンドゥ	100	2,129.00	212,900
アイケイ	100	412.00	41,200
パルグループホールディングス	300	2,307.00	692,100
エディオン	1,200	1,224.00	1,468,800
サーラコーポレーション	600	776.00	465,600
ワッツ	100	652.00	65,200
ハローズ	100	2,918.00	291,800
フジオフードグループ本社	200	1,378.00	275,600
あみやき亭	100	2,885.00	288,500
ひらまつ	600	195.00	117,000
大黒天物産	100	4,680.00	468,000
ハニーズホールディングス	300	1,195.00	358,500
アルペン	300	2,053.00	615,900
ハブ	100	670.00	67,000
クオールホールディングス	400	1,148.00	459,200
ジinzホールディングス	200	4,140.00	828,000
ビックカメラ	2,100	1,150.00	2,415,000
D C Mホールディングス	1,900	1,169.00	2,221,100
ペッパーフードサービス	600	212.00	127,200
Monotaro	4,500	2,149.00	9,670,500
アークランドサービスホールディングス	200	2,163.00	432,600
J.フロント リテイリング	3,900	1,182.00	4,609,800
ドトール・日レスホールディングス	600	1,650.00	990,000
マツキヨココカラ&カンパニー	1,900	5,380.00	10,222,000
ブロンコビリー	200	2,438.00	487,600
Zozo	2,100	3,160.00	6,636,000
トレジャー・ファクトリー	100	2,195.00	219,500
物語コーポレーション	200	6,690.00	1,338,000
三越伊勢丹ホールディングス	5,300	1,313.00	6,958,900
Hamee	100	821.00	82,100
ウエルシアホールディングス	1,600	3,015.00	4,824,000

クリエイトSDホールディングス	500	3,135.00	1,567,500
丸善CHIホールディングス	300	319.00	95,700
シュッピン	200	1,489.00	297,800
オイシックス・ラ・大地	400	1,578.00	631,200
ネクステージ	700	2,928.00	2,049,600
ジョイフル本田	1,000	1,792.00	1,792,000
鳥貴族ホールディングス	100	2,155.00	215,500
ホットランド	200	1,395.00	279,000
すかいらーくホールディングス	4,300	1,578.00	6,785,400
SFPホールディングス	200	1,626.00	325,200
綿半ホールディングス	200	1,347.00	269,400
ヨシックスホールディングス	100	2,111.00	211,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,000	1,043.00	1,043,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	1,405.00	140,500
B E E N O S	200	2,704.00	540,800
あさひ	200	1,282.00	256,400
日本調剤	200	1,196.00	239,200
コスモス薬品	400	14,000.00	5,600,000
トーエル	100	695.00	69,500
セブン&アイ・ホールディングス	10,900	5,566.00	60,669,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2,300	926.00	2,129,800
ツルハホールディングス	800	8,530.00	6,824,000
サンマルクホールディングス	200	1,613.00	322,600
フェリシモ	100	973.00	97,300
トリドールホールディングス	800	2,865.00	2,292,000
T O K Y O B A S E	300	342.00	102,600
J Mホールディングス	300	1,631.00	489,300
サツドラホールディングス	100	671.00	67,100
アレンザホールディングス	200	937.00	187,400
串カツ田中ホールディングス	100	1,825.00	182,500
パロックジャパンリミテッド	200	784.00	156,800
クスリのアオキホールディングス	300	7,210.00	2,163,000
力の源ホールディングス	100	775.00	77,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E	1,800	2,470.00	4,446,000
メディカルシステムネットワーク	200	406.00	81,200
ジャパクラフトホールディングス	100	629.00	62,900
はるやまホールディングス	100	433.00	43,300
ノジマ	1,000	1,317.00	1,317,000
カップ・クリエイト	500	1,363.00	681,500
ライトオン	200	626.00	125,200
良品計画	4,000	1,434.00	5,736,000

パリミキホールディングス	300	261.00	78,300
アドヴァングループ	300	866.00	259,800
アルビス	100	2,273.00	227,300
コナカ	300	334.00	100,200
G - 7ホールディングス	400	1,400.00	560,000
イオン北海道	400	1,143.00	457,200
コジマ	600	607.00	364,200
ヒマラヤ	100	914.00	91,400
コーナン商事	400	3,135.00	1,254,000
エコス	100	1,801.00	180,100
ワタミ	300	901.00	270,300
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	7,100	2,471.00	17,544,100
西松屋チェーン	700	1,365.00	955,500
ゼンショーホールディングス	1,700	3,465.00	5,890,500
幸楽苑ホールディングス	200	1,056.00	211,200
ハークスレイ	100	549.00	54,900
サイゼリヤ	500	2,872.00	1,436,000
V Tホールディングス	1,200	486.00	583,200
魚力	100	2,051.00	205,100
フジ・コーポレーション	200	1,232.00	246,400
ユナイテッドアローズ	300	2,071.00	621,300
ハイデイ日高	500	1,843.00	921,500
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	100	216.00	21,600
コロワイド	1,400	1,759.00	2,462,600
ピーシーデポコーポレーション	300	263.00	78,900
壱番屋	200	4,540.00	908,000
トップカルチャー	100	202.00	20,200
スギホールディングス	600	5,810.00	3,486,000
薬王堂ホールディングス	200	2,629.00	525,800
スクロール	400	707.00	282,800
ヨンドシーホールディングス	300	1,720.00	516,000
木曽路	500	2,135.00	1,067,500
S R S ホールディングス	500	836.00	418,000
千趣会	500	397.00	198,500
リテールパートナーズ	500	1,184.00	592,000
ケーヨー	500	898.00	449,000
上新電機	300	1,923.00	576,900
日本瓦斯	1,700	2,062.00	3,505,400
ロイヤルホールディングス	600	2,382.00	1,429,200
いなげや	300	1,115.00	334,500
チヨダ	300	723.00	216,900

ライフコーポレーション	300	2,180.00	654,000
リンガーハット	400	2,181.00	872,400
MrMaxHD	400	667.00	266,800
AOKIホールディングス	500	706.00	353,000
オークワ	500	894.00	447,000
コメリ	500	2,593.00	1,296,500
青山商事	600	1,049.00	629,400
しまむら	400	12,020.00	4,808,000
はせがわ	100	365.00	36,500
高島屋	2,400	1,833.00	4,399,200
松屋	500	1,016.00	508,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,500	1,271.00	1,906,500
近鉄百貨店	100	2,414.00	241,400
丸井グループ	2,300	2,390.00	5,497,000
アクシアル リテイリング	200	3,280.00	656,000
井筒屋	200	365.00	73,000
イオン	10,700	2,735.00	29,264,500
イズミ	500	3,000.00	1,500,000
平和堂	500	1,893.00	946,500
フジ	500	1,843.00	921,500
ヤオコー	400	6,470.00	2,588,000
ゼビオホールディングス	400	1,014.00	405,600
ケーズホールディングス	2,500	1,115.00	2,787,500
Olympicグループ	100	504.00	50,400
日産東京販売ホールディングス	300	275.00	82,500
シルバーライフ	100	1,506.00	150,600
Genky DrugStores	100	3,685.00	368,500
ブックオフグループホールディングス	200	1,349.00	269,800
ギフトホールディングス	100	3,750.00	375,000
アインホールディングス	400	6,140.00	2,456,000
元気寿司	100	3,070.00	307,000
ヤマダホールディングス	12,800	462.00	5,913,600
アークランズ	400	1,451.00	580,400
ニトリホールディングス	1,300	13,885.00	18,050,500
グルメ杵屋	300	1,005.00	301,500
愛眼	100	174.00	17,400
ケーユーホールディングス	200	1,185.00	237,000
吉野家ホールディングス	1,200	2,268.00	2,721,600
松屋フーズホールディングス	100	3,940.00	394,000
サガミホールディングス	500	1,210.00	605,000
関西フードマーケット	300	1,317.00	395,100
王将フードサービス	200	6,040.00	1,208,000

プレナス	300	2,635.00	790,500	
ミニストップ	200	1,407.00	281,400	
アークス	600	1,977.00	1,186,200	
パローホールディングス	600	1,731.00	1,038,600	
ベルク	200	5,430.00	1,086,000	
大庄	100	1,028.00	102,800	
ファーストリテイリング	500	83,840.00	41,920,000	
サンドラッグ	1,200	3,390.00	4,068,000	
サックスパー ホールディングス	300	741.00	222,300	
やまや	100	2,452.00	245,200	
ペルーナ	700	694.00	485,800	
いよぎんホールディングス	3,500	679.00	2,376,500	
しずおかフィナンシャルグループ	6,600	934.00	6,164,400	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	2,500	873.00	2,182,500	
島根銀行	100	416.00	41,600	
じもとホールディングス	200	409.00	81,800	
めぶきフィナンシャルグループ	14,600	290.00	4,234,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	400	2,150.00	860,000	
九州フィナンシャルグループ	5,200	376.00	1,955,200	
ゆうちょ銀行	8,400	992.00	8,332,800	
富山第一銀行	700	403.00	282,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	16,200	450.00	7,290,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	1,900	742.00	1,409,800	
三十三フィナンシャルグループ	300	1,438.00	431,400	
第四北越フィナンシャルグループ	500	2,570.00	1,285,000	
ひろぎんホールディングス	3,800	611.00	2,321,800	
おきなわフィナンシャルグループ	300	2,028.00	608,400	
十六フィナンシャルグループ	400	2,448.00	979,200	
北國フィナンシャルホールディングス	200	4,190.00	838,000	
プロクレアホールディングス	400	2,047.00	818,800	
あいちフィナンシャルグループ	400	1,934.00	773,600	
新生銀行	900	2,227.00	2,004,300	
あおぞら銀行	1,900	2,555.00	4,854,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	192,500	703.80	135,481,500	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	37,100	569.40	21,124,740	
三井住友トラスト・ホールディングス	5,500	4,266.00	23,463,000	
三井住友フィナンシャルグループ	21,500	4,256.00	91,504,000	代用有価証券 3,500株
千葉銀行	8,200	806.00	6,609,200	
群馬銀行	5,700	399.00	2,274,300	
武蔵野銀行	400	1,686.00	674,400	
千葉興業銀行	700	291.00	203,700	

筑波銀行	1,200	191.00	229,200
七十七銀行	900	1,759.00	1,583,100
秋田銀行	200	1,562.00	312,400
山形銀行	300	1,021.00	306,300
岩手銀行	200	1,793.00	358,600
東邦銀行	2,300	202.00	464,600
東北銀行	100	945.00	94,500
ふくおかフィナンシャルグループ	2,300	2,533.00	5,825,900
スルガ銀行	2,600	387.00	1,006,200
八十二銀行	6,100	469.00	2,860,900
山梨中央銀行	300	1,001.00	300,300
大垣共立銀行	600	1,721.00	1,032,600
福井銀行	300	1,372.00	411,600
清水銀行	100	1,406.00	140,600
滋賀銀行	500	2,444.00	1,222,000
南都銀行	400	2,096.00	838,400
百五銀行	2,800	325.00	910,000
京都銀行	900	5,230.00	4,707,000
紀陽銀行	1,000	1,408.00	1,408,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,900	870.00	1,653,000
山陰合同銀行	1,800	693.00	1,247,400
鳥取銀行	100	1,053.00	105,300
百十四銀行	300	1,667.00	500,100
四国銀行	500	850.00	425,000
阿波銀行	400	1,840.00	736,000
大分銀行	200	1,777.00	355,400
宮崎銀行	200	2,206.00	441,200
佐賀銀行	200	1,533.00	306,600
琉球銀行	700	768.00	537,600
セブン銀行	10,600	254.00	2,692,400
みずほフィナンシャルグループ	42,500	1,615.00	68,637,500
高知銀行	100	623.00	62,300
山口フィナンシャルグループ	3,300	777.00	2,564,100
長野銀行	100	1,156.00	115,600
名古屋銀行	200	3,060.00	612,000
北洋銀行	4,500	233.00	1,048,500
大光銀行	100	1,118.00	111,800
愛媛銀行	400	835.00	334,000
トマト銀行	100	964.00	96,400
京葉銀行	1,300	503.00	653,900
栃木銀行	1,300	297.00	386,100
北日本銀行	100	1,830.00	183,000

東和銀行	500	521.00	260,500
福島銀行	300	205.00	61,500
大東銀行	100	602.00	60,200
トモニホールディングス	2,300	319.00	733,700
フィデアホールディングス	300	1,287.00	386,100
池田泉州ホールディングス	3,700	213.00	788,100
F P G	1,200	1,066.00	1,279,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	200	1,244.00	248,800
マーキュリアホールディングス	200	601.00	120,200
S B Iホールディングス	4,300	2,679.00	11,519,700
日本アジア投資	300	232.00	69,600
ジャフコ グループ	1,000	2,248.00	2,248,000
大和証券グループ本社	21,000	582.00	12,222,000
野村ホールディングス	54,000	480.70	25,957,800
岡三証券グループ	2,600	355.00	923,000
丸三証券	1,000	404.00	404,000
東洋証券	1,000	236.00	236,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3,200	343.00	1,097,600
光世証券	100	356.00	35,600
水戸証券	800	217.00	173,600
いちよし証券	500	595.00	297,500
松井証券	1,700	773.00	1,314,100
マネックスグループ	3,300	480.00	1,584,000
極東証券	400	610.00	244,000
岩井コスモホールディングス	300	1,238.00	371,400
アイザワ証券グループ	400	643.00	257,200
マネーパートナーズグループ	300	273.00	81,900
スパークス・グループ	300	1,578.00	473,400
小林洋行	100	220.00	22,000
かんぽ生命保険	3,600	2,139.00	7,700,400
S O M P Oホールディングス	5,000	6,235.00	31,175,000
アニコム ホールディングス	900	589.00	530,100
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	6,600	3,972.00	26,215,200
第一生命ホールディングス	15,000	2,331.00	34,965,000
東京海上ホールディングス	29,600	2,742.50	81,178,000
T & Dホールディングス	7,900	1,470.00	11,613,000
アドバンスクリエイト	100	995.00	99,500
全国保証	800	4,965.00	3,972,000
あんしん保証	100	253.00	25,300
ジェイリース	100	2,554.00	255,400
イントラスト	100	703.00	70,300
日本モーゲージサービス	100	823.00	82,300

C a s a	100	847.00	84,700
アルヒ	600	1,398.00	838,800
プレミアグループ	500	1,758.00	879,000
ネットプロテクションズホールディングス	900	425.00	382,500
クレディセゾン	1,900	1,565.00	2,973,500
芙蓉総合リース	300	8,190.00	2,457,000
みずほリース	400	3,245.00	1,298,000
東京センチュリー	500	4,950.00	2,475,000
日本証券金融	1,200	901.00	1,081,200
アイフル	4,800	400.00	1,920,000
リコーリース	300	3,580.00	1,074,000
イオンフィナンシャルサービス	1,700	1,432.00	2,434,400
アコム	5,200	321.00	1,669,200
ジャックス	300	3,655.00	1,096,500
オリエントコーポレーション	800	1,191.00	952,800
オリックス	19,600	2,163.00	42,394,800
三菱HCキャピタル	11,400	639.00	7,284,600
九州リースサービス	100	632.00	63,200
日本取引所グループ	8,300	1,916.50	15,906,950
イー・ギャランティ	500	2,382.00	1,191,000
アサックス	100	596.00	59,600
NECキャピタルソリューション	100	2,067.00	206,700
大東建託	1,100	14,860.00	16,346,000
いちご	3,500	331.00	1,158,500
日本駐車場開発	3,600	258.00	928,800
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,391.00	139,100
SREホールディングス	200	4,275.00	855,000
ADワークスグループ	900	162.00	145,800
ヒューリック	6,900	1,080.00	7,452,000
三栄建築設計	100	1,448.00	144,800
野村不動産ホールディングス	1,800	3,350.00	6,030,000
三重交通グループホールディングス	700	501.00	350,700
サムティ	500	2,333.00	1,166,500
ディア・ライフ	500	607.00	303,500
コーセーアールイー	100	665.00	66,500
地主	200	2,048.00	409,600
プレサンスコーポレーション	400	1,477.00	590,800
THEグローバル社	300	259.00	77,700
ハウスコム	100	971.00	97,100
JPMC	200	1,008.00	201,600
サンセイランディック	100	840.00	84,000
エストラスト	100	550.00	55,000

フージャースホールディングス	500	758.00	379,000
オープンハウスグループ	1,100	5,360.00	5,896,000
東急不動産ホールディングス	8,800	735.00	6,468,000
飯田グループホールディングス	2,600	2,064.00	5,366,400
イーランド	100	1,551.00	155,100
ムゲンエステート	300	464.00	139,200
ビーロッド	200	557.00	111,400
ファーストブラザーズ	100	875.00	87,500
A n d D oホールディングス	200	859.00	171,800
シーアールイー	200	1,420.00	284,000
プロパティエージェント	100	1,353.00	135,300
ケイアイスター不動産	100	4,440.00	444,000
アグレ都市デザイン	100	1,477.00	147,700
グッドコムアセット	200	682.00	136,400
ジェイ・エス・ビー	100	3,985.00	398,500
ロードスターキャピタル	100	1,571.00	157,100
テンポイノベーション	100	918.00	91,800
グローバル・リンク・マネジメント	100	1,042.00	104,200
フェイスネットワーク	100	1,301.00	130,100
パーク24	2,300	1,991.00	4,579,300
パラカ	100	1,893.00	189,300
宮越ホールディングス	100	849.00	84,900
三井不動産	12,800	2,795.00	35,776,000
三菱地所	18,600	1,850.00	34,410,000
平和不動産	500	3,860.00	1,930,000
東京建物	2,800	1,970.00	5,516,000
京阪神ビルディング	400	1,322.00	528,800
住友不動産	5,300	3,388.00	17,956,400
テーオーシー	500	743.00	371,500
東京楽天地	100	4,180.00	418,000
スターツコーポレーション	400	2,696.00	1,078,400
フジ住宅	400	621.00	248,400
空港施設	400	530.00	212,000
明和地所	200	608.00	121,600
ゴールドクレスト	300	1,702.00	510,600
エスリード	100	1,841.00	184,100
日神グループホールディングス	500	425.00	212,500
日本エスコン	700	803.00	562,100
M I R A R T Hホールディングス	1,500	383.00	574,500
A V A N T I A	200	765.00	153,000
イオンモール	1,500	1,603.00	2,404,500
毎日コムネット	100	658.00	65,800

ファースト住建	100	1,003.00	100,300
カチタス	800	3,040.00	2,432,000
トーセイ	500	1,404.00	702,000
サンフロンティア不動産	500	1,142.00	571,000
FJネクストホールディングス	300	984.00	295,200
インテリックス	100	552.00	55,200
ランドビジネス	200	225.00	45,000
サンネクスタグループ	100	908.00	90,800
グランディハウス	300	548.00	164,400
日本空港ビルデング	1,000	6,190.00	6,190,000
明豊ファシリティワークス	200	699.00	139,800
日本工営	200	3,305.00	661,000
LIFULL	1,100	166.00	182,600
MIXI	700	2,387.00	1,670,900
ジェイエイシーリクルートメント	300	2,504.00	751,200
日本M&Aセンターホールディングス	5,300	1,659.00	8,792,700
メンバーズ	100	2,114.00	211,400
中広	100	366.00	36,600
UTグループ	500	2,409.00	1,204,500
アイティメディア	100	1,670.00	167,000
E・Jホールディングス	200	1,280.00	256,000
夢真ビーネックスグループ	1,100	1,950.00	2,145,000
コシダカホールディングス	900	1,121.00	1,008,900
アルトナー	100	1,000.00	100,000
パソナグループ	400	1,941.00	776,400
CDS	100	1,810.00	181,000
リンクアンドモチベーション	900	882.00	793,800
エス・エム・エス	1,200	3,540.00	4,248,000
サニーサイドアップグループ	100	559.00	55,900
パーソルホールディングス	3,500	3,015.00	10,552,500
リニカル	200	738.00	147,600
クックパッド	900	201.00	180,900
エスクリ	200	363.00	72,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	200	623.00	124,600
学情	100	1,492.00	149,200
スタジオアリス	200	2,056.00	411,200
シミックホールディングス	200	1,717.00	343,400
エプコ	100	653.00	65,300
NJS	100	2,073.00	207,300
総合警備保障	1,100	3,625.00	3,987,500
カカクコム	2,300	2,335.00	5,370,500
アイロムグループ	100	2,338.00	233,800

セントケア・ホールディング	200	823.00	164,600
サイネックス	100	532.00	53,200
ルネサンス	200	933.00	186,600
ディップ	500	4,230.00	2,115,000
デジタルホールディングス	200	1,140.00	228,000
新日本科学	300	2,651.00	795,300
キャリアデザインセンター	100	1,465.00	146,500
ベネフィット・ワン	1,400	2,079.00	2,910,600
エムスリー	6,100	4,146.00	25,290,600
ツカダ・グローバルホールディング	200	393.00	78,600
アウトソーシング	1,800	1,177.00	2,118,600
ウェルネット	300	604.00	181,200
ワールドホールディングス	100	2,611.00	261,100
ディー・エヌ・エー	1,300	1,922.00	2,498,600
博報堂D Yホールディングス	3,900	1,229.00	4,793,100
ぐるなび	600	409.00	245,400
タカミヤ	400	390.00	156,000
ジャパンベストレスキューシステム	200	853.00	170,600
ファンコミュニケーションズ	600	435.00	261,000
ライク	100	2,021.00	202,100
ビジネス・ブレークスルー	100	396.00	39,600
エスプール	900	926.00	833,400
WDBホールディングス	200	2,547.00	509,400
ティア	200	424.00	84,800
アドウェイズ	400	627.00	250,800
バリューコマース	200	2,068.00	413,600
インフォマート	3,200	429.00	1,372,800
J Pホールディングス	900	297.00	267,300
エコナックホールディングス	700	91.00	63,700
CLホールディングス	100	841.00	84,100
プレステージ・インターナショナル	1,300	710.00	923,000
アミューズ	200	1,751.00	350,200
ドリームインキュベータ	100	2,334.00	233,400
クイック	200	2,071.00	414,200
T A C	200	207.00	41,400
電通グループ	3,200	4,490.00	14,368,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	1,536.00	153,600
ぴあ	100	3,365.00	336,500
イオンファンタジー	100	2,848.00	284,800
シーティーエス	400	818.00	327,200
ネクシィーズグループ	100	671.00	67,100
H . U . グループホールディングス	900	2,743.00	2,468,700

アルプス技研	300	1,968.00	590,400
サニックス	600	225.00	135,000
ダイオーズ	100	1,498.00	149,800
日本空調サービス	300	702.00	210,600
オリエンタルランド	3,200	19,775.00	63,280,000
ダスキン	700	2,831.00	1,981,700
明光ネットワークジャパン	400	607.00	242,800
ファルコホールディングス	100	1,729.00	172,900
秀英予備校	100	433.00	43,300
ラウンドワン	2,600	629.00	1,635,400
リゾートトラスト	1,200	2,344.00	2,812,800
ビー・エム・エル	400	3,345.00	1,338,000
りらいあコミュニケーションズ	500	1,026.00	513,000
リソー教育	1,400	315.00	441,000
早稲田アカデミー	200	1,108.00	221,600
ユー・エス・エス	3,200	2,190.00	7,008,000
東京個別指導学院	400	518.00	207,200
サイバーエージェント	7,400	1,120.00	8,288,000
楽天グループ	14,300	660.00	9,438,000
クリーク・アンド・リバー社	200	2,039.00	407,800
モーニングスター	500	450.00	225,000
テー・オー・ダブリュー	700	305.00	213,500
山田コンサルティンググループ	200	1,139.00	227,800
セントラルスポーツ	100	2,322.00	232,200
フルキャストホールディングス	300	2,888.00	866,400
エン・ジャパン	600	2,546.00	1,527,600
テクノプロ・ホールディングス	2,100	3,815.00	8,011,500
アトラグループ	100	188.00	18,800
インターワークス	100	372.00	37,200
アイ・アールジャパンホールディングス	200	2,164.00	432,800
Keeper 技研	200	3,770.00	754,000
ファーストロジック	100	784.00	78,400
三機サービス	100	888.00	88,800
Gunosy	200	654.00	130,800
デザインワン・ジャパン	100	209.00	20,900
イー・ガーディアン	100	2,975.00	297,500
リブセンス	200	278.00	55,600
ジャパンマテリアル	900	1,983.00	1,784,700
ベクトル	500	1,047.00	523,500
ウチヤマホールディングス	200	291.00	58,200
チャーム・ケア・コーポレーション	300	1,039.00	311,700
キャリアリンク	100	2,373.00	237,300

I B J	200	958.00	191,600
アサンテ	200	1,594.00	318,800
バリューHR	300	1,488.00	446,400
M&Aキャピタルパートナーズ	300	4,200.00	1,260,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	1,015.00	101,500
E R Iホールディングス	100	1,037.00	103,700
アビスト	100	2,890.00	289,000
シグマクシス・ホールディングス	500	1,245.00	622,500
ウィルグループ	300	1,446.00	433,800
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	400	147.00	58,800
メドピア	300	1,412.00	423,600
レアジョブ	100	1,031.00	103,100
リクルートホールディングス	22,700	4,550.00	103,285,000
エラン	400	1,088.00	435,200
土木管理総合試験所	200	304.00	60,800
日本郵政	40,300	990.80	39,929,240
ベルシステム24ホールディングス	400	1,307.00	522,800
鎌倉新書	400	751.00	300,400
S M N	100	462.00	46,200
一蔵	100	482.00	48,200
グローバルキッズCOMPANY	100	573.00	57,300
エアトリ	200	2,494.00	498,800
アトラエ	200	1,487.00	297,400
ストライク	200	4,250.00	850,000
ソラスト	900	849.00	764,100
セラク	100	1,136.00	113,600
インソース	400	3,430.00	1,372,000
ベイカレント・コンサルティング	2,000	3,970.00	7,940,000
Orchestra Holdings	100	2,490.00	249,000
アイモバイル	200	1,192.00	238,400
キャリアインデックス	100	394.00	39,400
MS - Japan	100	827.00	82,700
船場	100	768.00	76,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,100	1,680.00	1,848,000
フルテック	100	1,058.00	105,800
グリーンズ	100	1,001.00	100,100
ツナググループ・ホールディングス	100	471.00	47,100
GameWith	100	364.00	36,400
MS&Consulting	100	602.00	60,200
ウェルビー	200	841.00	168,200
ミダックホールディングス	200	3,610.00	722,000
日総工産	200	562.00	112,400

キュービーネットホールディングス	200	1,322.00	264,400
RPAホールディングス	500	278.00	139,000
スプリックス	100	976.00	97,600
マネジメントソリューションズ	200	3,065.00	613,000
プロレド・パートナーズ	100	510.00	51,000
and factory	100	384.00	38,400
テノ・ホールディングス	100	528.00	52,800
フロンティア・マネジメント	100	1,240.00	124,000
ピアラ	100	688.00	68,800
コプロ・ホールディングス	100	912.00	91,200
ギークス	100	751.00	75,100
カーブスホールディングス	1,000	880.00	880,000
フォーラムエンジニアリング	200	840.00	168,000
Fast Fitness Japan	100	1,415.00	141,500
ダイレクトマーケティングミックス	400	1,629.00	651,600
ポピンズ	100	1,508.00	150,800
LITALICO	200	2,424.00	484,800
アドバンテッジリスクマネジメント	200	414.00	82,800
リログループ	1,700	2,060.00	3,502,000
東祥	200	1,251.00	250,200
ビーウィズ	100	1,210.00	121,000
TREホールディングス	700	1,560.00	1,092,000
人・夢・技術グループ	100	2,670.00	267,000
エイチ・アイ・エス	800	2,044.00	1,635,200
ラックランド	100	2,830.00	283,000
共立メンテナンス	500	6,260.00	3,130,000
イチネンホールディングス	300	1,232.00	369,600
建設技術研究所	200	2,838.00	567,600
スペース	200	862.00	172,400
燦ホールディングス	100	1,703.00	170,300
東京テアトル	100	1,100.00	110,000
タナベコンサルティンググループ	100	619.00	61,900
ナガワ	100	6,990.00	699,000
東京都競馬	300	4,040.00	1,212,000
常磐興産	100	1,156.00	115,600
カナモト	600	2,235.00	1,341,000
西尾レントオール	300	2,962.00	888,600
アゴラ ホスピタリティグループ	2,100	23.00	48,300
トランス・コスモス	400	3,125.00	1,250,000
乃村工藝社	1,300	1,059.00	1,376,700
藤田観光	100	3,090.00	309,000
KNT-CTホールディングス	200	1,649.00	329,800

日本管財	300	2,510.00	753,000	
トーカイ	300	1,869.00	560,700	
セコム	3,100	8,270.00	25,637,000	
セントラル警備保障	200	2,504.00	500,800	
丹青社	600	802.00	481,200	
メイテック	1,200	2,538.00	3,045,600	
応用地質	300	2,323.00	696,900	
船井総研ホールディングス	600	2,551.00	1,530,600	
進学会ホールディングス	100	302.00	30,200	
オオバ	200	673.00	134,600	
いであ	100	1,536.00	153,600	
学究社	100	1,675.00	167,500	
ベネッセホールディングス	1,200	2,165.00	2,598,000	
イオンディライト	300	2,947.00	884,100	
ナック	100	926.00	92,600	
ダイセキ	600	4,615.00	2,769,000	
ステップ	100	1,853.00	185,300	
合 計	3,474,200		8,336,984,060	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年11月30日現在です。

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	172,310,656円
負債総額	63,392円
純資産総額（ - ）	172,247,264円
発行済口数	166,387,022口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0352円

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	8,531,622,787円
負債総額	25,615,633円
純資産総額（ - ）	8,506,007,154円
発行済口数	3,884,184,823口
1口当たり純資産額（ / ）	2.190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ときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止

期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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11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11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11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11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	860	239,232
株式投資信託	801	203,127
単位型	315	9,875
追加型	486	193,252
公社債投資信託	59	36,104
単位型	46	1,194
追加型	13	34,910

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		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)	
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、記載してありません。</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-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

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	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場合、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場合、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場合、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場合、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 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>

5 ヘッジ会計の方法	<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>
6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 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>	
1	<p>有形固定資産の減価償却累計額 2,264百万円</p>
2	<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
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円(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(日本マスタートラスト信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

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・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
 - ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
 - 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
 - ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金

の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。

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

2023年1月25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」に掲げられているバランスポートフォリオの2021年11月9日から2022年11月7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、バランスポートフォリオの2022年11月7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を検討すること、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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記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。