

【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4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】	上場インデックスファンドTOPIX
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	30兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

上場インデックスファンドTOPIX（以下「ファンド」といいます。）

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

30兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

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

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

（７）【申込期間】

2023年4月8日から2023年10月6日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

「(8) 申込取扱場所」に同じです。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

※TOPIX(東証株価指数)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数として算出します。算出方法は、基準時を昭和43年(1968年)1月4日(終値)に置き、その日の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

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

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

「TOPIX」の著作権などについて

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

ETF

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

インデックス型

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

2) 属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

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

年1回

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

日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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

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

- ・ 売買単位は100口単位です。(有価証券届出書提出日現在)
 - ・ 売買手数料は、取扱会社が定めるものによります。
 - ・ 取引方法は原則として株式と同様です。
- ※詳しくは、取扱会社へお問い合わせください。

2. 株式をもって受益権の取得申込みを行いません。

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

- ※「ユニット株式」とは、委託会社がTOPIX(東証株価指数)に連動すると想定する、TOPIX(東証株価指数)における各構成銘柄の委託会社が指定する株数の株式すべてを指すものとします。
- ※金融商品取引清算機関による清算制度を利用した取得申込みが可能です。

3. 解約請求による途中換金をすることはできません。

4. 受益権をもって株式と交換することができます。

- ※取得申込時に換出されたTOPIX(東証株価指数)構成銘柄と、交換時に取得される各株式は一致するものではありません。
- ※取得申込時に取得された受益権の口数と、交換時に必要とされる口数は一致するものではありません。
- ※金融商品取引清算機関による清算制度を利用した交換請求が可能です。

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

主な投資制限

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

分配方針

- ・ 信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

- ・ 30兆円相当額を限度として有価証券または金銭を追加信託することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2)【ファンドの沿革】

2001年12月20日

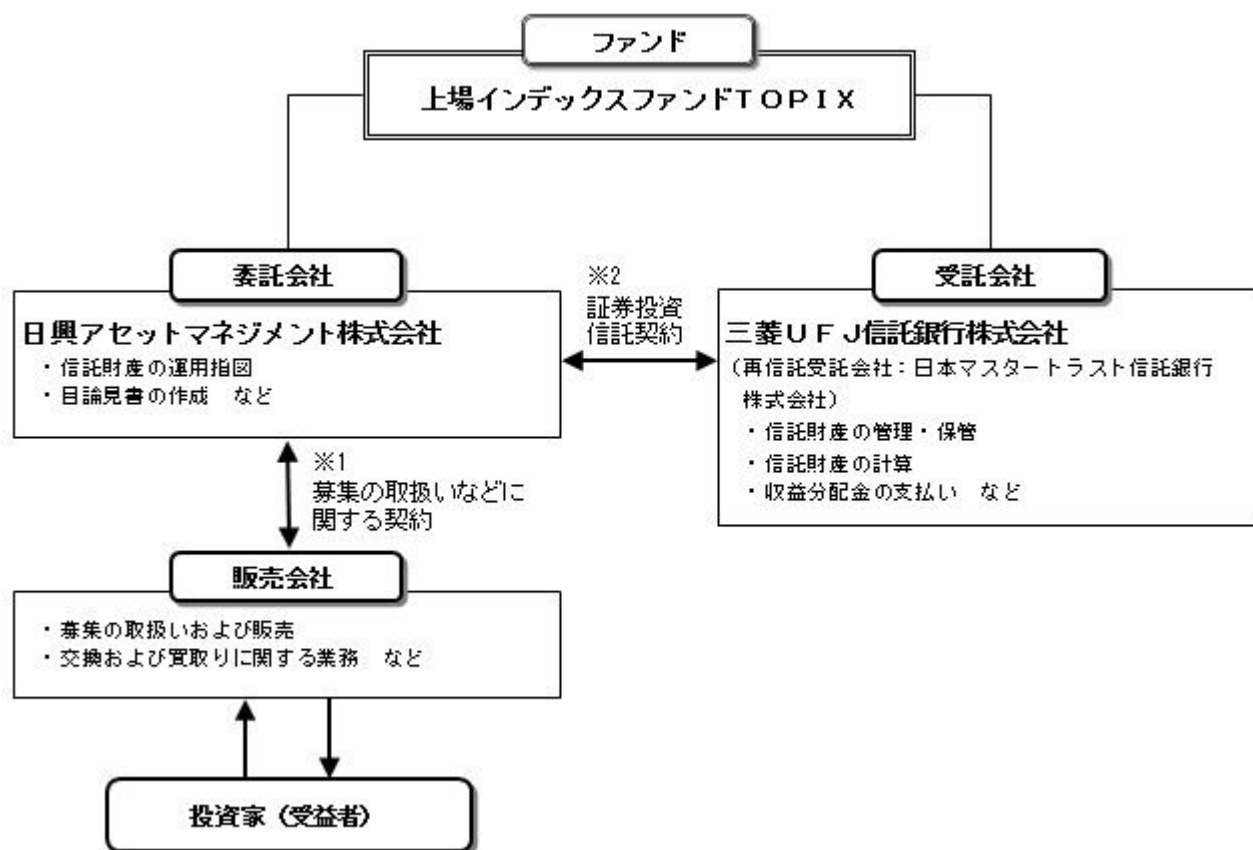
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

2002年 1月 9日

- ・ ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、交換および買取りに関する業務の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。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（2023年1月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

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

TOPIX（東証株価指数）の計算方法が変更された場合

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

追加信託および受益権と株式との交換の指図を行なう場合

その他連動性を維持するために委託会社が必要と認めた場合

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

（２）【投資対象】

TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第26条に定めるものに限りません。）

3) 金銭債権

主として株式に投資するほか、次に掲げる株式以外の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）および金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

1) 預金

2) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

3) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

4) コール・ローン

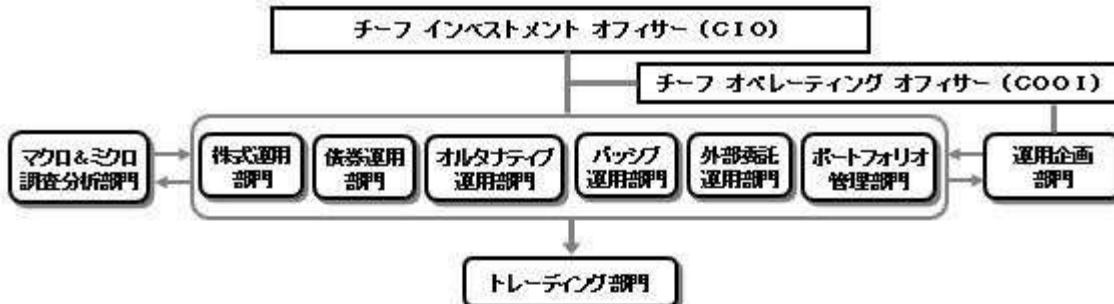
次の取引ができます。

1) 先物取引等

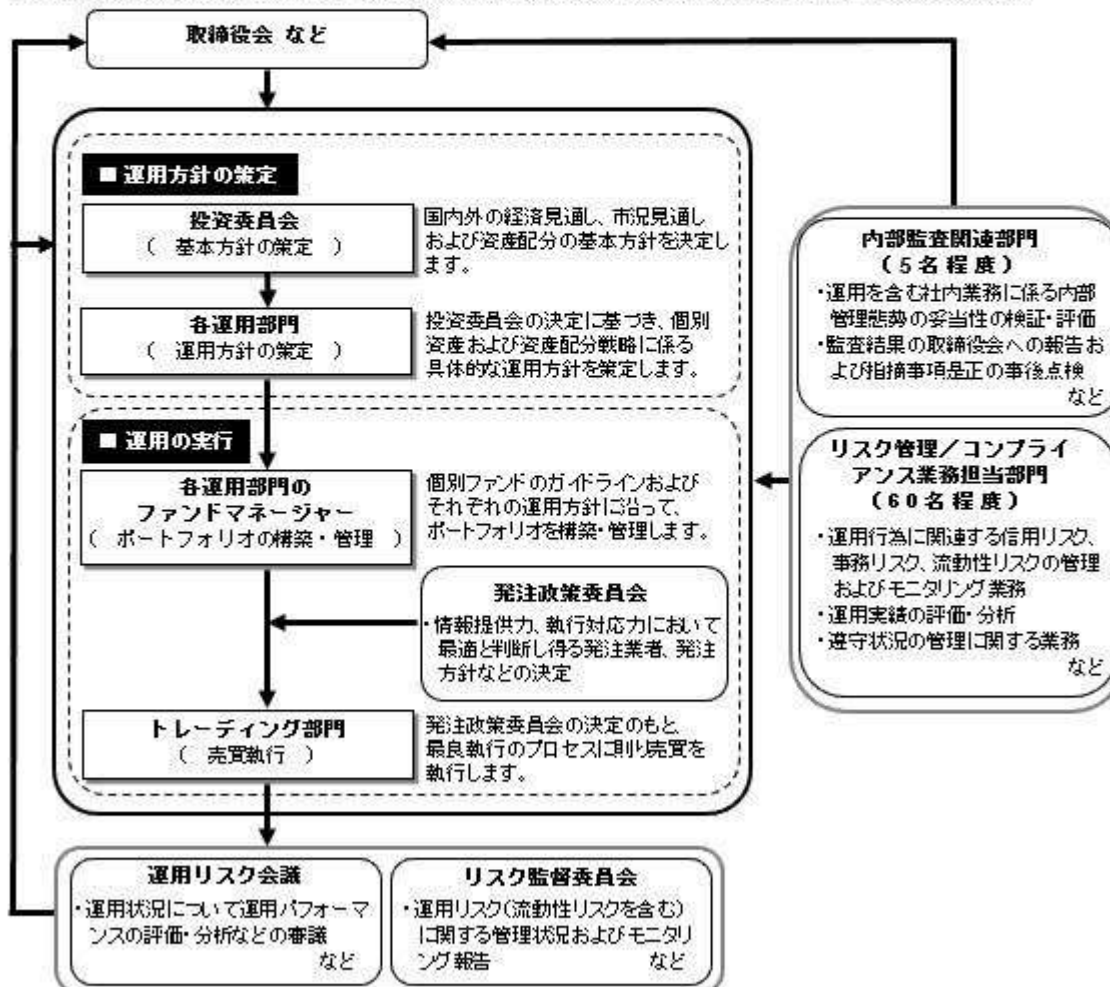
2) 有価証券の貸付

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2023年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

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

ではありません。

- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) わが国の金融商品取引所における東証株価指数先物取引および東証株価指数オプション取引ならびに外国の金融商品取引所における東証株価指数先物取引および東証株価指数オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 6) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

有価証券の貸付などにおけるリスク

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリ

スクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

< T O P I X (東証株価指数) と基準価額の主なカイ離要因 >

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

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

金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

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

< その他の留意事項 >

- ・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・交換の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・交換の取扱いを停止する場合があります。

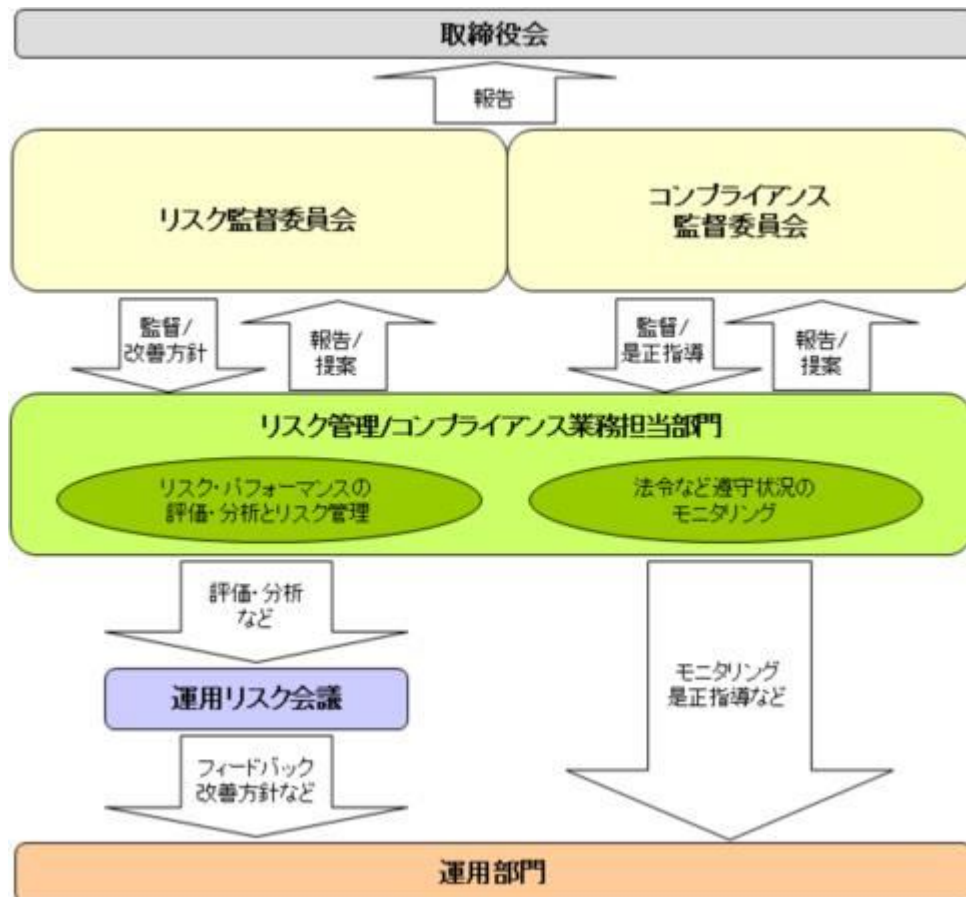
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額がカイ離する可能性があります。

- ・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

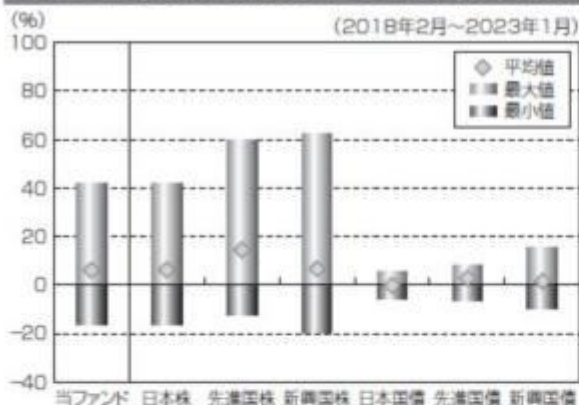
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2023年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.1%	6.2%	14.4%	6.6%	-0.2%	2.8%	1.6%
最大値	42.0%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-16.1%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

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J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の100口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2018年2月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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】

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。

信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.242%（税抜0.22%）以内（有価証券届出書提出日現在、年0.0968%（税抜0.088%））の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

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

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

委託会社	委託した資金の運用の対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（4）【その他の手数料等】

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

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

用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息。

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料に0.55（税抜0.5）以内（有価証券届出書提出日現在、0.55（税抜0.5））を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は1：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 受益権の売却時の課税

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

2) 収益分配金の受取り時の課税

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

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

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

3) 受益権と現物株式との交換

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

法人受益者の場合

1) 受益権の売却時の課税

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

2) 収益分配金の受取り時の課税

- ・ 収益分配金は配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれ、他の法人所得と合算して課税されます。
- ・ 収益分配金は、原則として益金不算入の対象となります。

3) 受益権と現物株式との交換

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

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

上記は2023年4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】

【上場インデックスファンドTOPIX】

以下の運用状況は2023年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	7,641,007,462,540	99.69
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		23,793,539,935	0.31
合計(純資産総額)		7,664,801,002,475	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	23,785,020,000	0.31

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	147,725,400	2,101.69	310,473,277,427	1,896.50	280,161,221,100	3.66
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	19,030,900	11,125.03	211,719,502,719	11,580.00	220,377,822,000	2.88
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	168,234,100	725.21	122,005,051,661	952.70	160,276,627,070	2.09
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,691,500	49,785.93	133,998,849,322	59,280.00	159,552,120,000	2.08
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	34,573,900	3,839.69	132,753,175,067	3,892.00	134,561,618,800	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	19,362,400	4,079.62	78,991,414,190	5,652.00	109,436,284,800	1.43
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	23,878,300	3,884.54	92,756,335,285	4,090.00	97,662,247,000	1.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	15,600,600	5,416.66	84,503,182,233	6,144.00	95,850,086,400	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	16,985,400	5,798.72	98,493,683,112	5,625.00	95,542,875,000	1.25
日本	株式	第一三共	医薬品	23,506,100	3,544.44	83,316,144,750	4,064.00	95,528,790,400	1.25
日本	株式	日立製作所	電気機器	13,212,800	6,500.11	85,884,653,408	6,782.00	89,609,209,600	1.17

日本	株式	信越化学工業	化学	4,547,800	16,003.37	72,780,153,828	19,075.00	86,749,285,000	1.13
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,898,000	43,530.66	82,621,210,744	45,170.00	85,732,660,000	1.12
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	20,474,900	4,252.39	87,067,328,844	4,144.00	84,847,985,600	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	20,850,100	4,289.01	89,426,376,117	4,059.00	84,630,555,900	1.10
日本	株式	HOYA	精密機器	5,746,000	12,277.36	70,545,731,528	14,200.00	81,593,200,000	1.06
日本	株式	三井物産	卸売業	20,827,600	2,876.05	59,901,282,116	3,820.00	79,561,432,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	38,319,700	1,565.00	59,970,566,036	2,027.50	77,693,191,750	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	17,797,000	3,899.06	69,391,601,422	4,336.00	77,167,792,000	1.01
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	17,539,500	3,811.00	66,843,089,046	4,183.00	73,367,728,500	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	3,243,800	22,054.91	71,541,739,968	22,470.00	72,888,186,000	0.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	26,680,800	2,654.00	70,810,977,456	2,714.00	72,411,691,200	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	21,869,000	3,251.87	71,115,167,540	3,207.00	70,133,883,000	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	43,345,600	1,523.26	66,026,650,498	1,486.50	64,433,234,400	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	2,927,200	18,184.54	53,229,791,635	21,580.00	63,168,976,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	2,640,700	21,874.86	57,764,956,236	22,905.00	60,485,233,500	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	8,159,000	7,604.77	62,047,383,764	7,394.00	60,327,646,000	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	9,810,000	5,335.30	52,339,371,719	6,127.00	60,105,870,000	0.78
日本	株式	S M C	機械	881,100	62,234.42	54,834,748,750	65,350.00	57,579,885,000	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	2,707,400	17,877.79	48,402,344,524	18,510.00	50,113,974,000	0.65

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	0.30
		建設業	1.95
		食料品	3.40
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.19
		医薬品	5.35
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.57
		機械	5.22
		電気機器	17.33
輸送用機器	7.39		
精密機器	2.61		
その他製品	2.30		

	電気・ガス業	1.24
	陸運業	2.98
	海運業	0.60
	空運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	8.89
	卸売業	5.91
	小売業	4.53
	銀行業	6.55
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.40
	その他金融業	1.14
	不動産業	1.90
	サービス業	5.31
合 計		99.69

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2023年03月	買建	1,204	日本円	23,162,715,200	23,785,020,000	0.31

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)		東京証券取引所 取引価格（円）
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き	
第12計算期間末 (2013年 7月 8日)	602,953	612,496	1,173.87	1,192.45	1,174
第13計算期間末 (2014年 7月 8日)	790,486	803,304	1,280.23	1,300.99	1,281
第14計算期間末 (2015年 7月 8日)	1,238,974	1,255,990	1,593.91	1,615.80	1,595
第15計算期間末 (2016年 7月 8日)	1,149,571	1,173,804	1,217.26	1,242.92	1,216
第16計算期間末 (2017年 7月 8日)	2,366,170	2,403,721	1,624.47	1,650.25	1,624
第17計算期間末 (2018年 7月 8日)	3,351,921	3,413,173	1,712.85	1,744.15	1,713
第18計算期間末 (2019年 7月 8日)	4,151,311	4,238,348	1,601.15	1,634.72	1,602
第19計算期間末 (2020年 7月 8日)	5,396,794	5,507,352	1,586.45	1,618.95	1,586
第20計算期間末 (2021年 7月 8日)	7,326,730	7,463,287	1,959.42	1,995.94	1,963

第21計算期間末 (2022年 7月 8日)	7,264,099	7,440,343	1,923.56	1,970.23	1,928
2022年 1月末日	7,336,524		1,952.81		1,952
2月末日	7,317,350		1,944.09		1,944.5
3月末日	7,653,610		2,027.45		2,026
4月末日	7,456,203		1,978.75		1,977.5
5月末日	7,497,753		1,993.92		1,992.5
6月末日	7,371,087		1,952.92		1,956
7月末日	7,459,881		1,977.48		1,977.5
8月末日	7,547,488		2,001.16		2,000
9月末日	7,132,764		1,891.19		1,889.5
10月末日	7,578,332		1,987.41		1,985.5
11月末日	7,717,056		2,045.70		2,042
12月末日	7,340,682		1,952.07		1,953
2023年 1月末日	7,664,801		2,038.26		2,036.5

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

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	18.5800
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	20.7600
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	21.8900
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	25.6600
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	25.7800
第17期	2017年 7月 9日～2018年 7月 8日	31.3000
第18期	2018年 7月 9日～2019年 7月 8日	33.5700
第19期	2019年 7月 9日～2020年 7月 8日	32.5000
第20期	2020年 7月 9日～2021年 7月 8日	36.5200
第21期	2021年 7月 9日～2022年 7月 8日	46.6700
当中間期	2022年 7月 9日～2023年 1月 8日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	55.16
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	10.83
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	26.21
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	22.02
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	35.57
第17期	2017年 7月 9日～2018年 7月 8日	7.37
第18期	2018年 7月 9日～2019年 7月 8日	4.56

第19期	2019年 7月 9日～2020年 7月 8日	1.11
第20期	2020年 7月 9日～2021年 7月 8日	25.81
第21期	2021年 7月 9日～2022年 7月 8日	0.55
当中間期	2022年 7月 9日～2023年 1月 8日	0.62

(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12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	199,396,100	178,109,648
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	216,920,100	113,108,630
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	337,726,500	177,866,039
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	240,119,800	73,043,677
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	757,397,200	245,213,668
第17期	2017年 7月 9日～2018年 7月 8日	658,406,900	158,062,049
第18期	2018年 7月 9日～2019年 7月 8日	730,718,600	94,941,417
第19期	2019年 7月 9日～2020年 7月 8日	898,361,100	89,264,353
第20期	2020年 7月 9日～2021年 7月 8日	463,665,200	126,225,665
第21期	2021年 7月 9日～2022年 7月 8日	196,553,600	159,401,632
当中間期	2022年 7月 9日～2023年 1月 8日	64,460,700	80,378,865

(注)解約口数は交換口数を表示しております。

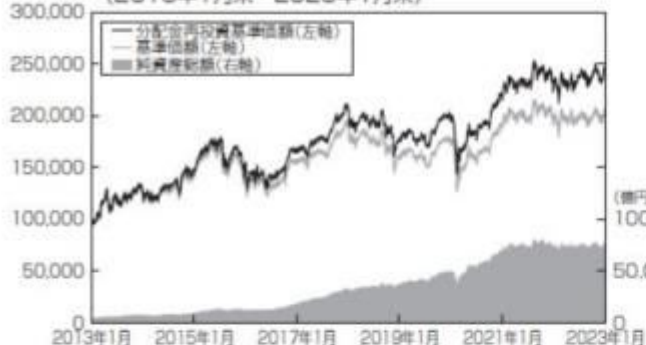
参考情報

運用実績

2023年1月31日現在

基準価額・純資産の推移

(円) (2013年1月末～2023年1月末)



基準価額……………203,826円

純資産総額……………7兆6,648億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の100口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、100口当たり)

2018年7月	2019年7月	2020年7月	2021年7月	2022年7月	設定来累計
3,130円	3,357円	3,250円	3,652円	4,667円	47,085円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	100.00%
うち先物	0.31%
現金その他	0.31%

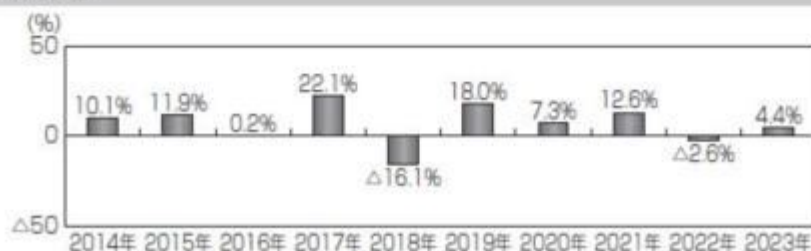
※対純資産総額比です。

<組入上位10銘柄>

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.66%
2 ソニーグループ	電気機器	2.88%
3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.09%
4 キーエンス	電気機器	2.08%
5 日本電信電話	情報・通信業	1.76%
6 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.43%
7 武田薬品工業	医薬品	1.27%
8 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.25%
9 任天堂	その他製品	1.25%
10 第一三共	医薬品	1.25%

※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。

※2023年は、2023年1月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

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

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

- 当ファンドは、東京証券取引所に上場しております。委託会社は、当該金融商品取引所が定める諸規則などを遵守し、当該金融商品取引所が諸規則などに基づいて行なう売買取引の停止または上場廃止その他の措置に従うものとします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

原則として、午後3時までに販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。ただし、取得申込者がT O P I X (東証株価指数)に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合の受付締切時間は午後2時までとします。なお、販売会社によっては、取得の申込みの受付締切時間および受付方法が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

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

(5) 申込単位

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

(6) 受付の中止および取消

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

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

2【換金(解約)手続等】

(1) 受益権の解約

受益者は、信託期間中において解約の請求をすることはできません。

(2) 受益権と信託財産に属する株式との交換

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

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

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

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

払うものとしします。

交換請求日が次に該当することとなる場合には、交換請求の受付は行ないません。

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

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

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

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合は、交換請求の受付を中止すること、および既に受け付けた交換請求の受付を取り消すことができます。

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

（3）受益権の買取り

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

原則として、午後3時までに委託会社が指定する販売会社において所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額とします。

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

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

買取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。

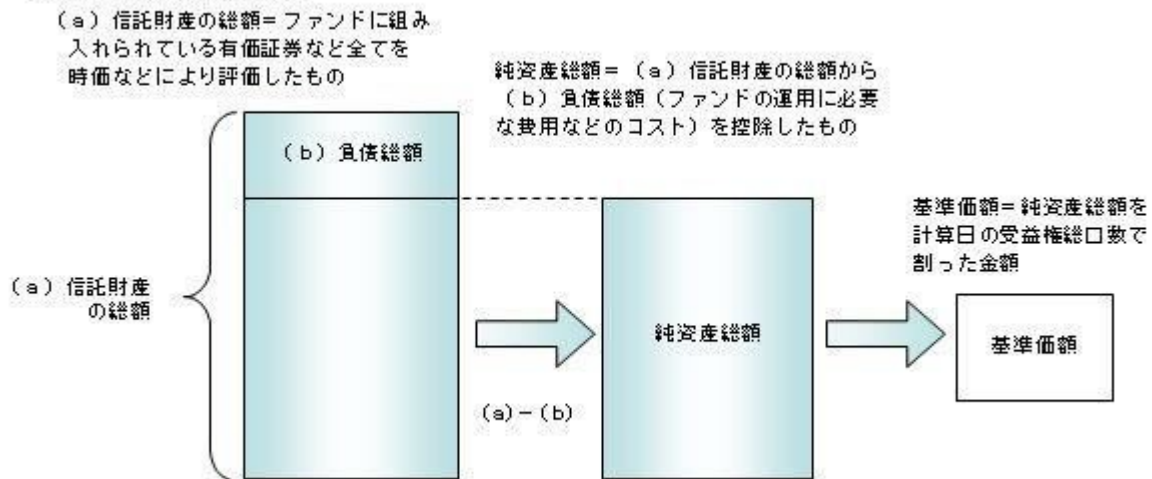
3【資産管理等の概要】

（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100口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

国内上場株式

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2001年12月20日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年7月9日から翌年7月8日までとします。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 受益権の口数が300万口を下回ることとなった場合
 - ロ) 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合

八) T O P I X（東証株価指数）が廃止された場合

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

ホ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

へ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ト) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

チ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

信託約款の変更

1) 委託会社は、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

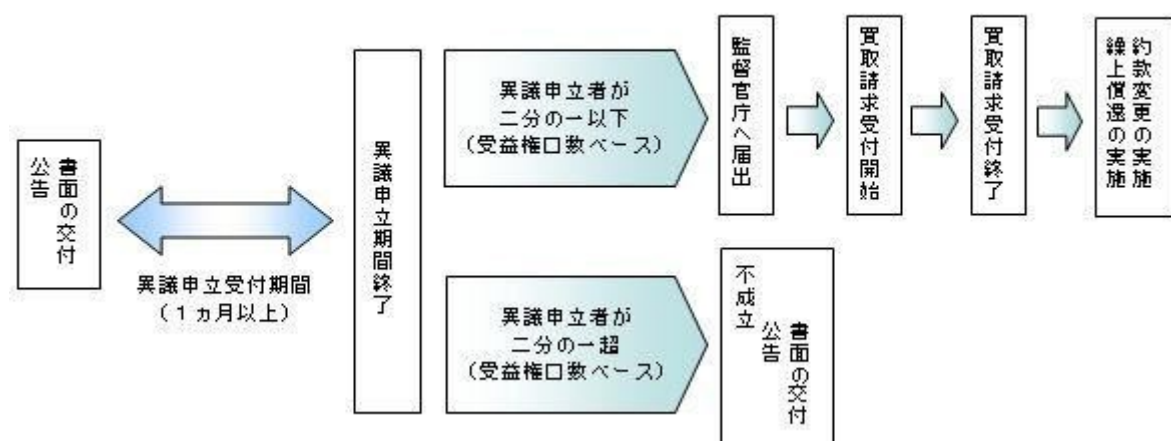
異議の申立て

1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

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

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

信託終了時の交換等

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

2) 交換は、委託会社の指定する販売会社で取り扱うものとします。

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

運用報告書の作成

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

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

(2) 受益権と信託財産に属する株式との交換権

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

(3) 受益権の買取請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2021年7月9日から2022年7月8日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【上場インデックスファンドTOPIX】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 2021年 7月 8日現在	第21期 2022年 7月 8日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	793,181,358,574	-
コール・ローン	65,310,122,994	1,003,540,348,062
株式	7,307,719,405,270	7,240,388,379,560
派生商品評価勘定	-	1,200,150
未収入金	89,125,181,980	119,112,308,740
未収配当金	8,875,490,976	6,717,011,072
未収利息	-	20,310,842
前払金	662,984,600	2,717,276,300
その他未収収益	561,000,504	4,526,232,897
流動資産合計	8,265,435,544,898	8,377,023,067,623
資産合計	8,265,435,544,898	8,377,023,067,623
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	383,239,650	527,383,050
未払金	934,521,200	1,866,136,100
未払収益分配金	136,556,861,213	176,243,978,536
未払受託者報酬	2,365,847,546	2,632,255,112
未払委託者報酬	4,712,782,060	5,284,714,044
未払利息	46,110	7,328
受入担保金	793,181,358,574	925,779,112,752
その他未払費用	570,574,733	590,287,824
流動負債合計	938,705,231,086	1,112,923,874,746
負債合計	938,705,231,086	1,112,923,874,746
純資産の部		
元本等		
元本	3,728,017,268,081	3,765,057,780,177
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,598,713,045,731	3,499,041,412,700
（分配準備積立金）	71,220,111	44,550,538
元本等合計	7,326,730,313,812	7,264,099,192,877
純資産合計	7,326,730,313,812	7,264,099,192,877
負債純資産合計	8,265,435,544,898	8,377,023,067,623

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	2020年 7月 9日	自	2021年 7月 9日
	至	2021年 7月 8日	至	2022年 7月 8日
営業収益				
受取配当金		137,398,497,567		171,519,171,301
受取利息		26,946		350,028,939
有価証券売買等損益		1,319,515,964,848		130,044,519,285
派生商品取引等損益		7,603,927,850		6,228,820,650
その他収益		8,393,144,584		15,067,995,307
営業収益合計		1,472,911,561,795		49,963,797,734
営業費用				
支払利息		4,966,627		-
受託者報酬		2,365,847,546		2,632,255,112
委託者報酬		4,712,782,060		5,284,714,044
その他費用		2,124,611,642		2,102,859,550
営業費用合計		9,208,207,875		10,019,828,706
営業利益又は営業損失（ ）		1,463,703,353,920		39,943,969,028
経常利益又は経常損失（ ）		1,463,703,353,920		39,943,969,028
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,463,703,353,920		39,943,969,028
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,005,204,541,536		3,598,713,045,731
剰余金増加額又は欠損金減少額		378,608,770,343		203,091,099,553
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		378,608,770,343		203,091,099,553
剰余金減少額又は欠損金増加額		112,246,758,855		166,462,723,076
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		112,246,758,855		166,462,723,076
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		136,556,861,213		176,243,978,536
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,598,713,045,731		3,499,041,412,700

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第20期 2021年 7月 8日現在	第21期 2022年 7月 8日現在
1.	期首元本額	3,391,590,051,686円	3,728,017,268,081円
	期中追加設定元本額	462,274,204,400円	195,963,939,200円
	期中一部交換元本額	125,846,988,005円	158,923,427,104円
2.	受益権の総数	3,739,234,973口	3,776,386,941口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	30,968,574,040円	28,423,811,920円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	740,913,762,170円	894,352,114,040円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日		第21期 自 2021年 7月 9日 至 2022年 7月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	当期配当等収益額 145,786,702,470円	A	当期配当等収益額 186,237,137,669円
B	分配準備積立金 44,620,102円	B	分配準備積立金 71,220,111円

C 配当等収益額合計 (A+B)	145,831,322,572円	C 配当等収益額合計 (A+B)	186,308,357,780円
D 経費	9,203,241,248円	D 経費	10,019,828,706円
E 収益分配可能額 (C-D)	136,628,081,324円	E 収益分配可能額 (C-D)	176,288,529,074円
F 収益分配金額	136,556,861,213円	F 収益分配金額	176,243,978,536円
G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	71,220,111円	G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	44,550,538円
H 口数	3,739,234,973口	H 口数	3,776,386,941口
I 分配金額 (100口当たり)	3,652円	I 分配金額 (100口当たり)	4,667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20期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日	第21期 自 2021年 7月 9日 至 2022年 7月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第20期 2021年 7月 8日現在	第21期 2022年 7月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引

	「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左 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20期(2021年7月8日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

第21期(2022年7月8日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	136,269,091,469
合計	136,269,091,469

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

第20期(2021年7月8日現在)

(単位:円)

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

合計	19,419,804,600	-	19,037,110,000	382,694,600
----	----------------	---	----------------	-------------

第21期(2022年7月8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	24,168,856,500	-	23,643,360,000	525,496,500
合計		24,168,856,500	-	23,643,360,000	525,496,500

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第20期 2021年7月8日現在		第21期 2022年7月8日現在	
1口当たり純資産額	1,959.42円	1口当たり純資産額	1,923.56円
(100口当たり純資産額)	(195,942円)	(100口当たり純資産額)	(192,356円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	131,600	3,495.00	459,942,000	貸付有価証券 92,300株
日本水産	3,761,700	567.00	2,132,883,900	貸付有価証券 82,000株

マルハニチロ	536,500	2,498.00	1,340,177,000	
雪国まいたけ	295,700	944.00	279,140,800	貸付有価証券 197,400株
カネコ種苗	114,500	1,580.00	180,910,000	貸付有価証券 100株
サカタのタネ	439,100	4,345.00	1,907,889,500	貸付有価証券 15,600株
ホクト	309,000	1,934.00	597,606,000	貸付有価証券 22,700株
ホクリヨウ	54,800	620.00	33,976,000	貸付有価証券 36,600株
住石ホールディングス	709,100	183.00	129,765,300	貸付有価証券 504,300株
日鉄鉱業	77,400	5,190.00	401,706,000	貸付有価証券 200株
三井松島ホールディングス	169,400	2,801.00	474,489,400	貸付有価証券 117,800株
I N P E X	14,127,100	1,374.00	19,410,635,400	貸付有価証券 10,695,300株
石油資源開発	476,400	3,105.00	1,479,222,000	貸付有価証券 28,300株
K & O エナジーグループ	157,500	1,498.00	235,935,000	貸付有価証券 3,200株
ショーボンドホールディングス	473,000	5,850.00	2,767,050,000	貸付有価証券 341,500株
ミライト・ワン	1,304,300	1,636.00	2,133,834,800	貸付有価証券 1,700株
タマホーム	245,500	2,371.00	582,080,500	貸付有価証券 174,500株
サンヨーホームズ	46,700	719.00	33,577,300	貸付有価証券 30,600株
日本アクア	161,000	581.00	93,541,000	
ファーストコーポレーション	99,000	721.00	71,379,000	貸付有価証券 38,300株
ベステラ	81,800	1,126.00	92,106,800	貸付有価証券 56,900株
Robot Home	675,200	178.00	120,185,600	貸付有価証券 10,800株
キャンディル	59,600	531.00	31,647,600	貸付有価証券 42,400株
ダイセキ環境ソリューション	77,900	857.00	66,760,300	貸付有価証券 48,300株
第一カッター興業	88,900	1,279.00	113,703,100	貸付有価証券 500株
安藤・間	1,844,200	851.00	1,569,414,200	貸付有価証券 900株
東急建設	1,087,700	618.00	672,198,600	貸付有価証券 44,800株
コムシスホールディングス	1,305,900	2,578.00	3,366,610,200	貸付有価証券 600株
ピーアールホールディングス	509,000	329.00	167,461,000	貸付有価証券 263,700株

高松コンストラクショングループ	258,000	2,020.00	521,160,000	貸付有価証券 166,700株
東建コーポレーション	112,300	8,060.00	905,138,000	貸付有価証券 78,800株
ソネック	41,700	999.00	41,658,300	貸付有価証券 29,500株
ヤマウラ	175,900	942.00	165,697,800	貸付有価証券 129,600株
オリエンタル白石	1,361,400	239.00	325,374,600	貸付有価証券 800株
大成建設	2,603,700	4,205.00	10,948,558,500	貸付有価証券 164,300株
大林組	8,687,100	957.00	8,313,554,700	貸付有価証券 423,200株
清水建設	8,033,300	747.00	6,000,875,100	貸付有価証券 493,800株
飛島建設	250,300	1,023.00	256,056,900	
長谷工コーポレーション	2,507,300	1,564.00	3,921,417,200	貸付有価証券 32,400株
松井建設	311,500	619.00	192,818,500	貸付有価証券 3,800株
銭高組	34,100	3,180.00	108,438,000	貸付有価証券 500株
鹿島建設	6,365,200	1,494.00	9,509,608,800	
不動テトラ	198,500	1,593.00	316,210,500	貸付有価証券 5,000株
大末建設	98,300	1,497.00	147,155,100	貸付有価証券 300株
鉄建建設	188,600	1,780.00	335,708,000	
西松建設	566,300	3,975.00	2,251,042,500	貸付有価証券 171,500株
三井住友建設	2,109,200	452.00	953,358,400	貸付有価証券 6,600株
大豊建設	136,600	4,165.00	568,939,000	貸付有価証券 90,200株
佐田建設	201,200	453.00	91,143,600	貸付有価証券 72,400株
ナカノフドー建設	223,700	300.00	67,110,000	貸付有価証券 66,100株
奥村組	465,500	2,955.00	1,375,552,500	
東鉄工業	367,800	2,356.00	866,536,800	
イチケン	67,400	1,794.00	120,915,600	貸付有価証券 100株
富士ピー・エス	120,600	455.00	54,873,000	貸付有価証券 84,000株
浅沼組	104,800	5,340.00	559,632,000	貸付有価証券 5,900株
戸田建設	3,586,000	699.00	2,506,614,000	
熊谷組	462,600	2,738.00	1,266,598,800	
北野建設	57,000	2,122.00	120,954,000	貸付有価証券 6,800株

植木組	76,400	1,334.00	101,917,600	貸付有価証券 54,700株
矢作建設工業	371,800	763.00	283,683,400	貸付有価証券 1,600株
ピーエス三菱	307,900	606.00	186,587,400	貸付有価証券 3,300株
日本ハウスホールディングス	629,700	393.00	247,472,100	貸付有価証券 410,100株
大東建託	957,500	11,960.00	11,451,700,000	貸付有価証券 10,200株
新日本建設	397,800	717.00	285,222,600	
東亜道路工業	48,300	5,590.00	269,997,000	
日本道路	81,400	6,250.00	508,750,000	貸付有価証券 41,100株
東亜建設工業	208,300	2,443.00	508,876,900	
日本国土開発	728,000	519.00	377,832,000	貸付有価証券 32,500株
若築建設	144,100	2,190.00	315,579,000	貸付有価証券 700株
東洋建設	1,048,800	861.00	903,016,800	貸付有価証券 601,400株
五洋建設	3,443,600	694.00	2,389,858,400	
世紀東急工業	449,100	804.00	361,076,400	
福田組	99,900	4,670.00	466,533,000	貸付有価証券 8,800株
住友林業	2,049,900	1,979.00	4,056,752,100	貸付有価証券 1,575,200株
日本基礎技術	228,500	597.00	136,414,500	貸付有価証券 3,000株
巴コーポレーション	339,800	443.00	150,531,400	貸付有価証券 100株
大和ハウス工業	7,404,600	3,209.00	23,761,361,400	貸付有価証券 117,300株
ライト工業	514,100	1,852.00	952,113,200	貸付有価証券 8,600株
積水ハウス	8,877,900	2,331.00	20,694,384,900	貸付有価証券 2,319,800株
日特建設	193,200	805.00	155,526,000	貸付有価証券 200株
北陸電気工事	166,500	744.00	123,876,000	
ユアテック	535,100	719.00	384,736,900	貸付有価証券 7,800株
日本リーテック	178,000	933.00	166,074,000	貸付有価証券 200株
四電工	90,400	1,714.00	154,945,600	
中電工	376,900	2,119.00	798,651,100	
関電工	1,521,100	842.00	1,280,766,200	貸付有価証券 6,800株
きんでん	1,900,000	1,579.00	3,000,100,000	貸付有価証券 63,400株

東京エネシス	276,100	1,009.00	278,584,900	
トーエネック	94,000	3,565.00	335,110,000	
住友電設	231,000	2,587.00	597,597,000	
日本電設工業	399,000	1,777.00	709,023,000	貸付有価証券 4,700株
エクシオグループ	1,298,300	2,107.00	2,735,518,100	貸付有価証券 1,200株
新日本空調	202,400	1,815.00	367,356,000	貸付有価証券 1,800株
九電工	590,700	2,717.00	1,604,931,900	
三機工業	607,800	1,556.00	945,736,800	
日揮ホールディングス	2,642,100	1,649.00	4,356,822,900	貸付有価証券 189,600株
中外炉工業	86,700	1,630.00	141,321,000	
ヤマト	224,400	749.00	168,075,600	貸付有価証券 500株
太平電業	169,600	2,833.00	480,476,800	貸付有価証券 1,100株
高砂熱学工業	715,600	1,624.00	1,162,134,400	
三晃金属工業	36,700	2,655.00	97,438,500	
朝日工業社	113,400	1,813.00	205,594,200	貸付有価証券 1,100株
明星工業	470,000	695.00	326,650,000	貸付有価証券 356,900株
大気社	389,900	3,095.00	1,206,740,500	貸付有価証券 600株
ダイダン	175,600	2,099.00	368,584,400	貸付有価証券 500株
日比谷総合設備	254,800	1,899.00	483,865,200	貸付有価証券 400株
フィル・カンパニー	48,100	1,281.00	61,616,100	貸付有価証券 13,900株
テスホールディングス	260,400	1,188.00	309,355,200	貸付有価証券 173,600株
インフロニア・ホールディングス	3,257,300	940.00	3,061,862,000	貸付有価証券 39,000株
東洋エンジニアリング	392,900	625.00	245,562,500	貸付有価証券 174,300株
レイズネクスト	401,300	1,143.00	458,685,900	
ニッポン	730,000	1,650.00	1,204,500,000	
日清製粉グループ本社	2,818,900	1,634.00	4,606,082,600	貸付有価証券 51,600株
日東富士製粉	43,500	4,515.00	196,402,500	貸付有価証券 200株
昭和産業	236,100	2,582.00	609,610,200	
鳥越製粉	217,000	649.00	140,833,000	貸付有価証券 2,600株
中部飼料	309,400	1,063.00	328,892,200	貸付有価証券 8,400株

フィード・ワン	356,300	678.00	241,571,400	貸付有価証券 1,700株
東洋精糖	50,500	936.00	47,268,000	貸付有価証券 2,500株
日本甜菜製糖	156,100	1,690.00	263,809,000	貸付有価証券 300株
D M三井製糖ホールディングス	241,800	1,915.00	463,047,000	貸付有価証券 79,200株
塩水港精糖	356,500	206.00	73,439,000	貸付有価証券 250,200株
日新製糖	141,700	1,762.00	249,675,400	貸付有価証券 98,300株
森永製菓	602,300	4,375.00	2,635,062,500	貸付有価証券 6,200株
中村屋	60,900	3,135.00	190,921,500	貸付有価証券 47,100株
江崎グリコ	697,500	4,015.00	2,800,462,500	貸付有価証券 513,300株
名糖産業	107,900	1,658.00	178,898,200	貸付有価証券 76,500株
井村屋グループ	145,400	2,280.00	331,512,000	貸付有価証券 400株
不二家	167,200	2,401.00	401,447,200	貸付有価証券 107,200株
山崎製パン	1,836,200	1,718.00	3,154,591,600	貸付有価証券 910,100株
第一屋製パン	57,800	494.00	28,553,200	貸付有価証券 29,900株
モロゾフ	88,400	3,625.00	320,450,000	貸付有価証券 62,800株
亀田製菓	155,000	4,645.00	719,975,000	貸付有価証券 2,200株
寿スピリッツ	259,400	6,300.00	1,634,220,000	貸付有価証券 13,200株
カルビー	1,364,400	2,822.00	3,850,336,800	貸付有価証券 58,700株
森永乳業	507,800	5,120.00	2,599,936,000	貸付有価証券 98,800株
六甲バター	198,700	1,396.00	277,385,200	貸付有価証券 36,700株
ヤクルト本社	1,901,000	8,010.00	15,227,010,000	貸付有価証券 900株
明治ホールディングス	1,649,000	7,010.00	11,559,490,000	貸付有価証券 319,000株
雪印メグミルク	655,300	1,881.00	1,232,619,300	貸付有価証券 82,600株
プリマハム	374,300	2,292.00	857,895,600	貸付有価証券 10,500株
日本ハム	1,048,900	4,300.00	4,510,270,000	貸付有価証券 1,500株
林兼産業	90,800	480.00	43,584,000	貸付有価証券 9,300株

丸大食品	270,000	1,556.00	420,120,000	貸付有価証券 1,500株
S Foods	269,000	3,120.00	839,280,000	貸付有価証券 187,100株
柿安本店	103,700	2,386.00	247,428,200	貸付有価証券 4,400株
伊藤ハム米久ホールディングス	1,927,800	690.00	1,330,182,000	貸付有価証券 336,800株
サッポロホールディングス	875,700	2,902.00	2,541,281,400	貸付有価証券 431,900株
アサヒグループホールディングス	6,104,400	4,457.00	27,207,310,800	貸付有価証券 4,341,100株
キリンホールディングス	11,004,600	2,175.50	23,940,507,300	貸付有価証券 7,557,600株
宝ホールディングス	1,664,600	1,011.00	1,682,910,600	貸付有価証券 500株
オエノンホールディングス	789,600	305.00	240,828,000	
養命酒製造	80,200	1,782.00	142,916,400	貸付有価証券 58,800株
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	1,910,400	1,521.00	2,905,718,400	貸付有価証券 1,326,300株
サントリー食品インターナショナル	2,003,300	5,100.00	10,216,830,000	貸付有価証券 1,367,700株
ダイドーグループホールディングス	153,500	5,040.00	773,640,000	貸付有価証券 76,000株
伊藤園	908,900	6,250.00	5,680,625,000	貸付有価証券 635,800株
キーコーヒー	273,200	2,086.00	569,895,200	貸付有価証券 195,500株
ユニカフェ	89,800	920.00	82,616,000	貸付有価証券 63,900株
ジャパンフーズ	42,500	1,130.00	48,025,000	貸付有価証券 28,900株
日清オイリオグループ	343,500	3,215.00	1,104,352,500	
不二製油グループ本社	648,900	2,316.00	1,502,852,400	貸付有価証券 9,900株
かどや製油	26,100	3,540.00	92,394,000	貸付有価証券 17,200株
J - オイルミルズ	279,300	1,625.00	453,862,500	貸付有価証券 183,000株
キッコーマン	1,795,700	7,720.00	13,862,804,000	貸付有価証券 118,300株
味の素	5,968,200	3,431.00	20,476,894,200	貸付有価証券 326,100株
ブルドックソース	106,600	1,894.00	201,900,400	貸付有価証券 82,800株
キューピー	1,310,500	2,297.00	3,010,218,500	貸付有価証券 31,000株
ハウス食品グループ本社	933,100	2,941.00	2,744,247,100	貸付有価証券 96,100株
カゴメ	1,136,200	3,375.00	3,834,675,000	貸付有価証券 808,000株

焼津水産化学工業	120,900	923.00	111,590,700	貸付有価証券 25,700株
アリアケジャパン	273,500	5,530.00	1,512,455,000	
ピエトロ	39,100	1,834.00	71,709,400	貸付有価証券 27,800株
エバラ食品工業	65,400	3,005.00	196,527,000	貸付有価証券 43,300株
やまみ	25,800	1,663.00	42,905,400	貸付有価証券 2,100株
ニチレイ	1,117,000	2,416.00	2,698,672,000	貸付有価証券 300株
東洋水産	1,335,100	5,350.00	7,142,785,000	
イトアンドホールディングス	112,900	2,284.00	257,863,600	貸付有価証券 80,200株
大冷	33,400	1,908.00	63,727,200	貸付有価証券 23,700株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	154,200	481.00	74,170,200	貸付有価証券 40,700株
日清食品ホールディングス	965,300	9,720.00	9,382,716,000	貸付有価証券 16,900株
永谷園ホールディングス	132,900	2,008.00	266,863,200	貸付有価証券 90,400株
一正蒲鉾	116,200	790.00	91,798,000	貸付有価証券 84,400株
フジッコ	278,300	1,990.00	553,817,000	貸付有価証券 31,100株
ロック・フィールド	297,700	1,467.00	436,725,900	貸付有価証券 211,500株
日本たばこ産業	16,053,600	2,342.50	37,605,558,000	貸付有価証券 11,179,400株
ケンコーマヨネーズ	152,600	1,455.00	222,033,000	貸付有価証券 111,300株
わらべや日洋ホールディングス	179,600	2,188.00	392,964,800	貸付有価証券 6,900株
なとり	167,100	2,044.00	341,552,400	貸付有価証券 113,600株
イフジ産業	52,200	953.00	49,746,600	貸付有価証券 33,400株
ピックルスコーポレーション	142,900	1,127.00	161,048,300	貸付有価証券 200株
ファーマフーズ	377,000	1,439.00	542,503,000	貸付有価証券 268,100株
ユーグレナ	1,545,000	915.00	1,413,675,000	貸付有価証券 1,098,600株
紀文食品	232,600	987.00	229,576,200	貸付有価証券 163,500株
ミヨシ油脂	105,000	1,023.00	107,415,000	貸付有価証券 75,100株
理研ビタミン	210,800	1,708.00	360,046,400	貸付有価証券 99,000株
片倉工業	260,900	2,055.00	536,149,500	貸付有価証券 90,400株

グンゼ	169,400	3,730.00	631,862,000	
東洋紡	1,154,700	1,037.00	1,197,423,900	貸付有価証券 76,300株
ユニチカ	802,300	234.00	187,738,200	貸付有価証券 334,300株
富士紡ホールディングス	119,400	3,340.00	398,796,000	
倉敷紡績	203,800	2,006.00	408,822,800	貸付有価証券 500株
シキボウ	153,100	890.00	136,259,000	貸付有価証券 22,300株
日本毛織	720,900	981.00	707,202,900	貸付有価証券 900株
ダイトウボウ	475,100	90.00	42,759,000	貸付有価証券 334,900株
トーア紡コーポレーション	107,600	369.00	39,704,400	貸付有価証券 7,300株
ダイドーリミテッド	419,000	183.00	76,677,000	貸付有価証券 281,200株
帝国繊維	305,000	1,662.00	506,910,000	貸付有価証券 11,900株
帝人	2,566,800	1,419.00	3,642,289,200	
東レ	18,132,400	747.60	13,555,782,240	
住江織物	49,800	1,658.00	82,568,400	貸付有価証券 37,000株
日本フェルト	165,400	411.00	67,979,400	貸付有価証券 115,100株
イチカワ	34,500	1,393.00	48,058,500	貸付有価証券 14,300株
日東製網	31,400	1,309.00	41,102,600	貸付有価証券 13,400株
アツギ	208,500	490.00	102,165,000	貸付有価証券 18,900株
ダイニック	94,500	622.00	58,779,000	貸付有価証券 34,700株
セーレン	538,800	2,028.00	1,092,686,400	貸付有価証券 392,400株
ソトー	106,500	845.00	89,992,500	貸付有価証券 11,000株
東海染工	33,500	1,135.00	38,022,500	貸付有価証券 2,400株
小松マテーレ	439,500	1,071.00	470,704,500	貸付有価証券 6,300株
ワコールホールディングス	597,400	2,077.00	1,240,799,800	
ホギメディカル	363,200	3,255.00	1,182,216,000	貸付有価証券 19,400株
クラウディアホールディングス	62,800	253.00	15,888,400	貸付有価証券 39,400株
T S Iホールディングス	887,200	336.00	298,099,200	貸付有価証券 111,900株
マツオカコーポレーション	84,000	929.00	78,036,000	

ワールド	382,200	1,265.00	483,483,000	貸付有価証券 5,500株
三陽商会	128,600	866.00	111,367,600	貸付有価証券 1,100株
ナイガイ	98,900	287.00	28,384,300	貸付有価証券 65,500株
オンワードホールディングス	1,608,900	247.00	397,398,300	貸付有価証券 225,300株
ルックホールディングス	92,900	1,602.00	148,825,800	貸付有価証券 5,600株
キムラタン	1,638,500	22.00	36,047,000	貸付有価証券 1,165,500株
ゴールドウイン	483,400	7,810.00	3,775,354,000	
デサント	498,700	3,225.00	1,608,307,500	貸付有価証券 34,300株
キング	137,700	509.00	70,089,300	貸付有価証券 97,500株
ヤマトインターナショナル	217,000	281.00	60,977,000	貸付有価証券 170,500株
特種東海製紙	151,800	3,090.00	469,062,000	貸付有価証券 9,100株
王子ホールディングス	11,273,900	563.00	6,347,205,700	貸付有価証券 274,400株
日本製紙	1,184,400	971.00	1,150,052,400	貸付有価証券 838,200株
三菱製紙	373,000	294.00	109,662,000	貸付有価証券 40,600株
北越コーポレーション	1,741,800	715.00	1,245,387,000	貸付有価証券 307,700株
中越パルプ工業	111,300	906.00	100,837,800	貸付有価証券 11,900株
巴川製紙所	86,600	609.00	52,739,400	貸付有価証券 32,000株
大王製紙	1,252,300	1,454.00	1,820,844,200	貸付有価証券 889,300株
阿波製紙	65,900	302.00	19,901,800	貸付有価証券 38,500株
レンゴー	2,259,400	741.00	1,674,215,400	
トモク	143,300	1,500.00	214,950,000	貸付有価証券 51,100株
ザ・バック	184,300	2,326.00	428,681,800	貸付有価証券 136,300株
北の達人コーポレーション	1,045,300	214.00	223,694,200	貸付有価証券 743,100株
クラレ	3,943,900	1,071.00	4,223,916,900	貸付有価証券 2,085,600株
旭化成	18,074,100	1,055.50	19,077,212,550	貸付有価証券 149,600株
共和レザー	158,800	561.00	89,086,800	貸付有価証券 26,000株
昭和電工	2,568,800	2,222.00	5,707,873,600	貸付有価証券 755,800株

住友化学	19,932,000	525.00	10,464,300,000	貸付有価証券 854,900株
住友精化	116,500	2,876.00	335,054,000	貸付有価証券 500株
日産化学	1,315,200	6,510.00	8,561,952,000	貸付有価証券 46,200株
ラサ工業	103,000	1,815.00	186,945,000	貸付有価証券 500株
クレハ	212,000	10,030.00	2,126,360,000	貸付有価証券 1,700株
多木化学	96,400	4,465.00	430,426,000	貸付有価証券 37,500株
テイカ	166,700	1,201.00	200,206,700	
石原産業	523,600	1,014.00	530,930,400	貸付有価証券 1,500株
片倉コープアグリ	65,900	1,257.00	82,836,300	貸付有価証券 2,000株
日本曹達	320,200	4,235.00	1,356,047,000	
東ソー	3,613,000	1,712.00	6,185,456,000	貸付有価証券 22,500株
トクヤマ	867,900	1,752.00	1,520,560,800	貸付有価証券 1,200株
セントラル硝子	437,800	3,095.00	1,354,991,000	貸付有価証券 38,500株
東亜合成	1,391,400	1,037.00	1,442,881,800	貸付有価証券 8,100株
大阪ソーダ	222,800	3,270.00	728,556,000	貸付有価証券 7,700株
関東電化工業	533,000	882.00	470,106,000	貸付有価証券 39,700株
デンカ	984,200	3,315.00	3,262,623,000	貸付有価証券 3,500株
信越化学工業	4,630,800	15,980.00	74,000,184,000	貸付有価証券 99,600株
日本カーバイド工業	104,400	1,341.00	140,000,400	
堺化学工業	188,900	1,857.00	350,787,300	貸付有価証券 14,800株
第一稀元素化学工業	248,600	1,187.00	295,088,200	貸付有価証券 11,900株
エア・ウォーター	2,340,700	1,698.00	3,974,508,600	貸付有価証券 46,000株
日本酸素ホールディングス	2,406,700	2,184.00	5,256,232,800	貸付有価証券 14,900株
日本化学工業	82,600	1,932.00	159,583,200	
東邦アセチレン	58,400	1,108.00	64,707,200	貸付有価証券 1,000株
日本パーカライズン	1,228,100	938.00	1,151,957,800	貸付有価証券 20,900株
高圧ガス工業	411,800	666.00	274,258,800	
チタン工業	33,600	1,610.00	54,096,000	貸付有価証券 11,800株

四国化成工業	337,700	1,231.00	415,708,700	貸付有価証券 100株
戸田工業	62,200	2,295.00	142,749,000	貸付有価証券 20,600株
ステラ ケミファ	146,900	2,431.00	357,113,900	貸付有価証券 4,600株
保土谷化学工業	77,900	3,270.00	254,733,000	貸付有価証券 1,000株
日本触媒	415,700	5,220.00	2,169,954,000	貸付有価証券 11,100株
大日精化工業	206,900	1,775.00	367,247,500	
カネカ	629,800	3,375.00	2,125,575,000	貸付有価証券 16,000株
三菱瓦斯化学	2,299,800	1,943.00	4,468,511,400	貸付有価証券 7,800株
三井化学	2,274,500	2,835.00	6,448,207,500	
J S R	2,722,600	3,505.00	9,542,713,000	貸付有価証券 531,200株
東京応化工業	434,000	6,820.00	2,959,880,000	貸付有価証券 329,200株
大阪有機化学工業	207,500	2,481.00	514,807,500	貸付有価証券 9,900株
三菱ケミカルグループ	18,136,000	744.20	13,496,811,200	貸付有価証券 211,200株
K Hネオケム	447,300	2,442.00	1,092,306,600	貸付有価証券 318,000株
ダイセル	3,928,100	835.00	3,279,963,500	
住友ベークライト	413,400	4,120.00	1,703,208,000	貸付有価証券 5,300株
積水化学工業	5,580,700	1,858.00	10,368,940,600	貸付有価証券 5,000株
日本ゼオン	2,195,700	1,359.00	2,983,956,300	
アイカ工業	688,600	3,015.00	2,076,129,000	貸付有価証券 114,500株
U B E	1,377,000	2,028.00	2,792,556,000	貸付有価証券 309,000株
積水樹脂	401,100	1,725.00	691,897,500	
タキロンシーアイ	632,100	539.00	340,701,900	貸付有価証券 1,800株
旭有機材	165,100	1,938.00	319,963,800	貸付有価証券 22,200株
ニチバン	153,700	1,615.00	248,225,500	貸付有価証券 11,200株
リケンテクノス	593,800	435.00	258,303,000	
大倉工業	126,500	1,688.00	213,532,000	貸付有価証券 1,000株
積水化成品工業	348,200	409.00	142,413,800	貸付有価証券 10,700株
群栄化学工業	58,300	2,539.00	148,023,700	貸付有価証券 500株

タイガースポリマー	139,700	426.00	59,512,200	貸付有価証券 9,600株
ミライアル	93,700	1,720.00	161,164,000	貸付有価証券 13,100株
ダイキアクシス	113,900	692.00	78,818,800	貸付有価証券 75,400株
ダイキョーニシカワ	616,000	524.00	322,784,000	貸付有価証券 373,700株
竹本容器	104,400	763.00	79,657,200	貸付有価証券 72,700株
森六ホールディングス	141,400	1,784.00	252,257,600	
恵和	80,300	3,390.00	272,217,000	
日本化薬	2,052,900	1,099.00	2,256,137,100	貸付有価証券 48,600株
カーリットホールディングス	245,000	673.00	164,885,000	貸付有価証券 192,400株
日本精化	188,000	1,920.00	360,960,000	貸付有価証券 46,900株
扶桑化学工業	230,200	3,480.00	801,096,000	
トリケミカル研究所	301,000	2,144.00	645,344,000	
A D E K A	1,153,300	2,296.00	2,647,976,800	貸付有価証券 1,700株
日油	844,000	5,140.00	4,338,160,000	
新日本理化	414,400	262.00	108,572,800	
ハリマ化成グループ	193,200	750.00	144,900,000	貸付有価証券 3,800株
花王	6,159,000	5,708.00	35,155,572,000	貸付有価証券 4,379,900株
第一工業製薬	99,000	2,301.00	227,799,000	
石原ケミカル	135,900	1,276.00	173,408,400	貸付有価証券 95,300株
日華化学	98,400	811.00	79,802,400	貸付有価証券 7,900株
ニイタカ	55,000	2,074.00	114,070,000	貸付有価証券 300株
三洋化成工業	174,400	4,700.00	819,680,000	貸付有価証券 1,200株
有機合成薬品工業	203,600	267.00	54,361,200	貸付有価証券 124,700株
大日本塗料	330,200	711.00	234,772,200	貸付有価証券 237,700株
日本ペイントホールディングス	10,977,500	1,112.00	12,206,980,000	貸付有価証券 4,588,000株
関西ペイント	2,525,000	1,853.00	4,678,825,000	貸付有価証券 68,300株
神東塗料	229,600	148.00	33,980,800	貸付有価証券 108,000株
中国塗料	631,700	894.00	564,739,800	貸付有価証券 62,800株
日本特殊塗料	175,000	969.00	169,575,000	

藤倉化成	363,600	472.00	171,619,200	貸付有価証券 18,500株
太陽ホールディングス	430,400	2,792.00	1,201,676,800	
D I C	1,057,600	2,426.00	2,565,737,600	貸付有価証券 752,000株
サカタイクス	501,700	944.00	473,604,800	貸付有価証券 100株
東洋インキ S C ホールディングス	539,800	1,895.00	1,022,921,000	貸付有価証券 406,500株
T & K T O K A	235,500	819.00	192,874,500	貸付有価証券 156,300株
富士フイルムホールディングス	5,243,000	7,622.00	39,962,146,000	貸付有価証券 300株
資生堂	5,557,000	5,552.00	30,852,464,000	貸付有価証券 524,700株
ライオン	2,980,300	1,516.00	4,518,134,800	貸付有価証券 1,314,800株
高砂香料工業	168,000	2,500.00	420,000,000	貸付有価証券 100株
マンダム	581,100	1,620.00	941,382,000	貸付有価証券 60,800株
ミルボン	368,100	5,070.00	1,866,267,000	貸付有価証券 44,800株
ファンケル	1,207,300	2,532.00	3,056,883,600	貸付有価証券 1,800株
コーセー	561,200	12,260.00	6,880,312,000	貸付有価証券 145,600株
コタ	208,000	1,565.00	325,520,000	
シーボン	38,700	1,698.00	65,712,600	貸付有価証券 12,600株
ポーラ・オルビスホールディングス	1,273,300	1,634.00	2,080,572,200	貸付有価証券 905,500株
ノエビアホールディングス	221,400	5,860.00	1,297,404,000	貸付有価証券 85,300株
アジュバンホールディングス	67,100	984.00	66,026,400	貸付有価証券 24,600株
新日本製薬	141,700	1,515.00	214,675,500	貸付有価証券 100,700株
エステー	191,700	1,550.00	297,135,000	貸付有価証券 49,700株
アグロ カネショウ	99,300	1,244.00	123,529,200	貸付有価証券 5,100株
コニシ	452,400	1,562.00	706,648,800	
長谷川香料	514,200	2,939.00	1,511,233,800	貸付有価証券 44,800株
星光 P M C	168,500	528.00	88,968,000	貸付有価証券 7,700株
小林製薬	835,900	8,830.00	7,380,997,000	貸付有価証券 324,000株
荒川化学工業	210,400	981.00	206,402,400	貸付有価証券 16,800株

メック	204,500	2,256.00	461,352,000	貸付有価証券 17,200株
日本高純度化学	70,200	2,253.00	158,160,600	
タカラバイオ	780,700	1,984.00	1,548,908,800	
J C U	306,100	3,420.00	1,046,862,000	貸付有価証券 100株
新田ゼラチン	170,200	611.00	103,992,200	貸付有価証券 54,200株
O A Tアグリオ	123,100	1,548.00	190,558,800	貸付有価証券 7,800株
デクセリアルズ	776,700	3,545.00	2,753,401,500	貸付有価証券 45,100株
アース製薬	245,400	5,400.00	1,325,160,000	貸付有価証券 174,500株
北興化学工業	250,000	918.00	229,500,000	貸付有価証券 3,000株
大成ラミック	78,300	2,674.00	209,374,200	
クミアイ化学工業	1,110,200	1,048.00	1,163,489,600	
日本農薬	531,400	651.00	345,941,400	
アキレス	191,000	1,357.00	259,187,000	貸付有価証券 38,900株
有沢製作所	404,800	1,000.00	404,800,000	貸付有価証券 900株
日東電工	1,803,100	8,550.00	15,416,505,000	貸付有価証券 13,100株
レック	353,500	664.00	234,724,000	貸付有価証券 251,300株
三光合成	341,100	329.00	112,221,900	
きもと	456,600	222.00	101,365,200	貸付有価証券 800株
藤森工業	232,000	3,495.00	810,840,000	貸付有価証券 5,400株
前澤化成工業	174,900	1,293.00	226,145,700	貸付有価証券 85,800株
未来工業	106,700	1,492.00	159,196,400	
ウェーブロックホールディングス	113,300	627.00	71,039,100	貸付有価証券 1,200株
J S P	174,600	1,433.00	250,201,800	貸付有価証券 115,900株
エフピコ	548,300	2,872.00	1,574,717,600	
天馬	234,400	2,275.00	533,260,000	貸付有価証券 2,800株
信越ポリマー	535,700	1,208.00	647,125,600	貸付有価証券 3,700株
東リ	680,900	203.00	138,222,700	貸付有価証券 13,900株
ニフコ	995,700	3,205.00	3,191,218,500	貸付有価証券 16,500株
バルカー	242,300	2,582.00	625,618,600	貸付有価証券 11,200株

ユニ・チャーム	5,750,000	4,798.00	27,588,500,000	貸付有価証券 2,005,300株
ショーエイコーポレーション	80,000	582.00	46,560,000	貸付有価証券 52,900株
協和キリン	3,000,800	3,130.00	9,392,504,000	貸付有価証券 1,255,200株
武田薬品工業	23,447,200	3,884.00	91,068,924,800	代用有価証券 550,000株 貸付有価証券 307,800株
アステラス製薬	25,504,700	2,122.00	54,120,973,400	貸付有価証券 183,000株
住友ファーマ	1,842,700	1,103.00	2,032,498,100	
塩野義製薬	3,463,000	7,063.00	24,459,169,000	貸付有価証券 10,200株
わかもと製薬	290,300	259.00	75,187,700	貸付有価証券 28,100株
日本新薬	650,600	8,310.00	5,406,486,000	貸付有価証券 320,100株
中外製薬	9,330,600	3,657.00	34,122,004,200	貸付有価証券 6,111,000株
科研製薬	425,500	3,895.00	1,657,322,500	貸付有価証券 49,500株
エーザイ	3,296,000	6,096.00	20,092,416,000	貸付有価証券 11,000株
ロート製薬	1,421,800	4,010.00	5,701,418,000	貸付有価証券 2,400株
小野薬品工業	5,750,600	3,756.00	21,599,253,600	
久光製薬	631,000	3,380.00	2,132,780,000	貸付有価証券 32,200株
持田製薬	334,800	3,335.00	1,116,558,000	
参天製薬	5,195,800	1,078.00	5,601,072,400	
扶桑薬品工業	96,300	2,093.00	201,555,900	貸付有価証券 900株
日本ケミファ	31,600	1,865.00	58,934,000	貸付有価証券 5,700株
ツムラ	853,100	3,160.00	2,695,796,000	
日医工	859,500	360.00	309,420,000	貸付有価証券 611,100株
キッセイ薬品工業	431,900	2,687.00	1,160,515,300	貸付有価証券 4,800株
生化学工業	526,200	847.00	445,691,400	貸付有価証券 20,300株
栄研化学	443,600	1,859.00	824,652,400	貸付有価証券 32,800株
日水製薬	109,600	1,713.00	187,744,800	貸付有価証券 400株
鳥居薬品	160,100	3,275.00	524,327,500	貸付有価証券 500株
JCRファーマ	840,800	2,555.00	2,148,244,000	貸付有価証券 588,200株

東和薬品	429,400	2,630.00	1,129,322,000	貸付有価証券 1,600株
富士製薬工業	160,500	973.00	156,166,500	
ゼリア新薬工業	442,800	2,180.00	965,304,000	貸付有価証券 87,100株
第一三共	21,639,400	3,443.00	74,504,454,200	
キョーリン製薬ホールディングス	538,500	1,800.00	969,300,000	
大幸薬品	449,700	589.00	264,873,300	貸付有価証券 319,700株
ダイト	185,300	2,836.00	525,510,800	貸付有価証券 1,800株
大塚ホールディングス	5,683,100	4,879.00	27,727,844,900	貸付有価証券 3,322,000株
大正製薬ホールディングス	552,000	5,410.00	2,986,320,000	貸付有価証券 4,700株
ペプチドリーム	1,565,400	1,562.00	2,445,154,800	貸付有価証券 116,100株
あすか製薬ホールディングス	283,100	1,036.00	293,291,600	貸付有価証券 700株
サワイグループホールディングス	572,300	4,250.00	2,432,275,000	貸付有価証券 25,000株
日本コークス工業	2,520,400	116.00	292,366,400	貸付有価証券 37,800株
ニチレキ	322,800	1,324.00	427,387,200	
ユシロ化学工業	141,600	901.00	127,581,600	貸付有価証券 1,500株
ビーピー・カストロール	106,400	1,110.00	118,104,000	貸付有価証券 1,500株
富士石油	651,600	304.00	198,086,400	貸付有価証券 20,100株
MORESCO	98,800	1,220.00	120,536,000	
出光興産	3,034,600	3,180.00	9,650,028,000	
ENEOSホールディングス	44,876,600	499.40	22,411,374,040	
コスモエネルギーホールディングス	1,177,700	3,405.00	4,010,068,500	貸付有価証券 242,500株
横浜ゴム	1,413,300	1,919.00	2,712,122,700	貸付有価証券 668,400株
TOYO TIRE	1,427,300	1,750.00	2,497,775,000	貸付有価証券 996,900株
ブリヂストン	7,932,100	4,966.00	39,390,808,600	貸付有価証券 2,031,400株
住友ゴム工業	2,436,200	1,215.00	2,959,983,000	貸付有価証券 1,760,700株
藤倉コンポジット	238,900	859.00	205,215,100	貸付有価証券 115,200株
オカモト	137,800	3,835.00	528,463,000	貸付有価証券 400株
フコク	130,500	950.00	123,975,000	
ニッタ	280,400	2,746.00	769,978,400	貸付有価証券 4,600株

住友理工	578,100	584.00	337,610,400	貸付有価証券 27,500株
三ツ星ベルト	362,400	2,840.00	1,029,216,000	
バンドー化学	481,000	937.00	450,697,000	貸付有価証券 3,500株
日東紡績	369,900	2,263.00	837,083,700	
A G C	2,527,800	4,760.00	12,032,328,000	貸付有価証券 1,327,400株
日本板硝子	1,348,900	388.00	523,373,200	貸付有価証券 842,800株
石塚硝子	46,900	1,604.00	75,227,600	貸付有価証券 33,600株
日本山村硝子	103,200	689.00	71,104,800	貸付有価証券 1,200株
日本電気硝子	1,106,100	2,640.00	2,920,104,000	貸付有価証券 786,500株
オハラ	117,900	1,167.00	137,589,300	貸付有価証券 77,200株
住友大阪セメント	445,100	3,550.00	1,580,105,000	貸付有価証券 195,400株
太平洋セメント	1,694,700	1,961.00	3,323,306,700	貸付有価証券 177,800株
日本ヒューム	244,600	649.00	158,745,400	
日本コンクリート工業	535,200	263.00	140,757,600	貸付有価証券 60,200株
三谷セキサン	121,500	4,185.00	508,477,500	貸付有価証券 4,800株
アジアパイルホールディングス	423,300	466.00	197,257,800	貸付有価証券 5,600株
東海カーボン	2,291,700	1,033.00	2,367,326,100	貸付有価証券 550,500株
日本カーボン	153,400	4,000.00	613,600,000	貸付有価証券 13,200株
東洋炭素	175,000	2,895.00	506,625,000	貸付有価証券 21,500株
ノリタケカンパニーリミテド	151,200	4,155.00	628,236,000	
T O T O	1,803,100	4,570.00	8,240,167,000	貸付有価証券 2,800株
日本碍子	2,937,900	1,842.00	5,411,611,800	貸付有価証券 13,700株
日本特殊陶業	2,080,100	2,422.00	5,038,002,200	
ダントーホールディングス	194,400	290.00	56,376,000	貸付有価証券 138,300株
M A R U W A	103,100	15,130.00	1,559,903,000	貸付有価証券 14,000株
品川リフラクトリーズ	69,900	3,530.00	246,747,000	
黒崎播磨	50,700	4,310.00	218,517,000	貸付有価証券 3,100株
ヨータイ	189,600	1,456.00	276,057,600	貸付有価証券 5,200株

東京窯業	294,800	271.00	79,890,800	貸付有価証券 124,900株
ニッカトー	123,600	450.00	55,620,000	貸付有価証券 60,900株
フジインコーポレーテッド	239,200	5,480.00	1,310,816,000	貸付有価証券 35,600株
クニミネ工業	93,700	919.00	86,110,300	貸付有価証券 7,000株
エーアンドエーマテリアル	50,400	858.00	43,243,200	貸付有価証券 34,500株
ニチアス	628,100	2,311.00	1,451,539,100	
ニチ八	380,300	2,622.00	997,146,600	貸付有価証券 10,300株
日本製鉄	12,322,200	1,930.00	23,781,846,000	貸付有価証券 1,906,700株
神戸製鋼所	5,139,100	617.00	3,170,824,700	貸付有価証券 127,000株
中山製鋼所	409,000	426.00	174,234,000	貸付有価証券 800株
合同製鐵	142,900	1,363.00	194,772,700	貸付有価証券 3,100株
J F E ホールディングス	6,828,900	1,468.00	10,024,825,200	貸付有価証券 1,870,000株
東京製鐵	861,700	1,456.00	1,254,635,200	貸付有価証券 33,700株
共英製鋼	291,100	1,381.00	402,009,100	貸付有価証券 193,500株
大和工業	481,600	4,360.00	2,099,776,000	貸付有価証券 3,100株
東京鐵鋼	121,400	1,241.00	150,657,400	貸付有価証券 86,300株
大阪製鐵	156,600	1,430.00	223,938,000	貸付有価証券 111,000株
淀川製鋼所	322,700	2,325.00	750,277,500	貸付有価証券 256,900株
丸一鋼管	855,800	2,851.00	2,439,885,800	貸付有価証券 284,000株
モリ工業	71,900	2,399.00	172,488,100	
大同特殊鋼	402,400	3,590.00	1,444,616,000	
日本高周波鋼業	108,800	319.00	34,707,200	貸付有価証券 47,300株
日本冶金工業	200,900	2,156.00	433,140,400	貸付有価証券 123,200株
山陽特殊製鋼	252,400	1,882.00	475,016,800	貸付有価証券 1,900株
愛知製鋼	165,800	2,064.00	342,211,200	貸付有価証券 9,900株
日立金属	3,177,900	2,041.00	6,486,093,900	貸付有価証券 993,400株
日本金属	74,500	1,187.00	88,431,500	貸付有価証券 10,500株

大太平洋金属	181,300	2,366.00	428,955,800	貸付有価証券 38,300株
新日本電工	1,632,200	347.00	566,373,400	貸付有価証券 22,100株
栗本鐵工所	121,300	1,641.00	199,053,300	貸付有価証券 3,700株
虹技	37,400	988.00	36,951,200	貸付有価証券 900株
日本鑄鉄管	30,500	994.00	30,317,000	貸付有価証券 600株
三菱製鋼	189,200	939.00	177,658,800	貸付有価証券 1,300株
日垂鋼業	335,600	254.00	85,242,400	貸付有価証券 1,100株
日本精線	46,300	4,385.00	203,025,500	貸付有価証券 17,700株
エンビプロ・ホールディングス	195,200	764.00	149,132,800	貸付有価証券 138,700株
シンニッタン	356,500	219.00	78,073,500	貸付有価証券 34,300株
新家工業	61,600	1,457.00	89,751,200	貸付有価証券 300株
大紀アルミニウム工業所	363,700	1,191.00	433,166,700	貸付有価証券 257,400株
日本軽金属ホールディングス	746,400	1,528.00	1,140,499,200	貸付有価証券 5,800株
三井金属鉱業	796,200	3,095.00	2,464,239,000	貸付有価証券 5,000株
東邦亜鉛	151,000	2,163.00	326,613,000	貸付有価証券 57,300株
三菱マテリアル	1,704,900	1,926.00	3,283,637,400	貸付有価証券 113,200株
住友金属鉱山	3,232,100	4,043.00	13,067,380,300	貸付有価証券 3,000株
D O W Aホールディングス	689,000	4,500.00	3,100,500,000	貸付有価証券 15,300株
古河機械金属	449,500	1,201.00	539,849,500	貸付有価証券 6,700株
エス・サイエンス	1,311,300	27.00	35,405,100	貸付有価証券 657,200株
大阪チタニウムテクノロジーズ	340,800	2,850.00	971,280,000	貸付有価証券 242,300株
東邦チタニウム	528,100	2,223.00	1,173,966,300	貸付有価証券 375,500株
U A C J	402,800	2,087.00	840,643,600	貸付有価証券 1,800株
C Kサンエツ	55,400	4,070.00	225,478,000	貸付有価証券 27,400株
古河電気工業	850,800	2,264.00	1,926,211,200	貸付有価証券 44,200株
住友電気工業	10,294,600	1,457.50	15,004,379,500	貸付有価証券 204,600株

フジクラ	3,288,200	736.00	2,420,115,200	
昭和電線ホールディングス	257,000	1,578.00	405,546,000	貸付有価証券 8,400株
東京特殊電線	37,800	2,273.00	85,919,400	貸付有価証券 2,100株
タツタ電線	519,800	459.00	238,588,200	
カナレ電気	43,900	1,537.00	67,474,300	貸付有価証券 32,000株
平河ヒューテック	163,300	1,058.00	172,771,400	貸付有価証券 9,300株
リョービ	302,300	1,024.00	309,555,200	
アーレスティ	314,000	367.00	115,238,000	貸付有価証券 9,800株
アサヒホールディングス	1,181,200	2,053.00	2,425,003,600	貸付有価証券 65,800株
稲葉製作所	149,400	1,361.00	203,333,400	貸付有価証券 109,700株
宮地エンジニアリンググループ	83,300	3,275.00	272,807,500	
トーカロ	760,900	1,239.00	942,755,100	
アルファC o	103,900	988.00	102,653,200	貸付有価証券 75,200株
SUMCO	4,864,800	1,757.00	8,547,453,600	貸付有価証券 3,199,200株
川田テクノロジーズ	54,800	3,505.00	192,074,000	貸付有価証券 200株
RS Technologies	95,800	6,040.00	578,632,000	貸付有価証券 9,900株
ジェイテックコーポレーション	38,000	2,185.00	83,030,000	貸付有価証券 27,000株
信和	182,900	779.00	142,479,100	
東洋製罐グループホールディングス	1,503,100	1,410.00	2,119,371,000	
ホッカンホールディングス	137,200	1,223.00	167,795,600	貸付有価証券 107,700株
コロナ	142,700	834.00	119,011,800	貸付有価証券 107,900株
横河ブリッジホールディングス	422,000	1,939.00	818,258,000	
駒井ハルテック	46,100	1,677.00	77,309,700	
高田機工	24,900	2,426.00	60,407,400	貸付有価証券 17,800株
三和ホールディングス	2,781,300	1,315.00	3,657,409,500	貸付有価証券 19,200株
文化シャッター	869,300	1,007.00	875,385,100	貸付有価証券 613,100株
三協立山	350,700	544.00	190,780,800	貸付有価証券 3,000株
アルインコ	194,900	853.00	166,249,700	貸付有価証券 139,400株
東洋シャッター	65,100	590.00	38,409,000	貸付有価証券 7,500株
LIXIL	4,643,000	2,696.00	12,517,528,000	

日本ファイルコン	184,800	491.00	90,736,800	貸付有価証券 15,800株
ノーリツ	470,500	1,474.00	693,517,000	貸付有価証券 154,100株
長府製作所	299,900	1,760.00	527,824,000	貸付有価証券 11,100株
リンナイ	509,600	9,790.00	4,988,984,000	貸付有価証券 32,600株
ダイニチ工業	141,200	649.00	91,638,800	貸付有価証券 9,000株
日東精工	333,300	482.00	160,650,600	貸付有価証券 5,400株
三洋工業	35,900	1,707.00	61,281,300	貸付有価証券 8,000株
岡部	456,500	611.00	278,921,500	貸付有価証券 30,400株
ジーテクト	325,500	1,261.00	410,455,500	貸付有価証券 2,100株
東プレ	450,300	1,032.00	464,709,600	貸付有価証券 319,200株
高周波熱錬	454,600	648.00	294,580,800	貸付有価証券 20,600株
東京製綱	180,800	900.00	162,720,000	貸付有価証券 3,000株
サンコール	252,300	604.00	152,389,200	貸付有価証券 100株
モリテック スチール	229,800	278.00	63,884,400	貸付有価証券 25,300株
パイオラックス	387,700	1,946.00	754,464,200	貸付有価証券 2,600株
エイチワン	263,000	599.00	157,537,000	貸付有価証券 191,100株
日本発條	2,486,500	847.00	2,106,065,500	貸付有価証券 7,900株
中央発條	141,900	690.00	97,911,000	貸付有価証券 1,000株
アドバネクス	38,500	1,156.00	44,506,000	貸付有価証券 7,100株
立川ブラインド工業	115,400	1,051.00	121,285,400	貸付有価証券 2,800株
三益半導体工業	230,100	2,031.00	467,333,100	貸付有価証券 7,200株
日本ドライケミカル	66,500	1,571.00	104,471,500	貸付有価証券 47,600株
日本製鋼所	757,700	3,080.00	2,333,716,000	
三浦工業	1,160,400	3,155.00	3,661,062,000	貸付有価証券 1,400株
タクマ	845,600	1,316.00	1,112,809,600	
ツガミ	602,000	1,153.00	694,106,000	貸付有価証券 268,000株
オークマ	281,400	5,100.00	1,435,140,000	貸付有価証券 8,500株

芝浦機械	333,200	2,673.00	890,643,600	貸付有価証券 100株
アマダ	4,656,400	1,016.00	4,730,902,400	貸付有価証券 43,600株
アイダエンジニアリング	643,200	925.00	594,960,000	貸付有価証券 6,800株
滝澤鉄工所	85,300	1,193.00	101,762,900	貸付有価証券 5,300株
F U J I	1,177,800	2,034.00	2,395,645,200	貸付有価証券 1,600株
牧野フライス製作所	299,700	4,350.00	1,303,695,000	貸付有価証券 3,100株
オーエスジー	1,286,000	1,635.00	2,102,610,000	貸付有価証券 112,000株
ダイジェット工業	30,500	906.00	27,633,000	貸付有価証券 800株
旭ダイヤモンド工業	722,300	627.00	452,882,100	
D M G 森精機	1,633,200	1,691.00	2,761,741,200	貸付有価証券 1,161,400株
ソディック	642,300	807.00	518,336,100	貸付有価証券 9,200株
ディスコ	434,600	30,700.00	13,342,220,000	貸付有価証券 162,600株
日東工器	141,400	1,508.00	213,231,200	
日進工具	231,900	1,260.00	292,194,000	貸付有価証券 153,900株
パンチ工業	249,300	444.00	110,689,200	貸付有価証券 21,100株
富士ダイス	148,200	660.00	97,812,000	貸付有価証券 26,300株
豊和工業	151,100	911.00	137,652,100	
ニデックオーケーケー	111,100	1,171.00	130,098,100	貸付有価証券 79,000株
石川製作所	76,900	1,611.00	123,885,900	貸付有価証券 36,300株
東洋機械金属	191,700	558.00	106,968,600	貸付有価証券 126,200株
津田駒工業	50,400	507.00	25,552,800	貸付有価証券 4,400株
エンシュウ	64,700	896.00	57,971,200	貸付有価証券 1,100株
島精機製作所	431,000	2,147.00	925,357,000	貸付有価証券 83,100株
オプトラン	369,700	1,856.00	686,163,200	貸付有価証券 11,100株
N C ホールディングス	82,500	2,091.00	172,507,500	貸付有価証券 100株
イワキポンプ	187,500	960.00	180,000,000	貸付有価証券 200株
フリー	262,100	1,172.00	307,181,200	貸付有価証券 179,700株

ヤマシンフィルタ	462,900	330.00	152,757,000	貸付有価証券 185,200株
日阪製作所	303,100	828.00	250,966,800	貸付有価証券 240,800株
やまびこ	490,200	1,152.00	564,710,400	貸付有価証券 32,700株
野村マイクロ・サイエンス	94,000	3,485.00	327,590,000	貸付有価証券 66,900株
平田機工	129,500	4,410.00	571,095,000	貸付有価証券 91,300株
ペガサスミシン製造	299,000	584.00	174,616,000	貸付有価証券 198,600株
マルマエ	120,900	1,924.00	232,611,600	貸付有価証券 85,900株
タツモ	150,900	1,227.00	185,154,300	貸付有価証券 107,300株
ナプテスコ	1,569,700	3,355.00	5,266,343,500	貸付有価証券 1,105,100株
三井海洋開発	313,500	1,131.00	354,568,500	貸付有価証券 6,100株
レオン自動機	315,600	1,283.00	404,914,800	貸付有価証券 1,800株
S M C	873,500	62,240.00	54,366,640,000	貸付有価証券 22,900株
ホソカワミクロン	191,500	2,684.00	513,986,000	
ユニオンツール	109,900	3,205.00	352,229,500	貸付有価証券 78,100株
オイレス工業	381,200	1,572.00	599,246,400	貸付有価証券 273,700株
日精エー・エス・ビー機械	113,700	3,550.00	403,635,000	貸付有価証券 8,300株
サトーホールディングス	388,100	1,888.00	732,732,800	
技研製作所	261,100	3,110.00	812,021,000	
日本エアーテック	135,600	1,012.00	137,227,200	貸付有価証券 26,900株
カワタ	86,800	967.00	83,935,600	
日精樹脂工業	185,600	894.00	165,926,400	貸付有価証券 132,200株
オカダアイヨン	93,100	1,473.00	137,136,300	貸付有価証券 61,800株
ワイエイシイホールディングス	117,500	1,510.00	177,425,000	貸付有価証券 75,200株
小松製作所	13,519,500	2,936.00	39,693,252,000	
住友重機械工業	1,593,600	2,914.00	4,643,750,400	
日立建機	1,195,400	2,865.00	3,424,821,000	
日工	370,500	622.00	230,451,000	貸付有価証券 3,000株
巴工業	107,300	2,346.00	251,725,800	貸付有価証券 77,100株
井関農機	234,200	1,193.00	279,400,600	貸付有価証券 4,100株

TOWA	254,900	1,738.00	443,016,200	貸付有価証券 181,300株
丸山製作所	46,600	1,543.00	71,903,800	貸付有価証券 31,300株
北川鉄工所	116,200	1,393.00	161,866,600	
ローツェ	147,000	8,560.00	1,258,320,000	貸付有価証券 49,500株
タカキタ	90,800	510.00	46,308,000	貸付有価証券 67,300株
クボタ	14,451,200	2,095.00	30,275,264,000	貸付有価証券 3,812,100株
荏原実業	136,800	2,228.00	304,790,400	貸付有価証券 100株
三菱化工機	88,000	2,026.00	178,288,000	
月島機械	464,800	879.00	408,559,200	
帝国電機製作所	189,300	1,648.00	311,966,400	貸付有価証券 138,300株
東京機械製作所	121,300	849.00	102,983,700	貸付有価証券 86,200株
新東工業	556,100	686.00	381,484,600	貸付有価証券 109,500株
澁谷工業	234,600	2,415.00	566,559,000	貸付有価証券 12,800株
アイチ コーポレーション	424,600	828.00	351,568,800	
小森コーポレーション	684,900	800.00	547,920,000	貸付有価証券 1,500株
鶴見製作所	210,100	1,905.00	400,240,500	
住友精密工業	44,300	2,847.00	126,122,100	貸付有価証券 1,000株
日本ギア工業	105,800	291.00	30,787,800	貸付有価証券 24,300株
酒井重工業	48,500	2,843.00	137,885,500	貸付有価証券 1,000株
荏原製作所	1,193,300	5,080.00	6,061,964,000	貸付有価証券 485,300株
石井鐵工所	35,000	2,964.00	103,740,000	貸付有価証券 5,500株
西島製作所	242,700	1,293.00	313,811,100	貸付有価証券 9,900株
北越工業	251,500	873.00	219,559,500	
ダイキン工業	3,257,700	22,040.00	71,799,708,000	代用有価証券 177,800株 貸付有価証券 82,000株
オルガノ	85,900	8,490.00	729,291,000	貸付有価証券 5,000株
トーヨーカネツ	103,600	2,674.00	277,026,400	貸付有価証券 5,000株
栗田工業	1,506,700	4,990.00	7,518,433,000	貸付有価証券 273,900株

椿本チエイン	390,000	3,065.00	1,195,350,000	貸付有価証券 19,700株
大同工業	121,400	797.00	96,755,800	
木村化工機	228,900	739.00	169,157,100	貸付有価証券 163,900株
アネスト岩田	464,000	899.00	417,136,000	貸付有価証券 57,600株
ダイフク	1,407,100	8,180.00	11,510,078,000	貸付有価証券 96,400株
サムコ	81,900	2,669.00	218,591,100	貸付有価証券 58,200株
加藤製作所	141,400	804.00	113,685,600	貸付有価証券 48,400株
油研工業	46,000	1,730.00	79,580,000	貸付有価証券 9,100株
タダノ	1,439,200	937.00	1,348,530,400	貸付有価証券 43,800株
フジテック	915,800	3,035.00	2,779,453,000	貸付有価証券 640,700株
C K D	754,800	1,765.00	1,332,222,000	貸付有価証券 17,700株
キトー	234,000	2,621.00	613,314,000	貸付有価証券 800株
平和	832,000	2,029.00	1,688,128,000	貸付有価証券 372,400株
理想科学工業	250,100	2,253.00	563,475,300	
S A N K Y O	614,400	4,125.00	2,534,400,000	貸付有価証券 436,900株
日本金銭機械	302,200	665.00	200,963,000	貸付有価証券 13,900株
マースグループホールディングス	189,400	1,609.00	304,744,600	貸付有価証券 124,800株
フクシマガリレイ	183,900	3,590.00	660,201,000	貸付有価証券 132,600株
オーイズミ	104,200	403.00	41,992,600	貸付有価証券 17,400株
ダイコク電機	136,900	1,233.00	168,797,700	貸付有価証券 97,300株
竹内製作所	453,800	2,351.00	1,066,883,800	貸付有価証券 61,600株
アマノ	781,000	2,442.00	1,907,202,000	貸付有価証券 100株
J U K I	415,000	714.00	296,310,000	貸付有価証券 7,200株
サンデン	413,900	239.00	98,922,100	貸付有価証券 173,100株
ジャノメ	253,100	705.00	178,435,500	貸付有価証券 1,000株
マックス	352,200	1,631.00	574,438,200	
グローリー	707,300	2,078.00	1,469,769,400	

新晃工業	277,200	1,657.00	459,320,400	貸付有価証券 154,700株
大和冷機工業	431,100	1,099.00	473,778,900	貸付有価証券 5,300株
セガサミーホールディングス	2,681,000	2,224.00	5,962,544,000	貸付有価証券 16,700株
日本ピストンリング	108,600	1,255.00	136,293,000	
リケン	108,500	2,316.00	251,286,000	貸付有価証券 1,400株
T P R	325,100	1,199.00	389,794,900	貸付有価証券 230,400株
ツバキ・ナカシマ	654,700	911.00	596,431,700	貸付有価証券 458,000株
ホシザキ	1,744,200	4,045.00	7,055,289,000	貸付有価証券 24,000株
大豊工業	243,200	656.00	159,539,200	貸付有価証券 900株
日本精工	5,105,600	723.00	3,691,348,800	貸付有価証券 1,321,900株
N T N	5,424,900	249.00	1,350,800,100	貸付有価証券 18,100株
ジェイテクト	2,543,500	1,009.00	2,566,391,500	貸付有価証券 12,000株
不二越	207,700	3,600.00	747,720,000	貸付有価証券 28,600株
日本トムソン	680,800	515.00	350,612,000	
T H K	1,683,800	2,675.00	4,504,165,000	貸付有価証券 364,500株
ユーシン精機	231,000	703.00	162,393,000	
前澤給装工業	191,700	902.00	172,913,400	貸付有価証券 138,000株
イーグル工業	322,600	972.00	313,567,200	
前澤工業	178,600	612.00	109,303,200	貸付有価証券 16,100株
日本ピラー工業	255,100	2,620.00	668,362,000	貸付有価証券 198,500株
キッツ	837,300	658.00	550,943,400	貸付有価証券 212,900株
マキタ	3,371,500	3,469.00	11,695,733,500	貸付有価証券 1,216,200株
三井E & Sホールディングス	1,097,800	334.00	366,665,200	貸付有価証券 361,300株
日立造船	2,364,700	843.00	1,993,442,100	貸付有価証券 277,100株
三菱重工業	4,374,400	5,014.00	21,933,241,600	貸付有価証券 146,000株
I H I	1,862,400	3,535.00	6,583,584,000	貸付有価証券 23,900株
サノヤスホールディングス	337,900	123.00	41,561,700	貸付有価証券 142,700株

スター精密	402,600	1,615.00	650,199,000	貸付有価証券 800株
日清紡ホールディングス	1,722,000	1,040.00	1,790,880,000	貸付有価証券 942,300株
イビデン	1,435,100	3,890.00	5,582,539,000	貸付有価証券 398,800株
コニカミノルタ	6,052,300	456.00	2,759,848,800	貸付有価証券 349,000株
ブラザー工業	3,400,100	2,371.00	8,061,637,100	貸付有価証券 295,300株
ミネベアミツミ	4,746,600	2,329.00	11,054,831,400	貸付有価証券 319,500株
日立製作所	14,347,700	6,490.00	93,116,573,000	貸付有価証券 279,200株
東芝	5,215,100	5,408.00	28,203,260,800	貸付有価証券 335,800株
三菱電機	27,841,500	1,454.50	40,495,461,750	貸付有価証券 309,200株
富士電機	1,659,300	5,450.00	9,043,185,000	貸付有価証券 78,400株
東洋電機製造	99,200	891.00	88,387,200	貸付有価証券 11,800株
安川電機	2,964,000	4,545.00	13,471,380,000	貸付有価証券 345,300株
シンフォニアテクノロジー	303,500	1,366.00	414,581,000	
明電舎	421,600	2,038.00	859,220,800	貸付有価証券 51,000株
オリジン	68,200	1,166.00	79,521,200	貸付有価証券 1,200株
山洋電気	108,100	5,220.00	564,282,000	貸付有価証券 2,000株
デンヨー	211,700	1,612.00	341,260,400	貸付有価証券 144,700株
P H C ホールディングス	460,500	1,438.00	662,199,000	貸付有価証券 42,500株
東芝テック	320,300	4,335.00	1,388,500,500	貸付有価証券 21,300株
芝浦メカトロニクス	52,900	9,290.00	491,441,000	貸付有価証券 3,100株
マブチモーター	683,400	3,630.00	2,480,742,000	貸付有価証券 381,300株
日本電産	6,627,100	8,997.00	59,624,018,700	貸付有価証券 1,116,800株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	104,700	437.00	45,753,900	貸付有価証券 5,400株
トレックス・セミコンダクター	128,400	2,476.00	317,918,400	
東光高岳	165,800	1,747.00	289,652,600	貸付有価証券 29,700株
ダブル・スコープ	858,600	1,673.00	1,436,437,800	貸付有価証券 610,500株
ダイヘン	276,100	4,000.00	1,104,400,000	貸付有価証券 800株

ヤーマン	486,400	1,700.00	826,880,000	貸付有価証券 284,900株
JVCケンウッド	2,430,200	178.00	432,575,600	貸付有価証券 38,700株
ミマキエンジニアリング	267,100	539.00	143,966,900	貸付有価証券 3,800株
I - P E X	138,700	1,322.00	183,361,400	貸付有価証券 65,400株
日新電機	699,100	1,424.00	995,518,400	
大崎電気工業	501,800	504.00	252,907,200	貸付有価証券 700株
オムロン	2,483,200	7,001.00	17,384,883,200	貸付有価証券 52,500株
日東工業	374,700	2,338.00	876,048,600	貸付有価証券 1,300株
I D E C	369,300	2,779.00	1,026,284,700	貸付有価証券 7,500株
正興電機製作所	81,700	1,104.00	90,196,800	貸付有価証券 52,400株
不二電機工業	55,600	1,151.00	63,995,600	貸付有価証券 39,400株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	895,800	2,203.00	1,973,447,400	貸付有価証券 1,600株
サクサホールディングス	69,400	1,258.00	87,305,200	貸付有価証券 17,000株
メルコホールディングス	83,100	3,505.00	291,265,500	貸付有価証券 22,400株
テクノメディカ	66,900	1,580.00	105,702,000	貸付有価証券 45,500株
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	83,100	1,620.00	134,622,000	貸付有価証券 59,000株
日本電気	3,537,900	5,500.00	19,458,450,000	貸付有価証券 1,000株
富士通	2,684,100	17,890.00	48,018,549,000	貸付有価証券 3,900株
沖電気工業	1,130,900	743.00	840,258,700	貸付有価証券 7,400株
岩崎通信機	121,400	797.00	96,755,800	貸付有価証券 37,600株
電気興業	143,500	2,518.00	361,333,000	貸付有価証券 4,100株
サンケン電気	255,700	4,715.00	1,205,625,500	
ナカヨ	48,900	1,131.00	55,305,900	貸付有価証券 14,700株
アイホン	135,000	1,790.00	241,650,000	貸付有価証券 1,600株
ルネサスエレクトロニクス	16,243,200	1,231.00	19,995,379,200	
セイコーエプソン	3,331,100	1,931.00	6,432,354,100	貸付有価証券 22,100株
ワコム	2,285,900	845.00	1,931,585,500	貸付有価証券 801,800株

アルバック	594,300	4,755.00	2,825,896,500	貸付有価証券 242,600株
アクセル	114,200	784.00	89,532,800	貸付有価証券 16,900株
E I Z O	203,600	3,785.00	770,626,000	貸付有価証券 27,200株
ジャパンディスプレイ	10,187,500	66.00	672,375,000	貸付有価証券 5,773,300株
日本信号	633,000	992.00	627,936,000	貸付有価証券 3,700株
京三製作所	582,100	438.00	254,959,800	貸付有価証券 500株
能美防災	338,000	1,869.00	631,722,000	貸付有価証券 29,500株
ホーチキ	186,800	1,282.00	239,477,600	
星和電機	122,600	463.00	56,763,800	貸付有価証券 2,800株
エレコム	683,300	1,595.00	1,089,863,500	貸付有価証券 3,900株
パナソニック ホールディングス	31,817,700	1,125.00	35,794,912,500	貸付有価証券 422,800株
シャープ	2,833,600	1,058.00	2,997,948,800	貸付有価証券 1,474,700株
アンリツ	1,921,500	1,529.00	2,937,973,500	貸付有価証券 256,400株
富士通ゼネラル	809,900	2,741.00	2,219,935,900	貸付有価証券 19,100株
ソニーグループ	18,687,600	11,145.00	208,273,302,000	代用有価証券 500,000株 貸付有価証券 2,536,100株
T D K	4,320,800	4,050.00	17,499,240,000	貸付有価証券 29,300株
帝国通信工業	131,500	1,400.00	184,100,000	貸付有価証券 1,600株
タムラ製作所	1,073,400	584.00	626,865,600	貸付有価証券 637,600株
アルプスアルパイン	2,437,100	1,308.00	3,187,726,800	貸付有価証券 43,400株
池上通信機	87,700	606.00	53,146,200	
日本電波工業	298,600	1,082.00	323,085,200	貸付有価証券 212,300株
鈴木	146,700	763.00	111,932,100	貸付有価証券 56,400株
メイコー	322,700	3,100.00	1,000,370,000	貸付有価証券 4,500株
日本トリム	56,100	2,427.00	136,154,700	貸付有価証券 200株
ローランド ディー . ジー .	175,800	3,120.00	548,496,000	貸付有価証券 14,500株
フォスター電機	277,800	743.00	206,405,400	貸付有価証券 600株

S M K	69,500	2,123.00	147,548,500	貸付有価証券 500株
ヨコオ	198,800	1,968.00	391,238,400	貸付有価証券 7,900株
ティアック	455,600	119.00	54,216,400	貸付有価証券 66,300株
ホシデン	659,300	1,234.00	813,576,200	貸付有価証券 50,100株
ヒロセ電機	413,700	18,270.00	7,558,299,000	貸付有価証券 12,900株
日本航空電子工業	598,400	2,042.00	1,221,932,800	貸付有価証券 155,800株
T O A	319,900	777.00	248,562,300	
マクセル	543,400	1,314.00	714,027,600	貸付有価証券 40,700株
古野電気	354,500	1,046.00	370,807,000	貸付有価証券 14,500株
ユニデンホールディングス	65,300	4,095.00	267,403,500	
スミダコーポレーション	279,600	789.00	220,604,400	
アイコム	96,300	2,475.00	238,342,500	貸付有価証券 72,900株
リオン	102,600	2,413.00	247,573,800	貸付有価証券 59,300株
本多通信工業	231,600	526.00	121,821,600	貸付有価証券 144,500株
横河電機	2,736,700	2,209.00	6,045,370,300	貸付有価証券 1,500株
新電元工業	105,300	3,390.00	356,967,000	
アズビル	1,730,200	3,785.00	6,548,807,000	貸付有価証券 56,200株
東亜ディーケーケー	147,300	901.00	132,717,300	貸付有価証券 104,700株
日本光電工業	1,150,500	2,980.00	3,428,490,000	貸付有価証券 271,900株
チノー	94,300	1,651.00	155,689,300	貸付有価証券 62,500株
共和電業	285,900	305.00	87,199,500	貸付有価証券 85,000株
日本電子材料	140,100	1,625.00	227,662,500	貸付有価証券 70,700株
堀場製作所	512,100	6,040.00	3,093,084,000	貸付有価証券 363,100株
アドバンテスト	2,217,700	7,280.00	16,144,856,000	貸付有価証券 11,100株
小野測器	113,000	424.00	47,912,000	貸付有価証券 48,600株
エスベック	220,200	1,786.00	393,277,200	
キーエンス	2,703,000	49,630.00	134,149,890,000	代用有価証券 60,000株 貸付有価証券 146,200株

日置電機	142,900	6,440.00	920,276,000	貸付有価証券 17,300株
シスメックス	2,136,000	8,839.00	18,880,104,000	貸付有価証券 13,400株
日本マイクロニクス	444,900	1,219.00	542,333,100	貸付有価証券 51,400株
メガチップス	264,500	3,020.00	798,790,000	貸付有価証券 27,700株
O B A R A G R O U P	116,000	2,995.00	347,420,000	貸付有価証券 85,900株
澤藤電機	36,000	1,453.00	52,308,000	貸付有価証券 23,100株
原田工業	141,100	892.00	125,861,200	貸付有価証券 95,200株
コーセル	330,800	832.00	275,225,600	
イリソ電子工業	250,500	3,205.00	802,852,500	貸付有価証券 50,300株
オブテックスグループ	489,300	2,056.00	1,006,000,800	貸付有価証券 315,800株
千代田インテグレ	112,800	1,969.00	222,103,200	
レーザーテック	1,222,600	17,480.00	21,371,048,000	貸付有価証券 869,400株
スタンレー電気	1,922,700	2,296.00	4,414,519,200	貸付有価証券 83,800株
岩崎電気	94,200	2,597.00	244,637,400	
ウシオ電機	1,411,500	1,717.00	2,423,545,500	貸付有価証券 148,400株
岡谷電機産業	212,300	252.00	53,499,600	貸付有価証券 150,900株
ヘリオス テクノ ホールディング	253,500	325.00	82,387,500	
エノモト	82,700	1,444.00	119,418,800	貸付有価証券 11,300株
日本セラミック	277,400	2,030.00	563,122,000	貸付有価証券 17,900株
遠藤照明	136,900	760.00	104,044,000	貸付有価証券 700株
古河電池	212,600	1,210.00	257,246,000	貸付有価証券 134,600株
双信電機	142,600	502.00	71,585,200	貸付有価証券 5,000株
山一電機	194,500	1,654.00	321,703,000	貸付有価証券 20,400株
図研	193,900	3,210.00	622,419,000	
日本電子	572,700	5,420.00	3,104,034,000	貸付有価証券 6,400株
カシオ計算機	1,845,100	1,257.00	2,319,290,700	貸付有価証券 56,700株
ファナック	2,618,000	21,905.00	57,347,290,000	貸付有価証券 228,600株
日本シイエムケイ	525,700	432.00	227,102,400	貸付有価証券 44,500株

エンプラス	73,500	3,050.00	224,175,000	貸付有価証券 18,200株
大真空	368,700	885.00	326,299,500	貸付有価証券 262,200株
ローム	1,240,100	9,450.00	11,718,945,000	
浜松ホトニクス	1,987,300	5,600.00	11,128,880,000	貸付有価証券 70,500株
三井ハイテック	255,900	8,420.00	2,154,678,000	貸付有価証券 165,500株
新光電気工業	876,300	3,495.00	3,062,668,500	貸付有価証券 31,600株
京セラ	4,196,900	6,929.00	29,080,320,100	
太陽誘電	1,326,700	4,565.00	6,056,385,500	貸付有価証券 12,100株
村田製作所	8,136,900	7,616.00	61,970,630,400	
双葉電子工業	510,800	682.00	348,365,600	貸付有価証券 10,200株
北陸電気工業	111,400	1,087.00	121,091,800	貸付有価証券 1,100株
ニチコン	794,600	1,200.00	953,520,000	貸付有価証券 1,700株
日本ケミコン	282,200	1,661.00	468,734,200	貸付有価証券 140,700株
K O A	412,400	1,584.00	653,241,600	貸付有価証券 44,100株
市光工業	356,700	371.00	132,335,700	貸付有価証券 6,500株
小糸製作所	1,489,200	4,460.00	6,641,832,000	貸付有価証券 6,300株
ミツバ	464,400	401.00	186,224,400	貸付有価証券 364,700株
S C R E E Nホールディングス	470,400	9,000.00	4,233,600,000	貸付有価証券 500株
キャノン電子	273,600	1,523.00	416,692,800	貸付有価証券 32,000株
キャノン	14,823,600	3,100.00	45,953,160,000	貸付有価証券 6,337,400株
リコー	7,098,000	1,042.00	7,396,116,000	貸付有価証券 353,500株
象印マホービン	739,600	1,496.00	1,106,441,600	貸付有価証券 7,800株
M U T O Hホールディングス	37,400	2,060.00	77,044,000	貸付有価証券 24,800株
東京エレクトロン	1,892,900	43,550.00	82,435,795,000	貸付有価証券 238,500株
トヨタ紡織	1,042,800	2,002.00	2,087,685,600	
芦森工業	56,100	1,000.00	56,100,000	貸付有価証券 5,200株
ユニプレス	488,900	814.00	397,964,600	貸付有価証券 338,800株

豊田自動織機	2,112,500	8,110.00	17,132,375,000	貸付有価証券 80,900株
モリタホールディングス	478,000	1,313.00	627,614,000	
三櫻工業	412,500	675.00	278,437,500	貸付有価証券 11,500株
デンソー	5,838,200	7,280.00	42,502,096,000	貸付有価証券 54,900株
東海理化電機製作所	785,500	1,460.00	1,146,830,000	貸付有価証券 3,100株
川崎重工業	2,021,800	2,491.00	5,036,303,800	貸付有価証券 178,300株
名村造船所	768,000	414.00	317,952,000	貸付有価証券 577,600株
日本車輛製造	95,100	2,046.00	194,574,600	貸付有価証券 100株
三菱ロジスネクスト	395,000	869.00	343,255,000	貸付有価証券 260,800株
近畿車輛	44,800	1,100.00	49,280,000	貸付有価証券 16,100株
日産自動車	35,181,800	504.20	17,738,663,560	貸付有価証券 1,348,200株
いすゞ自動車	8,640,500	1,451.00	12,537,365,500	
トヨタ自動車	135,994,100	2,111.00	287,083,545,100	貸付有価証券 13,078,500株
日野自動車	3,725,100	711.00	2,648,546,100	貸付有価証券 59,800株
三菱自動車工業	11,042,000	420.00	4,637,640,000	貸付有価証券 7,697,600株
エフテック	190,600	498.00	94,918,800	貸付有価証券 700株
レシップホールディングス	118,200	538.00	63,591,600	貸付有価証券 27,100株
G M B	53,700	698.00	37,482,600	貸付有価証券 900株
ファルテック	52,100	600.00	31,260,000	貸付有価証券 2,700株
武蔵精密工業	665,100	1,389.00	923,823,900	貸付有価証券 278,000株
日産車体	436,900	578.00	252,528,200	貸付有価証券 26,500株
新明和工業	778,000	1,059.00	823,902,000	
極東開発工業	475,000	1,413.00	671,175,000	
トビー工業	223,000	1,305.00	291,015,000	
ティラド	80,800	2,526.00	204,100,800	貸付有価証券 16,200株
曙ブレーキ工業	1,637,500	157.00	257,087,500	貸付有価証券 6,200株
タチエス	489,600	1,068.00	522,892,800	貸付有価証券 5,700株
N O K	1,122,500	1,086.00	1,219,035,000	貸付有価証券 107,200株

フタバ産業	663,700	375.00	248,887,500	貸付有価証券 6,700株
K Y B	262,300	3,030.00	794,769,000	貸付有価証券 5,400株
大同メタル工業	572,300	522.00	298,740,600	貸付有価証券 32,000株
プレス工業	1,336,700	395.00	527,996,500	貸付有価証券 114,100株
ミクニ	347,000	349.00	121,103,000	貸付有価証券 18,600株
太平洋工業	567,900	1,049.00	595,727,100	貸付有価証券 11,400株
河西工業	366,000	259.00	94,794,000	貸付有価証券 26,800株
アイシン	2,183,300	4,165.00	9,093,444,500	貸付有価証券 135,900株
マツダ	8,777,300	1,020.00	8,952,846,000	貸付有価証券 1,102,600株
今仙電機製作所	195,700	590.00	115,463,000	貸付有価証券 19,400株
本田技研工業	21,809,900	3,250.00	70,882,175,000	代用有価証券 93,900株 貸付有価証券 645,200株
スズキ	5,913,200	4,240.00	25,071,968,000	貸付有価証券 459,400株
S U B A R U	7,836,200	2,253.00	17,654,958,600	貸付有価証券 292,500株
安永	119,800	711.00	85,177,800	貸付有価証券 3,200株
ヤマハ発動機	3,892,400	2,505.00	9,750,462,000	貸付有価証券 62,300株
T B K	299,900	334.00	100,166,600	貸付有価証券 42,800株
エクセディ	450,000	1,709.00	769,050,000	貸付有価証券 263,000株
豊田合成	843,100	2,147.00	1,810,135,700	貸付有価証券 3,300株
愛三工業	467,400	703.00	328,582,200	貸付有価証券 12,200株
盟和産業	42,200	1,000.00	42,200,000	貸付有価証券 29,500株
日本プラスト	215,700	450.00	97,065,000	貸付有価証券 9,500株
ヨロズ	232,000	876.00	203,232,000	貸付有価証券 178,900株
エフ・シー・シー	487,600	1,335.00	650,946,000	貸付有価証券 1,500株
シマノ	1,097,600	23,450.00	25,738,720,000	貸付有価証券 780,500株
テイ・エス テック	1,259,600	1,432.00	1,803,747,200	貸付有価証券 19,800株

ジャムコ	174,200	1,111.00	193,536,200	貸付有価証券 96,000株
テルモ	8,441,300	4,167.00	35,174,897,100	貸付有価証券 42,600株
クリエートメディック	89,500	982.00	87,889,000	貸付有価証券 25,600株
日機装	756,800	821.00	621,332,800	貸付有価証券 18,800株
日本エム・ディ・エム	171,600	1,587.00	272,329,200	
島津製作所	3,564,800	4,450.00	15,863,360,000	貸付有価証券 55,800株
J M S	229,100	541.00	123,943,100	貸付有価証券 900株
クボテック	64,000	253.00	16,192,000	貸付有価証券 13,400株
長野計器	198,000	1,113.00	220,374,000	貸付有価証券 2,800株
ブイ・テクノロジー	130,400	2,827.00	368,640,800	貸付有価証券 18,600株
東京計器	189,800	1,295.00	245,791,000	貸付有価証券 134,900株
愛知時計電機	107,100	1,384.00	148,226,400	貸付有価証券 75,300株
インターアクション	149,300	1,841.00	274,861,300	貸付有価証券 96,000株
オーバル	266,700	343.00	91,478,100	貸付有価証券 19,400株
東京精密	465,500	4,385.00	2,041,217,500	貸付有価証券 111,900株
マニー	1,089,200	1,436.00	1,564,091,200	
ニコン	4,204,800	1,439.00	6,050,707,200	貸付有価証券 152,400株
トプコン	1,402,700	1,784.00	2,502,416,800	
オリンパス	14,440,500	2,705.50	39,068,772,750	貸付有価証券 2,795,900株
理研計器	197,200	3,800.00	749,360,000	貸付有価証券 24,200株
タムロン	208,400	2,582.00	538,088,800	貸付有価証券 1,000株
H O Y A	5,759,200	12,200.00	70,262,240,000	貸付有価証券 1,300株
シード	139,200	512.00	71,270,400	貸付有価証券 95,400株
ノーリツ鋼機	268,200	2,279.00	611,227,800	
A & Dホロンホールディングス	335,300	889.00	298,081,700	貸付有価証券 1,000株
朝日インテック	3,270,600	2,388.00	7,810,192,800	貸付有価証券 1,200,500株
シチズン時計	2,911,200	529.00	1,540,024,800	貸付有価証券 139,700株

リズム	93,200	1,675.00	156,110,000	貸付有価証券 6,100株
大研医器	235,900	478.00	112,760,200	貸付有価証券 400株
メニコン	920,400	3,250.00	2,991,300,000	貸付有価証券 63,900株
シンシア	31,800	430.00	13,674,000	貸付有価証券 100株
松風	99,400	1,692.00	168,184,800	貸付有価証券 70,700株
セイコーホールディングス	421,900	2,862.00	1,207,477,800	貸付有価証券 6,800株
ニプロ	2,064,400	1,095.00	2,260,518,000	貸付有価証券 226,200株
中本パックス	83,300	1,576.00	131,280,800	貸付有価証券 9,900株
スノーピーク	388,600	2,679.00	1,041,059,400	貸付有価証券 276,200株
パラマウントベッドホールディングス	572,000	2,282.00	1,305,304,000	貸付有価証券 86,600株
トランザクション	190,400	1,139.00	216,865,600	貸付有価証券 108,000株
粧美堂	74,500	400.00	29,800,000	貸付有価証券 54,600株
ニホンフラッシュ	232,100	935.00	217,013,500	貸付有価証券 41,500株
前田工織	268,900	2,916.00	784,112,400	貸付有価証券 204,200株
永大産業	325,000	260.00	84,500,000	貸付有価証券 48,700株
アートネイチャー	254,800	747.00	190,335,600	
バンダイナムコホールディングス	2,467,300	9,947.00	24,542,233,100	貸付有価証券 37,400株
アイフィスジャパン	75,900	627.00	47,589,300	貸付有価証券 49,100株
共立印刷	408,600	143.00	58,429,800	貸付有価証券 31,700株
S H O E I	261,200	5,360.00	1,400,032,000	貸付有価証券 3,700株
フランスベッドホールディングス	383,400	896.00	343,526,400	貸付有価証券 254,600株
パイロットコーポレーション	426,000	4,760.00	2,027,760,000	貸付有価証券 298,900株
萩原工業	179,400	1,118.00	200,569,200	貸付有価証券 4,000株
フジシールインターナショナル	612,900	1,461.00	895,446,900	貸付有価証券 347,500株
タカラトミー	1,231,700	1,399.00	1,723,148,300	
広済堂ホールディングス	185,000	1,046.00	193,510,000	貸付有価証券 25,500株
エステールホールディングス	63,700	631.00	40,194,700	貸付有価証券 44,900株

タカノ	101,900	824.00	83,965,600	貸付有価証券 68,700株
プロネクサス	231,000	1,097.00	253,407,000	貸付有価証券 153,500株
ホクシン	210,200	146.00	30,689,200	貸付有価証券 145,000株
ウッドワン	91,100	1,133.00	103,216,300	貸付有価証券 2,300株
大建工業	150,500	1,871.00	281,585,500	貸付有価証券 1,000株
凸版印刷	3,886,600	2,190.00	8,511,654,000	
大日本印刷	3,232,000	2,819.00	9,111,008,000	貸付有価証券 62,800株
共同印刷	77,600	2,522.00	195,707,200	
N I S S H A	518,100	1,498.00	776,113,800	
光村印刷	23,000	1,236.00	28,428,000	貸付有価証券 500株
TAKARA & COMPANY	170,500	1,831.00	312,185,500	貸付有価証券 121,300株
アシックス	2,286,100	2,581.00	5,900,424,100	貸付有価証券 1,626,800株
ツツミ	74,400	1,980.00	147,312,000	貸付有価証券 47,700株
ローランド	208,000	4,015.00	835,120,000	貸付有価証券 33,200株
小松ウオール工業	90,900	1,968.00	178,891,200	貸付有価証券 100株
ヤマハ	1,734,700	5,630.00	9,766,361,000	貸付有価証券 102,200株
河合楽器製作所	75,100	2,648.00	198,864,800	貸付有価証券 2,300株
クリナップ	277,400	587.00	162,833,800	貸付有価証券 1,000株
ピジョン	1,802,700	1,933.00	3,484,619,100	貸付有価証券 1,282,000株
兼松サステック	19,200	1,615.00	31,008,000	貸付有価証券 13,500株
キングジム	218,600	895.00	195,647,000	貸付有価証券 131,800株
リンテック	568,000	2,303.00	1,308,104,000	貸付有価証券 27,200株
イトーキ	549,800	373.00	205,075,400	貸付有価証券 10,000株
任天堂	1,683,900	57,960.00	97,598,844,000	貸付有価証券 237,800株
三菱鉛筆	401,900	1,414.00	568,286,600	貸付有価証券 78,700株
タカラスタANDARD	479,400	1,282.00	614,590,800	
コクヨ	1,311,600	1,729.00	2,267,756,400	貸付有価証券 932,700株

ナカバヤシ	240,000	503.00	120,720,000	貸付有価証券 173,400株
グロープライド	222,300	2,147.00	477,278,100	貸付有価証券 8,400株
オカムラ	838,700	1,228.00	1,029,923,600	
美津濃	246,200	2,347.00	577,831,400	
東京電力ホールディングス	22,325,800	619.00	13,819,670,200	
中部電力	8,424,500	1,378.00	11,608,961,000	貸付有価証券 143,800株
関西電力	10,433,200	1,375.00	14,345,650,000	貸付有価証券 201,600株
中国電力	4,302,800	893.00	3,842,400,400	貸付有価証券 111,800株
北陸電力	2,532,500	542.00	1,372,615,000	貸付有価証券 16,400株
東北電力	6,520,500	741.00	4,831,690,500	貸付有価証券 43,200株
四国電力	2,479,400	795.00	1,971,123,000	
九州電力	5,709,300	879.00	5,018,474,700	貸付有価証券 41,400株
北海道電力	2,592,100	512.00	1,327,155,200	
沖縄電力	632,700	1,298.00	821,244,600	貸付有価証券 225,000株
電源開発	2,204,000	2,253.00	4,965,612,000	貸付有価証券 4,400株
エフオン	180,400	563.00	101,565,200	貸付有価証券 2,900株
イーレックス	384,300	2,356.00	905,410,800	貸付有価証券 107,900株
レノバ	585,000	2,629.00	1,537,965,000	貸付有価証券 416,000株
東京瓦斯	5,309,700	2,510.00	13,327,347,000	
大阪瓦斯	5,016,900	2,408.00	12,080,695,200	貸付有価証券 133,700株
東邦瓦斯	1,169,800	2,979.00	3,484,834,200	
北海道瓦斯	147,800	1,578.00	233,228,400	貸付有価証券 19,900株
広島ガス	521,500	320.00	166,880,000	貸付有価証券 377,900株
西部ガスホールディングス	284,100	1,838.00	522,175,800	貸付有価証券 3,600株
静岡ガス	705,700	916.00	646,421,200	貸付有価証券 12,600株
メタウォーター	309,600	2,003.00	620,128,800	
SBSホールディングス	220,700	2,750.00	606,925,000	貸付有価証券 1,100株
東武鉄道	2,720,600	2,974.00	8,091,064,400	貸付有価証券 10,100株
相鉄ホールディングス	886,200	2,267.00	2,009,015,400	貸付有価証券 33,500株

東急	6,944,800	1,528.00	10,611,654,400	貸付有価証券 949,700株
京浜急行電鉄	3,320,200	1,380.00	4,581,876,000	貸付有価証券 159,600株
小田急電鉄	3,754,200	1,791.00	6,723,772,200	貸付有価証券 117,300株
京王電鉄	1,309,700	4,800.00	6,286,560,000	貸付有価証券 88,200株
京成電鉄	1,756,500	3,430.00	6,024,795,000	貸付有価証券 14,800株
富士急行	305,000	3,905.00	1,191,025,000	貸付有価証券 216,800株
新京成電鉄	68,900	2,781.00	191,610,900	
東日本旅客鉄道	4,550,400	6,594.00	30,005,337,600	貸付有価証券 653,000株
西日本旅客鉄道	3,163,800	4,688.00	14,831,894,400	貸付有価証券 156,600株
東海旅客鉄道	2,098,700	14,860.00	31,186,682,000	貸付有価証券 100,400株
西武ホールディングス	3,595,000	1,286.00	4,623,170,000	貸付有価証券 225,000株
鴻池運輸	422,000	1,250.00	527,500,000	
西日本鉄道	716,600	2,770.00	1,984,982,000	貸付有価証券 120,600株
ハマキョウレックス	193,700	3,010.00	583,037,000	貸付有価証券 5,500株
サカイ引越センター	137,200	4,630.00	635,236,000	貸付有価証券 48,500株
近鉄グループホールディングス	2,648,800	4,075.00	10,793,860,000	貸付有価証券 390,900株
阪急阪神ホールディングス	3,297,100	3,595.00	11,853,074,500	貸付有価証券 112,700株
南海電気鉄道	1,181,600	2,480.00	2,930,368,000	貸付有価証券 166,200株
京阪ホールディングス	1,100,700	3,145.00	3,461,701,500	貸付有価証券 500株
神戸電鉄	67,200	3,185.00	214,032,000	貸付有価証券 47,800株
名古屋鉄道	2,732,700	2,012.00	5,498,192,400	貸付有価証券 821,100株
山陽電気鉄道	201,700	2,116.00	426,797,200	貸付有価証券 143,500株
アルプス物流	197,100	1,111.00	218,978,100	貸付有価証券 130,900株
ヤマトホールディングス	3,958,800	2,257.00	8,935,011,600	貸付有価証券 42,000株
山九	686,400	3,965.00	2,721,576,000	貸付有価証券 6,200株
丸運	134,100	233.00	31,245,300	貸付有価証券 106,500株
丸全昭和運輸	190,900	3,185.00	608,016,500	

センコーグループホールディングス	1,309,300	898.00	1,175,751,400	
トナミホールディングス	54,200	3,600.00	195,120,000	貸付有価証券 400株
ニッコンホールディングス	852,400	2,219.00	1,891,475,600	貸付有価証券 128,700株
日本石油輸送	30,800	2,442.00	75,213,600	貸付有価証券 8,600株
福山通運	361,600	3,090.00	1,117,344,000	
セイノーホールディングス	1,538,700	1,118.00	1,720,266,600	貸付有価証券 24,400株
エスライン	77,100	832.00	64,147,200	貸付有価証券 55,600株
神奈川中央交通	70,000	3,350.00	234,500,000	貸付有価証券 40,600株
日立物流	545,200	8,580.00	4,677,816,000	貸付有価証券 11,200株
丸和運輸機関	477,300	1,397.00	666,788,100	貸付有価証券 354,000株
C & F ロジホールディングス	238,000	1,098.00	261,324,000	貸付有価証券 24,700株
九州旅客鉄道	1,894,000	2,678.00	5,072,132,000	貸付有価証券 18,500株
S Gホールディングス	4,744,900	2,423.00	11,496,892,700	貸付有価証券 2,000株
NIPPON EXPRESSホールディングス	839,100	7,520.00	6,310,032,000	貸付有価証券 1,000株
日本郵船	2,362,500	9,340.00	22,065,750,000	貸付有価証券 107,800株
商船三井	4,357,200	3,130.00	13,638,036,000	貸付有価証券 2,172,600株
川崎汽船	870,000	7,930.00	6,899,100,000	貸付有価証券 195,300株
NSユナイテッド海運	133,200	3,700.00	492,840,000	貸付有価証券 94,700株
明治海運	266,700	900.00	240,030,000	貸付有価証券 199,500株
飯野海運	1,109,400	678.00	752,173,200	貸付有価証券 49,400株
共栄タンカー	49,600	944.00	46,822,400	貸付有価証券 29,200株
乾汽船	169,000	1,768.00	298,792,000	貸付有価証券 74,300株
日本航空	6,073,100	2,243.00	13,621,963,300	貸付有価証券 315,400株
ANAホールディングス	6,728,100	2,422.50	16,298,822,250	貸付有価証券 4,772,400株
パスコ	53,400	1,309.00	69,900,600	貸付有価証券 8,900株
トランコム	78,900	7,240.00	571,236,000	貸付有価証券 300株
日新	206,500	1,593.00	328,954,500	

三菱倉庫	683,200	3,340.00	2,281,888,000	
三井倉庫ホールディングス	276,500	2,903.00	802,679,500	
住友倉庫	829,600	2,014.00	1,670,814,400	
澁澤倉庫	140,900	2,114.00	297,862,600	貸付有価証券 900株
東陽倉庫	400,600	292.00	116,975,200	貸付有価証券 41,900株
日本トランスシティ	497,500	488.00	242,780,000	貸付有価証券 155,700株
ケイヒン	48,400	1,354.00	65,533,600	貸付有価証券 10,300株
中央倉庫	145,700	972.00	141,620,400	貸付有価証券 102,600株
川西倉庫	51,600	1,051.00	54,231,600	貸付有価証券 35,400株
安田倉庫	189,800	919.00	174,426,200	貸付有価証券 140,900株
ファイズホールディングス	60,200	702.00	42,260,400	貸付有価証券 29,100株
東洋埠頭	78,900	1,278.00	100,834,200	貸付有価証券 7,400株
上組	1,341,800	2,703.00	3,626,885,400	貸付有価証券 9,800株
サンリツ	72,300	701.00	50,682,300	貸付有価証券 6,000株
キムラユニティー	146,900	769.00	112,966,100	貸付有価証券 96,800株
キューソー流通システム	140,900	1,126.00	158,653,400	貸付有価証券 69,200株
近鉄エクスプレス	533,500	4,165.00	2,222,027,500	貸付有価証券 16,400株
東海運	160,800	283.00	45,506,400	貸付有価証券 108,500株
エーアイティー	177,200	1,475.00	261,370,000	貸付有価証券 1,300株
内外トランスライン	109,000	1,831.00	199,579,000	貸付有価証券 10,500株
日本コンセプト	89,900	1,403.00	126,129,700	貸付有価証券 1,300株
NEC ネットズエスアイ	968,100	1,933.00	1,871,337,300	
クロスキャット	157,500	951.00	149,782,500	貸付有価証券 82,100株
システナ	4,175,900	449.00	1,874,979,100	貸付有価証券 6,300株
デジタルアーツ	157,100	6,340.00	996,014,000	貸付有価証券 600株
日鉄ソリューションズ	508,500	3,745.00	1,904,332,500	貸付有価証券 600株
キューブシステム	147,700	985.00	145,484,500	貸付有価証券 45,100株

WOW WORLD	40,700	1,027.00	41,798,900	貸付有価証券 28,000株
コア	123,700	1,454.00	179,859,800	貸付有価証券 32,500株
手間いらず	42,000	5,150.00	216,300,000	貸付有価証券 8,900株
ラクーンホールディングス	248,500	1,643.00	408,285,500	貸付有価証券 176,700株
ソリトンシステムズ	146,200	1,267.00	185,235,400	貸付有価証券 46,400株
ソフトクリエイイトホールディングス	127,600	4,040.00	515,504,000	貸付有価証券 1,100株
T I S	2,558,800	3,575.00	9,147,710,000	
J N Sホールディングス	134,900	411.00	55,443,900	貸付有価証券 53,500株
グリー	1,331,800	831.00	1,106,725,800	貸付有価証券 901,100株
G M Oペパボ	30,400	1,982.00	60,252,800	貸付有価証券 21,200株
コーエーテクモホールディングス	933,800	4,650.00	4,342,170,000	貸付有価証券 136,100株
三菱総合研究所	121,700	4,140.00	503,838,000	貸付有価証券 6,000株
ボルテージ	78,400	341.00	26,734,400	貸付有価証券 5,500株
電算	32,400	2,169.00	70,275,600	貸付有価証券 22,000株
A G S	115,700	731.00	84,576,700	貸付有価証券 80,900株
ファインデックス	246,500	660.00	162,690,000	貸付有価証券 1,100株
ブレインパッド	247,800	1,080.00	267,624,000	
K L a b	500,900	478.00	239,430,200	貸付有価証券 266,800株
ポールトゥウィンホールディングス	424,100	939.00	398,229,900	貸付有価証券 900株
ネクソン	6,678,100	2,940.00	19,633,614,000	貸付有価証券 833,900株
アイスタイル	755,500	243.00	183,586,500	貸付有価証券 484,500株
エムアップホールディングス	338,000	1,327.00	448,526,000	貸付有価証券 13,000株
エイチーム	183,300	710.00	130,143,000	貸付有価証券 1,100株
エニグモ	316,000	522.00	164,952,000	貸付有価証券 220,700株
テクノスジャパン	226,700	479.00	108,589,300	貸付有価証券 8,800株
e n i s h	206,700	400.00	82,680,000	貸付有価証券 149,300株
コロプラ	963,100	649.00	625,051,900	貸付有価証券 15,800株

オルトプラス	209,500	357.00	74,791,500	貸付有価証券 149,000株
ブロードリーフ	1,450,500	453.00	657,076,500	貸付有価証券 878,300株
クロス・マーケティンググループ	111,000	724.00	80,364,000	貸付有価証券 78,800株
デジタルハーツホールディングス	132,800	1,800.00	239,040,000	貸付有価証券 70,500株
システム情報	219,200	983.00	215,473,600	貸付有価証券 90,300株
メディアドゥ	99,900	1,979.00	197,702,100	
じげん	827,700	342.00	283,073,400	貸付有価証券 17,000株
ブイキューブ	297,800	1,213.00	361,231,400	貸付有価証券 210,900株
エンカレッジ・テクノロジー	64,100	505.00	32,370,500	
サイバーリンクス	97,800	1,154.00	112,861,200	貸付有価証券 7,300株
ディー・エル・イー	196,300	362.00	71,060,600	貸付有価証券 90,500株
フィックスターズ	280,400	982.00	275,352,800	
CARTA HOLDINGS	119,300	1,855.00	221,301,500	貸付有価証券 69,200株
オブティム	204,300	821.00	167,730,300	貸付有価証券 43,900株
セレス	109,500	1,206.00	132,057,000	貸付有価証券 35,800株
SHIFT	181,500	19,100.00	3,466,650,000	貸付有価証券 118,400株
ティーガイア	259,700	1,612.00	418,636,400	貸付有価証券 184,600株
セック	42,700	2,505.00	106,963,500	貸付有価証券 23,900株
テクマトリックス	494,800	1,845.00	912,906,000	貸付有価証券 1,300株
プロシップ	96,900	1,589.00	153,974,100	貸付有価証券 64,200株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	760,200	2,477.00	1,883,015,400	貸付有価証券 540,600株
GMOペイメントゲートウェイ	567,200	10,950.00	6,210,840,000	貸付有価証券 17,900株
ザッパラス	101,100	361.00	36,497,100	貸付有価証券 35,000株
システムリサーチ	85,200	2,075.00	176,790,000	貸付有価証券 2,200株
インターネットイニシアティブ	779,700	5,080.00	3,960,876,000	貸付有価証券 500株
さくらインターネット	313,600	547.00	171,539,200	貸付有価証券 219,700株
ヴィンクス	82,100	1,270.00	104,267,000	貸付有価証券 9,600株

GMOグローバルサイン・ホールディングス	65,000	5,400.00	351,000,000	貸付有価証券 8,400株
SRAホールディングス	141,100	2,839.00	400,582,900	
システムインテグレータ	92,300	481.00	44,396,300	貸付有価証券 12,500株
朝日ネット	266,700	581.00	154,952,700	
eBASE	349,500	542.00	189,429,000	貸付有価証券 238,900株
アバント	313,600	1,474.00	462,246,400	貸付有価証券 44,600株
アドソル日進	104,400	1,589.00	165,891,600	貸付有価証券 71,400株
ODKソリューションズ	60,800	570.00	34,656,000	貸付有価証券 6,200株
フリービット	151,800	826.00	125,386,800	貸付有価証券 100,000株
コムチュア	328,500	2,800.00	919,800,000	貸付有価証券 1,200株
サイバーコム	44,600	1,316.00	58,693,600	貸付有価証券 15,500株
アステリア	210,600	924.00	194,594,400	貸付有価証券 89,300株
アイル	139,100	1,533.00	213,240,300	貸付有価証券 100株
マークライنز	146,800	2,212.00	324,721,600	
メディカル・データ・ビジョン	370,700	1,148.00	425,563,600	
gumi	405,500	651.00	263,980,500	貸付有価証券 215,200株
ショーケース	63,500	434.00	27,559,000	貸付有価証券 17,700株
モバイルファクトリー	66,100	1,095.00	72,379,500	貸付有価証券 26,200株
テラスカイ	106,600	1,509.00	160,859,400	貸付有価証券 74,500株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	129,200	1,402.00	181,138,400	
PCIホールディングス	114,700	918.00	105,294,600	貸付有価証券 1,500株
パイブドHD	53,500	2,799.00	149,746,500	貸付有価証券 37,100株
アイビーシー	42,400	441.00	18,698,400	
ネオジャパン	82,900	1,120.00	92,848,000	貸付有価証券 58,000株
PR TIMES	62,300	2,122.00	132,200,600	貸付有価証券 44,300株
ラクス	1,342,700	1,884.00	2,529,646,800	貸付有価証券 2,500株
ランドコンピュータ	66,500	876.00	58,254,000	貸付有価証券 1,300株
ダブルスタンダード	88,000	1,993.00	175,384,000	貸付有価証券 62,500株

オープンドア	173,700	1,624.00	282,088,800	貸付有価証券 123,500株
マイネット	104,700	493.00	51,617,100	貸付有価証券 74,400株
アカツキ	130,600	2,632.00	343,739,200	貸付有価証券 4,400株
ベネフィットジャパン	22,000	1,923.00	42,306,000	貸付有価証券 100株
Ubicomホールディングス	76,700	2,613.00	200,417,100	貸付有価証券 54,300株
カナミックネットワーク	356,600	589.00	210,037,400	貸付有価証券 109,500株
ノムラシステムコーポレーション	300,800	123.00	36,998,400	貸付有価証券 96,600株
チェンジ	608,200	2,155.00	1,310,671,000	貸付有価証券 408,000株
シンクロ・フード	149,500	383.00	57,258,500	貸付有価証券 37,600株
オークネット	155,400	2,098.00	326,029,200	貸付有価証券 1,200株
キャピタル・アセット・プランニング	53,000	635.00	33,655,000	貸付有価証券 3,500株
セグエグループ	75,800	535.00	40,553,000	貸付有価証券 4,200株
エイトレッド	41,600	2,009.00	83,574,400	貸付有価証券 27,700株
マクロミル	562,400	932.00	524,156,800	貸付有価証券 15,800株
ビーグリー	68,900	1,286.00	88,605,400	貸付有価証券 4,900株
オロ	89,700	1,721.00	154,373,700	貸付有価証券 5,600株
ユーザーローカル	89,100	1,589.00	141,579,900	貸付有価証券 2,100株
テモナ	52,800	362.00	19,113,600	貸付有価証券 12,100株
ニーズウェル	84,800	630.00	53,424,000	貸付有価証券 9,600株
マネーフォワード	596,300	3,790.00	2,259,977,000	貸付有価証券 150,000株
サインポスト	94,600	897.00	84,856,200	貸付有価証券 59,100株
電算システムホールディングス	119,900	2,390.00	286,561,000	
ソルクシーズ	248,400	369.00	91,659,600	貸付有価証券 1,100株
フェイス	76,900	597.00	45,909,300	貸付有価証券 8,400株
プロトコーポレーション	310,600	1,049.00	325,819,400	
ハイマックス	77,600	1,364.00	105,846,400	貸付有価証券 2,100株
野村総合研究所	5,090,500	3,810.00	19,394,805,000	貸付有価証券 64,200株

サイバネットシステム	208,000	847.00	176,176,000	貸付有価証券 12,700株
C Eホールディングス	141,400	459.00	64,902,600	貸付有価証券 101,200株
日本システム技術	51,800	2,457.00	127,272,600	
インテージホールディングス	337,000	1,311.00	441,807,000	貸付有価証券 7,600株
東邦システムサイエンス	77,100	908.00	70,006,800	貸付有価証券 53,600株
ソースネクスト	1,262,300	214.00	270,132,200	貸付有価証券 897,700株
インフォコム	320,100	2,129.00	681,492,900	
シンプレクス・ホールディングス	463,100	1,773.00	821,076,300	貸付有価証券 23,000株
H E R O Z	83,500	837.00	69,889,500	貸付有価証券 59,300株
ラクスル	349,300	1,956.00	683,230,800	貸付有価証券 248,300株
I P S	80,500	2,270.00	182,735,000	貸付有価証券 1,600株
F I G	318,000	321.00	102,078,000	貸付有価証券 218,600株
システムサポート	105,700	1,252.00	132,336,400	貸付有価証券 900株
イーソル	178,900	605.00	108,234,500	貸付有価証券 125,100株
アルテリア・ネットワークス	277,800	1,244.00	345,583,200	
東海ソフト	45,600	928.00	42,316,800	
ウイングアーク1st	223,000	1,654.00	368,842,000	貸付有価証券 3,500株
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	66,300	1,584.00	105,019,200	貸付有価証券 20,300株
サーバーワークス	50,100	2,265.00	113,476,500	貸付有価証券 18,400株
東名	20,400	1,050.00	21,420,000	貸付有価証券 14,400株
ヴィッツ	27,000	1,092.00	29,484,000	貸付有価証券 1,700株
トビラシステムズ	59,000	918.00	54,162,000	貸付有価証券 200株
S a n s a n	925,900	1,070.00	990,713,000	貸付有価証券 658,400株
L i n k - U	52,400	658.00	34,479,200	貸付有価証券 27,400株
ギフトィ	240,300	1,216.00	292,204,800	貸付有価証券 172,800株
ベース	50,000	5,370.00	268,500,000	貸付有価証券 12,300株
J M D C	366,600	6,900.00	2,529,540,000	貸付有価証券 64,600株

フォーカスシステムズ	181,100	892.00	161,541,200	貸付有価証券 130,100株
クレスコ	213,000	1,943.00	413,859,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,602,800	1,167.00	3,037,467,600	貸付有価証券 13,700株
オービック	922,500	21,120.00	19,483,200,000	貸付有価証券 16,900株
ジャストシステム	416,400	4,030.00	1,678,092,000	貸付有価証券 95,400株
TDCソフト	232,600	1,078.00	250,742,800	
Zホールディングス	42,211,900	435.50	18,383,282,450	貸付有価証券 1,804,300株
トレンドマイクロ	1,434,300	7,280.00	10,441,704,000	貸付有価証券 469,800株
IDホールディングス	184,100	822.00	151,330,200	貸付有価証券 1,900株
日本オラクル	475,100	8,100.00	3,848,310,000	貸付有価証券 4,700株
アルファシステムズ	78,100	4,370.00	341,297,000	貸付有価証券 300株
フューチャー	618,000	1,542.00	952,956,000	貸付有価証券 311,900株
CAC Holdings	152,200	1,374.00	209,122,800	貸付有価証券 3,700株
S Bテクノロジー	126,400	2,275.00	287,560,000	貸付有価証券 4,600株
トーセ	71,900	757.00	54,428,300	
オービックビジネスコンサルタント	279,300	4,925.00	1,375,552,500	貸付有価証券 185,600株
伊藤忠テクノソリューションズ	1,333,700	3,480.00	4,641,276,000	貸付有価証券 54,100株
アイティフォー	354,300	783.00	277,416,900	
東計電算	34,600	5,840.00	202,064,000	
エクスネット	45,900	1,012.00	46,450,800	貸付有価証券 300株
大塚商会	1,583,800	4,110.00	6,509,418,000	
サイボウズ	390,900	1,098.00	429,208,200	貸付有価証券 31,200株
電通国際情報サービス	362,200	4,280.00	1,550,216,000	貸付有価証券 256,700株
ACCESS	330,400	753.00	248,791,200	貸付有価証券 9,800株
デジタルガレージ	484,100	3,870.00	1,873,467,000	
EMシステムズ	483,100	1,016.00	490,829,600	貸付有価証券 64,100株
ウェザーニューズ	87,800	7,560.00	663,768,000	貸付有価証券 56,700株
CIJ	226,900	728.00	165,183,200	貸付有価証券 1,500株
ビジネスエンジニアリング	66,700	2,336.00	155,811,200	貸付有価証券 46,400株

日本エンタープライズ	285,500	152.00	43,396,000	貸付有価証券 73,000株
WOWOW	120,200	1,490.00	179,098,000	貸付有価証券 87,600株
スカラ	245,800	719.00	176,730,200	貸付有価証券 1,600株
インテリジェント ウェイブ	146,400	798.00	116,827,200	貸付有価証券 26,700株
IMAGICA GROUP	207,200	760.00	157,472,000	貸付有価証券 13,000株
ネットワンシステムズ	1,079,700	3,225.00	3,482,032,500	
システムソフト	864,400	106.00	91,626,400	貸付有価証券 151,100株
アルゴグラフィックス	227,700	3,205.00	729,778,500	貸付有価証券 500株
マーベラス	461,000	681.00	313,941,000	貸付有価証券 49,600株
エイベックス	505,000	1,435.00	724,675,000	貸付有価証券 333,800株
BIPROGY	914,100	2,778.00	2,539,369,800	貸付有価証券 61,400株
兼松エレクトロニクス	159,100	4,045.00	643,559,500	
都築電気	130,800	1,280.00	167,424,000	貸付有価証券 93,100株
TBSホールディングス	1,430,300	1,680.00	2,402,904,000	貸付有価証券 72,000株
日本テレビホールディングス	2,443,500	1,218.00	2,976,183,000	
朝日放送グループホールディングス	232,500	645.00	149,962,500	貸付有価証券 165,000株
テレビ朝日ホールディングス	703,600	1,477.00	1,039,217,200	貸付有価証券 18,300株
スカパーJ SATホールディングス	2,479,000	535.00	1,326,265,000	貸付有価証券 6,500株
テレビ東京ホールディングス	180,100	1,935.00	348,493,500	貸付有価証券 11,600株
日本BS放送	98,900	1,050.00	103,845,000	貸付有価証券 23,200株
ビジョン	465,700	1,031.00	480,136,700	貸付有価証券 326,700株
スマートバリュー	66,600	490.00	32,634,000	貸付有価証券 37,400株
USEN-NEXT HOLDINGS	222,600	2,190.00	487,494,000	貸付有価証券 172,000株
ワイヤレスゲート	119,800	286.00	34,262,800	貸付有価証券 81,100株
コネクシオ	207,200	1,328.00	275,161,600	貸付有価証券 2,300株
日本通信	2,434,000	201.00	489,234,000	貸付有価証券 731,200株
クロップス	53,300	912.00	48,609,600	貸付有価証券 37,600株

日本電信電話	32,810,800	3,830.00	125,665,364,000	代用有価証券 800,000株 貸付有価証券 4,641,300株
K D D I	21,340,800	4,293.00	91,616,054,400	貸付有価証券 407,600株
ソフトバンク	44,337,100	1,525.00	67,614,077,500	貸付有価証券 3,263,300株
光通信	337,500	13,930.00	4,701,375,000	貸付有価証券 9,100株
エムティーアイ	226,900	483.00	109,592,700	貸付有価証券 152,100株
G M Oインターネット	1,025,300	2,611.00	2,677,058,300	貸付有価証券 727,300株
ファイバーゲート	133,500	918.00	122,553,000	貸付有価証券 94,900株
アйдママーケティングコミュニケーション	62,600	294.00	18,404,400	貸付有価証券 1,900株
K A D O K A W A	1,575,800	3,085.00	4,861,343,000	貸付有価証券 43,800株
学研ホールディングス	413,400	927.00	383,221,800	貸付有価証券 18,800株
ゼンリン	477,600	921.00	439,869,600	貸付有価証券 22,300株
昭文社ホールディングス	117,900	366.00	43,151,400	貸付有価証券 82,300株
インプレスホールディングス	242,300	213.00	51,609,900	貸付有価証券 7,400株
アイネット	135,400	1,235.00	167,219,000	
松竹	167,800	11,940.00	2,003,532,000	貸付有価証券 35,800株
東宝	1,727,200	4,915.00	8,489,188,000	貸付有価証券 1,000株
東映	82,100	18,460.00	1,515,566,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	7,793,800	1,954.00	15,229,085,200	貸付有価証券 20,500株
ピー・シー・エー	171,200	1,232.00	210,918,400	貸付有価証券 96,800株
ビジネスブレイン太田昭和	97,200	1,447.00	140,648,400	貸付有価証券 20,900株
D T S	545,400	3,245.00	1,769,823,000	貸付有価証券 2,100株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,361,800	6,050.00	8,238,890,000	貸付有価証券 1,800株
シーイーシー	313,400	1,184.00	371,065,600	
カブコン	2,759,800	3,670.00	10,128,466,000	貸付有価証券 29,800株
アイ・エス・ビー	136,800	1,000.00	136,800,000	貸付有価証券 3,100株
ジャステック	169,400	1,165.00	197,351,000	貸付有価証券 31,500株

S C S K	2,026,300	2,380.00	4,822,594,000	貸付有価証券 700株
日本システムウエア	110,400	2,322.00	256,348,800	
アイネス	251,600	1,622.00	408,095,200	貸付有価証券 13,000株
T K C	445,600	3,360.00	1,497,216,000	貸付有価証券 500株
富士ソフト	280,900	8,060.00	2,264,054,000	貸付有価証券 194,400株
N S D	916,900	2,512.00	2,303,252,800	貸付有価証券 53,500株
コナミグループ	1,063,200	7,140.00	7,591,248,000	貸付有価証券 3,600株
福井コンピュータホールディングス	134,200	3,515.00	471,713,000	
J B C Cホールディングス	197,500	1,589.00	313,827,500	
ミロク情報サービス	257,900	1,321.00	340,685,900	貸付有価証券 8,600株
ソフトバンクグループ	17,553,300	5,400.00	94,787,820,000	代用有価証券 500,000株 貸付有価証券 1,011,700株
高千穂交易	103,600	1,937.00	200,673,200	貸付有価証券 72,500株
オルバヘルスケアホールディングス	47,800	1,620.00	77,436,000	貸付有価証券 9,600株
伊藤忠食品	58,900	4,955.00	291,849,500	貸付有価証券 43,900株
エレマテック	235,100	1,227.00	288,467,700	貸付有価証券 7,200株
あらた	217,100	4,015.00	871,656,500	貸付有価証券 6,400株
トーメンデバイス	44,100	5,480.00	241,668,000	貸付有価証券 31,100株
東京エレクトロン デバイス	87,100	5,200.00	452,920,000	貸付有価証券 1,700株
フィールズ	257,100	844.00	216,992,400	
双日	3,013,600	1,927.00	5,807,207,200	貸付有価証券 2,081,800株
アルフレッサ ホールディングス	3,047,300	1,824.00	5,558,275,200	貸付有価証券 402,500株
横浜冷凍	713,600	888.00	633,676,800	貸付有価証券 900株
神栄	42,500	851.00	36,167,500	貸付有価証券 7,200株
ラサ商事	133,200	964.00	128,404,800	
アルコニックス	373,000	1,291.00	481,543,000	貸付有価証券 199,700株
神戸物産	2,027,200	3,475.00	7,044,520,000	貸付有価証券 1,043,300株
ハイパー	72,900	453.00	33,023,700	貸付有価証券 8,400株

あい ホールディングス	419,300	1,607.00	673,815,100	貸付有価証券 298,100株
ディーブイエックス	99,800	1,085.00	108,283,000	貸付有価証券 63,700株
ダイワボウホールディングス	1,249,400	1,839.00	2,297,646,600	貸付有価証券 1,100株
マクニカ・富士エレホールディングス	700,500	2,574.00	1,803,087,000	貸付有価証券 44,800株
ラクト・ジャパン	100,800	2,339.00	235,771,200	貸付有価証券 68,300株
グリムス	130,500	1,563.00	203,971,500	貸付有価証券 20,600株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	467,800	683.00	319,507,400	貸付有価証券 1,800株
八洲電機	211,800	984.00	208,411,200	貸付有価証券 147,300株
メディアスホールディングス	167,500	961.00	160,967,500	貸付有価証券 116,400株
レスターホールディングス	278,500	1,876.00	522,466,000	
ジュテックホールディングス	57,400	1,030.00	59,122,000	貸付有価証券 44,500株
大光	124,600	707.00	88,092,200	貸付有価証券 76,600株
OCHIホールディングス	66,200	1,213.00	80,300,600	貸付有価証券 47,000株
TOKAIホールディングス	1,423,100	874.00	1,243,789,400	貸付有価証券 922,600株
黒谷	79,700	591.00	47,102,700	貸付有価証券 51,600株
Cominix	50,900	718.00	36,546,200	貸付有価証券 34,200株
三洋貿易	268,700	983.00	264,132,100	貸付有価証券 2,500株
ビューティガレージ	47,200	2,621.00	123,711,200	貸付有価証券 33,600株
ウイン・パートナーズ	211,900	1,034.00	219,104,600	貸付有価証券 142,500株
ミタチ産業	73,600	859.00	63,222,400	貸付有価証券 5,400株
シップヘルスケアホールディングス	847,500	2,535.00	2,148,412,500	貸付有価証券 3,600株
明治電機工業	88,300	1,080.00	95,364,000	
デリカフーズホールディングス	113,700	510.00	57,987,000	貸付有価証券 80,700株
スターティアホールディングス	66,400	770.00	51,128,000	貸付有価証券 2,800株
コメダホールディングス	641,300	2,247.00	1,441,001,100	貸付有価証券 5,000株
ピーバンドットコム	41,100	513.00	21,084,300	貸付有価証券 22,900株
アセンテック	100,300	621.00	62,286,300	貸付有価証券 59,500株

富士興産	72,900	1,065.00	77,638,500	
協栄産業	29,600	1,323.00	39,160,800	貸付有価証券 100株
フルサト・マルカホールディングス	260,400	2,582.00	672,352,800	貸付有価証券 167,700株
ヤマエグループホールディングス	164,500	1,362.00	224,049,000	貸付有価証券 1,400株
小野建	262,600	1,400.00	367,640,000	貸付有価証券 180,000株
南陽	55,100	1,784.00	98,298,400	貸付有価証券 39,300株
佐鳥電機	182,900	1,061.00	194,056,900	貸付有価証券 119,700株
エコートレーディング	61,500	576.00	35,424,000	
伯東	171,400	2,500.00	428,500,000	貸付有価証券 29,100株
コンドーテック	219,700	1,000.00	219,700,000	貸付有価証券 152,000株
中山福	154,400	315.00	48,636,000	貸付有価証券 62,600株
ナガイレーベン	354,100	1,960.00	694,036,000	
三菱食品	282,300	3,670.00	1,036,041,000	貸付有価証券 1,800株
松田産業	214,200	2,057.00	440,609,400	貸付有価証券 142,100株
第一興商	557,600	3,670.00	2,046,392,000	貸付有価証券 276,300株
メディバルホールディングス	2,717,700	1,950.00	5,299,515,000	貸付有価証券 24,700株
S P K	116,200	1,378.00	160,123,600	貸付有価証券 2,300株
萩原電気ホールディングス	100,300	1,956.00	196,186,800	
アズワン	421,500	6,000.00	2,529,000,000	貸付有価証券 5,900株
スズデン	91,600	1,928.00	176,604,800	貸付有価証券 6,800株
尾家産業	68,600	833.00	57,143,800	貸付有価証券 50,100株
シモジマ	179,800	986.00	177,282,800	貸付有価証券 122,300株
ドウシシャ	276,900	1,548.00	428,641,200	貸付有価証券 176,400株
小津産業	64,500	1,873.00	120,808,500	貸付有価証券 44,700株
高速	155,400	1,485.00	230,769,000	貸付有価証券 800株
たけびし	99,800	1,471.00	146,805,800	貸付有価証券 72,600株
リックス	60,000	1,937.00	116,220,000	貸付有価証券 43,800株
丸文	233,800	725.00	169,505,000	

ハピネット	222,800	1,555.00	346,454,000	貸付有価証券 160,900株
橋本総業ホールディングス	51,800	1,945.00	100,751,000	貸付有価証券 33,700株
日本ライフライン	870,300	940.00	818,082,000	貸付有価証券 2,900株
タカショー	228,100	728.00	166,056,800	貸付有価証券 162,100株
I D O M	891,000	763.00	679,833,000	貸付有価証券 89,300株
進和	173,600	2,177.00	377,927,200	貸付有価証券 123,400株
エスケイジャパン	70,800	460.00	32,568,000	貸付有価証券 20,700株
ダイترون	113,700	1,799.00	204,546,300	貸付有価証券 100株
シークス	373,400	937.00	349,875,800	貸付有価証券 24,400株
田中商事	90,000	589.00	53,010,000	貸付有価証券 34,800株
オーハシテクニカ	144,500	1,351.00	195,219,500	貸付有価証券 103,800株
白銅	94,500	2,342.00	221,319,000	貸付有価証券 67,200株
ダイコー通産	34,600	1,139.00	39,409,400	貸付有価証券 2,500株
伊藤忠商事	17,614,500	3,803.00	66,987,943,500	
丸紅	25,452,600	1,183.50	30,123,152,100	
高島	41,700	2,589.00	107,961,300	
長瀬産業	1,343,800	1,887.00	2,535,750,600	貸付有価証券 80,800株
蝶理	164,100	1,927.00	316,220,700	
豊田通商	2,623,300	4,375.00	11,476,937,500	貸付有価証券 22,400株
三共生興	376,100	506.00	190,306,600	
兼松	1,017,400	1,347.00	1,370,437,800	貸付有価証券 1,100株
ツカモトコーポレーション	49,000	1,093.00	53,557,000	貸付有価証券 34,200株
三井物産	21,295,400	2,851.50	60,723,833,100	貸付有価証券 354,200株
日本紙パルプ商事	139,100	3,885.00	540,403,500	貸付有価証券 49,600株
カメイ	313,300	1,057.00	331,158,100	
東都水産	14,900	4,545.00	67,720,500	貸付有価証券 9,600株
O U Gホールディングス	42,500	2,798.00	118,915,000	貸付有価証券 30,300株
スターゼン	198,900	2,057.00	409,137,300	貸付有価証券 1,100株

山善	1,059,200	984.00	1,042,252,800	貸付有価証券 500株
椿本興業	48,100	3,590.00	172,679,000	貸付有価証券 33,600株
住友商事	17,385,200	1,853.00	32,214,775,600	貸付有価証券 1,442,300株
内田洋行	115,800	5,040.00	583,632,000	
三菱商事	19,264,400	3,885.00	74,842,194,000	貸付有価証券 503,500株
第一実業	113,000	3,350.00	378,550,000	
キャノンマーケティングジャパン	728,400	2,833.00	2,063,557,200	貸付有価証券 145,000株
西華産業	125,500	1,622.00	203,561,000	
佐藤商事	201,900	1,090.00	220,071,000	
菱洋エレクトロ	173,700	2,269.00	394,125,300	貸付有価証券 14,200株
東京産業	239,100	710.00	169,761,000	貸付有価証券 79,400株
ユアサ商事	235,900	3,480.00	820,932,000	
神鋼商事	65,600	3,700.00	242,720,000	貸付有価証券 1,000株
トルク	155,700	197.00	30,672,900	貸付有価証券 58,200株
阪和興業	509,700	2,842.00	1,448,567,400	貸付有価証券 38,800株
正栄食品工業	190,100	3,795.00	721,429,500	貸付有価証券 98,100株
カナデン	238,400	1,020.00	243,168,000	貸付有価証券 158,400株
菱電商事	232,500	1,594.00	370,605,000	貸付有価証券 156,100株
岩谷産業	650,800	5,230.00	3,403,684,000	
ナイス	89,900	1,624.00	145,997,600	
ニチモウ	35,100	2,335.00	81,958,500	貸付有価証券 200株
極東貿易	84,200	2,633.00	221,698,600	貸付有価証券 56,400株
アステナホールディングス	377,600	450.00	169,920,000	貸付有価証券 45,200株
三愛オブリ	657,500	1,019.00	669,992,500	貸付有価証券 7,100株
稲畑産業	588,000	2,278.00	1,339,464,000	貸付有価証券 115,400株
G S I クレオス	140,400	1,382.00	194,032,800	貸付有価証券 61,100株
明和産業	270,900	712.00	192,880,800	貸付有価証券 192,600株
クワザワホールディングス	104,400	444.00	46,353,600	貸付有価証券 76,800株
ワキタ	530,000	1,187.00	629,110,000	貸付有価証券 200株

東邦ホールディングス	797,400	2,053.00	1,637,062,200	貸付有価証券 900株
サンゲツ	712,800	1,574.00	1,121,947,200	貸付有価証券 500株
ミツウロコグループホールディングス	336,900	911.00	306,915,900	貸付有価証券 256,900株
シナネンホールディングス	96,700	3,445.00	333,131,500	貸付有価証券 1,600株
伊藤忠エネクス	649,500	1,043.00	677,428,500	貸付有価証券 2,800株
サンリオ	824,900	2,946.00	2,430,155,400	貸付有価証券 66,500株
サンワテクノス	148,600	1,293.00	192,139,800	
リョーサン	301,000	2,142.00	644,742,000	貸付有価証券 3,200株
新光商事	387,200	882.00	341,510,400	貸付有価証券 1,200株
トーホー	112,200	1,297.00	145,523,400	貸付有価証券 86,500株
三信電気	120,600	1,530.00	184,518,000	貸付有価証券 1,300株
東陽テクニカ	289,900	1,129.00	327,297,100	貸付有価証券 600株
モスフードサービス	385,400	3,190.00	1,229,426,000	貸付有価証券 256,000株
加賀電子	239,200	3,005.00	718,796,000	貸付有価証券 4,800株
ソーダニッカ	234,000	567.00	132,678,000	貸付有価証券 165,700株
立花エレテック	191,200	1,512.00	289,094,400	貸付有価証券 135,500株
フォーバル	102,700	874.00	89,759,800	
PALTAC	412,000	4,345.00	1,790,140,000	貸付有価証券 6,600株
三谷産業	457,700	311.00	142,344,700	貸付有価証券 115,300株
太平洋興発	108,200	614.00	66,434,800	貸付有価証券 20,800株
西本Wismettacホールディングス	66,500	3,840.00	255,360,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	26,000	1,802.00	46,852,000	貸付有価証券 17,900株
コーア商事ホールディングス	183,500	703.00	129,000,500	貸付有価証券 70,100株
国際紙パルプ商事	542,700	480.00	260,496,000	貸付有価証券 17,000株
ヤマタネ	126,100	1,568.00	197,724,800	
丸紅建材リース	25,400	1,852.00	47,040,800	貸付有価証券 2,600株
日鉄物産	179,500	4,985.00	894,807,500	貸付有価証券 19,000株

泉州電業	72,900	4,975.00	362,677,500	貸付有価証券 40,600株
トラスコ中山	611,300	1,826.00	1,116,233,800	貸付有価証券 1,200株
オートバックスセブン	911,900	1,403.00	1,279,395,700	貸付有価証券 656,300株
モリト	214,000	758.00	162,212,000	貸付有価証券 3,900株
加藤産業	318,000	3,315.00	1,054,170,000	貸付有価証券 10,800株
北恵	74,200	841.00	62,402,200	貸付有価証券 35,600株
イノテック	177,600	1,299.00	230,702,400	
イエローハット	462,400	1,697.00	784,692,800	貸付有価証券 335,600株
J Kホールディングス	206,400	977.00	201,652,800	貸付有価証券 155,200株
日伝	199,300	1,921.00	382,855,300	貸付有価証券 147,400株
北沢産業	154,400	201.00	31,034,400	貸付有価証券 5,000株
杉本商事	137,200	2,047.00	280,848,400	貸付有価証券 61,500株
因幡電機産業	731,600	2,719.00	1,989,220,400	貸付有価証券 6,400株
東テク	87,400	3,080.00	269,192,000	
ミスミグループ本社	3,688,900	3,195.00	11,786,035,500	貸付有価証券 41,000株
アルテック	179,300	271.00	48,590,300	貸付有価証券 6,400株
タキヒヨー	79,200	934.00	73,972,800	貸付有価証券 62,200株
蔵王産業	56,600	1,867.00	105,672,200	貸付有価証券 3,700株
スズケン	1,052,900	3,785.00	3,985,226,500	貸付有価証券 20,900株
ジェコス	202,500	825.00	167,062,500	貸付有価証券 1,700株
グローセル	318,200	399.00	126,961,800	貸付有価証券 227,500株
ローソン	650,300	4,515.00	2,936,104,500	
サンエー	199,900	4,065.00	812,593,500	貸付有価証券 500株
カワチ薬品	227,700	2,146.00	488,644,200	貸付有価証券 20,600株
エービーシー・マート	458,700	5,720.00	2,623,764,000	
ハードオフコーポレーション	129,300	905.00	117,016,500	
アスクル	632,200	1,644.00	1,039,336,800	貸付有価証券 289,000株
ゲオホールディングス	353,500	1,275.00	450,712,500	貸付有価証券 1,400株

アダストリア	316,400	2,029.00	641,975,600	貸付有価証券 210,500株
ジーフット	177,300	330.00	58,509,000	貸付有価証券 126,100株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	42,200	399.00	16,837,800	貸付有価証券 23,200株
くら寿司	306,700	3,160.00	969,172,000	貸付有価証券 218,100株
キャンドウ	108,700	2,140.00	232,618,000	貸付有価証券 77,100株
アイケイ	92,300	446.00	41,165,800	貸付有価証券 24,600株
パルグループホールディングス	257,100	1,702.00	437,584,200	
エディオン	1,348,600	1,276.00	1,720,813,600	貸付有価証券 959,000株
サーラコーポレーション	596,400	699.00	416,883,600	貸付有価証券 18,200株
ワッツ	141,600	724.00	102,518,400	貸付有価証券 100,700株
ハローズ	133,900	2,990.00	400,361,000	
フジオフードグループ本社	218,000	1,347.00	293,646,000	貸付有価証券 157,300株
あみやき亭	69,800	2,910.00	203,118,000	貸付有価証券 46,200株
ひらまつ	623,000	196.00	122,108,000	貸付有価証券 18,300株
大黒天物産	93,800	4,310.00	404,278,000	貸付有価証券 66,700株
ハニーズホールディングス	232,600	1,235.00	287,261,000	貸付有価証券 162,800株
ファーマライズホールディングス	62,700	702.00	44,015,400	貸付有価証券 25,100株
アルペン	216,100	2,103.00	454,458,300	貸付有価証券 151,200株
ハブ	95,100	531.00	50,498,100	貸付有価証券 54,500株
クオールホールディングス	360,300	1,360.00	490,008,000	貸付有価証券 241,600株
ジinzホールディングス	155,500	4,355.00	677,202,500	貸付有価証券 110,500株
ビックカメラ	1,742,600	1,146.00	1,997,019,600	貸付有価証券 1,239,200株
D C Mホールディングス	1,744,900	1,009.00	1,760,604,100	貸付有価証券 37,800株
ペッパーフードサービス	401,500	367.00	147,350,500	貸付有価証券 140,200株
Monotaro	3,714,400	2,316.00	8,602,550,400	貸付有価証券 1,351,600株
東京一番フーズ	66,200	593.00	39,256,600	貸付有価証券 47,800株
D Dホールディングス	153,700	546.00	83,920,200	貸付有価証券 14,500株

きちりホールディングス	78,200	365.00	28,543,000	貸付有価証券 51,500株
アークランドサービスホールディングス	214,600	2,126.00	456,239,600	貸付有価証券 152,600株
J.フロント リテイリング	3,257,700	1,041.00	3,391,265,700	
ドトール・日レスホールディングス	464,700	1,523.00	707,738,100	貸付有価証券 11,700株
マツキヨココカラ & カンパニー	1,721,400	5,160.00	8,882,424,000	貸付有価証券 9,700株
ブロンコピラー	153,600	2,329.00	357,734,400	貸付有価証券 111,100株
Z O Z O	2,020,400	2,831.00	5,719,752,400	貸付有価証券 105,100株
トレジャー・ファクトリー	85,900	1,221.00	104,883,900	貸付有価証券 15,100株
物語コーポレーション	145,500	5,380.00	782,790,000	貸付有価証券 68,200株
三越伊勢丹ホールディングス	4,409,500	986.00	4,347,767,000	貸付有価証券 89,900株
H a m e e	105,500	1,075.00	113,412,500	貸付有価証券 68,500株
マーケットエンタープライズ	29,500	1,132.00	33,394,000	貸付有価証券 20,900株
ウエルシアホールディングス	1,553,300	2,896.00	4,498,356,800	貸付有価証券 414,800株
クリエイトSDホールディングス	433,200	3,095.00	1,340,754,000	貸付有価証券 6,900株
丸善CHIホールディングス	342,900	371.00	127,215,900	貸付有価証券 243,800株
ミサワ	59,300	604.00	35,817,200	貸付有価証券 39,100株
ティーライフ	39,400	1,390.00	54,766,000	貸付有価証券 28,000株
エー・ピーホールディングス	57,400	445.00	25,543,000	貸付有価証券 4,000株
チムニー	89,600	1,209.00	108,326,400	貸付有価証券 63,700株
シュッピン	244,300	1,302.00	318,078,600	貸付有価証券 173,700株
オイシックス・ラ・大地	422,600	1,761.00	744,198,600	貸付有価証券 242,900株
ネクステージ	596,800	2,459.00	1,467,531,200	貸付有価証券 67,400株
ジョイフル本田	843,000	1,596.00	1,345,428,000	貸付有価証券 578,700株
鳥貴族ホールディングス	96,900	2,162.00	209,497,800	貸付有価証券 68,900株
ホットランド	219,700	1,307.00	287,147,900	貸付有価証券 149,700株
すかいらーくホールディングス	3,582,000	1,570.00	5,623,740,000	貸付有価証券 2,547,300株

S F Pホールディングス	143,300	1,539.00	220,538,700	貸付有価証券 101,900株
綿半ホールディングス	202,300	1,366.00	276,341,800	貸付有価証券 13,900株
ヨシックスホールディングス	57,400	2,279.00	130,814,600	貸付有価証券 38,200株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	853,700	1,082.00	923,703,400	貸付有価証券 606,000株
ゴルフダイジェスト・オンライン	152,300	1,318.00	200,731,400	貸付有価証券 106,500株
B E E N O S	148,200	2,360.00	349,752,000	貸付有価証券 103,600株
あさひ	243,000	1,279.00	310,797,000	貸付有価証券 172,800株
日本調剤	178,100	1,326.00	236,160,600	貸付有価証券 126,300株
コスモス薬品	296,400	13,140.00	3,894,696,000	貸付有価証券 119,600株
トーエル	128,500	906.00	116,421,000	貸付有価証券 92,400株
セブン&アイ・ホールディングス	9,852,100	5,325.00	52,462,432,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,971,000	898.00	1,769,958,000	貸付有価証券 1,401,600株
ツルハホールディングス	641,200	7,520.00	4,821,824,000	貸付有価証券 1,600株
サンマルクホールディングス	232,100	1,553.00	360,451,300	
フェリシモ	65,100	1,124.00	73,172,400	貸付有価証券 46,300株
トリドールホールディングス	730,900	2,517.00	1,839,675,300	貸付有価証券 495,200株
T O K Y O B A S E	269,500	325.00	87,587,500	貸付有価証券 41,300株
ウイルプラスホールディングス	55,100	861.00	47,441,100	貸付有価証券 26,900株
J Mホールディングス	222,400	1,648.00	366,515,200	貸付有価証券 158,100株
サツドラホールディングス	131,700	662.00	87,185,400	貸付有価証券 53,100株
アレンザホールディングス	195,700	1,018.00	199,222,600	貸付有価証券 77,900株
串カツ田中ホールディングス	78,300	1,813.00	141,957,900	貸付有価証券 400株
パロックジャパンリミテッド	203,800	797.00	162,428,600	貸付有価証券 144,900株
クスリのアオキホールディングス	262,800	5,440.00	1,429,632,000	貸付有価証券 7,100株
力の源ホールディングス	150,300	645.00	96,943,500	貸付有価証券 105,300株
F O O D & L I F E C O M P A N I E	1,505,000	2,721.00	4,095,105,000	貸付有価証券 23,800株
メディカルシステムネットワーク	255,400	434.00	110,843,600	

一家ホールディングス	61,600	563.00	34,680,800	貸付有価証券 43,800株
藤久ホールディングス	91,100	658.00	59,943,800	貸付有価証券 63,700株
はるやまホールディングス	137,400	442.00	60,730,800	貸付有価証券 96,300株
ノジマ	475,000	2,840.00	1,349,000,000	貸付有価証券 77,600株
カップ・クリエイト	411,900	1,443.00	594,371,700	貸付有価証券 292,800株
ライトオン	219,500	735.00	161,332,500	貸付有価証券 156,100株
良品計画	3,380,600	1,268.00	4,286,600,800	貸付有価証券 551,300株
パリミキホールディングス	363,500	271.00	98,508,500	貸付有価証券 55,900株
アドヴァングループ	249,200	788.00	196,369,600	貸付有価証券 176,500株
アルビス	85,700	2,222.00	190,425,400	貸付有価証券 39,500株
コナカ	317,300	339.00	107,564,700	
ハウス オブ ローゼ	35,900	1,661.00	59,629,900	貸付有価証券 25,000株
G - 7ホールディングス	326,500	1,451.00	473,751,500	貸付有価証券 800株
イオン北海道	387,400	1,079.00	418,004,600	貸付有価証券 3,100株
コジマ	505,200	642.00	324,338,400	貸付有価証券 359,200株
ヒマラヤ	91,300	965.00	88,104,500	貸付有価証券 67,900株
コーナン商事	417,600	3,670.00	1,532,592,000	貸付有価証券 60,600株
エコス	97,100	2,271.00	220,514,100	貸付有価証券 71,500株
ワタミ	355,800	891.00	317,017,800	貸付有価証券 197,600株
マルシェ	95,000	451.00	42,845,000	貸付有価証券 67,600株
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	5,875,200	2,132.00	12,525,926,400	貸付有価証券 4,178,000株
西松屋チェーン	580,000	1,498.00	868,840,000	貸付有価証券 422,300株
ゼンショーホールディングス	1,434,300	3,330.00	4,776,219,000	貸付有価証券 1,019,900株
幸楽苑ホールディングス	170,900	1,265.00	216,188,500	貸付有価証券 123,600株
ハークスレイ	122,600	547.00	67,062,200	貸付有価証券 83,800株
サイゼリヤ	435,700	2,624.00	1,143,276,800	貸付有価証券 309,800株

VTホールディングス	1,105,700	492.00	544,004,400	貸付有価証券 734,500株
魚力	81,300	2,450.00	199,185,000	貸付有価証券 57,100株
ポブラ	65,500	146.00	9,563,000	貸付有価証券 31,700株
フジ・コーポレーション	155,400	1,243.00	193,162,200	貸付有価証券 107,000株
ユナイテッドアローズ	307,800	1,827.00	562,350,600	貸付有価証券 215,200株
ハイデイ日高	424,000	2,066.00	875,984,000	貸付有価証券 301,400株
YU-WA Creation Holdings	172,200	209.00	35,989,800	貸付有価証券 24,000株
コロワイド	1,207,300	1,825.00	2,203,322,500	貸付有価証券 858,500株
ピーシーデポコーポレーション	341,100	308.00	105,058,800	貸付有価証券 226,500株
巻番屋	207,000	4,725.00	978,075,000	貸付有価証券 8,700株
トップカルチャー	105,800	232.00	24,545,600	貸付有価証券 600株
PLANT	67,400	643.00	43,338,200	貸付有価証券 900株
スギホールディングス	586,500	6,120.00	3,589,380,000	貸付有価証券 104,900株
薬王堂ホールディングス	146,300	2,070.00	302,841,000	貸付有価証券 12,200株
ヴィア・ホールディングス	381,900	144.00	54,993,600	貸付有価証券 233,900株
スクロール	452,200	929.00	420,093,800	貸付有価証券 201,000株
ヨンドシーホールディングス	247,900	1,750.00	433,825,000	貸付有価証券 93,800株
木曽路	390,600	2,175.00	849,555,000	貸付有価証券 277,700株
SRSホールディングス	422,300	857.00	361,911,100	貸付有価証券 300,300株
千趣会	530,300	378.00	200,453,400	貸付有価証券 377,100株
タカキュー	204,100	90.00	18,369,000	貸付有価証券 149,900株
リテールパートナーズ	388,800	1,165.00	452,952,000	貸付有価証券 276,500株
ケーヨー	543,000	889.00	482,727,000	貸付有価証券 24,400株
上新電機	285,200	1,915.00	546,158,000	貸付有価証券 154,000株
日本瓦斯	1,403,900	1,944.00	2,729,181,600	
ロイヤルホールディングス	454,100	2,115.00	960,421,500	貸付有価証券 336,300株

東天紅	21,400	910.00	19,474,000	貸付有価証券 100株
いなげや	291,100	1,275.00	371,152,500	貸付有価証券 192,500株
チヨダ	250,400	778.00	194,811,200	貸付有価証券 24,700株
ライフコーポレーション	229,000	2,664.00	610,056,000	貸付有価証券 63,300株
リンガーハット	338,000	2,363.00	798,694,000	貸付有価証券 240,500株
MrMaxHD	366,900	614.00	225,276,600	貸付有価証券 50,100株
テンアライド	287,200	305.00	87,596,000	貸付有価証券 204,200株
AOKIホールディングス	568,200	661.00	375,580,200	貸付有価証券 43,100株
オークワ	419,000	855.00	358,245,000	貸付有価証券 3,800株
コメリ	453,500	2,612.00	1,184,542,000	貸付有価証券 49,100株
青山商事	560,100	839.00	469,923,900	貸付有価証券 1,700株
しまむら	341,900	12,350.00	4,222,465,000	
はせがわ	155,400	253.00	39,316,200	貸付有価証券 6,200株
高島屋	1,975,600	1,337.00	2,641,377,200	貸付有価証券 103,100株
松屋	493,600	823.00	406,232,800	貸付有価証券 36,600株
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,275,600	953.00	1,215,646,800	貸付有価証券 73,900株
近鉄百貨店	84,300	2,335.00	196,840,500	貸付有価証券 20,600株
丸井グループ	2,125,800	2,232.00	4,744,785,600	貸付有価証券 182,600株
アクシアル リテイリング	195,000	3,275.00	638,625,000	貸付有価証券 10,900株
井筒屋	138,300	334.00	46,192,200	貸付有価証券 95,000株
イオン	9,690,600	2,624.50	25,432,979,700	貸付有価証券 2,942,100株
イズミ	464,600	3,020.00	1,403,092,000	貸付有価証券 9,300株
平和堂	438,000	1,962.00	859,356,000	貸付有価証券 315,000株
フジ	643,600	2,193.00	1,411,414,800	貸付有価証券 394,800株
ヤオコー	333,500	6,280.00	2,094,380,000	貸付有価証券 233,300株
ゼビオホールディングス	399,400	900.00	359,460,000	貸付有価証券 258,900株

ケースホールディングス	2,500,600	1,360.00	3,400,816,000	貸付有価証券 1,354,700株
Olympicグループ	129,700	639.00	82,878,300	貸付有価証券 79,800株
日産東京販売ホールディングス	432,000	269.00	116,208,000	貸付有価証券 286,600株
シルバーライフ	60,000	1,374.00	82,440,000	貸付有価証券 42,000株
Genky DrugStores	129,100	3,330.00	429,903,000	貸付有価証券 87,900株
ナルミヤ・インターナショナル	65,600	864.00	56,678,400	貸付有価証券 44,500株
ブックオフグループホールディングス	171,300	1,004.00	171,985,200	貸付有価証券 116,100株
ギフトホールディングス	46,100	2,152.00	99,207,200	
アインホールディングス	360,900	7,490.00	2,703,141,000	貸付有価証券 251,300株
元気寿司	82,300	2,510.00	206,573,000	貸付有価証券 58,500株
ヤマダホールディングス	10,394,200	486.00	5,051,581,200	貸付有価証券 7,391,700株
アークランドサカモト	459,900	1,592.00	732,160,800	貸付有価証券 48,500株
ニトリホールディングス	1,165,900	13,705.00	15,978,659,500	貸付有価証券 61,800株
グルメ軒屋	233,400	1,005.00	234,567,000	貸付有価証券 165,900株
愛眼	214,700	179.00	38,431,300	貸付有価証券 119,700株
ケーユーホールディングス	153,300	1,067.00	163,571,100	貸付有価証券 4,100株
吉野家ホールディングス	1,025,500	2,398.00	2,459,149,000	貸付有価証券 729,200株
松屋フーズホールディングス	141,200	4,010.00	566,212,000	貸付有価証券 90,700株
サガミホールディングス	421,000	1,095.00	460,995,000	貸付有価証券 278,900株
関西フードマーケット	236,600	1,204.00	284,866,400	貸付有価証券 150,500株
王将フードサービス	194,100	6,720.00	1,304,352,000	貸付有価証券 128,200株
プレナス	328,900	1,977.00	650,235,300	貸付有価証券 400株
ミニストップ	217,600	1,470.00	319,872,000	貸付有価証券 154,700株
アークス	520,600	2,085.00	1,085,451,000	貸付有価証券 500株
バローホールディングス	600,000	1,898.00	1,138,800,000	貸付有価証券 6,900株
ベルク	130,500	5,180.00	675,990,000	貸付有価証券 4,100株

大庄	157,100	1,151.00	180,822,100	貸付有価証券 111,700株
ファーストリテイリング	393,000	68,260.00	26,826,180,000	貸付有価証券 3,700株
サンドラッグ	1,105,200	3,090.00	3,415,068,000	貸付有価証券 53,000株
サクスパー ホールディングス	276,500	616.00	170,324,000	貸付有価証券 183,400株
ヤマザワ	60,900	1,493.00	90,923,700	貸付有価証券 45,400株
やまや	60,300	2,506.00	151,111,800	貸付有価証券 42,800株
ペルーナ	630,400	757.00	477,212,800	貸付有価証券 382,000株
島根銀行	93,600	500.00	46,800,000	貸付有価証券 9,000株
じもとホールディングス	194,500	563.00	109,503,500	貸付有価証券 400株
めぶきフィナンシャルグループ	12,103,900	262.00	3,171,221,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	340,600	2,184.00	743,870,400	
九州フィナンシャルグループ	5,150,100	383.00	1,972,488,300	貸付有価証券 275,300株
ゆうちょ銀行	6,945,600	1,061.00	7,369,281,600	貸付有価証券 4,697,000株
富山第一銀行	654,500	410.00	268,345,000	貸付有価証券 153,100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	14,564,100	451.00	6,568,409,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	1,544,500	727.00	1,122,851,500	貸付有価証券 6,800株
三十三フィナンシャルグループ	236,300	1,401.00	331,056,300	貸付有価証券 60,100株
第四北越フィナンシャルグループ	414,900	2,477.00	1,027,707,300	
ひろぎんホールディングス	3,761,000	617.00	2,320,537,000	貸付有価証券 273,600株
おきなわフィナンシャルグループ	248,800	2,137.00	531,685,600	貸付有価証券 18,300株
十六フィナンシャルグループ	342,500	2,347.00	803,847,500	貸付有価証券 51,900株
北國フィナンシャルホールディングス	243,000	4,555.00	1,106,865,000	貸付有価証券 170,200株
プロクレアホールディングス	298,600	1,992.00	594,811,200	貸付有価証券 142,900株
新生銀行	1,919,300	1,972.00	3,784,859,600	貸付有価証券 8,500株
あおぞら銀行	1,643,300	2,678.00	4,400,757,400	貸付有価証券 1,164,500株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	172,219,800	724.60	124,790,467,080	代用有価証券 5,734,200株 貸付有価証券 2,553,400株
りそなホールディングス	31,132,000	503.70	15,681,188,400	貸付有価証券 4,970,800株

三井住友トラスト・ホールディングス	4,866,200	4,198.00	20,428,307,600	貸付有価証券 196,200株
三井住友フィナンシャルグループ	19,093,300	4,064.00	77,595,171,200	代用有価証券 70,500株 貸付有価証券 96,700株
千葉銀行	8,308,400	733.00	6,090,057,200	貸付有価証券 115,000株
群馬銀行	4,733,300	376.00	1,779,720,800	貸付有価証券 59,200株
武蔵野銀行	375,700	1,746.00	655,972,200	貸付有価証券 38,300株
千葉興業銀行	633,900	252.00	159,742,800	貸付有価証券 11,000株
筑波銀行	1,147,000	187.00	214,489,000	貸付有価証券 12,600株
七十七銀行	781,000	1,731.00	1,351,911,000	貸付有価証券 33,000株
秋田銀行	176,000	1,638.00	288,288,000	
山形銀行	270,900	888.00	240,559,200	貸付有価証券 106,200株
岩手銀行	179,900	1,946.00	350,085,400	
東邦銀行	2,104,700	205.00	431,463,500	貸付有価証券 249,700株
東北銀行	132,100	966.00	127,608,600	貸付有価証券 17,300株
ふくおかフィナンシャルグループ	2,124,300	2,375.00	5,045,212,500	貸付有価証券 137,500株
静岡銀行	6,063,100	808.00	4,898,984,800	貸付有価証券 302,200株
スルガ銀行	2,579,900	369.00	951,983,100	貸付有価証券 33,000株
八十二銀行	5,458,200	497.00	2,712,725,400	貸付有価証券 22,200株
山梨中央銀行	296,000	1,156.00	342,176,000	
大垣共立銀行	503,600	1,726.00	869,213,600	貸付有価証券 17,800株
福井銀行	234,800	1,345.00	315,806,000	貸付有価証券 126,500株
清水銀行	105,100	1,449.00	152,289,900	貸付有価証券 9,400株
富山銀行	45,400	1,788.00	81,175,200	貸付有価証券 32,900株
滋賀銀行	479,400	2,651.00	1,270,889,400	貸付有価証券 700株
南都銀行	397,600	1,982.00	788,043,200	貸付有価証券 4,500株
百五銀行	2,471,200	323.00	798,197,600	貸付有価証券 189,800株
京都銀行	913,200	5,610.00	5,123,052,000	貸付有価証券 158,600株
紀陽銀行	872,700	1,369.00	1,194,726,300	

ほくほくフィナンシャルグループ	1,669,700	828.00	1,382,511,600	貸付有価証券 12,300株
山陰合同銀行	1,635,600	654.00	1,069,682,400	貸付有価証券 12,200株
中国銀行	2,070,100	976.00	2,020,417,600	貸付有価証券 17,400株
鳥取銀行	93,500	1,159.00	108,366,500	貸付有価証券 62,100株
伊予銀行	3,298,600	651.00	2,147,388,600	貸付有価証券 220,700株
百十四銀行	270,900	1,649.00	446,714,100	貸付有価証券 3,000株
四国銀行	387,400	841.00	325,803,400	貸付有価証券 294,800株
阿波銀行	390,500	2,004.00	782,562,000	貸付有価証券 53,300株
大分銀行	158,000	1,848.00	291,984,000	貸付有価証券 7,000株
宮崎銀行	159,200	2,051.00	326,519,200	貸付有価証券 11,800株
佐賀銀行	154,700	1,468.00	227,099,600	貸付有価証券 500株
琉球銀行	638,800	784.00	500,819,200	
セブン銀行	8,737,800	258.00	2,254,352,400	貸付有価証券 895,000株
みずほフィナンシャルグループ	35,276,700	1,559.00	54,996,375,300	
高知銀行	92,500	693.00	64,102,500	貸付有価証券 29,300株
山口フィナンシャルグループ	2,938,000	745.00	2,188,810,000	貸付有価証券 77,500株
長野銀行	90,000	1,260.00	113,400,000	貸付有価証券 3,800株
名古屋銀行	179,900	3,050.00	548,695,000	貸付有価証券 61,900株
北洋銀行	3,696,000	226.00	835,296,000	
愛知銀行	91,200	5,240.00	477,888,000	貸付有価証券 3,100株
中京銀行	90,800	1,694.00	153,815,200	貸付有価証券 64,300株
大光銀行	87,300	1,339.00	116,894,700	
愛媛銀行	383,400	887.00	340,075,800	貸付有価証券 6,400株
トマト銀行	89,200	1,002.00	89,378,400	
京葉銀行	1,227,400	460.00	564,604,000	貸付有価証券 283,100株
栃木銀行	1,319,600	252.00	332,539,200	貸付有価証券 24,700株
北日本銀行	85,500	1,631.00	139,450,500	貸付有価証券 60,800株
東和銀行	482,100	516.00	248,763,600	貸付有価証券 7,200株

福島銀行	311,200	214.00	66,596,800	貸付有価証券 28,100株
大東銀行	129,400	645.00	83,463,000	貸付有価証券 12,400株
トモニホールディングス	2,122,800	309.00	655,945,200	貸付有価証券 10,100株
フィデアホールディングス	268,800	1,288.00	346,214,400	貸付有価証券 3,000株
池田泉州ホールディングス	3,123,200	197.00	615,270,400	貸付有価証券 102,700株
F P G	990,000	903.00	893,970,000	貸付有価証券 35,900株
ジャパンインベストメントアドバイザー	227,700	1,235.00	281,209,500	貸付有価証券 73,600株
マーキュリアホールディングス	158,900	607.00	96,452,300	貸付有価証券 4,700株
S B Iホールディングス	3,634,000	2,693.00	9,786,362,000	貸付有価証券 22,000株
日本アジア投資	231,900	241.00	55,887,900	貸付有価証券 92,200株
ジャフコ グループ	1,018,000	1,683.00	1,713,294,000	貸付有価証券 25,400株
大和証券グループ本社	18,895,700	617.60	11,669,984,320	貸付有価証券 382,600株
野村ホールディングス	44,922,300	506.00	22,730,683,800	貸付有価証券 786,900株
岡三証券グループ	2,121,300	345.00	731,848,500	貸付有価証券 101,000株
丸三証券	873,900	485.00	423,841,500	貸付有価証券 584,800株
東洋証券	890,100	202.00	179,800,200	貸付有価証券 275,300株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2,896,100	377.00	1,091,829,700	貸付有価証券 16,800株
光世証券	61,500	450.00	27,675,000	貸付有価証券 1,400株
水戸証券	720,200	258.00	185,811,600	貸付有価証券 113,200株
いちよし証券	486,800	640.00	311,552,000	貸付有価証券 236,000株
松井証券	1,440,800	801.00	1,154,080,800	貸付有価証券 12,400株
マネックスグループ	2,477,000	455.00	1,127,035,000	貸付有価証券 1,759,400株
極東証券	333,900	686.00	229,055,400	貸付有価証券 58,000株
岩井コスモホールディングス	278,000	1,250.00	347,500,000	
アイザワ証券グループ	396,100	708.00	280,438,800	貸付有価証券 36,300株
マネーパートナーズグループ	313,100	254.00	79,527,400	貸付有価証券 6,600株

スパークス・グループ	1,358,700	277.00	376,359,900	貸付有価証券 315,900株
小林洋行	104,600	217.00	22,698,200	貸付有価証券 9,900株
かんぼ生命保険	2,961,500	2,171.00	6,429,416,500	貸付有価証券 121,500株
S O M P Oホールディングス	4,186,300	5,923.00	24,795,454,900	貸付有価証券 195,400株
アニコム ホールディングス	903,700	662.00	598,249,400	貸付有価証券 1,000株
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	6,047,800	4,257.00	25,745,484,600	貸付有価証券 35,800株
第一生命ホールディングス	14,328,100	2,403.00	34,430,424,300	貸付有価証券 3,689,800株
東京海上ホールディングス	8,187,300	7,959.00	65,162,720,700	貸付有価証券 170,900株
T & Dホールディングス	6,546,200	1,595.00	10,441,189,000	貸付有価証券 181,700株
アドバンスクリエイト	141,000	960.00	135,360,000	貸付有価証券 88,500株
全国保証	701,700	4,310.00	3,024,327,000	貸付有価証券 436,100株
あんしん保証	116,600	260.00	30,316,000	貸付有価証券 36,900株
ジェイリース	99,100	1,980.00	196,218,000	貸付有価証券 4,800株
イントラスト	124,200	552.00	68,558,400	貸付有価証券 2,600株
日本モーゲージサービス	163,400	968.00	158,171,200	貸付有価証券 113,900株
C a s a	103,800	879.00	91,240,200	貸付有価証券 73,700株
アルヒ	434,400	1,005.00	436,572,000	貸付有価証券 257,600株
プレミアグループ	148,900	4,345.00	646,970,500	貸付有価証券 12,700株
ネットプロテクションズホールディングス	893,300	527.00	470,769,100	貸付有価証券 635,200株
クレディセゾン	1,717,500	1,532.00	2,631,210,000	貸付有価証券 270,200株
芙蓉総合リース	252,500	7,720.00	1,949,300,000	貸付有価証券 15,000株
みずほリース	363,100	3,170.00	1,151,027,000	貸付有価証券 287,500株
東京センチュリー	455,800	4,460.00	2,032,868,000	貸付有価証券 43,700株
日本証券金融	1,155,800	850.00	982,430,000	貸付有価証券 66,000株
アイフル	4,937,200	363.00	1,792,203,600	貸付有価証券 2,402,300株
リコーリース	260,400	3,545.00	923,118,000	貸付有価証券 180,700株

イオンフィナンシャルサービス	1,600,500	1,261.00	2,018,230,500	貸付有価証券 77,500株
アコム	5,803,600	319.00	1,851,348,400	
ジャックス	292,400	3,375.00	986,850,000	
オリエントコーポレーション	7,959,100	127.00	1,010,805,700	貸付有価証券 2,451,000株
オリックス	17,480,700	2,265.00	39,593,785,500	貸付有価証券 1,285,300株
三菱HCキャピタル	9,510,200	616.00	5,858,283,200	貸付有価証券 318,000株
九州リースサービス	126,200	568.00	71,681,600	貸付有価証券 95,300株
日本取引所グループ	6,853,800	2,091.00	14,331,295,800	貸付有価証券 71,300株
イー・ギャランティ	437,100	2,200.00	961,620,000	貸付有価証券 228,500株
アサックス	152,800	603.00	92,138,400	貸付有価証券 101,700株
NECキャピタルソリューション	119,700	2,035.00	243,589,500	貸付有価証券 79,500株
いちご	3,276,400	312.00	1,022,236,800	貸付有価証券 20,700株
日本駐車場開発	2,904,200	171.00	496,618,200	
スター・マイカ・ホールディングス	160,400	1,436.00	230,334,400	貸付有価証券 98,100株
SREホールディングス	74,700	2,619.00	195,639,300	貸付有価証券 53,100株
ADワークスグループ	524,600	149.00	78,165,400	貸付有価証券 394,700株
ヒューリック	6,400,900	1,039.00	6,650,535,100	貸付有価証券 4,552,000株
三栄建築設計	117,900	1,604.00	189,111,600	
野村不動産ホールディングス	1,522,700	3,185.00	4,849,799,500	貸付有価証券 70,100株
三重交通グループホールディングス	596,300	465.00	277,279,500	貸付有価証券 396,900株
サムティ	430,900	2,017.00	869,125,300	貸付有価証券 57,400株
ディア・ライフ	360,800	605.00	218,284,000	貸付有価証券 21,100株
コーセーアールイー	86,400	652.00	56,332,800	貸付有価証券 61,400株
地主	186,300	2,052.00	382,287,600	貸付有価証券 128,900株
プレサンスコーポレーション	320,800	1,505.00	482,804,000	貸付有価証券 227,700株
THEグローバル社	157,300	145.00	22,808,500	貸付有価証券 36,500株
ハウスコム	50,500	891.00	44,995,500	貸付有価証券 11,400株

J P M C	141,000	1,000.00	141,000,000	貸付有価証券 6,300株
サンセイランディック	86,300	835.00	72,060,500	貸付有価証券 61,000株
エストラスト	34,300	561.00	19,242,300	貸付有価証券 1,300株
フージャースホールディングス	376,100	787.00	295,990,700	
オープンハウスグループ	935,700	5,550.00	5,193,135,000	貸付有価証券 182,800株
東急不動産ホールディングス	8,000,200	695.00	5,560,139,000	
飯田グループホールディングス	2,454,300	2,112.00	5,183,481,600	
イーランド	41,300	1,406.00	58,067,800	
ムゲンエステート	180,500	477.00	86,098,500	貸付有価証券 126,200株
ビーロッド	204,100	503.00	102,662,300	貸付有価証券 45,900株
ファーストブラザーズ	66,900	848.00	56,731,200	貸付有価証券 27,400株
A n d D oホールディングス	144,900	820.00	118,818,000	貸付有価証券 56,100株
シーアールイー	111,000	1,663.00	184,593,000	貸付有価証券 78,900株
プロパティエージェント	33,800	1,450.00	49,010,000	貸付有価証券 24,000株
ケイアイスター不動産	132,200	4,650.00	614,730,000	貸付有価証券 94,000株
アグレ都市デザイン	47,900	1,505.00	72,089,500	貸付有価証券 31,900株
グッドコムアセット	127,000	1,258.00	159,766,000	貸付有価証券 42,700株
ジェイ・エス・ビー	59,800	3,115.00	186,277,000	
ロードスターキャピタル	74,500	1,907.00	142,071,500	貸付有価証券 52,900株
テンポイノベーション	81,800	867.00	70,920,600	貸付有価証券 44,600株
グローバル・リンク・マネジメント	51,400	905.00	46,517,000	貸付有価証券 23,800株
フェイスネットワーク	36,900	1,366.00	50,405,400	貸付有価証券 1,700株
パーク24	1,742,600	1,716.00	2,990,301,600	
パラカ	85,800	1,790.00	153,582,000	貸付有価証券 61,000株
宮越ホールディングス	111,200	912.00	101,414,400	貸付有価証券 77,700株
三井不動産	11,481,500	2,848.00	32,699,312,000	貸付有価証券 218,000株
三菱地所	16,753,700	1,943.50	32,560,815,950	貸付有価証券 10,700株
平和不動産	467,900	3,910.00	1,829,489,000	
東京建物	2,518,400	1,930.00	4,860,512,000	貸付有価証券 723,600株

京阪神ビルディング	384,400	1,292.00	496,644,800	
住友不動産	5,291,200	3,441.00	18,207,019,200	貸付有価証券 122,100株
テ-オーシー	441,200	776.00	342,371,200	貸付有価証券 351,300株
東京楽天地	42,200	3,930.00	165,846,000	貸付有価証券 31,800株
レオパレス21	3,050,600	245.00	747,397,000	貸付有価証券 896,500株
スターツコーポレーション	400,100	2,796.00	1,118,679,600	貸付有価証券 3,200株
フジ住宅	341,300	652.00	222,527,600	貸付有価証券 237,400株
空港施設	294,400	533.00	156,915,200	貸付有価証券 14,200株
明和地所	138,300	620.00	85,746,000	貸付有価証券 900株
ゴールドクレスト	232,000	1,684.00	390,688,000	貸付有価証券 164,900株
エスリード	114,600	1,651.00	189,204,600	貸付有価証券 76,100株
日神グループホールディングス	478,300	430.00	205,669,000	貸付有価証券 317,200株
日本エスコン	547,800	765.00	419,067,000	貸付有価証券 263,300株
タカラレーベン	1,232,800	352.00	433,945,600	貸付有価証券 1,800株
A V A N T I A	137,900	803.00	110,733,700	貸付有価証券 64,100株
イオンモール	1,475,300	1,645.00	2,426,868,500	貸付有価証券 120,600株
毎日コムネット	100,000	623.00	62,300,000	貸付有価証券 69,900株
ファースト住建	109,600	1,100.00	120,560,000	貸付有価証券 76,000株
ランド	16,016,600	10.00	160,166,000	貸付有価証券 1,549,900株
カチタス	728,400	3,175.00	2,312,670,000	貸付有価証券 104,400株
トーセイ	405,800	1,177.00	477,626,600	貸付有価証券 100株
穴吹興産	64,100	2,081.00	133,392,100	貸付有価証券 45,500株
サンフロンティア不動産	406,400	1,084.00	440,537,600	貸付有価証券 270,600株
FJネクストホールディングス	288,800	1,063.00	306,994,400	貸付有価証券 132,200株
インテリックス	66,200	567.00	37,535,400	貸付有価証券 46,300株
ランドビジネス	99,200	227.00	22,518,400	貸付有価証券 4,700株

サンネクスタグループ	93,800	1,012.00	94,925,600	貸付有価証券 64,900株
グランディハウス	199,800	534.00	106,693,200	貸付有価証券 8,700株
日本空港ビルデング	949,000	5,070.00	4,811,430,000	貸付有価証券 86,800株
明豊ファシリティワークス	130,200	636.00	82,807,200	貸付有価証券 1,500株
日本工営	181,300	3,290.00	596,477,000	貸付有価証券 300株
L I F U L L	870,200	168.00	146,193,600	貸付有価証券 458,600株
ミクシィ	652,100	2,219.00	1,447,009,900	貸付有価証券 165,300株
ジェイエイシーリクルートメント	230,000	1,829.00	420,670,000	貸付有価証券 300株
日本M&Aセンターホールディングス	4,675,700	1,670.00	7,808,419,000	貸付有価証券 248,700株
メンバーズ	74,100	2,592.00	192,067,200	貸付有価証券 2,400株
中広	45,700	390.00	17,823,000	貸付有価証券 28,000株
UTグループ	411,200	2,594.00	1,066,652,800	貸付有価証券 8,500株
アイティメディア	135,100	1,580.00	213,458,000	貸付有価証券 17,200株
E・Jホールディングス	163,800	1,163.00	190,499,400	貸付有価証券 48,200株
夢真ビーネックスグループ	929,300	1,581.00	1,469,223,300	貸付有価証券 623,400株
コシダカホールディングス	762,300	694.00	529,036,200	貸付有価証券 542,000株
アルトナー	68,900	875.00	60,287,500	貸付有価証券 25,900株
パソナグループ	308,900	1,944.00	600,501,600	貸付有価証券 22,000株
C D S	70,500	1,779.00	125,419,500	貸付有価証券 2,400株
リンクアンドモチベーション	628,300	481.00	302,212,300	貸付有価証券 412,800株
エス・エム・エス	968,600	2,951.00	2,858,338,600	貸付有価証券 21,200株
サニーサイドアップグループ	98,500	647.00	63,729,500	貸付有価証券 31,900株
パーソルホールディングス	2,850,000	2,685.00	7,652,250,000	貸付有価証券 301,200株
リニカル	160,400	766.00	122,866,400	貸付有価証券 17,600株
クックパッド	895,500	201.00	179,995,500	貸付有価証券 577,000株
エスクリ	127,700	356.00	45,461,200	貸付有価証券 84,900株

アイ・ケイ・ケイホールディングス	138,800	593.00	82,308,400	貸付有価証券 94,900株
学情	115,300	983.00	113,339,900	貸付有価証券 75,900株
スタジオアリス	127,300	2,363.00	300,809,900	貸付有価証券 93,200株
シミックホールディングス	140,200	1,486.00	208,337,200	貸付有価証券 104,700株
エプロ	60,400	701.00	42,340,400	貸付有価証券 11,900株
N J S	62,800	1,915.00	120,262,000	貸付有価証券 2,500株
総合警備保障	1,039,600	3,850.00	4,002,460,000	
カカクコム	2,091,400	2,353.00	4,921,064,200	貸付有価証券 32,300株
アイロムグループ	102,600	1,876.00	192,477,600	貸付有価証券 19,800株
セントケア・ホールディング	185,100	860.00	159,186,000	貸付有価証券 26,200株
サイネックス	47,900	594.00	28,452,600	貸付有価証券 900株
ルネサンス	198,000	915.00	181,170,000	貸付有価証券 140,700株
ディップ	501,300	3,730.00	1,869,849,000	貸付有価証券 45,400株
デジタルホールディングス	198,500	1,230.00	244,155,000	貸付有価証券 20,000株
新日本科学	347,000	2,000.00	694,000,000	
キャリアデザインセンター	58,800	1,151.00	67,678,800	貸付有価証券 41,600株
ベネフィット・ワン	1,037,100	1,961.00	2,033,753,100	貸付有価証券 18,800株
エムスリー	5,030,300	4,136.00	20,805,320,800	貸付有価証券 7,600株
ツカダ・グローバルホールディング	181,400	321.00	58,229,400	貸付有価証券 109,500株
プラス	37,000	902.00	33,374,000	貸付有価証券 300株
アウトソーシング	1,632,900	1,110.00	1,812,519,000	貸付有価証券 132,000株
ウェルネット	251,600	451.00	113,471,600	貸付有価証券 52,400株
ワールドホールディングス	114,000	2,263.00	257,982,000	貸付有価証券 41,500株
ディー・エヌ・エー	1,085,400	1,878.00	2,038,381,200	貸付有価証券 257,600株
博報堂DYホールディングス	3,608,000	1,255.00	4,528,040,000	
ぐるなび	415,800	371.00	154,261,800	貸付有価証券 255,800株
タカミヤ	345,100	362.00	124,926,200	

ジャパンベストレスキューシステム	160,600	752.00	120,771,200	貸付有価証券 3,600株
ファンコミュニケーションズ	641,300	383.00	245,617,900	貸付有価証券 10,600株
ライク	94,800	2,257.00	213,963,600	貸付有価証券 9,200株
ビジネス・ブレークスルー	105,700	418.00	44,182,600	貸付有価証券 25,400株
エスプール	804,900	962.00	774,313,800	貸付有価証券 100株
WDBホールディングス	130,000	2,341.00	304,330,000	貸付有価証券 86,100株
ティア	166,000	431.00	71,546,000	貸付有価証券 34,800株
CDG	30,300	1,278.00	38,723,400	貸付有価証券 20,000株
アドウェイズ	427,900	668.00	285,837,200	貸付有価証券 256,000株
バリューコマース	223,500	3,140.00	701,790,000	貸付有価証券 156,300株
インフォマート	3,123,700	389.00	1,215,119,300	貸付有価証券 77,500株
J Pホールディングス	732,300	259.00	189,665,700	貸付有価証券 2,900株
エコナックホールディングス	490,200	91.00	44,608,200	貸付有価証券 348,500株
CLホールディングス	60,200	904.00	54,420,800	貸付有価証券 41,900株
プレステージ・インターナショナル	1,068,500	692.00	739,402,000	貸付有価証券 500株
アミューズ	155,200	1,958.00	303,881,600	貸付有価証券 10,800株
ドリームインキュベータ	87,200	1,929.00	168,208,800	貸付有価証券 58,400株
クイック	176,900	1,423.00	251,728,700	貸付有価証券 2,000株
TAC	154,200	215.00	33,153,000	貸付有価証券 9,200株
電通グループ	2,671,200	4,160.00	11,112,192,000	貸付有価証券 1,897,400株
テイクアンドギヴ・ニーズ	133,100	1,291.00	171,832,100	貸付有価証券 88,200株
ぴあ	85,300	3,090.00	263,577,000	貸付有価証券 28,500株
イオンファンタジー	109,900	2,412.00	265,078,800	貸付有価証券 76,600株
シーティーエス	321,600	811.00	260,817,600	
ネクシィーズグループ	87,300	583.00	50,895,900	
H.U.グループホールディングス	744,900	3,020.00	2,249,598,000	
アルプス技研	241,700	1,792.00	433,126,400	

サニックス	498,400	230.00	114,632,000	貸付有価証券 223,100株
ダイオーズ	56,000	1,074.00	60,144,000	貸付有価証券 100株
日本空調サービス	298,300	782.00	233,270,600	貸付有価証券 9,500株
オリエンタルランド	3,031,600	18,125.00	54,947,750,000	貸付有価証券 285,500株
ダスキン	614,000	2,880.00	1,768,320,000	貸付有価証券 208,600株
明光ネットワークジャパン	334,800	613.00	205,232,400	貸付有価証券 238,000株
ファルコホールディングス	125,400	1,918.00	240,517,200	
秀英予備校	62,200	427.00	26,559,400	貸付有価証券 41,800株
田谷	52,000	551.00	28,652,000	貸付有価証券 36,900株
ラウンドワン	795,600	1,376.00	1,094,745,600	貸付有価証券 230,200株
リゾートトラスト	1,206,100	2,010.00	2,424,261,000	貸付有価証券 246,400株
ビー・エム・エル	362,700	3,605.00	1,307,533,500	貸付有価証券 101,600株
りらいあコミュニケーションズ	420,300	1,089.00	457,706,700	
リソー教育	1,302,200	320.00	416,704,000	貸付有価証券 147,300株
早稲田アカデミー	158,500	1,138.00	180,373,000	貸付有価証券 112,700株
ユー・エス・エス	3,191,400	2,427.00	7,745,527,800	貸付有価証券 108,500株
東京個別指導学院	251,400	609.00	153,102,600	貸付有価証券 166,500株
サイバーエージェント	6,088,800	1,359.00	8,274,679,200	
楽天グループ	13,229,900	637.00	8,427,446,300	貸付有価証券 6,746,600株
クリーク・アンド・リバー社	149,200	2,110.00	314,812,000	
モーニングスター	498,300	523.00	260,610,900	貸付有価証券 108,900株
テー・オー・ダブリュー	544,300	309.00	168,188,700	貸付有価証券 158,100株
山田コンサルティンググループ	147,400	1,106.00	163,024,400	
セントラルスポーツ	106,200	2,451.00	260,296,200	貸付有価証券 75,500株
フルキャストホールディングス	243,000	2,426.00	589,518,000	貸付有価証券 2,500株
エン・ジャパン	506,500	1,943.00	984,129,500	
リソルホールディングス	30,900	4,570.00	141,213,000	貸付有価証券 20,900株
テクノプロ・ホールディングス	1,707,100	3,055.00	5,215,190,500	貸付有価証券 573,600株

アトラグループ	63,300	195.00	12,343,500	貸付有価証券 40,400株
インターワークス	81,700	367.00	29,983,900	貸付有価証券 300株
アイ・アールジャパンホールディングス	132,200	2,229.00	294,673,800	貸付有価証券 67,200株
K e e P e r 技研	183,400	3,450.00	632,730,000	貸付有価証券 111,100株
ファーストロジック	43,900	771.00	33,846,900	貸付有価証券 14,400株
三機サービス	49,600	990.00	49,104,000	貸付有価証券 32,500株
G u n o s y	157,100	705.00	110,755,500	貸付有価証券 111,700株
デザインワン・ジャパン	84,300	183.00	15,426,900	貸付有価証券 7,600株
イー・ガーディアン	96,400	2,905.00	280,042,000	
リブセンス	156,500	182.00	28,483,000	貸付有価証券 104,300株
ジャパンマテリアル	876,500	1,880.00	1,647,820,000	貸付有価証券 1,200株
ベクトル	399,600	1,007.00	402,397,200	貸付有価証券 197,500株
ウチヤマホールディングス	140,200	293.00	41,078,600	貸付有価証券 93,300株
チャーム・ケア・コーポレーション	212,000	1,008.00	213,696,000	貸付有価証券 150,700株
キャリアリンク	104,900	2,006.00	210,429,400	貸付有価証券 73,300株
I B J	233,400	761.00	177,617,400	貸付有価証券 160,700株
アサンテ	125,800	1,514.00	190,461,200	貸付有価証券 89,400株
バリューHR	246,400	1,336.00	329,190,400	貸付有価証券 84,200株
M & Aキャピタルパートナーズ	235,000	3,485.00	818,975,000	貸付有価証券 167,000株
ライドオンエクスプレスホールディングス	110,600	1,228.00	135,816,800	貸付有価証券 74,900株
E R Iホールディングス	79,800	1,168.00	93,206,400	貸付有価証券 38,100株
アピスト	44,200	2,723.00	120,356,600	貸付有価証券 30,600株
シグマクス・ホールディングス	343,100	1,215.00	416,866,500	
ウィルグループ	211,700	1,199.00	253,828,300	貸付有価証券 139,400株
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	296,500	162.00	48,033,000	
メドピア	200,000	2,157.00	431,400,000	貸付有価証券 106,900株
レアジョブ	53,700	563.00	30,233,100	貸付有価証券 37,100株

リクルートホールディングス	20,419,800	4,242.00	86,620,791,600	代用有価証券 779,800株 貸付有価証券 57,100株
エラン	392,800	1,077.00	423,045,600	貸付有価証券 500株
土木管理総合試験所	131,700	323.00	42,539,100	貸付有価証券 8,800株
ネットマーケティング	139,100	558.00	77,617,800	貸付有価証券 76,000株
日本郵政	31,143,200	973.60	30,321,019,520	貸付有価証券 44,500株
ベルシステム24ホールディングス	409,600	1,413.00	578,764,800	貸付有価証券 29,400株
鎌倉新書	324,600	548.00	177,880,800	貸付有価証券 195,400株
S MN	62,000	585.00	36,270,000	
一蔵	35,800	459.00	16,432,200	貸付有価証券 2,200株
グローバルキッズCOMPANY	43,500	676.00	29,406,000	貸付有価証券 1,300株
エアトリ	164,100	2,329.00	382,188,900	貸付有価証券 122,500株
アトラエ	199,800	1,685.00	336,663,000	貸付有価証券 41,700株
ストライク	125,500	3,560.00	446,780,000	貸付有価証券 89,200株
ソラスト	700,800	747.00	523,497,600	貸付有価証券 1,300株
セラク	90,400	1,264.00	114,265,600	貸付有価証券 37,500株
インソース	315,800	2,397.00	756,972,600	貸付有価証券 91,900株
ベイカレント・コンサルティング	201,500	39,000.00	7,858,500,000	貸付有価証券 54,100株
Orchestra Holdings	54,400	2,521.00	137,142,400	貸付有価証券 7,400株
アイモバイル	141,700	1,376.00	194,979,200	貸付有価証券 100,700株
キャリアインデックス	97,100	542.00	52,628,200	貸付有価証券 3,900株
MS - Japan	115,700	903.00	104,477,100	貸付有価証券 82,200株
船場	57,000	665.00	37,905,000	貸付有価証券 2,100株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	904,200	1,561.00	1,411,456,200	貸付有価証券 100株
フルテック	39,800	1,324.00	52,695,200	貸付有価証券 26,200株
グリーンズ	107,400	561.00	60,251,400	貸付有価証券 15,100株

ツナググループ・ホールディングス	79,900	315.00	25,168,500	貸付有価証券 15,700株
GameWith	84,800	482.00	40,873,600	貸付有価証券 4,400株
MS&Consulting	41,300	652.00	26,927,600	
ウェルビー	186,600	689.00	128,567,400	貸付有価証券 3,900株
エル・ティー・エス	36,400	3,650.00	132,860,000	貸付有価証券 18,300株
ミダックホールディングス	128,600	2,745.00	353,007,000	貸付有価証券 91,100株
日総工産	222,600	581.00	129,330,600	貸付有価証券 147,800株
キュービーネットホールディングス	131,700	1,333.00	175,556,100	貸付有価証券 1,000株
RPAホールディングス	401,500	334.00	134,101,000	貸付有価証券 285,400株
スプリックス	97,200	986.00	95,839,200	
マネジメントソリューションズ	139,900	2,789.00	390,181,100	貸付有価証券 97,400株
プロレド・パートナーズ	62,200	495.00	30,789,000	貸付有価証券 40,400株
and factory	82,100	398.00	32,675,800	貸付有価証券 29,600株
テノ・ホールディングス	34,700	687.00	23,838,900	貸付有価証券 8,100株
フロンティア・マネジメント	74,300	1,247.00	92,652,100	貸付有価証券 900株
ピアラ	46,200	690.00	31,878,000	貸付有価証券 32,000株
コプロ・ホールディングス	55,600	837.00	46,537,200	貸付有価証券 200株
ギークス	48,900	979.00	47,873,100	貸付有価証券 6,800株
カーブスホールディングス	782,400	675.00	528,120,000	貸付有価証券 507,700株
フォーラムエンジニアリング	173,200	925.00	160,210,000	
Fast Fitness Japan	52,000	1,386.00	72,072,000	貸付有価証券 36,000株
ダイレクトマーケティングミックス	289,300	1,829.00	529,129,700	貸付有価証券 67,500株
ポピンズ	66,000	1,824.00	120,384,000	貸付有価証券 43,900株
LITALICO	230,900	2,332.00	538,458,800	貸付有価証券 14,100株
アドバンテッジリスクマネジメント	144,000	444.00	63,936,000	貸付有価証券 7,600株
リログループ	1,558,900	2,039.00	3,178,597,100	貸付有価証券 35,800株
東祥	212,900	1,249.00	265,912,100	貸付有価証券 141,500株

ビーウィズ	76,100	1,385.00	105,398,500	貸付有価証券 3,000株
TREホールディングス	536,000	1,696.00	909,056,000	
人・夢・技術グループ	113,400	2,392.00	271,252,800	貸付有価証券 700株
エイチ・アイ・エス	591,700	1,966.00	1,163,282,200	貸付有価証券 421,000株
ラックランド	85,900	2,920.00	250,828,000	貸付有価証券 61,100株
共立メンテナンス	508,500	4,615.00	2,346,727,500	貸付有価証券 361,600株
イチネンホールディングス	292,200	1,234.00	360,574,800	貸付有価証券 195,900株
建設技術研究所	144,300	2,608.00	376,334,400	
スペース	184,800	884.00	163,363,200	貸付有価証券 2,300株
燦ホールディングス	123,900	1,799.00	222,896,100	貸付有価証券 26,600株
スバル興業	17,300	8,550.00	147,915,000	貸付有価証券 3,700株
東京テアトル	103,900	1,211.00	125,822,900	貸付有価証券 73,700株
タナベ経営	109,400	665.00	72,751,000	貸付有価証券 19,200株
ナガワ	79,500	7,780.00	618,510,000	貸付有価証券 57,500株
東京都競馬	213,100	4,035.00	859,858,500	貸付有価証券 8,000株
常磐興産	97,900	1,252.00	122,570,800	貸付有価証券 74,700株
カナモト	466,500	1,933.00	901,744,500	貸付有価証券 146,300株
西尾レントオール	236,700	2,779.00	657,789,300	貸付有価証券 10,000株
アゴーラ ホスピタリティグループ	1,565,100	22.00	34,432,200	貸付有価証券 185,800株
トランス・コスモス	361,500	3,470.00	1,254,405,000	貸付有価証券 98,900株
乃村工藝社	1,221,500	893.00	1,090,799,500	貸付有価証券 45,500株
藤田観光	124,400	2,642.00	328,664,800	貸付有価証券 67,400株
KNT-CTホールディングス	177,200	1,414.00	250,560,800	貸付有価証券 96,600株
日本管財	305,100	2,582.00	787,768,200	貸付有価証券 201,100株
トーカイ	225,300	1,669.00	376,025,700	
白洋舎	29,800	1,290.00	38,442,000	貸付有価証券 21,500株
セコム	2,808,900	8,657.00	24,316,647,300	貸付有価証券 46,500株

セントラル警備保障	137,200	2,826.00	387,727,200	貸付有価証券 96,700株
丹青社	538,200	806.00	433,789,200	貸付有価証券 6,700株
メイテック	1,015,000	2,307.00	2,341,605,000	貸付有価証券 46,500株
応用地質	271,700	1,693.00	459,988,100	貸付有価証券 5,200株
船井総研ホールディングス	534,900	2,256.00	1,206,734,400	貸付有価証券 141,600株
進学会ホールディングス	92,800	321.00	29,788,800	貸付有価証券 64,300株
オオバ	178,300	740.00	131,942,000	貸付有価証券 132,900株
いであ	69,500	1,675.00	116,412,500	貸付有価証券 49,700株
学究社	91,400	1,566.00	143,132,400	貸付有価証券 60,900株
ベネッセホールディングス	950,000	2,197.00	2,087,150,000	貸付有価証券 432,200株
イオンディライト	328,500	2,820.00	926,370,000	貸付有価証券 400株
ナック	135,100	970.00	131,047,000	貸付有価証券 91,000株
ダイセキ	519,600	3,730.00	1,938,108,000	
ステップ	104,200	1,672.00	174,222,400	貸付有価証券 900株
合 計	3,076,265,700		7,240,388,379,560	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年 7月 9日から2023年 1月 8日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【上場インデックスファンドTOPIX】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 2022年 7月 8日現在	当中間計算期間末 2023年 1月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,003,540,348,062	933,307,928,164
株式	7,240,388,379,560	7,256,563,458,990
派生商品評価勘定	1,200,150	-
未収入金	119,112,308,740	-
未収配当金	6,717,011,072	7,479,626,849
未収利息	20,310,842	84,195,806
前払金	2,717,276,300	695,106,800
その他未収収益	4,526,232,897	5,629,259,793
流動資産合計	8,377,023,067,623	8,203,759,576,402
資産合計		
	8,377,023,067,623	8,203,759,576,402
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	527,383,050	591,942,950
未払金	1,866,136,100	3,559,500
未払収益分配金	176,243,978,536	-
未払受託者報酬	2,632,255,112	1,318,247,422
未払委託者報酬	5,284,714,044	2,632,006,524
未払利息	7,328	3,055
受入担保金	925,779,112,752	919,587,078,892
その他未払費用	590,287,824	1,035,931,442
流動負債合計	1,112,923,874,746	925,168,769,785
負債合計		
	1,112,923,874,746	925,168,769,785
純資産の部		
元本等		
元本	3,765,057,780,177	3,749,187,369,672
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,499,041,412,700	3,529,403,436,945
（分配準備積立金）	44,550,538	44,550,538
元本等合計	7,264,099,192,877	7,278,590,806,617
純資産合計		
	7,264,099,192,877	7,278,590,806,617
負債純資産合計		
	8,377,023,067,623	8,203,759,576,402

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2021年 7月 9日 至 2022年 1月 8日	当中間計算期間 自 2022年 7月 9日 至 2023年 1月 8日
営業収益		
受取配当金	73,903,812,797	79,405,587,109
受取利息	11,045	430,112,779
有価証券売買等損益	286,264,535,857	43,836,051,969
派生商品取引等損益	2,460,864,350	5,418,935,350
その他収益	5,641,294,752	14,624,374,474
営業収益合計	363,348,790,101	55,182,732,185
営業費用		
支払利息	4,113,296	5,566,779
受託者報酬	1,338,651,323	1,318,247,422
委託者報酬	2,688,446,664	2,632,006,524
その他費用	1,130,710,102	736,923,050
営業費用合計	5,161,921,385	4,692,743,775
営業利益又は営業損失（ ）	358,186,868,716	50,489,988,410
経常利益又は経常損失（ ）	358,186,868,716	50,489,988,410
中間純利益又は中間純損失（ ）	358,186,868,716	50,489,988,410
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額又は一部交換に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,598,713,045,731	3,499,041,412,700
剰余金増加額又は欠損金減少額	134,056,154,115	61,621,973,950
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	134,056,154,115	61,621,973,950
剰余金減少額又は欠損金増加額	133,250,198,081	81,749,938,115
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	133,250,198,081	81,749,938,115
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,957,705,870,481	3,529,403,436,945

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 2022年 7月 8日現在	当中間計算期間末 2023年 1月 8日現在
1.	期首元本額	3,728,017,268,081円	3,765,057,780,177円
	期中追加設定元本額	195,963,939,200円	64,267,317,900円
	期中一部交換元本額	158,923,427,104円	80,137,728,405円
2.	受益権の総数	3,776,386,941口	3,760,468,776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	28,423,811,920円	29,377,850,480円
	4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	894,352,114,040円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2021年 7月 9日 至 2022年 1月 8日	当中間計算期間 自 2022年 7月 9日 至 2023年 1月 8日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2022年 7月 8日現在	当中間計算期間末 2023年 1月 8日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

前計算期間末（2022年 7月 8日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	24,168,856,500	-	23,643,360,000	525,496,500
合計		24,168,856,500	-	23,643,360,000	525,496,500

当中間計算期間末（2023年 1月 8日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	22,549,857,800	-	21,958,560,000	591,297,800
	合計	22,549,857,800	-	21,958,560,000	591,297,800

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

前計算期間末 2022年 7月 8日現在		当中間計算期間末 2023年 1月 8日現在	
1口当たり純資産額	1,923.56円	1口当たり純資産額	1,935.55円
(100口当たり純資産額)	(192,356円)	(100口当たり純資産額)	(193,555円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 1月31日現在です。

【上場インデックスファンドTOPIX】

【純資産額計算書】

資産総額	8,462,596,329,002円
負債総額	797,795,326,527円
純資産総額（ - ）	7,664,801,002,475円
発行済口数	3,760,468,776口
1口当たり純資産額（ / ）	2,038.26円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

るほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2023年1月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2023年1月末現在）

・株主総会

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

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（2023年1月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2023年1月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	860	239,019
株式投資信託	802	202,540
単位型	317	9,769
追加型	485	192,771
公社債投資信託	58	36,478
単位型	45	1,145
追加型	13	35,333

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	5,572
未払法人税等		1,090		2,354
未払消費税等	4	775	4	3,669
賞与引当金		3,034		3,958
役員賞与引当金		55		5
訴訟損失引当金		-		7,847
その他		643		1,330
流動負債合計		20,938		35,083
固定負債				
退職給付引当金		1,456		1,395
賞与引当金		156		423
その他		544		390
固定負債合計		2,157		2,209
負債合計		23,095		37,292
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		61,956		68,901
利益剰余金合計		61,956		68,901
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		82,472		89,417
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		1,461		2,350

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 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額23,094百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されています。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関して、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履行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位:百万円)

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

(1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。

(2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(3) 通貨関連のデリバティブ取引の 1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(4) 時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

(有価証券関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,188	3,369	180
	小計	3,188	3,369	180
合計		24,123	20,735	3,387

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,079	253	132
合計	3,079	253	132

(デリバティブ取引関係)

第62期(2021年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第63期(2022年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,306	-	262	262
	買建	-	-	-	-
合計		2,306	-	262	262

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	4,708	-	293	293
合計		4,708	-	293	293

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964

(退職給付関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,363
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	6
退職給付の支払額	86
退職給付債務の期末残高	1,429

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

退職給付債務	1,429
未積立退職給付債務	1,429
未認識数理計算上の差異	27
貸借対照表に計上された負債の額	1,456

退職給付引当金	1,456
---------	-------

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	2
確定給付制度に係る退職給付費用	147

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.2%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)	
退職給付債務の期首残高	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	211
退職給付債務の期末残高	1,352

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

退職給付債務	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
貸借対照表に計上された負債の額	1,395
退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.3%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	1,184,700	1,346,000
付与	0	0
失効	752,300	330,000
権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	88,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558

付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0	0
-----------------------------	---	---

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,222百万円
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割
 又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日
 において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の 内訳 (単位:百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の 内訳 (単位:百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 929	賞与引当金 1,341
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 97
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 446	退職給付引当金 427
固定資産減価償却費 90	固定資産減価償却費 87
その他 978	繰延ヘッジ損益 322
繰延税金資産小計 3,972	訴訟損失引当金 2,403
評価性引当金 1,430	その他 1,039
繰延税金資産合計 2,541	繰延税金資産小計 5,772
繰延税金負債	評価性引当金(注) 52
繰延ヘッジ利益 51	繰延税金資産合計 5,719
その他有価証券評価差額金 645	繰延税金負債
繰延税金負債合計 696	その他有価証券評価差額金 1,092
繰延税金資産の純額 1,845	その他 948
	繰延税金負債合計 2,041
	繰延税金資産の純額 3,678

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

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

(関連当事者情報)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	-	資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	-	配当の受取	1,783 (USD 17,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR千)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	2,019 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86千)
							資金の返済(円貸建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(円貸建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	2,788 (SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	2,985 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	23 (SGD 266千)	未収収益	23 (SGD 266千)
減資(注2)	9,149 (SGD 110,000千)	-	-							
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注3)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	3,788 (USD 34,000千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った110,000千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,450百万円
------	-----------

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

関連情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

項目	第62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	432円90銭	468円88銭
1株当たり当期純利益金額	48円45銭	62円50銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,424	12,136
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	9,424	12,136
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,509	194,152

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション (1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株	2016年度ストックオプション (1) 88,000株、2016年度ストックオプション(2) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000株
--	---	--

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	84,049	91,035
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	84,049	91,035
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	194,152	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第64期中間会計期間 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		33,164
有価証券		481
未収委託者報酬		16,607
未収収益		1,063
関係会社短期貸付金		3,335
その他	2	3,967
流動資産合計		58,620
固定資産		
有形固定資産	1	404
無形固定資産		353
投資その他の資産		
投資有価証券		23,904
関係会社株式		22,366
長期差入保証金		416
繰延税金資産		4,029
投資その他の資産合計		50,718
固定資産合計		51,476
資産合計		110,097

(単位:百万円)

第64期中間会計期間
(2022年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,815
未払費用	3,556
未払法人税等	3,271
未払消費税等	3
賞与引当金	1,924
役員賞与引当金	110
その他	1,258
流動負債合計	18,282
固定負債	
退職給付引当金	1,445
賞与引当金	321
役員賞与引当金	16
その他	119
固定負債合計	1,903
負債合計	20,186
純資産の部	
株主資本	
資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	68,572
利益剰余金合計	68,572
自己株式	2,067
株主資本合計	89,088
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,064
繰延ヘッジ損益	1,242
評価・換算差額等合計	822
純資産合計	89,911
負債純資産合計	110,097

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第64期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

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

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417
当中間期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
中間純利益				7,091	7,091		7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	328	328	-	328
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	68,572	68,572	2,067	89,088

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,350	731	1,618	91,035
当中間期変動額				
剰余金の配当				7,420
中間純利益				7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	285	510	795	795
当中間期変動額合計	285	510	795	1,124
当中間期末残高	2,064	1,242	822	89,911

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
----	---

1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行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項に定める経過措置に従って、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
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,505百万円 (2021年12月末現在)	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円 (2021年12月末現在)	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	
ジェフリーズ証券会社 東京支店	2,004百万円 (2021年11月末現在)	

シティグループ証券株式会社	96,307百万円 (2021年12月末現在)	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765百万円 (2021年12月末現在)	
大和証券株式会社	100,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
パークレイズ証券株式会社	38,945百万円 (2021年12月末現在)	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
BofA証券株式会社	83,140百万円 (2021年12月末現在)	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社	62,149百万円	
UBS証券株式会社	34,708百万円 (2021年12月末現在)	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券などの管理・計算事務・収益分配金の支払いなどを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

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

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2022年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
業務執行社員

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年9月28日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIXの2021年7月9日から2022年7月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、上場インデックスファンドTOPIXの2022年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記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 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年2月1日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIXの2022年7月9日から2023年1月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、上場インデックスファンドTOPIXの2023年1月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月9日から2023年1月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠

に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記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。