【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11月1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】	財形株投（一般財形３０） 財形株投（一般財形５０） 財形株投（年金・住宅財形３０）
【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】	財形株投（一般財形３０） 1兆円を上限とします。 財形株投（一般財形５０） 1兆円を上限とします。 財形株投（年金・住宅財形３０） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

財形株投（一般財形30）
財形株投（一般財形50）
財形株投（年金・住宅財形30）
・以下、上記を総称して、また各々を称して「財形株投」、「ファンド」または「ポートフォリオ」ということがあります。

（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】

各ファンド毎に、 1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2023年11月2日から2024年5月1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、原則として勤務先の事務局を通じて給与天引きにより申込金額を支払うものとします。
・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、原則として勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　ファンドの目的
信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。

②　ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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

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

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

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

◇年１回

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

◇日本

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

◇ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

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

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

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

＜財形株投（一般財形 30）＞　実質株式組入上限 30%

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

＜財形株投（一般財形 50）＞　実質株式組入上限 50%

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

＜財形株投（年金・住宅財形 30）＞　実質株式組入上限 30%

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

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

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

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

3. 信託財産の安定した成長をめざして安定運用を行ないます。

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

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

*1 バーラ日本株式モデル
バーラ日本株式モデルは、日本株への投資から期待される収益（必然的にリスクを伴ないます。）の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指数、③業種指標、④ポートフォリオ（または個別銘柄）固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し数値化します。
これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適のポートフォリオを求めます。

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

4. お買付けは無手数料で、給与天引きで行ないます。

給与からの天引きですので、毎月定期的に積立ていただけます。

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

詳しくは、勤務先の事務局へお問い合わせください。

《ファンドの仕組み》

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

主な投資制限

「財形株投（一般財形 30）」
「財形株投（年金・住宅財形 30）」

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

「財形株投（一般財形 50）」

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

分配方針

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

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

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

④　信託金限度額

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

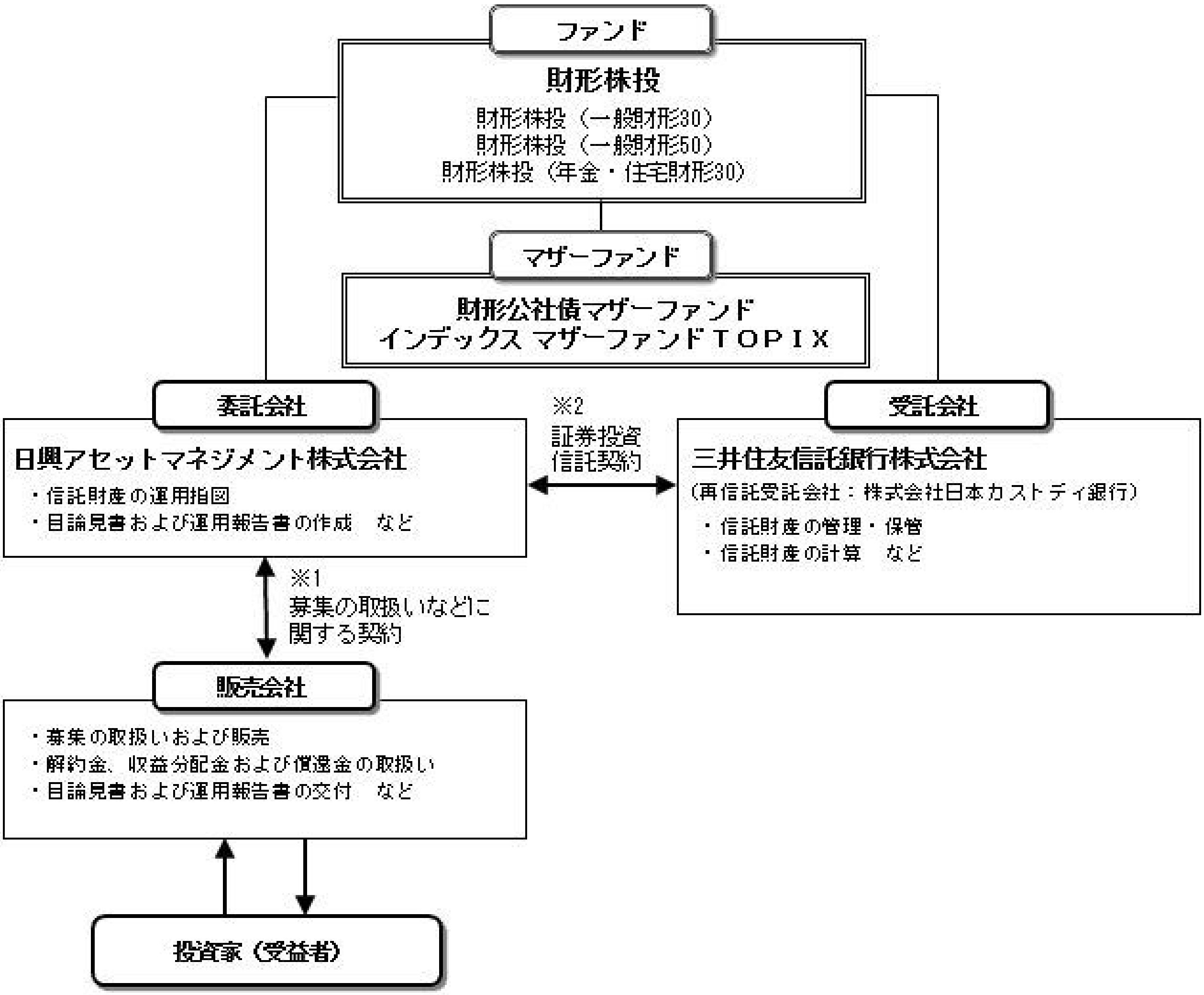
（2）【ファンドの沿革】

1994年 2月 4日
・ファンドの信託契約締結、運用開始
2018年3月20日

・投資対象ファンドに関する変更

（３）【ファンドの仕組み】

①　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。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。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。

②　委託会社の概況（2023年8月末現在）

１）資本金

17,363百万円

２）沿革

1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立

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

３）大株主の状況

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。
・「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。
＜財形株投（一般財形50）＞
・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。
・「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

（２）【投資対象】

＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（一般財形50）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
「財形公社債マザーファンド」受益証券および「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式を主要投資対象とします。
① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第18条および第18条の2に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形
② 主として「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券および「財形公社債マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する証券または証書で、１）～８）の証券または証書の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
12）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
13）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
14）外国法人が発行する譲渡性預金証書

15）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
16）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
17）外国の者に対する権利で16）の有価証券の性質を有するもの
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの
④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）有価証券の貸付
５）外国為替予約取引
６）資金の借入
＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形
②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
２）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
３）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）の証券の性質を有するもの
４）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
５）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
６）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
７）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
④　次の取引ができます。

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

◆投資対象とするマザーファンドの概要
<財形公社債マザーファンド>

運用の基本方針		
	基本方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。
	主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1994年２月４日設定）
	決算日	毎年２月１日 （２月１日および２日のいずれかが休業日のときは、２月１日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち２月１日に最も近い日を決算日とします。）

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

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

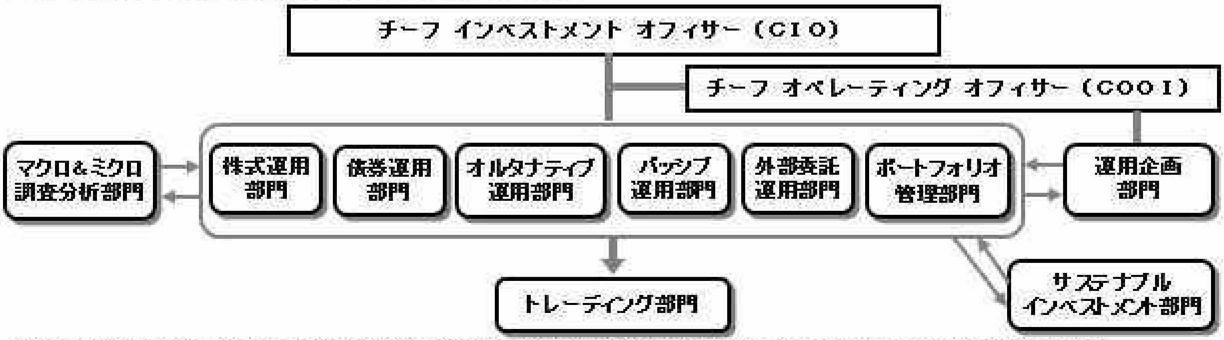
	投資方針	・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みの動きにできるだけ連動させるため、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。 ①投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないます。 ②資金の流出入に伴なう売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50％以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
	決算日	毎年２月12日（休業日の場合は翌営業日）

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

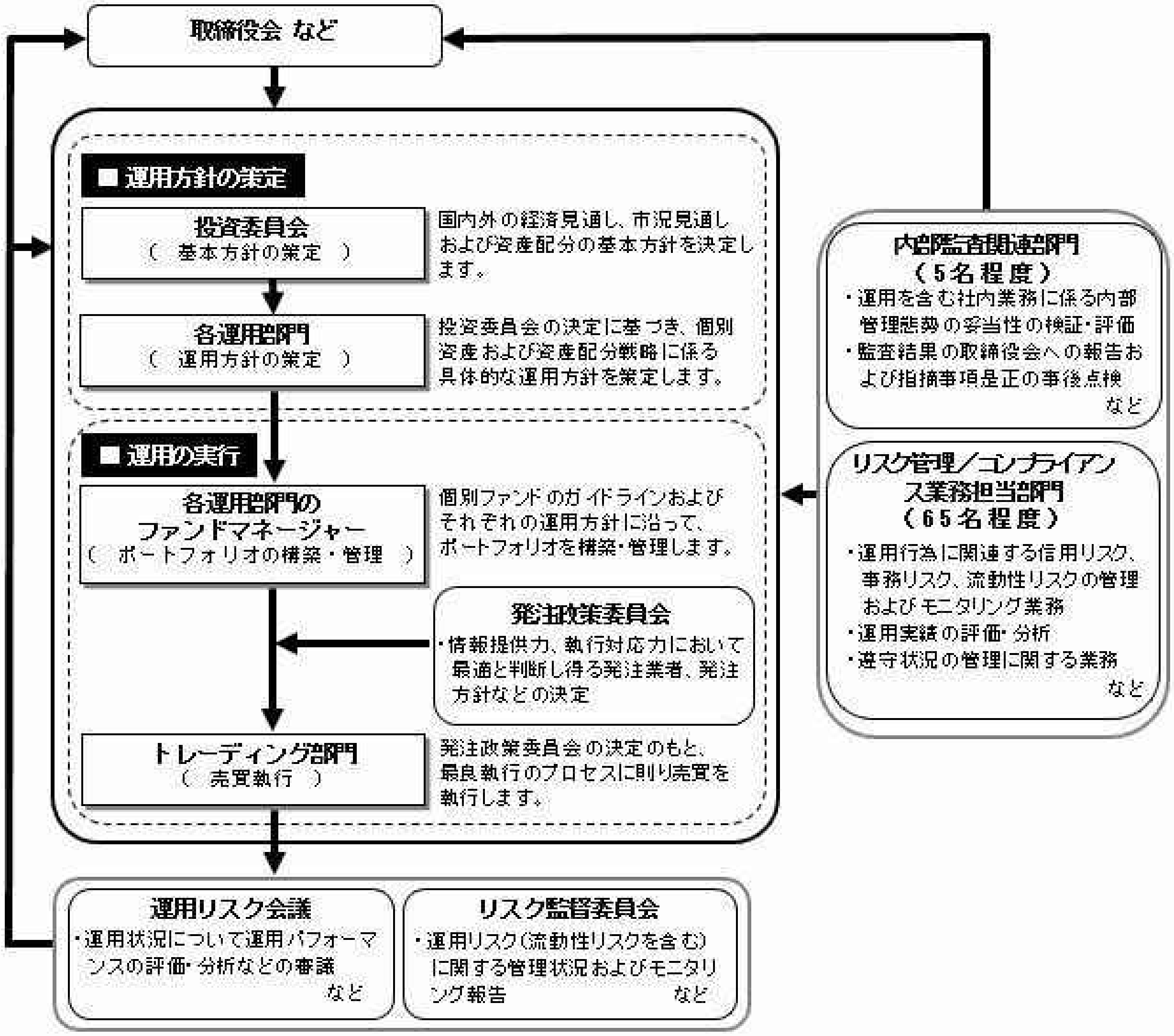
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸに係る標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸに係る標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、ＴＯＰＩＸの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

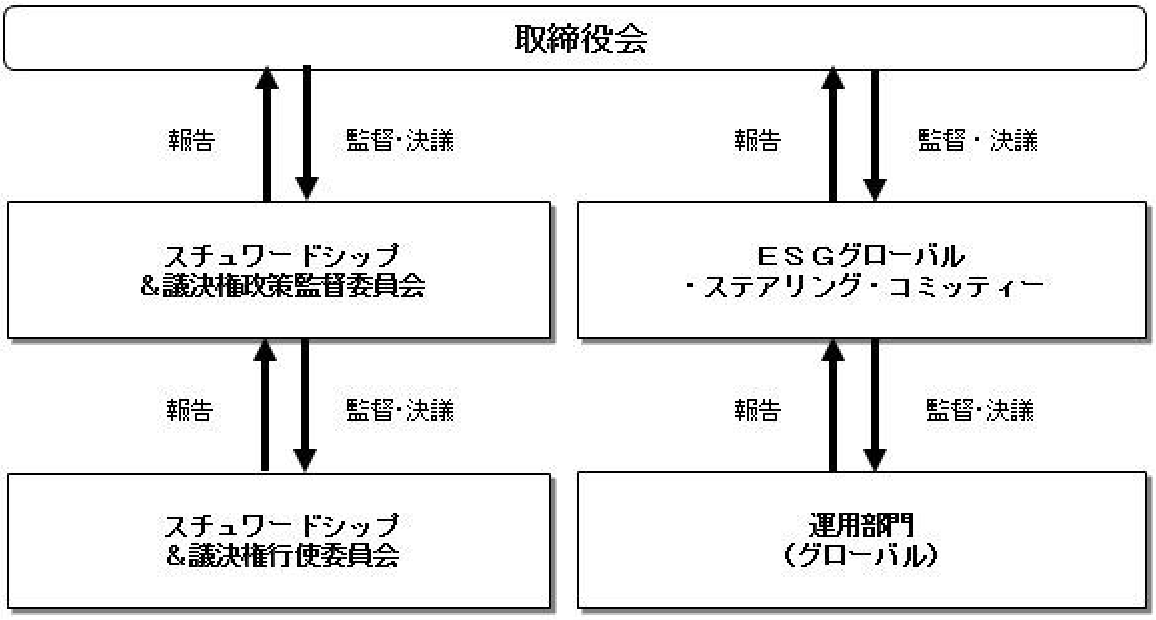


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。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なっており、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・デューティー

ＥＳＧ（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。
（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



※上記体制は2023年8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】

①　収益分配方針
毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。
１）分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
２）分配対象額についての分配方針
利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
②　収益分配金の支払い
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

①　約款に定める投資制限
＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（一般財形50）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
１）＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
＜財形株投（一般財形50）＞
株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資

産総額の50%以下とします。

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

3）同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

4）新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

5）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

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

8）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売り出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

ヘ）信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

9）信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

13）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

14）信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

15）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価

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

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

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

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

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

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

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

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

３）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

４）外貨建資産への投資は行ないません。

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

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

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売り出しにより取得する株券

６）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

７）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

５％を上回らない範囲内とします。

8）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

9）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50％を超えないものとします。

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

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

＜財形公社債マザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

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

3）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

4）信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。

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

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

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

８）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

９）信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

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

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

② 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ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク
・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

② 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。

③ 信用リスク
・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④ 為替変動リスク
外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

＜その他の留意事項＞
・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
・投資対象とする投資信託証券に関する事項
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴なう資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量

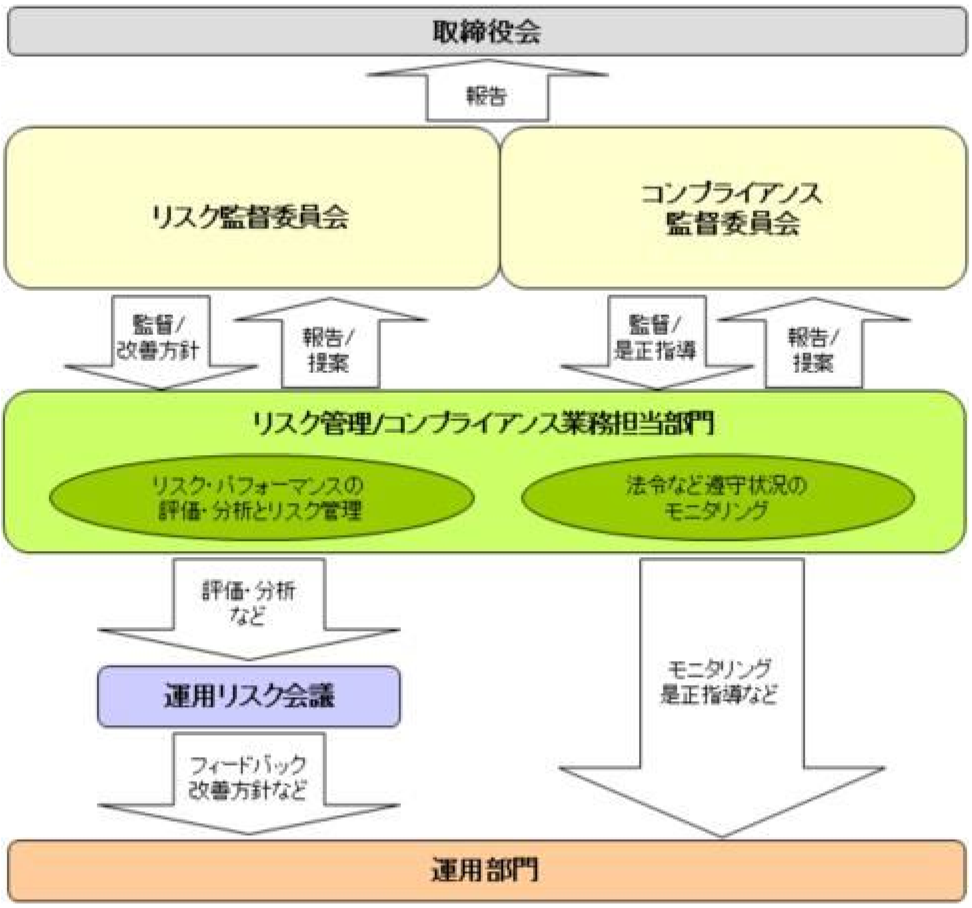
に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

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

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

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

（２）リスク管理体制



■**全社的リスク管理**

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

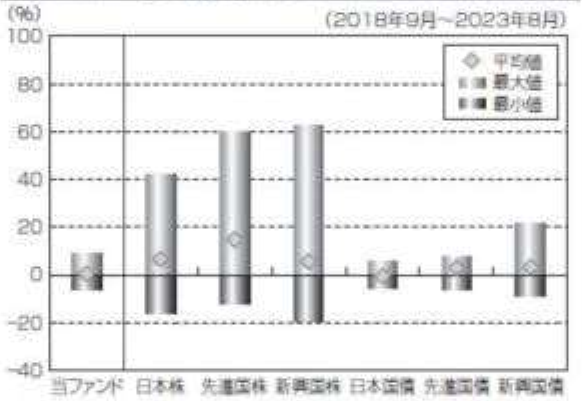
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

※上記体制は2023年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

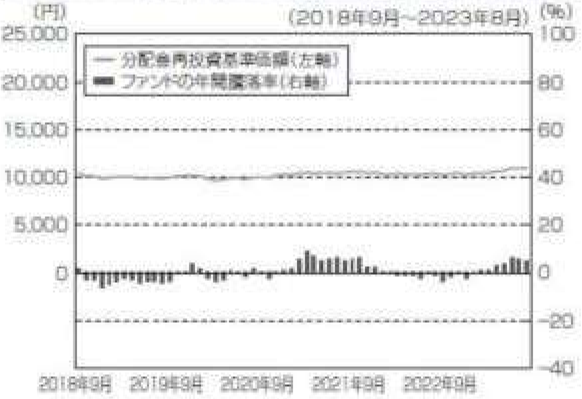
(参考情報)

「財形株投(一般財形 30)」

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



(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(%))

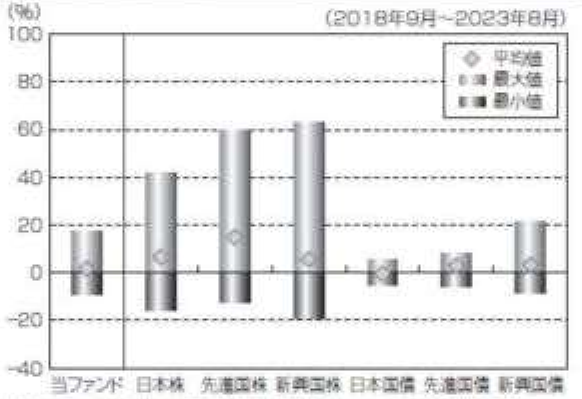
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	0.4%	6.5%	14.8%	5.6%	-0.5%	2.9%	3.2%
最大値	9.1%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	21.5%
最小値	-6.0%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※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9月から2023年8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して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。

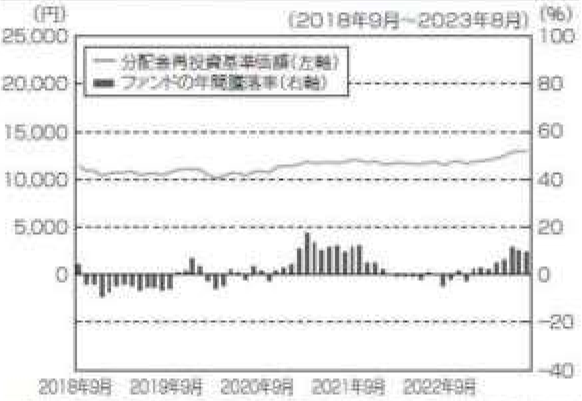
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2018年9月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「財形株投(一般財形 50)」

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

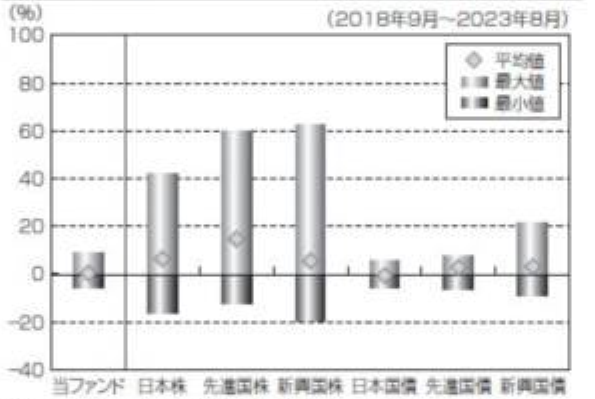
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.8%	6.5%	14.8%	5.6%	-0.5%	2.9%	3.2%
最大値	17.2%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	21.5%
最小値	-9.2%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※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9月から2023年8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して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。

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2018年9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して計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「財形株投(年金・住宅財形 30)」

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

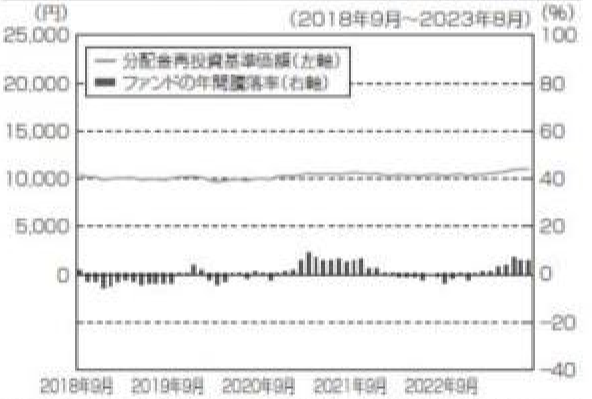
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	0.5%	6.5%	14.8%	5.6%	-0.5%	2.9%	3.2%
最大値	9.2%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	21.5%
最小値	-5.9%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※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9月から2023年8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して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………TOPIX（東証株価指数）配当込み
先進国株…MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込み、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（配当込み、円ベース）
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2018年9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して計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

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

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

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.572%（税抜0.52%）の率を乗じて得た額とします。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。
① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
② 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。）。
③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解

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

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①　個人受益者の場合

＜一般財形の場合＞

収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

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

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

＜年金・住宅財形の場合＞

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

（目的外解約）

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

②　個別元本

１）各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

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

③　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

１）収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

２）受益者が収益分配金を受け取る際

イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場

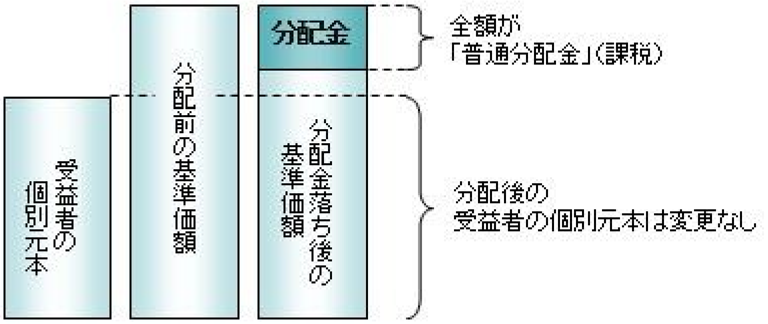
合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

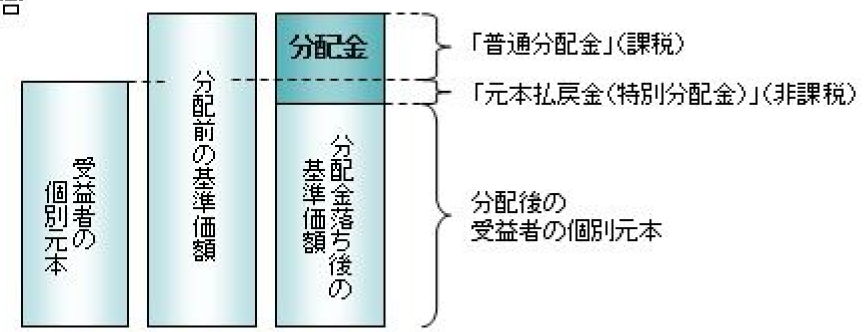
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



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

※上記は2023年11月1日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【財形株投（一般財形３０）】

以下の運用状況は2023年 8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（%）
親投資信託受益証券	日本	106,025,529	97.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	2,700,540	2.48
合計（純資産総額）		108,726,069	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	58,282,700	1.2612	73,510,207	1.2650	73,727,615	67.81
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	10,069,184	2.6776	26,961,483	3.2076	32,297,914	29.71

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.52
合　　計	97.52

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第20計算期間末　(2014年 2月 3日)	76	76	0.9341	0.9346
第21計算期間末　(2015年 2月 2日)	76	76	0.9788	0.9793
第22計算期間末　(2016年 2月 1日)	74	74	0.9931	0.9936
第23計算期間末　(2017年 2月 1日)	74	74	1.0043	1.0048
第24計算期間末　(2018年 2月 1日)	96	96	1.0543	1.0548
第25計算期間末　(2019年 2月 4日)	92	92	0.9991	0.9996
第26計算期間末　(2020年 2月 3日)	102	102	1.0087	1.0092
第27計算期間末　(2021年 2月 1日)	116	116	1.0311	1.0316
第28計算期間末　(2022年 2月 1日)	110	110	1.0303	1.0308
第29計算期間末　(2023年 2月 1日)	107	107	1.0358	1.0363
2022年 8月末日	105	―	1.0386	―
9月末日	104	―	1.0197	―
10月末日	106	―	1.0345	―
11月末日	107	―	1.0425	―
12月末日	105	―	1.0225	―

2023年 1月末日	107	―	1.0362	―
2月末日	108	―	1.0382	―
3月末日	106	―	1.0480	―
4月末日	104	―	1.0558	―
5月末日	104	―	1.0666	―
6月末日	106	―	1.0901	―
7月末日	108	―	1.0920	―
8月末日	108	―	1.0922	―

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.0005
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	0.0005
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	―

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.51
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.84
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.51
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.18
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	△5.19
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	1.01
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	2.27
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	△0.03
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	0.58
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	5.62

(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20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	5,310,568	7,297,643
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	7,771,084	11,906,050
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	10,650,522	13,562,169
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	9,441,348	10,877,640
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	19,263,657	1,878,188
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	12,037,575	10,950,460
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	14,822,167	5,888,725
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	16,599,772	5,126,195
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	10,442,932	15,936,539
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	9,483,632	13,007,727
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	4,409,251	9,057,050

【財形株投（一般財形５０）】

以下の運用状況は2023年 8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（%）
親投資信託受益証券	日本	201,883,226	97.54
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	5,089,950	2.46
合計（純資産総額）		206,973,176	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	32,070,757	2.6771	85,856,893	3.2076	102,870,160	49.70
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	78,271,199	1.2614	98,731,839	1.2650	99,013,066	47.84

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)

親投資信託受益証券	97.54
合　　計	97.54

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第20計算期間末　(2014年 2月 3日)	169	169	0.9212	0.9217
第21計算期間末　(2015年 2月 2日)	183	183	0.9993	0.9998
第22計算期間末　(2016年 2月 1日)	187	187	1.0263	1.0268
第23計算期間末　(2017年 2月 1日)	207	207	1.0525	1.0530
第24計算期間末　(2018年 2月 1日)	241	241	1.1549	1.1554
第25計算期間末　(2019年 2月 4日)	225	225	1.0635	1.0640
第26計算期間末　(2020年 2月 3日)	209	209	1.0921	1.0926
第27計算期間末　(2021年 2月 1日)	194	194	1.1429	1.1434
第28計算期間末　(2022年 2月 1日)	195	195	1.1566	1.1571
第29計算期間末　(2023年 2月 1日)	194	194	1.1819	1.1824
2022年 8月末日	192	―	1.1787	―
9月末日	183	―	1.1450	―
10月末日	189	―	1.1732	―
11月末日	193	―	1.1893	―
12月末日	189	―	1.1577	―
2023年 1月末日	195	―	1.1829	―
2月末日	193	―	1.1874	―
3月末日	194	―	1.2011	―
4月末日	192	―	1.2163	―
5月末日	194	―	1.2374	―
6月末日	202	―	1.2827	―
7月末日	206	―	1.2895	―
8月末日	206	―	1.2911	―

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.0005
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	0.0005
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	―

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	11.99
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	8.53
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	2.75
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	2.60
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	9.78
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	△7.87
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	2.74
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	4.70
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	1.24
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	2.23
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	9.44

(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20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	18,531,876	53,414,352
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	17,501,615	18,329,958
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	17,040,435	17,577,441
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	18,988,051	4,886,387
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	48,663,216	36,200,357
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	21,221,642	18,123,775

第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,804,485	42,344,325
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	20,242,673	42,112,594
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	16,776,660	17,963,998
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	16,167,615	20,049,736
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	8,606,574	13,527,594

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

以下の運用状況は2023年 8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（%）
親投資信託受益証券	日本	264,541,831	97.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	6,891,731	2.54
合計（純資産総額）		271,433,562	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	145,420,271	1.2614	183,434,995	1.2650	183,956,642	67.77
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	25,123,204	2.6860	67,481,727	3.2076	80,585,189	29.69

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.46
合　　計	97.46

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第20計算期間末　（2014年 2月 3日）	188	188	0.9360	0.9365
第21計算期間末　（2015年 2月 2日）	190	190	0.9807	0.9812
第22計算期間末　（2016年 2月 1日）	178	178	0.9949	0.9954
第23計算期間末　（2017年 2月 1日）	182	182	1.0057	1.0062
第24計算期間末　（2018年 2月 1日）	210	210	1.0558	1.0563
第25計算期間末　（2019年 2月 4日）	203	203	1.0016	1.0021
第26計算期間末　（2020年 2月 3日）	201	201	1.0109	1.0114
第27計算期間末　（2021年 2月 1日）	221	221	1.0324	1.0329
第28計算期間末　（2022年 2月 1日）	237	237	1.0325	1.0330
第29計算期間末　（2023年 2月 1日）	251	252	1.0392	1.0397
2022年 8月末日	248	―	1.0419	―
9月末日	244	―	1.0232	―
10月末日	248	―	1.0379	―
11月末日	251	―	1.0460	―
12月末日	248	―	1.0260	―
2023年 1月末日	252	―	1.0397	―
2月末日	253	―	1.0416	―
3月末日	254	―	1.0521	―
4月末日	255	―	1.0600	―
5月末日	259	―	1.0707	―
6月末日	266	―	1.0942	―
7月末日	270	―	1.0963	―
8月末日	271	―	1.0965	―

②【分配の推移】

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

第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.0005
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	0.0005
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	—

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.48
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.83
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.50
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.14
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	△5.09
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.98
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	2.18
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	0.06
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	0.70
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	5.69

(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20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	17,559,108	18,995,836
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	20,521,555	27,814,502
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	20,768,810	35,315,828
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	22,112,907	19,936,078
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	34,698,129	17,021,386
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	22,034,865	18,046,134
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,763,698	25,689,628
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	21,694,209	6,452,657
第28期	2021年 2月 2日～2022年 2月 1日	19,721,443	4,395,546
第29期	2022年 2月 2日～2023年 2月 1日	25,024,830	12,521,696
当中間期	2023年 2月 2日～2023年 8月 1日	9,861,759	5,662,987

（参考）

財形公社債マザーファンド

以下の運用状況は2023年 8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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	198,384,834	55.62
地方債証券	日本	34,771,170	9.75
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	123,520,736	34.63
合計（純資産総額）		356,676,740	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	40,000,000	100.06	40,026,234	100.06	40,026,234	0.100	2023/12/20	11.22
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	40,000,000	98.95	39,583,200	99.21	39,686,000	0.100	2028/12/20	11.13
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	40,000,000	98.56	39,425,200	98.91	39,566,400	0.100	2029/6/20	11.09
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	40,000,000	98.15	39,262,000	98.58	39,432,000	0.100	2029/12/20	11.06
日本	地方債証券	平成２７年度第４回京都府公募公債	34,500,000	100.97	34,837,755	100.78	34,771,170	0.553	2025/6/19	9.75
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	20,000,000	100.24	20,048,800	100.19	20,039,000	0.100	2024/12/20	5.62
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	20,000,000	97.60	19,520,000	98.17	19,635,200	0.100	2030/6/20	5.51

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	55.62
地方債証券	9.75
合　　計	65.37

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

以下の運用状況は2023年 8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。

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	52,139,432,700	99.79
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	111,649,353	0.21
合計（純資産総額）		52,251,082,053	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	116,525,000	0.22

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	863,400	1,881.01	1,624,068,548	2,515.00	2,171,451,000	4.16
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	111,200	11,734.42	1,304,868,204	12,145.00	1,350,524,000	2.58
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	969,900	966.93	937,832,780	1,163.50	1,128,478,650	2.16
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,700	59,510.43	934,313,761	60,520.00	950,164,000	1.82
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,052,100	154.55	780,814,684	168.30	850,268,430	1.63
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,200	7,013.71	541,459,144	9,694.00	748,376,800	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	110,100	5,774.45	635,766,945	6,681.00	735,578,100	1.41
日本	株式	三菱商事	卸売業	101,400	4,653.77	471,892,916	7,196.00	729,674,400	1.40
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,300	15,447.71	514,408,849	21,575.00	718,447,500	1.37
日本	株式	三井物産	卸売業	118,100	3,966.05	468,391,617	5,432.00	641,519,200	1.23
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	139,600	4,180.79	583,639,206	4,508.00	629,316,800	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	119,700	4,375.20	523,712,410	5,220.00	624,834,000	1.20
日本	株式	任天堂	その他製品	99,300	5,239.72	520,304,466	6,267.00	622,313,100	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	130,900	3,860.92	505,394,939	4,659.00	609,863,100	1.17
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	127,800	3,333.21	425,984,450	4,703.00	601,043,400	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	137,400	4,178.64	574,145,748	4,299.00	590,682,600	1.13

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	102,500	4,159.28	426,326,925	5,472.00	560,880,000	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	224,000	2,107.48	472,076,584	2,410.00	539,840,000	1.03
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	33,300	13,736.87	457,438,002	16,155.00	537,961,500	1.03
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	121,900	3,995.56	487,059,322	4,325.00	527,217,500	1.01
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	77,800	5,820.31	452,820,181	6,545.00	509,201,000	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	153,100	2,690.79	411,960,849	3,227.00	494,053,700	0.95
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,000	23,028.41	437,539,950	25,225.00	479,275,000	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	85,600	4,295.75	367,716,796	5,249.00	449,314,400	0.86
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	253,500	1,526.23	386,901,678	1,670.00	423,345,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,700	7,514.23	358,429,001	8,185.00	390,424,500	0.75
日本	株式	ＳＭＣ	機械	5,100	67,749.71	345,523,521	70,600.00	360,060,000	0.69
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	57,300	6,040.94	346,146,290	5,981.00	342,711,300	0.66
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	149,000	1,918.09	285,796,254	2,214.50	329,960,500	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	32,400	7,291.95	236,259,383	9,959.00	322,671,600	0.62

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	0.36
		建設業	2.09
		食料品	3.38
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.96
		医薬品	5.12
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.52
		機械	5.49
		電気機器	17.28
		輸送用機器	8.33
		精密機器	2.39
		その他製品	2.28
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	2.96
		海運業	0.66
		空運業	0.49

		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.08
		卸売業	6.82
		小売業	4.36
		銀行業	6.58
		証券、商品先物取引業	0.74
		保険業	2.25
		その他金融業	1.16
		不動産業	1.87
		サービス業	4.91
合　計			99.79

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０９月	買建	5	日本円	112,212,750	116,525,000	0.22

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

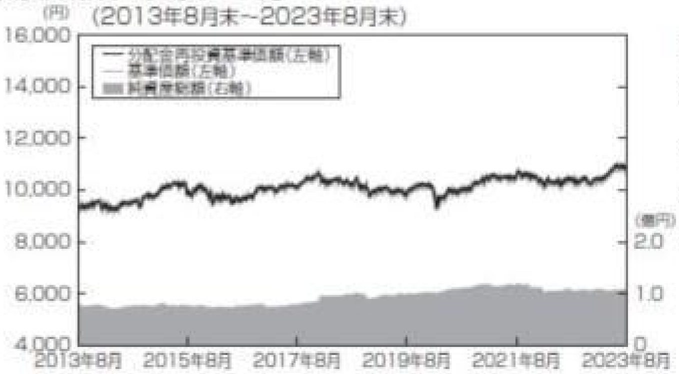
≪参考情報≫

運用実績

2023年8月31日現在

基準価額・純資産の推移

「財形株投（一般財形 30）」

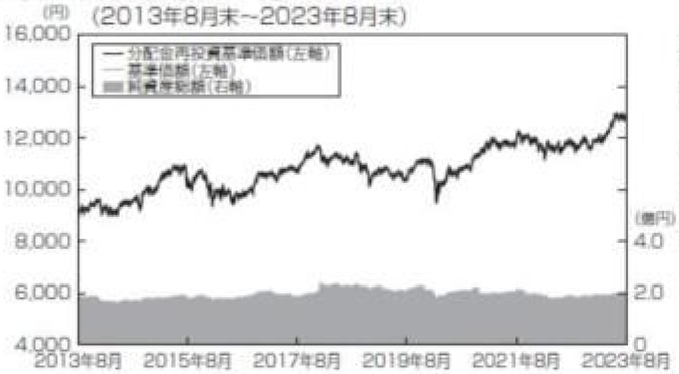


基準価額……………………10,922円

純資産総額…………………1.08億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2013年8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して計算した理論上のものであることにご留意ください。

「財形株投（一般財形 50）」

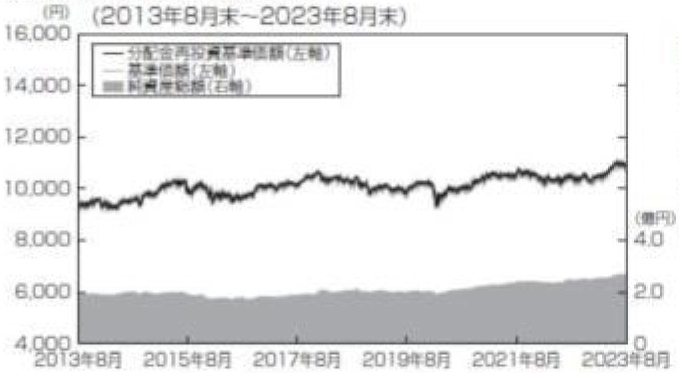


基準価額……………………12,911円

純資産総額…………………2.06億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2013年8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して計算した理論上のものであることにご留意ください。

「財形株投（年金・住宅財形 30）」



基準価額……………………10,965円

純資産総額…………………2.71億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2013年8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して計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移（税引前、1万口当たり）

「財形株投（一般財形 30）」

2019年2月	2020年2月	2021年2月	2022年2月	2023年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	140円

「財形株投（一般財形 50）」

2019年2月	2020年2月	2021年2月	2022年2月	2023年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	140円

「財形株投（年金・住宅財形 30）」

2019年2月	2020年2月	2021年2月	2022年2月	2023年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	140円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	財形株投（一般財形 30）	財形株投（一般財形 50）	財形株投（年金・住宅財形 30）
財形公社債マザーファンド	67.81%	47.84%	67.77%
インデックス マザーファンド TOPIX	29.71%	49.70%	29.69%
現金その他	2.48%	2.46%	2.54%

※各ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>

財形公社債マザーファンド

	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	第138回利付国債(5年)	国債証券	0.1%	2023年12月20日	11.22%
2	第353回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2028年12月20日	11.13%
3	第355回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2029年6月20日	11.09%

※財形公社債マザーファンドの対純資産総額比です。

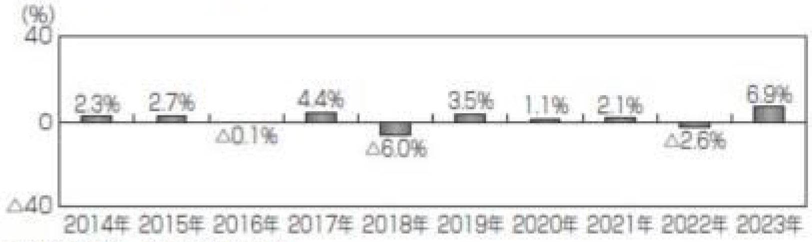
インデックス マザーファンド TOPIX

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	4.16%
2	ソニーグループ	電気機器	2.58%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.16%
4	キーエンス	電気機器	1.82%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.63%

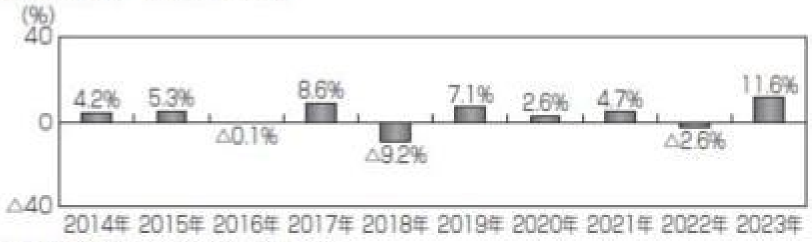
※インデックス マザーファンド TOPIXの対純資産総額比です。

年間収益率の推移

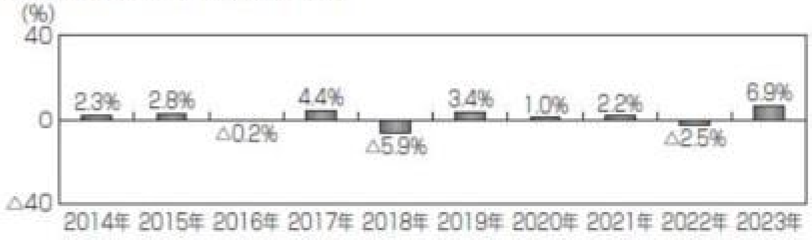
「財形株投（一般財形 30）」



「財形株投（一般財形 50）」



「財形株投（年金・住宅財形 30）」



※ファンドの年間収益率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
※当ファンドには、ベンチマークはありません。
※2023年は、2023年8月末までの騰落率です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。

・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

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

（２）申込金額

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

（３）申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

（４）申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

（５）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

①　一般財形の場合（＜一般財形30＞＜一般財形50＞）

原則として、いつでも解約が可能です。

②　年金財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

・年金受取り以外の目的での解約は原則として認められません。

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

③　住宅財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

・自宅用住宅の取得など以外の目的での解約は原則として認められません。

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

（２）解約制限

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

（３）解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（４）手取額

①　一般財形の場合（＜一般財形30＞＜一般財形50＞）

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

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

②　年金財形の場合（<年金・住宅財形30>）

1）年金受取りを目的として解約される場合

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

2）年金受取り以外の目的で解約される場合

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

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

③　住宅財形の場合（<年金・住宅財形30>）

1）自宅用住宅の取得などを目的として解約される場合

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

2）自宅用住宅の取得など以外の目的で解約される場合

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

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

（5）解約単位

１口単位

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

（6）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して４営業日目からお支払いします。

（7）受付の中止および取消

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

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

<買取請求による換金>

（1）買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

（2）買取制限

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

（3）買取価額

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

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

（４）手取額

１口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

（５）買取単位

１口単位

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

（６）受付の中止および取消

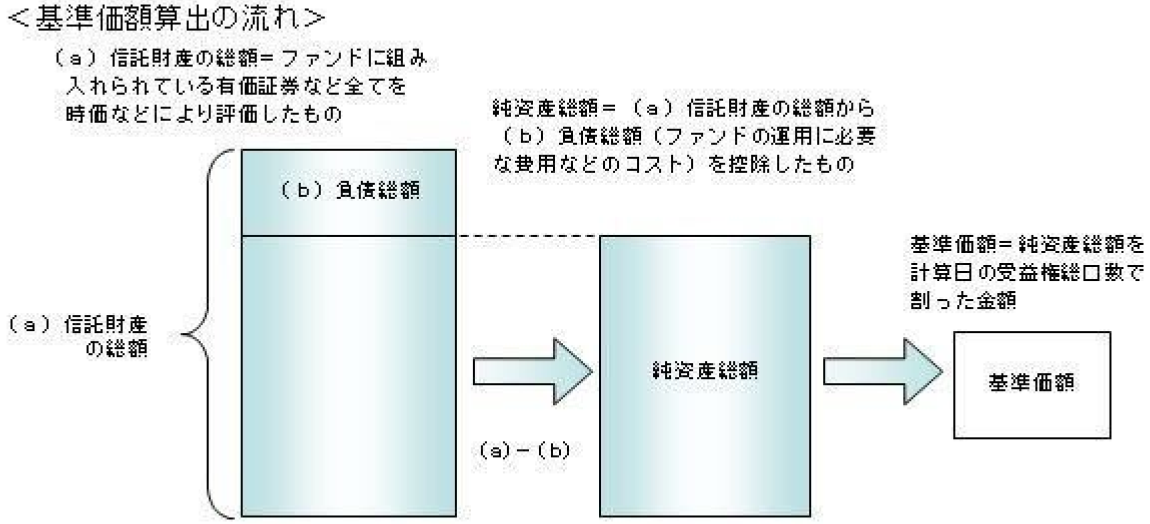
・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

①　基準価額の算出

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



②　有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇国内公社債

原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

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

③　基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞ 日興アセットマネジメント株式会社 ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/ コールセンター 電話番号　0120-25-1404 午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

①　信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ロ）やむを得ない事情が発生したとき

２）この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（１ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

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

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

②　償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③　信託約款の変更

1）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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

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

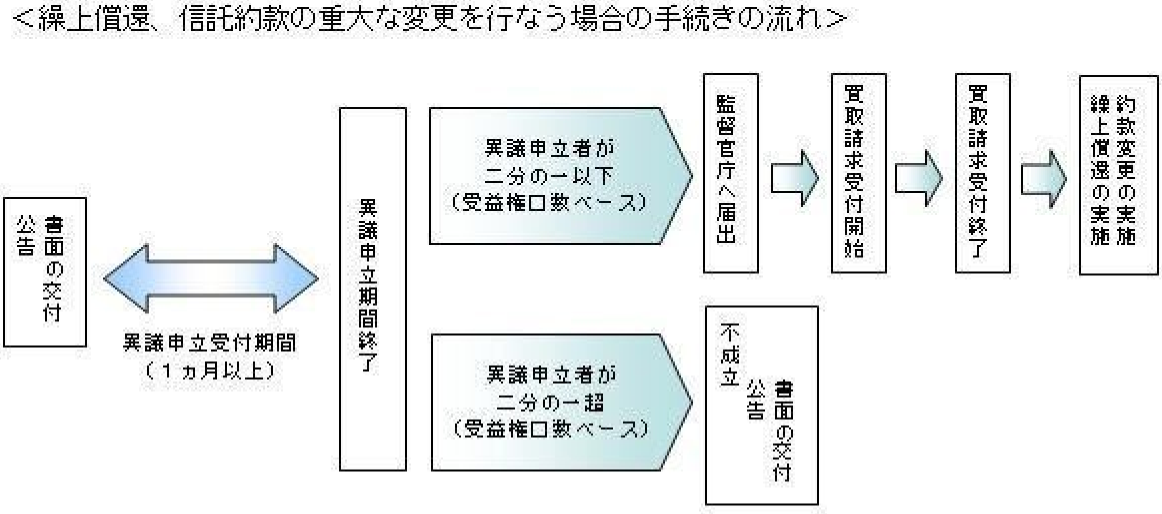
4）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

④　異議の申立て

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

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。



⑤　公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥　運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

⑦　関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（1）収益分配金・償還金受領権

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

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行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）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期計算期間（2022年 2月 2日から2023年 2月 1日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【財形株投（一般財形３０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,659,967	3,057,091
親投資信託受益証券	107,773,662	104,688,986
流動資産合計	111,433,629	107,746,077
資産合計	111,433,629	107,746,077
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	53,599	51,837
未払受託者報酬	31,733	29,583
未払委託者報酬	903,075	278,649
その他未払費用	2,499	2,295
流動負債合計	990,906	362,364
負債合計	990,906	362,364
純資産の部		
元本等		
元本	107,198,165	103,674,070
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,244,558	3,709,643
（分配準備積立金）	5,933,642	5,273,621
元本等合計	110,442,723	107,383,713
純資産合計	110,442,723	107,383,713
負債純資産合計	111,433,629	107,746,077

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 自　2021年 2月 2日 至　2022年 2月 1日	第29期 自　2022年 2月 2日 至　2023年 2月 1日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	1,998,663	1,522,284
営業収益合計	1,998,663	1,522,285
営業費用		
支払利息	267	647
受託者報酬	63,543	58,481
委託者報酬	1,808,030	812,465
その他費用	4,984	4,543
営業費用合計	1,876,824	876,136
営業利益又は営業損失（△）	121,839	646,149
経常利益又は経常損失（△）	121,839	646,149
当期純利益又は当期純損失（△）	121,839	646,149
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	320,441	14,095
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,505,259	3,244,558
剰余金増加額又は欠損金減少額	499,140	278,107
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	499,140	278,107
剰余金減少額又は欠損金増加額	507,640	393,239
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	507,640	393,239
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	53,599	51,837
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,244,558	3,709,643

（3）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
1．	期首元本額	112,691,772円	107,198,165円
	期中追加設定元本額	10,442,932円	9,483,632円
	期中一部解約元本額	15,936,539円	13,007,727円
2．	受益権の総数	107,198,165口	103,674,070口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日			第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日		
	分配金の計算過程			分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	90,164円
C	信託約款に定める収益調整金	15,867,213円	C	信託約款に定める収益調整金	15,848,809円
D	信託約款に定める分配準備積立金	5,987,241円	D	信託約款に定める分配準備積立金	5,235,294円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	21,854,454円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	21,174,267円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,038円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,042円
G	分配金額	53,599円	G	分配金額	51,837円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H	分配金額(1万口当たり)	5円

（金融商品に関する注記）
Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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28期（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

親投資信託受益証券	1,271,512
合計	1,271,512

第29期（2023年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,287,837
合計	1,287,837

（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28期 2022年 2月 1日現在		第29期 2023年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0303円	1口当たり純資産額	1.0358円
(1万口当たり純資産額)	(10,303円)	(1万口当たり純資産額)	(10,358円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	57,611,841	72,648,531	
	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	11,983,116	32,040,455	
合計		69,594,957	104,688,986	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【財形株投（一般財形５０）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,448,145	5,581,032
親投資信託受益証券	190,505,512	189,930,398
流動資産合計	196,953,657	195,511,430
資産合計	196,953,657	195,511,430
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	84,384	82,442
未払受託者報酬	56,387	52,817
未払委託者報酬	1,603,114	497,073
未払利息	1	1
その他未払費用	4,459	4,173
流動負債合計	1,748,345	636,506
負債合計	1,748,345	636,506
純資産の部		
元本等		
元本	168,768,071	164,885,950
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	26,437,241	29,988,974
（分配準備積立金）	25,830,053	26,904,604
元本等合計	195,205,312	194,874,924
純資産合計	195,205,312	194,874,924
負債純資産合計	196,953,657	195,511,430

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 自　2021年 2月 2日 至　2022年 2月 1日	第29期 自　2022年 2月 2日 至　2023年 2月 1日
営業収益		
受取利息	-	3
有価証券売買等損益	6,065,400	5,909,672
営業収益合計	6,065,400	5,909,675
営業費用		
支払利息	585	1,252
受託者報酬	111,856	103,801
委託者報酬	3,180,164	1,444,104
その他費用	8,844	8,186
営業費用合計	3,301,449	1,557,343
営業利益又は営業損失（△）	2,763,951	4,352,332
経常利益又は経常損失（△）	2,763,951	4,352,332
当期純利益又は当期純損失（△）	2,763,951	4,352,332
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	926,513	203,470
期首剰余金又は期首欠損金（△）	24,280,970	26,437,241
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,005,488	2,626,497
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,005,488	2,626,497
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,602,271	3,141,184
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,602,271	3,141,184
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	84,384	82,442
期末剰余金又は期末欠損金（△）	26,437,241	29,988,974

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
1．	期首元本額	169,955,409円	168,768,071円
	期中追加設定元本額	16,776,660円	16,167,615円
	期中一部解約元本額	17,963,998円	20,049,736円
2．	受益権の総数	168,768,071口	164,885,950口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日			第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日		
	分配金の計算過程			分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	1,836,982円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	4,149,611円
C	信託約款に定める収益調整金	44,890,876円	C	信託約款に定める収益調整金	46,256,637円
D	信託約款に定める分配準備積立金	24,077,455円	D	信託約款に定める分配準備積立金	22,837,435円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	70,805,313円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	73,243,683円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,195円	F	分配対象収益(1万口当たり)	4,442円
G	分配金額	84,384円	G	分配金額	82,442円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H	分配金額(1万口当たり)	5円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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28期（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

親投資信託受益証券	4,055,990
合計	4,055,990

第29期（2023年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,144,609
合計	5,144,609

（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28期 2022年 2月 1日現在		第29期 2023年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.1566円	1口当たり純資産額	1.1819円
(1万口当たり純資産額)	(11,566円)	(1万口当たり純資産額)	(11,819円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	74,014,550	93,332,347	
	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	36,127,628	96,598,051	
合計		110,142,178	189,930,398	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,801,478	7,357,414
親投資信託受益証券	231,607,629	245,382,211
流動資産合計	239,409,107	252,739,625
資産合計	239,409,107	252,739,625
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	114,941	121,193
未払受託者報酬	66,108	69,001
未払委託者報酬	1,879,222	649,090
未払利息	2	2
その他未払費用	5,241	5,458
流動負債合計	2,065,514	844,744
負債合計	2,065,514	844,744
純資産の部		
元本等		
元本	229,883,526	242,386,660
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,460,067	9,508,221
（分配準備積立金）	15,905,445	14,950,211
元本等合計	237,343,593	251,894,881
純資産合計	237,343,593	251,894,881
負債純資産合計	239,409,107	252,739,625

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 自　2021年 2月 2日 至　2022年 2月 1日	第29期 自　2022年 2月 2日 至　2023年 2月 1日
営業収益		
受取利息	1	4
有価証券売買等損益	3,655,547	3,643,120
営業収益合計	3,655,548	3,643,124
営業費用		
支払利息	706	1,674
受託者報酬	128,964	133,776
委託者報酬	3,666,027	1,842,466
その他費用	10,207	10,584
営業費用合計	3,805,904	1,988,500
営業利益又は営業損失（△）	△150,356	1,654,624
経常利益又は経常損失（△）	△150,356	1,654,624
当期純利益又は当期純損失（△）	△150,356	1,654,624
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	58,065	△76,030
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,961,181	7,460,067
剰余金増加額又は欠損金減少額	969,047	844,512
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	969,047	844,512
剰余金減少額又は欠損金増加額	146,799	405,819
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	146,799	405,819
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	114,941	121,193
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,460,067	9,508,221

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
１．	期首元本額	214,557,629円	229,883,526円
	期中追加設定元本額	19,721,443円	25,024,830円
	期中一部解約元本額	4,395,546円	12,521,696円
２．	受益権の総数	229,883,526口	242,386,660口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日			第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日		
	分配金の計算過程			分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	40,188,311円	C	信託約款に定める収益調整金	44,073,269円
D	信託約款に定める分配準備積立金	16,020,386円	D	信託約款に定める分配準備積立金	15,071,404円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	56,208,697円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	59,144,673円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,445円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,440円
G	分配金額	114,941円	G	分配金額	121,193円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H	分配金額(1万口当たり)	5円

（金融商品に関する注記）
Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第28期 自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第28期 2022年 2月 1日現在	第29期 2023年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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28期（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

親投資信託受益証券	2,580,515
合計	2,580,515

第29期（2023年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,015,664
合計	3,015,664

（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28期 2022年 2月 1日現在		第29期 2023年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0325円	1口当たり純資産額	1.0392円
(1万口当たり純資産額)	(10,325円)	(1万口当たり純資産額)	(10,392円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	136,020,757	171,522,174	
	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	27,623,621	73,860,037	
合計		163,644,378	245,382,211	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

財形公社債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	93,551,329	120,586,352
国債証券	210,474,004	196,769,400
地方債証券	25,110,082	20,041,344
未収利息	73,894	60,128
前払費用	-	109
流動資産合計	329,209,309	337,457,333
資産合計	329,209,309	337,457,333
負債の部		
流動負債		
未払利息	24	37
流動負債合計	24	37
負債合計	24	37
純資産の部		
元本等		
元本	258,353,525	267,647,148
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	70,855,760	69,810,148
元本等合計	329,209,285	337,457,296
純資産合計	329,209,285	337,457,296
負債純資産合計	329,209,309	337,457,333

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
1．	期首	2021年 2月 2日	2022年 2月 2日
	期首元本額	255,644,528円	258,353,525円
	期首からの追加設定元本額	36,468,014円	39,793,152円
	期首からの一部解約元本額	33,759,017円	30,499,529円
	元本の内訳　※		
	財形株投（一般財形３０）	58,759,688円	57,611,841円
	財形株投（一般財形５０）	73,321,017円	74,014,550円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	126,272,820円	136,020,757円
	計	258,353,525円	267,647,148円
2．	受益権の総数	258,353,525口	267,647,148口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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）
（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2023年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△3,685,200
地方債証券	△91,456
合計	△3,776,656

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2022年 2月 1日現在		2023年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.274円	1口当たり純資産額	1.261円
(1千口当たり純資産額)	(1,274円)	(1千口当たり純資産額)	(1,261円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第１４２回利付国債（５年）	20,000,000	20,048,800	
	第３５３回利付国債（１０年）	40,000,000	39,583,200	

	第３５５回利付国債（１０年）	40,000,000	39,425,200	
	第３５７回利付国債（１０年）	40,000,000	39,262,000	
	第３５９回利付国債（１０年）	40,000,000	39,042,000	
	第３６１回利付国債（１０年）	20,000,000	19,408,200	
国債証券 合計		200,000,000	196,769,400	
地方債証券	第７１８回東京都公募公債	10,000,000	10,008,456	
	平成２５年度第４回京都府公募公債	10,000,000	10,032,888	
地方債証券 合計		20,000,000	20,041,344	
合計		220,000,000	216,810,744	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	111,518,846	257,327,383
株式	42,196,845,440	44,798,911,120
派生商品評価勘定	-	3,136,700
未収入金	43,314	-
未収配当金	63,025,784	77,391,639
前払金	5,490,000	-
流動資産合計	42,376,923,384	45,136,766,842
資産合計	42,376,923,384	45,136,766,842
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,763,300	-
前受金	-	3,410,000
未払金	11,349,260	196,242,740
未払解約金	47,000,000	22,819,967
未払利息	29	79
流動負債合計	64,112,589	222,472,786
負債合計	64,112,589	222,472,786
純資産の部		
元本等		
元本	16,909,899,311	16,797,664,281
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	25,402,911,484	28,116,629,775
元本等合計	42,312,810,795	44,914,294,056
純資産合計	42,312,810,795	44,914,294,056

	2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
負債純資産合計	42,376,923,384	45,136,766,842

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	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。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
1.	期首	2021年 2月 2日	2022年 2月 2日
	期首元本額	17,381,724,461円	16,909,899,311円
	期首からの追加設定元本額	1,944,445,849円	1,940,408,042円
	期首からの一部解約元本額	2,416,270,999円	2,052,643,072円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンドＴＳＰ	8,563,473,897円	8,585,771,002円
	財形株投（一般財形３０）	13,153,427円	11,983,116円
	財形株投（一般財形５０）	38,802,117円	36,127,628円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	28,268,416円	27,623,621円
	インデックスファンドＴＯＰＩＸ（日本株式）	7,742,030,865円	7,592,072,236円
	ＴＯＰＩＸインデックスファンド（個人型年金向け）	484,756,519円	512,523,130円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	23,980,026円	19,237,955円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	7,938,017円	6,208,760円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	7,496,027円	6,116,833円
	計	16,909,899,311円	16,797,664,281円
2.	受益権の総数	16,909,899,311口	16,797,664,281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	506,962,000円	512,777,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 2月 2日 至 2022年 2月 1日	自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月 1日現在	2023年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	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）
（2022年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2023年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,009,452,864
合計	1,009,452,864

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2022年 2月 1日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	119,400,000	－	113,640,000	△5,760,000

合計	119,400,000	－	113,640,000	△5,760,000

（2023年 2月 1日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	115,120,000	－	118,260,000	3,140,000
合計		115,120,000	－	118,260,000	3,140,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2022年 2月 1日現在		2023年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	2.5023円	1口当たり純資産額	2.6738円
(1万口当たり純資産額)	(25,023円)	(1万口当たり純資産額)	(26,738円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,855.00	3,084,000	
ニッスイ	22,100	536.00	11,845,600	
マルハニチロ	3,300	2,440.00	8,052,000	
雪国まいたけ	1,900	1,036.00	1,968,400	

カネコ種苗	700	1,610.00	1,127,000	
サカタのタネ	2,500	4,155.00	10,387,500	
ホクト	2,000	1,877.00	3,754,000	
ホクリヨウ	300	871.00	261,300	
住石ホールディングス	3,100	391.00	1,212,100	
日鉄鉱業	900	3,630.00	3,267,000	
三井松島ホールディングス	1,000	3,255.00	3,255,000	
ＩＮＰＥＸ	81,900	1,434.00	117,444,600	
石油資源開発	2,600	4,260.00	11,076,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,000	2,010.00	2,010,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,430.00	16,290,000	
ミライト・ワン	7,700	1,550.00	11,935,000	
タマホーム	1,400	3,195.00	4,473,000	
サンヨーホームズ	300	716.00	214,800	
日本アクア	800	945.00	756,000	
ファーストコーポレーション	500	712.00	356,000	
ベステラ	400	901.00	360,400	
キャンディル	300	500.00	150,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	983.00	393,200	
第一カッター興業	600	1,036.00	621,600	
安藤・間	12,800	852.00	10,905,600	
東急建設	6,300	655.00	4,126,500	
コムシスホールディングス	7,500	2,420.00	18,150,000	
ビーアールホールディングス	3,500	340.00	1,190,000	
高松コンストラクショングループ	1,500	1,945.00	2,917,500	
東建コーポレーション	600	7,650.00	4,590,000	
ソネック	200	943.00	188,600	
ヤマウラ	1,100	1,042.00	1,146,200	
大成建設	15,400	4,365.00	67,221,000	
大林組	55,400	988.00	54,735,200	
清水建設	46,600	726.00	33,831,600	
飛島建設	1,700	1,047.00	1,779,900	
長谷工コーポレーション	16,000	1,480.00	23,680,000	
松井建設	1,500	589.00	883,500	
錢高組	200	2,735.00	547,000	
鹿島建設	34,400	1,555.00	53,492,000	
不動テトラ	1,100	1,538.00	1,691,800	
大末建設	500	1,165.00	582,500	
鉄建建設	1,100	1,825.00	2,007,500	
西松建設	2,600	3,495.00	9,087,000	
三井住友建設	12,500	420.00	5,250,000	
大豊建設	700	3,630.00	2,541,000	

ナカノフドー建設	1,000	330.00	330,000	
奥村組	2,500	2,997.00	7,492,500	
東鉄工業	2,100	2,661.00	5,588,100	
イチケン	300	1,813.00	543,900	
富士ピー・エス	600	448.00	268,800	
淺沼組	1,300	3,220.00	4,186,000	
戸田建設	19,100	698.00	13,331,800	
熊谷組	2,700	2,632.00	7,106,400	
北野建設	300	2,742.00	822,600	
植木組	400	1,326.00	530,400	
矢作建設工業	2,100	801.00	1,682,100	
ピーエス三菱	2,000	630.00	1,260,000	
日本ハウスホールディングス	3,100	384.00	1,190,400	
新日本建設	2,200	807.00	1,775,400	
東亜道路工業	300	6,150.00	1,845,000	
日本道路	300	6,160.00	1,848,000	
東亜建設工業	1,300	2,474.00	3,216,200	
日本国土開発	4,700	548.00	2,575,600	
若築建設	700	3,010.00	2,107,000	
東洋建設	5,000	849.00	4,245,000	
五洋建設	22,000	638.00	14,036,000	
世紀東急工業	2,100	811.00	1,703,100	
福田組	600	4,510.00	2,706,000	
住友林業	11,900	2,393.00	28,476,700	
日本基礎技術	900	527.00	474,300	
巴コーポレーション	1,600	411.00	657,600	
大和ハウス工業	43,300	3,096.00	134,056,800	
ライト工業	3,000	1,877.00	5,631,000	
積水ハウス	48,600	2,432.50	118,219,500	
日特建設	1,500	914.00	1,371,000	
北陸電気工事	1,100	696.00	765,600	
ユアテック	3,400	749.00	2,546,600	
日本リーテック	1,000	874.00	874,000	
四電工	700	1,820.00	1,274,000	
中電工	2,400	2,073.00	4,975,200	
関電工	8,500	862.00	7,327,000	
きんでん	10,900	1,459.00	15,903,100	
東京エネシス	1,600	906.00	1,449,600	
トーエネック	500	3,370.00	1,685,000	
住友電設	1,500	2,285.00	3,427,500	
日本電設工業	2,600	1,536.00	3,993,600	
エクシオグループ	7,100	2,323.00	16,493,300	

新日本空調	900	1,944.00	1,749,600	
九電工	3,800	3,225.00	12,255,000	
三機工業	3,400	1,526.00	5,188,400	
日揮ホールディングス	15,300	1,690.00	25,857,000	
中外炉工業	500	1,770.00	885,000	
ヤマト	1,200	762.00	914,400	
太平電業	1,000	3,350.00	3,350,000	
高砂熱学工業	3,700	1,845.00	6,826,500	
三晃金属工業	200	3,665.00	733,000	
朝日工業社	700	2,085.00	1,459,500	
明星工業	2,700	803.00	2,168,100	
大氣社	1,900	3,440.00	6,536,000	
ダイダン	1,000	2,183.00	2,183,000	
日比谷総合設備	1,300	1,960.00	2,548,000	
フィル・カンパニー	300	1,112.00	333,600	
テスホールディングス	1,700	1,165.00	1,980,500	
インフロニア・ホールディングス	16,300	1,031.00	16,805,300	
東洋エンジニアリング	2,100	607.00	1,274,700	
レイズネクスト	2,300	1,314.00	3,022,200	
ニップン	4,200	1,605.00	6,741,000	
日清製粉グループ本社	14,400	1,608.00	23,155,200	
日東富士製粉	300	4,390.00	1,317,000	
昭和産業	1,400	2,499.00	3,498,600	
鳥越製粉	1,100	590.00	649,000	
中部飼料	2,200	1,033.00	2,272,600	
フィード・ワン	2,300	682.00	1,568,600	
東洋精糖	300	871.00	261,300	
日本甜菜製糖	900	1,667.00	1,500,300	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	1,600	2,018.00	3,228,800	
塩水港精糖	1,700	192.00	326,400	
ウェルネオシュガー	800	1,651.00	1,320,800	
森永製菓	2,900	3,830.00	11,107,000	
中村屋	400	3,075.00	1,230,000	
江崎グリコ	4,500	3,620.00	16,290,000	
名糖産業	600	1,679.00	1,007,400	
井村屋グループ	800	2,253.00	1,802,400	
不二家	1,100	2,523.00	2,775,300	
山崎製パン	10,400	1,513.00	15,735,200	
第一屋製パン	300	384.00	115,200	
モロゾフ	500	3,365.00	1,682,500	
亀田製菓	1,000	4,370.00	4,370,000	
寿スピリッツ	1,700	8,500.00	14,450,000	

カルビー	7,100	2,879.00	20,440,900	
森永乳業	2,800	4,790.00	13,412,000	
六甲バター	1,100	1,317.00	1,448,700	
ヤクルト本社	11,100	9,220.00	102,342,000	
明治ホールディングス	9,700	6,750.00	65,475,000	
雪印メグミルク	3,800	1,802.00	6,847,600	
プリマハム	2,100	2,157.00	4,529,700	
日本ハム	6,100	3,825.00	23,332,500	
林兼産業	400	471.00	188,400	
丸大食品	1,600	1,456.00	2,329,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,700	2,923.00	4,969,100	
柿安本店	600	2,009.00	1,205,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	12,100	703.00	8,506,300	
サッポロホールディングス	5,100	3,160.00	16,116,000	
アサヒグループホールディングス	35,900	4,273.00	153,400,700	
キリンホールディングス	70,200	2,008.00	140,961,600	
宝ホールディングス	10,600	1,051.00	11,140,600	
オエノンホールディングス	4,600	256.00	1,177,600	
養命酒製造	500	1,830.00	915,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	12,200	1,345.00	16,409,000	
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,345.00	47,360,500	
ダイドーグループホールディングス	900	4,665.00	4,198,500	
伊藤園	5,300	4,605.00	24,406,500	
キーコーヒー	1,800	2,063.00	3,713,400	
ユニカフェ	500	898.00	449,000	
ジャパンフーズ	200	1,089.00	217,800	
日清オイリオグループ	2,200	3,185.00	7,007,000	
不二製油グループ本社	3,600	2,054.00	7,394,400	
かどや製油	100	3,530.00	353,000	
Ｊ－オイルミルズ	1,600	1,556.00	2,489,600	
キッコーマン	10,300	6,790.00	69,937,000	
味の素	38,100	4,117.00	156,857,700	
ブルドックソース	600	1,897.00	1,138,200	
キユーピー	8,400	2,231.00	18,740,400	
ハウス食品グループ本社	4,800	2,737.00	13,137,600	
カゴメ	7,300	3,165.00	23,104,500	
焼津水産化学工業	600	813.00	487,800	
アリアケジャパン	1,400	4,355.00	6,097,000	
ピエトロ	200	1,818.00	363,600	
エバラ食品工業	400	3,085.00	1,234,000	
やまみ	100	1,354.00	135,400	
ニチレイ	7,100	2,689.00	19,091,900	

東洋水産	7,900	5,360.00	42,344,000	
イートアンドホールディングス	700	2,345.00	1,641,500	
大冷	200	1,902.00	380,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	905.00	905,000	
日清食品ホールディングス	5,500	10,220.00	56,210,000	
永谷園ホールディングス	800	2,024.00	1,619,200	
一正蒲鉾	600	704.00	422,400	
フジッコ	1,600	1,857.00	2,971,200	
ロック・フィールド	1,800	1,572.00	2,829,600	
日本たばこ産業	102,400	2,650.50	271,411,200	
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,337.00	1,470,700	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,954.00	2,344,800	
なとり	1,000	2,062.00	2,062,000	
イフジ産業	300	914.00	274,200	
ファーマフーズ	2,400	1,349.00	3,237,600	
ユーグレナ	10,000	1,040.00	10,400,000	
紀文食品	1,200	953.00	1,143,600	
ピックルスホールディングス	900	1,197.00	1,077,300	
ミヨシ油脂	500	927.00	463,500	
理研ビタミン	1,400	1,929.00	2,700,600	
片倉工業	1,500	1,733.00	2,599,500	
グンゼ	1,200	4,230.00	5,076,000	
東洋紡	6,900	1,030.00	7,107,000	
ユニチカ	4,800	242.00	1,161,600	
富士紡ホールディングス	600	3,190.00	1,914,000	
倉敷紡績	1,200	2,240.00	2,688,000	
シキボウ	800	972.00	777,600	
日本毛織	4,200	956.00	4,015,200	
ダイトウボウ	2,300	88.00	202,400	
トーア紡コーポレーション	600	351.00	210,600	
ダイドーリミテッド	2,200	259.00	569,800	
帝国繊維	1,800	1,556.00	2,800,800	
帝人	15,200	1,323.00	20,109,600	
東レ	106,000	792.00	83,952,000	
住江織物	300	1,882.00	564,600	
日本フエルト	800	410.00	328,000	
日東製網	200	1,588.00	317,600	
アツギ	800	394.00	315,200	
ダイニック	400	657.00	262,800	
セーレン	3,100	2,338.00	7,247,800	
ソトー	500	815.00	407,500	
東海染工	200	1,116.00	223,200	

小松マテーレ	2,300	767.00	1,764,100	
ワコールホールディングス	3,100	2,439.00	7,560,900	
ホギメディカル	2,100	3,255.00	6,835,500	
クラウディアホールディングス	300	375.00	112,500	
ＴＳＩホールディングス	5,700	535.00	3,049,500	
マツオカコーポレーション	400	1,164.00	465,600	
ワールド	2,000	1,358.00	2,716,000	
三陽商会	600	1,415.00	849,000	
ナイガイ	500	260.00	130,000	
オンワードホールディングス	10,300	342.00	3,522,600	
ルックホールディングス	400	2,608.00	1,043,200	
ゴールドウイン	2,800	9,860.00	27,608,000	
デサント	2,700	3,635.00	9,814,500	
キング	600	511.00	306,600	
ヤマトインターナショナル	1,100	250.00	275,000	
特種東海製紙	700	2,915.00	2,040,500	
王子ホールディングス	65,900	538.00	35,454,200	
日本製紙	8,300	964.00	8,001,200	
三菱製紙	1,700	289.00	491,300	
北越コーポレーション	10,000	833.00	8,330,000	
中越パルプ工業	600	1,046.00	627,600	
巴川製紙所	500	700.00	350,000	
大王製紙	7,000	994.00	6,958,000	
阿波製紙	400	735.00	294,000	
レンゴー	14,400	915.00	13,176,000	
トーモク	900	1,540.00	1,386,000	
ザ・パック	1,200	2,573.00	3,087,600	
北の達人コーポレーション	6,700	331.00	2,217,700	
クラレ	25,200	1,067.00	26,888,400	
旭化成	98,800	979.70	96,794,360	
共和レザー	800	514.00	411,200	
レゾナック・ホールディングス	15,300	2,210.00	33,813,000	
住友化学	117,400	496.00	58,230,400	
住友精化	700	4,120.00	2,884,000	
日産化学	7,500	6,040.00	45,300,000	
ラサ工業	600	1,995.00	1,197,000	
クレハ	1,400	8,290.00	11,606,000	
多木化学	600	4,545.00	2,727,000	
テイカ	1,100	1,205.00	1,325,500	
石原産業	2,900	1,103.00	3,198,700	
片倉コープアグリ	300	1,742.00	522,600	
日本曹達	1,700	4,215.00	7,165,500	

東ソー	21,100	1,686.00	35,574,600	
トクヤマ	5,100	1,972.00	10,057,200	
セントラル硝子	2,500	2,917.00	7,292,500	
東亞合成	7,900	1,179.00	9,314,100	
大阪ソーダ	1,000	4,145.00	4,145,000	
関東電化工業	3,100	998.00	3,093,800	
デンカ	5,700	2,694.00	15,355,800	
信越化学工業	26,700	19,255.00	514,108,500	
日本カーバイド工業	600	1,324.00	794,400	
堺化学工業	1,200	1,830.00	2,196,000	
第一稀元素化学工業	1,500	1,088.00	1,632,000	
エア・ウォーター	14,900	1,575.00	23,467,500	
日本酸素ホールディングス	15,300	2,126.00	32,527,800	
日本化学工業	500	1,894.00	947,000	
東邦アセチレン	300	1,160.00	348,000	
日本パーカライジング	7,800	950.00	7,410,000	
高圧ガス工業	2,300	655.00	1,506,500	
四国化成ホールディングス	1,900	1,272.00	2,416,800	
戸田工業	400	2,591.00	1,036,400	
ステラ　ケミファ	900	2,590.00	2,331,000	
保土谷化学工業	500	3,350.00	1,675,000	
日本触媒	2,400	5,490.00	13,176,000	
大日精化工業	1,100	1,796.00	1,975,600	
カネカ	3,600	3,380.00	12,168,000	
三菱瓦斯化学	11,800	1,888.00	22,278,400	
三井化学	13,100	3,055.00	40,020,500	
ＪＳＲ	14,800	2,892.00	42,801,600	
東京応化工業	2,800	6,410.00	17,948,000	
大阪有機化学工業	1,200	2,112.00	2,534,400	
三菱ケミカルグループ	106,800	724.70	77,397,960	
ＫＨネオケム	2,600	2,735.00	7,111,000	
ダイセル	23,300	962.00	22,414,600	
住友ベークライト	2,300	4,175.00	9,602,500	
積水化学工業	32,400	1,802.00	58,384,800	
日本ゼオン	9,500	1,222.00	11,609,000	
アイカ工業	4,000	3,075.00	12,300,000	
ＵＢＥ	8,200	2,026.00	16,613,200	
積水樹脂	2,300	1,935.00	4,450,500	
タキロンシーアイ	3,500	520.00	1,820,000	
旭有機材	1,100	2,711.00	2,982,100	
ニチバン	1,000	1,805.00	1,805,000	
リケンテクノス	3,400	530.00	1,802,000	

大倉工業	700	1,882.00	1,317,400	
積水化成品工業	2,200	392.00	862,400	
群栄化学工業	400	2,484.00	993,600	
タイガースポリマー	700	414.00	289,800	
ミライアル	400	1,508.00	603,200	
ダイキアクシス	500	694.00	347,000	
ダイキョーニシカワ	3,500	611.00	2,138,500	
竹本容器	500	744.00	372,000	
森六ホールディングス	800	1,770.00	1,416,000	
恵和	1,000	1,574.00	1,574,000	
日本化薬	12,100	1,160.00	14,036,000	
カーリットホールディングス	1,400	775.00	1,085,000	
日本精化	900	2,377.00	2,139,300	
扶桑化学工業	1,500	3,650.00	5,475,000	
トリケミカル研究所	2,100	2,381.00	5,000,100	
ＡＤＥＫＡ	5,500	2,169.00	11,929,500	
日油	4,900	5,500.00	26,950,000	
新日本理化	2,000	226.00	452,000	
ハリマ化成グループ	1,000	856.00	856,000	
花王	38,500	5,174.00	199,199,000	
第一工業製薬	600	1,957.00	1,174,200	
石原ケミカル	700	1,276.00	893,200	
日華化学	600	818.00	490,800	
ニイタカ	300	2,035.00	610,500	
三洋化成工業	1,000	4,200.00	4,200,000	
有機合成薬品工業	1,100	289.00	317,900	
大日本塗料	1,900	786.00	1,493,400	
日本ペイントホールディングス	70,000	1,177.00	82,390,000	
関西ペイント	14,500	1,794.00	26,013,000	
神東塗料	1,200	126.00	151,200	
中国塗料	2,600	1,042.00	2,709,200	
日本特殊塗料	900	888.00	799,200	
藤倉化成	2,100	436.00	915,600	
太陽ホールディングス	2,400	2,388.00	5,731,200	
ＤＩＣ	6,200	2,396.00	14,855,200	
サカタインクス	3,500	1,078.00	3,773,000	
東洋インキＳＣホールディングス	3,100	1,850.00	5,735,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,400	1,259.00	1,762,600	
富士フイルムホールディングス	30,400	6,790.00	206,416,000	
資生堂	33,100	6,640.00	219,784,000	
ライオン	19,000	1,425.00	27,075,000	
高砂香料工業	1,100	2,584.00	2,842,400	

マンダム	3,400	1,447.00	4,919,800	
ミルボン	2,300	5,620.00	12,926,000	
ファンケル	6,900	2,615.00	18,043,500	
コーセー	3,200	14,060.00	44,992,000	
コタ	1,300	1,717.00	2,232,100	
シーボン	200	1,609.00	321,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,100	1,839.00	14,895,900	
ノエビアホールディングス	1,400	5,650.00	7,910,000	
アジュバンホールディングス	400	982.00	392,800	
新日本製薬	900	1,454.00	1,308,600	
エステー	1,200	1,572.00	1,886,400	
アグロ　カネショウ	700	1,610.00	1,127,000	
コニシ	2,700	1,806.00	4,876,200	
長谷川香料	3,300	3,145.00	10,378,500	
星光ＰＭＣ	700	564.00	394,800	
小林製薬	4,600	9,190.00	42,274,000	
荒川化学工業	1,400	993.00	1,390,200	
メック	1,300	2,496.00	3,244,800	
日本高純度化学	400	2,359.00	943,600	
タカラバイオ	4,300	1,728.00	7,430,400	
ＪＣＵ	1,800	3,165.00	5,697,000	
新田ゼラチン	900	859.00	773,100	
ＯＡＴアグリオ	600	1,497.00	898,200	
デクセリアルズ	4,600	2,741.00	12,608,600	
アース製薬	1,400	5,060.00	7,084,000	
北興化学工業	1,600	831.00	1,329,600	
大成ラミック	500	2,943.00	1,471,500	
クミアイ化学工業	6,300	870.00	5,481,000	
日本農薬	2,900	712.00	2,064,800	
アキレス	1,000	1,272.00	1,272,000	
有沢製作所	2,600	1,400.00	3,640,000	
日東電工	11,500	8,300.00	95,450,000	
レック	2,300	1,001.00	2,302,300	
三光合成	2,000	539.00	1,078,000	
きもと	2,100	202.00	424,200	
藤森工業	1,300	3,315.00	4,309,500	
前澤化成工業	1,000	1,374.00	1,374,000	
未来工業	600	1,494.00	896,400	
ウェーブロックホールディングス	400	624.00	249,600	
ＪＳＰ	1,100	1,587.00	1,745,700	
エフピコ	3,000	3,785.00	11,355,000	
天馬	1,400	2,202.00	3,082,800	

信越ポリマー	2,900	1,286.00	3,729,400	
東リ	3,200	230.00	736,000	
ニフコ	5,700	3,335.00	19,009,500	
バルカー	1,300	3,220.00	4,186,000	
ユニ・チャーム	33,000	4,909.00	161,997,000	
ショーエイコーポレーション	400	588.00	235,200	
協和キリン	19,100	2,897.00	55,332,700	
武田薬品工業	140,300	4,075.00	571,722,500	
アステラス製薬	151,900	1,902.00	288,913,800	
住友ファーマ	11,800	878.00	10,360,400	
塩野義製薬	20,200	6,203.00	125,300,600	
わかもと製薬	1,300	223.00	289,900	
日本新薬	3,700	6,700.00	24,790,000	
中外製薬	49,600	3,325.00	164,920,000	
科研製薬	2,700	3,730.00	10,071,000	
エーザイ	19,300	8,019.00	154,766,700	
ロート製薬	15,400	2,374.00	36,559,600	
小野薬品工業	30,600	2,863.00	87,607,800	
久光製薬	3,500	4,025.00	14,087,500	
持田製薬	1,900	3,445.00	6,545,500	
参天製薬	29,800	1,007.00	30,008,600	
扶桑薬品工業	500	1,950.00	975,000	
日本ケミファ	200	1,708.00	341,600	
ツムラ	5,000	2,758.00	13,790,000	
キッセイ薬品工業	2,500	2,630.00	6,575,000	
生化学工業	3,000	827.00	2,481,000	
栄研化学	2,600	1,608.00	4,180,800	
鳥居薬品	900	3,060.00	2,754,000	
ＪＣＲファーマ	5,400	1,636.00	8,834,400	
東和薬品	2,400	2,031.00	4,874,400	
富士製薬工業	1,000	1,052.00	1,052,000	
ゼリア新薬工業	2,200	2,181.00	4,798,200	
第一三共	138,100	4,094.00	565,381,400	
キョーリン製薬ホールディングス	3,400	1,707.00	5,803,800	
大幸薬品	2,900	387.00	1,122,300	
ダイト	1,100	2,587.00	2,845,700	
大塚ホールディングス	36,300	4,153.00	150,753,900	
大正製薬ホールディングス	3,500	5,430.00	19,005,000	
ペプチドリーム	7,700	1,973.00	15,192,100	
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,239.00	1,982,400	
サワイグループホールディングス	3,600	4,015.00	14,454,000	
日本コークス工業	14,300	93.00	1,329,900	

ニチレキ	1,900	1,388.00	2,637,200	
ユシロ化学工業	800	789.00	631,200	
ビーピー・カストロール	600	887.00	532,200	
富士石油	3,300	264.00	871,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	500	1,215.00	607,500	
出光興産	17,600	3,225.00	56,760,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	286,300	464.00	132,843,200	
コスモエネルギーホールディングス	6,300	3,615.00	22,774,500	
横浜ゴム	9,000	2,135.00	19,215,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9,100	1,552.00	14,123,200	
ブリヂストン	50,600	4,829.00	244,347,400	
住友ゴム工業	15,600	1,161.00	18,111,600	
藤倉コンポジット	1,000	903.00	903,000	
オカモト	900	3,790.00	3,411,000	
フコク	900	1,037.00	933,300	
ニッタ	1,600	2,850.00	4,560,000	
住友理工	3,100	706.00	2,188,600	
三ツ星ベルト	2,300	3,700.00	8,510,000	
バンドー化学	2,500	1,018.00	2,545,000	
日東紡績	1,900	2,036.00	3,868,400	
ＡＧＣ	16,100	4,730.00	76,153,000	
日本板硝子	8,100	629.00	5,094,900	
石塚硝子	200	1,450.00	290,000	
日本山村硝子	500	548.00	274,000	
日本電気硝子	6,500	2,394.00	15,561,000	
オハラ	800	1,214.00	971,200	
住友大阪セメント	2,200	3,380.00	7,436,000	
太平洋セメント	10,100	2,208.00	22,300,800	
日本ヒューム	1,400	663.00	928,200	
日本コンクリート工業	3,100	224.00	694,400	
三谷セキサン	700	4,140.00	2,898,000	
アジアパイルホールディングス	2,500	630.00	1,575,000	
東海カーボン	13,300	1,119.00	14,882,700	
日本カーボン	900	4,380.00	3,942,000	
東洋炭素	1,000	4,135.00	4,135,000	
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,170.00	3,336,000	
ＴＯＴＯ	10,400	4,600.00	47,840,000	
日本碍子	18,700	1,788.00	33,435,600	
日本特殊陶業	12,100	2,580.00	31,218,000	
ダントーホールディングス	1,000	314.00	314,000	
ＭＡＲＵＷＡ	600	16,790.00	10,074,000	
品川リフラクトリーズ	500	4,150.00	2,075,000	

黒崎播磨	300	5,950.00	1,785,000	
ヨータイ	1,100	1,499.00	1,648,900	
東京窯業	1,300	288.00	374,400	
ニッカトー	700	533.00	373,100	
フジミインコーポレーテッド	1,300	6,620.00	8,606,000	
クニミネ工業	400	840.00	336,000	
エーアンドエーマテリアル	300	899.00	269,700	
ニチアス	4,000	2,459.00	9,836,000	
ニチハ	2,000	2,647.00	5,294,000	
日本製鉄	73,000	2,719.00	198,487,000	
神戸製鋼所	32,800	699.00	22,927,200	
合同製鐵	800	2,567.00	2,053,600	
ＪＦＥホールディングス	43,600	1,723.00	75,122,800	
東京製鐵	4,600	1,397.00	6,426,200	
共英製鋼	1,900	1,443.00	2,741,700	
大和工業	2,700	4,980.00	13,446,000	
東京鐵鋼	800	1,701.00	1,360,800	
大阪製鐵	800	1,225.00	980,000	
淀川製鋼所	1,900	2,761.00	5,245,900	
中部鋼鈑	1,300	1,879.00	2,442,700	
丸一鋼管	5,000	2,800.00	14,000,000	
モリ工業	300	2,925.00	877,500	
大同特殊鋼	2,100	4,890.00	10,269,000	
日本高周波鋼業	500	345.00	172,500	
日本冶金工業	1,200	4,645.00	5,574,000	
山陽特殊製鋼	1,600	2,540.00	4,064,000	
愛知製鋼	1,000	2,329.00	2,329,000	
日本金属	300	917.00	275,100	
大平洋金属	1,200	1,998.00	2,397,600	
新日本電工	10,400	385.00	4,004,000	
栗本鐵工所	800	1,872.00	1,497,600	
虹技	200	1,020.00	204,000	
日本鋳鉄管	200	982.00	196,400	
三菱製鋼	1,000	1,131.00	1,131,000	
日亜鋼業	1,500	257.00	385,500	
日本精線	200	4,545.00	909,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,000	752.00	752,000	
シンニッタン	1,600	245.00	392,000	
新家工業	300	2,439.00	731,700	
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,372.00	3,155,600	
日本軽金属ホールディングス	4,400	1,467.00	6,454,800	
三井金属鉱業	4,700	3,410.00	16,027,000	

東邦亜鉛	1,000	2,172.00	2,172,000	
三菱マテリアル	10,900	2,213.00	24,121,700	
住友金属鉱山	18,900	5,272.00	99,640,800	
ＤＯＷＡホールディングス	3,700	4,495.00	16,631,500	
古河機械金属	2,400	1,315.00	3,156,000	
エス・サイエンス	8,700	26.00	226,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	3,630.00	8,712,000	
東邦チタニウム	3,000	2,382.00	7,146,000	
ＵＡＣＪ	2,300	2,409.00	5,540,700	
ＣＫサンエツ	400	4,310.00	1,724,000	
古河電気工業	5,400	2,512.00	13,564,800	
住友電気工業	56,300	1,553.00	87,433,900	
フジクラ	17,500	965.00	16,887,500	
昭和電線ホールディングス	1,800	1,834.00	3,301,200	
タツタ電線	3,300	715.00	2,359,500	
カナレ電気	200	1,329.00	265,800	
平河ヒューテック	1,000	1,192.00	1,192,000	
リョービ	1,700	1,257.00	2,136,900	
アーレスティ	1,600	490.00	784,000	
アサヒホールディングス	6,600	1,967.00	12,982,200	
稲葉製作所	1,000	1,377.00	1,377,000	
宮地エンジニアリンググループ	500	3,620.00	1,810,000	
トーカロ	4,500	1,211.00	5,449,500	
アルファＣｏ	500	943.00	471,500	
ＳＵＭＣＯ	31,000	1,945.00	60,295,000	
川田テクノロジーズ	400	3,365.00	1,346,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,100	3,915.00	4,306,500	
ジェイテックコーポレーション	200	3,165.00	633,000	
信和	800	805.00	644,000	
東洋製罐グループホールディングス	10,800	1,672.00	18,057,600	
ホッカンホールディングス	900	1,410.00	1,269,000	
コロナ	900	916.00	824,400	
横河ブリッジホールディングス	2,200	2,019.00	4,441,800	
駒井ハルテック	300	1,539.00	461,700	
高田機工	100	2,560.00	256,000	
三和ホールディングス	15,000	1,369.00	20,535,000	
文化シヤッター	4,700	1,153.00	5,419,100	
三協立山	1,900	662.00	1,257,800	
アルインコ	1,300	1,050.00	1,365,000	
東洋シヤッター	400	542.00	216,800	
ＬＩＸＩＬ	23,800	2,117.00	50,384,600	
日本フイルコン	1,000	451.00	451,000	

ノーリツ	2,400	1,477.00	3,544,800	
長府製作所	1,700	2,093.00	3,558,100	
リンナイ	3,000	9,990.00	29,970,000	
ダイニチ工業	700	667.00	466,900	
日東精工	2,400	509.00	1,221,600	
三洋工業	200	1,824.00	364,800	
岡部	2,600	725.00	1,885,000	
ジーテクト	1,800	1,550.00	2,790,000	
東プレ	2,900	1,267.00	3,674,300	
高周波熱錬	2,700	693.00	1,871,100	
東京製綱	1,000	1,066.00	1,066,000	
サンコール	1,300	662.00	860,600	
モリテック　スチール	1,100	294.00	323,400	
パイオラックス	2,300	1,764.00	4,057,200	
エイチワン	1,700	660.00	1,122,000	
日本発條	14,400	908.00	13,075,200	
中央発條	900	769.00	692,100	
アドバネクス	200	1,067.00	213,400	
立川ブラインド工業	800	1,206.00	964,800	
三益半導体工業	1,300	2,578.00	3,351,400	
日本ドライケミカル	400	1,509.00	603,600	
日本製鋼所	4,400	2,727.00	11,998,800	
三浦工業	6,700	3,185.00	21,339,500	
タクマ	4,900	1,264.00	6,193,600	
ツガミ	3,600	1,424.00	5,126,400	
オークマ	1,600	5,110.00	8,176,000	
芝浦機械	1,600	2,824.00	4,518,400	
アマダ	25,500	1,148.00	29,274,000	
アイダエンジニアリング	3,300	799.00	2,636,700	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	400	1,136.00	454,400	
ＦＵＪＩ	6,900	2,143.00	14,786,700	
牧野フライス製作所	1,800	4,695.00	8,451,000	
オーエスジー	7,600	2,020.00	15,352,000	
ダイジェット工業	200	859.00	171,800	
旭ダイヤモンド工業	4,500	745.00	3,352,500	
ＤＭＧ森精機	9,700	1,953.00	18,944,100	
ソディック	4,400	754.00	3,317,600	
ディスコ	2,600	39,300.00	102,180,000	
日東工器	800	1,579.00	1,263,200	
日進工具	1,300	1,071.00	1,392,300	
パンチ工業	1,200	456.00	547,200	
冨士ダイス	700	590.00	413,000	

豊和工業	800	966.00	772,800	
ニデックオーケーケー	500	929.00	464,500	
東洋機械金属	1,000	555.00	555,000	
島精機製作所	2,500	1,843.00	4,607,500	
オプトラン	2,400	2,558.00	6,139,200	
ＮＣホールディングス	300	2,018.00	605,400	
イワキポンプ	1,100	1,267.00	1,393,700	
フリュー	1,700	1,166.00	1,982,200	
ヤマシンフィルタ	3,800	557.00	2,116,600	
日阪製作所	1,500	859.00	1,288,500	
やまびこ	2,600	1,129.00	2,935,400	
野村マイクロ・サイエンス	500	4,710.00	2,355,000	
平田機工	800	6,320.00	5,056,000	
ペガサスミシン製造	1,800	673.00	1,211,400	
マルマエ	800	1,686.00	1,348,800	
タツモ	900	1,939.00	1,745,100	
ナブテスコ	10,000	3,700.00	37,000,000	
三井海洋開発	2,000	1,377.00	2,754,000	
レオン自動機	1,700	1,098.00	1,866,600	
ＳＭＣ	5,200	65,820.00	342,264,000	
ホソカワミクロン	1,200	2,735.00	3,282,000	
ユニオンツール	700	3,390.00	2,373,000	
オイレス工業	2,200	1,539.00	3,385,800	
日精エー・エス・ビー機械	700	4,495.00	3,146,500	
サトーホールディングス	2,300	2,110.00	4,853,000	
技研製作所	1,700	2,889.00	4,911,300	
日本エアーテック	800	1,118.00	894,400	
カワタ	400	849.00	339,600	
日精樹脂工業	1,200	977.00	1,172,400	
オカダアイヨン	500	1,595.00	797,500	
ワイエイシイホールディングス	600	2,143.00	1,285,800	
小松製作所	74,800	3,128.00	233,974,400	
住友重機械工業	9,500	2,825.00	26,837,500	
日立建機	6,400	3,015.00	19,296,000	
日工	2,400	630.00	1,512,000	
巴工業	700	2,470.00	1,729,000	
井関農機	1,500	1,227.00	1,840,500	
ＴＯＷＡ	1,600	1,933.00	3,092,800	
丸山製作所	300	1,615.00	484,500	
北川鉄工所	600	1,174.00	704,400	
ローツェ	800	10,070.00	8,056,000	
タカキタ	400	413.00	165,200	

クボタ	84,500	1,923.50	162,535,750	
荏原実業	800	2,553.00	2,042,400	
三菱化工機	500	2,207.00	1,103,500	
月島機械	2,200	1,016.00	2,235,200	
帝国電機製作所	1,200	2,431.00	2,917,200	
新東工業	3,200	718.00	2,297,600	
澁谷工業	1,500	2,481.00	3,721,500	
アイチ　コーポレーション	2,300	773.00	1,777,900	
小森コーポレーション	3,700	817.00	3,022,900	
鶴見製作所	1,200	1,980.00	2,376,000	
住友精密工業	100	3,635.00	363,500	
日本ギア工業	500	455.00	227,500	
酒井重工業	200	3,620.00	724,000	
荏原製作所	6,500	5,420.00	35,230,000	
石井鐵工所	200	2,281.00	456,200	
酉島製作所	1,400	1,482.00	2,074,800	
北越工業	1,600	1,411.00	2,257,600	
ダイキン工業	19,000	22,445.00	426,455,000	
オルガノ	2,200	3,150.00	6,930,000	
トーヨーカネツ	600	2,649.00	1,589,400	
栗田工業	8,900	5,790.00	51,531,000	
椿本チエイン	2,300	3,065.00	7,049,500	
大同工業	600	746.00	447,600	
木村化工機	1,200	709.00	850,800	
アネスト岩田	2,700	869.00	2,346,300	
ダイフク	8,200	7,070.00	57,974,000	
サムコ	500	3,595.00	1,797,500	
加藤製作所	700	759.00	531,300	
油研工業	200	1,885.00	377,000	
タダノ	8,400	945.00	7,938,000	
フジテック	5,800	3,125.00	18,125,000	
ＣＫＤ	4,400	2,035.00	8,954,000	
平和	5,300	2,336.00	12,380,800	
理想科学工業	1,400	2,259.00	3,162,600	
ＳＡＮＫＹＯ	3,100	5,300.00	16,430,000	
日本金銭機械	1,800	1,161.00	2,089,800	
マースグループホールディングス	900	2,413.00	2,171,700	
フクシマガリレイ	1,200	4,305.00	5,166,000	
オーイズミ	600	490.00	294,000	
ダイコク電機	900	2,043.00	1,838,700	
竹内製作所	2,900	2,840.00	8,236,000	
アマノ	4,500	2,333.00	10,498,500	

ＪＵＫＩ	2,500	631.00	1,577,500	
サンデン	2,100	217.00	455,700	
ジャノメ	1,600	605.00	968,000	
マックス	2,000	2,140.00	4,280,000	
グローリー	4,100	2,244.00	9,200,400	
新晃工業	1,600	1,564.00	2,502,400	
大和冷機工業	2,500	1,192.00	2,980,000	
セガサミーホールディングス	12,800	2,046.00	26,188,800	
日本ピストンリング	500	1,258.00	629,000	
リケン	600	2,460.00	1,476,000	
ＴＰＲ	1,800	1,323.00	2,381,400	
ツバキ・ナカシマ	3,900	1,123.00	4,379,700	
ホシザキ	10,300	4,600.00	47,380,000	
大豊工業	1,400	672.00	940,800	
日本精工	29,300	731.00	21,418,300	
ＮＴＮ	31,500	268.00	8,442,000	
ジェイテクト	14,200	963.00	13,674,600	
不二越	1,200	3,865.00	4,638,000	
日本トムソン	3,900	593.00	2,312,700	
ＴＨＫ	9,200	2,725.00	25,070,000	
ユーシン精機	1,300	694.00	902,200	
前澤給装工業	1,100	932.00	1,025,200	
イーグル工業	1,800	1,143.00	2,057,400	
前澤工業	800	617.00	493,600	
日本ピラー工業	1,500	3,165.00	4,747,500	
キッツ	5,900	820.00	4,838,000	
マキタ	19,800	3,275.00	64,845,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	7,300	401.00	2,927,300	
日立造船	13,100	856.00	11,213,600	
三菱重工業	27,900	5,072.00	141,508,800	
ＩＨＩ	10,100	3,910.00	39,491,000	
スター精密	3,000	1,682.00	5,046,000	
日清紡ホールディングス	13,000	958.00	12,454,000	
イビデン	9,100	5,120.00	46,592,000	
コニカミノルタ	35,700	540.00	19,278,000	
ブラザー工業	21,300	1,984.00	42,259,200	
ミネベアミツミ	27,800	2,258.00	62,772,400	
日立製作所	77,600	6,706.00	520,385,600	
東芝	30,700	4,488.00	137,781,600	
三菱電機	164,900	1,424.50	234,900,050	
富士電機	9,700	5,210.00	50,537,000	
東洋電機製造	500	883.00	441,500	

安川電機	18,900	5,050.00	95,445,000	
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,586.00	2,854,800	
明電舎	2,400	1,884.00	4,521,600	
オリジン	300	1,279.00	383,700	
山洋電気	700	5,660.00	3,962,000	
デンヨー	1,200	1,535.00	1,842,000	
ＰＨＣホールディングス	2,200	1,525.00	3,355,000	
ソシオネクスト	1,700	8,570.00	14,569,000	
東芝テック	2,400	3,620.00	8,688,000	
芝浦メカトロニクス	300	11,070.00	3,321,000	
マブチモーター	4,000	3,710.00	14,840,000	
日本電産	38,700	7,162.00	277,169,400	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	509.00	610,800	
トレックス・セミコンダクター	800	2,735.00	2,188,000	
東光高岳	1,000	2,054.00	2,054,000	
ダブル・スコープ	5,200	1,451.00	7,545,200	
ダイヘン	1,500	4,175.00	6,262,500	
ヤーマン	2,800	1,366.00	3,824,800	
ＪＶＣケンウッド	14,500	368.00	5,336,000	
ミマキエンジニアリング	1,500	603.00	904,500	
Ｉ－ＰＥＸ	900	1,151.00	1,035,900	
日新電機	3,800	1,373.00	5,217,400	
大崎電気工業	3,800	531.00	2,017,800	
オムロン	14,600	7,449.00	108,755,400	
日東工業	2,200	2,416.00	5,315,200	
ＩＤＥＣ	2,400	3,040.00	7,296,000	
正興電機製作所	600	956.00	573,600	
不二電機工業	300	1,092.00	327,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,200	2,276.00	11,835,200	
サクサホールディングス	300	1,205.00	361,500	
メルコホールディングス	400	3,355.00	1,342,000	
テクノメディカ	400	1,709.00	683,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,411.00	705,500	
日本電気	22,600	4,840.00	109,384,000	
富士通	15,900	18,505.00	294,229,500	
沖電気工業	7,200	733.00	5,277,600	
岩崎通信機	600	755.00	453,000	
電気興業	700	1,942.00	1,359,400	
サンケン電気	1,500	7,800.00	11,700,000	
ナカヨ	200	1,076.00	215,200	
アイホン	1,000	1,931.00	1,931,000	
ルネサスエレクトロニクス	104,100	1,357.00	141,263,700	

セイコーエプソン	21,300	1,890.00	40,257,000	
ワコム	12,700	686.00	8,712,200	
アルバック	3,800	5,980.00	22,724,000	
アクセル	500	1,588.00	794,000	
ＥＩＺＯ	1,200	3,580.00	4,296,000	
ジャパンディスプレイ	61,300	45.00	2,758,500	
日本信号	3,600	1,029.00	3,704,400	
京三製作所	3,400	406.00	1,380,400	
能美防災	2,200	1,718.00	3,779,600	
ホーチキ	1,200	1,464.00	1,756,800	
星和電機	600	433.00	259,800	
エレコム	3,800	1,343.00	5,103,400	
パナソニック　ホールディングス	188,500	1,192.50	224,786,250	
シャープ	19,200	1,079.00	20,716,800	
アンリツ	11,200	1,234.00	13,820,800	
富士通ゼネラル	4,500	3,640.00	16,380,000	
ソニーグループ	111,800	11,470.00	1,282,346,000	代用有価証券 30,000株
ＴＤＫ	25,300	4,675.00	118,277,500	
帝国通信工業	700	1,462.00	1,023,400	
タムラ製作所	6,900	740.00	5,106,000	
アルプスアルパイン	14,300	1,390.00	19,877,000	
池上通信機	500	604.00	302,000	
日本電波工業	1,900	1,496.00	2,842,400	
鈴木	900	968.00	871,200	
メイコー	1,800	2,939.00	5,290,200	
日本トリム	400	2,880.00	1,152,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	2,933.00	2,639,700	
フォスター電機	1,500	966.00	1,449,000	
ＳＭＫ	400	2,335.00	934,000	
ヨコオ	1,300	2,246.00	2,919,800	
ホシデン	3,800	1,572.00	5,973,600	
ヒロセ電機	2,600	16,980.00	44,148,000	
日本航空電子工業	3,300	2,216.00	7,312,800	
ＴＯＡ	1,800	782.00	1,407,600	
マクセル	3,500	1,483.00	5,190,500	
古野電気	2,100	940.00	1,974,000	
スミダコーポレーション	1,500	1,430.00	2,145,000	
アイコム	600	2,532.00	1,519,200	
リオン	600	1,850.00	1,110,000	
横河電機	17,500	2,268.00	39,690,000	
新電元工業	600	3,400.00	2,040,000	
アズビル	11,000	3,660.00	40,260,000	

東亜ディーケーケー	700	770.00	539,000	
日本光電工業	7,300	3,335.00	24,345,500	
チノー	700	1,893.00	1,325,100	
共和電業	1,300	341.00	443,300	
日本電子材料	1,100	1,437.00	1,580,700	
堀場製作所	3,500	6,010.00	21,035,000	
アドバンテスト	12,500	9,570.00	119,625,000	
小野測器	500	416.00	208,000	
エスペック	1,300	2,022.00	2,628,600	
キーエンス	15,800	59,580.00	941,364,000	
日置電機	800	7,470.00	5,976,000	
シスメックス	13,600	8,560.00	116,416,000	
日本マイクロニクス	2,600	1,395.00	3,627,000	
メガチップス	1,300	2,712.00	3,525,600	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	700	3,695.00	2,586,500	
澤藤電機	200	1,174.00	234,800	
原田工業	600	854.00	512,400	
コーセル	1,900	1,103.00	2,095,700	
イリソ電子工業	1,500	4,335.00	6,502,500	
オプテックスグループ	2,900	2,124.00	6,159,600	
千代田インテグレ	600	2,275.00	1,365,000	
レーザーテック	7,200	22,020.00	158,544,000	
スタンレー電気	11,200	2,780.00	31,136,000	
岩崎電気	500	2,395.00	1,197,500	
ウシオ電機	8,200	1,703.00	13,964,600	
岡谷電機産業	1,100	263.00	289,300	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,300	473.00	614,900	
エノモト	300	1,783.00	534,900	
日本セラミック	1,600	2,435.00	3,896,000	
遠藤照明	600	732.00	439,200	
古河電池	1,200	1,073.00	1,287,600	
双信電機	600	379.00	227,400	
山一電機	1,400	1,832.00	2,564,800	
図研	1,400	3,120.00	4,368,000	
日本電子	4,000	3,765.00	15,060,000	
カシオ計算機	11,800	1,330.00	15,694,000	
ファナック	15,500	22,800.00	353,400,000	
日本シイエムケイ	3,400	512.00	1,740,800	
エンプラス	500	4,045.00	2,022,500	
大真空	1,900	742.00	1,409,800	
ローム	7,300	10,470.00	76,431,000	
浜松ホトニクス	12,700	6,840.00	86,868,000	

三井ハイテック	1,600	6,740.00	10,784,000	
新光電気工業	5,600	3,735.00	20,916,000	
京セラ	24,600	6,709.00	165,041,400	
太陽誘電	7,700	4,380.00	33,726,000	
村田製作所	47,900	7,397.00	354,316,300	
双葉電子工業	3,000	555.00	1,665,000	
北陸電気工業	500	1,280.00	640,000	
ニチコン	3,200	1,275.00	4,080,000	
日本ケミコン	1,600	1,663.00	2,660,800	
ＫＯＡ	2,400	1,859.00	4,461,600	
市光工業	2,300	385.00	885,500	
小糸製作所	19,000	2,160.00	41,040,000	
ミツバ	3,000	523.00	1,569,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,700	10,060.00	27,162,000	
キヤノン電子	1,800	1,700.00	3,060,000	
キヤノン	86,700	2,869.00	248,742,300	
リコー	39,600	1,011.00	40,035,600	
象印マホービン	4,700	1,675.00	7,872,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,597.00	319,400	
東京エレクトロン	11,200	46,130.00	516,656,000	
イノテック	1,100	1,339.00	1,472,900	
トヨタ紡織	6,700	1,917.00	12,843,900	
芦森工業	300	1,428.00	428,400	
ユニプレス	2,800	780.00	2,184,000	
豊田自動織機	11,500	7,870.00	90,505,000	
モリタホールディングス	2,800	1,180.00	3,304,000	
三櫻工業	2,400	648.00	1,555,200	
デンソー	32,600	7,001.00	228,232,600	
東海理化電機製作所	4,500	1,496.00	6,732,000	
川崎重工業	11,900	2,972.00	35,366,800	
名村造船所	3,600	404.00	1,454,400	
日本車輌製造	600	1,970.00	1,182,000	
三菱ロジスネクスト	2,500	722.00	1,805,000	
近畿車輛	200	1,067.00	213,400	
日産自動車	224,500	467.80	105,021,100	
いすゞ自動車	45,900	1,638.00	75,184,200	
トヨタ自動車	867,700	1,903.00	1,651,233,100	
日野自動車	20,400	564.00	11,505,600	
三菱自動車工業	61,600	514.00	31,662,400	
エフテック	1,000	545.00	545,000	
レシップホールディングス	600	467.00	280,200	
ＧＭＢ	300	734.00	220,200	

ファルテック	200	595.00	119,000	
武蔵精密工業	3,900	1,799.00	7,016,100	
日産車体	2,800	890.00	2,492,000	
新明和工業	5,000	1,057.00	5,285,000	
極東開発工業	2,800	1,476.00	4,132,800	
トピー工業	1,300	1,688.00	2,194,400	
ティラド	400	2,722.00	1,088,800	
タチエス	2,500	1,208.00	3,020,000	
ＮＯＫ	6,100	1,231.00	7,509,100	
フタバ産業	4,200	389.00	1,633,800	
ＫＹＢ	1,500	3,665.00	5,497,500	
大同メタル工業	3,100	498.00	1,543,800	
プレス工業	7,100	450.00	3,195,000	
ミクニ	1,600	340.00	544,000	
太平洋工業	3,600	1,069.00	3,848,400	
河西工業	1,900	162.00	307,800	
アイシン	12,200	3,785.00	46,177,000	
マツダ	52,300	1,065.00	55,699,500	
今仙電機製作所	900	693.00	623,700	
本田技研工業	128,400	3,238.00	415,759,200	
スズキ	29,000	4,834.00	140,186,000	
ＳＵＢＡＲＵ	50,000	2,165.00	108,250,000	
安永	600	667.00	400,200	
ヤマハ発動機	24,800	3,215.00	79,732,000	
ＴＢＫ	1,400	250.00	350,000	
エクセディ	2,600	1,747.00	4,542,200	
豊田合成	4,600	2,144.00	9,862,400	
愛三工業	2,600	753.00	1,957,800	
盟和産業	200	940.00	188,000	
日本プラスト	1,100	438.00	481,800	
ヨロズ	1,500	728.00	1,092,000	
エフ・シー・シー	2,800	1,447.00	4,051,600	
シマノ	6,500	22,975.00	149,337,500	
テイ・エス　テック	7,200	1,613.00	11,613,600	
ジャムコ	800	1,544.00	1,235,200	
テルモ	49,400	3,746.00	185,052,400	
クリエートメディック	500	882.00	441,000	
日機装	4,000	1,024.00	4,096,000	
日本エム・ディ・エム	1,000	896.00	896,000	
島津製作所	19,200	3,985.00	76,512,000	
ＪＭＳ	1,500	496.00	744,000	
長野計器	1,200	1,145.00	1,374,000	

ブイ・テクノロジー	800	2,714.00	2,171,200	
東京計器	1,200	1,293.00	1,551,600	
愛知時計電機	600	1,396.00	837,600	
インターアクション	800	1,475.00	1,180,000	
オーバル	1,300	429.00	557,700	
東京精密	3,500	4,470.00	15,645,000	
マニー	7,000	1,858.00	13,006,000	
ニコン	24,600	1,266.00	31,143,600	
トプコン	8,300	1,620.00	13,446,000	
オリンパス	98,800	2,439.00	240,973,200	
理研計器	1,000	4,635.00	4,635,000	
タムロン	1,200	3,140.00	3,768,000	
ＨＯＹＡ	33,700	13,785.00	464,554,500	
シード	700	518.00	362,600	
ノーリツ鋼機	1,500	2,349.00	3,523,500	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	2,300	1,075.00	2,472,500	
朝日インテック	17,700	2,239.00	39,630,300	
シチズン時計	17,400	620.00	10,788,000	
リズム	500	1,655.00	827,500	
大研医器	1,100	460.00	506,000	
メニコン	5,400	2,837.00	15,319,800	
シンシア	100	500.00	50,000	
松風	700	2,322.00	1,625,400	
セイコーグループ	2,500	2,955.00	7,387,500	
ニプロ	13,200	1,031.00	13,609,200	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	2,100	124.00	260,400	
中本パックス	400	1,591.00	636,400	
スノーピーク	2,700	2,173.00	5,867,100	
パラマウントベッドホールディングス	3,600	2,472.00	8,899,200	
トランザクション	1,200	1,577.00	1,892,400	
粧美堂	400	356.00	142,400	
ニホンフラッシュ	1,500	926.00	1,389,000	
前田工繊	1,300	3,305.00	4,296,500	
永大産業	1,500	225.00	337,500	
アートネイチャー	1,600	755.00	1,208,000	
バンダイナムコホールディングス	14,400	8,710.00	125,424,000	
アイフィスジャパン	400	609.00	243,600	
ＳＨＯＥＩ	1,700	5,120.00	8,704,000	
フランスベッドホールディングス	2,000	970.00	1,940,000	
パイロットコーポレーション	2,500	4,595.00	11,487,500	
萩原工業	1,100	1,189.00	1,307,900	
フジシールインターナショナル	3,200	1,667.00	5,334,400	

タカラトミー	7,300	1,265.00	9,234,500	
広済堂ホールディングス	1,000	2,001.00	2,001,000	
エステールホールディングス	300	628.00	188,400	
タカノ	500	681.00	340,500	
プロネクサス	1,300	965.00	1,254,500	
ホクシン	1,100	146.00	160,600	
ウッドワン	500	926.00	463,000	
大建工業	1,000	2,193.00	2,193,000	
凸版印刷	20,700	2,094.00	43,345,800	
大日本印刷	18,800	3,040.00	57,152,000	
共同印刷	500	2,890.00	1,445,000	
ＮＩＳＳＨＡ	3,000	1,920.00	5,760,000	
光村印刷	100	1,181.00	118,100	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	1,000	2,133.00	2,133,000	
アシックス	14,600	3,205.00	46,793,000	
ツツミ	300	1,926.00	577,800	
ローランド	1,200	3,795.00	4,554,000	
小松ウオール工業	600	1,916.00	1,149,600	
ヤマハ	10,000	4,975.00	49,750,000	
河合楽器製作所	400	2,600.00	1,040,000	
クリナップ	1,800	647.00	1,164,600	
ピジョン	10,100	2,045.00	20,654,500	
兼松サステック	100	2,247.00	224,700	
キングジム	1,400	893.00	1,250,200	
リンテック	3,200	2,226.00	7,123,200	
イトーキ	3,200	709.00	2,268,800	
任天堂	99,800	5,580.00	556,884,000	
三菱鉛筆	2,300	1,439.00	3,309,700	
タカラスタンダード	3,100	1,373.00	4,256,300	
コクヨ	7,600	1,841.00	13,991,600	
ナカバヤシ	1,700	488.00	829,600	
グローブライド	1,300	2,664.00	3,463,200	
オカムラ	4,800	1,394.00	6,691,200	
美津濃	1,600	2,947.00	4,715,200	
東京電力ホールディングス	142,400	478.00	68,067,200	
中部電力	58,200	1,387.00	80,723,400	
関西電力	61,000	1,218.00	74,298,000	
中国電力	25,200	677.00	17,060,400	
北陸電力	14,900	522.00	7,777,800	
東北電力	38,600	646.00	24,935,600	
四国電力	13,500	722.00	9,747,000	
九州電力	36,400	708.00	25,771,200	

北海道電力	15,300	473.00	7,236,900	
沖縄電力	3,700	1,052.00	3,892,400	
電源開発	11,900	2,106.00	25,061,400	
エフオン	1,000	509.00	509,000	
イーレックス	2,800	2,445.00	6,846,000	
レノバ	4,200	2,242.00	9,416,400	
東京瓦斯	33,400	2,868.00	95,791,200	
大阪瓦斯	32,000	2,095.00	67,040,000	
東邦瓦斯	6,200	2,482.00	15,388,400	
北海道瓦斯	1,000	1,775.00	1,775,000	
広島ガス	3,400	343.00	1,166,200	
西部ガスホールディングス	1,500	1,772.00	2,658,000	
静岡ガス	3,600	1,119.00	4,028,400	
メタウォーター	2,000	1,648.00	3,296,000	
ＳＢＳホールディングス	1,400	2,944.00	4,121,600	
東武鉄道	17,300	3,025.00	52,332,500	
相鉄ホールディングス	5,200	2,187.00	11,372,400	
東急	44,300	1,631.00	72,253,300	
京浜急行電鉄	17,900	1,315.00	23,538,500	
小田急電鉄	24,000	1,662.00	39,888,000	
京王電鉄	8,400	4,650.00	39,060,000	
京成電鉄	10,200	3,710.00	37,842,000	
富士急行	2,000	4,530.00	9,060,000	
東日本旅客鉄道	26,800	7,020.00	188,136,000	
西日本旅客鉄道	20,200	5,256.00	106,171,200	
東海旅客鉄道	12,200	15,520.00	189,344,000	
西武ホールディングス	19,100	1,453.00	27,752,300	
鴻池運輸	2,700	1,559.00	4,209,300	
西日本鉄道	4,200	2,365.00	9,933,000	
ハマキョウレックス	1,200	3,235.00	3,882,000	
サカイ引越センター	800	4,375.00	3,500,000	
近鉄グループホールディングス	15,800	4,160.00	65,728,000	
阪急阪神ホールディングス	21,000	3,820.00	80,220,000	
南海電気鉄道	7,500	2,751.00	20,632,500	
京阪ホールディングス	6,500	3,415.00	22,197,500	
神戸電鉄	400	3,190.00	1,276,000	
名古屋鉄道	17,400	2,117.00	36,835,800	
山陽電気鉄道	1,200	2,169.00	2,602,800	
アルプス物流	1,300	1,325.00	1,722,500	
ヤマトホールディングス	20,200	2,248.00	45,409,600	
山九	4,000	5,130.00	20,520,000	
丸運	700	221.00	154,700	

丸全昭和運輸	1,000	3,145.00	3,145,000	
センコーグループホールディングス	8,400	1,000.00	8,400,000	
トナミホールディングス	400	3,730.00	1,492,000	
ニッコンホールディングス	5,100	2,478.00	12,637,800	
日本石油輸送	200	2,276.00	455,200	
福山通運	1,200	3,335.00	4,002,000	
セイノーホールディングス	9,800	1,282.00	12,563,600	
エスライン	400	819.00	327,600	
神奈川中央交通	500	3,290.00	1,645,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	3,800	1,666.00	6,330,800	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,500	1,251.00	1,876,500	
九州旅客鉄道	11,100	2,890.00	32,079,000	
ＳＧホールディングス	30,300	1,993.00	60,387,900	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	5,900	7,450.00	43,955,000	
日本郵船	42,200	3,175.00	133,985,000	
商船三井	27,800	3,290.00	91,462,000	
川崎汽船	13,400	2,813.00	37,694,200	
ＮＳユナイテッド海運	900	4,065.00	3,658,500	
飯野海運	5,800	946.00	5,486,800	
乾汽船	2,000	2,000.00	4,000,000	
日本航空	38,700	2,744.00	106,192,800	
ＡＮＡホールディングス	42,900	2,873.50	123,273,150	
パスコ	300	1,383.00	414,900	
トランコム	500	7,440.00	3,720,000	
日新	1,200	2,236.00	2,683,200	
三菱倉庫	3,400	3,070.00	10,438,000	
三井倉庫ホールディングス	1,500	3,705.00	5,557,500	
住友倉庫	4,300	1,991.00	8,561,300	
澁澤倉庫	600	2,091.00	1,254,600	
東陽倉庫	1,900	279.00	530,100	
日本トランスシティ	3,200	528.00	1,689,600	
ケイヒン	300	1,520.00	456,000	
中央倉庫	800	967.00	773,600	
川西倉庫	300	993.00	297,900	
安田倉庫	1,100	953.00	1,048,300	
ファイズホールディングス	300	1,090.00	327,000	
東洋埠頭	400	1,320.00	528,000	
上組	7,600	2,651.00	20,147,600	
サンリツ	300	740.00	222,000	
キムラユニティー	700	944.00	660,800	
キユーソー流通システム	900	949.00	854,100	
東海運	800	282.00	225,600	

エーアイテイー	1,000	1,494.00	1,494,000	
内外トランスライン	600	2,180.00	1,308,000	
日本コンセプト	500	1,547.00	773,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	5,300	1,658.00	8,787,400	
クロスキャット	900	1,437.00	1,293,300	
システナ	26,700	414.00	11,053,800	
デジタルアーツ	1,000	5,460.00	5,460,000	
日鉄ソリューションズ	2,700	3,305.00	8,923,500	
キューブシステム	1,000	1,083.00	1,083,000	
コア	700	1,527.00	1,068,900	
手間いらず	300	5,000.00	1,500,000	
ラクーンホールディングス	1,300	1,188.00	1,544,400	
ソリトンシステムズ	800	1,155.00	924,000	
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,250.00	2,275,000	
ＴＩＳ	17,800	3,730.00	66,394,000	
ＪＮＳホールディングス	700	316.00	221,200	
グリー	4,300	695.00	2,988,500	
GMOペパボ	200	1,885.00	377,000	
コーエーテクモホールディングス	9,900	2,344.00	23,205,600	
三菱総合研究所	800	4,935.00	3,948,000	
ボルテージ	400	313.00	125,200	
電算	200	1,598.00	319,600	
ＡＧＳ	600	700.00	420,000	
ファインデックス	1,300	523.00	679,900	
ブレインパッド	1,200	733.00	879,600	
ＫＬａｂ	3,200	413.00	1,321,600	
ポールトゥウィンホールディングス	2,700	878.00	2,370,600	
ネクソン	41,000	3,120.00	127,920,000	
アイスタイル	4,600	507.00	2,332,200	
エムアップホールディングス	2,000	1,209.00	2,418,000	
エイチーム	1,200	787.00	944,400	
エニグモ	2,000	620.00	1,240,000	
テクノスジャパン	1,200	564.00	676,800	
コロプラ	6,200	654.00	4,054,800	
ブロードリーフ	9,300	457.00	4,250,100	
クロス・マーケティンググループ	900	764.00	687,600	
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,856.00	1,856,000	
システム情報	1,400	841.00	1,177,400	
メディアドゥ	700	1,692.00	1,184,400	
じげん	4,600	383.00	1,761,800	
ブイキューブ	1,900	733.00	1,392,700	
エンカレッジ・テクノロジ	300	492.00	147,600	

サイバーリンクス	500	985.00	492,500	
フィックスターズ	1,800	1,325.00	2,385,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	800	1,675.00	1,340,000	
オプティム	1,300	1,152.00	1,497,600	
セレス	700	1,046.00	732,200	
ＳＨＩＦＴ	1,100	23,750.00	26,125,000	
ティーガイア	1,700	1,644.00	2,794,800	
セック	200	3,320.00	664,000	
テクマトリックス	2,900	1,634.00	4,738,600	
プロシップ	700	1,470.00	1,029,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,900	2,142.00	10,495,800	
GMOペイメントゲートウェイ	3,600	12,140.00	43,704,000	
ザッパラス	400	358.00	143,200	
システムリサーチ	500	2,329.00	1,164,500	
インターネットイニシアティブ	8,900	2,388.00	21,253,200	
さくらインターネット	1,800	551.00	991,800	
ヴィンクス	400	1,479.00	591,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	4,275.00	2,137,500	
ＳＲＡホールディングス	800	3,080.00	2,464,000	
システムインテグレータ	400	419.00	167,600	
朝日ネット	1,700	591.00	1,004,700	
ｅＢＡＳＥ	2,200	592.00	1,302,400	
アバントグループ	2,000	1,413.00	2,826,000	
アドソル日進	700	1,374.00	961,800	
ＯＤＫソリューションズ	300	595.00	178,500	
フリービット	800	1,098.00	878,400	
コムチュア	2,100	2,299.00	4,827,900	
サイバーコム	200	1,427.00	285,400	
アステリア	1,300	771.00	1,002,300	
アイル	900	1,926.00	1,733,400	
マークラインズ	900	2,691.00	2,421,900	
メディカル・データ・ビジョン	2,400	993.00	2,383,200	
ｇｕｍｉ	2,500	840.00	2,100,000	
ショーケース	300	310.00	93,000	
モバイルファクトリー	300	960.00	288,000	
テラスカイ	700	2,009.00	1,406,300	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,830.00	1,647,000	
ＰＣＩホールディングス	600	1,037.00	622,200	
アイビーシー	200	391.00	78,200	
ネオジャパン	500	973.00	486,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	400	1,819.00	727,600	
ラクス	7,500	1,768.00	13,260,000	

ランドコンピュータ	400	971.00	388,400	
ダブルスタンダード	700	2,207.00	1,544,900	
オープンドア	1,100	1,837.00	2,020,700	
マイネット	500	377.00	188,500	
アカツキ	800	2,304.00	1,843,200	
ベネフィットジャパン	100	1,244.00	124,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	500	2,205.00	1,102,500	
カナミックネットワーク	2,300	571.00	1,313,300	
ノムラシステムコーポレーション	1,300	115.00	149,500	
チェンジ	3,900	2,326.00	9,071,400	
シンクロ・フード	900	462.00	415,800	
オークネット	800	1,870.00	1,496,000	
キャピタル・アセット・プランニング	300	599.00	179,700	
セグエグループ	400	865.00	346,000	
エイトレッド	200	1,474.00	294,800	
マクロミル	3,100	1,112.00	3,447,200	
ビーグリー	300	1,154.00	346,200	
オロ	500	1,957.00	978,500	
ユーザーローカル	600	1,323.00	793,800	
テモナ	300	276.00	82,800	
ニーズウェル	500	810.00	405,000	
マネーフォワード	3,800	4,855.00	18,449,000	
サインポスト	600	607.00	364,200	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	900	1,451.00	1,305,900	
電算システムホールディングス	800	2,148.00	1,718,400	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	4,500	1,745.00	7,852,500	
ソルクシーズ	1,200	355.00	426,000	
フェイス	400	501.00	200,400	
プロトコーポレーション	2,000	1,232.00	2,464,000	
ハイマックス	500	1,437.00	718,500	
野村総合研究所	32,500	3,090.00	100,425,000	
サイバネットシステム	1,300	995.00	1,293,500	
ＣＥホールディングス	700	514.00	359,800	
日本システム技術	600	1,768.00	1,060,800	
インテージホールディングス	1,800	1,547.00	2,784,600	
東邦システムサイエンス	400	1,014.00	405,600	
ソースネクスト	8,100	288.00	2,332,800	
インフォコム	2,100	2,177.00	4,571,700	
シンプレクス・ホールディングス	2,700	2,361.00	6,374,700	
ＨＥＲＯＺ	600	1,133.00	679,800	
ラクスル	4,400	1,466.00	6,450,400	
メルカリ	7,100	2,909.00	20,653,900	

ＩＰＳ	500	2,815.00	1,407,500	
ＦＩＧ	1,600	378.00	604,800	
システムサポート	600	1,606.00	963,600	
イーソル	1,000	797.00	797,000	
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,245.00	1,867,500	
東海ソフト	200	941.00	188,200	
ウイングアーク１ｓｔ	1,600	1,988.00	3,180,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,628.00	651,200	
サーバーワークス	300	2,440.00	732,000	
東名	100	2,142.00	214,200	
ヴィッツ	200	935.00	187,000	
トビラシステムズ	400	824.00	329,600	
Ｓａｎｓａｎ	5,200	1,641.00	8,533,200	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	300	964.00	289,200	
ギフティ	1,700	2,239.00	3,806,300	
メドレー	1,600	4,610.00	7,376,000	
ベース	500	4,515.00	2,257,500	
ＪＭＤＣ	2,600	4,290.00	11,154,000	
フォーカスシステムズ	1,200	1,066.00	1,279,200	
クレスコ	1,200	1,842.00	2,210,400	
フジ・メディア・ホールディングス	15,200	1,081.00	16,431,200	
オービック	5,300	20,580.00	109,074,000	
ジャストシステム	2,300	3,205.00	7,371,500	
ＴＤＣソフト	1,300	1,592.00	2,069,600	
Ｚホールディングス	225,500	369.30	83,277,150	
トレンドマイクロ	9,200	6,260.00	57,592,000	
ＩＤホールディングス	1,100	988.00	1,086,800	
日本オラクル	3,000	8,900.00	26,700,000	
アルファシステムズ	500	4,100.00	2,050,000	
フューチャー	4,000	1,663.00	6,652,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,000	1,451.00	1,451,000	
ＳＢテクノロジー	700	1,953.00	1,367,100	
トーセ	400	737.00	294,800	
オービックビジネスコンサルタント	3,100	4,985.00	15,453,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	8,500	3,120.00	26,520,000	
アイティフォー	2,100	866.00	1,818,600	
東計電算	200	5,350.00	1,070,000	
エックスネット	200	1,002.00	200,400	
大塚商会	9,000	4,310.00	38,790,000	
サイボウズ	2,200	2,717.00	5,977,400	
電通国際情報サービス	1,900	4,240.00	8,056,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,900	975.00	1,852,500	

デジタルガレージ	2,800	4,575.00	12,810,000	
EMシステムズ	2,700	912.00	2,462,400	
ウェザーニューズ	500	7,000.00	3,500,000	
ＣＩＪ	1,300	1,022.00	1,328,600	
ビジネスエンジニアリング	300	2,509.00	752,700	
日本エンタープライズ	1,500	133.00	199,500	
WOWOW	900	1,251.00	1,125,900	
スカラ	1,500	729.00	1,093,500	
インテリジェント　ウェイブ	800	785.00	628,000	
WOW　WORLD　GROUP	300	1,390.00	417,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　GROUP	1,300	666.00	865,800	
ネットワンシステムズ	5,900	3,485.00	20,561,500	
システムソフト	5,500	92.00	506,000	
アルゴグラフィックス	1,500	3,935.00	5,902,500	
マーベラス	2,600	688.00	1,788,800	
エイベックス	2,700	1,762.00	4,757,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	5,800	3,300.00	19,140,000	
兼松エレクトロニクス	1,000	6,180.00	6,180,000	
都築電気	900	1,322.00	1,189,800	
ＴＢＳホールディングス	8,100	1,522.00	12,328,200	
日本テレビホールディングス	14,000	1,044.00	14,616,000	
朝日放送グループホールディングス	1,500	646.00	969,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,333.00	5,198,700	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	14,100	494.00	6,965,400	
テレビ東京ホールディングス	1,200	1,965.00	2,358,000	
日本ＢＳ放送	500	905.00	452,500	
ビジョン	2,100	1,415.00	2,971,500	
スマートバリュー	400	417.00	166,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,400	2,251.00	3,151,400	
コネクシオ	1,100	1,910.00	2,101,000	
日本通信	14,600	221.00	3,226,600	
クロップス	200	1,034.00	206,800	
日本電信電話	203,100	3,886.00	789,246,600	
ＫＤＤＩ	122,500	4,038.00	494,655,000	
ソフトバンク	254,600	1,485.50	378,208,300	
光通信	1,900	18,520.00	35,188,000	
エムティーアイ	1,500	507.00	760,500	
GMOインターネットグループ	5,900	2,579.00	15,216,100	
ファイバーゲート	900	920.00	828,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	300	280.00	84,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	8,400	2,398.00	20,143,200	
学研ホールディングス	2,600	972.00	2,527,200	

ゼンリン	2,700	835.00	2,254,500	
昭文社ホールディングス	600	292.00	175,200	
インプレスホールディングス	1,300	207.00	269,100	
アイネット	1,000	1,281.00	1,281,000	
松竹	900	10,920.00	9,828,000	
東宝	9,900	4,765.00	47,173,500	
東映	400	16,950.00	6,780,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	49,700	1,991.00	98,952,700	
ピー・シー・エー	900	1,219.00	1,097,100	
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,006.00	1,404,200	
ＤＴＳ	3,400	3,155.00	10,727,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	6,060.00	48,480,000	
シーイーシー	2,200	1,536.00	3,379,200	
カプコン	15,700	4,160.00	65,312,000	
アイ・エス・ビー	800	1,207.00	965,600	
ジャステック	1,000	1,218.00	1,218,000	
ＳＣＳＫ	12,900	1,963.00	25,322,700	
ＮＳＷ	600	2,084.00	1,250,400	
アイネス	1,100	1,338.00	1,471,800	
ＴＫＣ	2,800	3,670.00	10,276,000	
富士ソフト	1,800	7,540.00	13,572,000	
ＮＳＤ	5,700	2,233.00	12,728,100	
コナミグループ	6,800	6,310.00	42,908,000	
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,979.00	3,276,900	
ＪＢＣＣホールディングス	1,200	1,996.00	2,395,200	
ミロク情報サービス	1,400	1,645.00	2,303,000	
ソフトバンクグループ	91,600	6,254.00	572,866,400	
高千穂交易	500	2,339.00	1,169,500	
オルバヘルスケアホールディングス	200	1,597.00	319,400	
伊藤忠食品	400	4,965.00	1,986,000	
エレマテック	1,500	1,672.00	2,508,000	
あらた	1,300	4,175.00	5,427,500	
トーメンデバイス	300	6,080.00	1,824,000	
東京エレクトロン　デバイス	600	7,610.00	4,566,000	
円谷フィールズホールディングス	1,400	2,680.00	3,752,000	
双日	17,800	2,586.00	46,030,800	
アルフレッサ　ホールディングス	16,800	1,605.00	26,964,000	
横浜冷凍	4,600	1,082.00	4,977,200	
神栄	200	869.00	173,800	
ラサ商事	700	1,219.00	853,300	
アルコニックス	2,200	1,397.00	3,073,400	
神戸物産	12,900	3,780.00	48,762,000	

ハイパー	300	449.00	134,700	
あい　ホールディングス	2,700	2,161.00	5,834,700	
ディーブイエックス	400	1,036.00	414,400	
ダイワボウホールディングス	6,800	1,941.00	13,198,800	
マクニカホールディングス	4,100	3,470.00	14,227,000	
ラクト・ジャパン	700	2,039.00	1,427,300	
グリムス	700	2,513.00	1,759,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	838.00	2,095,000	
八洲電機	1,400	1,099.00	1,538,600	
メディアスホールディングス	1,100	735.00	808,500	
レスターホールディングス	1,600	2,233.00	3,572,800	
ジューテックホールディングス	400	1,231.00	492,400	
大光	600	656.00	393,600	
ＯＣＨＩホールディングス	400	1,328.00	531,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	8,300	860.00	7,138,000	
黒谷	400	620.00	248,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	815.00	244,500	
三洋貿易	1,700	1,152.00	1,958,400	
ビューティガレージ	300	3,555.00	1,066,500	
ウイン・パートナーズ	1,200	1,001.00	1,201,200	
ミタチ産業	400	1,182.00	472,800	
シップヘルスケアホールディングス	6,000	2,494.00	14,964,000	
明治電機工業	600	1,113.00	667,800	
デリカフーズホールディングス	600	511.00	306,600	
スターティアホールディングス	300	1,017.00	305,100	
コメダホールディングス	4,100	2,391.00	9,803,100	
ピーバンドットコム	200	525.00	105,000	
アセンテック	600	496.00	297,600	
富士興産	300	1,257.00	377,100	
協栄産業	200	1,723.00	344,600	
フルサト・マルカホールディングス	1,700	3,490.00	5,933,000	
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,434.00	1,434,000	
小野建	1,500	1,544.00	2,316,000	
南陽	300	2,008.00	602,400	
佐鳥電機	900	1,417.00	1,275,300	
エコートレーディング	300	729.00	218,700	
伯東	1,000	4,680.00	4,680,000	
コンドーテック	1,300	1,015.00	1,319,500	
中山福	800	330.00	264,000	
ナガイレーベン	2,100	1,948.00	4,090,800	
三菱食品	1,600	3,110.00	4,976,000	
松田産業	1,300	2,402.00	3,122,600	

第一興商	3,200	3,970.00	12,704,000	
メディパルホールディングス	17,300	1,714.00	29,652,200	
ＳＰＫ	800	1,511.00	1,208,800	
萩原電気ホールディングス	600	2,585.00	1,551,000	
アズワン	2,400	5,870.00	14,088,000	
スズデン	600	2,390.00	1,434,000	
シモジマ	1,200	956.00	1,147,200	
ドウシシャ	1,800	1,834.00	3,301,200	
小津産業	300	1,595.00	478,500	
高速	900	1,912.00	1,720,800	
たけびし	700	1,586.00	1,110,200	
リックス	300	2,279.00	683,700	
丸文	1,500	1,247.00	1,870,500	
ハピネット	1,400	2,059.00	2,882,600	
橋本総業ホールディングス	700	1,079.00	755,300	
日本ライフライン	4,900	941.00	4,610,900	
タカショー	1,500	706.00	1,059,000	
ＩＤＯＭ	5,100	837.00	4,268,700	
進和	1,100	2,090.00	2,299,000	
エスケイジャパン	400	565.00	226,000	
ダイトロン	700	2,465.00	1,725,500	
シークス	2,400	1,421.00	3,410,400	
田中商事	400	576.00	230,400	
オーハシテクニカ	900	1,494.00	1,344,600	
白銅	600	2,582.00	1,549,200	
ダイコー通産	200	1,062.00	212,400	
伊藤忠商事	103,000	4,176.00	430,128,000	
丸紅	132,000	1,603.00	211,596,000	
高島	300	2,911.00	873,300	
長瀬産業	7,900	2,073.00	16,376,700	
蝶理	900	2,337.00	2,103,300	
豊田通商	14,600	5,520.00	80,592,000	
三共生興	2,400	481.00	1,154,400	
兼松	6,500	1,567.00	10,185,500	
ツカモトコーポレーション	200	1,405.00	281,000	
三井物産	122,300	3,864.00	472,567,200	
日本紙パルプ商事	900	5,460.00	4,914,000	
カメイ	1,800	1,452.00	2,613,600	
東都水産	100	5,000.00	500,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,412.00	482,400	
スターゼン	1,300	2,140.00	2,782,000	
山善	4,500	1,058.00	4,761,000	

椿本興業	300	4,145.00	1,243,500	
住友商事	103,500	2,328.00	240,948,000	
内田洋行	700	4,625.00	3,237,500	
三菱商事	104,500	4,363.00	455,933,500	
第一実業	600	4,720.00	2,832,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,900	3,085.00	12,031,500	
西華産業	700	1,611.00	1,127,700	
佐藤商事	1,200	1,326.00	1,591,200	
菱洋エレクトロ	1,400	2,330.00	3,262,000	
東京産業	1,500	770.00	1,155,000	
ユアサ商事	1,500	3,630.00	5,445,000	
神鋼商事	400	5,890.00	2,356,000	
トルク	800	211.00	168,800	
阪和興業	3,000	4,175.00	12,525,000	
正栄食品工業	1,100	4,130.00	4,543,000	
カナデン	1,400	1,121.00	1,569,400	
菱電商事	1,400	1,784.00	2,497,600	
岩谷産業	3,800	5,580.00	21,204,000	
ナイス	400	1,323.00	529,200	
ニチモウ	200	3,190.00	638,000	
極東貿易	1,000	1,403.00	1,403,000	
アステナホールディングス	2,900	417.00	1,209,300	
三愛オブリ	4,600	1,341.00	6,168,600	
稲畑産業	3,400	2,503.00	8,510,200	
ＧＳＩクレオス	1,000	1,538.00	1,538,000	
明和産業	2,200	697.00	1,533,400	
クワザワホールディングス	500	441.00	220,500	
ワキタ	3,100	1,203.00	3,729,300	
東邦ホールディングス	4,200	2,095.00	8,799,000	
サンゲツ	4,200	2,249.00	9,445,800	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,161.00	2,554,200	
シナネンホールディングス	500	3,640.00	1,820,000	
伊藤忠エネクス	4,200	1,084.00	4,552,800	
サンリオ	4,700	4,925.00	23,147,500	
サンワテクノス	900	1,895.00	1,705,500	
リョーサン	1,800	2,923.00	5,261,400	
新光商事	2,300	1,338.00	3,077,400	
トーホー	700	1,596.00	1,117,200	
三信電気	700	2,565.00	1,795,500	
東陽テクニカ	1,900	1,350.00	2,565,000	
モスフードサービス	2,500	3,060.00	7,650,000	
加賀電子	1,400	4,350.00	6,090,000	

ソーダニッカ	1,100	752.00	827,200	
立花エレテック	1,200	1,833.00	2,199,600	
フォーバル	700	1,110.00	777,000	
ＰＡＬＴＡＣ	2,600	4,980.00	12,948,000	
三谷産業	2,900	317.00	919,300	
太平洋興発	500	912.00	456,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	400	3,515.00	1,406,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,652.00	165,200	
コーア商事ホールディングス	1,000	649.00	649,000	
ＫＰＰグループホールディングス	3,900	912.00	3,556,800	
ヤマタネ	800	1,678.00	1,342,400	
丸紅建材リース	100	1,791.00	179,100	
日鉄物産	1,100	9,240.00	10,164,000	
泉州電業	800	3,470.00	2,776,000	
トラスコ中山	3,500	2,098.00	7,343,000	
オートバックスセブン	5,800	1,430.00	8,294,000	
モリト	1,200	950.00	1,140,000	
加藤産業	2,000	3,575.00	7,150,000	
北恵	400	689.00	275,600	
イエローハット	3,000	1,738.00	5,214,000	
ＪＫホールディングス	1,300	1,059.00	1,376,700	
日伝	1,000	1,811.00	1,811,000	
北沢産業	800	222.00	177,600	
杉本商事	800	1,981.00	1,584,800	
因幡電機産業	4,300	2,772.00	11,919,600	
東テク	600	3,920.00	2,352,000	
ミスミグループ本社	25,200	3,295.00	83,034,000	
アルテック	800	270.00	216,000	
タキヒヨー	400	917.00	366,800	
蔵王産業	300	1,891.00	567,300	
スズケン	5,200	3,400.00	17,680,000	
ジェコス	1,100	856.00	941,600	
グローセル	1,800	400.00	720,000	
ローソン	4,200	5,170.00	21,714,000	
サンエー	1,300	4,140.00	5,382,000	
カワチ薬品	1,300	2,232.00	2,901,600	
エービーシー・マート	2,400	7,000.00	16,800,000	
ハードオフコーポレーション	600	1,301.00	780,600	
アスクル	3,500	1,691.00	5,918,500	
ゲオホールディングス	1,700	1,869.00	3,177,300	
アダストリア	2,000	2,153.00	4,306,000	
ジーフット	800	300.00	240,000	

シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	408.00	81,600	
くら寿司	2,000	3,010.00	6,020,000	
キャンドゥ	600	2,280.00	1,368,000	
ＩＫホールディングス	500	374.00	187,000	
パルグループホールディングス	1,700	2,812.00	4,780,400	
エディオン	6,600	1,269.00	8,375,400	
サーラコーポレーション	3,500	746.00	2,611,000	
ワッツ	700	694.00	485,800	
ハローズ	800	3,130.00	2,504,000	
フジオフードグループ本社	1,400	1,406.00	1,968,400	
あみやき亭	400	2,931.00	1,172,400	
大黒天物産	500	5,560.00	2,780,000	
ハニーズホールディングス	1,300	1,490.00	1,937,000	
ファーマライズホールディングス	300	618.00	185,400	
アルペン	1,400	1,955.00	2,737,000	
ハブ	500	670.00	335,000	
クオールホールディングス	2,300	1,190.00	2,737,000	
ジンズホールディングス	1,000	3,870.00	3,870,000	
ビックカメラ	11,100	1,211.00	13,442,100	
ＤＣＭホールディングス	10,200	1,174.00	11,974,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	23,700	1,984.00	47,020,800	
東京一番フーズ	400	489.00	195,600	
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,152.00	3,012,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	20,800	1,207.00	25,105,600	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	1,860.00	5,580,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	10,100	6,460.00	65,246,000	
ブロンコビリー	900	2,455.00	2,209,500	
ＺＯＺＯ	11,100	3,205.00	35,575,500	
トレジャー・ファクトリー	500	2,327.00	1,163,500	
物語コーポレーション	900	6,490.00	5,841,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,200	1,394.00	39,310,800	
Ｈａｍｅｅ	600	764.00	458,400	
マーケットエンタープライズ	200	1,026.00	205,200	
ウエルシアホールディングス	8,700	2,911.00	25,325,700	
クリエイトＳＤホールディングス	2,800	3,540.00	9,912,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,800	344.00	619,200	
ミサワ	300	629.00	188,700	
ティーライフ	200	1,265.00	253,000	
シュッピン	1,300	1,080.00	1,404,000	
オイシックス・ラ・大地	2,200	2,193.00	4,824,600	
ネクステージ	3,800	3,020.00	11,476,000	
ジョイフル本田	5,000	1,861.00	9,305,000	

鳥貴族ホールディングス	600	2,049.00	1,229,400	
ホットランド	1,300	1,410.00	1,833,000	
すかいらーくホールディングス	22,800	1,535.00	34,998,000	
ＳＦＰホールディングス	900	1,797.00	1,617,300	
綿半ホールディングス	1,300	1,401.00	1,821,300	
ヨシックスホールディングス	300	2,191.00	657,300	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	1,129.00	6,209,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,167.00	933,600	
ＢＥＥＮＯＳ	1,000	2,126.00	2,126,000	
あさひ	1,400	1,373.00	1,922,200	
日本調剤	1,100	1,187.00	1,305,700	
コスモス薬品	1,700	12,750.00	21,675,000	
トーエル	700	762.00	533,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	57,600	6,090.00	350,784,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,600	996.00	12,549,600	
ツルハホールディングス	3,500	9,710.00	33,985,000	
サンマルクホールディングス	1,400	1,746.00	2,444,400	
フェリシモ	400	1,001.00	400,400	
トリドールホールディングス	4,200	2,798.00	11,751,600	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,700	413.00	702,100	
ウイルプラスホールディングス	300	1,120.00	336,000	
ＪＭホールディングス	1,400	1,832.00	2,564,800	
サツドラホールディングス	700	796.00	557,200	
アレンザホールディングス	1,300	1,037.00	1,348,100	
串カツ田中ホールディングス	500	1,645.00	822,500	
バロックジャパンリミテッド	1,100	850.00	935,000	
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,450.00	11,175,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	9,600	2,928.00	28,108,800	
メディカルシステムネットワーク	1,500	402.00	603,000	
ジャパンクラフトホールディングス	500	589.00	294,500	
はるやまホールディングス	600	432.00	259,200	
ノジマ	5,500	1,321.00	7,265,500	
カッパ・クリエイト	2,600	1,407.00	3,658,200	
ライトオン	1,100	581.00	639,100	
良品計画	21,600	1,413.00	30,520,800	
パリミキホールディングス	1,900	273.00	518,700	
アドヴァングループ	1,600	884.00	1,414,400	
アルビス	600	2,427.00	1,456,200	
コナカ	1,600	342.00	547,200	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,641.00	328,200	
Ｇ－７ホールディングス	2,100	1,505.00	3,160,500	

イオン北海道	2,500	916.00	2,290,000	
コジマ	3,200	564.00	1,804,800	
ヒマラヤ	500	932.00	466,000	
コーナン商事	2,200	3,305.00	7,271,000	
エコス	600	1,886.00	1,131,600	
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	33,700	2,404.00	81,014,800	
西松屋チェーン	3,700	1,544.00	5,712,800	
ゼンショーホールディングス	9,200	3,305.00	30,406,000	
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,083.00	1,191,300	
ハークスレイ	500	815.00	407,500	
サイゼリヤ	2,800	3,175.00	8,890,000	
ＶＴホールディングス	6,400	500.00	3,200,000	
魚力	500	2,160.00	1,080,000	
フジ・コーポレーション	1,000	1,332.00	1,332,000	
ユナイテッドアローズ	1,800	1,746.00	3,142,800	
ハイデイ日高	2,500	2,067.00	5,167,500	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	900	200.00	180,000	
コロワイド	7,700	1,837.00	14,144,900	
ピーシーデポコーポレーション	1,900	291.00	552,900	
壱番屋	1,300	4,680.00	6,084,000	
ＰＬＡＮＴ	400	675.00	270,000	
スギホールディングス	3,400	5,740.00	19,516,000	
薬王堂ホールディングス	900	2,582.00	2,323,800	
スクロール	2,500	782.00	1,955,000	
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,796.00	2,514,400	
木曽路	2,500	2,123.00	5,307,500	
ＳＲＳホールディングス	2,800	889.00	2,489,200	
千趣会	3,100	398.00	1,233,800	
リテールパートナーズ	2,500	1,350.00	3,375,000	
ケーヨー	2,700	887.00	2,394,900	
上新電機	1,500	1,959.00	2,938,500	
日本瓦斯	9,000	1,955.00	17,595,000	
ロイヤルホールディングス	3,300	2,427.00	8,009,100	
東天紅	100	753.00	75,300	
いなげや	1,600	1,275.00	2,040,000	
チヨダ	1,600	790.00	1,264,000	
ライフコーポレーション	1,500	2,823.00	4,234,500	
リンガーハット	2,200	2,245.00	4,939,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,400	671.00	1,610,400	
ＡＯＫＩホールディングス	3,100	684.00	2,120,400	
オークワ	2,700	925.00	2,497,500	

コメリ	2,600	2,596.00	6,749,600	
青山商事	3,600	920.00	3,312,000	
しまむら	2,000	12,360.00	24,720,000	
はせがわ	700	351.00	245,700	
高島屋	12,600	1,802.00	22,705,200	
松屋	2,800	1,123.00	3,144,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8,100	1,256.00	10,173,600	
近鉄百貨店	500	2,528.00	1,264,000	
丸井グループ	12,300	2,171.00	26,703,300	
アクシアル　リテイリング	1,100	3,500.00	3,850,000	
イオン	56,700	2,648.50	150,169,950	
イズミ	2,600	2,913.00	7,573,800	
平和堂	2,800	2,146.00	6,008,800	
フジ	2,600	1,849.00	4,807,400	
ヤオコー	1,900	6,700.00	12,730,000	
ゼビオホールディングス	2,300	927.00	2,132,100	
ケーズホールディングス	13,300	1,129.00	15,015,700	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	600	516.00	309,600	
日産東京販売ホールディングス	1,900	315.00	598,500	
シルバーライフ	400	1,661.00	664,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	700	4,310.00	3,017,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	915.00	274,500	
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,297.00	1,297,000	
ギフトホールディングス	400	4,205.00	1,682,000	
アインホールディングス	2,300	5,520.00	12,696,000	
元気寿司	500	2,950.00	1,475,000	
ヤマダホールディングス	68,500	467.00	31,989,500	
アークランズ	2,400	1,438.00	3,451,200	
ニトリホールディングス	6,800	17,025.00	115,770,000	
愛眼	1,100	166.00	182,600	
ケーユーホールディングス	1,000	1,437.00	1,437,000	
吉野家ホールディングス	6,500	2,385.00	15,502,500	
松屋フーズホールディングス	800	4,000.00	3,200,000	
サガミホールディングス	2,700	1,241.00	3,350,700	
関西フードマーケット	1,500	1,340.00	2,010,000	
王将フードサービス	1,100	6,010.00	6,611,000	
ミニストップ	1,200	1,411.00	1,693,200	
アークス	3,100	2,184.00	6,770,400	
バローホールディングス	3,200	1,860.00	5,952,000	
ベルク	800	5,570.00	4,456,000	
大庄	800	1,050.00	840,000	
ファーストリテイリング	2,500	77,990.00	194,975,000	

サンドラッグ	6,400	3,685.00	23,584,000	
サックスバー　ホールディングス	1,600	750.00	1,200,000	
ヤマザワ	300	1,366.00	409,800	
やまや	300	2,573.00	771,900	
ベルーナ	4,000	696.00	2,784,000	
いよぎんホールディングス	18,500	717.00	13,264,500	
しずおかフィナンシャルグループ	35,200	1,099.00	38,684,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,100	935.00	12,248,500	
島根銀行	500	512.00	256,000	
じもとホールディングス	900	442.00	397,800	
めぶきフィナンシャルグループ	77,200	334.00	25,784,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	2,897.00	5,794,000	
九州フィナンシャルグループ	27,400	473.00	12,960,200	
ゆうちょ銀行	44,300	1,158.00	51,299,400	
富山第一銀行	3,900	637.00	2,484,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	85,800	564.00	48,391,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,900	1,057.00	10,464,300	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,661.00	2,325,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	3,010.00	7,525,000	
ひろぎんホールディングス	20,300	668.00	13,560,400	
おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,373.00	3,559,500	
十六フィナンシャルグループ	2,000	3,050.00	6,100,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,300	4,080.00	5,304,000	
プロクレアホールディングス	1,900	2,326.00	4,419,400	
あいちフィナンシャルグループ	2,200	2,289.00	5,035,800	
ＳＢＩ新生銀行	4,600	2,403.00	11,053,800	
あおぞら銀行	9,800	2,570.00	25,186,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	988,100	948.50	937,212,850	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	198,600	710.00	141,006,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,200	4,714.00	132,934,800	
三井住友フィナンシャルグループ	113,700	5,679.00	645,702,300	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	43,400	969.00	42,054,600	
群馬銀行	30,200	501.00	15,130,200	
武蔵野銀行	2,000	2,251.00	4,502,000	
千葉興業銀行	3,200	500.00	1,600,000	
筑波銀行	6,800	244.00	1,659,200	
七十七銀行	5,000	2,258.00	11,290,000	
秋田銀行	1,100	1,866.00	2,052,600	
山形銀行	1,700	1,250.00	2,125,000	
岩手銀行	1,100	2,176.00	2,393,600	
東邦銀行	12,300	241.00	2,964,300	

東北銀行	700	1,035.00	724,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,400	2,947.00	36,542,800	
スルガ銀行	13,700	421.00	5,767,700	
八十二銀行	31,900	562.00	17,927,800	
山梨中央銀行	1,600	1,215.00	1,944,000	
大垣共立銀行	3,000	1,915.00	5,745,000	
福井銀行	1,400	1,658.00	2,321,200	
清水銀行	600	1,524.00	914,400	
富山銀行	200	1,834.00	366,800	
滋賀銀行	2,600	2,703.00	7,027,800	
南都銀行	2,400	2,666.00	6,398,400	
百五銀行	14,700	408.00	5,997,600	
京都銀行	4,900	6,130.00	30,037,000	
紀陽銀行	5,600	1,619.00	9,066,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,900	1,000.00	9,900,000	
山陰合同銀行	9,700	804.00	7,798,800	
鳥取銀行	500	1,234.00	617,000	
百十四銀行	1,400	2,010.00	2,814,000	
四国銀行	2,500	984.00	2,460,000	
阿波銀行	2,300	2,126.00	4,889,800	
大分銀行	900	2,184.00	1,965,600	
宮崎銀行	1,000	2,650.00	2,650,000	
佐賀銀行	900	1,841.00	1,656,900	
琉球銀行	3,600	954.00	3,434,400	
セブン銀行	55,800	265.00	14,787,000	
みずほフィナンシャルグループ	225,100	2,039.50	459,091,450	
高知銀行	500	740.00	370,000	
山口フィナンシャルグループ	17,200	885.00	15,222,000	
長野銀行	400	1,448.00	579,200	
名古屋銀行	1,000	3,545.00	3,545,000	
北洋銀行	23,600	281.00	6,631,600	
大光銀行	400	1,256.00	502,400	
愛媛銀行	2,100	962.00	2,020,200	
トマト銀行	500	1,061.00	530,500	
京葉銀行	7,200	610.00	4,392,000	
栃木銀行	7,100	308.00	2,186,800	
北日本銀行	600	2,228.00	1,336,800	
東和銀行	2,900	618.00	1,792,200	
福島銀行	1,500	264.00	396,000	
大東銀行	600	759.00	455,400	
トモニホールディングス	12,600	394.00	4,964,400	
フィデアホールディングス	1,600	1,471.00	2,353,600	

池田泉州ホールディングス	19,900	249.00	4,955,100	
ＦＰＧ	6,300	1,228.00	7,736,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,080.00	1,404,000	
マーキュリアホールディングス	800	711.00	568,800	
ＳＢＩホールディングス	22,500	2,734.00	61,515,000	
ジャフコ　グループ	5,200	2,251.00	11,705,200	
大和証券グループ本社	111,300	607.00	67,559,100	
野村ホールディングス	286,600	511.00	146,452,600	
岡三証券グループ	13,700	412.00	5,644,400	
丸三証券	5,200	423.00	2,199,600	
東洋証券	5,200	275.00	1,430,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,900	370.00	6,253,000	
光世証券	300	365.00	109,500	
水戸証券	4,200	294.00	1,234,800	
いちよし証券	2,900	619.00	1,795,100	
松井証券	9,200	772.00	7,102,400	
マネックスグループ	17,400	469.00	8,160,600	
極東証券	2,000	599.00	1,198,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,329.00	2,392,200	
アイザワ証券グループ	2,300	707.00	1,626,100	
マネーパートナーズグループ	1,500	263.00	394,500	
スパークス・グループ	1,700	1,766.00	3,002,200	
かんぽ生命保険	18,900	2,332.00	44,074,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	26,700	5,618.00	150,000,600	
アニコム　ホールディングス	5,300	609.00	3,227,700	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	31,700	4,202.00	133,203,400	
第一生命ホールディングス	79,200	3,062.00	242,510,400	
東京海上ホールディングス	156,700	2,751.00	431,081,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	41,800	2,083.00	87,069,400	
アドバンスクリエイト	900	1,129.00	1,016,100	
全国保証	4,100	4,935.00	20,233,500	
あんしん保証	700	271.00	189,700	
ジェイリース	500	2,572.00	1,286,000	
イントラスト	500	922.00	461,000	
日本モーゲージサービス	800	885.00	708,000	
Ｃａｓａ	600	838.00	502,800	
アルヒ	1,900	1,040.00	1,976,000	
プレミアグループ	2,600	1,580.00	4,108,000	
ネットプロテクションズホールディングス	5,200	606.00	3,151,200	
クレディセゾン	9,900	1,682.00	16,651,800	
芙蓉総合リース	1,400	8,780.00	12,292,000	
みずほリース	2,300	3,405.00	7,831,500	

東京センチュリー	2,900	4,495.00	13,035,500	
日本証券金融	6,200	1,155.00	7,161,000	
アイフル	25,800	387.00	9,984,600	
リコーリース	1,500	3,825.00	5,737,500	
イオンフィナンシャルサービス	8,900	1,303.00	11,596,700	
アコム	27,800	316.00	8,784,800	
ジャックス	1,700	4,120.00	7,004,000	
オリエントコーポレーション	4,100	1,122.00	4,600,200	
オリックス	104,100	2,267.50	236,046,750	
三菱ＨＣキャピタル	60,700	661.00	40,122,700	
九州リースサービス	700	780.00	546,000	
日本取引所グループ	43,700	1,940.50	84,799,850	
イー・ギャランティ	2,500	2,398.00	5,995,000	
アサックス	600	604.00	362,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	800	2,452.00	1,961,600	
大東建託	5,700	12,520.00	71,364,000	
いちご	17,900	292.00	5,226,800	
日本駐車場開発	18,500	268.00	4,958,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	679.00	950,600	
ＳＲＥホールディングス	800	3,380.00	2,704,000	
ＡＤワークスグループ	3,500	147.00	514,500	
ヒューリック	36,300	1,065.00	38,659,500	
三栄建築設計	800	1,487.00	1,189,600	
野村不動産ホールディングス	9,700	2,848.00	27,625,600	
三重交通グループホールディングス	3,300	496.00	1,636,800	
サムティ	2,500	2,031.00	5,077,500	
ディア・ライフ	2,400	625.00	1,500,000	
コーセーアールイー	500	736.00	368,000	
地主	1,200	1,845.00	2,214,000	
プレサンスコーポレーション	2,100	1,658.00	3,481,800	
ＴＨＥグローバル社	800	222.00	177,600	
ハウスコム	200	1,108.00	221,600	
ＪＰＭＣ	800	1,002.00	801,600	
サンセイランディック	400	826.00	330,400	
エストラスト	200	583.00	116,600	
フージャースホールディングス	2,400	792.00	1,900,800	
オープンハウスグループ	5,700	4,840.00	27,588,000	
東急不動産ホールディングス	46,800	646.00	30,232,800	
飯田グループホールディングス	13,600	2,128.00	28,940,800	
イーグランド	200	1,474.00	294,800	
ムゲンエステート	900	496.00	446,400	
ビーロット	1,000	536.00	536,000	

ファーストブラザーズ	300	864.00	259,200	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	900	839.00	755,100	
シーアールイー	700	1,073.00	751,100	
プロパティエージェント	200	1,227.00	245,400	
ケイアイスター不動産	800	4,835.00	3,868,000	
アグレ都市デザイン	300	1,623.00	486,900	
グッドコムアセット	1,500	790.00	1,185,000	
ジェイ・エス・ビー	400	3,985.00	1,594,000	
ロードスターキャピタル	700	1,633.00	1,143,100	
テンポイノベーション	400	1,112.00	444,800	
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,145.00	343,500	
フェイスネットワーク	200	1,681.00	336,200	
パーク２４	12,100	2,189.00	26,486,900	
パラカ	600	1,900.00	1,140,000	
三井不動産	67,600	2,423.00	163,794,800	
三菱地所	93,900	1,665.00	156,343,500	
平和不動産	2,500	3,535.00	8,837,500	
東京建物	14,800	1,589.00	23,517,200	
京阪神ビルディング	2,000	1,332.00	2,664,000	
住友不動産	28,100	3,125.00	87,812,500	
テーオーシー	2,800	665.00	1,862,000	
東京楽天地	300	4,215.00	1,264,500	
スターツコーポレーション	2,200	2,538.00	5,583,600	
フジ住宅	2,200	684.00	1,504,800	
空港施設	1,900	518.00	984,200	
明和地所	700	869.00	608,300	
ゴールドクレスト	1,500	1,616.00	2,424,000	
エスリード	700	2,126.00	1,488,200	
日神グループホールディングス	2,500	457.00	1,142,500	
日本エスコン	3,500	826.00	2,891,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	7,900	384.00	3,033,600	
ＡＶＡＮＴＩＡ	700	799.00	559,300	
イオンモール	8,100	1,816.00	14,709,600	
毎日コムネット	500	682.00	341,000	
ファースト住建	600	1,044.00	626,400	
カチタス	4,200	3,135.00	13,167,000	
トーセイ	2,600	1,480.00	3,848,000	
穴吹興産	300	2,051.00	615,300	
サンフロンティア不動産	2,600	1,104.00	2,870,400	
ＦＪネクストホールディングス	1,600	1,002.00	1,603,200	
インテリックス	400	574.00	229,600	
ランドビジネス	500	226.00	113,000	

サンネクスタグループ	400	936.00	374,400	
グランディハウス	1,200	584.00	700,800	
日本空港ビルデング	5,500	6,670.00	36,685,000	
明豊ファシリティワークス	700	739.00	517,300	
日本工営	1,000	3,525.00	3,525,000	
ＬＩＦＵＬＬ	5,600	223.00	1,248,800	
ＭＩＸＩ	3,700	2,473.00	9,150,100	
ジェイエイシーリクルートメント	1,500	2,397.00	3,595,500	
日本M＆Ａセンターホールディングス	27,900	1,367.00	38,139,300	
メンバーズ	500	1,963.00	981,500	
中広	200	388.00	77,600	
ＵＴグループ	2,400	2,635.00	6,324,000	
アイティメディア	600	1,520.00	912,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,000	1,328.00	1,328,000	
オープンアップグループ	4,800	1,918.00	9,206,400	
コシダカホールディングス	4,900	939.00	4,601,100	
アルトナー	400	1,007.00	402,800	
パソナグループ	2,000	2,110.00	4,220,000	
ＣＤＳ	400	1,786.00	714,400	
リンクアンドモチベーション	4,700	656.00	3,083,200	
エス・エム・エス	6,200	3,465.00	21,483,000	
サニーサイドアップグループ	500	563.00	281,500	
パーソルホールディングス	18,200	2,861.00	52,070,200	
リニカル	800	720.00	576,000	
クックパッド	4,500	216.00	972,000	
エスクリ	600	320.00	192,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	700	632.00	442,400	
学情	800	1,414.00	1,131,200	
スタジオアリス	800	2,121.00	1,696,800	
シミックホールディングス	900	1,756.00	1,580,400	
エプコ	300	745.00	223,500	
ＮＪＳ	400	2,193.00	877,200	
綜合警備保障	6,000	3,630.00	21,780,000	
カカクコム	12,100	2,185.00	26,438,500	
アイロムグループ	600	2,471.00	1,482,600	
セントケア・ホールディング	1,100	825.00	907,500	
サイネックス	300	554.00	166,200	
ルネサンス	1,200	922.00	1,106,400	
ディップ	2,800	3,905.00	10,934,000	
デジタルホールディングス	1,300	1,251.00	1,626,300	
新日本科学	1,700	2,189.00	3,721,300	
キャリアデザインセンター	300	1,767.00	530,100	

ベネフィット・ワン	7,500	2,309.00	17,317,500	
エムスリー	32,100	3,515.00	112,831,500	
ツカダ・グローバルホールディング	900	380.00	342,000	
ブラス	200	1,049.00	209,800	
アウトソーシング	9,700	998.00	9,680,600	
ウェルネット	1,100	609.00	669,900	
ワールドホールディングス	700	2,585.00	1,809,500	
ディー・エヌ・エー	6,900	1,802.00	12,433,800	
博報堂ＤＹホールディングス	20,700	1,388.00	28,731,600	
ぐるなび	3,000	396.00	1,188,000	
タカミヤ	2,200	382.00	840,400	
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	828.00	828,000	
ファンコミュニケーションズ	3,200	415.00	1,328,000	
ライク	600	2,162.00	1,297,200	
ビジネス・ブレークスルー	600	383.00	229,800	
エスプール	4,700	771.00	3,623,700	
ＷＤＢホールディングス	800	2,148.00	1,718,400	
ティア	900	423.00	380,700	
ＣＤＧ	200	1,119.00	223,800	
アドウェイズ	2,300	512.00	1,177,600	
バリューコマース	1,200	1,869.00	2,242,800	
インフォマート	16,900	420.00	7,098,000	
ＪＰホールディングス	4,700	336.00	1,579,200	
エコナックホールディングス	2,500	90.00	225,000	
ＣＬホールディングス	500	817.00	408,500	
プレステージ・インターナショナル	6,800	719.00	4,889,200	
アミューズ	900	1,723.00	1,550,700	
ドリームインキュベータ	500	2,582.00	1,291,000	
クイック	1,300	1,905.00	2,476,500	
ＴＡＣ	700	204.00	142,800	
電通グループ	16,000	4,130.00	66,080,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,309.00	654,500	
ぴあ	600	3,320.00	1,992,000	
イオンファンタジー	700	3,050.00	2,135,000	
シーティーエス	1,800	826.00	1,486,800	
ネクシィーズグループ	500	655.00	327,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,800	2,752.00	13,209,600	
アルプス技研	1,400	2,192.00	3,068,800	
日本空調サービス	1,800	701.00	1,261,800	
オリエンタルランド	17,200	21,560.00	370,832,000	
ダスキン	3,600	2,985.00	10,746,000	
明光ネットワークジャパン	2,200	613.00	1,348,600	

ファルコホールディングス	700	1,840.00	1,288,000	
秀英予備校	300	436.00	130,800	
ラウンドワン	13,600	477.00	6,487,200	
リゾートトラスト	6,400	2,366.00	15,142,400	
ビー・エム・エル	2,000	3,210.00	6,420,000	
りらいあコミュニケーションズ	2,700	1,457.00	3,933,900	
リソー教育	7,400	358.00	2,649,200	
早稲田アカデミー	900	1,166.00	1,049,400	
ユー・エス・エス	16,700	2,129.00	35,554,300	
東京個別指導学院	1,900	540.00	1,026,000	
サイバーエージェント	38,900	1,204.00	46,835,600	
楽天グループ	75,200	667.00	50,158,400	
クリーク・アンド・リバー社	1,000	2,183.00	2,183,000	
モーニングスター	2,700	463.00	1,250,100	
テー・オー・ダブリュー	3,200	293.00	937,600	
山田コンサルティンググループ	800	1,154.00	923,200	
セントラルスポーツ	600	2,475.00	1,485,000	
フルキャストホールディングス	1,600	2,805.00	4,488,000	
エン・ジャパン	2,900	2,470.00	7,163,000	
リソルホールディングス	100	4,750.00	475,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,600	4,070.00	39,072,000	
アトラグループ	300	184.00	55,200	
インターワークス	400	366.00	146,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	1,832.00	1,648,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,000	3,285.00	3,285,000	
ファーストロジック	200	841.00	168,200	
三機サービス	200	915.00	183,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,300	654.00	850,200	
デザインワン・ジャパン	500	199.00	99,500	
イー・ガーディアン	600	2,740.00	1,644,000	
リブセンス	700	334.00	233,800	
ジャパンマテリアル	5,000	2,376.00	11,880,000	
ベクトル	2,600	1,259.00	3,273,400	
ウチヤマホールディングス	600	266.00	159,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,177.00	1,647,800	
キャリアリンク	600	2,617.00	1,570,200	
ＩＢＪ	1,000	1,002.00	1,002,000	
アサンテ	800	1,645.00	1,316,000	
バリューＨＲ	1,400	1,708.00	2,391,200	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,500	3,840.00	5,760,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,077.00	646,200	
ＥＲＩホールディングス	400	1,461.00	584,400	

アビスト	200	2,966.00	593,200	
シグマクシス・ホールディングス	2,500	1,364.00	3,410,000	
ウィルグループ	1,400	1,225.00	1,715,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,500	152.00	228,000	
メドピア	1,300	1,457.00	1,894,100	
レアジョブ	300	960.00	288,000	
リクルートホールディングス	120,200	4,259.00	511,931,800	
エラン	2,200	991.00	2,180,200	
土木管理総合試験所	600	305.00	183,000	
日本郵政	212,900	1,143.00	243,344,700	
ベルシステム２４ホールディングス	2,200	1,471.00	3,236,200	
鎌倉新書	1,900	1,100.00	2,090,000	
ＳＭＮ	400	478.00	191,200	
一蔵	200	440.00	88,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	200	830.00	166,000	
エアトリ	1,100	2,664.00	2,930,400	
アトラエ	1,300	1,272.00	1,653,600	
ストライク	800	3,945.00	3,156,000	
ソラスト	4,500	672.00	3,024,000	
セラク	600	1,437.00	862,200	
インソース	4,000	1,490.00	5,960,000	
ベイカレント・コンサルティング	12,800	5,500.00	70,400,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	400	2,040.00	816,000	
アイモバイル	900	1,253.00	1,127,700	
キャリアインデックス	500	317.00	158,500	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	500	1,070.00	535,000	
船場	300	702.00	210,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,800	1,816.00	10,532,800	
フルテック	200	1,103.00	220,600	
グリーンズ	500	1,219.00	609,500	
ツナググループ・ホールディングス	400	497.00	198,800	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	500	328.00	164,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	200	596.00	119,200	
ウェルビー	1,200	663.00	795,600	
エル・ティー・エス	200	2,809.00	561,800	
ミダックホールディングス	1,000	2,880.00	2,880,000	
日総工産	1,200	589.00	706,800	
キュービーネットホールディングス	800	1,509.00	1,207,200	
ＲＰＡホールディングス	2,200	301.00	662,200	
スプリックス	500	896.00	448,000	
マネジメントソリューションズ	900	3,415.00	3,073,500	
プロレド・パートナーズ	400	502.00	200,800	

ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	400	373.00	149,200	
テノ．ホールディングス	200	850.00	170,000	
フロンティア・マネジメント	600	1,440.00	864,000	
ピアラ	300	549.00	164,700	
コプロ・ホールディングス	300	1,106.00	331,800	
ギークス	200	905.00	181,000	
カーブスホールディングス	5,000	823.00	4,115,000	
フォーラムエンジニアリング	1,000	883.00	883,000	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	600	1,206.00	723,600	
ダイレクトマーケティングミックス	2,000	1,616.00	3,232,000	
ポピンズ	300	2,105.00	631,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1,300	2,712.00	3,525,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	406.00	284,200	
リログループ	9,000	2,186.00	19,674,000	
東祥	1,100	1,216.00	1,337,600	
ビーウィズ	300	1,470.00	441,000	
ＴＲＥホールディングス	3,400	1,456.00	4,950,400	
人・夢・技術グループ	700	1,445.00	1,011,500	
大栄環境	3,100	1,763.00	5,465,300	
エイチ・アイ・エス	4,300	2,106.00	9,055,800	
ラックランド	500	2,905.00	1,452,500	
共立メンテナンス	2,800	5,880.00	16,464,000	
イチネンホールディングス	1,700	1,289.00	2,191,300	
建設技術研究所	800	3,300.00	2,640,000	
スペース	1,200	937.00	1,124,400	
燦ホールディングス	700	1,890.00	1,323,000	
スバル興業	100	8,890.00	889,000	
東京テアトル	500	1,119.00	559,500	
タナベコンサルティンググループ	600	643.00	385,800	
ナガワ	400	7,790.00	3,116,000	
東京都競馬	1,400	3,860.00	5,404,000	
常磐興産	500	1,228.00	614,000	
カナモト	3,000	2,219.00	6,657,000	
西尾レントオール	1,500	3,085.00	4,627,500	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	8,000	22.00	176,000	
トランス・コスモス	2,000	3,170.00	6,340,000	
乃村工藝社	7,100	922.00	6,546,200	
藤田観光	700	3,425.00	2,397,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,000	1,699.00	1,699,000	
日本管財	1,700	2,520.00	4,284,000	
トーカイ	1,400	1,940.00	2,716,000	
セコム	16,500	7,645.00	126,142,500	

セントラル警備保障	900	2,642.00	2,377,800	
丹青社	3,200	712.00	2,278,400	
メイテック	6,500	2,446.00	15,899,000	
応用地質	1,500	2,000.00	3,000,000	
船井総研ホールディングス	3,400	2,766.00	9,404,400	
進学会ホールディングス	500	298.00	149,000	
オオバ	900	719.00	647,100	
いであ	300	1,726.00	517,800	
学究社	700	2,005.00	1,403,500	
ベネッセホールディングス	6,100	1,969.00	12,010,900	
イオンディライト	1,800	3,055.00	5,499,000	
ナック	700	968.00	677,600	
ダイセキ	3,300	4,340.00	14,322,000	
ステップ	700	1,801.00	1,260,700	
合　　計	18,332,500		44,798,911,120	

(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】

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

（１）　当ファンドの中間財務諸表は、「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（2023年 2月 2日から2023年 8月 1日まで）の中間財務諸表について、ＰｗＣ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。

【財形株投（一般財形３０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,057,091	3,001,723
親投資信託受益証券	104,688,986	105,642,360
流動資産合計	107,746,077	108,644,083
資産合計	107,746,077	108,644,083
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	51,837	-
未払受託者報酬	29,583	29,152
未払委託者報酬	278,649	274,593
未払利息	-	5
その他未払費用	2,295	2,263
流動負債合計	362,364	306,013
負債合計	362,364	306,013
純資産の部		
元本等		
元本	103,674,070	99,026,271
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,709,643	9,311,799
（分配準備積立金）	5,273,621	4,820,885
元本等合計	107,383,713	108,338,070
純資産合計	107,383,713	108,338,070
負債純資産合計	107,746,077	108,644,083

（2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自　2022年 2月 2日 至　2022年 8月 1日	当中間計算期間 自　2023年 2月 2日 至　2023年 8月 1日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	1,638,482	6,131,091
営業収益合計	1,638,482	6,131,092
営業費用		
支払利息	110	419
受託者報酬	28,898	29,152
委託者報酬	533,816	274,593
その他費用	2,248	2,263
営業費用合計	565,072	306,427
営業利益又は営業損失（△）	1,073,410	5,824,665
経常利益又は経常損失（△）	1,073,410	5,824,665
中間純利益又は中間純損失（△）	1,073,410	5,824,665
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△28,519	183,620
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,244,558	3,709,643
剰余金増加額又は欠損金減少額	144,298	286,593
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	144,298	286,593
剰余金減少額又は欠損金増加額	244,557	325,482
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	244,557	325,482
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（△）	4,246,228	9,311,799

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在
１．	期首元本額	107,198,165円	103,674,070円
	期中追加設定元本額	9,483,632円	4,409,251円
	期中一部解約元本額	13,007,727円	9,057,050円
２．	受益権の総数	103,674,070口	99,026,271口

（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 2022年 2月 2日 至 2022年 8月 1日	当中間計算期間 自 2023年 2月 2日 至 2023年 8月 1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 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1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日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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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

（１口当たり情報）

前計算期間末 2023年 2月 1日現在		当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0358円	1口当たり純資産額	1.0940円
(1万口当たり純資産額)	(10,358円)	(1万口当たり純資産額)	(10,940円)

【財形株投（一般財形５０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,581,032	5,772,470
親投資信託受益証券	189,930,398	201,712,631
流動資産合計	195,511,430	207,485,101
資産合計	195,511,430	207,485,101
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	82,442	-
未払受託者報酬	52,817	53,806
未払委託者報酬	497,073	506,356
未払利息	1	10
その他未払費用	4,173	4,245
流動負債合計	636,506	564,417
負債合計	636,506	564,417
純資産の部		
元本等		
元本	164,885,950	159,964,930
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	29,988,974	46,955,754
（分配準備積立金）	26,904,604	24,739,736
元本等合計	194,874,924	206,920,684
純資産合計	194,874,924	206,920,684
負債純資産合計	195,511,430	207,485,101

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自　2022年 2月 2日 至　2022年 8月 1日	当中間計算期間 自　2023年 2月 2日 至　2023年 8月 1日
営業収益		
受取利息	1	1
有価証券売買等損益	4,979,726	18,356,630
営業収益合計	4,979,727	18,356,631
営業費用		
支払利息	238	841
受託者報酬	50,984	53,806
委託者報酬	947,031	506,356
その他費用	4,013	4,246
営業費用合計	1,002,266	565,249
営業利益又は営業損失（△）	3,977,461	17,791,382
経常利益又は経常損失（△）	3,977,461	17,791,382
中間純利益又は中間純損失（△）	3,977,461	17,791,382
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	182,892	356,484
期首剰余金又は期首欠損金（△）	26,437,241	29,988,974
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,366,863	1,995,554
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,366,863	1,995,554
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,416,167	2,463,672
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,416,167	2,463,672
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（△）	29,182,506	46,955,754

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在
１．	期首元本額	168,768,071円	164,885,950円
	期中追加設定元本額	16,167,615円	8,606,574円
	期中一部解約元本額	20,049,736円	13,527,594円
２．	受益権の総数	164,885,950口	159,964,930口

（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 2022年 2月 2日 至 2022年 8月 1日	当中間計算期間 自 2023年 2月 2日 至 2023年 8月 1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 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1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日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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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

（１口当たり情報）

前計算期間末 2023年 2月 1日現在		当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.1819円	1口当たり純資産額	1.2935円
(1万口当たり純資産額)	(11,819円)	(1万口当たり純資産額)	(12,935円)

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,357,414	7,712,483
親投資信託受益証券	245,382,211	263,855,329
流動資産合計	252,739,625	271,567,812
資産合計	252,739,625	271,567,812
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	121,193	-
未払受託者報酬	69,001	70,599
未払委託者報酬	649,090	664,286
未払利息	2	14
その他未払費用	5,458	5,594
流動負債合計	844,744	740,493
負債合計	844,744	740,493
純資産の部		
元本等		
元本	242,386,660	246,585,432
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	9,508,221	24,241,887
（分配準備積立金）	14,950,211	14,606,192
元本等合計	251,894,881	270,827,319
純資産合計	251,894,881	270,827,319
負債純資産合計	252,739,625	271,567,812

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自　2022年 2月 2日 至　2022年 8月 1日	当中間計算期間 自　2023年 2月 2日 至　2023年 8月 1日
営業収益		
受取利息	1	2
有価証券売買等損益	3,898,091	15,070,526
営業収益合計	3,898,092	15,070,528
営業費用		
支払利息	318	1,123
受託者報酬	64,775	70,599
委託者報酬	1,193,376	664,286
その他費用	5,126	5,595
営業費用合計	1,263,595	741,603
営業利益又は営業損失（△）	2,634,497	14,328,925
経常利益又は経常損失（△）	2,634,497	14,328,925
中間純利益又は中間純損失（△）	2,634,497	14,328,925
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△85,606	83,417
期首剰余金又は期首欠損金（△）	7,460,067	9,508,221
剰余金増加額又は欠損金減少額	567,401	711,698
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	567,401	711,698
剰余金減少額又は欠損金増加額	338,838	223,540
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	338,838	223,540
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（△）	10,408,733	24,241,887

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在
１．	期首元本額	229,883,526円	242,386,660円
	期中追加設定元本額	25,024,830円	9,861,759円
	期中一部解約元本額	12,521,696円	5,662,987円
２．	受益権の総数	242,386,660口	246,585,432口

（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 2022年 2月 2日 至 2022年 8月 1日	当中間計算期間 自 2023年 2月 2日 至 2023年 8月 1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 2023年 2月 1日現在	当中間計算期間末 2023年 8月 1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日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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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

（１口当たり情報）

前計算期間末 2023年 2月 1日現在		当中間計算期間末 2023年 8月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0392円	1口当たり純資産額	1.0983円
(1万口当たり純資産額)	(10,392円)	(1万口当たり純資産額)	(10,983円)

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

（参考）

財形公社債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	120,586,352	122,119,932
国債証券	196,769,400	198,701,854
地方債証券	20,041,344	34,796,700
未収利息	60,128	43,206
前払費用	109	2,090
流動資産合計	337,457,333	355,663,782
資産合計	337,457,333	355,663,782
負債の部		
流動負債		
未払利息	37	229
流動負債合計	37	229
負債合計	37	229
純資産の部		
元本等		
元本	267,647,148	280,922,704
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	69,810,148	74,740,849
元本等合計	337,457,296	355,663,553
純資産合計	337,457,296	355,663,553
負債純資産合計	337,457,333	355,663,782

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
1．	期首	2022年 2月 2日	2023年 2月 2日
	期首元本額	258,353,525円	267,647,148円
	期首からの追加設定元本額	39,793,152円	28,998,833円
	期首からの一部解約元本額	30,499,529円	15,723,277円
	元本の内訳　※		
	財形株投（一般財形３０）	57,611,841円	57,936,066円
	財形株投（一般財形５０）	74,014,550円	78,084,586円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	136,020,757円	144,902,052円
	計	267,647,148円	280,922,704円
2．	受益権の総数	267,647,148口	280,922,704口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	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

（１口当たり情報）

2023年 2月 1日現在		2023年 8月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.261円	1口当たり純資産額	1.266円
(1千口当たり純資産額)	(1,261円)	(1千口当たり純資産額)	(1,266円)

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	257,327,383	526,901,395
株式	44,798,911,120	52,265,967,136
派生商品評価勘定	3,136,700	4,462,250
未収配当金	77,391,639	70,897,194
流動資産合計	45,136,766,842	52,868,227,975
資産合計	45,136,766,842	52,868,227,975
負債の部		
流動負債		
前受金	3,410,000	4,140,000
未払金	196,242,740	482,967,490
未払解約金	22,819,967	6,901,633
未払利息	79	988
流動負債合計	222,472,786	494,010,111
負債合計	222,472,786	494,010,111
純資産の部		
元本等		
元本	16,797,664,281	16,294,826,858
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	28,116,629,775	36,079,391,006

	2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
元本等合計	44,914,294,056	52,374,217,864
純資産合計	44,914,294,056	52,374,217,864
負債純資産合計	45,136,766,842	52,868,227,975

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	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。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
1．	期首	2022年 2月 2日	2023年 2月 2日
	期首元本額	16,909,899,311円	16,797,664,281円
	期首からの追加設定元本額	1,940,408,042円	808,449,364円
	期首からの一部解約元本額	2,052,643,072円	1,311,286,787円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンドＴＳＰ	8,585,771,002円	8,208,289,810円
	財形株投（一般財形３０）	11,983,116円	10,047,695円
	財形株投（一般財形５０）	36,127,628円	32,000,979円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	27,623,621円	25,016,904円
	インデックスファンドＴＯＰＩＸ（日本株式）	7,592,072,236円	7,474,198,304円
	ＴＯＰＩＸインデックスファンド（個人型年金向け）	512,523,130円	518,267,975円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	19,237,955円	16,664,014円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	6,208,760円	5,251,498円

		2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	6,116,833円	5,089,679円
	計	16,797,664,281円	16,294,826,858円
２．	受益権の総数	16,797,664,281口	16,294,826,858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	512,777,000円	602,668,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 2月 1日現在	2023年 8月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「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)

（2023年 2月 1日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	115,120,000	－	118,260,000	3,140,000
合計		115,120,000	－	118,260,000	3,140,000

（2023年 8月 1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	112,210,000	－	116,675,000	4,465,000
合計		112,210,000	－	116,675,000	4,465,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として本書における開示対象ファンドの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）

2023年 2月 1日現在		2023年 8月 1日現在	
1口当たり純資産額	2.6738円	1口当たり純資産額	3.2142円
(1万口当たり純資産額)	(26,738円)	(1万口当たり純資産額)	(32,142円)

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 8月31日現在です。

【財形株投（一般財形３０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	108,777,151円
Ⅱ　負債総額	51,082円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	108,726,069円
Ⅳ　発行済口数	99,544,619口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0922円

【財形株投（一般財形５０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	207,070,032円
Ⅱ　負債総額	96,856円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	206,973,176円
Ⅳ　発行済口数	160,306,305口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2911円

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	271,561,113円
Ⅱ　負債総額	127,551円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	271,433,562円
Ⅳ　発行済口数	247,537,891口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0965円

（参考）

財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	356,676,911円
Ⅱ　負債総額	171円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	356,676,740円
Ⅳ　発行済口数	281,974,170口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.265円

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	52,279,635,736円
Ⅱ　負債総額	28,553,683円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	52,251,082,053円
Ⅳ　発行済口数	16,289,874,217口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2076円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
該当事項はありません。
（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。
（３）譲渡制限の内容
①　譲渡制限はありません。
②　受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
（４）受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
（５）受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2023年8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8月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

（３）運用の意思決定プロセス（2023年8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8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			849	269,747
	株式投資信託		794	230,883
		単位型	314	9,797
		追加型	480	221,085
	公社債投資信託		55	38,864
		単位型	42	1,029
		追加型	13	37,835

３【委託会社等の経理状況】

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

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64期事業年度（2022年４月１日から2023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。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第63期 (2022年３月31日)		第64期 (2023年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,427		42,036
有価証券		170		1,025
前払費用		932		908
未収入金		96	※4	410
未収委託者報酬		25,193		21,336
未収収益	※3	1,048	※3	589
関係会社短期貸付金		5,005		3,318
立替金		1,056		1,015
その他	※2	998	※2	1,233
流動資産合計		76,928		71,875
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	244	※1	245
器具備品	※1	153	※1	122
有形固定資産合計		397		367
無形固定資産				
ソフトウエア		335		390
無形固定資産合計		335		390
投資その他の資産				
投資有価証券		23,969		23,274
関係会社株式		22,366		22,366
長期差入保証金		652		375
繰延税金資産		3,678		448

投資その他の資産合計		50,667		46,465
固定資産合計		51,399		47,224
資産合計		128,328		119,099

（単位：百万円）

		第63期 (2022年３月31日)		第64期 (2023年３月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		651		433
未払金		9,693		7,557
未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		8,783		6,586
その他未払金		831		892
未払費用	※3	5,572	※3	4,227
未払法人税等		2,354		-
未払消費税等	※4	3,669		-
賞与引当金		3,958		2,563
役員賞与引当金		5		218
訴訟損失引当金		7,847		-
その他		1,330		647
流動負債合計		35,083		15,648
固定負債				
退職給付引当金		1,395		1,424
賞与引当金		423		437
役員賞与引当金		-		16
その他		390		181
固定負債合計		2,209		2,059
負債合計		37,292		17,708
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		68,901		79,307
利益剰余金合計		68,901		79,307
自己株式		△2,067		△2,067
株主資本合計		89,417		99,823
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,350		2,056
繰延ヘッジ損益		△731		△488
評価・換算差額等合計		1,618		1,567
純資産合計		91,035		101,391
負債純資産合計		128,328		119,099

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第63期 (自　2021年４月１日 至　2022年３月31日)	第64期 (自　2022年４月１日 至　2023年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	94,938	73,998
その他営業収益	4,743	3,479
営業収益合計	99,682	77,477
営業費用		
支払手数料	42,026	30,699
広告宣伝費	987	755
公告費	1	3
調査費	23,000	17,479
調査費	1,042	1,170
委託調査費	21,932	16,282
図書費	25	26
委託計算費	598	581
営業雑経費	1,014	948
通信費	143	139
印刷費	308	309
協会費	52	56
諸会費	13	16
その他	494	427
営業費用計	67,628	50,469
一般管理費		
給料	11,759	9,818
役員報酬	156	314
役員賞与引当金繰入額	5	234
給料・手当	7,229	6,544
賞与	143	147
賞与引当金繰入額	4,225	2,577
交際費	22	56
寄付金	29	24
旅費交通費	66	205
租税公課	429	433
不動産賃借料	937	938
退職給付費用	394	383
退職金	169	155
固定資産減価償却費	172	183
福利費	1,171	1,097
諸経費	3,888	4,291
一般管理費計	19,042	17,588
営業利益	13,010	9,420

（単位：百万円）

	第63期 (自　2021年４月１日 至　2022年３月31日)	第64期 (自　2022年４月１日 至　2023年３月31日)
営業外収益		
受取利息	71	107
受取配当金	※１　5,257	※１　9,255
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	1,548	―

その他		58		236
営業外収益合計		6,936		9,601
営業外費用				
支払利息		177		407
デリバティブ費用		49		389
有価証券償還損		―		6
時効成立後支払分配金・償還金		9		1
為替差損		―		342
その他		39		15
営業外費用合計		275		1,163
経常利益		19,672		17,858
特別利益				
投資有価証券売却益		253		427
子会社有償減資払戻益		1,445		―
訴訟損失引当金戻入額		―	※３	4,481
特別利益合計		1,699		4,909
特別損失				
投資有価証券売却損		132		347
固定資産処分損		0		0
訴訟損失引当金繰入額		7,847		―
特別損失合計		7,980		347
税引前当期純利益		13,391		22,420
法人税、住民税及び事業税		3,435		1,340
法人税等還付税額	※２	△329		―
法人税等調整額		△1,851		3,252
法人税等合計		1,255		4,593
当期純利益		12,136		17,826

（３）【株主資本等変動計算書】

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						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	△2,067	82,472
当期変動額							
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

第64期（自　2022年４月１日　至　2023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	68,901	68,901	△2,067	89,417
当期変動額							
剰余金の配当				△7,420	△7,420		△7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
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	－	－	－	10,406	10,406	－	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	△2,067	99,823

	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
当期変動額				
剰余金の配当				△7,420
当期純利益				17,826
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△294	242	△51	△51
当期変動額合計	△294	242	△51	10,355
当期末残高	2,056	△488	1,567	101,391

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　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 (2) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　３年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(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。
3　引当金の計上基準	(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。 (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。 (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。 ①　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。 ②　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。
4　収益の計上基準	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義務の内容及び当該履行義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。 (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。 (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。

	(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。
5　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (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。
6　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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、当事業年度の費用として処理しております。

（会計方針の変更）

第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
（時価の算定に関する会計基準の適用） 「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。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。本会計基準適用指針の適用が当財務諸表に与える影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
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、前事業年度において、「為替差損益」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事業年度よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である投資有価証券売却益あるいは投資有価証券売却損として表示することとしております。

（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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

（貸借対照表関係）

第63期 (2022年３月31日)	第64期 (2023年３月31日)
※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。 ※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。 ※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。	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,437百万円 器具備品　879百万円 ※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。 ※３　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　263百万円 (流動負債) 未払費用　1,778百万円 ※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、「未収入金」に含め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448百万円(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。

（損益計算書関係）

第63期 (自　2021年４月１日 至　2022年３月31日)	第64期 (自　2022年４月１日 至　2023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　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。	※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　9,241百万円 ※３　訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことにより、前事業年度に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した額を計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）

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

第64期（自　2022年４月１日　至　2023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	
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	―	784,000	752,000	―

合計	2,440,000	－	1,391,800	969,000	－

(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(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)752,000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。

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
2023年５月26日取締役会	普通株式	利益剰余金	5,092	26.23	2023年３月31日	2023年６月27日

(リース取引関係)

第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）		第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	
オペレーティング・リース取引		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		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	899百万円
１年超	4,324百万円	１年超	3,425百万円
合計	5,236百万円	合計	4,324百万円

（金融商品関係）

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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

通貨関連（*3)	－	△1,066	－	△1,066
デリバティブ取引計	△262	△1,066	－	△1,329

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。
（※２）株式関連のデリバティブ取引のうち△262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
（※３）通貨関連のデリバティブ取引の△1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
（※４）時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債
現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明
デリバティブ取引
株式関連
株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。
通貨関連
為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル２の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。
（単位：百万円）

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

３　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
（単位：百万円）

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

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２ 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、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			
	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	6,238	18,045	－	24,283
資産計	6,238	18,045	－	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連（*2)	△246	－	－	△246
通貨関連（*3)	－	△352	－	△352
デリバティブ取引計	△246	△352	－	△599

（※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△246百万円は、貸借対照表上流動資産及び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△352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(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

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	42,036			
未収委託者報酬	21,336			
未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

（有価証券関係）

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

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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	17,219	13,860	3,359
	小計	17,219	13,860	3,359
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	7,063	7,459	△395
	小計	7,063	7,459	△395
合計		24,283	21,319	2,963

(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	11,194	1,349	△221
合計	11,194	1,349	△221

（デリバティブ取引関係）
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	投資有価証券			
	売建				
	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。

第64期(2023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	10,970	-	△ 246	△ 246
合計		10,970	-	△ 246	△ 246

(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				
	シンガポールドル	3,275	-	△ 24	△ 24
合計		3,275	-	△ 24	△ 24

(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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		6,132	-	△280
	豪ドル		105	-	0
	香港ドル		699	-	△34
	人民元		5,822	-	△1
	ユーロ		234	-	△10
合計			12,994	-	△328

（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63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023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） (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　15,942 (3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,964	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　5,326 (2)持分法を適用した場合の投資の金額　16,722 (3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　2,185

（退職給付関係）

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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	△16
退職給付の支払額	△107
退職給付債務の期末残高	1,366

（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	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
貸借対照表に計上された負債の額	1,424
退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	△1
確定給付制度に係る退職給付費用	136

（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	0.6%

3　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

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

①　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。

②　単価情報

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

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

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

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員　16名	当社及び関係会社の取締役・従業員　31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　4,437,000株	普通株式　4,409,000株

付与日	2016年７月15日	2017年４月27日
権利確定条件	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。	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。
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	2018年7月15日から 2026年7月31日まで	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

	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 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 4,422,000株
付与日	2018年４月27日
権利確定条件	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
権利行使期間	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

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年７月15日	2017年４月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	539,000
権利確定	0	0
権利未確定残	―	217,000
権利確定後(株)		

期首	－	－
権利確定	－	－
権利行使	－	－
失効	－	－
権利未行使残	－	－

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年４月27日
権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
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。

②　単価情報

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年７月15日	2017年４月27日
権利行使価格(円)	558	553
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年４月27日
権利行使価格(円)	694
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	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　　　　　344百万円

(税効果会計関係)

第63期 (2022年３月31日)	第64期 (2023年３月31日)

1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：百万円）

繰延税金資産	
賞与引当金	1,341
投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	52
退職給付引当金	427
固定資産減価償却費	87
繰延ヘッジ損益	322
訴訟損失引当金	2,403
その他	1,039
繰延税金資産小計	5,772
評価性引当金(注)	△52
繰延税金資産合計	5,719
繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	1,092
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

法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△10.9%
評価性引当金の減少	△10.3%
その他	△0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	9.4%

1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：百万円）

繰延税金資産	
賞与引当金	918
投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	52
退職給付引当金	436
固定資産減価償却費	83
繰延ヘッジ損益	215
その他	672
繰延税金資産小計	2,478
評価性引当金	△52
繰延税金資産合計	2,425
繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	1,028
その他	948
繰延税金負債合計	1,977
繰延税金資産の純額	448

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	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△12.0%
その他	0.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	20.5%

（関連当事者情報）

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)
							資金の貸付(米国ドル貨建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	2,019 (USD 16,500 千)

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	－	貸付金利息 (米国ドル貨建) (注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86 千)
							資金の返済 (円貨建) (注1)	577	関係会社短期貸付金	－
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	3	未収収益	－
							資金の貸付 (シンガポールドル貨建) (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 (シンガポールドル貨建) (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

1　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。

2　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。

3　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

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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(シンガポールドル貨建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	3,318 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	103 (SGD 1,043千)	未収収益	55 (SGD 551千)
							資金の返済(米国ドル貨建)(注2)	2,019 (USD 16,500千)	関係会社短期貸付金	―
							貸付金利息(米国ドル貨建)(注2)	3 (USD 26千)	未収収益	―
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	7,795 (USD 58,000千)	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1．融資枠55百万シンガポールドル、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。

2．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した（決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております）。

3．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2022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	34,828百万円
負債合計	5,655百万円
純資産合計	29,173百万円

営業収益	15,864百万円
税引前当期純利益	4,191百万円
当期純利益	3,159百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023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63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
１株当たり純資産額	468円88銭	522円22銭
１株当たり当期純利益金額	62円50銭	91円81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63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
当期純利益（百万円）	12,136	17,826
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）	12,136	17,826

普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152	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	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	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）752,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 (2022年３月31日)	第64期 (2023年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	91,035	101,391
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）	91,035	101,391
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）

当社は2022年12月21日付け株式売買契約書に基づき、星州子会社の日興アセットマネジメントインターナショナルが保有する関連会社AHAMアセットマネジメントBerhadの20%の株式を、2023年４月19日に13,412百万円で取得しました。

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 （2023年3月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞
名称　　　：株式会社日本カストディ銀行
資本金の額：51,000百万円（2023年3月末現在）
事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

（2）販売会社

名　　称	資本金の額 （2023年3月末現在）	事業の内容
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

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

3【資本関係】

（1）受託会社
該当事項はありません。

（2）販売会社
該当事項はありません。

第3【その他】

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

（2）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
①　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
②　ファンドの基本的性格など
③　委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④　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
⑤　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。
①　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。

② 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。
③ 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。
④ 「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。
⑤ 「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。
⑥ 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。
⑦ 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。
⑧ 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨ 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。
⑩ 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。
⑪ 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。
⑫ 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。

① 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。
② 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。
③ ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。
④ 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

2023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 業務執行社員	公認会計士　秋　宗　勝　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦

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2023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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
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.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2023年４月19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 業務執行社員	公認会計士　辻村　和之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形30）の2022年２月２日から2023年２月１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形30）の2023年２月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2023年４月19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 業務執行社員	公認会計士　辻村　和之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形50）の2022年２月２日から2023年２月１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形50）の2023年２月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年４月19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 業務執行社員	公認会計士	辻村　和之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	榊原　康太

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2022年２月２日から2023年２月１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（年金・住宅財形30）の2023年２月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬ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

2023年９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

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

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」に掲げられている財形株投（一般財形30）の2023年２月２日から2023年８月１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、財形株投（一般財形30）の2023年８月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年２月２日から2023年８月１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
　経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
　中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬ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９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

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

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」に掲げられている財形株投（一般財形50）の2023年２月２日から2023年８月１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、財形株投（一般財形50）の2023年８月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年２月２日から2023年８月１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
　経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
　中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬ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９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

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

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」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2023年２月２日から2023年８月１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、財形株投（年金・住宅財形30）の2023年８月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年２月２日から2023年８月１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
　経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
　中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

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

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

利害関係

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

以　　上

(注)1.上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。