

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年5月1日提出
【計算期間】	第30期(自 2023年2月2日至 2024年2月1日)
【ファンド名】	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）
【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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的
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。
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 債 券
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

資産複合

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般	年1回	グローバル	
大型株 中小型株	年2回	日本	
	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いません。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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な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.

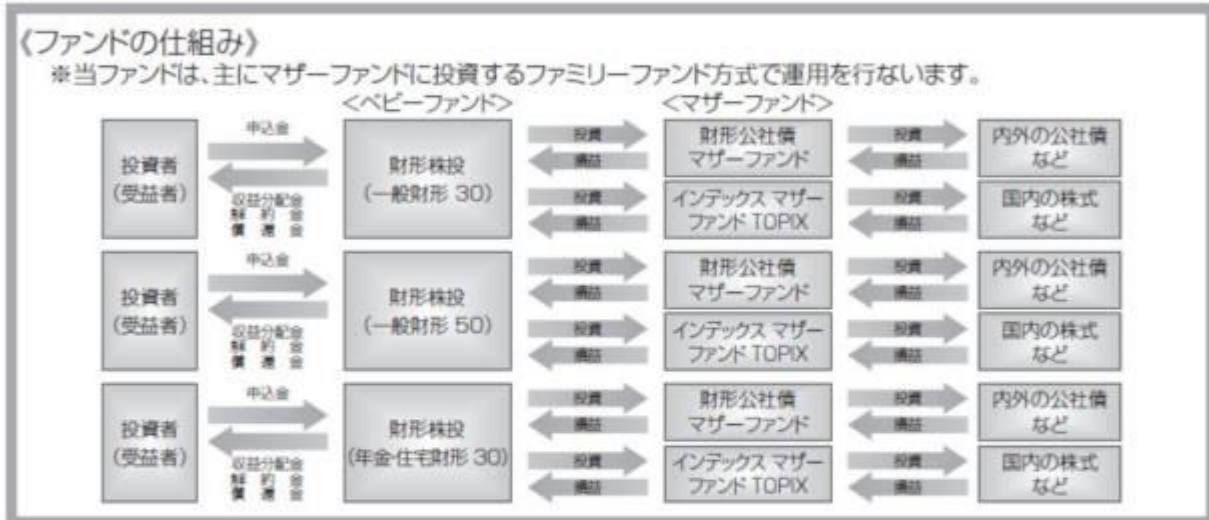
お買付けは無手数料で、給与天引きで行ないます。

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。



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

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

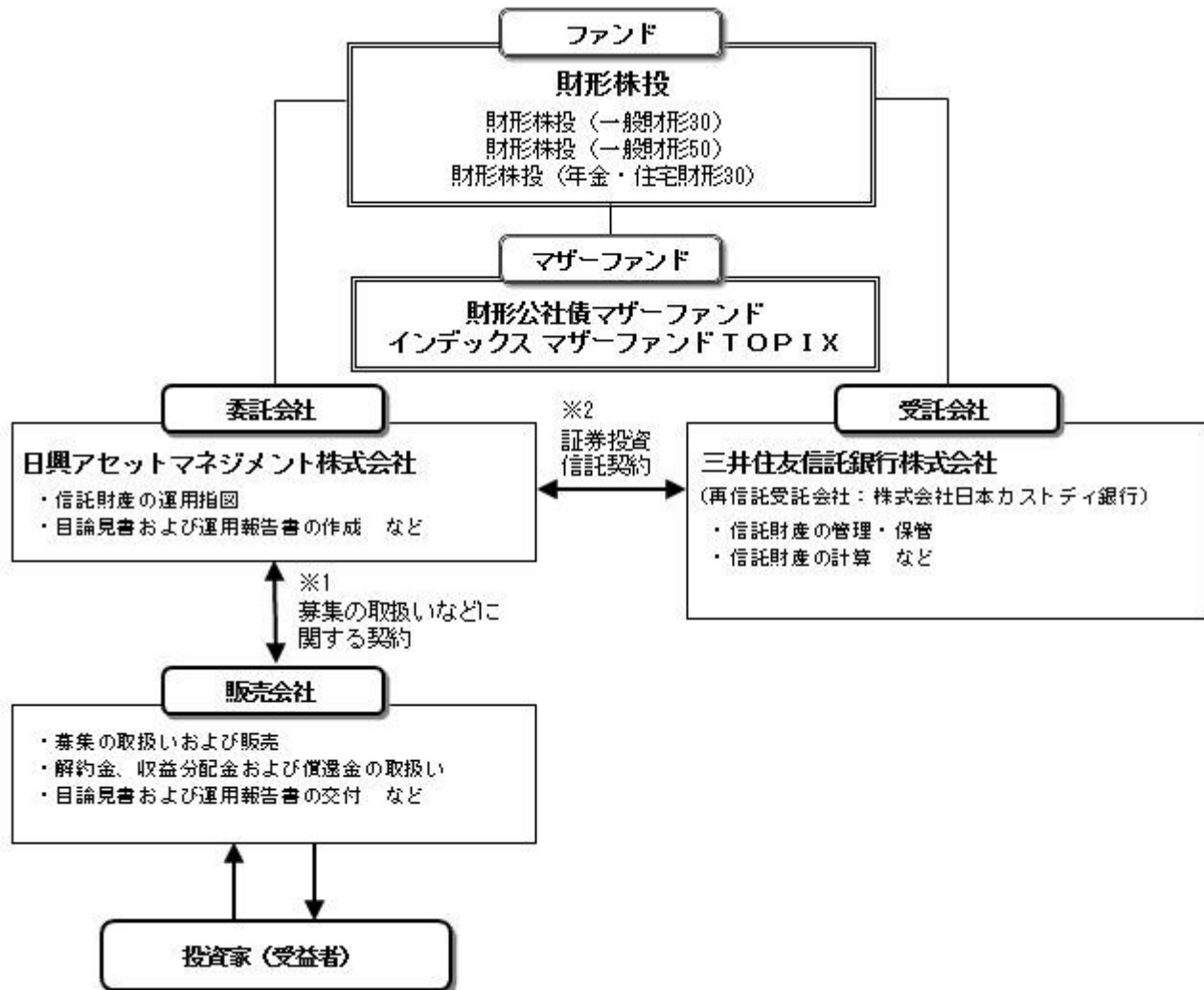
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

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】

ファンドの仕組み



- 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの、販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの、運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2024年2月末現在）

- 資本金
17,363百万円
- 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 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 T O P I X」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 T O P I X」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 T O P I X」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。

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
- 主として「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券および「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券
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 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 T O P I X >
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。))に投資することができます。

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
 - 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
 - 4) 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
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 有価証券の貸付
- <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。
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ひ、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
- 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
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付
 - 4) 外国為替予約取引

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いません。
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	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行いません。 ・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	<ul style="list-style-type: none"> ・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、「バール日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行いません。 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行いません。 株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

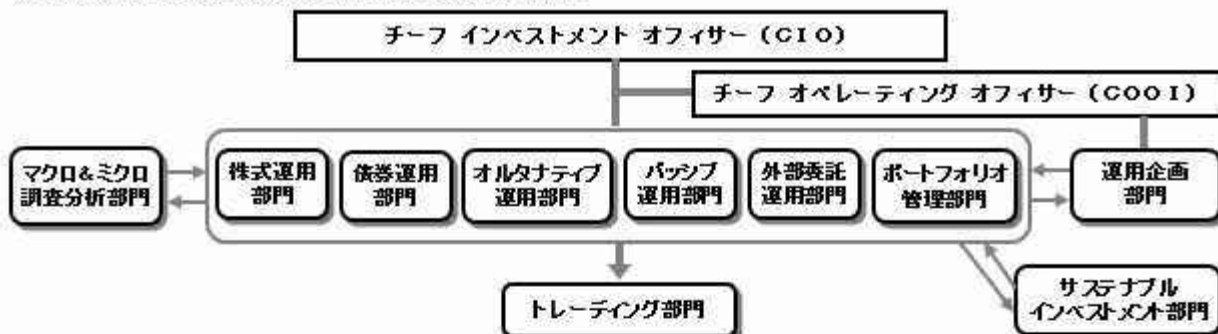
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

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

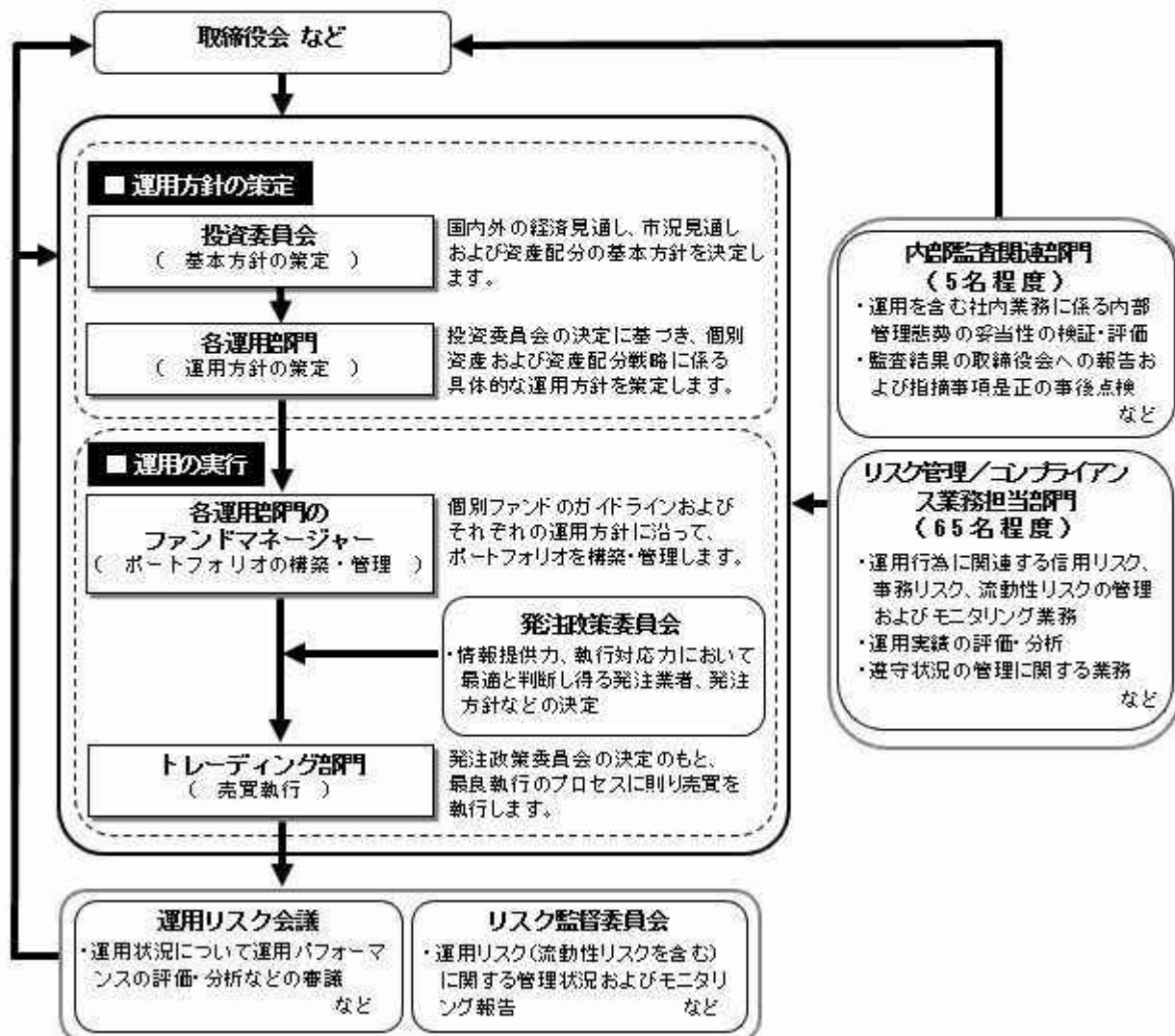
T O P I Xの指数値およびT O P I Xに係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ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

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



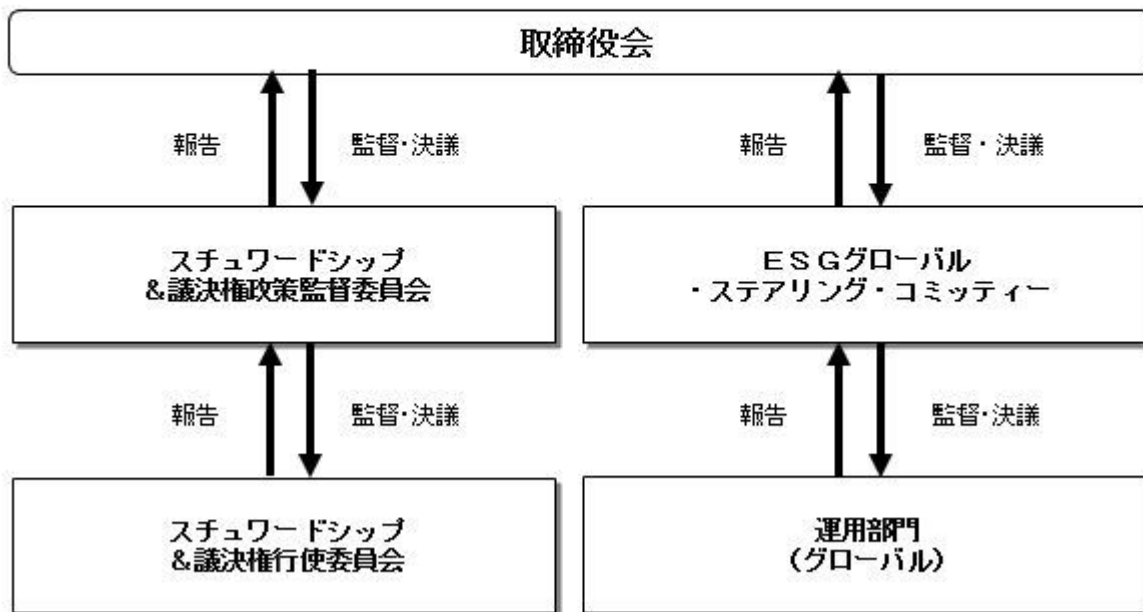
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行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2024年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- < 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。）と同じ。と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、信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- ロ) 株式分割により取得する株券
- ハ) 有償増資により取得する株券
- ニ) 売り出しにより取得する株券
- ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。))の新株予約権に限り、)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て、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、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- 八) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 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券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売り出しにより取得する株券
- 6) 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

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ず。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て、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、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。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

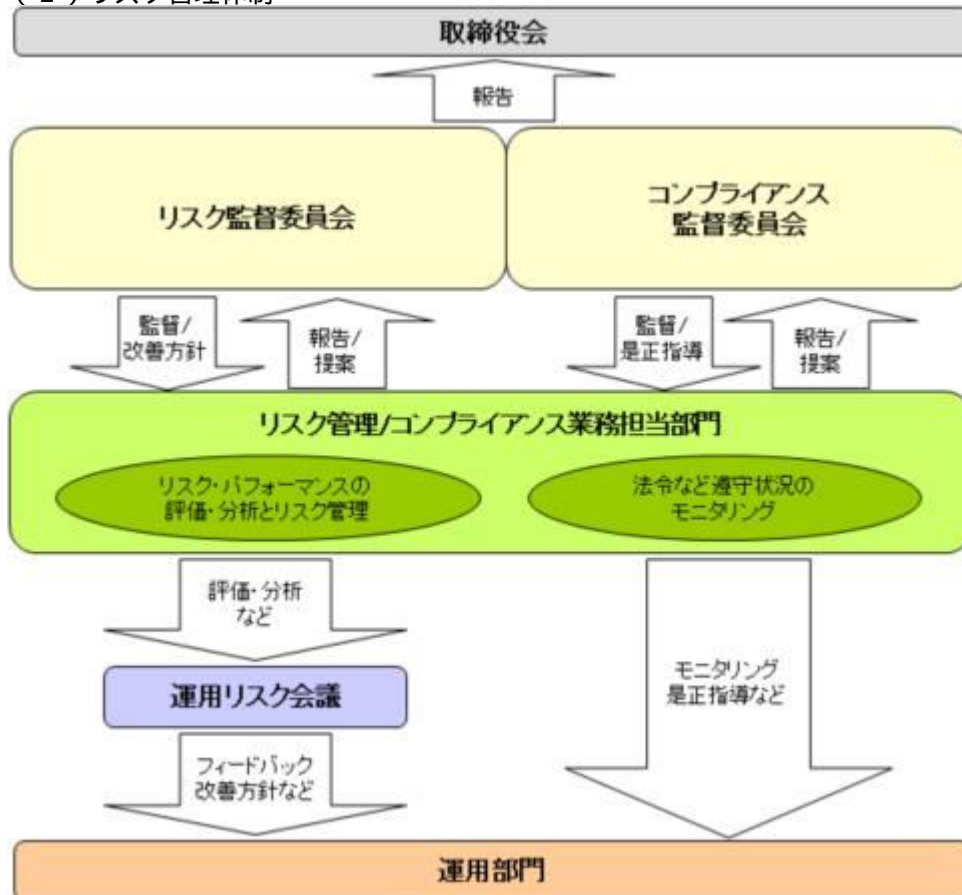
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券(マザーファンドを含みます。)と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

- ・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

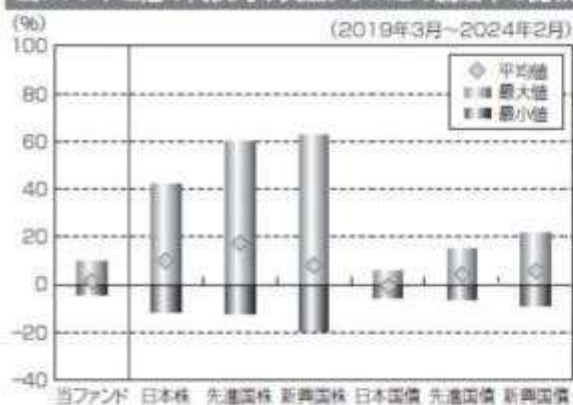
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2024年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

「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	1.4%	9.9%	17.3%	8.0%	-0.7%	4.1%	5.6%
最大値	9.6%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	14.8%	21.5%
最小値	-4.5%	-11.4%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-8.1%	-8.8%

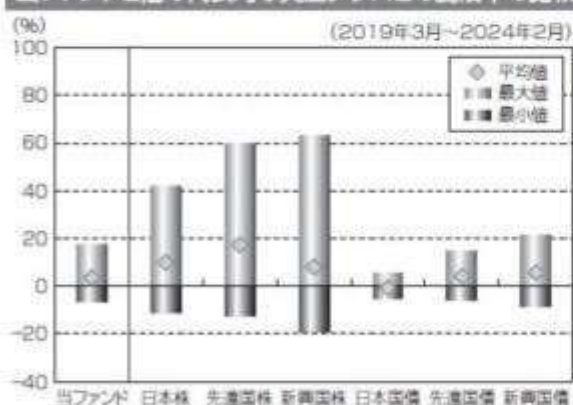
※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※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2019年3月から2024年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「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(%))

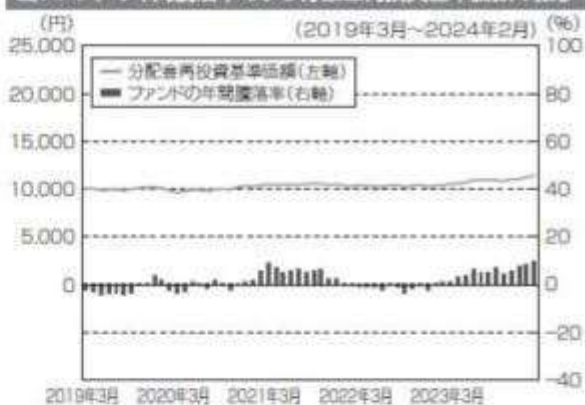
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.4%	9.9%	17.3%	8.0%	-0.7%	4.1%	5.6%
最大値	17.2%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	14.8%	21.5%
最小値	-8.8%	-11.4%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-8.1%	-8.8%

※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2019年3月から2024年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

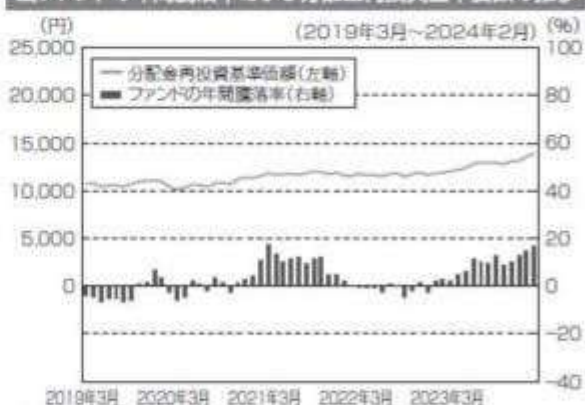


※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2019年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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



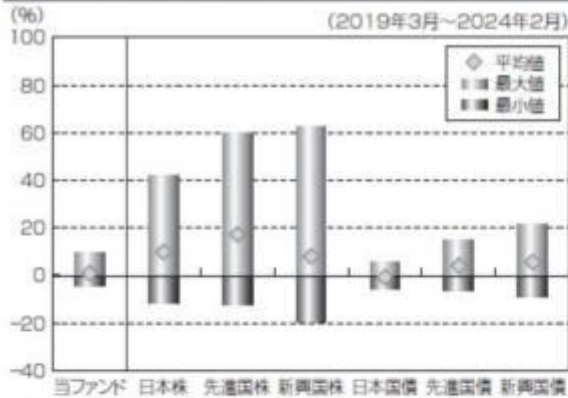
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2019年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

「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	1.5%	9.9%	17.3%	8.0%	-0.7%	4.1%	5.6%
最大値	9.7%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	14.8%	21.5%
最小値	-4.4%	-11.4%	-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2019年3月から2024年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……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・ディバースィファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、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「NFRFC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRFCに帰属します。なお、NFRFCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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。

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、2019年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。
信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

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

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

支払時期

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

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。

個別元本

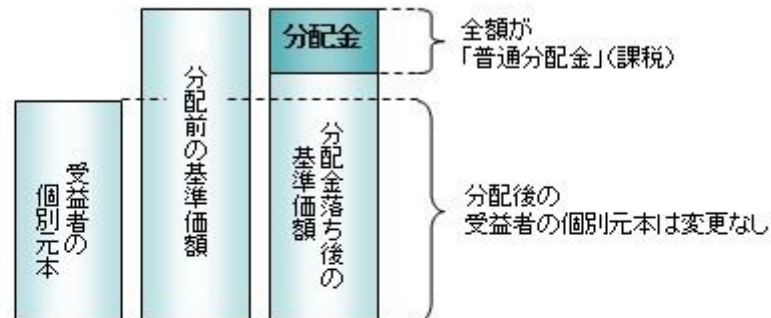
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

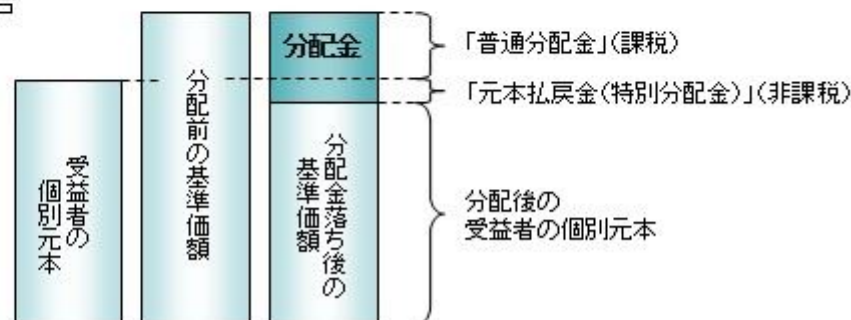
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2024年5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。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年2月2日~2024年2月1日

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
財形株投(一般財形30)	0.58%	0.58%	0.00%
財形株投(一般財形50)	0.58%	0.58%	0.00%
財形株投(年金-住宅財形30)	0.58%	0.58%	0.00%

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準面額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※運用管理費用の内訳等の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【財形株投(一般財形30)】

以下の運用状況は2024年 2月29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	113,969,597	97.50
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,918,704	2.50
合計(純資産総額)		116,888,301	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	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	62,705,976	1.2659	79,383,601	1.2640	79,260,353	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 T O P I X	9,326,932	3.5232	32,860,647	3.7214	34,709,244	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	97.50
合計	97.50

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第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
第30計算期間末	(2024年 2月 1日)	114	114	1.1211	1.1211
	2023年 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	
	9月末日	109		1.0918	
	10月末日	108		1.0800	
	11月末日	111		1.0998	
	12月末日	111		1.0997	
	2024年 1月末日	114		1.1228	
	2月末日	116		1.1377	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	8.24

(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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	7,711,426	9,057,050

【財形株投（一般財形50）】

以下の運用状況は2024年 2月29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	203,018,095	97.44
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		5,327,359	2.56
合計（純資産総額）		208,345,454	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	27,603,839	3.5233	97,256,606	3.7214	102,724,926	49.31
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	79,345,862	1.2659	100,449,092	1.2640	100,293,169	48.14

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.44
合計	97.44

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第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
第30計算期間末 (2024年 2月 1日)	206	206	1.3507	1.3507
2023年 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	
9月末日	203		1.2926	
10月末日	198		1.2717	
11月末日	204		1.3078	
12月末日	206		1.3068	
2024年 1月末日	206		1.3547	
2月末日	208		1.3861	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	14.28

(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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	15,664,055	27,818,749

【財形株投（年金・住宅財形30）】

以下の運用状況は2024年 2月29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	253,680,931	97.51
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		6,486,613	2.49
合計（純資産総額）		260,167,544	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	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	139,804,511	1.2659	176,978,531	1.2640	176,712,901	67.92
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	20,682,547	3.5232	72,868,750	3.7214	76,968,030	29.58

□. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.51
合 計	97.51

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第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
第30計算期間末 (2024年 2月 1日)	258	258	1.1256	1.1256
2023年 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	
9月末日	267		1.0961	
10月末日	264		1.0843	
11月末日	270		1.1042	
12月末日	262		1.1041	
2024年 1月末日	258		1.1273	
2月末日	260		1.1424	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	8.31

(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
第30期	2023年 2月 2日～2024年 2月 1日	15,931,802	28,993,479

(参考)

財形公社債マザーファンド

以下の運用状況は2024年 2月29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	177,953,049	49.97
地方債証券	日本	34,655,940	9.73
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		143,527,089	40.30
合計（純資産総額）		356,136,078	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353回利付国債 （10年）	40,000,000	99.20	39,682,000	98.79	39,518,000	0.100	2028/12/20	11.10
日本	国債証券	第355回利付国債 （10年）	40,000,000	99.04	39,618,400	98.59	39,438,000	0.100	2029/6/20	11.07
日本	国債証券	第357回利付国債 （10年）	40,000,000	98.87	39,549,200	98.40	39,363,600	0.100	2029/12/20	11.05
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	100.59	34,705,275	100.45	34,655,940	0.553	2025/6/19	9.73
日本	国債証券	第142回利付国債 （5年）	20,000,000	100.12	20,024,249	100.12	20,024,249	0.100	2024/12/20	5.62
日本	国債証券	第146回利付国債 （5年）	20,000,000	100.11	20,022,400	99.89	19,978,200	0.100	2025/12/20	5.61
日本	国債証券	第359回利付国債 （10年）	20,000,000	98.53	19,706,400	98.15	19,631,000	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	49.97
地方債証券	9.73
合計	59.70

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2024年 2月29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	60,351,374,550	99.74

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		156,621,178	0.26
合計(純資産総額)		60,507,995,728	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	160,860,000	0.27

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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	874,000	3,456.00	3,020,544,000	3,621.00	3,164,754,000	5.23
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	954,600	1,410.50	1,346,463,300	1,542.00	1,471,993,200	2.43
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	112,600	14,735.00	1,659,161,000	12,945.00	1,457,607,000	2.41
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,700	33,720.00	1,136,364,000	36,870.00	1,242,519,000	2.05
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	66,950.00	1,064,505,000	70,040.00	1,113,636,000	1.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	323,700	2,889.50	935,331,150	3,205.00	1,037,458,500	1.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,300	12,355.00	955,041,500	12,665.00	979,004,500	1.62
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,500	7,682.00	856,543,000	8,344.00	930,356,000	1.54
日本	株式	信越化学工業	化学	143,100	5,990.00	857,169,000	6,387.00	913,979,700	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,748,400	181.00	859,460,400	182.30	865,633,320	1.43
日本	株式	任天堂	その他製品	100,500	8,710.00	875,355,000	8,400.00	844,200,000	1.40
日本	株式	三井物産	卸売業	126,900	6,118.00	776,374,200	6,553.00	831,575,700	1.37
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	113,200	6,668.00	754,817,600	6,516.00	737,611,200	1.22
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,100	6,281.00	760,629,100	6,044.00	731,928,400	1.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,800	8,492.00	669,169,600	8,790.00	692,652,000	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	139,100	4,707.00	654,743,700	4,974.00	691,883,400	1.14
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	388,200	1,719.00	667,315,800	1,782.00	691,772,400	1.14
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	154,900	4,277.00	662,507,300	4,376.00	677,842,400	1.12
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	141,300	4,350.00	614,655,000	4,387.00	619,883,100	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	31,300	18,500.00	579,050,000	19,485.00	609,880,500	1.01
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	211,600	2,705.50	572,483,800	2,801.00	592,691,600	0.98
日本	株式	KDDI	情報・通信業	123,300	4,547.00	560,645,100	4,554.00	561,508,200	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	257,200	1,958.01	503,600,588	1,972.50	507,327,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	86,600	5,247.00	454,390,200	5,363.00	464,435,800	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	144,800	3,025.00	438,020,000	3,023.00	437,730,400	0.72
日本	株式	S M C	機械	4,800	83,220.00	399,456,000	90,150.00	432,720,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	178,900	2,170.50	388,302,450	2,381.50	426,050,350	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,200	21,445.00	411,744,000	21,175.00	406,560,000	0.67

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	174,000	2,076.66	361,340,000	2,230.00	388,020,000	0.64
日本	株式	ディスコ	機械	7,700	43,580.00	335,566,000	48,260.00	371,602,000	0.61

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	0.08
		鉱業	0.31
		建設業	1.98
		食料品	3.10
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.16
		化学	5.75
		医薬品	4.53
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.96
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.45
		電気機器	17.43
		輸送用機器	9.35
		精密機器	2.34
		その他製品	2.34
		電気・ガス業	1.30
		陸運業	2.58
		海運業	0.83
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.52
		卸売業	7.30
		小売業	4.14
銀行業	7.29		
証券、商品先物取引業	0.89		
保険業	2.59		
その他金融業	1.18		
不動産業	1.88		
サービス業	4.55		
合 計			99.74

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2024年03月	買建	6	日本円	158,585,550	160,860,000	0.27

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

参考情報

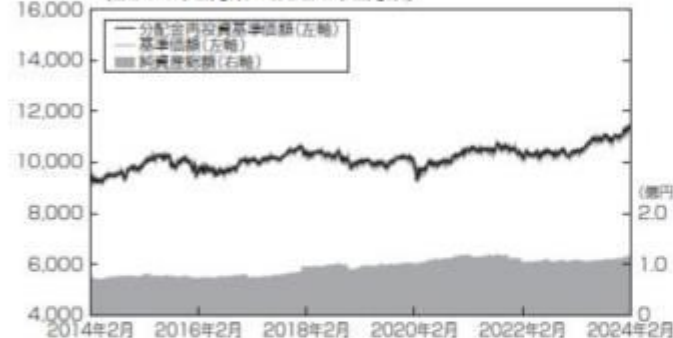
運用実績

2024年2月29日現在

基準価額・純資産の推移

「財形株投（一般財形 30）」

(円) (2014年2月末～2024年2月末)



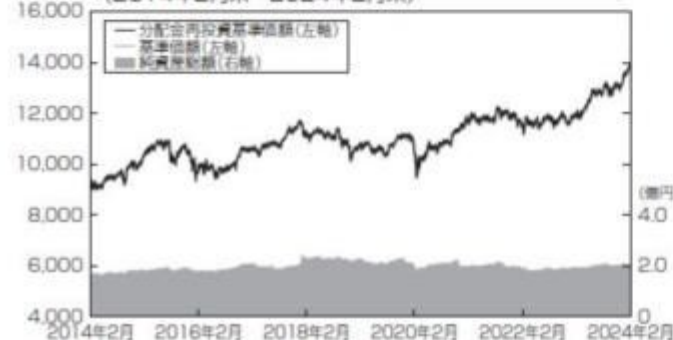
基準価額……………11,377円

純資産総額……………1.16億円

※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、2014年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

「財形株投（一般財形 50）」

(円) (2014年2月末～2024年2月末)



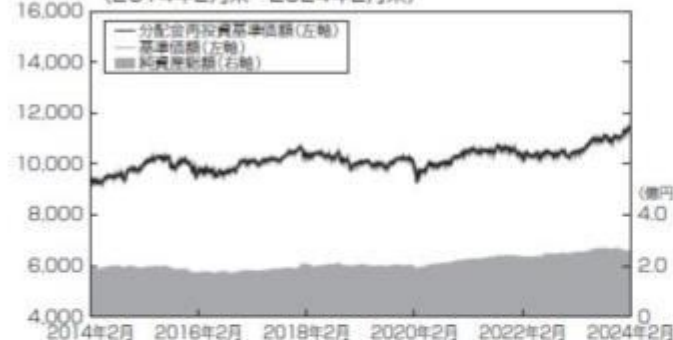
基準価額……………13,861円

純資産総額……………2.08億円

※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、2014年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

「財形株投（年金・住宅財形 30）」

(円) (2014年2月末～2024年2月末)



基準価額……………11,424円

純資産総額……………2.60億円

※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、2014年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである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）」

2020年2月	2021年2月	2022年2月	2023年2月	2024年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	0円	140円

「財形株投（一般財形 50）」

2020年2月	2021年2月	2022年2月	2023年2月	2024年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	0円	140円

「財形株投（年金・住宅財形 30）」

2020年2月	2021年2月	2022年2月	2023年2月	2024年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	0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%	48.14%	67.92%
インデックス マザーファンド TOPIX	29.69%	49.31%	29.58%
現金その他	2.50%	2.56%	2.49%

※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353回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2028年12月20日	11.10%
2 第355回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2029年6月20日	11.07%
3 第357回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2029年12月20日	11.05%

※財形公社債マザーファンドの対純資産総額比です。

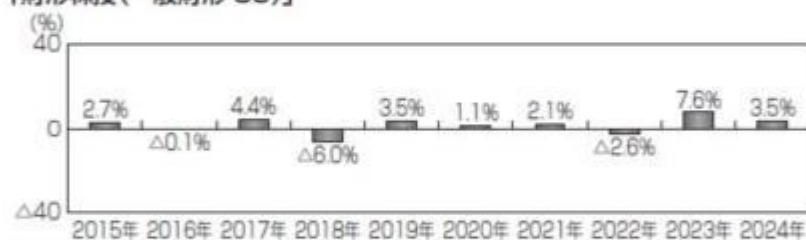
インデックス マザーファンド TOPIX

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	5.23%
2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.43%
3 ソニーグループ	電気機器	2.41%
4 東京エレクトロン	電気機器	2.05%
5 キーエンス	電気機器	1.84%

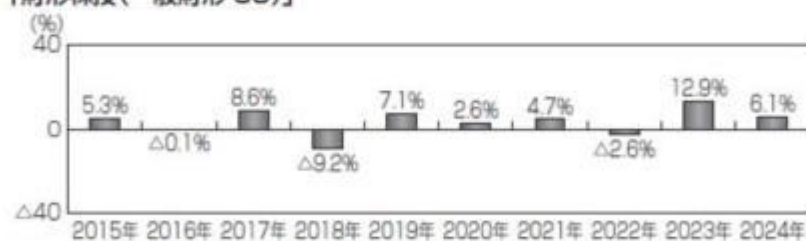
※インデックス マザーファンド TOPIXの対純資産総額比です。

年間収益率の推移

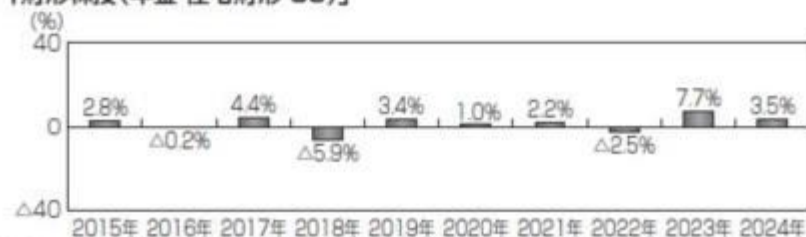
「財形株投(一般財形 30)」



「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。

※2024年は、2024年2月末までの騰落率です。

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

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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の請求

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。

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。

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となります。
- 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となります。

(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

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。

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となります。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。

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となります。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。

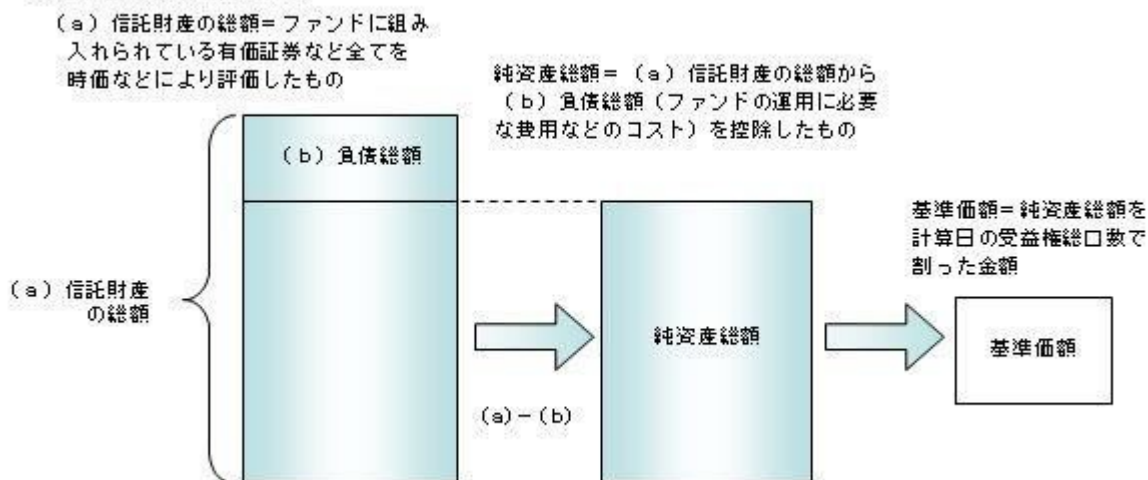
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

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。

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。

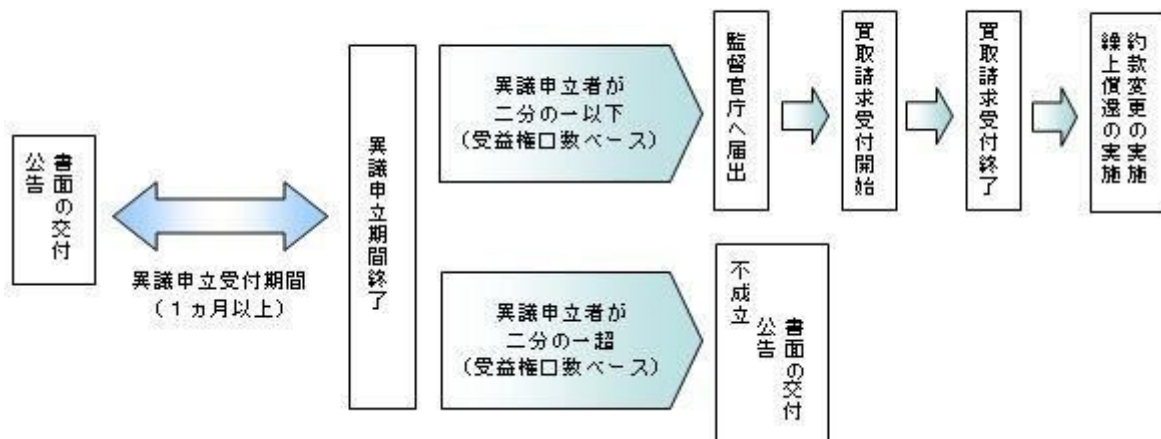
(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 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。
 - 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
 - やむを得ない事情が発生したとき
- この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同

- じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
- イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
- ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
- ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
- ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 償還金について
- 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日まで)から受益者に支払います。
 - 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
- 信託約款の変更
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。
- 異議の申立て
- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。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わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

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/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

します。

- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

< 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30期計算期間(2023年2月2日から2024年2月1日まで)の財務諸表について、PwC Japan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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,057,091	3,275,707
親投資信託受益証券	104,688,986	111,769,155
流動資産合計	107,746,077	115,044,862
資産合計	107,746,077	115,044,862
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	30,538
未払委託者報酬	278,649	287,649
その他未払費用	2,295	2,399
流動負債合計	362,364	320,586
負債合計	362,364	320,586
純資産の部		
元本等		
元本	103,674,070	102,328,446
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,709,643	12,395,830
（分配準備積立金）	5,273,621	13,231,111
元本等合計	107,383,713	114,724,276
純資産合計	107,383,713	114,724,276
負債純資産合計	107,746,077	115,044,862

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29期		第30期	
	自 至	2022年 2月 2日 2023年 2月 1日	自 至	2023年 2月 2日 2024年 2月 1日
営業収益				
受取利息		1		2
有価証券売買等損益		1,522,284		9,221,025
営業収益合計		1,522,285		9,221,027
営業費用				
支払利息		647		663
受託者報酬		58,481		59,690
委託者報酬		812,465		562,242
その他費用		4,543		4,662
営業費用合計		876,136		627,257
営業利益又は営業損失（ ）		646,149		8,593,770
経常利益又は経常損失（ ）		646,149		8,593,770
当期純利益又は当期純損失（ ）		646,149		8,593,770
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（ ）		14,095		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		278,107		601,519
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		278,107		601,519
剰余金減少額又は欠損金増加額		393,239		325,482
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		393,239		325,482
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		51,837		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,709,643		12,395,830

（ 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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2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	7,711,426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	102,328,446口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日		第30期 自 2023年 2月 2日 至 2024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	90,164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	8,410,226円
C 信託約款に定める収益調整金	15,848,809円	C 信託約款に定める収益調整金	16,027,362円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	5,235,294円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	4,820,885円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	21,174,267円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	29,258,473円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,042円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,859円
G 分配金額	51,837円	G 分配金額	0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)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日	第30期 自 2023年 2月 2日 至 2024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

金融商品の時価等に関する事項

	第29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第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

第30期（2024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	8,359,796
合計	8,359,796

（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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2月 1日現在
1口当たり純資産額	1.0358円	1.1211円
(1万口当たり純資産額)	(10,358円)	(11,211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	61,432,080	77,773,013	
	インデックス マザーファンド TOPIX	9,649,223	33,996,142	
合計		71,081,303	111,769,155	

(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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,581,032	5,910,036
親投資信託受益証券	189,930,398	200,978,464
流動資産合計	195,511,430	206,888,500
資産合計	195,511,430	206,888,500
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	56,831
未払委託者報酬	497,073	534,823
未払利息	1	-
その他未払費用	4,173	4,484
流動負債合計	636,506	596,138
負債合計	636,506	596,138
純資産の部		
元本等		
元本	164,885,950	152,731,256
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,988,974	53,561,106
（分配準備積立金）	26,904,604	47,203,308
元本等合計	194,874,924	206,292,362
純資産合計	194,874,924	206,292,362
負債純資産合計	195,511,430	206,888,500

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29期		第30期	
	自 至	2022年 2月 2日 2023年 2月 1日	自 至	2023年 2月 2日 2024年 2月 1日
営業収益				
受取利息		3		5
有価証券売買等損益		5,909,672		27,891,028
営業収益合計		5,909,675		27,891,033
営業費用				
支払利息		1,252		1,383
受託者報酬		103,801		110,637
委託者報酬		1,444,104		1,041,179
その他費用		8,186		8,730
営業費用合計		1,557,343		1,161,929
営業利益又は営業損失（ ）		4,352,332		26,729,104
経常利益又は経常損失（ ）		4,352,332		26,729,104
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,352,332		26,729,104
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（ ）		203,470		2,115,624
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		2,626,497		4,102,317
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		2,626,497		4,102,317
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,141,184		5,143,665
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,141,184		5,143,665
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		82,442		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,988,974		53,561,106

(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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2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	15,664,055円
期中一部解約元本額	20,049,736円	27,818,749円
2. 受益権の総数	164,885,950口	152,731,256口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日	第30期 自 2023年 2月 2日 至 2024年 2月 1日
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	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	4,149,611円	24,613,696円
C 信託約款に定める収益調整金	46,256,637円	45,178,422円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	22,837,435円	22,589,612円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	73,243,683円	92,381,730円
F 分配対象収益(1万口当たり)	4,442円	6,048円
G 分配金額	82,442円	0円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日	第30期 自 2023年 2月 2日 至 2024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

金融商品の時価等に関する事項

	第29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第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

第30期（2024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	24,242,069
合計	24,242,069

（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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2月 1日現在
1口当たり純資産額	1.1819円	1.3507円
(1万口当たり純資産額)	(11,819円)	(13,507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	78,434,949	99,298,645	
	インデックス マザーファンド TOPIX	28,860,076	101,679,819	
合計		107,295,025	200,978,464	

(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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,357,414	7,187,992
親投資信託受益証券	245,382,211	251,725,135
流動資産合計	252,739,625	258,913,127
資産合計	252,739,625	258,913,127
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	74,132
未払委託者報酬	649,090	697,340
未払利息	2	1
その他未払費用	5,458	5,875
流動負債合計	844,744	777,348
負債合計	844,744	777,348
純資産の部		
元本等		
元本	242,386,660	229,324,983
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,508,221	28,810,796
（分配準備積立金）	14,950,211	32,202,526
元本等合計	251,894,881	258,135,779
純資産合計	251,894,881	258,135,779
負債純資産合計	252,739,625	258,913,127

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29期		第30期	
	自	2022年 2月 2日	自	2023年 2月 2日
	至	2023年 2月 1日	至	2024年 2月 1日
営業収益				
受取利息		4		7
有価証券売買等損益		3,643,120		22,344,138
営業収益合計		3,643,124		22,344,145
営業費用				
支払利息		1,674		1,848
受託者報酬		133,776		144,731
委託者報酬		1,842,466		1,361,626
その他費用		10,584		11,470
営業費用合計		1,988,500		1,519,675
営業利益又は営業損失（ ）		1,654,624		20,824,470
経常利益又は経常損失（ ）		1,654,624		20,824,470
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,654,624		20,824,470
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		76,030		1,645,376
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		844,512		1,316,341
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		844,512		1,316,341
剰余金減少額又は欠損金増加額		405,819		1,192,860
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		405,819		1,192,860
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		121,193		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,508,221		28,810,796

(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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2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	15,931,802円
期中一部解約元本額	12,521,696円	28,993,479円
2. 受益権の総数	242,386,660口	229,324,983口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日		第30期 自 2023年 2月 2日 至 2024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	18,953,632円
C 信託約款に定める収益調整金	44,073,269円	C 信託約款に定める収益調整金	42,593,841円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	15,071,404円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	13,248,894円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	59,144,673円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	74,796,367円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,440円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,261円
G 分配金額	121,193円	G 分配金額	0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)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第29期 自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日	第30期 自 2023年 2月 2日 至 2024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

金融商品の時価等に関する事項

	第29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第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

第30期（2024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	18,498,571
合計	18,498,571

（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29期 2023年 2月 1日現在	第30期 2024年 2月 1日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0392円 (10,392円)	1.1256円 (11,256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	138,902,269	175,850,272	
	インデックス マザーファンド TOPIX	21,535,781	75,874,863	
合計		160,438,050	251,725,135	

(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）

	2023年 2月 1日現在	2024年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	120,586,352	139,552,301
国債証券	196,769,400	178,604,917
地方債証券	20,041,344	34,705,275

	2023年 2月 1日現在	2024年 2月 1日現在
未収利息	60,128	43,941
前払費用	109	54
流動資産合計	337,457,333	352,906,488
資産合計	337,457,333	352,906,488
負債の部		
流動負債		
未払利息	37	19
流動負債合計	37	19
負債合計	37	19
純資産の部		
元本等		
元本	267,647,148	278,769,298
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	69,810,148	74,137,171
元本等合計	337,457,296	352,906,469
純資産合計	337,457,296	352,906,469
負債純資産合計	337,457,333	352,906,488

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

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 2月 1日現在	2024年 2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	46,983,969円
期首からの一部解約元本額	30,499,529円	35,861,819円
元本の内訳		
財形株投（一般財形30）	57,611,841円	61,432,080円
財形株投（一般財形50）	74,014,550円	78,434,949円
財形株投（年金・住宅財形30）	136,020,757円	138,902,269円
計	267,647,148円	278,769,298円
2. 受益権の総数	267,647,148口	278,769,298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）

金融商品の状況に関する事項

	自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日	自 2023年 2月 2日 至 2024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

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 2月 1日現在	2024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る場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(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

(2024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	733,717
地方債証券	132,480
合計	601,237

(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)

2023年 2月 1日現在		2024年 2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)

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

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	20,026,517	
	第146回利付国債（5年）	20,000,000	20,022,400	
	第353回利付国債（10年）	40,000,000	39,682,000	
	第355回利付国債（10年）	40,000,000	39,618,400	
	第357回利付国債（10年）	40,000,000	39,549,200	
	第359回利付国債（10年）	20,000,000	19,706,400	
国債証券 合計		180,000,000	178,604,917	
地方債証券	平成27年度第4回京都府公募公債	34,500,000	34,705,275	
地方債証券 合計		34,500,000	34,705,275	
合計		214,500,000	213,310,192	

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）

	2023年 2月 1日現在	2024年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	257,327,383	240,098,002
株式	44,798,911,120	57,215,702,820
派生商品評価勘定	3,136,700	8,726,850
未収配当金	77,391,639	79,717,034
流動資産合計	45,136,766,842	57,544,244,706
資産合計	45,136,766,842	57,544,244,706
負債の部		
流動負債		
前受金	3,410,000	9,879,600
未払金	196,242,740	65,977,692
未払解約金	22,819,967	130,000,000
未払利息	79	33
流動負債合計	222,472,786	205,857,325
負債合計	222,472,786	205,857,325
純資産の部		
元本等		
元本	16,797,664,281	16,274,607,381
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	28,116,629,775	41,063,780,000
元本等合計	44,914,294,056	57,338,387,381
純資産合計	44,914,294,056	57,338,387,381
負債純資産合計	45,136,766,842	57,544,244,706

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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(2) 金融商品取引所等の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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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	2024年 2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	1,652,722,000円
	期首からの一部解約元本額	2,052,643,072円	2,175,778,900円
	元本の内訳		
	インデックスファンドTSP	8,585,771,002円	8,036,944,266円
	財形株投（一般財形30）	11,983,116円	9,649,223円
	財形株投（一般財形50）	36,127,628円	28,860,076円
	財形株投（年金・住宅財形30）	27,623,621円	21,535,781円
	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	7,592,072,236円	7,611,006,620円
	TOPIXインデックスファンド（個人型年金向け）	512,523,130円	541,781,237円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	19,237,955円	15,197,896円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	6,208,760円	4,767,662円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	6,116,833円	4,864,620円
	計	16,797,664,281円	16,274,607,381円
2.	受益権の総数	16,797,664,281口	16,274,607,381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	545,659,800円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2022年 2月 2日 至 2023年 2月 1日	自 2023年 2月 2日 至 2024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

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 2月 1日現在	2024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。	(1)有価証券 同左

	2023年 2月 1日現在	2024年 2月 1日現在
	(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(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

(2024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	12,195,465,446
合計	12,195,465,446

(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)

(2023年 2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	115,120,000	-	118,260,000	3,140,000
合計		115,120,000	-	118,260,000	3,140,000

(2024年 2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	117,795,400	-	126,525,000	8,729,600
合計		117,795,400	-	126,525,000	8,729,600

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として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）

2023年 2月 1日現在		2024年 2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	3.5232円
(1万口当たり純資産額)	(26,738円)	(1万口当たり純資産額)	(35,232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	3,960.00	3,168,000	
ニッスイ	22,300	818.90	18,261,470	
マルハニチロ	3,300	2,914.00	9,616,200	
雪国まいたけ	1,900	963.00	1,829,700	
カネコ種苗	600	1,471.00	882,600	
サカタのタネ	2,500	3,610.00	9,025,000	
ホクト	1,800	1,792.00	3,225,600	
ホクリヨウ	200	1,037.00	207,400	
住石ホールディングス	2,500	1,725.00	4,312,500	
日鉄鉱業	900	5,240.00	4,716,000	
三井松島ホールディングス	1,300	2,810.00	3,653,000	
I N P E X	82,500	2,039.00	168,217,500	
石油資源開発	2,600	6,040.00	15,704,000	
K & O エナジーグループ	1,000	2,241.00	2,241,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	6,522.00	19,566,000	
ミライト・ワン	7,400	1,963.50	14,529,900	
タマホーム	1,400	4,205.00	5,887,000	
サンヨーホームズ	100	760.00	76,000	
日本アクア	400	995.00	398,000	
ファーストコーポレーション	300	796.00	238,800	
ベステラ	300	996.00	298,800	
キャンディル	200	588.00	117,600	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,040.00	208,000	
第一カッター興業	700	1,381.00	966,700	
安藤・間	12,900	1,194.00	15,402,600	
東急建設	7,000	821.00	5,747,000	
コムシスホールディングス	7,100	3,208.00	22,776,800	
ピーアールホールディングス	3,300	373.00	1,230,900	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,977.00	5,060,900	
東建コーポレーション	600	9,490.00	5,694,000	

ソネック	100	940.00	94,000
ヤマウラ	1,100	1,654.00	1,819,400
大成建設	14,600	5,327.00	77,774,200
大林組	55,800	1,366.50	76,250,700
清水建設	44,300	987.90	43,763,970
飛島建設	1,600	1,503.00	2,404,800
長谷工コーポレーション	14,300	1,923.00	27,498,900
松井建設	1,500	833.00	1,249,500
銭高組	100	4,500.00	450,000
鹿島建設	34,600	2,632.00	91,067,200
不動テトラ	1,100	2,319.00	2,550,900
大末建設	300	1,433.00	429,900
鉄建建設	1,100	2,183.00	2,401,300
西松建設	3,000	4,033.00	12,099,000
三井住友建設	11,600	408.00	4,732,800
大豊建設	500	3,835.00	1,917,500
ナカノフドー建設	500	504.00	252,000
奥村組	2,500	5,200.00	13,000,000
東鉄工業	1,900	3,025.00	5,747,500
イチケン	200	2,376.00	475,200
富士ピー・エス	300	446.00	133,800
浅沼組	1,200	4,390.00	5,268,000
戸田建設	21,100	934.10	19,709,510
熊谷組	2,600	3,820.00	9,932,000
北野建設	100	3,135.00	313,500
植木組	200	1,683.00	336,600
矢作建設工業	2,100	1,464.00	3,074,400
日本ハウスホールディングス	3,400	301.00	1,023,400
新日本建設	2,200	1,204.00	2,648,800
東亜道路工業	600	7,010.00	4,206,000
日本道路	1,800	2,077.00	3,738,600
東亜建設工業	1,200	3,870.00	4,644,000
日本国土開発	4,500	538.00	2,421,000
若築建設	600	3,065.00	1,839,000
東洋建設	3,900	1,295.00	5,050,500
五洋建設	22,100	786.30	17,377,230
世紀東急工業	2,000	1,895.00	3,790,000
福田組	600	5,410.00	3,246,000
住友林業	13,500	4,353.00	58,765,500
日本基礎技術	400	489.00	195,600
巴コーポレーション	900	606.00	545,400
大和ハウス工業	43,200	4,487.00	193,838,400

ライト工業	3,200	2,056.00	6,579,200
積水ハウス	47,300	3,317.00	156,894,100
日特建設	1,500	1,170.00	1,755,000
北陸電気工事	1,100	1,263.00	1,389,300
ユアテック	3,400	1,229.00	4,178,600
日本リーテック	1,200	1,293.00	1,551,600
四電工	700	3,610.00	2,527,000
中電工	2,400	2,794.00	6,705,600
関電工	9,800	1,601.00	15,689,800
きんでん	11,000	2,635.00	28,985,000
東京エネシス	1,600	1,040.00	1,664,000
トーエネック	500	4,935.00	2,467,500
住友電設	1,500	3,030.00	4,545,000
日本電設工業	2,900	2,002.00	5,805,800
エクシオグループ	7,600	3,294.00	25,034,400
新日本空調	1,000	2,608.00	2,608,000
九電工	3,400	5,617.00	19,097,800
三機工業	3,400	1,904.00	6,473,600
日揮ホールディングス	15,400	1,707.00	26,287,800
中外炉工業	500	2,578.00	1,289,000
ヤマト	600	985.00	591,000
太平電業	1,000	4,395.00	4,395,000
高砂熱学工業	4,200	3,430.00	14,406,000
三晃金属工業	100	5,060.00	506,000
朝日工業社	700	3,170.00	2,219,000
明星工業	3,000	1,174.00	3,522,000
大気社	1,800	4,415.00	7,947,000
ダイダン	2,100	1,660.00	3,486,000
日比谷総合設備	1,100	2,627.00	2,889,700
フィル・カンパニー	300	783.00	234,900
テスホールディングス	3,400	446.00	1,516,400
インフロニア・ホールディングス	18,000	1,536.50	27,657,000
東洋エンジニアリング	2,300	796.00	1,830,800
レイズネクスト	2,300	1,562.00	3,592,600
ニッポン	4,700	2,272.00	10,678,400
日清製粉グループ本社	14,500	2,102.00	30,479,000
日東富士製粉	300	5,220.00	1,566,000
昭和産業	1,500	3,405.00	5,107,500
鳥越製粉	600	726.00	435,600
中部飼料	2,200	1,206.00	2,653,200
フィード・ワン	2,300	899.00	2,067,700
東洋精糖	100	2,302.00	230,200

日本甜菜製糖	900	2,178.00	1,960,200
D M三井製糖ホールディングス	1,600	3,395.00	5,432,000
塩水港精糖	900	319.00	287,100
ウェルネオシュガー	800	2,336.00	1,868,800
森永製菓	6,700	2,849.50	19,091,650
中村屋	400	3,140.00	1,256,000
江崎グリコ	4,500	4,327.00	19,471,500
名糖産業	600	1,733.00	1,039,800
井村屋グループ	900	2,428.00	2,185,200
不二家	1,100	2,486.00	2,734,600
山崎製パン	10,500	3,551.00	37,285,500
第一屋製パン	200	820.00	164,000
モロゾフ	500	4,140.00	2,070,000
亀田製菓	900	4,225.00	3,802,500
寿スピリッツ	7,400	1,985.50	14,692,700
カルビー	7,200	3,096.00	22,291,200
森永乳業	5,500	3,025.00	16,637,500
六甲バター	1,100	1,344.00	1,478,400
ヤクルト本社	22,400	3,215.00	72,016,000
明治ホールディングス	19,200	3,607.00	69,254,400
雪印メグミルク	3,800	2,314.00	8,793,200
プリマハム	2,100	2,432.00	5,107,200
日本ハム	6,700	5,161.00	34,578,700
林兼産業	300	573.00	171,900
丸大食品	1,600	1,689.00	2,702,400
S Foods	1,700	3,345.00	5,686,500
柿安本店	600	2,583.00	1,549,800
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	4,160.00	9,984,000
サッポロホールディングス	5,200	6,818.00	35,453,600
アサヒグループホールディングス	36,200	5,500.00	199,100,000
キリンホールディングス	65,300	2,115.50	138,142,150
宝ホールディングス	10,700	1,277.50	13,669,250
オエノンホールディングス	4,700	368.00	1,729,600
養命酒製造	500	1,881.00	940,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,300	2,030.50	24,975,150
ライフドリンク カンパニー	200	5,610.00	1,122,000
サントリー食品インターナショナル	11,000	4,849.00	53,339,000
ダイドーグループホールディングス	1,800	3,005.00	5,409,000
伊藤園	5,300	4,327.00	22,933,100
キーコーヒー	1,800	2,056.00	3,700,800
ユニカフェ	300	912.00	273,600
ジャパンフーズ	100	1,335.00	133,500

日清オイリオグループ	2,200	4,540.00	9,988,000
不二製油グループ本社	3,600	2,408.50	8,670,600
かどや製油	100	3,745.00	374,500
J・オイルミルズ	1,800	2,067.00	3,720,600
キッコーマン	10,400	9,188.00	95,555,200
味の素	37,300	6,012.00	224,247,600
ブルドックソース	800	2,144.00	1,715,200
キューピー	8,400	2,634.50	22,129,800
ハウス食品グループ本社	5,400	3,251.00	17,555,400
カゴメ	6,800	3,827.00	26,023,600
焼津水産化学工業	300	1,223.00	366,900
アリアケジャパン	1,600	4,745.00	7,592,000
ピエトロ	100	1,804.00	180,400
エバラ食品工業	400	2,954.00	1,181,600
やまみ	100	3,940.00	394,000
ニチレイ	7,200	3,628.00	26,121,600
東洋水産	7,900	8,140.00	64,306,000
イトアンドホールディングス	800	2,138.00	1,710,400
大冷	100	1,935.00	193,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	1,132.00	792,400
日清食品ホールディングス	16,500	4,776.00	78,804,000
永谷園ホールディングス	800	2,248.00	1,798,400
一正蒲鉾	300	731.00	219,300
フジッコ	1,600	1,990.00	3,184,000
ロック・フィールド	1,900	1,626.00	3,089,400
日本たばこ産業	95,200	3,903.00	371,565,600
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,750.00	1,925,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,858.00	3,143,800
なとり	1,000	2,157.00	2,157,000
イフジ産業	200	1,385.00	277,000
ファーマフーズ	2,300	1,004.00	2,309,200
ユーグレナ	9,700	691.00	6,702,700
紀文食品	1,400	1,190.00	1,666,000
ピックルスホールディングス	900	1,292.00	1,162,800
ミヨシ油脂	300	1,330.00	399,000
理研ビタミン	1,400	2,330.00	3,262,000
片倉工業	1,500	1,759.00	2,638,500
ゲンゼ	1,100	5,390.00	5,929,000
東洋紡	6,900	1,092.00	7,534,800
ユニチカ	5,200	167.00	868,400
富士紡ホールディングス	700	4,410.00	3,087,000
倉敷紡績	1,100	3,120.00	3,432,000

シキボウ	900	1,204.00	1,083,600
日本毛織	4,100	1,487.00	6,096,700
ダイトウボウ	1,200	92.00	110,400
トーア紡コーポレーション	300	421.00	126,300
ダイドーリミテッド	1,000	545.00	545,000
帝国繊維	1,800	2,178.00	3,920,400
帝人	15,300	1,341.50	20,524,950
東レ	106,800	735.00	78,498,000
住江織物	200	2,411.00	482,200
日本フェルト	400	433.00	173,200
日東製網	100	1,613.00	161,300
アツギ	500	535.00	267,500
ダイニック	200	700.00	140,000
セーレン	3,100	2,442.00	7,570,200
ソトー	200	689.00	137,800
東海染工	100	840.00	84,000
小松マテーレ	2,300	820.00	1,886,000
ワコールホールディングス	3,300	3,453.00	11,394,900
ホギメディカル	2,100	3,550.00	7,455,000
クラウディアホールディングス	200	418.00	83,600
T S Iホールディングス	5,200	685.00	3,562,000
マツオカコーポレーション	200	1,607.00	321,400
ワールド	2,300	1,745.00	4,013,500
三陽商会	600	2,708.00	1,624,800
ナイガイ	300	261.00	78,300
オンワードホールディングス	9,400	543.00	5,104,200
ルックホールディングス	500	2,563.00	1,281,500
ゴールドウイン	2,800	9,820.00	27,496,000
デサント	2,800	3,445.00	9,646,000
キング	300	699.00	209,700
ヤマトインターナショナル	600	305.00	183,000
特種東海製紙	900	3,980.00	3,582,000
王子ホールディングス	66,400	574.70	38,160,080
日本製紙	9,000	1,356.00	12,204,000
三菱製紙	1,000	608.00	608,000
北越コーポレーション	7,800	1,419.00	11,068,200
中越パルプ工業	300	1,983.00	594,900
大王製紙	7,100	1,129.50	8,019,450
阿波製紙	200	470.00	94,000
レンゴー	14,500	950.00	13,775,000
トーモク	900	2,243.00	2,018,700
ザ・パック	1,200	3,445.00	4,134,000

北の達人コーポレーション	6,700	225.00	1,507,500
クラレ	23,200	1,531.00	35,519,200
旭化成	107,900	1,107.50	119,499,250
共和レザー	400	819.00	327,600
巴川コーポレーション	200	983.00	196,600
レゾナック・ホールディングス	15,400	2,927.50	45,083,500
住友化学	118,300	328.30	38,837,890
住友精化	800	5,170.00	4,136,000
日産化学	7,500	5,842.00	43,815,000
ラサ工業	600	2,300.00	1,380,000
クレハ	3,500	2,847.00	9,964,500
多木化学	600	3,160.00	1,896,000
テイカ	1,400	1,407.00	1,969,800
石原産業	2,700	1,586.00	4,282,200
片倉コープアグリ	100	1,117.00	111,700
日本曹達	1,900	5,690.00	10,811,000
東ソー	21,300	1,899.00	40,448,700
トクヤマ	5,200	2,254.00	11,720,800
セントラル硝子	1,700	2,756.00	4,685,200
東亜合成	7,700	1,476.00	11,365,200
大阪ソーダ	1,100	10,290.00	11,319,000
関東電化工業	3,100	890.00	2,759,000
デンカ	5,800	2,567.50	14,891,500
信越化学工業	144,600	5,810.00	840,126,000
日本カーバイド工業	700	1,526.00	1,068,200
堺化学工業	1,200	1,901.00	2,281,200
第一稀元素化学工業	1,800	967.00	1,740,600
エア・ウォーター	15,100	1,941.50	29,316,650
日本酸素ホールディングス	15,500	3,754.00	58,187,000
日本化学工業	600	1,957.00	1,174,200
東邦アセチレン	800	374.00	299,200
日本パーカラライジング	7,100	1,200.00	8,520,000
高压ガス工業	2,300	860.00	1,978,000
四国化成ホールディングス	2,000	1,836.00	3,672,000
戸田工業	400	1,553.00	621,200
ステラ ケミファ	900	3,240.00	2,916,000
保土谷化学工業	500	3,570.00	1,785,000
日本触媒	2,300	5,520.00	12,696,000
大日精化工業	1,100	2,775.00	3,052,500
カネカ	4,100	3,565.00	14,616,500
三菱瓦斯化学	11,900	2,393.00	28,476,700
三井化学	13,100	4,353.00	57,024,300

J S R	17,400	4,015.00	69,861,000
東京応化工業	7,600	3,407.00	25,893,200
大阪有機化学工業	1,300	2,912.00	3,785,600
三菱ケミカルグループ	116,600	888.10	103,552,460
K Hネオケム	2,400	2,286.00	5,486,400
ダイセル	20,500	1,443.00	29,581,500
住友ベークライト	2,200	7,337.00	16,141,400
積水化学工業	32,000	2,113.50	67,632,000
日本ゼオン	10,900	1,328.50	14,480,650
アイカ工業	4,000	3,508.00	14,032,000
U B E	7,600	2,421.00	18,399,600
積水樹脂	2,400	2,557.00	6,136,800
タキロンシーアイ	4,100	651.00	2,669,100
旭有機材	1,100	3,960.00	4,356,000
ニチバン	900	1,744.00	1,569,600
リケンテクノス	3,400	933.00	3,172,200
大倉工業	700	2,917.00	2,041,900
積水化成成品工業	2,300	468.00	1,076,400
群栄化学工業	400	3,620.00	1,448,000
タイガースポリマー	300	979.00	293,700
ミライアル	200	1,485.00	297,000
ダイキアクシス	300	721.00	216,300
ダイキョーニシカワ	3,500	741.00	2,593,500
竹本容器	200	786.00	157,200
森六ホールディングス	800	2,793.00	2,234,400
恵和	1,200	1,368.00	1,641,600
日本化薬	12,200	1,272.50	15,524,500
カーリットホールディングス	1,700	962.00	1,635,400
日本精化	1,100	2,799.00	3,078,900
扶桑化学工業	1,700	4,340.00	7,378,000
トリケミカル研究所	1,900	3,655.00	6,944,500
A D E K A	5,600	2,853.00	15,976,800
日油	4,800	6,656.00	31,948,800
新日本理化	1,000	197.00	197,000
ハリマ化成グループ	1,000	897.00	897,000
花王	36,100	5,830.00	210,463,000
第一工業製薬	700	2,718.00	1,902,600
石原ケミカル	700	1,921.00	1,344,700
日華化学	300	896.00	268,800
ニイタカ	200	1,882.00	376,400
三洋化成工業	1,000	4,290.00	4,290,000
有機合成薬品工業	600	283.00	169,800

大日本塗料	1,800	1,178.00	2,120,400
日本ペイントホールディングス	84,600	1,163.50	98,432,100
関西ペイント	15,600	2,467.00	38,485,200
神東塗料	600	127.00	76,200
中国塗料	3,300	1,991.00	6,570,300
日本特殊塗料	500	1,316.00	658,000
藤倉化成	1,900	459.00	872,100
太陽ホールディングス	2,800	3,235.00	9,058,000
D I C	6,200	2,745.00	17,019,000
サカティンクス	3,600	1,432.00	5,155,200
a r t i e n c e	3,500	2,769.00	9,691,500
T & K T O K A	1,500	1,407.00	2,110,500
富士フィルムホールディングス	29,600	9,349.00	276,730,400
資生堂	33,300	4,096.00	136,396,800
ライオン	20,900	1,297.00	27,107,300
高砂香料工業	1,200	3,535.00	4,242,000
マンダム	3,500	1,291.00	4,518,500
ミルボン	2,200	3,544.00	7,796,800
ファンケル	7,000	2,365.00	16,555,000
コーセー	3,300	9,558.00	31,541,400
コタ	1,500	1,599.00	2,398,500
シーボン	100	1,494.00	149,400
ポーラ・オルビスホールディングス	8,200	1,530.50	12,550,100
ノエビアホールディングス	1,400	5,260.00	7,364,000
アジュバンホールディングス	200	931.00	186,200
新日本製薬	900	1,728.00	1,555,200
I - n e	300	2,438.00	731,400
アクシージア	800	866.00	692,800
エステー	1,200	1,544.00	1,852,800
アグロ カネショウ	700	1,333.00	933,100
コニシ	4,600	1,364.00	6,274,400
長谷川香料	3,000	3,335.00	10,005,000
小林製薬	4,700	6,725.00	31,607,500
荒川化学工業	1,400	1,097.00	1,535,800
メック	1,300	4,485.00	5,830,500
日本高純度化学	300	2,649.00	794,700
タカラバイオ	4,300	1,241.00	5,336,300
J C U	1,800	3,740.00	6,732,000
新田ゼラチン	500	767.00	383,500
O A T アグリオ	500	1,948.00	974,000
デクセリアルズ	4,000	4,277.00	17,108,000
アース製薬	1,500	4,605.00	6,907,500

北興化学工業	1,600	1,023.00	1,636,800
大成ラミック	500	2,976.00	1,488,000
クミアイ化学工業	6,400	840.00	5,376,000
日本農薬	2,900	699.00	2,027,100
アキレス	1,000	1,575.00	1,575,000
有沢製作所	2,800	1,127.00	3,155,600
日東電工	10,300	12,775.00	131,582,500
レック	2,100	1,050.00	2,205,000
三光合成	2,000	654.00	1,308,000
きもと	1,200	211.00	253,200
藤森工業	1,300	4,055.00	5,271,500
前澤化成工業	1,000	1,581.00	1,581,000
未来工業	600	4,650.00	2,790,000
ウェーブロックホールディングス	300	680.00	204,000
J S P	1,100	2,170.00	2,387,000
エフピコ	3,000	2,776.00	8,328,000
天馬	1,200	2,288.00	2,745,600
信越ポリマー	3,500	1,654.00	5,789,000
東リ	1,600	346.00	553,600
ニフコ	4,800	3,878.00	18,614,400
バルカー	1,300	4,145.00	5,388,500
ユニ・チャーム	33,200	5,163.00	171,411,600
ショーエイコーポレーション	200	602.00	120,400
協和キリン	19,300	2,310.00	44,583,000
武田薬品工業	141,300	4,306.00	608,437,800
アステラス製薬	140,000	1,692.00	236,880,000
住友ファーマ	11,900	354.00	4,212,600
塩野義製薬	20,100	7,118.00	143,071,800
わかもと製薬	800	208.00	166,400
日本新薬	4,200	5,189.00	21,793,800
中外製薬	50,000	5,310.00	265,500,000
科研製薬	2,700	3,500.00	9,450,000
エーザイ	19,400	6,934.00	134,519,600
ロート製薬	15,500	3,038.00	47,089,000
小野薬品工業	33,900	2,525.50	85,614,450
久光製薬	3,600	4,181.00	15,051,600
持田製薬	1,800	3,320.00	5,976,000
参天製薬	29,100	1,473.00	42,864,300
扶桑薬品工業	600	2,197.00	1,318,200
日本ケミファ	100	1,598.00	159,800
ツムラ	5,000	2,695.50	13,477,500
キッセイ薬品工業	2,700	3,155.00	8,518,500

生化学工業	2,700	768.00	2,073,600
栄研化学	2,900	1,943.00	5,634,700
鳥居薬品	900	3,750.00	3,375,000
JCRファーマ	5,400	1,062.00	5,734,800
東和薬品	2,500	2,620.00	6,550,000
富士製薬工業	1,200	1,986.00	2,383,200
ゼリア新薬工業	2,200	2,042.00	4,492,400
そーせいグループ	5,200	1,422.00	7,394,400
第一三共	139,100	4,650.00	646,815,000
杏林製薬	3,500	1,777.00	6,219,500
大幸薬品	3,300	307.00	1,013,100
ダイト	1,200	1,948.00	2,337,600
大塚ホールディングス	33,200	5,737.00	190,468,400
大正製薬ホールディングス	3,500	8,599.00	30,096,500
ペプチドリーム	7,700	1,256.00	9,671,200
セルソース	500	1,277.00	638,500
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,979.00	3,166,400
サワイグループホールディングス	3,700	5,644.00	20,882,800
日本コークス工業	16,200	124.00	2,008,800
ニチレキ	2,100	2,516.00	5,283,600
ユシロ化学工業	800	1,898.00	1,518,400
ビーピー・カストロール	300	869.00	260,700
富士石油	4,700	379.00	1,781,300
MORESCO	300	1,437.00	431,100
出光興産	88,600	825.20	73,112,720
ENEOSホールディングス	252,700	598.90	151,342,030
コスモエネルギーホールディングス	4,700	6,169.00	28,994,300
横浜ゴム	8,100	3,501.00	28,358,100
TOYO TIRE	9,200	2,468.00	22,705,600
ブリヂストン	46,700	6,334.00	295,797,800
住友ゴム工業	15,600	1,699.00	26,504,400
藤倉コンポジット	1,200	1,440.00	1,728,000
オカモト	800	4,960.00	3,968,000
フコク	900	1,414.00	1,272,600
ニッタ	1,600	3,820.00	6,112,000
住友理工	2,500	1,260.00	3,150,000
三ツ星ベルト	1,900	4,900.00	9,310,000
バンドー化学	2,400	1,764.00	4,233,600
日東紡績	2,000	5,030.00	10,060,000
AGC	14,200	5,535.00	78,597,000
日本板硝子	7,600	603.00	4,582,800
石塚硝子	100	3,800.00	380,000

日本山村硝子	300	1,431.00	429,300
日本電気硝子	6,500	3,285.00	21,352,500
オハラ	800	1,167.00	933,600
住友大阪セメント	2,700	3,704.00	10,000,800
太平洋セメント	9,400	3,041.00	28,585,400
日本ヒューム	1,400	903.00	1,264,200
日本コンクリート工業	3,100	476.00	1,475,600
三谷セキサン	700	5,100.00	3,570,000
アジアパイルホールディングス	2,300	789.00	1,814,700
東海カーボン	14,700	1,032.00	15,170,400
日本カーボン	900	4,450.00	4,005,000
東洋炭素	1,100	4,975.00	5,472,500
ノリタケカンパニーリミテド	900	7,810.00	7,029,000
TOTO	10,500	3,809.00	39,994,500
日本碍子	18,600	1,850.00	34,410,000
日本特殊陶業	13,400	3,991.00	53,479,400
ダントーホールディングス	500	1,163.00	581,500
MARUWA	600	31,050.00	18,630,000
品川リフラクトリーズ	2,000	2,067.00	4,134,000
黒崎播磨	300	13,600.00	4,080,000
ヨータイ	1,000	1,443.00	1,443,000
東京窯業	800	492.00	393,600
ニッカトー	300	598.00	179,400
フジインコーポレーテッド	4,300	2,998.00	12,891,400
クニミネ工業	200	1,015.00	203,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,353.00	270,600
ニチアス	4,000	3,440.00	13,760,000
ニチハ	2,000	3,205.00	6,410,000
日本製鉄	73,500	3,546.00	260,631,000
神戸製鋼所	33,000	2,033.00	67,089,000
合同製鐵	900	5,450.00	4,905,000
JFEホールディングス	45,700	2,326.00	106,298,200
東京製鐵	4,600	1,807.00	8,312,200
共英製鋼	1,900	2,124.00	4,035,600
大和工業	3,100	8,467.00	26,247,700
東京鐵鋼	700	5,450.00	3,815,000
大阪製鐵	800	2,257.00	1,805,600
淀川製鋼所	1,900	3,945.00	7,495,500
中部鋼鈹	1,100	2,475.00	2,722,500
丸一鋼管	5,000	3,816.00	19,080,000
モリ工業	300	4,905.00	1,471,500
大同特殊鋼	10,300	1,646.50	16,958,950

日本高周波鋼業	300	588.00	176,400
日本冶金工業	1,200	4,785.00	5,742,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,559.00	4,094,400
愛知製鋼	900	3,420.00	3,078,000
日本金属	200	887.00	177,400
大太平洋金属	1,400	1,404.00	1,965,600
新日本電工	8,200	286.00	2,345,200
栗本鐵工所	800	3,625.00	2,900,000
虹技	100	1,500.00	150,000
日本鑄鉄管	100	1,212.00	121,200
三菱製鋼	1,200	1,635.00	1,962,000
日亜鋼業	800	330.00	264,000
日本精線	300	5,480.00	1,644,000
エンビプロ・ホールディングス	1,300	597.00	776,100
シンニッタン	900	272.00	244,800
新家工業	200	3,035.00	607,000
大紀アルミニウム工業所	2,100	1,221.00	2,564,100
日本軽金属ホールディングス	4,800	1,749.00	8,395,200
三井金属鉱業	4,800	4,578.00	21,974,400
東邦亜鉛	1,100	1,112.00	1,223,200
三菱マテリアル	11,700	2,710.50	31,712,850
住友金属鉱山	19,100	4,058.00	77,507,800
D O W Aホールディングス	4,100	5,063.00	20,758,300
古河機械金属	2,200	1,925.00	4,235,000
エス・サイエンス	4,400	22.00	96,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	2,778.00	7,778,400
東邦チタニウム	3,400	1,941.00	6,599,400
U A C J	2,300	4,110.00	9,453,000
C Kサンエツ	400	3,935.00	1,574,000
古河電気工業	5,500	2,713.00	14,921,500
住友電気工業	61,400	1,951.50	119,822,100
フジクラ	19,400	1,202.50	23,328,500
S W C C	1,800	3,060.00	5,508,000
タツタ電線	2,900	695.00	2,015,500
カナレ電気	100	1,710.00	171,000
平河ヒューテック	1,100	1,398.00	1,537,800
リョービ	1,800	2,753.00	4,955,400
アーレスティ	800	736.00	588,800
A R Eホールディングス	6,200	1,971.00	12,220,200
稲葉製作所	800	1,501.00	1,200,800
宮地エンジニアリンググループ	800	3,550.00	2,840,000
トーカロ	4,700	1,533.00	7,205,100

アルファC o	300	1,534.00	460,200
SUMCO	29,200	2,223.00	64,911,600
川田テクノロジーズ	400	7,420.00	2,968,000
RS Technologies	1,100	2,883.00	3,171,300
ジェイテックコーポレーション	100	2,018.00	201,800
信和	500	774.00	387,000
東洋製罐グループホールディングス	9,400	2,344.50	22,038,300
ホッカンホールディングス	800	1,760.00	1,408,000
コロナ	900	964.00	867,600
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,873.00	7,469,800
駒井ハルテック	100	2,165.00	216,500
高田機工	100	3,665.00	366,500
三和ホールディングス	16,500	2,247.50	37,083,750
文化シャッター	4,300	1,462.00	6,286,600
三協立山	2,100	907.00	1,904,700
アルインコ	1,300	1,085.00	1,410,500
東洋シャッター	200	742.00	148,400
LIXIL	25,600	1,940.50	49,676,800
日本フィルコン	500	544.00	272,000
ノーリツ	2,700	1,550.00	4,185,000
長府製作所	1,600	2,110.00	3,376,000
リンナイ	7,800	3,269.00	25,498,200
ダイニチ工業	400	715.00	286,000
日東精工	2,400	550.00	1,320,000
三洋工業	100	2,902.00	290,200
岡部	2,900	807.00	2,340,300
ジーテクト	2,100	1,844.00	3,872,400
東プレ	2,900	2,165.00	6,278,500
高周波熱錬	2,500	1,061.00	2,652,500
東京製綱	1,100	1,371.00	1,508,100
サンコール	1,500	479.00	718,500
モリテック スチール	700	283.00	198,100
パイオラックス	2,000	2,513.00	5,026,000
エイチワン	1,700	846.00	1,438,200
日本発條	14,500	1,241.50	18,001,750
中央発條	1,200	731.00	877,200
アドバネクス	100	1,038.00	103,800
立川ブラインド工業	800	1,430.00	1,144,000
三益半導体工業	1,500	3,235.00	4,852,500
日本ドライケミカル	200	2,887.00	577,400
日本製鋼所	4,400	2,377.50	10,461,000
三浦工業	6,700	2,725.00	18,257,500

タクマ	5,400	1,774.00	9,579,600
ツガミ	3,600	1,194.00	4,298,400
オークマ	1,400	6,901.00	9,661,400
芝浦機械	1,600	3,355.00	5,368,000
アマダ	25,600	1,605.00	41,088,000
アイダエンジニアリング	3,700	831.00	3,074,700
F U J I	7,600	2,515.50	19,117,800
牧野フライス製作所	1,800	5,880.00	10,584,000
オーエスジー	7,100	2,036.00	14,455,600
ダイジェット工業	100	824.00	82,400
旭ダイヤモンド工業	3,700	867.00	3,207,900
D M G 森精機	9,700	2,963.50	28,745,950
ソディック	3,900	702.00	2,737,800
ディスコ	7,700	40,000.00	308,000,000
日東工器	800	1,949.00	1,559,200
日進工具	1,500	1,016.00	1,524,000
パンチ工業	700	424.00	296,800
富士ダイス	1,000	714.00	714,000
豊和工業	400	766.00	306,400
リケンN P R	1,800	2,750.00	4,950,000
東洋機械金属	600	703.00	421,800
島精機製作所	2,600	1,425.00	3,705,000
オプトラン	2,700	1,706.00	4,606,200
N C ホールディングス	200	1,534.00	306,800
イワキポンプ	1,100	2,246.00	2,470,600
フリー	1,500	1,327.00	1,990,500
ヤマシンフィルタ	3,900	326.00	1,271,400
日阪製作所	1,800	980.00	1,764,000
やまびこ	2,600	1,677.00	4,360,200
野村マイクロ・サイエンス	500	14,110.00	7,055,000
平田機工	800	6,680.00	5,344,000
P E G A S U S	1,800	444.00	799,200
マルマエ	700	1,856.00	1,299,200
タツモ	1,000	3,185.00	3,185,000
ナプテスコ	10,100	2,814.50	28,426,450
三井海洋開発	2,000	2,265.00	4,530,000
レオン自動機	1,900	1,543.00	2,931,700
S M C	4,800	82,280.00	394,944,000
ホソカワミクロン	1,000	4,670.00	4,670,000
ユニオンツール	700	3,385.00	2,369,500
瑞光	1,200	1,831.00	2,197,200
オイレス工業	2,200	2,135.00	4,697,000

日精エー・エス・ピー機械	600	4,250.00	2,550,000
サトーホールディングス	2,300	2,160.00	4,968,000
技研製作所	1,500	2,150.00	3,225,000
日本エアーテック	800	1,226.00	980,800
カワタ	200	1,030.00	206,000
日精樹脂工業	1,200	1,155.00	1,386,000
オカダアイヨン	300	2,720.00	816,000
ワイエイシイホールディングス	600	2,404.00	1,442,400
小松製作所	75,400	4,134.00	311,703,600
住友重機械工業	9,500	3,811.00	36,204,500
日立建機	6,400	4,047.00	25,900,800
日工	2,400	766.00	1,838,400
巴工業	600	3,700.00	2,220,000
井関農機	1,500	1,173.00	1,759,500
TOWA	1,800	7,610.00	13,698,000
丸山製作所	100	2,738.00	273,800
北川鉄工所	600	1,496.00	897,600
ローツェ	800	16,610.00	13,288,000
タカキタ	300	495.00	148,500
クボタ	84,000	2,229.00	187,236,000
荏原実業	900	3,015.00	2,713,500
三菱化工機	600	3,895.00	2,337,000
月島ホールディングス	2,200	1,364.00	3,000,800
帝国電機製作所	1,100	2,913.00	3,204,300
新東工業	3,300	1,091.00	3,600,300
澁谷工業	1,500	2,497.00	3,745,500
アイチ コーポレーション	2,200	1,183.00	2,602,600
小森コーポレーション	4,000	1,266.00	5,064,000
鶴見製作所	1,200	3,725.00	4,470,000
日本ギア工業	300	701.00	210,300
酒井重工業	300	6,840.00	2,052,000
荏原製作所	6,600	9,260.00	61,116,000
石井鐵工所	100	2,677.00	267,700
西島製作所	1,400	2,531.00	3,543,400
北越工業	1,600	2,480.00	3,968,000
ダイキン工業	19,200	23,345.00	448,224,000
オルガノ	1,900	6,120.00	11,628,000
トーヨーカネツ	600	4,320.00	2,592,000
栗田工業	9,000	5,426.00	48,834,000
椿本チエイン	2,300	4,285.00	9,855,500
大同工業	300	749.00	224,700
木村化工機	1,200	724.00	868,800

アネスト岩田	2,500	1,303.00	3,257,500
ダイフク	27,100	2,869.00	77,749,900
サムコ	400	4,520.00	1,808,000
加藤製作所	400	1,523.00	609,200
油研工業	100	2,290.00	229,000
タダノ	9,300	1,190.50	11,071,650
フジテック	3,800	3,726.00	14,158,800
C K D	4,500	2,517.00	11,326,500
平和	4,800	2,189.00	10,507,200
理想科学工業	1,300	3,005.00	3,906,500
S A N K Y O	3,700	9,074.00	33,573,800
日本金銭機械	2,000	1,483.00	2,966,000
マースグループホールディングス	800	2,641.00	2,112,800
フクシマガリレイ	1,100	5,180.00	5,698,000
オーイズミ	300	453.00	135,900
ダイコク電機	800	3,600.00	2,880,000
竹内製作所	2,900	5,030.00	14,587,000
アマノ	4,600	3,447.00	15,856,200
J U K I	2,500	440.00	1,100,000
サンデン	1,100	181.00	199,100
ジャノメ	1,600	696.00	1,113,600
マックス	2,300	3,240.00	7,452,000
グローリー	3,900	3,054.00	11,910,600
新晃工業	1,600	3,050.00	4,880,000
大和冷機工業	2,500	1,588.00	3,970,000
セガサミーホールディングス	14,400	2,150.50	30,967,200
T P R	2,100	1,992.00	4,183,200
ツバキ・ナカシマ	3,200	749.00	2,396,800
ホシザキ	9,500	5,318.00	50,521,000
大豊工業	1,400	883.00	1,236,200
日本精工	29,800	804.80	23,983,040
N T N	34,900	265.40	9,262,460
ジェイテクト	14,300	1,344.50	19,226,350
不二越	1,200	3,420.00	4,104,000
日本トムソン	4,400	587.00	2,582,800
T H K	9,300	2,822.00	26,244,600
ユーシン精機	1,300	676.00	878,800
前澤給装工業	1,200	1,330.00	1,596,000
イーグル工業	1,800	1,712.00	3,081,600
前澤工業	500	1,079.00	539,500
日本ピラー工業	1,500	4,890.00	7,335,000
キッツ	5,400	1,209.00	6,528,600

マキタ	18,300	3,865.00	70,729,500	
三井E & S	8,000	739.00	5,912,000	
日立造船	14,200	922.00	13,092,400	
三菱重工業	28,100	9,829.00	276,194,900	
I H I	12,000	2,759.50	33,114,000	
スター精密	3,000	1,749.00	5,247,000	
日清紡ホールディングス	12,100	1,216.00	14,713,600	
イビデン	8,400	7,567.00	63,562,800	
コニカミノルタ	35,900	404.30	14,514,370	
ブラザー工業	21,500	2,457.50	52,836,250	
ミネベアミツミ	28,000	3,061.00	85,708,000	
日立製作所	77,300	11,785.00	910,980,500	代用有価証券 8,000株
三菱電機	178,900	2,159.50	386,334,550	
富士電機	9,800	7,768.00	76,126,400	
東洋電機製造	300	1,060.00	318,000	
安川電機	17,500	5,464.00	95,620,000	
シンフォニアテクノロジー	1,800	2,350.00	4,230,000	
明電舎	3,000	2,727.00	8,181,000	
オリジン	200	1,215.00	243,000	
山洋電気	700	6,040.00	4,228,000	
デンヨー	1,200	2,264.00	2,716,800	
PHCホールディングス	3,000	1,525.00	4,575,000	
KOKUSAI ELECTRIC	6,200	3,715.00	23,033,000	
ソシオネクスト	11,700	3,425.00	40,072,500	
東芝テック	2,100	3,050.00	6,405,000	
芝浦メカトロニクス	900	7,130.00	6,417,000	
マブチモーター	7,900	2,545.00	20,105,500	
ニデック	35,500	5,424.00	192,552,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	342.00	342,000	
トレックス・セミコンダクター	800	1,736.00	1,388,800	
東光高岳	1,000	2,426.00	2,426,000	
ダブル・スコープ	4,600	741.00	3,408,600	
ダイヘン	1,600	7,070.00	11,312,000	
ヤーマン	3,100	1,010.00	3,131,000	
JVCケンウッド	12,700	722.00	9,169,400	
ミマキエンジニアリング	1,500	926.00	1,389,000	
I - P E X	1,100	1,785.00	1,963,500	
大崎電気工業	3,500	684.00	2,394,000	
オムロン	12,300	6,611.00	81,315,300	
日東工業	2,200	4,040.00	8,888,000	
I D E C	2,400	2,920.00	7,008,000	
正興電機製作所	300	1,084.00	325,200	

不二電機工業	200	1,141.00	228,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,300	2,119.50	13,352,850
サクサホールディングス	200	2,776.00	555,200
メルコホールディングス	500	3,265.00	1,632,500
テクノメディカ	400	1,947.00	778,800
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	680.00	408,000
日本電気	21,100	9,583.00	202,201,300
富士通	14,800	21,080.00	311,984,000
沖電気工業	7,300	1,043.00	7,613,900
岩崎通信機	400	738.00	295,200
電気興業	700	2,353.00	1,647,100
サンケン電気	1,500	6,748.00	10,122,000
ナカヨ	100	1,163.00	116,300
アイホン	900	2,963.00	2,666,700
ルネサスエレクトロニクス	104,900	2,403.50	252,127,150
セイコーエプソン	20,600	2,149.50	44,279,700
ワコム	12,200	686.00	8,369,200
アルバック	3,500	7,345.00	25,707,500
アクセル	700	2,173.00	1,521,100
E I Z O	1,200	5,150.00	6,180,000
ジャパンディスプレイ	69,300	20.00	1,386,000
日本信号	3,700	944.00	3,492,800
京三製作所	3,400	465.00	1,581,000
能美防災	2,200	2,297.00	5,053,400
ホーチキ	1,200	1,990.00	2,388,000
星和電機	300	477.00	143,100
エレコム	3,800	1,712.00	6,505,600
パナソニック ホールディングス	189,900	1,382.00	262,441,800
シャープ	27,100	980.00	26,558,000
アンリツ	11,300	1,183.50	13,373,550
富士通ゼネラル	4,600	2,145.00	9,867,000
ソニーグループ	112,600	14,390.00	1,620,314,000
T D K	25,500	7,850.00	200,175,000
帝国通信工業	700	1,962.00	1,373,400
タムラ製作所	6,400	521.00	3,334,400
アルプスアルパイン	14,300	1,084.00	15,501,200
池上通信機	200	902.00	180,400
日本電波工業	1,900	1,188.00	2,257,200
鈴木	900	1,206.00	1,085,400
メイコー	1,600	3,960.00	6,336,000
日本トリム	400	3,145.00	1,258,000
ローランド ディー . ジー .	900	3,870.00	3,483,000

フォスター電機	1,200	1,085.00	1,302,000	
S M K	400	2,528.00	1,011,200	
ヨコオ	1,400	1,414.00	1,979,600	
ホシデン	3,600	1,811.00	6,519,600	
ヒロセ電機	2,400	17,305.00	41,532,000	
日本航空電子工業	3,900	2,520.00	9,828,000	
T O A	1,800	1,144.00	2,059,200	
マクセル	3,600	1,587.00	5,713,200	
古野電気	2,100	2,079.00	4,365,900	
スミダコーポレーション	2,200	1,144.00	2,516,800	
アイコム	600	3,695.00	2,217,000	
リオン	700	2,591.00	1,813,700	
横河電機	17,600	2,870.00	50,512,000	
新電元工業	600	3,130.00	1,878,000	
アズビル	11,000	4,814.00	52,954,000	
東亜ディーケーケー	300	942.00	282,600	
日本光電工業	6,800	4,496.00	30,572,800	
チノー	700	2,389.00	1,672,300	
共和電業	700	419.00	293,300	
日本電子材料	1,000	1,819.00	1,819,000	
堀場製作所	3,000	12,140.00	36,420,000	
アドバンテスト	45,600	5,943.00	271,000,800	
小野測器	300	459.00	137,700	
エスペック	1,300	2,520.00	3,276,000	
キーエンス	15,900	66,520.00	1,057,668,000	代用有価証券 1,600株
日置電機	800	6,610.00	5,288,000	
シスメックス	13,700	7,909.00	108,353,300	
日本マイクロニクス	2,800	4,500.00	12,600,000	
メガチップス	1,300	4,750.00	6,175,000	
O B A R A G R O U P	900	3,980.00	3,582,000	
澤藤電機	100	1,303.00	130,300	
原田工業	300	751.00	225,300	
コーセル	1,700	1,468.00	2,495,600	
イリソ電子工業	1,500	3,370.00	5,055,000	
オブテックスグループ	2,900	1,851.00	5,367,900	
千代田インテグレ	600	2,738.00	1,642,800	
レーザーテック	7,300	37,780.00	275,794,000	
スタンレー電気	10,200	2,769.00	28,243,800	
ウシオ電機	8,100	2,062.00	16,702,200	
岡谷電機産業	600	286.00	171,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	700	534.00	373,800	
エノモト	200	1,584.00	316,800	

日本セラミック	1,300	2,681.00	3,485,300
遠藤照明	300	1,544.00	463,200
古河電池	1,200	921.00	1,105,200
双信電機	300	304.00	91,200
山一電機	1,400	2,098.00	2,937,200
図研	1,400	4,080.00	5,712,000
日本電子	4,000	6,713.00	26,852,000
カシオ計算機	11,500	1,262.00	14,513,000
ファナック	77,600	4,003.00	310,632,800
日本シイエムケイ	3,400	742.00	2,522,800
エンプラス	500	9,860.00	4,930,000
大真空	2,400	905.00	2,172,000
ローム	29,400	2,591.50	76,190,100
浜松ホトニクス	12,800	5,801.00	74,252,800
三井ハイテック	1,400	6,895.00	9,653,000
新光電気工業	5,600	5,442.00	30,475,200
京セラ	98,900	2,159.00	213,525,100
太陽誘電	7,700	3,588.00	27,627,600
村田製作所	144,800	2,999.50	434,327,600
双葉電子工業	3,000	506.00	1,518,000
北陸電気工業	300	1,415.00	424,500
ニチコン	4,200	1,274.00	5,350,800
日本ケミコン	1,700	1,342.00	2,281,400
K O A	2,400	1,512.00	3,628,800
市光工業	2,900	583.00	1,690,700
小糸製作所	16,500	2,230.00	36,795,000
ミツバ	3,000	1,089.00	3,267,000
S C R E E Nホールディングス	5,400	15,255.00	82,377,000
キャノン電子	1,800	2,112.00	3,801,600
キャノン	79,400	4,034.00	320,299,600
リコー	39,900	1,154.00	46,044,600
象印マホービン	4,300	1,436.00	6,174,800
M U T O Hホールディングス	100	2,142.00	214,200
東京エレクトロン	33,700	27,640.00	931,468,000
イノテック	1,100	1,827.00	2,009,700
トヨタ紡織	6,700	2,442.00	16,361,400
芦森工業	200	2,281.00	456,200
ユニプレス	2,900	1,044.00	3,027,600
豊田自動織機	13,600	12,570.00	170,952,000
モリタホールディングス	2,800	1,534.00	4,295,200
三櫻工業	2,400	843.00	2,023,200
デンソー	131,300	2,295.00	301,333,500

東海理化電機製作所	4,500	2,314.00	10,413,000	
川崎重工業	13,000	3,289.00	42,757,000	
名村造船所	4,000	1,371.00	5,484,000	
日本車輛製造	500	2,221.00	1,110,500	
三菱ロジスネクスト	2,600	1,510.00	3,926,000	
近畿車輛	100	2,041.00	204,100	
日産自動車	214,800	585.60	125,786,880	
いすゞ自動車	46,300	2,051.00	94,961,300	
トヨタ自動車	874,000	2,945.00	2,573,930,000	代用有価証券 87,000株
日野自動車	23,900	489.10	11,689,490	
三菱自動車工業	62,100	472.60	29,348,460	
エフテック	500	655.00	327,500	
レシップホールディングス	300	665.00	199,500	
G M B	200	1,214.00	242,800	
ファルテック	200	543.00	108,600	
武蔵精密工業	3,900	1,683.00	6,563,700	
日産車体	1,600	967.00	1,547,200	
新明和工業	4,600	1,210.00	5,566,000	
極東開発工業	2,600	2,015.00	5,239,000	
トピー工業	1,300	2,929.00	3,807,700	
ティラド	400	3,605.00	1,442,000	
タチエス	2,900	2,001.00	5,802,900	
N O K	6,200	1,957.50	12,136,500	
フタバ産業	4,300	914.00	3,930,200	
カヤバ	1,500	5,140.00	7,710,000	
大同メタル工業	3,100	549.00	1,701,900	
プレス工業	6,400	650.00	4,160,000	
ミクニ	900	490.00	441,000	
太平洋工業	3,700	1,477.00	5,464,900	
アイシン	12,300	5,593.00	68,793,900	
マツダ	52,600	1,802.00	94,785,200	
今仙電機製作所	500	662.00	331,000	
本田技研工業	388,200	1,644.50	638,394,900	
スズキ	29,200	6,845.00	199,874,000	
S U B A R U	49,300	2,938.00	144,843,400	
安永	300	663.00	198,900	
ヤマハ発動機	68,800	1,394.50	95,941,600	
T B K	800	402.00	321,600	
エクセディ	2,600	2,862.00	7,441,200	
豊田合成	4,600	2,881.00	13,252,600	
愛三工業	2,600	1,426.00	3,707,600	
盟和産業	100	1,030.00	103,000	

日本プラスト	600	564.00	338,400
ヨロズ	1,500	957.00	1,435,500
エフ・シー・シー	2,800	1,948.00	5,454,400
シマノ	6,400	20,940.00	134,016,000
テイ・エス テック	5,700	1,900.00	10,830,000
ジャムコ	800	1,584.00	1,267,200
テルモ	44,500	5,015.00	223,167,500
クリエートメディック	200	895.00	179,000
日機装	3,700	1,106.00	4,092,200
日本エム・ディ・エム	1,300	730.00	949,000
島津製作所	21,100	4,060.00	85,666,000
JMS	1,500	526.00	789,000
長野計器	1,200	2,265.00	2,718,000
ブイ・テクノロジー	800	2,680.00	2,144,000
東京計器	1,200	1,804.00	2,164,800
愛知時計電機	700	2,813.00	1,969,100
インターアクション	1,000	1,103.00	1,103,000
オーバル	600	568.00	340,800
東京精密	3,200	9,751.00	31,203,200
マニー	6,400	2,061.00	13,190,400
ニコン	23,000	1,447.50	33,292,500
トプコン	7,700	1,750.00	13,475,000
オリンパス	98,000	2,165.50	212,219,000
理研計器	1,100	7,620.00	8,382,000
タムロン	1,000	5,560.00	5,560,000
HOYA	31,300	18,550.00	580,615,000
シード	400	776.00	310,400
ノーリツ鋼機	1,500	3,280.00	4,920,000
A & Dホロンホールディングス	2,300	2,066.00	4,751,800
朝日インテック	19,400	2,844.50	55,183,300
シチズン時計	14,700	945.00	13,891,500
リズム	200	3,435.00	687,000
大研医器	600	547.00	328,200
メニコン	5,500	2,112.50	11,618,750
シンシア	100	592.00	59,200
松風	700	2,856.00	1,999,200
セイコーグループ	2,200	2,610.00	5,742,000
ニプロ	13,300	1,193.00	15,866,900
KYORITSU	1,100	204.00	224,400
中本パックス	300	1,740.00	522,000
スノーピーク	2,300	879.00	2,021,700
パラマウントベッドホールディングス	3,300	2,677.00	8,834,100

トランザクション	1,100	2,515.00	2,766,500
粧美堂	200	757.00	151,400
ニホンフラッシュ	1,500	937.00	1,405,500
前田工織	1,400	3,185.00	4,459,000
永大産業	900	234.00	210,600
アートネイチャー	1,500	792.00	1,188,000
フルヤ金属	400	9,190.00	3,676,000
バンダイナムコホールディングス	43,600	3,106.00	135,421,600
アイフィスジャパン	200	607.00	121,400
SHOEI	3,600	1,950.00	7,020,000
フランスベッドホールディングス	2,100	1,399.00	2,937,900
パイロットコーポレーション	2,200	4,136.00	9,099,200
萩原工業	1,100	1,527.00	1,679,700
フジシールインターナショナル	3,200	1,763.00	5,641,600
タカラトミー	7,200	2,385.00	17,172,000
広済堂ホールディングス	4,100	720.00	2,952,000
エステールホールディングス	200	642.00	128,400
タカノ	300	1,004.00	301,200
プロネクサス	1,700	1,312.00	2,230,400
ホクシン	600	114.00	68,400
ウッドワン	300	1,022.00	306,600
TOPPANホールディングス	19,600	3,999.00	78,380,400
大日本印刷	17,400	4,183.00	72,784,200
共同印刷	500	3,365.00	1,682,500
NISSHA	2,700	1,621.00	4,376,700
光村印刷	100	1,558.00	155,800
TAKARA & COMPANY	900	2,831.00	2,547,900
アシックス	13,600	4,486.00	61,009,600
ツツミ	400	2,118.00	847,200
ローランド	1,200	4,895.00	5,874,000
小松ウオール工業	700	3,275.00	2,292,500
ヤマハ	10,000	3,224.00	32,240,000
河合楽器製作所	500	3,560.00	1,780,000
クリナップ	1,600	758.00	1,212,800
ピジョン	10,100	1,619.50	16,356,950
キングジム	1,400	874.00	1,223,600
リンテック	3,200	2,809.00	8,988,800
イトーキ	3,300	1,518.00	5,009,400
任天堂	100,500	8,310.00	835,155,000
三菱鉛筆	2,300	1,981.00	4,556,300
タカラスタンダード	3,400	1,906.00	6,480,400
コクヨ	6,500	2,373.00	15,424,500

ナカバヤシ	1,700	545.00	926,500
グローブライド	1,400	2,053.00	2,874,200
オカムラ	4,800	2,221.00	10,660,800
美津濃	1,600	4,420.00	7,072,000
東京電力ホールディングス	143,500	754.50	108,270,750
中部電力	58,700	1,942.00	113,995,400
関西電力	61,500	1,939.50	119,279,250
中国電力	27,600	988.00	27,268,800
北陸電力	16,300	720.30	11,740,890
東北電力	41,900	978.00	40,978,200
四国電力	14,800	1,043.50	15,443,800
九州電力	36,700	1,198.00	43,966,600
北海道電力	15,400	664.20	10,228,680
沖縄電力	4,100	1,101.00	4,514,100
電源開発	13,100	2,528.00	33,116,800
エフオン	1,200	451.00	541,200
イーレックス	2,800	787.00	2,203,600
レノバ	4,300	1,221.00	5,250,300
東京瓦斯	33,700	3,429.00	115,557,300
大阪瓦斯	32,300	3,109.00	100,420,700
東邦瓦斯	6,900	2,983.00	20,582,700
北海道瓦斯	1,000	2,321.00	2,321,000
広島ガス	3,400	391.00	1,329,400
西部ガスホールディングス	1,700	1,902.00	3,233,400
静岡ガス	3,200	999.00	3,196,800
メタウォーター	1,900	2,265.00	4,303,500
SBSホールディングス	1,400	2,481.00	3,473,400
東武鉄道	17,500	3,909.00	68,407,500
相鉄ホールディングス	5,700	2,724.00	15,526,800
東急	44,600	1,729.50	77,135,700
京浜急行電鉄	19,700	1,277.00	25,156,900
小田急電鉄	26,300	2,242.00	58,964,600
京王電鉄	7,600	4,309.00	32,748,400
京成電鉄	10,300	6,773.00	69,761,900
富士急行	2,000	4,300.00	8,600,000
東日本旅客鉄道	29,300	8,797.00	257,752,100
西日本旅客鉄道	18,900	6,316.00	119,372,400
東海旅客鉄道	61,300	3,655.00	224,051,500
西武ホールディングス	19,300	2,080.50	40,153,650
鴻池運輸	2,700	1,970.00	5,319,000
西日本鉄道	4,300	2,461.00	10,582,300
ハマキョウレックス	1,400	4,035.00	5,649,000

サカイ引越センター	1,800	2,775.00	4,995,000
近鉄グループホールディングス	15,900	4,556.00	72,440,400
阪急阪神ホールディングス	21,200	4,507.00	95,548,400
南海電気鉄道	7,100	2,887.00	20,497,700
京阪ホールディングス	8,800	3,647.00	32,093,600
神戸電鉄	400	2,898.00	1,159,200
名古屋鉄道	16,400	2,269.00	37,211,600
山陽電気鉄道	1,200	2,169.00	2,602,800
アルプス物流	1,300	1,784.00	2,319,200
ヤマトホールディングス	20,300	2,548.50	51,734,550
山九	4,100	5,450.00	22,345,000
丸運	400	277.00	110,800
丸全昭和運輸	1,000	4,100.00	4,100,000
センコーグループホールディングス	8,400	1,159.00	9,735,600
トナミホールディングス	400	4,715.00	1,886,000
ニッコンホールディングス	5,100	3,190.00	16,269,000
日本石油輸送	100	2,867.00	286,700
福山通運	1,800	4,170.00	7,506,000
セイノーホールディングス	8,900	2,162.50	19,246,250
エスライングループ本社	200	873.00	174,600
神奈川中央交通	500	3,095.00	1,547,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	4,100	1,496.00	6,133,600
C & F ロジホールディングス	1,500	1,740.00	2,610,000
九州旅客鉄道	11,200	3,303.00	36,993,600
S Gホールディングス	26,700	1,904.50	50,850,150
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,400	8,750.00	47,250,000
日本郵船	45,600	5,100.00	232,560,000
商船三井	34,500	5,317.00	183,436,500
川崎汽船	12,800	7,071.00	90,508,800
N S ユナイテッド海運	900	5,180.00	4,662,000
飯野海運	5,800	1,327.00	7,696,600
乾汽船	1,900	1,100.00	2,090,000
日本航空	39,000	2,867.00	111,813,000
A N Aホールディングス	43,200	3,309.00	142,948,800
パスコ	200	1,841.00	368,200
ランコム	500	6,970.00	3,485,000
日新	1,200	2,679.00	3,214,800
三菱倉庫	3,900	4,538.00	17,698,200
三井倉庫ホールディングス	1,500	4,960.00	7,440,000
住友倉庫	4,300	2,696.00	11,592,800
澁澤倉庫	700	3,120.00	2,184,000
東陽倉庫	200	1,521.00	304,200

日本トランスシティ	3,200	627.00	2,006,400
ケイヒン	100	1,905.00	190,500
中央倉庫	900	1,171.00	1,053,900
川西倉庫	200	1,132.00	226,400
安田倉庫	1,100	1,235.00	1,358,500
ファイブホールディングス	100	1,226.00	122,600
東洋埠頭	200	1,402.00	280,400
上組	7,300	3,431.00	25,046,300
サンリツ	200	788.00	157,600
キムラユニティー	400	1,566.00	626,400
キューソー流通システム	700	929.00	650,300
東海運	400	294.00	117,600
エーアイティー	1,000	1,913.00	1,913,000
内外トランスライン	700	2,448.00	1,713,600
日本コンセプト	600	1,735.00	1,041,000
NEC ネットエスアイ	6,200	2,414.00	14,966,800
クロスキャット	1,000	1,192.00	1,192,000
システナ	24,100	298.00	7,181,800
デジタルアーツ	1,000	4,665.00	4,665,000
日鉄ソリューションズ	2,700	4,870.00	13,149,000
キューブシステム	900	1,120.00	1,008,000
コア	700	1,810.00	1,267,000
手間いらず	300	2,756.00	826,800
ラクーンホールディングス	1,200	658.00	789,600
ソリトンシステムズ	800	1,411.00	1,128,800
ソフトクリエイトホールディングス	1,300	1,756.00	2,282,800
T I S	17,400	3,284.00	57,141,600
テクミラホールディングス	300	442.00	132,600
グリー	5,400	578.00	3,121,200
GMOペパボ	200	1,190.00	238,000
コーエーテクモホールディングス	10,000	1,787.00	17,870,000
三菱総合研究所	800	5,010.00	4,008,000
ボルテージ	200	270.00	54,000
電算	100	1,500.00	150,000
A G S	300	931.00	279,300
ファインデックス	1,300	1,039.00	1,350,700
ブレインパッド	1,300	1,135.00	1,475,500
K L a b	3,000	360.00	1,080,000
ポルトゥウィンホールディングス	2,700	491.00	1,325,700
ネクソン	35,700	2,306.00	82,324,200
アイスタイル	5,200	406.00	2,111,200
エムアップホールディングス	2,000	1,007.00	2,014,000

エイチーム	1,000	555.00	555,000
エニグモ	2,000	370.00	740,000
テクノスジャパン	600	631.00	378,600
e n i s h	700	180.00	126,000
コロプラ	6,200	628.00	3,893,600
ブロードリーフ	7,600	624.00	4,742,400
クロス・マーケティンググループ	400	567.00	226,800
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,041.00	1,041,000
メディアドゥ	700	1,247.00	872,900
じげん	4,700	525.00	2,467,500
ブイキューブ	1,900	300.00	570,000
エンカレッジ・テクノロジー	200	595.00	119,000
サイバーリンクス	300	803.00	240,900
フィックスターズ	1,800	1,681.00	3,025,800
CARTA HOLDINGS	800	1,509.00	1,207,200
オブティム	1,700	952.00	1,618,400
セレス	700	1,145.00	801,500
S H I F T	1,100	26,455.00	29,100,500
ティーガイア	1,700	2,023.00	3,439,100
セック	200	5,370.00	1,074,000
テクマトリックス	2,900	1,927.00	5,588,300
プロシップ	800	1,417.00	1,133,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,200	2,454.00	10,306,800
GMOペイメントゲートウェイ	3,200	8,727.00	27,926,400
ザッパラス	200	434.00	86,800
システムリサーチ	600	3,500.00	2,100,000
インターネットイニシアティブ	7,600	2,906.00	22,085,600
さくらインターネット	1,800	3,810.00	6,858,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,761.00	1,380,500
S R Aホールディングス	800	3,770.00	3,016,000
システムインテグレータ	200	427.00	85,400
朝日ネット	1,700	628.00	1,067,600
e B A S E	2,300	745.00	1,713,500
アバントグループ	2,000	1,405.00	2,810,000
アドソル日進	700	1,572.00	1,100,400
ODKソリューションズ	200	604.00	120,800
フリービット	700	1,463.00	1,024,100
コムチュア	2,300	1,883.00	4,330,900
アステリア	1,300	583.00	757,900
アイル	800	3,275.00	2,620,000
マークラインズ	900	2,992.00	2,692,800
メディカル・データ・ビジョン	1,900	631.00	1,198,900

g u m i	2,600	396.00	1,029,600
ショーケース	200	332.00	66,400
モバイルファクトリー	200	752.00	150,400
テラスカイ	700	1,482.00	1,037,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,747.00	1,397,600
P C Iホールディングス	300	1,004.00	301,200
アイビーシー	100	479.00	47,900
ネオジャパン	600	1,053.00	631,800
P R T I M E S	300	2,120.00	636,000
ラクス	7,500	2,470.50	18,528,750
ランドコンピュータ	400	876.00	350,400
ダブルスタンダード	500	1,614.00	807,000
オープンドア	900	858.00	772,200
マイネット	200	281.00	56,200
アカツキ	800	2,524.00	2,019,200
U b i c o mホールディングス	500	1,451.00	725,500
カナミックネットワーク	1,700	412.00	700,400
ノムラシステムコーポレーション	800	113.00	90,400
チェンジホールディングス	3,500	1,339.00	4,686,500
シンクロ・フード	500	638.00	319,000
オークネット	600	2,138.00	1,282,800
キャピタル・アセット・プランニング	200	754.00	150,800
セグエグループ	200	927.00	185,400
エイトレッド	100	1,409.00	140,900
マクロミル	3,100	785.00	2,433,500
ビーグリー	200	1,262.00	252,400
オロ	600	2,936.00	1,761,600
ユーザーローカル	700	2,022.00	1,415,400
テモナ	200	258.00	51,600
ニーズウェル	400	763.00	305,200
マネーフォワード	3,500	5,704.00	19,964,000
サインポスト	300	492.00	147,600
S u n A s t e r i s k	1,200	968.00	1,161,600
プラスアルファ・コンサルティング	1,000	2,584.00	2,584,000
電算システムホールディングス	700	2,980.00	2,086,000
A p p i e r G r o u p	5,400	1,700.00	9,180,000
ビジョナル	1,200	9,100.00	10,920,000
ソルクシーズ	600	404.00	242,400
フェイス	200	483.00	96,600
プロトコーポレーション	1,800	1,330.00	2,394,000
ハイマックス	500	1,413.00	706,500
野村総合研究所	35,400	4,225.00	149,565,000

C Eホールディングス	400	609.00	243,600
日本システム技術	600	3,325.00	1,995,000
インテージホールディングス	1,800	1,754.00	3,157,200
東邦システムサイエンス	600	1,272.00	763,200
ソースネクスト	7,300	146.00	1,065,800
インフォコム	2,100	2,430.00	5,103,000
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,628.00	6,307,200
HEROZ	600	1,630.00	978,000
ラクスル	3,900	1,145.00	4,465,500
メルカリ	7,800	2,366.50	18,458,700
I P S	500	2,043.00	1,021,500
F I G	800	304.00	243,200
システムサポート	600	1,944.00	1,166,400
イーソル	1,200	569.00	682,800
東海ソフト	100	1,171.00	117,100
ウイングアーク1 s t	1,700	2,833.00	4,816,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,202.00	480,800
サーバーワークス	300	3,695.00	1,108,500
東名	100	2,299.00	229,900
ヴィッツ	100	821.00	82,100
トピラシステムズ	200	881.00	176,200
S a n s a n	5,200	1,400.00	7,280,000
L i n k - U	200	626.00	125,200
ギフトィ	1,400	1,585.00	2,219,000
メドレー	2,200	4,590.00	10,098,000
ベース	600	3,255.00	1,953,000
J M D C	2,700	3,850.00	10,395,000
フォーカスシステムズ	1,100	1,050.00	1,155,000
クレスコ	1,300	1,888.00	2,454,400
フジ・メディア・ホールディングス	15,300	1,760.00	26,928,000
オービック	5,300	22,795.00	120,813,500
ジャストシステム	2,300	3,070.00	7,061,000
T D Cソフト	1,500	2,221.00	3,331,500
L I N Eヤフー	227,300	460.60	104,694,380
トレンドマイクロ	7,500	8,359.00	62,692,500
I Dホールディングス	1,100	1,649.00	1,813,900
日本オラクル	3,100	11,725.00	36,347,500
アルファシステムズ	400	3,100.00	1,240,000
フューチャー	3,400	1,762.00	5,990,800
C A C H o l d i n g s	900	1,792.00	1,612,800
S Bテクノロジー	700	2,270.00	1,589,000
トーセ	200	710.00	142,000

オービックビジネスコンサルタント	2,200	7,062.00	15,536,400	
アイティフォー	2,100	1,209.00	2,538,900	
東計電算	500	3,490.00	1,745,000	
エクスネット	100	1,131.00	113,100	
大塚商会	7,900	6,218.00	49,122,200	
サイボウズ	2,200	2,184.00	4,804,800	
電通総研	1,900	5,570.00	10,583,000	
A C C E S S	1,700	796.00	1,353,200	
デジタルガレージ	2,600	3,525.00	9,165,000	
E Mシステムズ	2,700	698.00	1,884,600	
ウェザーニューズ	500	5,280.00	2,640,000	
C I J	2,700	770.00	2,079,000	
ビジネスエンジニアリング	300	4,455.00	1,336,500	
日本エンタープライズ	800	127.00	101,600	
WOWOW	1,200	1,151.00	1,381,200	
スカラ	1,500	760.00	1,140,000	
インテリジェント ウェイブ	400	1,077.00	430,800	
A N Y C O L O R	1,700	3,755.00	6,383,500	
I M A G I C A G R O U P	1,600	647.00	1,035,200	
ネットワンシステムズ	6,400	2,346.00	15,014,400	
システムソフト	5,600	60.00	336,000	
アルゴグラフィックス	1,500	4,240.00	6,360,000	
マーベラス	2,600	726.00	1,887,600	
エイベックス	2,700	1,420.00	3,834,000	
B I P R O G Y	5,200	4,258.00	22,141,600	
都築電気	900	2,367.00	2,130,300	
T B S ホールディングス	8,000	3,512.00	28,096,000	
日本テレビホールディングス	14,100	1,751.00	24,689,100	
朝日放送グループホールディングス	1,500	672.00	1,008,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,781.00	6,945,900	
スカパーJ S A Tホールディングス	12,400	774.00	9,597,600	
テレビ東京ホールディングス	1,100	3,115.00	3,426,500	
日本BS放送	300	904.00	271,200	
ビジョン	2,400	1,147.00	2,752,800	
スマートバリュー	200	401.00	80,200	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,800	4,315.00	7,767,000	
日本通信	15,700	233.00	3,658,100	
クロップス	100	1,066.00	106,600	
日本電信電話	4,748,400	187.20	888,900,480	代用有価証券 474,000株
K D D I	123,300	4,897.00	603,800,100	
ソフトバンク	256,900	1,976.00	507,634,400	
光通信	1,600	25,710.00	41,136,000	

エムティーアイ	1,100	608.00	668,800
GMOインターネットグループ	5,900	2,657.50	15,679,250
ファイバーゲート	900	950.00	855,000
アйдママーケティングコミュニケーション	200	232.00	46,400
KADOKAWA	8,400	3,094.00	25,989,600
学研ホールディングス	2,700	1,004.00	2,710,800
ゼンリン	2,700	869.00	2,346,300
昭文社ホールディングス	300	367.00	110,100
インプレスホールディングス	700	179.00	125,300
アイネット	1,000	1,935.00	1,935,000
松竹	800	10,200.00	8,160,000
東宝	8,900	4,823.00	42,924,700
東映	500	20,610.00	10,305,000
NTTデータグループ	41,700	2,116.00	88,237,200
ピー・シー・エー	900	1,665.00	1,498,500
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,223.00	1,333,800
DTS	3,400	3,615.00	12,291,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	5,704.00	41,639,200
シーイーシー	2,000	1,637.00	3,274,000
カブコン	14,300	5,516.00	78,878,800
アイ・エス・ビー	800	1,578.00	1,262,400
ジャステック	1,000	1,365.00	1,365,000
SCSK	11,200	2,726.50	30,536,800
NSW	700	2,957.00	2,069,900
アイネス	1,300	1,508.00	1,960,400
TKC	2,500	3,885.00	9,712,500
富士ソフト	3,200	6,370.00	20,384,000
NSD	5,700	2,805.00	15,988,500
コナミグループ	6,000	8,846.00	53,076,000
福井コンピュータホールディングス	1,000	2,600.00	2,600,000
JBCホールディングス	1,100	3,870.00	4,257,000
ミロク情報サービス	1,500	1,831.00	2,746,500
ソフトバンクグループ	78,800	6,399.00	504,241,200
高千穂交易	500	4,145.00	2,072,500
オルバヘルスケアホールディングス	100	1,862.00	186,200
伊藤忠食品	400	7,880.00	3,152,000
エレマテック	1,500	1,761.00	2,641,500
あらた	2,600	3,305.00	8,593,000
トーメンデバイス	300	5,320.00	1,596,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	5,750.00	9,775,000
円谷フィールズホールディングス	2,900	1,759.00	5,101,100
双日	18,700	3,481.00	65,094,700

アルフレッサ ホールディングス	16,900	2,442.00	41,269,800
横浜冷凍	4,600	1,129.00	5,193,400
神栄	100	1,896.00	189,600
ラサ商事	700	1,694.00	1,185,800
アルコニックス	2,200	1,408.00	3,097,600
神戸物産	13,000	3,770.00	49,010,000
ハイパー	200	302.00	60,400
あい ホールディングス	2,700	2,496.00	6,739,200
ディーブイエックス	200	1,078.00	215,600
ダイワボウホールディングス	7,500	3,192.00	23,940,000
マクニカホールディングス	4,000	7,750.00	31,000,000
ラクト・ジャパン	700	2,263.00	1,584,100
グリムス	700	2,100.00	1,470,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,163.00	3,023,800
八洲電機	1,400	1,319.00	1,846,600
メディアスホールディングス	1,000	767.00	767,000
レスターホールディングス	1,400	3,075.00	4,305,000
ジオリーブグループ	200	1,348.00	269,600
大光	400	636.00	254,400
OCHIホールディングス	200	1,587.00	317,400
TOKAIホールディングス	9,100	1,001.00	9,109,100
黒谷	200	608.00	121,600
Cominix	200	821.00	164,200
三洋貿易	1,900	1,306.00	2,481,400
ビューティガレージ	500	2,109.00	1,054,500
ウイン・パートナーズ	1,100	1,276.00	1,403,600
ミタチ産業	200	1,144.00	228,800
シップヘルスケアホールディングス	6,100	2,253.50	13,746,350
明治電機工業	600	1,477.00	886,200
デリカフーズホールディングス	300	593.00	177,900
スターティアホールディングス	200	1,484.00	296,800
コメダホールディングス	4,100	2,834.00	11,619,400
ピーバンドットコム	100	385.00	38,500
アセンテック	600	562.00	337,200
富士興産	200	2,012.00	402,400
協栄産業	100	2,812.00	281,200
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,457.00	3,685,500
ヤマエグループホールディングス	900	3,270.00	2,943,000
小野建	1,700	1,811.00	3,078,700
南陽	100	2,222.00	222,200
佐島電機	1,000	2,389.00	2,389,000
エコートレーディング	200	1,218.00	243,600

伯東	1,000	5,960.00	5,960,000
コンドーテック	1,300	1,220.00	1,586,000
中山福	400	365.00	146,000
ナガイレーベン	2,100	2,379.00	4,995,900
三菱食品	1,600	5,050.00	8,080,000
松田産業	1,300	2,689.00	3,495,700
第一興商	6,500	2,013.00	13,084,500
メディカルホールディングス	17,100	2,361.50	40,381,650
S P K	800	1,964.00	1,571,200
萩原電気ホールディングス	700	5,080.00	3,556,000
アズワン	2,600	5,435.00	14,131,000
スズデン	600	2,272.00	1,363,200
シモジマ	1,100	1,325.00	1,457,500
ドウシシャ	1,500	2,169.00	3,253,500
小津産業	200	1,641.00	328,200
高速	1,000	2,335.00	2,335,000
たけびし	700	2,069.00	1,448,300
リックス	400	3,645.00	1,458,000
丸文	1,500	1,500.00	2,250,000
ハピネット	1,400	2,926.00	4,096,400
橋本総業ホールディングス	700	1,318.00	922,600
日本ライフライン	4,900	1,333.00	6,531,700
タカショー	1,500	496.00	744,000
I D O M	4,400	883.00	3,885,200
進和	1,000	2,432.00	2,432,000
エスケイジャパン	200	701.00	140,200
ダイترون	700	2,980.00	2,086,000
シークス	2,400	1,585.00	3,804,000
田中商事	200	792.00	158,400
オーハシテクニカ	900	1,793.00	1,613,700
白銅	500	2,442.00	1,221,000
ダイコー通産	100	1,209.00	120,900
伊藤忠商事	113,200	6,747.00	763,760,400
丸紅	140,400	2,530.50	355,282,200
高島	500	1,350.00	675,000
長瀬産業	7,700	2,398.00	18,464,600
蝶理	1,100	2,959.00	3,254,900
豊田通商	14,800	9,650.00	142,820,000
三共生興	2,300	744.00	1,711,200
兼松	7,000	2,312.00	16,184,000
ツカモトコーポレーション	100	1,218.00	121,800
三井物産	126,900	6,062.00	769,267,800

日本紙パルプ商事	800	5,080.00	4,064,000
カメイ	1,800	1,953.00	3,515,400
OUGホールディングス	100	2,447.00	244,700
スターゼン	1,200	2,756.00	3,307,200
山善	5,100	1,265.00	6,451,500
椿本興業	400	7,000.00	2,800,000
住友商事	101,900	3,393.00	345,746,700
内田洋行	700	7,620.00	5,334,000
三菱商事	333,700	2,561.50	854,772,550
第一実業	1,600	1,865.00	2,984,000
キャノンマーケティングジャパン	3,900	4,475.00	17,452,500
西華産業	700	3,100.00	2,170,000
佐藤商事	1,200	1,583.00	1,899,600
菱洋エレクトロ	1,600	3,720.00	5,952,000
東京産業	1,600	749.00	1,198,400
ユアサ商事	1,300	4,930.00	6,409,000
神鋼商事	400	6,060.00	2,424,000
トルク	400	293.00	117,200
阪和興業	3,000	5,330.00	15,990,000
正栄食品工業	1,100	4,500.00	4,950,000
カナデン	1,300	1,510.00	1,963,000
RYODEN	1,400	2,678.00	3,749,200
岩谷産業	3,800	6,603.00	25,091,400
ナイス	300	1,605.00	481,500
ニチモウ	300	2,234.00	670,200
極東貿易	1,000	2,200.00	2,200,000
アステナホールディングス	3,200	475.00	1,520,000
三愛オブリ	4,100	1,697.00	6,957,700
稲畑産業	3,300	3,185.00	10,510,500
G S Iクレオス	900	2,377.00	2,139,300
明和産業	2,000	710.00	1,420,000
クワザワホールディングス	300	719.00	215,700
ワキタ	2,800	1,600.00	4,480,000
東邦ホールディングス	4,600	3,213.00	14,779,800
サンゲツ	3,900	3,245.00	12,655,500
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,542.00	3,238,200
シナネンホールディングス	500	4,190.00	2,095,000
伊藤忠エネクス	4,200	1,584.00	6,652,800
サンリオ	4,800	6,169.00	29,611,200
サンワテクノス	900	2,260.00	2,034,000
リョーサン	1,200	4,775.00	5,730,000
新光商事	2,300	1,216.00	2,796,800

トーホー	700	2,944.00	2,060,800
三信電気	700	2,357.00	1,649,900
東陽テクニカ	1,700	1,447.00	2,459,900
モスフードサービス	2,500	3,420.00	8,550,000
加賀電子	1,500	6,830.00	10,245,000
ソーダニッカ	1,400	1,217.00	1,703,800
立花エレテック	1,100	3,120.00	3,432,000
フォーバル	700	1,429.00	1,000,300
PALTAC	2,300	4,572.00	10,515,600
三谷産業	3,000	398.00	1,194,000
太平洋興発	300	825.00	247,500
西本Wismettacホールディングス	400	6,360.00	2,544,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,223.00	222,300
コア商事ホールディングス	1,200	763.00	915,600
KPPグループホールディングス	4,400	722.00	3,176,800
ヤマタネ	800	2,596.00	2,076,800
泉州電業	800	3,695.00	2,956,000
トラスコ中山	3,500	2,497.00	8,739,500
オートバックスセブン	5,900	1,628.50	9,608,150
モリト	1,200	1,450.00	1,740,000
加藤産業	2,100	4,880.00	10,248,000
北恵	200	865.00	173,000
イエローハット	2,700	1,860.00	5,022,000
JKホールディングス	1,300	1,058.00	1,375,400
日伝	1,100	2,765.00	3,041,500
北沢産業	500	309.00	154,500
杉本商事	800	2,253.00	1,802,400
因幡電機産業	4,400	3,490.00	15,356,000
東テク	600	6,300.00	3,780,000
ミスミグループ本社	25,400	2,488.00	63,195,200
アルテック	400	254.00	101,600
タキヒヨー	200	1,164.00	232,800
蔵王産業	200	2,497.00	499,400
スズケン	6,400	4,598.00	29,427,200
ジェコス	1,000	1,186.00	1,186,000
グローセル	1,800	748.00	1,346,400
ローソン	3,600	8,634.00	31,082,400
サンエー	1,300	4,535.00	5,895,500
カワチ薬品	1,300	2,743.00	3,565,900
エービーシー・マート	7,400	2,592.50	19,184,500
ハードオフコーポレーション	600	1,804.00	1,082,400
アスクル	4,100	2,029.00	8,318,900

ゲオホールディングス	1,900	2,426.00	4,609,400
アダストリア	2,000	3,440.00	6,880,000
ジーフット	600	298.00	178,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	726.00	72,600
くら寿司	2,000	3,900.00	7,800,000
キャンドウ	600	2,676.00	1,605,600
I Kホールディングス	300	386.00	115,800
パルグループホールディングス	3,300	2,354.00	7,768,200
エディオン	6,700	1,643.00	11,008,100
サーラコーポレーション	3,500	797.00	2,789,500
ワッツ	400	593.00	237,200
ハローズ	800	4,380.00	3,504,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,464.00	2,781,600
あみやき亭	400	4,495.00	1,798,000
大黒天物産	500	8,550.00	4,275,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,658.00	2,487,000
ファーマライズホールディングス	200	641.00	128,200
アルペン	1,400	2,036.00	2,850,400
ハブ	300	755.00	226,500
クオールホールディングス	2,300	1,788.00	4,112,400
ジinzホールディングス	1,000	4,095.00	4,095,000
ビックカメラ	9,000	1,377.00	12,393,000
D C Mホールディングス	8,900	1,381.00	12,290,900
Monotaro	23,900	1,399.50	33,448,050
東京一番フーズ	200	527.00	105,400
J.フロント リテイリング	19,300	1,368.00	26,402,400
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,171.00	6,513,000
マツキヨココカラ&カンパニー	30,600	2,717.00	83,140,200
ブロンコビリー	1,000	3,415.00	3,415,000
Z O Z O	10,700	3,300.00	35,310,000
トレジャー・ファクトリー	900	1,314.00	1,182,600
物語コーポレーション	2,800	5,280.00	14,784,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,400	1,751.50	49,742,600
Hamee	700	1,095.00	766,500
マーケットエンタープライズ	100	986.00	98,600
ウエルシアホールディングス	8,700	2,518.00	21,906,600
クリエイティブSDホールディングス	2,400	3,220.00	7,728,000
丸善C H Iホールディングス	900	327.00	294,300
ミサワ	200	640.00	128,000
ティーライフ	100	1,413.00	141,300
シュッピン	1,500	1,017.00	1,525,500
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,380.00	3,174,000

ネクステージ	3,800	2,231.00	8,477,800
ジョイフル本田	4,900	1,962.00	9,613,800
鳥貴族ホールディングス	600	3,825.00	2,295,000
ホットランド	1,300	1,989.00	2,585,700
すかいらーくホールディングス	23,000	2,409.00	55,407,000
SFPホールディングス	900	2,131.00	1,917,900
綿半ホールディングス	1,300	1,484.00	1,929,200
ヨシックスホールディングス	400	3,020.00	1,208,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,700	1,010.00	4,747,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	609.00	487,200
B E E N O S	700	1,509.00	1,056,300
あさひ	1,600	1,300.00	2,080,000
日本調剤	1,200	1,470.00	1,764,000
コスモス薬品	1,400	15,960.00	22,344,000
トーエル	400	800.00	320,000
セブン&アイ・ホールディングス	58,000	5,873.00	340,634,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,400	1,111.00	12,665,400
ツルハホールディングス	3,500	11,485.00	40,197,500
サンマルクホールディングス	1,400	2,286.00	3,200,400
フェリシモ	200	912.00	182,400
トリドールホールディングス	4,700	4,512.00	21,206,400
T O K Y O B A S E	2,000	312.00	624,000
ウイルプラスホールディングス	200	1,021.00	204,200
J Mホールディングス	1,300	2,305.00	2,996,500
サツドラホールディングス	300	794.00	238,200
アレンザホールディングス	1,300	1,108.00	1,440,400
串カツ田中ホールディングス	500	1,976.00	988,000
パロックジャパンリミテッド	1,300	820.00	1,066,000
クスリのアオキホールディングス	5,100	3,162.00	16,126,200
F O O D & L I F E C O M P A N I E	9,000	2,947.50	26,527,500
メディカルシステムネットワーク	1,800	620.00	1,116,000
一家ホールディングス	200	698.00	139,600
ジャパングラフトホールディングス	600	169.00	101,400
はるやまホールディングス	400	589.00	235,600
ノジマ	4,900	1,692.00	8,290,800
カッパ・クリエイト	2,700	1,771.00	4,781,700
ライトオン	600	409.00	245,400
良品計画	18,400	2,253.50	41,464,400
パリミキホールディングス	1,000	521.00	521,000
アドヴァングループ	1,600	1,079.00	1,726,400
アルビス	600	2,678.00	1,606,800

コナカ	800	421.00	336,800
ハウス オブ ローゼ	100	1,614.00	161,400
G - 7ホールディングス	1,800	1,331.00	2,395,800
イオン北海道	5,000	961.00	4,805,000
コジマ	2,800	755.00	2,114,000
ヒマラヤ	300	939.00	281,700
コーナン商事	2,100	3,925.00	8,242,500
エコス	600	2,464.00	1,478,400
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	34,000	3,183.00	108,222,000
西松屋チェーン	3,300	2,144.00	7,075,200
ゼンショーホールディングス	8,600	7,213.00	62,031,800
ハークスレイ	300	902.00	270,600
サイゼリヤ	2,500	5,080.00	12,700,000
V Tホールディングス	6,400	529.00	3,385,600
魚力	600	2,418.00	1,450,800
フジ・コーポレーション	800	1,758.00	1,406,400
ユナイテッドアローズ	2,000	1,934.00	3,868,000
ハイデイ日高	2,500	3,010.00	7,525,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	400	142.00	56,800
コロワイド	7,200	2,354.00	16,948,800
壱番屋	1,300	6,620.00	8,606,000
P L A N T	200	1,642.00	328,400
スギホールディングス	3,400	7,053.00	23,980,200
薬王堂ホールディングス	800	2,581.00	2,064,800
スクロール	2,500	976.00	2,440,000
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,999.00	3,198,400
木曽路	2,500	2,684.00	6,710,000
S R S ホールディングス	2,800	1,206.00	3,376,800
千趣会	3,100	300.00	930,000
リテールパートナーズ	2,500	1,736.00	4,340,000
上新電機	1,700	2,474.00	4,205,800
日本瓦斯	8,900	2,264.00	20,149,600
ロイヤルホールディングス	3,000	2,588.00	7,764,000
東天紅	100	848.00	84,800
いなげや	1,600	1,265.00	2,024,000
チヨダ	1,600	897.00	1,435,200
ライフコーポレーション	1,800	3,760.00	6,768,000
リンガーハット	2,200	2,443.00	5,374,600
M r M a x H D	2,100	629.00	1,320,900
A O K I ホールディングス	3,600	1,166.00	4,197,600
オークワ	2,400	882.00	2,116,800

コメリ	2,600	3,340.00	8,684,000
青山商事	3,600	1,771.00	6,375,600
しまむら	2,000	16,270.00	32,540,000
はせがわ	400	370.00	148,000
高島屋	11,600	2,067.50	23,983,000
松屋	2,900	941.00	2,728,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,500	1,599.00	11,992,500
近鉄百貨店	700	2,554.00	1,787,800
丸井グループ	11,200	2,447.00	27,406,400
アクシアル リテイリング	1,200	4,100.00	4,920,000
イオン	57,100	3,505.00	200,135,500
イズミ	3,000	3,493.00	10,479,000
平和堂	2,800	2,203.00	6,168,400
フジ	2,600	1,967.00	5,114,200
ヤオコー	1,900	8,630.00	16,397,000
ゼビオホールディングス	2,300	986.00	2,267,800
ケーズホールディングス	11,300	1,334.50	15,079,850
Olympicグループ	400	553.00	221,200
日産東京販売ホールディングス	1,100	485.00	533,500
シルバーライフ	300	854.00	256,200
Genky DrugStores	700	6,800.00	4,760,000
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,210.00	121,000
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,270.00	1,270,000
ギフトホールディングス	700	2,923.00	2,046,100
アインホールディングス	2,300	4,807.00	11,056,100
元気寿司	900	3,765.00	3,388,500
ヤマダホールディングス	51,800	448.60	23,237,480
アーケランズ	5,000	1,701.00	8,505,000
ニトリホールディングス	6,100	19,495.00	118,919,500
愛眼	600	183.00	109,800
ケーユーホールディングス	800	1,183.00	946,400
吉野家ホールディングス	6,200	3,307.00	20,503,400
松屋フーズホールディングス	800	5,960.00	4,768,000
サガミホールディングス	2,500	1,547.00	3,867,500
関西フードマーケット	1,200	1,516.00	1,819,200
王将フードサービス	1,300	7,980.00	10,374,000
ミニストップ	1,200	1,525.00	1,830,000
アークス	3,100	2,968.00	9,200,800
パローホールディングス	3,200	2,557.00	8,182,400
ベルク	800	6,340.00	5,072,000
大庄	800	1,349.00	1,079,200
ファーストリテイリング	7,600	39,030.00	296,628,000

サンドラッグ	5,700	4,504.00	25,672,800
サクスパー ホールディングス	1,400	853.00	1,194,200
ヤマザワ	200	1,263.00	252,600
やまや	200	3,215.00	643,000
ペルーナ	4,100	622.00	2,550,200
いよぎんホールディングス	18,600	1,002.00	18,637,200
しずおかフィナンシャルグループ	34,800	1,411.50	49,120,200
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,200	1,048.50	13,840,200
楽天銀行	5,500	2,359.00	12,974,500
京都フィナンシャルグループ	19,900	2,515.00	50,048,500
島根銀行	200	525.00	105,000
じもとホールディングス	600	543.00	325,800
めぶきフィナンシャルグループ	77,800	442.50	34,426,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,135.00	8,270,000
九州フィナンシャルグループ	30,300	964.80	29,233,440
ゆうちょ銀行	172,300	1,530.00	263,619,000
富山第一銀行	5,000	830.00	4,150,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	84,100	706.30	59,399,830
西日本フィナンシャルホールディングス	8,900	1,720.00	15,308,000
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,927.00	2,697,800
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	4,080.00	10,200,000
ひろぎんホールディングス	22,300	1,001.00	22,322,300
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,557.00	3,324,100
十六フィナンシャルグループ	2,000	4,105.00	8,210,000
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,395.00	7,032,000
プロクレアホールディングス	1,800	1,899.00	3,418,200
あいちフィナンシャルグループ	2,400	2,617.00	6,280,800
あおぞら銀行	11,300	2,557.00	28,894,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	954,600	1,389.00	1,325,939,400
りそなホールディングス	182,800	805.00	147,154,000
三井住友トラスト・ホールディングス	56,400	2,945.00	166,098,000
三井住友フィナンシャルグループ	111,500	7,639.00	851,748,500
千葉銀行	43,700	1,106.00	48,332,200
群馬銀行	30,400	743.00	22,587,200
武蔵野銀行	2,200	2,790.00	6,138,000
千葉興業銀行	3,000	862.00	2,586,000
筑波銀行	6,900	255.00	1,759,500
七十七銀行	4,600	3,545.00	16,307,000
秋田銀行	1,100	2,049.00	2,253,900
山形銀行	1,800	1,123.00	2,021,400
岩手銀行	1,000	2,512.00	2,512,000
東邦銀行	12,400	314.00	3,893,600

東北銀行	400	1,212.00	484,800
ふくおかフィナンシャルグループ	13,600	3,657.00	49,735,200
スルガ銀行	13,800	843.00	11,633,400
八十二銀行	33,600	803.10	26,984,160
山梨中央銀行	1,800	1,763.00	3,173,400
大垣共立銀行	3,000	1,967.00	5,901,000
福井銀行	1,400	1,718.00	2,405,200
清水銀行	600	1,598.00	958,800
富山銀行	100	1,732.00	173,200
滋賀銀行	2,600	3,760.00	9,776,000
南都銀行	2,400	2,669.00	6,405,600
百五銀行	14,700	574.00	8,437,800
紀陽銀行	5,600	1,673.00	9,368,800
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	1,581.00	15,335,700
山陰合同銀行	9,800	1,024.00	10,035,200
鳥取銀行	300	1,415.00	424,500
百十四銀行	1,600	2,481.00	3,969,600
四国銀行	2,300	1,018.00	2,341,400
阿波銀行	2,200	2,481.00	5,458,200
大分銀行	1,000	2,685.00	2,685,000
宮崎銀行	1,000	2,785.00	2,785,000
佐賀銀行	900	1,940.00	1,746,000
琉球銀行	3,300	1,166.00	3,847,800
セブン銀行	49,100	307.50	15,098,250
みずほフィナンシャルグループ	211,600	2,670.50	565,077,800
高知銀行	300	958.00	287,400
山口フィナンシャルグループ	15,400	1,404.50	21,629,300
名古屋銀行	1,000	5,580.00	5,580,000
北洋銀行	23,800	378.00	8,996,400
大光銀行	200	1,451.00	290,200
愛媛銀行	2,100	1,058.00	2,221,800
トマト銀行	300	1,209.00	362,700
京葉銀行	6,600	719.00	4,745,400
栃木銀行	7,800	307.00	2,394,600
北日本銀行	500	2,277.00	1,138,500
東和銀行	2,900	628.00	1,821,200
福島銀行	800	237.00	189,600
大東銀行	300	745.00	223,500
トモニホールディングス	14,800	404.00	5,979,200
フィデアホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000
池田泉州ホールディングス	21,700	350.00	7,595,000
F P G	5,300	1,807.00	9,577,100

ジャパンインベストメントアドバイザー	2,600	883.00	2,295,800
マーキュリアホールディングス	400	709.00	283,600
S B Iホールディングス	23,000	3,639.00	83,697,000
ジャフコ グループ	4,700	1,745.50	8,203,850
大和証券グループ本社	121,400	1,018.00	123,585,200
野村ホールディングス	263,600	808.80	213,199,680
岡三証券グループ	13,800	704.00	9,715,200
丸三証券	5,200	928.00	4,825,600
東洋証券	4,200	340.00	1,428,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,600	566.00	10,527,600
光世証券	200	596.00	119,200
水戸証券	4,600	456.00	2,097,600
いちよし証券	2,900	749.00	2,172,100
松井証券	7,700	832.00	6,406,400
マネックスグループ	15,300	747.00	11,429,100
極東証券	2,200	1,000.00	2,200,000
岩井コスモホールディングス	1,800	2,117.00	3,810,600
アイザワ証券グループ	2,300	1,255.00	2,886,500
マネーパートナーズグループ	700	303.00	212,100
スパークス・グループ	1,800	1,767.00	3,180,600
かんぽ生命保険	16,000	2,709.00	43,344,000
F Pパートナー	300	6,300.00	1,890,000
S O M P Oホールディングス	23,600	7,650.00	180,540,000
アニコム ホールディングス	5,300	579.00	3,068,700
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	35,100	6,068.00	212,986,800
第一生命ホールディングス	76,600	3,144.00	240,830,400
東京海上ホールディングス	154,900	3,884.00	601,631,600
T & Dホールディングス	42,100	2,375.00	99,987,500
アドバンスクリエイト	900	1,030.00	927,000
全国保証	4,100	5,478.00	22,459,800
あんしん保証	300	246.00	73,800
ジェイリース	500	2,314.00	1,157,000
イントラスト	300	777.00	233,100
日本モーゲージサービス	400	518.00	207,200
C a s a	300	832.00	249,600
S B Iアルヒ	1,500	848.00	1,272,000
プレミアグループ	2,700	1,775.00	4,792,500
ネットプロテクションズホールディングス	5,200	172.00	894,400
クレディセゾン	9,900	2,739.50	27,121,050
芙蓉総合リース	1,500	13,280.00	19,920,000
みずほリース	2,600	5,340.00	13,884,000
東京センチュリー	11,700	1,639.50	19,182,150

日本証券金融	5,800	1,565.00	9,077,000
アイフル	23,100	371.00	8,570,100
リコーリース	1,500	5,080.00	7,620,000
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,332.50	11,992,500
アコム	28,000	376.10	10,530,800
ジャックス	1,700	5,620.00	9,554,000
オリエントコーポレーション	5,100	1,052.00	5,365,200
オリックス	95,600	2,816.50	269,257,400
三菱HCキャピタル	69,800	1,047.00	73,080,600
九州リースサービス	300	1,195.00	358,500
日本取引所グループ	40,900	3,323.00	135,910,700
イー・ギャランティ	2,600	1,948.00	5,064,800
アサックス	300	741.00	222,300
NECキャピタルソリューション	800	3,660.00	2,928,000
大東建託	5,800	17,085.00	99,093,000
いちご	18,100	384.00	6,950,400
日本駐車場開発	16,600	184.00	3,054,400
スター・マイカ・ホールディングス	1,800	584.00	1,051,200
SREホールディングス	700	3,125.00	2,187,500
ADワークスグループ	1,800	232.00	417,600
ヒューリック	36,600	1,627.50	59,566,500
野村不動産ホールディングス	8,700	3,907.00	33,990,900
三重交通グループホールディングス	3,400	626.00	2,128,400
サムティ	2,500	2,507.00	6,267,500
ディア・ライフ	2,700	1,002.00	2,705,400
コーセーアールイー	200	952.00	190,400
地主	1,200	2,306.00	2,767,200
プレサンスコーポレーション	2,500	1,676.00	4,190,000
THEグローバル社	500	388.00	194,000
ハウスコム	100	909.00	90,900
JPMC	900	1,154.00	1,038,600
サンセイランディック	200	1,066.00	213,200
エストラスト	100	640.00	64,000
フージャースホールディングス	2,400	1,164.00	2,793,600
オープンハウスグループ	5,700	4,641.00	26,453,700
東急不動産ホールディングス	47,100	976.30	45,983,730
飯田グループホールディングス	15,000	2,199.00	32,985,000
イーランド	100	1,563.00	156,300
ムゲンエステート	500	1,158.00	579,000
ビーロッド	500	1,073.00	536,500
ファーストブラザーズ	200	1,261.00	252,200
And Doホールディングス	1,000	1,128.00	1,128,000

シーアールイー	900	1,402.00	1,261,800
ケイアイスター不動産	800	3,405.00	2,724,000
アグレ都市デザイン	100	1,623.00	162,300
グッドコムアセット	1,500	765.00	1,147,500
ジェイ・エス・ビー	800	2,620.00	2,096,000
ロードスターキャピタル	1,000	1,926.00	1,926,000
テンポイノベーション	200	1,009.00	201,800
グローバル・リンク・マネジメント	200	2,527.00	505,400
フェイスネットワーク	200	1,647.00	329,400
霞ヶ関キャピタル	400	11,560.00	4,624,000
パーク24	10,200	1,922.00	19,604,400
パラカ	600	1,921.00	1,152,600
ミガロホールディングス	100	1,442.00	144,200
三井不動産	72,500	3,667.00	265,857,500
三菱地所	102,500	2,016.00	206,640,000
平和不動産	2,500	3,785.00	9,462,500
東京建物	13,700	2,267.50	31,064,750
京阪神ビルディング	2,900	1,448.00	4,199,200
住友不動産	22,700	4,653.00	105,623,100
テオーシー	2,800	700.00	1,960,000
スターツコーポレーション	2,200	3,020.00	6,644,000
フジ住宅	2,000	715.00	1,430,000
空港施設	2,200	620.00	1,364,000
明和地所	900	1,348.00	1,213,200
ゴールドクレスト	1,300	2,325.00	3,022,500
エスリード	700	3,455.00	2,418,500
日神グループホールディングス	2,500	523.00	1,307,500
日本エスコン	2,900	1,018.00	2,952,200
MIRARTHホールディングス	7,200	495.00	3,564,000
A V A N T I A	400	911.00	364,400
イオンモール	8,100	1,833.00	14,847,300
毎日コムネット	300	774.00	232,200
ファースト住建	300	1,115.00	334,500
カチタス	4,200	1,816.00	7,627,200
トーセイ	2,600	2,119.00	5,509,400
穴吹興産	200	2,141.00	428,200
サンフロンティア不動産	2,300	1,743.00	4,008,900
FJネクストホールディングス	1,700	1,247.00	2,119,900
インテリックス	200	563.00	112,600
ランドビジネス	300	274.00	82,200
サンネクスタグループ	200	956.00	191,200
グランディハウス	1,200	668.00	801,600

日本空港ビルデング	5,500	5,890.00	32,395,000
明豊ファシリティワークス	400	883.00	353,200
L I F U L L	5,600	191.00	1,069,600
M I X I	3,500	2,516.00	8,806,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,900	683.00	4,029,700
日本M&Aセンターホールディングス	26,100	894.20	23,338,620
メンバーズ	600	997.00	598,200
中広	100	412.00	41,200
UTグループ	2,100	2,385.00	5,008,500
アイティメディア	600	1,359.00	815,400
ケアネット	2,500	737.00	1,842,500
E・Jホールディングス	1,000	1,708.00	1,708,000
オープンアップグループ	4,900	2,327.00	11,402,300
コシダカホールディングス	4,900	946.00	4,635,400
アルトナー	300	2,161.00	648,300
パソナグループ	2,000	2,732.00	5,464,000
C D S	200	1,703.00	340,600
リンクアンドモチベーション	4,700	554.00	2,603,800
エス・エム・エス	5,700	2,653.00	15,122,100
サニーサイドアップグループ	300	583.00	174,900
パーソルホールディングス	166,600	239.90	39,967,340
リニカル	500	506.00	253,000
クックパッド	4,500	119.00	535,500
エスクリ	300	285.00	85,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	733.00	293,200
学情	900	1,770.00	1,593,000
スタジオアリス	800	2,092.00	1,673,600
エプロ	200	916.00	183,200
N J S	400	2,751.00	1,100,400
総合警備保障	27,300	797.20	21,763,560
カカクコム	10,800	1,659.50	17,922,600
アイロムグループ	700	2,021.00	1,414,700
セントケア・ホールディング	1,200	976.00	1,171,200
サイネックス	100	852.00	85,200
ルネサンス	1,300	922.00	1,198,600
ディップ	2,500	2,585.00	6,462,500
デジタルホールディングス	900	1,229.00	1,106,100
新日本科学	1,500	1,703.00	2,554,500
キャリアデザインセンター	200	1,825.00	365,000
ベネフィット・ワン	5,700	2,095.00	11,941,500
エムスリー	32,300	2,057.00	66,441,100
ツカダ・グローバルホールディング	500	404.00	202,000

プラス	100	715.00	71,500
アウトソーシング	10,500	1,739.00	18,259,500
ウェルネット	700	568.00	397,600
ワールドホールディングス	700	3,000.00	2,100,000
ディー・エヌ・エー	5,800	1,495.50	8,673,900
博報堂D Yホールディングス	20,900	1,162.00	24,285,800
ぐるなび	3,100	269.00	833,900
タカミヤ	2,200	484.00	1,064,800
ファンコミュニケーションズ	2,300	399.00	917,700
ライク	600	1,498.00	898,800
A o b a - B B T	300	407.00	122,100
エスプール	4,700	307.00	1,442,900
W D Bホールディングス	800	2,332.00	1,865,600
ティア	400	479.00	191,600
C D G	100	1,215.00	121,500
アドウェイズ	2,300	509.00	1,170,700
バリューコマース	1,400	1,280.00	1,792,000
インフォマート	17,000	391.00	6,647,000
J Pホールディングス	4,200	474.00	1,990,800
エコナックホールディングス	600	131.00	78,600
C Lホールディングス	400	938.00	375,200
プレステージ・インターナショナル	7,700	598.00	4,604,600
アミューズ	1,000	1,596.00	1,596,000
ドリームインキュベータ	600	3,310.00	1,986,000
クイック	1,100	2,498.00	2,747,800
T A C	400	196.00	78,400
電通グループ	16,100	3,890.00	62,629,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,180.00	708,000
ぴあ	600	3,385.00	2,031,000
イオンファンタジー	600	2,508.00	1,504,800
シーティーエス	2,100	725.00	1,522,500
N E X Y Z . G r o u p	200	698.00	139,600
H . U . グループホールディングス	4,800	2,775.50	13,322,400
アルプス技研	1,600	2,908.00	4,652,800
日本空調サービス	1,800	925.00	1,665,000
オリエンタルランド	86,600	5,500.00	476,300,000
ダスキン	3,700	3,432.00	12,698,400
明光ネットワークジャパン	2,000	718.00	1,436,000
ファルコホールディングス	700	2,125.00	1,487,500
秀英予備校	200	301.00	60,200
ラウンドワン	15,400	652.00	10,040,800
リゾートトラスト	7,100	2,575.00	18,282,500

ビー・エム・エル	2,000	2,890.00	5,780,000
リソー教育	8,400	241.00	2,024,400
早稲田アカデミー	900	1,698.00	1,528,200
ユー・エス・エス	18,300	2,797.50	51,194,250
東京個別指導学院	2,000	448.00	896,000
サイバーエージェント	36,100	994.50	35,901,450
楽天グループ	140,200	624.20	87,512,840
クリーク・アンド・リバー社	800	2,006.00	1,604,800
SBIグローバルアセットマネジメント	3,200	718.00	2,297,600
テー・オー・ダブリュー	3,200	339.00	1,084,800
山田コンサルティンググループ	700	1,845.00	1,291,500
セントラルスポーツ	600	2,502.00	1,501,200
フルキャストホールディングス	1,600	1,788.00	2,860,800
エン・ジャパン	2,700	2,738.00	7,392,600
リソルホールディングス	100	6,050.00	605,000
テクノプロ・ホールディングス	9,600	3,468.00	33,292,800
アトラグループ	200	181.00	36,200
アイ・アールジャパンホールディングス	900	1,562.00	1,405,800
Keeper 技研	1,000	6,590.00	6,590,000
ファーストロジック	200	517.00	103,400
三機サービス	100	1,367.00	136,700
Gunosy	1,300	695.00	903,500
デザインワン・ジャパン	200	132.00	26,400
イー・ガーディアン	600	1,531.00	918,600
リブセンス	400	238.00	95,200
ジャパンマテリアル	5,000	2,562.00	12,810,000
ベクトル	2,000	1,171.00	2,342,000
ウチヤマホールディングス	300	392.00	117,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,201.00	1,681,400
キャリアリンク	600	2,611.00	1,566,600
I B J	1,300	692.00	899,600
アサンテ	800	1,693.00	1,354,400
バリューHR	1,400	1,411.00	1,975,400
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,352.00	3,057,600
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,038.00	726,600
E R Iホールディングス	200	1,839.00	367,800
アビスト	100	3,135.00	313,500
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,391.00	3,060,200
ウィルグループ	1,400	1,203.00	1,684,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	900	139.00	125,100
メドピア	1,500	679.00	1,018,500
レアジョブ	200	907.00	181,400

リクルートホールディングス	121,100	5,927.00	717,759,700
エラン	2,200	1,073.00	2,360,600
土木管理総合試験所	400	328.00	131,200
日本郵政	192,300	1,405.00	270,181,500
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,782.00	3,207,600
鎌倉新書	1,400	622.00	870,800
S MN	200	296.00	59,200
一蔵	100	627.00	62,700
グローバルキッズCOMPANY	200	657.00	131,400
エアトリ	1,200	1,798.00	2,157,600
アトラエ	1,000	694.00	694,000
ストライク	700	4,640.00	3,248,000
ソラスト	4,500	564.00	2,538,000
セラク	500	1,153.00	576,500
インソース	3,600	816.00	2,937,600
ベikalent・コンサルティング	12,000	3,391.00	40,692,000
Orchestra Holdings	400	990.00	396,000
アイモバイル	2,200	441.00	970,200
キャリアインデックス	300	197.00	59,100
MS - Japan	600	1,227.00	736,200
船場	200	1,000.00	200,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,300	2,209.00	11,707,700
フルテック	100	1,116.00	111,600
グリーンズ	300	2,125.00	637,500
ツナググループ・ホールディングス	200	866.00	173,200
GameWith	300	320.00	96,000
MS&Consulting	100	603.00	60,300
ウェルビー	800	836.00	668,800
エル・ティー・エス	200	2,890.00	578,000
ミダックホールディングス	1,000	1,823.00	1,823,000
キュービーネットホールディングス	1,000	1,502.00	1,502,000
RPAホールディングス	2,200	263.00	578,600
スプリックス	200	817.00	163,400
マネジメントソリューションズ	700	2,942.00	2,059,400
プロレド・パートナーズ	400	367.00	146,800
and factory	200	314.00	62,800
テノ・ホールディングス	100	507.00	50,700
フロンティア・マネジメント	400	1,551.00	620,400
ピアラ	200	338.00	67,600
コプロ・ホールディングス	300	1,649.00	494,700
ギークス	100	493.00	49,300
アンビスホールディングス	1,800	2,680.00	4,824,000

カーブスホールディングス	4,500	678.00	3,051,000
フォーラムエンジニアリング	2,200	816.00	1,795,200
Fast Fitness Japan	600	1,097.00	658,200
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	428.00	727,600
ポピンズ	300	1,226.00	367,800
LITALICO	1,300	2,094.00	2,722,200
コンフィデンス・インターワークス	100	1,586.00	158,600
アドバンテッジリスクマネジメント	400	463.00	185,200
リログループ	8,200	1,476.00	12,103,200
東祥	1,200	810.00	972,000
ID&Eホールディングス	1,000	3,565.00	3,565,000
ビーウィズ	400	1,875.00	750,000
TREホールディングス	3,100	1,261.00	3,909,100
人・夢・技術グループ	600	1,905.00	1,143,000
NISSOホールディングス	1,400	853.00	1,194,200
大栄環境	3,000	2,485.00	7,455,000
日本管財ホールディングス	1,700	2,628.00	4,467,600
M&A総研ホールディングス	800	5,720.00	4,576,000
エイチ・アイ・エス	4,700	1,787.00	8,398,900
ラックランド	800	2,641.00	2,112,800
共立メンテナンス	2,600	6,061.00	15,758,600
イチネンホールディングス	1,700	1,575.00	2,677,500
建設技術研究所	900	5,820.00	5,238,000
スペース	1,100	947.00	1,041,700
燦ホールディングス	1,500	1,131.00	1,696,500
スバル興業	500	3,050.00	1,525,000
東京テアトル	300	1,133.00	339,900
タナベコンサルティンググループ	600	1,089.00	653,400
ナガワ	500	7,120.00	3,560,000
東京都競馬	1,400	4,550.00	6,370,000
常磐興産	300	1,240.00	372,000
カナモト	2,500	2,824.00	7,060,000
ニシオホールディングス	1,500	4,030.00	6,045,000
アゴラ ホスピタリティ グループ	4,700	23.00	108,100
トランス・コスモス	2,000	3,085.00	6,170,000
乃村工藝社	7,100	861.00	6,113,100
藤田観光	700	6,630.00	4,641,000
KNT-CTホールディングス	1,000	1,308.00	1,308,000
トーカイ	1,500	2,143.00	3,214,500
セコム	16,700	10,775.00	179,942,500
セントラル警備保障	900	2,529.00	2,276,100
丹青社	3,200	825.00	2,640,000

メイテックグループホールディングス	5,900	3,100.00	18,290,000	
応用地質	1,500	2,178.00	3,267,000	
船井総研ホールディングス	3,400	2,623.00	8,918,200	
進学会ホールディングス	200	255.00	51,000	
オオバ	500	1,021.00	510,500	
いであ	200	1,875.00	375,000	
学究社	700	2,068.00	1,447,600	
ベネッセホールディングス	5,500	2,607.50	14,341,250	
イオンディライト	1,800	3,840.00	6,912,000	
ナック	1,400	537.00	751,800	
ダイセキ	3,300	4,220.00	13,926,000	
ステップ	600	2,017.00	1,210,200	
合 計	24,465,400		57,215,702,820	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 2月29日現在です。

【財形株投（一般財形30）】

【純資産額計算書】

資産総額	116,939,355円
負債総額	51,054円
純資産総額（ - ）	116,888,301円
発行済口数	102,744,413口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1377円

【財形株投（一般財形50）】

【純資産額計算書】

資産総額	208,436,400円
負債総額	90,946円
純資産総額（ - ）	208,345,454円
発行済口数	150,311,710口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3861円

【財形株投（年金・住宅財形30）】

【純資産額計算書】

資産総額	260,282,089円
負債総額	114,545円
純資産総額（ - ）	260,167,544円
発行済口数	227,740,265口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1424円

（参考）

財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	356,136,090円
負債総額	12円
純資産総額（ - ）	356,136,078円
発行済口数	281,856,349口
1口当たり純資産額（ / ）	1.264円

インデックス マザーファンド TOPIX

純資産額計算書

資産総額	60,616,513,233円
------	-----------------

負債総額	108,517,505円
純資産総額（ - ）	60,507,995,728円
発行済口数	16,259,372,529口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7214円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

第二部【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

2024年2月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2024年2月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。
当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。
当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2024年2月末現在）

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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、2024年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	822	302,098
株式投資信託	774	261,594
単位型	299	9,195
追加型	475	252,398
公社債投資信託	48	40,504
単位型	35	1,006
追加型	13	39,497

3【委託会社等の経理状況】

- 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）

並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第65期中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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				
ソフトウェア		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		第64期	
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		(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						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,944	6,944	-	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	889	847	41	41
当期変動額合計	889	847	41	6,985
当期末残高	2,350	731	1,618	91,035

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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417
当期変動額							
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	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 3年～15年</p> <p>器具備品 3年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p>

	<p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行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。</p>
	<p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしてあります。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価してあります。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

<p>第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用)</p> <p>「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（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。</p>

(表示方法の変更)

<p>第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)</p>
--

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、金額の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おります。

(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	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,390百万円	建物 1,437百万円
器具備品 823百万円	器具備品 879百万円
2 信託資産	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。	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。	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)	(流動資産)
未収収益 233百万円	未収収益 263百万円
(流動負債)	(流動負債)
未払費用 2,314百万円	未払費用 1,778百万円
4 消費税等の取扱い	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。	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	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。	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。	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	受取配当金 9,241百万円

<p>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。</p>	<p>3 訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことから、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。</p>
--	---

（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 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円	1年内	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・ドマネ-の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重

要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額 (*4)			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
有価証券 その他有価証券 投資信託 資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3) デリバティブ取引計	246 - 246	- 352 352	- - -	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	4,708	-	293	293
米ドル				
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 売建	投資有価証券			
	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)		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	(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	15,942	(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	1,964	(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tockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日

権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		

期首	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	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。

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的主要原因別の内訳 (単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳 (単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 1,341	賞与引当金 918
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 97
関係会社株式評価損 52	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 427	退職給付引当金 436
固定資産減価償却費 87	固定資産減価償却費 83
繰延ヘッジ損益 322	繰延ヘッジ損益 215
訴訟損失引当金 2,403	その他 672
その他 1,039	繰延税金資産小計 2,478
繰延税金資産小計 5,772	評価性引当金 52
評価性引当金(注) 52	繰延税金資産合計 2,425
繰延税金資産合計 5,719	
	繰延税金負債
繰延税金負債	その他有価証券評価差額金 1,028
その他有価証券評価差額金 1,092	その他 948
その他 948	繰延税金負債合計 1,977
繰延税金負債合計 2,041	繰延税金資産の純額 448
繰延税金資産の純額 3,678	

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

2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 (調整)	法定実効税率 (調整)
30.6%	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.1%	1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
10.9%	12.0%
評価性引当金の減少	その他
10.3%	0.8%
その他	税効果会計適用後の法人税等の負担率
0.1%	20.5%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	
9.4%	

(関連当事者情報)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場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(シンガポールドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	3,318 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	103 (SGD 1,043千)	未収収益	55 (SGD 551千)
							資金の返済(米国ドル貸建)(注2)	2,019 (USD 16,500千)	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(米国ドル貸建)(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

- 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルピング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 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年間のリボルピング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定してありました(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)。
- 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(ロンドン)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、記載していません。

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、記載していません。

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、記載していません。

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、記載を省略していません。

(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、記載していません。

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、記載していません。

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、記載を省略していません。

(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、記載していません。

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 2022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。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

第65期中間会計期間
(2023年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,751
金銭の信託		2,500
有価証券		78
未収委託者報酬		16,602
未収収益		940
その他	2	3,797
流動資産合計		55,670
固定資産		
有形固定資産	1	330
無形固定資産		389
投資その他の資産		
投資有価証券		24,116
関係会社株式		37,647
長期差入保証金		338
繰延税金資産		240
投資その他の資産合計		62,343
固定資産合計		63,063
資産合計		118,734

(単位：百万円)

第65期中間会計期間
(2023年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		8,446
未払費用		3,085
未払法人税等		1,334
未払消費税等	3	575
賞与引当金		1,383
役員賞与引当金		162
その他		1,230
流動負債合計		16,218
固定負債		
退職給付引当金		1,458
賞与引当金		397
役員賞与引当金		40
その他		170
固定負債合計		2,067
負債合計		18,286
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	77,549
利益剰余金合計	77,549
自己株式	2,067
株主資本合計	98,066
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,457
繰延ヘッジ損益	1,075
評価・換算差額等合計	2,381
純資産合計	100,447
負債純資産合計	118,734

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第65期中間会計期間
(自 2023年4月1日
至 2023年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		37,779
その他営業収益		1,652
営業収益合計		39,431
営業費用及び一般管理費	1	35,014
営業利益		4,416
営業外収益	2	1,245
営業外費用	3	1,458
経常利益		4,203
特別利益	4	501
特別損失	5	99
税引前中間純利益		4,605
法人税等	6	1,270
中間純利益		3,335

(3) 中間株主資本等変動計算書

第65期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823
当中間期変動額							
剰余金の配当				5,092	5,092		5,092
中間純利益				3,335	3,335		3,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	1,757	1,757	-	1,757

当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	77,549	77,549	2,067	98,066
---------	--------	-------	-------	--------	--------	-------	--------

	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	2,056	488	1,567	101,391
当中間期変動額				
剰余金の配当				5,092
中間純利益				3,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	1,400	587	813	813
当中間期変動額合計	1,400	587	813	943
当中間期末残高	3,457	1,075	2,381	100,447

注記事項
(重要な会計方針)

項目	第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>

4 収益の計上基準	<p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行業務の内容及び当該履行業務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第65期中間会計期間 (2023年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 2,354百万円

- 2 信託資産
流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
- 3 消費税等の取扱い
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
- 4 保証債務
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480百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

（中間損益計算書関係）

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	46百万円
無形固定資産	50百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	16百万円
受取配当金	1,205百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	255百万円
為替差損	184百万円
デリバティブ費用	1,017百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	501百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	97百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第65期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	

2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	217,000	-	96,000	121,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	752,000	-	406,000	346,000	-
合計		969,000	-	502,000	467,000	-

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

2 2016年度ストックオプション(2)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年5月26日 取締役会	普通株式	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

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

(リース取引関係)

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円
1年超	3,049百万円
合計	3,961百万円

(金融商品関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
金銭の信託 有価証券 其他有価証券 投資信託	-	2,500	-	2,500
資産計	6,821	17,357	-	24,178
デリバティブ取引(1、2)	6,821	19,857	-	26,678
株式関連	242	-	-	242
通貨関連	-	685	-	685
デリバティブ取引計	242	685	-	442

(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242百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち685百万円は、流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、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

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

(有価証券関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	22,320	17,117	5,202
	小計	22,320	17,117	5,202
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,858	2,078	220
	小計	1,858	2,078	220
合計		24,178	19,195	4,982

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

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額16百万円)については、市場価格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。

(デリバティブ取引関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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)
株価指数先物取引				

市場取引	売建	13,289	-	242	242
	合計	13,289	-	242	242

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,055	-	528
	豪ドル		124	-	2
	ユーロ		344	-	7
	香港ドル		527	-	53
	人民元		2,876	-	93
	合計		9,928	-	685

(持分法損益等)

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,339百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	16,494百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,148百万円

(収益認識関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30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」に記載の通りです。

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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(ストックオプション等関係)

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

[関連情報]

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30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、記載していません。

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65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり純資産額	517円36銭
1株当たり中間純利益金額	17円17銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,335
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,335
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(2)121,000株、 2017年度ストックオプション(1)346,000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65期中間会計期間 (2023年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	100,447
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	100,447
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (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
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
- (2) 販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類

2023年 5月 1日	有価証券届出書
2023年 5月 1日	有価証券報告書
2023年11月 1日	有価証券届出書
2023年11月 1日	半期報告書

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

公認会計士 秋 宗 勝 彦

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 三 上 和 彦

業務執行社員

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年4月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形30）の2023年2月2日から2024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2024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を検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.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

2024年4月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形50）の2023年2月2日から2024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2024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を検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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

2024年4月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2023年2月2日から2024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2024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を検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。