

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年8月7日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社　２０２５年９月１日にアモーヴァ・ア セットマネジメント株式会社へ変更
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	新屋敷　昇
【電話番号】	050-5785-6187
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスポートフォリオ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

インデックスポートフォリオ（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2025年8月8日から2026年2月6日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >
日興アセットマネジメント株式会社
2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
ホームページ アドレス www.nikkoam.com/
2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更
コールセンター 電話番号 0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

TOPIX（東証株価指数）配当込みの動きに連動した投資成果をめざして運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1）商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
追加型投信	内 外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2）属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX (東証株価指数)
その他債券	(毎月)			配当込み
クレジット属性 ()	日々	中南米		
不動産投信	その他	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株 式一般))		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(株式一般))

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

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

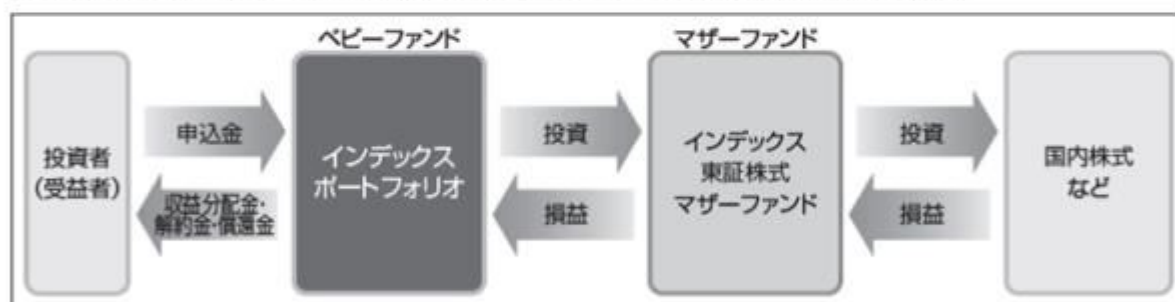
主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)配当込みの動きに連動する投資成果をめざします。

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

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

ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資は行ないません。

(分配方針)

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

「TOPIX」の著作権などについて

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

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

1987年11月27日

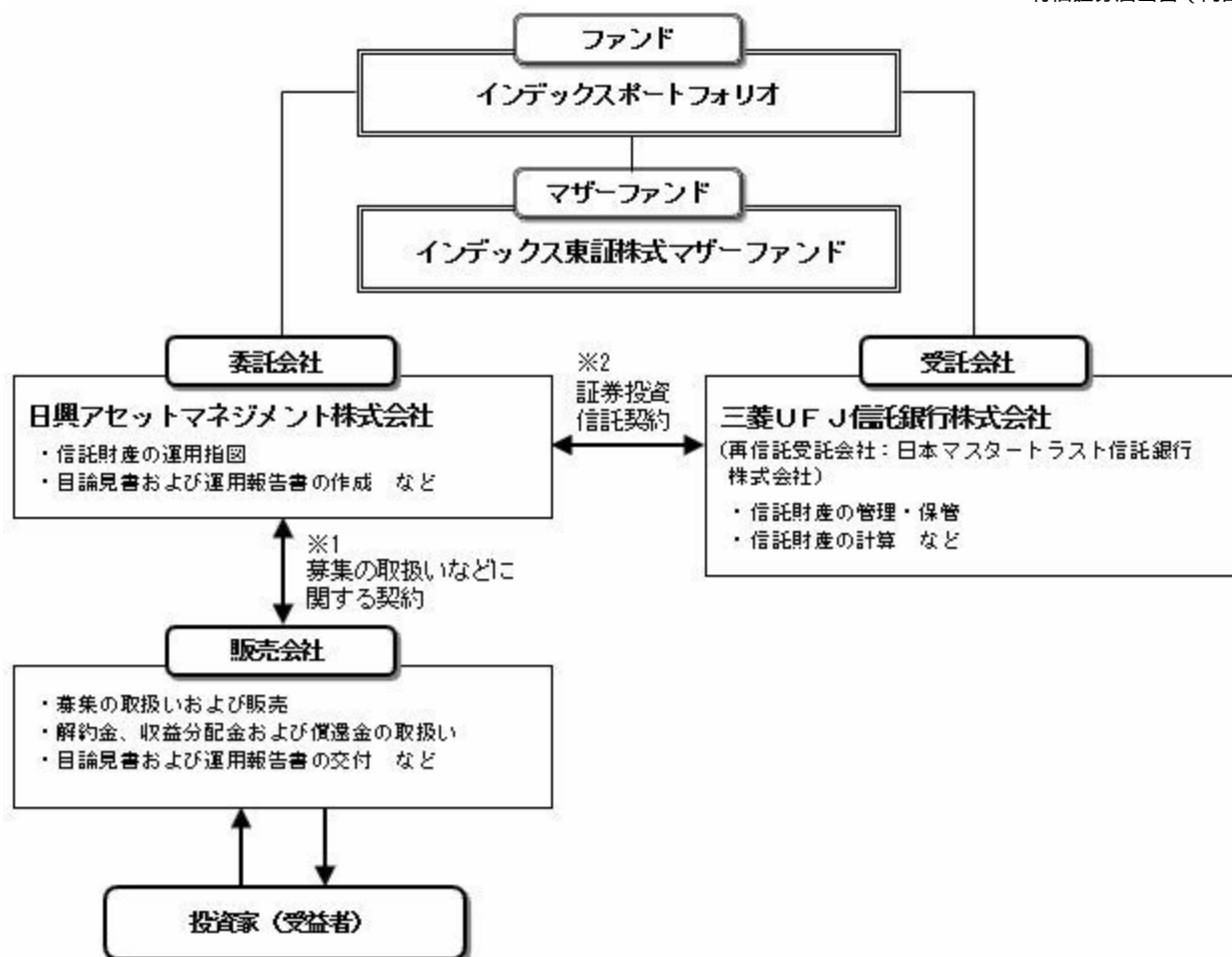
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2023年 2月 7日

- ・ミリオン（従業員積立投資プラン）としての取扱いを終了

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2025年5月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
2025年：「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に社名変更予定

2025年9月1日、日興アセットマネジメント株式会社は

「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に社名変更します。

社名変更後URL：www.amova-am.com

amova
アモーヴァ・アセットマネジメント

3) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）配当込みに連動する投資成果を目指します。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

＜インデックスポートフォリオ＞

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券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）金銭債権
- 3）約束手形
- 4）為替手形

主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1）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
 - 2）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1）の証券の性質を有するもの
 - 3）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。）
 - 4）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）資金の借入

＜インデックス東証株式マザーファンド＞

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1）有価証券
- 2）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第13条の2および第13条の4に定めるものに限りします。）
- 3）金銭債権
- 4）約束手形
- 5）為替手形

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

- 1）株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
 - 2）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 3）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2）の証券の性質を有するもの
 - 4）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 5）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

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

- 1）先物取引等
- 2）スワップ取引
- 3）有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

＜インデックス東証株式マザーファンド＞

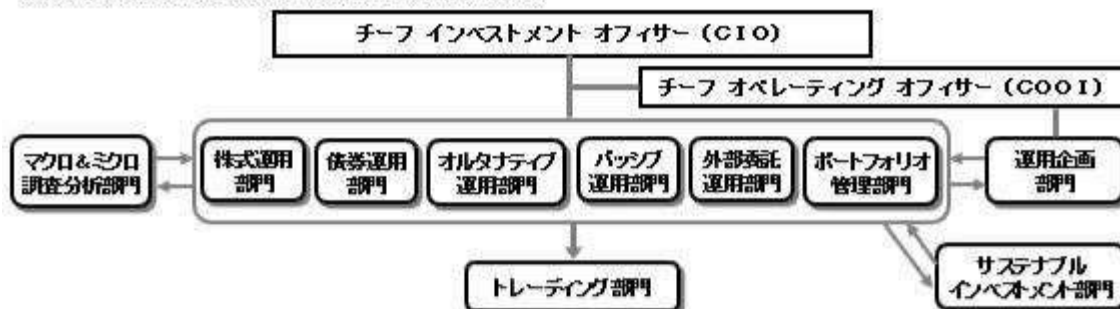
運用の基本方針		
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざします。	
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。	

投資方針	・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みの動きにできるだけ連動させるため、バーラ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行います。 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行ないます。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50％以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・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 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1986年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

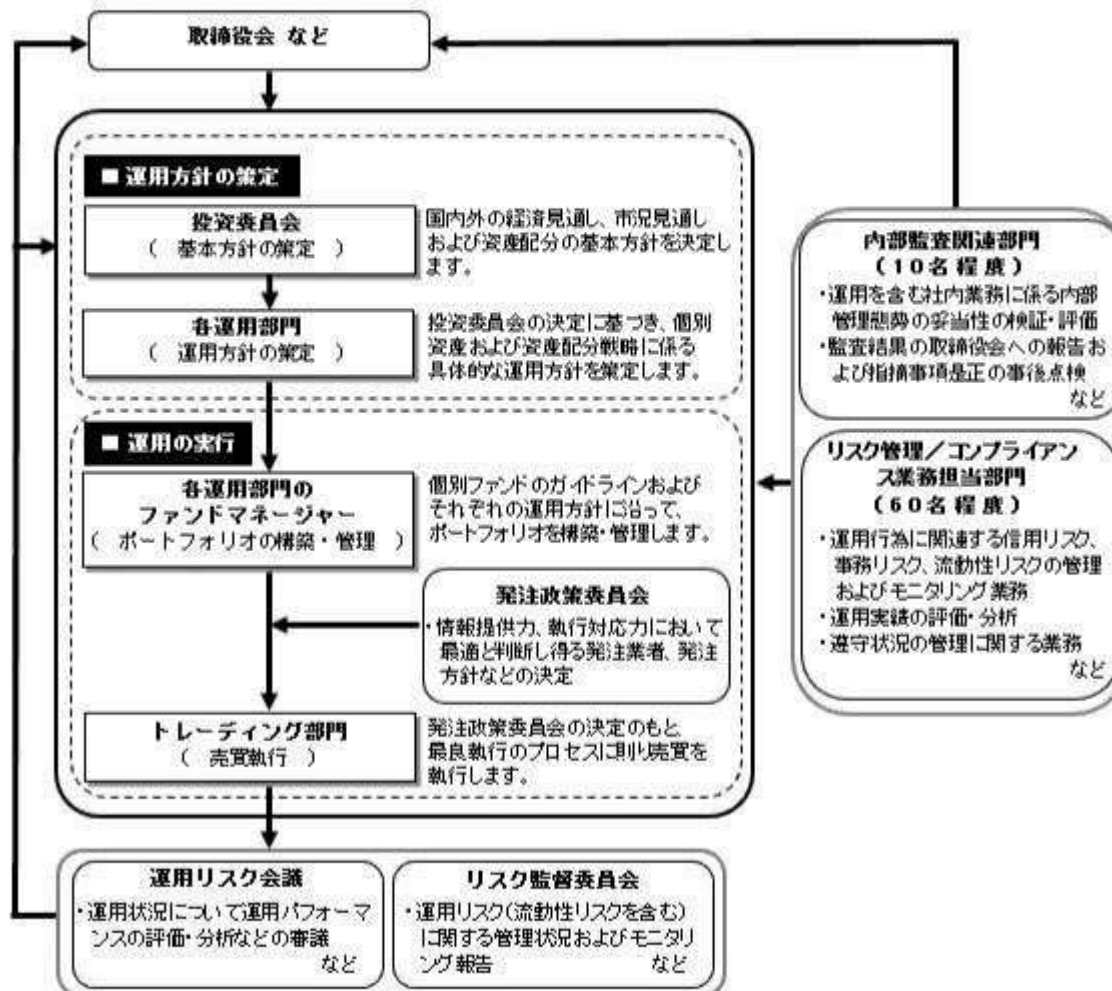
（３）【運用体制】

< 委託会社における運用体制 >

◆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・デューティー

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

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



上記体制は2025年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。

- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

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

ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<インデックス東証株式マザーファンド>

- 1) 株式への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 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。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 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10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 8) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

< T O P I X（東証株価指数）配当込みと基準価額の主なカイ離要因 >

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

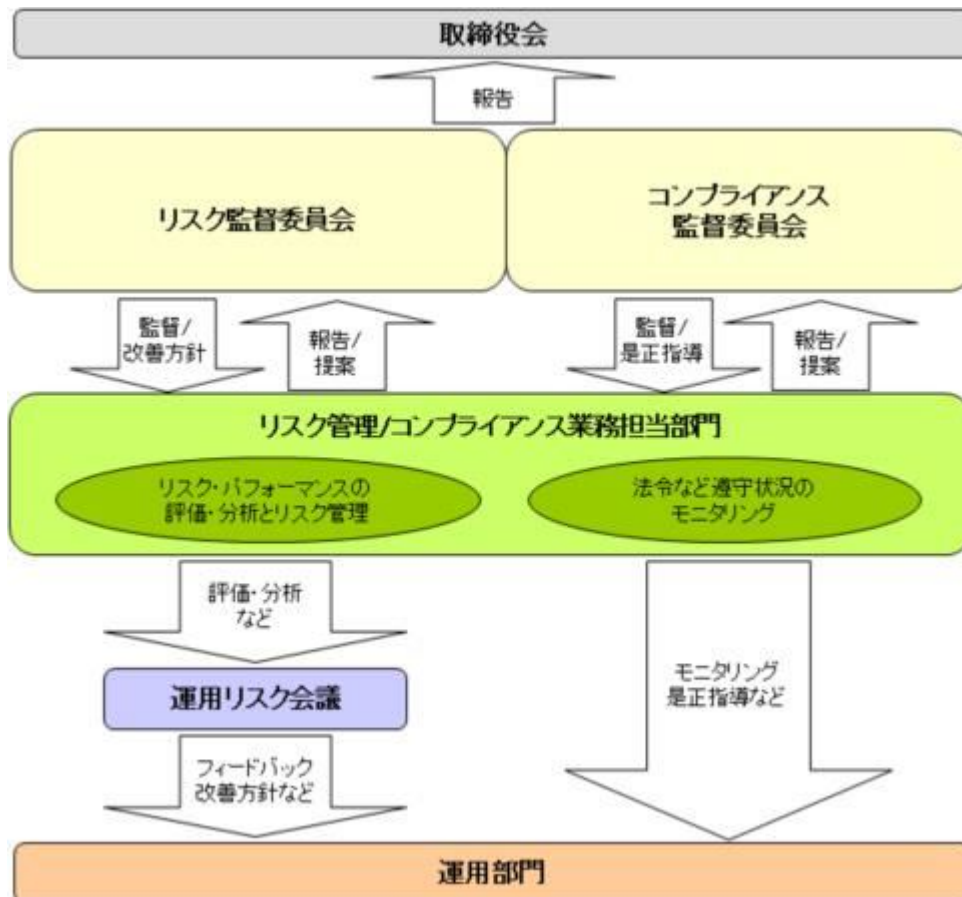
- ・T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること。
- ・また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- ・分配原資となる組入銘柄の配当金受け取りと、当ファンドの分配金支払いのタイミングや金額が完全には一致しないこと。
- ・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとT O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。
- ・有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

< その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・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・換金の取り扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることがあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額がカイ離する可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（２）リスク管理体制

< 委託会社におけるリスク管理体制 >



■ 全社的なリスク管理

当社は運用部門、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。

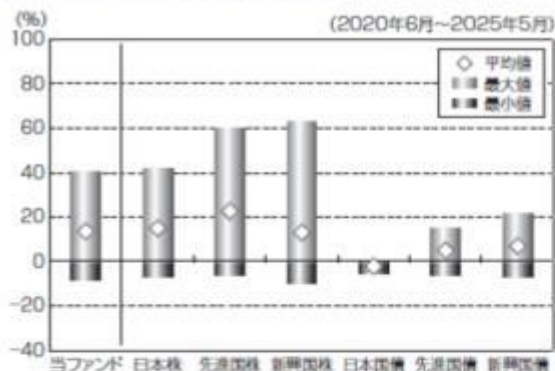
■ 法令など遵守状況のモニタリング

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・監督を行います。

上記体制は2025年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	13.7%	15.0%	22.7%	13.1%	-2.1%	5.0%	7.0%
最大値	40.5%	42.1%	59.8%	62.7%	0.6%	15.3%	21.5%
最小値	-8.6%	-7.1%	-5.8%	-9.7%	-5.5%	-6.1%	-7.0%

※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2020年6月から2025年5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・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※上記各指数の著作権等の知的財産権その他一切の権利は、各指数の算出元または公表元に帰属します。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX（東証株価指数）配当込み

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

MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込み、円ベース）

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

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

NOMURA-BPI国債

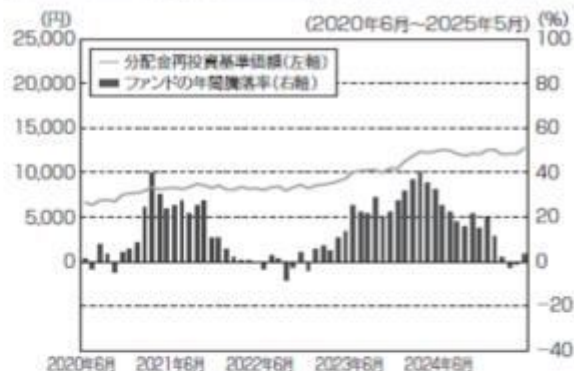
当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社（以下「NFRC」）が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

当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、2020年6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。

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。
信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.539%（税抜0.49%）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
0.49%	0.22%	0.22%	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。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。

・当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

個人受益者の場合

1）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

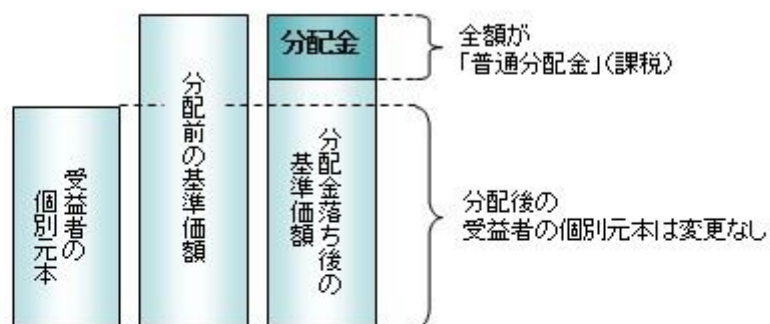
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

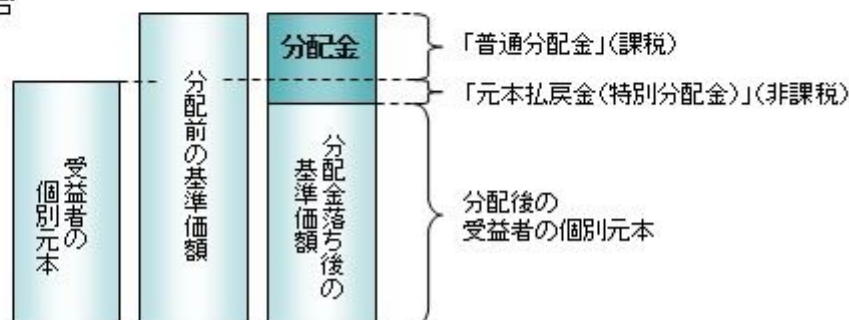
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2025年8月7日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変

更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年11月8日~2024年11月7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
0.53%	0.53%	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価額(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】

【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2025年 5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	9,307,745,582	99.97
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	—	2,988,171	0.03
合計(純資産総額)		9,310,733,753	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	インデックス東証株式マザーファンド	2,833,408,092	3.1710	8,984,737,060	3.2850	9,307,745,582	99.97

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.97
合 計	99.97

【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28計算期間末 (2015年11月 9日)	12,726	12,735	0.6615	0.6620
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	10,507	10,516	0.5690	0.5695

第30計算期間末	(2017年11月 7日)	12,193	12,201	0.7599	0.7604
第31計算期間末	(2018年11月 7日)	10,188	10,195	0.6952	0.6957
第32計算期間末	(2019年11月 7日)	10,181	10,188	0.7201	0.7206
第33計算期間末	(2020年11月 9日)	9,387	9,393	0.7182	0.7187
第34計算期間末	(2021年11月 8日)	9,766	9,771	0.8723	0.8728
第35計算期間末	(2022年11月 7日)	8,404	8,409	0.8389	0.8394
第36計算期間末	(2023年11月 7日)	8,407	8,411	1.0310	1.0315
第37計算期間末	(2024年11月 7日)	9,287	9,290	1.2329	1.2334
2024年 5月末日		9,623	—	1.2362	—
6月末日		9,728	—	1.2535	—
7月末日		9,566	—	1.2459	—
8月末日		9,252	—	1.2092	—
9月末日		9,090	—	1.1903	—
10月末日		9,133	—	1.2118	—
11月末日		9,047	—	1.2046	—
12月末日		9,377	—	1.2525	—
2025年 1月末日		9,327	—	1.2535	—
2月末日		8,951	—	1.2057	—
3月末日		8,870	—	1.2079	—
4月末日		8,887	—	1.2116	—
5月末日		9,310	—	1.2726	—

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005
第35期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0005
第36期	2022年11月 8日～2023年11月 7日	0.0005
第37期	2023年11月 8日～2024年11月 7日	0.0005
当中間期	2024年11月 8日～2025年 5月 7日	—

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	16.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	13.91
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	33.64
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	8.45
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	3.65

第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.19
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	21.53
第35期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	3.77
第36期	2022年11月 8日～2023年11月 7日	22.96
第37期	2023年11月 8日～2024年11月 7日	19.63
当中間期	2024年11月 8日～2025年 5月 7日	0.67

(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28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	397,656,514	3,710,414,810
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	404,194,947	1,174,901,250
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	324,013,392	2,744,057,822
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	240,808,421	1,634,396,234
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	252,391,538	768,201,863
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	226,616,601	1,294,592,956
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	170,327,435	2,044,549,305
第35期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	154,523,460	1,331,400,374
第36期	2022年11月 8日～2023年11月 7日	34,066,440	1,898,666,496
第37期	2023年11月 8日～2024年11月 7日	6,597,043	628,682,158
当中間期	2024年11月 8日～2025年 5月 7日	3,404,194	208,111,867

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

以下の運用状況は2025年 5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	9,232,787,110	98.51
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	139,804,538	1.49
合計（純資産総額）		9,372,591,648	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	111,900,000	1.19

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
------	----	-----	----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	123,400	2,543.39	313,854,784	2,769.00	341,694,600	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	80,100	2,715.93	217,546,674	3,810.00	305,181,000	3.26
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	146,700	1,616.83	237,189,054	2,025.50	297,140,850	3.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	59,700	3,963.68	236,631,928	4,046.00	241,546,200	2.58
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	47,200	3,206.52	151,347,832	3,700.00	174,640,000	1.86
日本	株式	任天堂	その他製品	14,700	8,087.30	118,883,416	11,835.00	173,974,500	1.86
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	17,600	9,675.81	170,294,256	8,689.00	152,926,400	1.63
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,300	66,890.00	153,847,000	60,740.00	139,702,000	1.49
日本	株式	三菱重工業	機械	41,000	2,220.19	91,027,865	3,352.00	137,432,000	1.47
日本	株式	三菱商事	卸売業	45,400	2,837.07	128,803,212	2,935.00	133,249,000	1.42
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	21,800	5,655.31	123,285,758	6,112.00	133,241,600	1.42
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	16,500	7,570.61	124,915,065	7,740.00	127,710,000	1.36
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	30,600	3,190.31	97,623,709	4,002.00	122,461,200	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	4,900	23,722.80	116,241,720	23,000.00	112,700,000	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	692,600	145.74	100,944,707	160.40	111,093,040	1.19
日本	株式	三井物産	卸売業	35,300	3,144.52	111,001,556	3,029.00	106,923,700	1.14
日本	株式	信越化学工業	化学	20,700	5,923.57	122,618,092	4,641.00	96,068,700	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	20,700	4,293.23	88,869,861	4,314.00	89,299,800	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	11,500	9,122.13	104,904,538	7,614.00	87,561,000	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	34,300	2,370.58	81,311,041	2,499.00	85,715,700	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	373,300	187.50	69,994,503	221.40	82,648,620	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	21,500	4,919.44	105,767,960	3,842.00	82,603,000	0.88
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	1,700	52,209.24	88,755,712	48,350.00	82,195,000	0.88
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	55,000	1,523.80	83,809,115	1,468.00	80,740,000	0.86
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	4,500	20,330.00	91,485,000	17,115.00	77,017,500	0.82
日本	株式	富士通	電気機器	21,600	3,056.88	66,028,675	3,318.00	71,668,800	0.76
日本	株式	三菱電機	電気機器	23,900	2,371.50	56,678,972	2,904.00	69,405,600	0.74
日本	株式	日本電気	電気機器	16,600	2,670.52	44,330,700	3,785.00	62,831,000	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	13,900	4,095.78	56,931,342	4,438.00	61,688,200	0.66
日本	株式	丸紅	卸売業	20,200	2,393.53	48,349,464	2,945.00	59,489,000	0.63

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	0.24
		建設業	2.23
		食料品	3.04
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.13
		化学	4.76
		医薬品	4.05
		石油・石炭製品	0.42

	ゴム製品	0.63
	ガラス・土石製品	0.61
	鉄鋼	0.77
	非鉄金属	0.88
	金属製品	0.48
	機械	5.79
	電気機器	17.11
	輸送用機器	7.21
	精密機器	2.01
	その他製品	3.05
	電気・ガス業	1.19
	陸運業	2.34
	海運業	0.64
	空運業	0.36
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	7.74
	卸売業	6.89
	小売業	4.72
	銀行業	8.92
	証券、商品先物取引業	0.85
	保険業	3.38
	その他金融業	1.09
	不動産業	1.89
	サービス業	4.45
合 計		98.51

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

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 2025年06月	買建	4	日本円	110,495,300	111,900,000	1.19

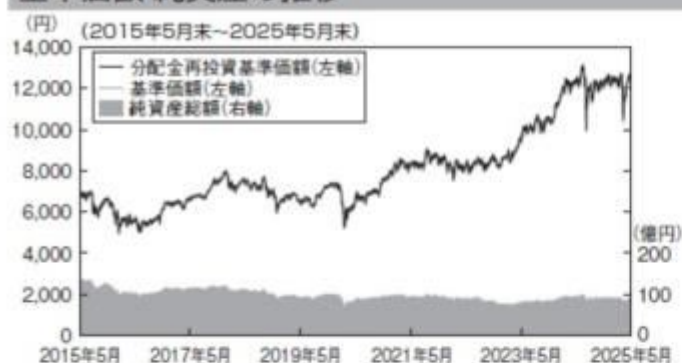
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

参考情報

運用実績

2025年5月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額 12,726円

純資産総額 93.10億円

※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、2015年5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)

2020年11月	2021年11月	2022年11月	2023年11月	2024年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	185円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	98.47%
株式先物	1.19%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.53%

※当ファンドの実質組入比率です。

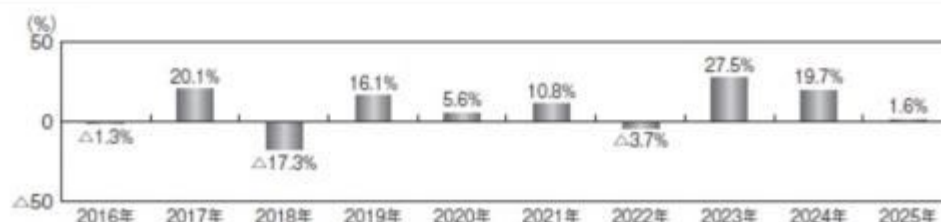
<組入上位10銘柄>

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.65%
2 ソニーグループ	電気機器	3.26%
3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	3.17%
4 日立製作所	電気機器	2.58%
5 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.86%
6 任天堂	その他製品	1.86%
7 リクルートホールディングス	サービス業	1.63%
8 キーエンス	電気機器	1.49%
9 三菱重工業	機械	1.47%
10 三菱商事	卸売業	1.42%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※2025年は、2025年5月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。

- (3) 取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 申込金額
取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (5) 申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (6) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約価額
解約請求受付日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (5) 手取額
1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
- (6) 解約単位
1口単位
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (7) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

< 買取請求による換金 >

- (1) 買取りの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 買取制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の買取りには受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 買取価額
買取請求受付日の基準価額から、当該買取りを行なう販売会社に係る源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額となります。なお、一定の要件の下では、買取請求受付日の基準価額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(6) 買取単位

1口単位

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

(7) 受付の中止および取消

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

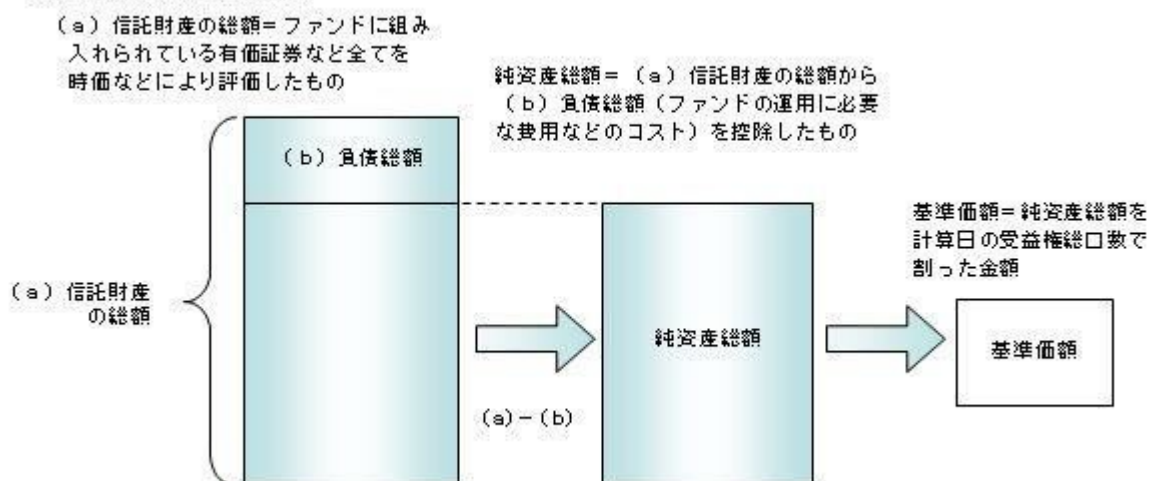
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

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。

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

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日より www.amova-am.com に変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（1987年11月27日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終

了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年11月8日から翌年11月7日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

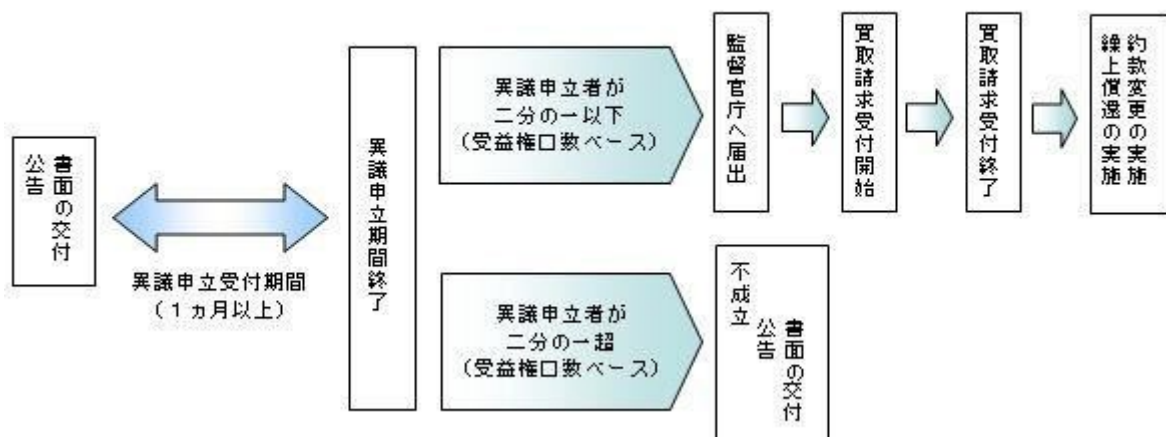
信託約款の変更

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

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 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提供されます。
- ・法令で定められた所要の要件¹を満たすことにより、交付運用報告書は電磁的方法²により提供されます。ただし、受益者から交付請求があった場合には、書面にて交付します。

1 あらかじめ、受益者からの承諾の取得または受益者への告知を行ないます。

2 販売会社が受益者のために開設している取引専用ページ内で提供する方法やメールにて送信する方法などがあります。詳しくは、販売会社へお問い合わせください。

- ・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、受益者から交付請求があった場合には、書面にて交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- （２） 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期計算期間（2023年11月 8日から2024年11月 7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】

【インデックスポートフォリオ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第36期 2023年11月 7日現在	第37期 2024年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,261,703	34,097,646
親投資信託受益証券	8,402,976,213	9,284,544,609
未収入金	4,000,816	1,688,117
未収利息	-	217
流動資産合計	8,437,238,732	9,320,330,589
資産合計	8,437,238,732	9,320,330,589
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,077,291	3,766,249
未払解約金	3,461,053	4,081,362
未払受託者報酬	2,282,542	2,571,467
未払委託者報酬	20,086,909	22,629,435
未払利息	4	-
その他未払費用	182,545	205,659
流動負債合計	30,090,344	33,254,172
負債合計	30,090,344	33,254,172
純資産の部		
元本等		
元本	8,154,583,290	7,532,498,175
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	252,565,098	1,754,578,242
（分配準備積立金）	3,606,954,523	4,849,742,892
元本等合計	8,407,148,388	9,287,076,417
純資産合計	8,407,148,388	9,287,076,417
負債純資産合計	8,437,238,732	9,320,330,589

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第36期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 7日	第37期 自 2023年11月 8日 至 2024年11月 7日
営業収益		
受取利息	-	23,363
有価証券売買等損益	1,703,131,343	1,665,719,147
営業収益合計	1,703,131,343	1,665,742,510
営業費用		
支払利息	5,870	250
受託者報酬	4,444,617	5,033,854
委託者報酬	39,113,710	44,299,015
その他費用	355,491	402,591
営業費用合計	43,919,688	49,735,710
営業利益又は営業損失（ ）	1,659,211,655	1,616,006,800
経常利益又は経常損失（ ）	1,659,211,655	1,616,006,800
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,659,211,655	1,616,006,800
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（ ）	89,139,571	91,523,491
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,614,238,060	252,565,098
剰余金増加額又は欠損金減少額	305,863,153	783,841
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	305,863,153	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	783,841
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,054,788	19,487,757
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	19,487,757
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,054,788	-
分配金	4,077,291	3,766,249
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	252,565,098	1,754,578,242

(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36期 2023年11月 7日現在	第37期 2024年11月 7日現在
1. 期首元本額	10,019,183,346円	8,154,583,290円
期中追加設定元本額	34,066,440円	6,597,043円
期中一部解約元本額	1,898,666,496円	628,682,158円
2. 受益権の総数	8,154,583,290口	7,532,498,175口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第36期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 7日		第37期 自 2023年11月 8日 至 2024年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	22,935円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,307,952,779円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,524,455,262円
C 信託約款に定める収益調整金	1,123,820,005円	C 信託約款に定める収益調整金	1,040,848,301円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	2,303,079,035円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	3,329,030,944円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	4,734,851,819円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	5,894,357,442円
F 分配対象収益(1万口当たり)	5,806円	F 分配対象収益(1万口当たり)	7,825円
G 分配金額	4,077,291円	G 分配金額	3,766,249円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第36期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 7日	第37期 自 2023年11月 8日 至 2024年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第36期 2023年11月 7日現在	第37期 2024年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 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36期（2023年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,606,029,582
合計	1,606,029,582

第37期（2024年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,568,394,551
合計	1,568,394,551

（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36期 2023年11月 7日現在	第37期 2024年11月 7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0310円 (10,310円)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2329円 (12,329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	インデックス東証株式マザーファンド	2,926,109,237	9,284,544,609	
合計		2,926,109,237	9,284,544,609	

(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。

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

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年11月 7日現在	2024年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	663,262	217,202
コール・ローン	75,854,712	87,440,216
株式	8,321,519,360	9,171,154,090
派生商品評価勘定	159,450	4,149,900
未収配当金	78,569,898	90,908,059

	2023年11月 7日現在	2024年11月 7日現在
未収利息	-	556
流動資産合計	8,476,766,682	9,353,870,023
資産合計	8,476,766,682	9,353,870,023
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	912,750	-
前受金	1,080,000	3,493,200
未払解約金	4,000,816	1,688,117
未払利息	11	-
流動負債合計	5,993,577	5,181,317
負債合計	5,993,577	5,181,317
純資産の部		
元本等		
元本	3,211,761,216	2,946,574,792
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,259,011,889	6,402,113,914
元本等合計	8,470,773,105	9,348,688,706
純資産合計	8,470,773,105	9,348,688,706
負債純資産合計	8,476,766,682	9,353,870,023

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月 7日現在	2024年11月 7日現在
1. 期首	2022年11月 8日	2023年11月 8日
期首元本額	3,985,739,219円	3,211,761,216円
期首からの追加設定元本額	45,130円	3,257,207円
期首からの一部解約元本額	774,023,133円	268,443,631円
元本の内訳		
インデックスポートフォリオ	3,186,566,634円	2,926,109,237円
バランスポートフォリオ	25,194,582円	20,465,555円
計	3,211,761,216円	2,946,574,792円
2. 受益権の総数	3,211,761,216口	2,946,574,792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	133,423,000円	125,872,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 7日	自 2023年11月 8日 至 2024年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 7日	自 2023年11月 8日 至 2024年11月 7日
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11月 7日現在	2024年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	335,785,437
合計	335,785,437

(2024年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	210,401,048
合計	210,401,048

(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11月 7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	140,580,000	-	139,830,000	750,000
合計		140,580,000	-	139,830,000	750,000

(2024年11月 7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	160,066,800	-	164,220,000	4,153,200
合計		160,066,800	-	164,220,000	4,153,200

(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11月 7日現在		2024年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.637円	1口当たり純資産額	3.173円
(1千口当たり純資産額)	(2,637円)	(1千口当たり純資産額)	(3,173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	100	4,035.00	403,500	
ニッスイ	3,300	930.30	3,069,990	
マルハニチロ	500	2,955.50	1,477,750	
雪国まいたけ	300	1,046.00	313,800	
カネコ種苗	100	1,384.00	138,400	
サカタのタネ	400	3,490.00	1,396,000	
ホクト	300	1,806.00	541,800	
住石ホールディングス	400	1,009.00	403,600	
日鉄鉱業	100	4,470.00	447,000	
I N P E X	9,900	2,047.50	20,270,250	
石油資源開発	1,800	1,151.00	2,071,800	
K & O エナジーグループ	100	3,130.00	313,000	
ショーボンドホールディングス	400	5,351.00	2,140,400	
ミライト・ワン	1,100	2,280.00	2,508,000	
タマホーム	200	3,780.00	756,000	
日本アクア	100	813.00	81,300	

第一カッター興業	100	1,460.00	146,000	
安藤・間	1,900	1,153.00	2,190,700	
東急建設	1,000	700.00	700,000	
コムシスホールディングス	1,200	3,261.00	3,913,200	
ピーアールホールディングス	500	348.00	174,000	
高松コンストラクショングループ	200	2,927.00	585,400	
東建コーポレーション	100	10,650.00	1,065,000	
ヤマウラ	200	1,203.00	240,600	
オリエンタル白石	1,200	381.00	457,200	
大成建設	2,100	7,350.00	15,435,000	
大林組	7,500	2,010.50	15,078,750	
清水建設	6,500	1,057.50	6,873,750	
長谷工コーポレーション	2,100	1,846.00	3,876,600	
松井建設	200	840.00	168,000	
鹿島建設	5,100	2,790.00	14,229,000	
不動テトラ	100	2,092.00	209,200	
鉄建建設	100	2,431.00	243,100	
西松建設	400	5,209.00	2,083,600	
三井住友建設	1,800	392.00	705,600	
大豊建設	100	3,440.00	344,000	
奥村組	400	4,395.00	1,758,000	
東鉄工業	200	3,225.00	645,000	
浅沼組	900	664.00	597,600	
戸田建設	2,800	950.20	2,660,560	
熊谷組	400	3,570.00	1,428,000	
矢作建設工業	300	1,530.00	459,000	
ピーエス・コンストラクション	200	1,045.00	209,000	
日本ハウスホールディングス	500	325.00	162,500	
新日本建設	300	1,577.00	473,100	
東亜道路工業	400	1,304.00	521,600	
日本道路	200	1,684.00	336,800	
東亜建設工業	700	1,003.00	702,100	
日本国土開発	600	526.00	315,600	
若築建設	100	3,670.00	367,000	
東洋建設	700	1,335.00	934,500	
五洋建設	3,000	639.50	1,918,500	
世紀東急工業	300	1,550.00	465,000	
福田組	100	5,690.00	569,000	
住友林業	2,000	5,615.00	11,230,000	
大和ハウス工業	6,900	4,636.00	31,988,400	
ライト工業	500	2,270.00	1,135,000	
積水ハウス	6,900	3,657.00	25,233,300	

日特建設	200	1,032.00	206,400	
北陸電気工事	200	1,150.00	230,000	
ユアテック	500	1,471.00	735,500	
日本リーテック	200	1,085.00	217,000	
四電工	300	1,488.00	446,400	
中電工	400	3,450.00	1,380,000	
関電工	1,200	2,178.00	2,613,600	
きんでん	1,600	3,084.00	4,934,400	
東京エネシス	200	1,069.00	213,800	
トーエネック	400	960.00	384,000	
住友電設	200	4,930.00	986,000	
日本電設工業	400	1,865.00	746,000	
エクシオグループ	2,400	1,608.50	3,860,400	
新日本空調	100	3,695.00	369,500	
九電工	500	5,594.00	2,797,000	
三機工業	500	2,442.00	1,221,000	
日揮ホールディングス	2,300	1,403.00	3,226,900	
中外炉工業	100	2,868.00	286,800	
太平電業	100	5,130.00	513,000	
高砂熱学工業	500	5,557.00	2,778,500	
朝日工業社	200	1,354.00	270,800	
明星工業	400	1,370.00	548,000	
大気社	300	5,070.00	1,521,000	
ダイダン	300	3,400.00	1,020,000	
日比谷総合設備	200	3,755.00	751,000	
飛島ホールディングス	200	1,562.00	312,400	
テスホールディングス	500	277.00	138,500	
インフロニア・ホールディングス	2,400	1,157.50	2,778,000	
東洋エンジニアリング	300	781.00	234,300	
レイズネクスト	300	1,579.00	473,700	
ニッポン	800	2,213.00	1,770,400	
日清製粉グループ本社	2,400	1,855.00	4,452,000	
昭和産業	200	2,852.00	570,400	
鳥越製粉	100	683.00	68,300	
中部飼料	300	1,388.00	416,400	
フィード・ワン	300	872.00	261,600	
日本甜菜製糖	100	2,530.00	253,000	
D M三井製糖ホールディングス	200	3,270.00	654,000	
塩水港精糖	100	274.00	27,400	
ウェルネオシュガー	100	2,268.00	226,800	
森永製菓	1,000	2,807.00	2,807,000	
中村屋	100	3,215.00	321,500	

江崎グリコ	700	4,312.00	3,018,400	
名糖産業	100	1,843.00	184,300	
井村屋グループ	100	2,431.00	243,100	
不二家	200	2,680.00	536,000	
山崎製パン	1,500	2,964.00	4,446,000	
モロゾフ	100	4,615.00	461,500	
亀田製菓	100	4,350.00	435,000	
寿スピリッツ	1,300	2,156.50	2,803,450	
カルビー	1,000	3,255.00	3,255,000	
森永乳業	900	3,456.00	3,110,400	
六甲バター	200	1,459.00	291,800	
ヤクルト本社	3,300	3,275.00	10,807,500	
明治ホールディングス	3,100	3,505.00	10,865,500	
雪印メグミルク	600	2,646.00	1,587,600	
プリマハム	300	2,235.00	670,500	
日本ハム	1,000	4,764.00	4,764,000	
丸大食品	200	1,656.00	331,200	
S Foods	300	2,808.00	842,400	
柿安本店	100	2,677.00	267,700	
伊藤ハム米久ホールディングス	400	3,825.00	1,530,000	
サッポロホールディングス	800	7,112.00	5,689,600	
アサヒグループホールディングス	17,300	1,807.50	31,269,750	
キリンホールディングス	9,600	2,239.50	21,499,200	
シマダヤ	100	1,437.00	143,700	
宝ホールディングス	1,500	1,211.00	1,816,500	
オエノンホールディングス	700	422.00	295,400	
養命酒製造	100	2,493.00	249,300	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	1,600	2,320.00	3,712,000	
サントリー食品インターナショナル	1,600	5,093.00	8,148,800	
ダイドーグループホールディングス	300	3,090.00	927,000	
伊藤園	800	3,345.00	2,676,000	
キーコーヒー	200	2,018.00	403,600	
日清オイリオグループ	300	5,210.00	1,563,000	
不二製油グループ本社	500	3,210.00	1,605,000	
J - オイルミルズ	300	2,099.00	629,700	
キッコーマン	7,600	1,747.00	13,277,200	
味の素	5,400	5,891.00	31,811,400	
ブルドックソース	100	1,808.00	180,800	
キュービー	1,200	3,603.00	4,323,600	
ハウス食品グループ本社	800	2,916.00	2,332,800	
カゴメ	1,000	3,036.00	3,036,000	
アリアケジャパン	200	5,240.00	1,048,000	

エバラ食品工業	100	2,977.00	297,700	
ニチレイ	900	4,126.00	3,713,400	
東洋水産	1,100	8,989.00	9,887,900	
イトアンドホールディングス	100	2,153.00	215,300	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	1,412.00	141,200	
日清食品ホールディングス	3,000	4,097.00	12,291,000	
フジッコ	200	1,734.00	346,800	
ロック・フィールド	300	1,458.00	437,400	
日本たばこ産業	14,000	4,225.00	59,150,000	
ケンコーマヨネーズ	100	2,177.00	217,700	
わらべや日洋ホールディングス	200	2,065.00	413,000	
なとり	100	2,141.00	214,100	
ファーマフーズ	300	1,008.00	302,400	
ユーグレナ	1,500	405.00	607,500	
紀文食品	200	1,104.00	220,800	
ピクルスホールディングス	100	1,051.00	105,100	
理研ビタミン	200	2,720.00	544,000	
片倉工業	200	2,028.00	405,600	
ゲンゼ	200	5,060.00	1,012,000	
東洋紡	1,000	976.00	976,000	
ユニチカ	700	295.00	206,500	
富士紡ホールディングス	100	4,875.00	487,500	
倉敷紡績	200	5,350.00	1,070,000	
シキボウ	200	1,013.00	202,600	
日本毛織	600	1,283.00	769,800	
帝国繊維	300	2,729.00	818,700	
帝人	2,200	1,419.50	3,122,900	
東レ	17,000	951.40	16,173,800	
セーレン	400	2,640.00	1,056,000	
小松マテーレ	300	793.00	237,900	
ワコールホールディングス	500	4,705.00	2,352,500	
ホギメディカル	300	4,575.00	1,372,500	
T S Iホールディングス	800	900.00	720,000	
ワールド	400	1,964.00	785,600	
三陽商会	100	2,630.00	263,000	
オンワードホールディングス	1,500	528.00	792,000	
ルックホールディングス	100	2,550.00	255,000	
ゴールドウイン	400	8,813.00	3,525,200	
デサント	400	4,330.00	1,732,000	
特種東海製紙	100	3,700.00	370,000	
王子ホールディングス	8,900	576.90	5,134,410	
日本製紙	1,200	903.00	1,083,600	

三菱製紙	100	500.00	50,000	
北越コーポレーション	1,300	1,589.00	2,065,700	
大王製紙	1,200	873.00	1,047,600	
レンゴー	2,100	909.40	1,909,740	
トモク	100	2,334.00	233,400	
ザ・パック	200	3,775.00	755,000	
北の達人コーポレーション	1,000	156.00	156,000	
クラレ	3,400	2,163.00	7,354,200	
旭化成	15,800	1,144.00	18,075,200	
レゾナック・ホールディングス	2,100	3,787.00	7,952,700	
住友化学	18,700	407.50	7,620,250	
住友精化	100	5,140.00	514,000	
日産化学	1,200	5,278.00	6,333,600	
ラサ工業	100	2,848.00	284,800	
クレハ	500	2,874.00	1,437,000	
多木化学	100	3,685.00	368,500	
テイカ	200	1,662.00	332,400	
石原産業	400	1,539.00	615,600	
日本曹達	500	2,550.00	1,275,000	
東ソー	3,100	2,054.00	6,367,400	
トクヤマ	700	2,774.00	1,941,800	
セントラル硝子	300	3,510.00	1,053,000	
東亜合成	1,100	1,562.00	1,718,200	
大阪ソーダ	800	1,621.00	1,296,800	
関東電化工業	500	1,011.00	505,500	
デンカ	800	2,189.50	1,751,600	
信越化学工業	21,000	5,887.00	123,627,000	
日本カーバイド工業	100	1,702.00	170,200	
堺化学工業	200	2,850.00	570,000	
第一稀元素化学工業	200	755.00	151,000	
エア・ウォーター	2,200	1,942.00	4,272,400	
日本酸素ホールディングス	2,300	4,769.00	10,968,700	
日本化学工業	100	2,687.00	268,700	
東邦アセチレン	100	354.00	35,400	
日本パーカライズिंग	1,000	1,320.00	1,320,000	
高压ガス工業	300	928.00	278,400	
四国化成ホールディングス	300	2,214.00	664,200	
ステラ ケミファ	100	4,425.00	442,500	
保土谷化学工業	100	4,395.00	439,500	
日本触媒	1,500	1,889.50	2,834,250	
大日精化工業	200	2,964.00	592,800	
カネカ	600	3,792.00	2,275,200	

三菱瓦斯化学	1,900	2,749.00	5,223,100	
三井化学	2,100	3,605.00	7,570,500	
東京応化工業	1,100	3,663.00	4,029,300	
大阪有機化学工業	200	2,913.00	582,600	
三菱ケミカルグループ	17,000	847.80	14,412,600	
K Hネオケム	400	2,090.00	836,000	
ダイセル	2,600	1,421.00	3,694,600	
住友ベークライト	700	4,204.00	2,942,800	
積水化学工業	4,600	2,358.50	10,849,100	
日本ゼオン	1,800	1,490.00	2,682,000	
アイカ工業	600	3,410.00	2,046,000	
U B E	1,200	2,563.50	3,076,200	
積水樹脂	300	2,271.00	681,300	
旭有機材	200	4,220.00	844,000	
ニチバン	100	1,948.00	194,800	
リケンテクノス	400	1,090.00	436,000	
大倉工業	100	2,769.00	276,900	
積水化成成品工業	300	370.00	111,000	
ダイキョーニシカワ	500	648.00	324,000	
森六ホールディングス	100	2,317.00	231,700	
恵和	200	1,044.00	208,800	
日本化薬	1,600	1,204.00	1,926,400	
カーリット	200	1,355.00	271,000	
日本精化	200	2,413.00	482,600	
扶桑化学工業	200	3,640.00	728,000	
トリケミカル研究所	300	3,020.00	906,000	
A D E K A	800	2,824.50	2,259,600	
日油	2,700	2,569.00	6,936,300	
新日本理化	100	195.00	19,500	
ハリマ化成グループ	200	878.00	175,600	
花王	5,700	6,474.00	36,901,800	
第一工業製薬	100	3,845.00	384,500	
石原ケミカル	100	2,303.00	230,300	
三洋化成工業	100	4,145.00	414,500	
大日本塗料	300	1,029.00	308,700	
日本ペイントホールディングス	10,300	1,083.00	11,154,900	
関西ペイント	2,000	2,417.00	4,834,000	
中国塗料	500	2,614.00	1,307,000	
藤倉化成	300	497.00	149,100	
太陽ホールディングス	400	3,970.00	1,588,000	
D I C	800	3,310.00	2,648,000	
サカタインクス	500	1,578.00	789,000	

artience	400	3,720.00	1,488,000	
富士フィルムホールディングス	14,100	3,515.00	49,561,500	
資生堂	4,900	3,182.00	15,591,800	
ライオン	3,000	1,645.00	4,935,000	
高砂香料工業	200	5,090.00	1,018,000	
マングラム	500	1,214.00	607,000	
ミルボン	400	3,160.00	1,264,000	
ファンケル	600	2,792.00	1,675,200	
コーセー	500	7,969.00	3,984,500	
コタ	200	1,616.00	323,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,200	1,468.00	1,761,600	
ノエビアホールディングス	200	5,030.00	1,006,000	
新日本製薬	100	1,729.00	172,900	
I - n e	100	2,051.00	205,100	
アクシージア	100	578.00	57,800	
エステー	200	1,498.00	299,600	
アグロ カネショウ	100	1,324.00	132,400	
コニシ	700	1,386.00	970,200	
長谷川香料	400	3,295.00	1,318,000	
小林製薬	600	5,500.00	3,300,000	
荒川化学工業	200	1,184.00	236,800	
メック	200	3,510.00	702,000	
タカラバイオ	700	993.00	695,100	
J C U	300	3,585.00	1,075,500	
O A T アグリオ	100	1,875.00	187,500	
デクセリアルズ	2,100	2,491.50	5,232,150	
アース製薬	200	5,160.00	1,032,000	
北興化学工業	200	1,315.00	263,000	
大成ラミック	100	2,567.00	256,700	
クミアイ化学工業	900	816.00	734,400	
日本農薬	300	670.00	201,000	
アキレス	100	1,537.00	153,700	
有沢製作所	300	1,432.00	429,600	
日東電工	7,400	2,577.00	19,069,800	
レック	300	1,326.00	397,800	
三光合成	300	624.00	187,200	
きもと	200	332.00	66,400	
Z A C R O S	200	4,360.00	872,000	
前澤化成工業	200	1,856.00	371,200	
未来工業	100	3,660.00	366,000	
J S P	200	2,007.00	401,400	
エフピコ	500	2,663.00	1,331,500	

天馬	200	2,979.00	595,800	
信越ポリマー	500	1,656.00	828,000	
東リ	100	471.00	47,100	
ニフコ	900	3,760.00	3,384,000	
バルカー	200	3,340.00	668,000	
ユニ・チャーム	4,900	4,705.00	23,054,500	
協和キリン	2,800	2,609.00	7,305,200	
武田薬品工業	20,800	4,234.00	88,067,200	
アステラス製薬	20,600	1,734.50	35,730,700	
住友ファーマ	2,200	588.00	1,293,600	
塩野義製薬	7,800	2,156.50	16,820,700	
日本新薬	600	4,147.00	2,488,200	
中外製薬	7,300	7,046.00	51,435,800	
科研製薬	400	3,889.00	1,555,600	
エーザイ	3,100	5,047.00	15,645,700	
ロート製薬	2,500	3,390.00	8,475,000	
小野薬品工業	4,800	2,004.00	9,619,200	
久光製薬	500	4,460.00	2,230,000	
持田製薬	300	3,370.00	1,011,000	
参天製薬	4,500	1,776.50	7,994,250	
扶桑薬品工業	100	2,720.00	272,000	
ツムラ	800	4,960.00	3,968,000	
キッセイ薬品工業	400	3,690.00	1,476,000	
生化学工業	500	862.00	431,000	
栄研化学	400	2,208.00	883,200	
鳥居薬品	100	4,115.00	411,500	
J C R ファーマ	800	679.00	543,200	
東和薬品	300	3,120.00	936,000	
富士製薬工業	200	1,305.00	261,000	
ゼリア新薬工業	400	2,255.00	902,000	
ネクセラファーマ	1,100	1,192.00	1,311,200	
第一三共	22,100	4,866.00	107,538,600	
杏林製薬	500	1,520.00	760,000	
大幸薬品	600	379.00	227,400	
ダイト	200	2,203.00	440,600	
大塚ホールディングス	5,800	9,500.00	55,100,000	
ペプチドリーム	1,100	2,745.50	3,020,050	
セルソース	200	1,169.00	233,800	
あすか製薬ホールディングス	200	2,159.00	431,800	
サワイグループホールディングス	1,400	1,989.00	2,784,600	
日本コークス工業	2,200	98.00	215,600	
ニチレキグループ	200	2,489.00	497,800	

ユシロ化学工業	100	1,595.00	159,500	
富士石油	600	338.00	202,800	
出光興産	10,900	1,033.50	11,265,150	
E N E O Sホールディングス	39,700	785.70	31,192,290	
コスモエネルギーホールディングス	800	7,526.00	6,020,800	
横浜ゴム	1,200	3,200.00	3,840,000	
T O Y O T I R E	1,300	2,223.00	2,889,900	
ブリヂストン	6,900	5,537.00	38,205,300	
住友ゴム工業	2,300	1,577.50	3,628,250	
藤倉コンポジット	200	1,242.00	248,400	
オカモト	100	5,390.00	539,000	
フコク	100	1,828.00	182,800	
ニッタ	200	3,750.00	750,000	
住友理工	500	1,662.00	831,000	
三ツ星ベルト	300	4,065.00	1,219,500	
バンドー化学	400	1,847.00	738,800	
日東紡績	300	6,390.00	1,917,000	
A G C	2,300	4,846.00	11,145,800	
日本板硝子	1,100	374.00	411,400	
日本電気硝子	900	3,393.00	3,053,700	
オハラ	100	1,317.00	131,700	
住友大阪セメント	400	3,717.00	1,486,800	
太平洋セメント	1,400	3,564.00	4,989,600	
日本ヒューム	200	1,274.00	254,800	
日本コンクリート工業	400	335.00	134,000	
三谷セキサン	100	6,530.00	653,000	
アジアパイルホールディングス	300	817.00	245,100	
東海カーボン	2,100	965.10	2,026,710	
日本カーボン	100	4,490.00	449,000	
東洋炭素	200	5,550.00	1,110,000	
ノリタケ	300	4,060.00	1,218,000	
T O T O	1,700	4,327.00	7,355,900	
日本碍子	2,700	2,052.00	5,540,400	
日本特殊陶業	1,900	4,923.00	9,353,700	
M A R U W A	100	46,680.00	4,668,000	
品川リフラクトリーズ	300	1,817.00	545,100	
黒崎播磨	100	2,542.00	254,200	
ヨータイ	100	1,678.00	167,800	
フジミインコーポレーテッド	600	2,498.00	1,498,800	
ニチアス	600	5,619.00	3,371,400	
ニチハ	300	3,555.00	1,066,500	
日本製鉄	12,200	3,213.00	39,198,600	

神戸製鋼所	4,800	1,721.00	8,260,800	
中山製鋼所	500	766.00	383,000	
合同製鐵	100	4,090.00	409,000	
J F E ホールディングス	7,200	1,888.00	13,593,600	
東京製鐵	700	1,572.00	1,100,400	
共英製鋼	200	1,768.00	353,600	
大和工業	500	8,200.00	4,100,000	
東京鐵鋼	100	6,580.00	658,000	
大阪製鐵	100	3,080.00	308,000	
淀川製鋼所	200	5,450.00	1,090,000	
中部鋼鈑	200	2,384.00	476,800	
丸一鋼管	700	3,417.00	2,391,900	
モリ工業	100	5,060.00	506,000	
大同特殊鋼	1,500	1,210.50	1,815,750	
日本冶金工業	200	4,125.00	825,000	
山陽特殊製鋼	200	1,924.00	384,800	
愛知製鋼	200	4,790.00	958,000	
大平洋金属	200	1,371.00	274,200	
新日本電工	1,500	296.00	444,000	
栗本鐵工所	100	4,180.00	418,000	
三菱製鋼	200	1,415.00	283,000	
日本精線	200	1,293.00	258,600	
エンビプロ・ホールディングス	300	502.00	150,600	
大紀アルミニウム工業所	400	1,118.00	447,200	
日本軽金属ホールディングス	700	1,548.00	1,083,600	
三井金属鉱業	600	4,838.00	2,902,800	
三菱マテリアル	1,700	2,586.00	4,396,200	
住友金属鉱山	3,000	4,372.00	13,116,000	
D O W A ホールディングス	700	5,355.00	3,748,500	
古河機械金属	300	1,702.00	510,600	
エス・サイエンス	1,300	24.00	31,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	400	2,028.00	811,200	
東邦チタニウム	500	1,011.00	505,500	
U A C J	300	5,100.00	1,530,000	
C K サンエツ	100	3,670.00	367,000	
古河電気工業	800	4,031.00	3,224,800	
住友電気工業	8,300	2,583.00	21,438,900	
フジクラ	2,600	5,808.00	15,100,800	
S W C C	300	5,610.00	1,683,000	
平河ヒューテック	200	1,614.00	322,800	
リョービ	300	1,959.00	587,700	
アーレスティ	100	574.00	57,400	

A R E ホールディングス	1,000	1,849.00	1,849,000	
稲葉製作所	100	1,800.00	180,000	
宮地エンジニアリンググループ	300	2,026.00	607,800	
トーカロ	700	1,871.00	1,309,700	
S U M C O	4,600	1,504.00	6,918,400	
川田テクノロジーズ	200	2,479.00	495,800	
R S T e c h n o l o g i e s	200	3,925.00	785,000	
信和	100	744.00	74,400	
東洋製罐グループホールディングス	1,500	2,308.50	3,462,750	
ホッカンホールディングス	100	1,744.00	174,400	
コロナ	100	947.00	94,700	
横河ブリッジホールディングス	400	2,830.00	1,132,000	
三和ホールディングス	2,400	4,465.00	10,716,000	
文化シャッター	600	1,847.00	1,108,200	
三協立山	300	764.00	229,200	
アルインコ	200	978.00	195,600	
L I X I L	3,500	1,743.50	6,102,250	
日本フィルコン	100	537.00	53,700	
ノーリツ	300	1,773.00	531,900	
長府製作所	300	1,986.00	595,800	
リンナイ	1,300	3,392.00	4,409,600	
ダイニチ工業	100	603.00	60,300	
日東精工	300	603.00	180,900	
岡部	400	805.00	322,000	
ジーテクト	300	1,602.00	480,600	
東プレ	400	1,820.00	728,000	
高周波熱錬	400	1,007.00	402,800	
東京製綱	100	1,183.00	118,300	
サンコール	300	406.00	121,800	
モリテック スチール	100	177.00	17,700	
パイオラックス	300	2,486.00	745,800	
エイチワン	300	915.00	274,500	
日本発條	2,100	1,888.00	3,964,800	
中央発條	200	1,272.00	254,400	
立川ブラインド工業	100	1,365.00	136,500	
日本製鋼所	700	5,601.00	3,920,700	
三浦工業	1,100	3,587.00	3,945,700	
タクマ	800	1,622.00	1,297,600	
ツガミ	500	1,429.00	714,500	
オークマ	400	3,360.00	1,344,000	
芝浦機械	300	3,770.00	1,131,000	
アマダ	3,300	1,562.50	5,156,250	

アイダエンジニアリング	500	798.00	399,000	
F U J I	1,000	2,299.00	2,299,000	
牧野フライス製作所	300	6,850.00	2,055,000	
オーエスジー	1,000	1,816.50	1,816,500	
旭ダイヤモンド工業	600	867.00	520,200	
D M G 森精機	1,500	2,748.00	4,122,000	
ソディック	600	785.00	471,000	
ディスコ	1,100	44,750.00	49,225,000	
日東工器	100	2,722.00	272,200	
日進工具	200	752.00	150,400	
パンチ工業	100	440.00	44,000	
富士ダイス	200	786.00	157,200	
リケン N P R	300	2,420.00	726,000	
東洋機械金属	100	622.00	62,200	
島精機製作所	400	1,097.00	438,800	
オプトラン	400	1,960.00	784,000	
イワキポンプ	200	3,075.00	615,000	
フリュー	200	1,100.00	220,000	
ヤマシンフィルタ	500	608.00	304,000	
日阪製作所	300	980.00	294,000	
やまびこ	400	2,519.00	1,007,600	
野村マイクロ・サイエンス	400	2,041.00	816,400	
平田機工	100	5,050.00	505,000	
P E G A S U S	300	456.00	136,800	
マルマエ	100	1,702.00	170,200	
タツモ	200	3,580.00	716,000	
ナブテスコ	1,500	2,470.00	3,705,000	
三井海洋開発	300	3,555.00	1,066,500	
レオン自動機	200	1,440.00	288,000	
S M C	700	67,870.00	47,509,000	
ホソカワミクロン	200	4,085.00	817,000	
ユニオンツール	100	6,970.00	697,000	
瑞光	200	1,256.00	251,200	
オイレス工業	300	2,029.00	608,700	
日精エー・エス・ビー機械	100	4,785.00	478,500	
サトーホールディングス	300	2,138.00	641,400	
技研製作所	200	1,754.00	350,800	
日本エアーテック	100	1,209.00	120,900	
日精樹脂工業	200	930.00	186,000	
ワイエイシイホールディングス	100	2,185.00	218,500	
小松製作所	11,900	4,349.00	51,753,100	
住友重機械工業	1,400	3,441.00	4,817,400	

日立建機	900	3,618.00	3,256,200	
日工	400	702.00	280,800	
巴工業	100	3,885.00	388,500	
井関農機	200	1,006.00	201,200	
T O W A	700	2,070.00	1,449,000	
北川鉄工所	100	1,255.00	125,500	
ローツェ	1,200	2,237.00	2,684,400	
クボタ	12,300	2,040.00	25,092,000	
荏原実業	100	4,560.00	456,000	
三菱化工機	100	3,225.00	322,500	
月島ホールディングス	300	1,387.00	416,100	
帝国電機製作所	200	2,885.00	577,000	
新東工業	500	1,010.00	505,000	
澁谷工業	200	3,740.00	748,000	
アイチ コーポレーション	400	1,219.00	487,600	
小森コーポレーション	600	1,117.00	670,200	
鶴見製作所	200	4,250.00	850,000	
酒井重工業	100	2,544.00	254,400	
荏原製作所	4,800	2,455.00	11,784,000	
西島製作所	200	2,913.00	582,600	
北越工業	200	1,784.00	356,800	
ダイキン工業	3,100	20,055.00	62,170,500	
オルガノ	400	8,270.00	3,308,000	
トーヨーカネツ	100	4,555.00	455,500	
栗田工業	1,300	5,858.00	7,615,400	
椿本チエイン	1,100	1,962.00	2,158,200	
木村化工機	200	784.00	156,800	
アネスト岩田	400	1,459.00	583,600	
ダイフク	4,000	2,931.50	11,726,000	
サムコ	100	3,285.00	328,500	
タダノ	1,400	1,051.50	1,472,100	
フジテック	800	5,634.00	4,507,200	
C K D	600	2,690.00	1,614,000	
平和	800	2,094.00	1,675,200	
理想科学工業	200	3,680.00	736,000	
S A N K Y O	2,700	1,985.00	5,359,500	
日本金銭機械	300	935.00	280,500	
マースグループホールディングス	200	3,245.00	649,000	
フクシマガリレイ	200	5,510.00	1,102,000	
ダイコク電機	100	3,400.00	340,000	
竹内製作所	400	5,120.00	2,048,000	
アマノ	700	4,342.00	3,039,400	

J U K I	400	407.00	162,800	
ジャノメ	200	927.00	185,400	
マックス	300	3,420.00	1,026,000	
グローリー	600	2,571.00	1,542,600	
新晃工業	200	4,510.00	902,000	
大和冷機工業	400	1,510.00	604,000	
セガサミーホールディングス	2,100	2,931.00	6,155,100	
T P R	300	2,393.00	717,900	
ツバキ・ナカシマ	600	707.00	424,200	
ホシザキ	1,500	5,000.00	7,500,000	
大豊工業	200	634.00	126,800	
日本精工	4,300	705.70	3,034,510	
N T N	5,600	256.20	1,434,720	
ジェイテクト	2,100	1,112.50	2,336,250	
不二越	200	3,285.00	657,000	
日本トムソン	600	503.00	301,800	
T H K	1,400	2,646.00	3,704,400	
ユーシン精機	200	664.00	132,800	
前澤給装工業	200	1,299.00	259,800	
イーグル工業	300	2,027.00	608,100	
P I L L A R	200	4,410.00	882,000	
キッツ	800	1,079.00	863,200	
マキタ	2,900	4,819.00	13,975,100	
三井E & S	1,300	1,202.00	1,562,600	
カナデビア	1,900	1,098.00	2,086,200	
三菱重工業	41,200	2,256.00	92,947,200	
I H I	1,900	9,285.00	17,641,500	
スター精密	400	2,005.00	802,000	
日清紡ホールディングス	1,800	929.30	1,672,740	
イビデン	1,400	5,303.00	7,424,200	
コニカミノルタ	5,300	706.40	3,743,920	
ブラザー工業	3,100	3,101.00	9,613,100	
ミネベアミツミ	4,100	2,675.50	10,969,550	
日立製作所	60,700	3,970.00	240,979,000	
三菱電機	24,000	2,757.50	66,180,000	
富士電機	1,400	8,514.00	11,919,600	
安川電機	2,600	4,529.00	11,775,400	
シンフォニアテクノロジー	200	5,510.00	1,102,000	
明電舎	400	4,120.00	1,648,000	
山洋電気	100	8,990.00	899,000	
デンヨー	200	2,643.00	528,600	
P H C ホールディングス	500	987.00	493,500	

KOKUSAI ELECTRIC	1,700	2,968.50	5,046,450	
ソシオネクスト	2,400	2,656.00	6,374,400	
東芝テック	400	3,630.00	1,452,000	
芝浦メカトロニクス	200	10,710.00	2,142,000	
マブチモーター	1,000	2,344.50	2,344,500	
ニデック	10,400	2,922.00	30,388,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	372.00	74,400	
トレックス・セミコンダクター	100	1,544.00	154,400	
東光高岳	100	2,047.00	204,700	
ダブル・スコープ	800	362.00	289,600	
ダイヘン	200	7,270.00	1,454,000	
ヤーマン	500	824.00	412,000	
JVCケンウッド	1,900	1,345.00	2,555,500	
ミマキエンジニアリング	200	1,526.00	305,200	
I - P E X	100	1,599.00	159,900	
大崎電気工業	500	772.00	386,000	
オムロン	2,200	5,793.00	12,744,600	
日東工業	300	3,000.00	900,000	
I D E C	400	2,657.00	1,062,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,100	2,809.00	3,089,900	
メルコホールディングス	100	2,341.00	234,100	
テクノメディカ	100	1,782.00	178,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	200	607.00	121,400	
日本電気	3,300	13,275.00	43,807,500	
富士通	21,700	2,787.50	60,488,750	
沖電気工業	1,200	1,041.00	1,249,200	
電気興業	100	1,903.00	190,300	
サンケン電気	200	5,953.00	1,190,600	
アイホン	200	2,877.00	575,400	
ルネサスエレクトロニクス	18,000	2,056.00	37,008,000	
セイコーエプソン	3,000	2,768.50	8,305,500	
ワコム	1,700	731.00	1,242,700	
アルバック	500	7,356.00	3,678,000	
アクセル	100	1,347.00	134,700	
E I Z O	300	2,294.00	688,200	
日本信号	600	933.00	559,800	
京三製作所	600	556.00	333,600	
能美防災	300	3,035.00	910,500	
ホーチキ	200	2,331.00	466,200	
星和電機	100	522.00	52,200	
エレコム	600	1,479.00	887,400	
パナソニック ホールディングス	27,900	1,405.50	39,213,450	

シャープ	3,400	901.00	3,063,400	
アンリツ	1,700	1,185.00	2,014,500	
富士通ゼネラル	700	1,948.00	1,363,600	
ソニーグループ	81,700	2,772.00	226,472,400	
T D K	20,400	2,045.00	41,718,000	
帝国通信工業	100	2,760.00	276,000	
タムラ製作所	1,000	559.00	559,000	
アルプスアルパイン	1,900	1,612.00	3,062,800	
日本電波工業	300	1,049.00	314,700	
鈴木	100	1,880.00	188,000	
メイコー	200	6,600.00	1,320,000	
日本トリム	100	3,655.00	365,500	
フォスター電機	300	1,836.00	550,800	
S M K	100	2,367.00	236,700	
ヨコオ	200	1,530.00	306,000	
ティアック	500	85.00	42,500	
ホシデン	600	2,429.00	1,457,400	
ヒロセ電機	300	19,035.00	5,710,500	
日本航空電子工業	600	2,872.00	1,723,200	
T O A	300	951.00	285,300	
マクセル	500	1,834.00	917,000	
古野電気	300	2,623.00	786,900	
スミダコーポレーション	400	989.00	395,600	
アイコム	100	2,902.00	290,200	
リオン	100	2,482.00	248,200	
横河電機	2,600	3,682.00	9,573,200	
新電元工業	100	2,449.00	244,900	
アズビル	6,400	1,216.00	7,782,400	
東亜ディーケーケー	100	739.00	73,900	
日本光電工業	2,100	2,271.50	4,770,150	
チノー	100	2,188.00	218,800	
共和電業	200	425.00	85,000	
日本電子材料	200	2,443.00	488,600	
堀場製作所	400	9,622.00	3,848,800	
アドバンテスト	7,400	9,767.00	72,275,800	
小野測器	100	543.00	54,300	
エスベック	200	2,672.00	534,400	
キーエンス	2,300	67,240.00	154,652,000	
日置電機	100	8,180.00	818,000	
シスメックス	6,100	2,985.50	18,211,550	
日本マイクロニクス	400	3,845.00	1,538,000	
メガチップス	200	5,550.00	1,110,000	

OBARA GROUP	200	4,280.00	856,000	
原田工業	100	542.00	54,200	
コーセル	300	1,275.00	382,500	
イリソ電子工業	300	2,951.00	885,300	
オブテックスグループ	400	1,634.00	653,600	
千代田インテグレ	100	3,345.00	334,500	
レーザーテック	1,100	19,900.00	21,890,000	
スタンレー電気	1,500	2,645.00	3,967,500	
ウシオ電機	1,000	2,142.50	2,142,500	
岡谷電機産業	200	225.00	45,000	
日本セラミック	200	2,597.00	519,400	
古河電池	200	1,373.00	274,600	
山一電機	200	2,613.00	522,600	
図研	200	3,585.00	717,000	
日本電子	500	5,815.00	2,907,500	
カシオ計算機	1,900	1,116.50	2,121,350	
ファナック	11,300	4,309.00	48,691,700	
日本シイエムケイ	800	435.00	348,000	
エンプラス	100	5,520.00	552,000	
大真空	300	560.00	168,000	
ローム	4,200	1,720.00	7,224,000	
浜松ホトニクス	3,700	2,073.50	7,671,950	
三井ハイテック	1,100	842.00	926,200	
新光電気工業	800	5,405.00	4,324,000	
京セラ	14,500	1,557.00	22,576,500	
太陽誘電	1,000	2,780.50	2,780,500	
村田製作所	20,900	2,777.00	58,039,300	
双葉電子工業	500	518.00	259,000	
ニチコン	700	1,139.00	797,300	
日本ケミコン	300	1,174.00	352,200	
K O A	400	1,046.00	418,400	
市光工業	500	462.00	231,000	
小糸製作所	2,400	2,028.00	4,867,200	
ミツバ	500	867.00	433,500	
S C R E E Nホールディングス	1,000	10,175.00	10,175,000	
キャノン電子	200	2,430.00	486,000	
キャノン	11,600	5,064.00	58,742,400	
リコー	6,100	1,704.50	10,397,450	
象印マホービン	700	1,615.00	1,130,500	
東京エレクトロン	4,900	23,055.00	112,969,500	
イノテック	200	1,475.00	295,000	
トヨタ紡織	1,000	2,049.00	2,049,000	

ユニプレス	400	1,135.00	454,000	
豊田自動織機	2,000	11,060.00	22,120,000	
モリタホールディングス	400	2,143.00	857,200	
三櫻工業	300	744.00	223,200	
デンソー	24,800	2,353.00	58,354,400	
東海理化電機製作所	700	2,156.00	1,509,200	
川崎重工業	1,800	6,625.00	11,925,000	
名村造船所	700	1,746.00	1,222,200	
日本車輛製造	100	2,202.00	220,200	
三菱ロジスネクスト	400	1,254.00	501,600	
日産自動車	30,600	410.00	12,546,000	
いすゞ自動車	7,200	1,973.50	14,209,200	
トヨタ自動車	124,000	2,762.00	342,488,000	代用有価証券 20,000株
日野自動車	3,500	380.50	1,331,750	
三菱自動車工業	9,200	460.60	4,237,520	
武蔵精密工業	600	1,991.00	1,194,600	
日産車体	300	1,067.00	320,100	
新明和工業	700	1,374.00	961,800	
極東開発工業	300	2,474.00	742,200	
トピー工業	200	1,983.00	396,600	
タチエス	400	1,802.00	720,800	
N O K	900	2,256.00	2,030,400	
フタバ産業	700	671.00	469,700	
カヤバ	200	4,840.00	968,000	
大同メタル工業	500	502.00	251,000	
プレス工業	900	554.00	498,600	
太平洋工業	500	1,399.00	699,500	
アイシン	4,900	1,675.50	8,209,950	
マツダ	7,100	1,055.00	7,490,500	
本田技研工業	55,300	1,420.00	78,526,000	
スズキ	18,900	1,512.00	28,576,800	
S U B A R U	7,200	2,486.00	17,899,200	
ヤマハ発動機	9,800	1,407.50	13,793,500	
エクセディ	400	4,050.00	1,620,000	
豊田合成	700	2,645.00	1,851,500	
愛三工業	500	1,419.00	709,500	
ヨロズ	200	1,199.00	239,800	
エフ・シー・シー	400	2,764.00	1,105,600	
シマノ	1,000	23,040.00	23,040,000	
テイ・エス テック	900	1,769.50	1,592,550	
ジャムコ	100	1,232.00	123,200	
テルモ	15,600	2,979.50	46,480,200	

日機装	600	1,057.00	634,200	
日本エム・ディ・エム	200	624.00	124,800	
島津製作所	3,300	4,656.00	15,364,800	
J M S	200	482.00	96,400	
長野計器	200	2,474.00	494,800	
ブイ・テクノロジー	100	2,457.00	245,700	
東京計器	200	3,235.00	647,000	
愛知時計電機	100	2,045.00	204,500	
インターアクション	100	1,061.00	106,100	
オーバル	100	381.00	38,100	
東京精密	500	8,890.00	4,445,000	
マニー	900	1,872.50	1,685,250	
ニコン	3,700	1,931.00	7,144,700	
トプコン	1,300	1,610.50	2,093,650	
オリンパス	13,400	2,697.00	36,139,800	
理研計器	300	4,305.00	1,291,500	
タムロン	300	4,030.00	1,209,000	
H O Y A	4,600	20,935.00	96,301,000	
シード	100	496.00	49,600	
ノーリツ鋼機	200	4,075.00	815,000	
A & Dホロンホールディングス	300	2,229.00	668,700	
朝日インテック	2,800	2,424.00	6,787,200	
シチズン時計	2,100	933.00	1,959,300	
大研医器	100	504.00	50,400	
メニコン	900	1,692.00	1,522,800	
松風	200	2,145.00	429,000	
セイコーグループ	400	3,920.00	1,568,000	
ニプロ	1,900	1,400.00	2,660,000	
三井松島ホールディングス	200	4,240.00	848,000	
K Y O R I T S U	100	150.00	15,000	
パラマウントベッドホールディングス	500	2,625.00	1,312,500	
トランザクション	200	2,318.00	463,600	
ニホンフラッシュ	200	896.00	179,200	
前田工織	400	1,751.00	700,400	
永大産業	100	215.00	21,500	
アートネイチャー	200	854.00	170,800	
フルヤ金属	200	4,065.00	813,000	
バンダイナムコホールディングス	6,300	3,222.00	20,298,600	
S H O E I	700	2,289.00	1,602,300	
フランスベッドホールディングス	300	1,260.00	378,000	
パイロットコーポレーション	400	4,934.00	1,973,600	
萩原工業	200	1,467.00	293,400	

フジシールインターナショナル	500	2,533.00	1,266,500	
タカラトミー	1,000	4,200.00	4,200,000	
広済堂ホールディングス	900	547.00	492,300	
プロネクサス	200	1,270.00	254,000	
TOPPANホールディングス	3,100	4,724.00	14,644,400	
大日本印刷	4,800	2,730.00	13,104,000	
共同印刷	100	3,570.00	357,000	
NISSHA	400	1,954.00	781,600	
TAKARA & COMPANY	100	2,695.00	269,500	
アシックス	8,600	2,608.50	22,433,100	
ツツミ	100	2,120.00	212,000	
ローランド	200	3,915.00	783,000	
小松ウオール工業	200	1,529.00	305,800	
ヤマハ	4,300	1,129.00	4,854,700	
河合楽器製作所	100	2,801.00	280,100	
クリナップ	200	711.00	142,200	
ピジョン	1,500	1,586.00	2,379,000	
キングジム	200	865.00	173,000	
リンテック	500	3,275.00	1,637,500	
イトーキ	500	1,607.00	803,500	
任天堂	14,700	8,208.00	120,657,600	代用有価証券 4,000株
三菱鉛筆	300	2,610.00	783,000	
タカラスタANDARD	500	1,640.00	820,000	
コクヨ	1,200	2,712.00	3,254,400	
ナカバヤシ	300	524.00	157,200	
グローブライド	200	1,981.00	396,200	
オカムラ	700	1,999.00	1,399,300	
美津濃	200	8,040.00	1,608,000	
グリムス	100	2,583.00	258,300	
東京電力ホールディングス	19,600	627.90	12,306,840	
中部電力	8,600	1,735.00	14,921,000	
関西電力	9,800	2,512.50	24,622,500	
中国電力	4,100	1,085.50	4,450,550	
北陸電力	2,400	1,040.50	2,497,200	
東北電力	6,100	1,315.00	8,021,500	
四国電力	2,200	1,363.00	2,998,600	
九州電力	5,400	1,640.00	8,856,000	
北海道電力	2,500	964.90	2,412,250	
沖縄電力	600	1,021.00	612,600	
電源開発	1,800	2,676.00	4,816,800	
エフオン	200	355.00	71,000	
イーレックス	500	635.00	317,500	

レノバ	700	873.00	611,100	
東京瓦斯	4,500	3,854.00	17,343,000	
大阪瓦斯	4,600	3,305.00	15,203,000	
東邦瓦斯	900	3,824.00	3,441,600	
北海道瓦斯	700	555.00	388,500	
広島ガス	500	388.00	194,000	
西部ガスホールディングス	200	1,775.00	355,000	
静岡ガス	600	1,000.00	600,000	
メタウォーター	300	1,798.00	539,400	
SBSホールディングス	200	2,424.00	484,800	
東武鉄道	2,500	2,620.00	6,550,000	
相鉄ホールディングス	800	2,463.00	1,970,400	
東急	6,500	1,934.50	12,574,250	
京浜急行電鉄	2,900	1,231.00	3,569,900	
小田急電鉄	3,900	1,608.00	6,271,200	
京王電鉄	1,200	3,949.00	4,738,800	
京成電鉄	1,400	4,075.00	5,705,000	
富士急行	300	2,416.00	724,800	
東日本旅客鉄道	12,900	3,004.00	38,751,600	
西日本旅客鉄道	6,000	2,703.00	16,218,000	
東海旅客鉄道	9,000	3,202.00	28,818,000	
西武ホールディングス	2,500	3,449.00	8,622,500	
鴻池運輸	400	2,474.00	989,600	
西日本鉄道	700	2,211.00	1,547,700	
ハマキョウレックス	800	1,237.00	989,600	
サカイ引越センター	300	2,425.00	727,500	
近鉄グループホールディングス	2,500	3,507.00	8,767,500	
阪急阪神ホールディングス	3,100	3,964.00	12,288,400	
南海電気鉄道	1,000	2,509.50	2,509,500	
京阪ホールディングス	1,300	2,846.50	3,700,450	
神戸電鉄	100	2,327.00	232,700	
名古屋鉄道	2,600	1,715.00	4,459,000	
山陽電気鉄道	200	2,030.00	406,000	
ヤマトホールディングス	2,800	1,594.00	4,463,200	
山九	600	5,265.00	3,159,000	
丸全昭和運輸	100	5,980.00	598,000	
センコーグループホールディングス	1,400	1,430.00	2,002,000	
ニッコンホールディングス	1,300	1,955.50	2,542,150	
福山通運	200	3,810.00	762,000	
セイノーホールディングス	1,100	2,394.50	2,633,950	
神奈川中央交通	100	3,370.00	337,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	700	1,018.00	712,600	

九州旅客鉄道	1,800	3,830.00	6,894,000	
S Gホールディングス	3,900	1,545.00	6,025,500	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	800	7,472.00	5,977,600	
日本郵船	4,800	4,834.00	23,203,200	
商船三井	4,400	5,284.00	23,249,600	
川崎汽船	5,300	2,176.00	11,532,800	
N S ユナイテッド海運	200	4,090.00	818,000	
飯野海運	900	1,136.00	1,022,400	
乾汽船	300	1,156.00	346,800	
日本航空	5,300	2,445.00	12,958,500	
A N Aホールディングス	6,400	2,869.00	18,361,600	
ランコム	100	10,230.00	1,023,000	
日新	200	4,345.00	869,000	
三菱倉庫	2,900	1,021.00	2,960,900	
三井倉庫ホールディングス	200	7,080.00	1,416,000	
住友倉庫	700	2,669.00	1,868,300	
澁澤倉庫	100	3,195.00	319,500	
日本トランスシティ	400	975.00	390,000	
中央倉庫	100	1,575.00	157,500	
安田倉庫	100	1,612.00	161,200	
上組	1,100	3,156.00	3,471,600	
キューソー流通システム	100	1,975.00	197,500	
エーアイティー	100	1,785.00	178,500	
内外トランスライン	100	2,799.00	279,900	
日本コンセプト	100	1,800.00	180,000	
N E C ネットズエスアイ	900	3,255.00	2,929,500	
クロスキャット	100	1,150.00	115,000	
システナ	3,400	348.00	1,183,200	
デジタルアーツ	100	5,870.00	587,000	
日鉄ソリューションズ	800	4,096.00	3,276,800	
キューブシステム	100	1,012.00	101,200	
コア	100	1,890.00	189,000	
ラクーンホールディングス	200	727.00	145,400	
ソリトンシステムズ	100	1,273.00	127,300	
ソフトクリエイイトホールディングス	200	2,124.00	424,800	
T I S	2,500	3,797.00	9,492,500	
テクミラホールディングス	100	317.00	31,700	
グリー	800	414.00	331,200	
コーエーテクモホールディングス	1,800	1,611.00	2,899,800	
三菱総合研究所	100	4,275.00	427,500	
ファインデックス	200	862.00	172,400	
K L a b	600	182.00	109,200	

ポルトゥウィンホールディングス	400	437.00	174,800	
ネクソン	5,100	2,650.50	13,517,550	
アイスタイル	800	424.00	339,200	
エムアップホールディングス	300	1,360.00	408,000	
エイチーム	200	633.00	126,600	
エニグモ	300	300.00	90,000	
テクノスジャパン	100	709.00	70,900	
e n i s h	100	174.00	17,400	
コロプラ	800	487.00	389,600	
ブロードリーフ	1,000	563.00	563,000	
クロス・マーケティンググループ	100	703.00	70,300	
デジタルハーツホールディングス	200	831.00	166,200	
メディアドゥ	100	1,311.00	131,100	
じげん	600	616.00	369,600	
フィックスターズ	200	1,439.00	287,800	
C A R T A H O L D I N G S	100	1,472.00	147,200	
オブティム	300	589.00	176,700	
セレス	100	1,686.00	168,600	
S H I F T	200	15,440.00	3,088,000	
ティーガイア	200	2,668.00	533,600	
テクマトリックス	500	2,447.00	1,223,500	
プロシップ	100	1,529.00	152,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	600	3,382.00	2,029,200	
G M O ペイメントゲートウェイ	500	8,783.00	4,391,500	
システムリサーチ	200	1,534.00	306,800	
インターネットイニシアティブ	1,300	2,980.00	3,874,000	
さくらインターネット	400	4,895.00	1,958,000	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	100	2,889.00	288,900	
S R A ホールディングス	100	4,305.00	430,500	
朝日ネット	300	635.00	190,500	
e B A S E	300	667.00	200,100	
アバントグループ	300	2,042.00	612,600	
アドソル日進	100	1,864.00	186,400	
フリービット	100	1,343.00	134,300	
コムチュア	300	2,281.00	684,300	
アステリア	200	504.00	100,800	
アイル	100	3,105.00	310,500	
マークライنز	100	2,714.00	271,400	
メディカル・データ・ビジョン	300	509.00	152,700	
g u m i	400	313.00	125,200	
テラスカイ	100	1,878.00	187,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	2,043.00	204,300	

ネオジャパン	100	1,841.00	184,100	
ラクス	1,100	2,013.00	2,214,300	
ダブルスタンダード	100	1,618.00	161,800	
オープンドア	200	699.00	139,800	
アカツキ	100	2,129.00	212,900	
U b i c o mホールディングス	100	1,310.00	131,000	
カナミックネットワーク	300	530.00	159,000	
ノムラシステムコーポレーション	100	116.00	11,600	
チェンジホールディングス	600	1,239.00	743,400	
シンクロ・フード	100	470.00	47,000	
オークネット	100	2,409.00	240,900	
マクロミル	500	815.00	407,500	
オロ	100	2,429.00	242,900	
ユーザーローカル	100	1,849.00	184,900	
ニーズウェル	100	283.00	28,300	
マネーフォワード	600	4,925.00	2,955,000	
S u n A s t e r i s k	200	537.00	107,400	
プラスアルファ・コンサルティング	300	2,104.00	631,200	
電算システムホールディングス	100	2,718.00	271,800	
A p p i e r G r o u p	700	1,622.00	1,135,400	
ビジョナル	300	8,176.00	2,452,800	
ソルクシーズ	100	283.00	28,300	
ハイマックス	100	1,394.00	139,400	
野村総合研究所	5,100	4,491.00	22,904,100	
C E ホールディングス	100	438.00	43,800	
日本システム技術	200	1,777.00	355,400	
インテージホールディングス	300	1,577.00	473,100	
東邦システムサイエンス	100	1,455.00	145,500	
ソースネクスト	1,200	233.00	279,600	
シンプレクス・ホールディングス	500	2,474.00	1,237,000	
H E R O Z	100	1,118.00	111,800	
ラクスル	600	1,239.00	743,400	
メルカリ	1,100	1,828.50	2,011,350	
I P S	100	2,420.00	242,000	
F I G	100	315.00	31,500	
システムサポート	100	1,755.00	175,500	
イーソル	200	714.00	142,800	
ウイングアーク1 s t	200	3,255.00	651,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	837.00	83,700	
S a n s a n	800	2,164.00	1,731,200	
ギフトィ	200	938.00	187,600	
メドレー	300	3,490.00	1,047,000	

ベース	100	3,035.00	303,500	
J M D C	300	4,175.00	1,252,500	
フォーカスシステムズ	200	1,109.00	221,800	
クレスコ	400	1,211.00	484,400	
フジ・メディア・ホールディングス	2,300	1,748.00	4,020,400	
オービック	4,400	5,199.00	22,875,600	
ジャストシステム	300	3,370.00	1,011,000	
T D C ソフト	400	1,283.00	513,200	
L I N E ヤフー	37,300	417.30	15,565,290	
トレンドマイクロ	1,200	8,124.00	9,748,800	
I D ホールディングス	200	1,597.00	319,400	
日本オラクル	400	15,390.00	6,156,000	
アルファシステムズ	100	3,325.00	332,500	
フューチャー	600	1,995.00	1,197,000	
C A C H o l d i n g s	100	1,765.00	176,500	
オービックビジネスコンサルタント	400	6,950.00	2,780,000	
アイティフォー	300	1,377.00	413,100	
東計電算	100	4,655.00	465,500	
大塚商会	2,600	3,566.00	9,271,600	
サイボウズ	300	2,100.00	630,000	
電通総研	200	5,160.00	1,032,000	
A C C E S S	200	1,282.00	256,400	
デジタルガレージ	400	3,030.00	1,212,000	
E M システムズ	400	546.00	218,400	
ウェザーニューズ	100	6,060.00	606,000	
C I J	600	429.00	257,400	
日本エンタープライズ	200	111.00	22,200	
WOWOW	200	1,002.00	200,400	
スカラ	200	465.00	93,000	
インテリジェント ウェイブ	100	952.00	95,200	
A N Y C O L O R	300	2,182.00	654,600	
I M A G I C A G R O U P	200	493.00	98,600	
ネットワンシステムズ	1,000	4,305.00	4,305,000	
システムソフト	900	59.00	53,100	
アルゴグラフィックス	200	4,815.00	963,000	
マーベラス	400	550.00	220,000	
エイベックス	400	1,514.00	605,600	
B I P R O G Y	800	4,466.00	3,572,800	
都築電気	100	2,475.00	247,500	
T B S ホールディングス	1,200	3,741.00	4,489,200	
日本テレビホールディングス	2,100	2,351.00	4,937,100	
朝日放送グループホールディングス	200	618.00	123,600	

テレビ朝日ホールディングス	600	1,973.00	1,183,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	1,800	849.00	1,528,200	
テレビ東京ホールディングス	100	3,305.00	330,500	
ビジョン	300	1,015.00	304,500	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	300	4,790.00	1,437,000	
日本通信	1,900	139.00	264,100	
日本電信電話	696,200	151.20	105,265,440	代用有価証券 250,000株
ＫＤＤＩ	17,200	4,835.00	83,162,000	
ソフトバンク	374,500	191.30	71,641,850	
光通信	300	31,630.00	9,489,000	
エムティーアイ	200	1,162.00	232,400	
ＧＭＯインターネットグループ	800	2,657.00	2,125,600	
ファイバーゲート	100	1,002.00	100,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	1,200	3,285.00	3,942,000	
学研ホールディングス	400	1,004.00	401,600	
ゼンリン	400	833.00	333,200	
昭文社ホールディングス	100	399.00	39,900	
インプレスホールディングス	100	141.00	14,100	
アイネット	100	1,649.00	164,900	
松竹	100	10,920.00	1,092,000	
東宝	1,500	6,000.00	9,000,000	
東映	400	5,040.00	2,016,000	
ＮＴＴデータグループ	6,100	2,689.50	16,405,950	
ピー・シー・エー	200	1,963.00	392,600	
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,897.00	189,700	
ＤＴＳ	400	3,990.00	1,596,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,200	6,159.00	7,390,800	
シーイーシー	300	1,938.00	581,400	
カブコン	4,600	3,102.00	14,269,200	
アイ・エス・ビー	100	1,364.00	136,400	
ＳＣＳＫ	1,900	3,048.00	5,791,200	
ＮＳＷ	100	3,090.00	309,000	
アイネス	200	1,708.00	341,600	
ＴＫＣ	400	3,840.00	1,536,000	
富士ソフト	600	9,250.00	5,550,000	
ＮＳＤ	900	3,389.00	3,050,100	
コナミグループ	900	14,180.00	12,762,000	
福井コンピュータホールディングス	200	2,718.00	543,600	
ＪＢＣＣホールディングス	200	4,630.00	926,000	
ミロク情報サービス	200	1,865.00	373,000	
ソフトバンクグループ	11,500	9,222.00	106,053,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	400	2,560.00	1,024,000	

高千穂交易	100	3,910.00	391,000	
伊藤忠食品	100	6,930.00	693,000	
エレマテック	200	2,396.00	479,200	
あらた	400	3,475.00	1,390,000	
東京エレクトロン デバイス	200	3,210.00	642,000	
円谷フィールズホールディングス	400	1,991.00	796,400	
双日	2,700	3,243.00	8,756,100	
アルフレッサ ホールディングス	2,300	2,204.00	5,069,200	
横浜冷凍	600	901.00	540,600	
ラサ商事	100	1,436.00	143,600	
アルコニックス	300	1,467.00	440,100	
神戸物産	1,900	3,663.00	6,959,700	
あい ホールディングス	400	2,343.00	937,200	
ダイワボウホールディングス	1,100	3,068.00	3,374,800	
マクニカホールディングス	1,900	1,816.50	3,451,350	
ラクト・ジャパン	100	2,850.00	285,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	300	1,169.00	350,700	
八洲電機	200	1,664.00	332,800	
メディアスホールディングス	100	847.00	84,700	
レスター	200	2,669.00	533,800	
大光	100	626.00	62,600	
T O K A I ホールディングス	1,300	924.00	1,201,200	
三洋貿易	200	1,517.00	303,400	
ビューティガレージ	100	1,475.00	147,500	
ウイン・パートナーズ	200	1,267.00	253,400	
シップヘルスケアホールディングス	1,000	2,342.50	2,342,500	
明治電機工業	100	1,416.00	141,600	
コメダホールディングス	600	2,885.00	1,731,000	
アセンテック	100	610.00	61,000	
フルサト・マルカホールディングス	200	2,264.00	452,800	
ヤマエグループホールディングス	300	2,145.00	643,500	
小野建	300	1,536.00	460,800	
佐島電機	200	1,940.00	388,000	
伯東	100	4,585.00	458,500	
コンドーテック	200	1,382.00	276,400	
中山福	100	362.00	36,200	
ナガイレーベン	300	2,281.00	684,300	
三菱食品	200	4,780.00	956,000	
松田産業	200	3,165.00	633,000	
第一興商	1,000	1,888.00	1,888,000	
メディバルホールディングス	2,700	2,494.00	6,733,800	
S P K	100	2,056.00	205,600	

萩原電気ホールディングス	100	3,475.00	347,500	
アズワン	800	2,843.50	2,274,800	
スズデン	100	1,799.00	179,900	
シモジマ	200	1,358.00	271,600	
ドウシシャ	200	2,068.00	413,600	
高速	100	2,539.00	253,900	
たけびし	100	2,072.00	207,200	
リックス	100	2,702.00	270,200	
丸文	200	1,095.00	219,000	
ハピネット	200	4,060.00	812,000	
橋本総業ホールディングス	100	1,207.00	120,700	
日本ライフライン	700	1,284.00	898,800	
タカショー	200	483.00	96,600	
I D O M	800	1,039.00	831,200	
進和	100	2,774.00	277,400	
ダイトロン	100	2,877.00	287,700	
シークス	300	1,167.00	350,100	
オーハシテクニカ	100	1,743.00	174,300	
白銅	100	2,478.00	247,800	
伊藤忠商事	16,600	7,786.00	129,247,600	
丸紅	20,500	2,500.00	51,250,000	
長瀬産業	1,100	3,312.00	3,643,200	
蝶理	100	3,965.00	396,500	
豊田通商	7,400	2,776.00	20,542,400	
三共生興	300	647.00	194,100	
兼松	1,000	2,620.00	2,620,000	
三井物産	37,000	3,292.00	121,804,000	
日本紙パルプ商事	1,200	682.00	818,400	
カメイ	300	2,045.00	613,500	
スターゼン	200	2,998.00	599,600	
山善	800	1,345.00	1,076,000	
椿本興業	100	1,937.00	193,700	
住友商事	14,800	3,374.00	49,935,200	
内田洋行	100	6,580.00	658,000	
三菱商事	47,400	2,768.00	131,203,200	
第一実業	200	2,656.00	531,200	
キャノンマーケティングジャパン	500	4,630.00	2,315,000	
西華産業	100	3,995.00	399,500	
佐藤商事	200	1,433.00	286,600	
東京産業	300	707.00	212,100	
ユアサ商事	200	4,795.00	959,000	
神鋼商事	100	6,440.00	644,000	

トルク	100	220.00	22,000	
阪和興業	400	5,170.00	2,068,000	
正栄食品工業	200	4,425.00	885,000	
カナデン	200	1,473.00	294,600	
R Y O D E N	200	2,396.00	479,200	
岩谷産業	2,500	2,020.00	5,050,000	
極東貿易	100	1,497.00	149,700	
アステナホールディングス	500	521.00	260,500	
三愛オブリ	600	1,943.00	1,165,800	
稲畑産業	700	3,445.00	2,411,500	
G S I クレオス	100	2,084.00	208,400	
明和産業	400	648.00	259,200	
ワキタ	400	1,583.00	633,200	
東邦ホールディングス	700	4,381.00	3,066,700	
サンゲツ	600	2,807.00	1,684,200	
ミツウロコグループホールディングス	300	1,737.00	521,100	
シナネンホールディングス	100	6,290.00	629,000	
伊藤忠エネクス	600	1,650.00	990,000	
サンリオ	2,000	4,825.00	9,650,000	
サンワテクノス	100	2,212.00	221,200	
新光商事	300	959.00	287,700	
トーヨー	100	2,735.00	273,500	
三信電気	100	2,014.00	201,400	
東陽テクニカ	200	1,563.00	312,600	
モスフードサービス	400	3,555.00	1,422,000	
加賀電子	500	2,724.00	1,362,000	
ソーダニッカ	200	1,187.00	237,400	
立花エレテック	100	2,607.00	260,700	
フォーバル	100	1,423.00	142,300	
P A L T A C	400	4,261.00	1,704,400	
三谷産業	500	323.00	161,500	
西本W i s m e t t a cホールディングス	100	1,339.00	133,900	
コア商事ホールディングス	200	612.00	122,400	
K P P グループホールディングス	500	678.00	339,000	
ヤマタネ	100	3,445.00	344,500	
泉州電業	200	5,460.00	1,092,000	
トラスコ中山	500	2,243.00	1,121,500	
オートバックスセブン	900	1,427.00	1,284,300	
モリト	200	1,445.00	289,000	
加藤産業	300	4,160.00	1,248,000	
イエローハット	400	2,522.00	1,008,800	
J K ホールディングス	200	1,033.00	206,600	

日伝	100	3,005.00	300,500	
北沢産業	100	358.00	35,800	
杉本商事	200	1,372.00	274,400	
因幡電機産業	700	3,881.00	2,716,700	
東テク	300	2,790.00	837,000	
ミスミグループ本社	3,700	2,509.00	9,283,300	
スズケン	800	4,889.00	3,911,200	
ジェコス	200	995.00	199,000	
サンエー	400	2,823.00	1,129,200	
カワチ薬品	200	2,503.00	500,600	
エービーシー・マート	1,100	2,981.00	3,279,100	
ハードオフコーポレーション	100	1,950.00	195,000	
アスクル	600	1,918.00	1,150,800	
ゲオホールディングス	300	1,567.00	470,100	
アダストリア	300	3,485.00	1,045,500	
ジーフット	100	280.00	28,000	
くら寿司	300	4,025.00	1,207,500	
キャンドウ	100	3,265.00	326,500	
パルグループホールディングス	600	2,945.00	1,767,000	
エディオン	1,100	1,779.00	1,956,900	
サーラコーポレーション	500	844.00	422,000	
ハローズ	100	4,215.00	421,500	
フジオフードグループ本社	300	1,374.00	412,200	
あみやき亭	200	1,650.00	330,000	
ひらまつ	300	172.00	51,600	
大黒天物産	100	10,520.00	1,052,000	
ハニーズホールディングス	200	1,648.00	329,600	
アルペン	200	2,015.00	403,000	
クオールホールディングス	300	1,362.00	408,600	
ジンズホールディングス	200	6,190.00	1,238,000	
ビックカメラ	1,500	1,668.50	2,502,750	
D C Mホールディングス	1,300	1,420.00	1,846,000	
ペッパーフードサービス	800	200.00	160,000	
M o n o t a R O	3,500	2,557.50	8,951,250	
J . フロント リテイリング	2,800	1,724.00	4,827,200	
ドトール・日レスホールディングス	400	2,248.00	899,200	
マツキヨココカラ＆カンパニー	4,300	2,087.00	8,974,100	
ブロンコビリー	100	3,815.00	381,500	
Z O Z O	1,800	4,889.00	8,800,200	
トレジャー・ファクトリー	200	1,356.00	271,200	
物語コーポレーション	400	3,490.00	1,396,000	
三越伊勢丹ホールディングス	3,700	2,307.50	8,537,750	

H a m e e	100	1,076.00	107,600	
ウエルシアホールディングス	1,300	1,900.00	2,470,000	
クリエイトSDホールディングス	400	2,989.00	1,195,600	
丸善CHIホールディングス	100	316.00	31,600	
シュッピン	200	1,064.00	212,800	
オイシックス・ラ・大地	400	1,258.00	503,200	
ネクステージ	600	1,555.00	933,000	
ジョイフル本田	700	1,991.00	1,393,700	
エターナルホスピタリティグループ	100	3,510.00	351,000	
ホットランド	200	2,362.00	472,400	
すかいらくホールディングス	3,400	2,370.00	8,058,000	
SFPホールディングス	100	1,999.00	199,900	
綿半ホールディングス	200	1,637.00	327,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	800	835.00	668,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	430.00	43,000	
B E E N O S	100	2,807.00	280,700	
あさひ	200	1,535.00	307,000	
日本調剤	200	1,341.00	268,200	
コスモス薬品	400	6,902.00	2,760,800	
トーエル	100	775.00	77,500	
セブン&アイ・ホールディングス	27,300	2,231.50	60,919,950	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,800	1,225.00	2,205,000	
ツルハホールディングス	500	8,564.00	4,282,000	
サンマルクホールディングス	200	2,299.00	459,800	
トリドールホールディングス	700	3,952.00	2,766,400	
T O K Y O B A S E	300	263.00	78,900	
J Mホールディングス	200	2,877.00	575,400	
アレンザホールディングス	200	1,087.00	217,400	
串カツ田中ホールディングス	100	1,560.00	156,000	
パロックジャパンリミテッド	300	787.00	236,100	
クスリのアオキホールディングス	800	3,217.00	2,573,600	
力の源ホールディングス	200	1,098.00	219,600	
F O O D & L I F E C O M P A N I E	1,300	2,990.00	3,887,000	
メディカルシステムネットワーク	200	411.00	82,200	
ジャパクラフトホールディングス	100	138.00	13,800	
はるやまホールディングス	100	516.00	51,600	
ノジマ	800	2,204.00	1,763,200	
カップ・クリエイト	400	1,585.00	634,000	
ライトオン	100	207.00	20,700	
良品計画	2,900	2,631.50	7,631,350	
パリミキホールディングス	100	339.00	33,900	

アドヴァングループ	200	974.00	194,800	
アルビス	100	2,658.00	265,800	
コナカ	100	225.00	22,500	
G - 7ホールディングス	300	1,499.00	449,700	
イオン北海道	600	887.00	532,200	
コジマ	500	1,038.00	519,000	
コーナン商事	300	3,610.00	1,083,000	
エコス	100	2,058.00	205,800	
ワタミ	300	1,076.00	322,800	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	5,000	3,797.00	18,985,000	
西松屋チェーン	500	2,203.00	1,101,500	
ゼンショーホールディングス	1,400	7,736.00	10,830,400	
幸楽苑	200	1,265.00	253,000	
サイゼリヤ	400	5,730.00	2,292,000	
V Tホールディングス	900	471.00	423,900	
魚力	100	2,400.00	240,000	
フジ・コーポレーション	100	1,937.00	193,700	
ユナイテッドアローズ	300	2,303.00	690,900	
ハイデイ日高	400	2,740.00	1,096,000	
コロワイド	1,400	1,693.50	2,370,900	
壱番屋	1,000	1,029.00	1,029,000	
スギホールディングス	1,300	2,544.50	3,307,850	
薬王堂ホールディングス	100	2,103.00	210,300	
スクロール	400	1,024.00	409,600	
ヨンドシーホールディングス	200	1,852.00	370,400	
木曽路	400	2,207.00	882,800	
S R Sホールディングス	400	1,137.00	454,800	
千趣会	500	315.00	157,500	
リテールパートナーズ	400	1,290.00	516,000	
上新電機	300	2,495.00	748,500	
日本瓦斯	1,200	2,074.00	2,488,800	
ロイヤルホールディングス	400	2,487.00	994,800	
いなげや	200	1,170.00	234,000	
チヨダ	200	1,397.00	279,400	
ライフコーポレーション	300	3,380.00	1,014,000	
リンガーハット	300	2,304.00	691,200	
M r M a x H D	300	671.00	201,300	
A O K Iホールディングス	500	1,210.00	605,000	
オークワ	400	898.00	359,200	
コメリ	300	3,245.00	973,500	
青山商事	500	1,371.00	685,500	
しまむら	600	7,787.00	4,672,200	

高島屋	3,500	1,270.00	4,445,000	
松屋	400	848.00	339,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,200	2,054.50	2,465,400	
近鉄百貨店	100	2,080.00	208,000	
丸井グループ	1,600	2,414.50	3,863,200	
アクシアル リテイリング	700	891.00	623,700	
イオン	9,100	3,803.00	34,607,300	
イズミ	400	3,238.00	1,295,200	
平和堂	400	2,195.00	878,000	
フジ	500	2,055.00	1,027,500	
ヤオコー	300	9,140.00	2,742,000	
ゼビオホールディングス	300	1,162.00	348,600	
ケーズホールディングス	1,600	1,412.00	2,259,200	
日産東京販売ホールディングス	100	433.00	43,300	
シルバーライフ	100	722.00	72,200	
Genky DrugStores	200	3,055.00	611,000	
ブックオフグループホールディングス	200	1,421.00	284,200	
ギフトホールディングス	100	3,470.00	347,000	
アインホールディングス	300	4,967.00	1,490,100	
Genki Global Dining	100	4,075.00	407,500	
ヤマダホールディングス	7,600	437.50	3,325,000	
アークランズ	700	1,677.00	1,173,900	
ニトリホールディングス	900	17,450.00	15,705,000	
グルメ杵屋	200	1,033.00	206,600	
愛眼	100	147.00	14,700	
ケーユーホールディングス	200	1,084.00	216,800	
吉野家ホールディングス	1,000	3,212.00	3,212,000	
松屋フーズホールディングス	100	6,350.00	635,000	
サガミホールディングス	400	1,840.00	736,000	
王将フードサービス	500	3,085.00	1,542,500	
ミニストップ	200	1,781.00	356,200	
アークス	400	2,524.00	1,009,600	
バローホールディングス	500	2,128.00	1,064,000	
ベルク	100	6,520.00	652,000	
大庄	200	1,038.00	207,600	
ファーストリテイリング	1,400	48,690.00	68,166,000	
サンドラッグ	800	3,761.00	3,008,800	
サックスパー ホールディングス	200	922.00	184,400	
ペルーナ	600	744.00	446,400	
いよぎんホールディングス	3,000	1,594.50	4,783,500	
しずおかフィナンシャルグループ	5,100	1,326.00	6,762,600	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	1,900	1,628.00	3,093,200	

楽天銀行	1,100	3,462.00	3,808,200	
京都フィナンシャルグループ	2,900	2,369.50	6,871,550	
じもとホールディングス	100	302.00	30,200	
めぶきフィナンシャルグループ	11,600	638.50	7,406,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	300	4,240.00	1,272,000	
九州フィナンシャルグループ	4,000	783.30	3,133,200	
ゆうちょ銀行	19,000	1,451.50	27,578,500	
富山第一銀行	700	1,173.00	821,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	12,200	842.90	10,283,380	
西日本フィナンシャルホールディングス	1,400	1,867.00	2,613,800	
三十三フィナンシャルグループ	200	1,791.00	358,200	
第四北越フィナンシャルグループ	700	2,560.00	1,792,000	
ひろぎんホールディングス	3,300	1,190.00	3,927,000	
おきなわフィナンシャルグループ	200	2,336.00	467,200	
十六フィナンシャルグループ	300	4,380.00	1,314,000	
北國フィナンシャルホールディングス	200	4,675.00	935,000	
プロクレアホールディングス	300	1,738.00	521,400	
あいちフィナンシャルグループ	400	2,390.00	956,000	
あおぞら銀行	1,600	2,666.50	4,266,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	150,700	1,767.00	266,286,900	
りそなホールディングス	28,400	1,150.00	32,660,000	
三井住友トラストグループ	8,200	3,563.00	29,216,600	
三井住友フィナンシャルグループ	47,900	3,563.00	170,667,700	
千葉銀行	7,100	1,260.00	8,946,000	
群馬銀行	4,100	977.00	4,005,700	
武蔵野銀行	400	2,902.00	1,160,800	
千葉興業銀行	600	1,220.00	732,000	
筑波銀行	1,100	241.00	265,100	
七十七銀行	700	4,397.00	3,077,900	
秋田銀行	200	2,191.00	438,200	
山形銀行	300	1,001.00	300,300	
岩手銀行	200	2,422.00	484,400	
東邦銀行	2,000	272.00	544,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,000	3,766.00	7,532,000	
スルガ銀行	1,500	1,069.00	1,603,500	
八十二銀行	5,400	917.40	4,953,960	
山梨中央銀行	300	1,776.00	532,800	
大垣共立銀行	400	1,906.00	762,400	
福井銀行	200	1,837.00	367,400	
清水銀行	100	1,489.00	148,900	
滋賀銀行	400	3,550.00	1,420,000	
南都銀行	300	3,180.00	954,000	

百五銀行	2,200	594.00	1,306,800	
紀陽銀行	800	1,862.00	1,489,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,300	1,729.50	2,248,350	
山陰合同銀行	1,400	1,282.00	1,794,800	
百十四銀行	200	2,651.00	530,200	
四国銀行	300	990.00	297,000	
阿波銀行	300	2,607.00	782,100	
大分銀行	100	3,300.00	330,000	
宮崎銀行	200	2,920.00	584,000	
佐賀銀行	100	2,190.00	219,000	
琉球銀行	500	1,051.00	525,500	
セブン銀行	8,200	324.00	2,656,800	
みずほフィナンシャルグループ	31,000	3,452.00	107,012,000	
山口フィナンシャルグループ	2,300	1,623.50	3,734,050	
名古屋銀行	100	6,520.00	652,000	
北洋銀行	3,200	420.00	1,344,000	
愛媛銀行	300	1,086.00	325,800	
京葉銀行	1,000	734.00	734,000	
栃木銀行	1,100	274.00	301,400	
北日本銀行	100	2,697.00	269,700	
東和銀行	400	603.00	241,200	
福島銀行	100	232.00	23,200	
トモニホールディングス	2,200	424.00	932,800	
フィデアホールディングス	200	1,482.00	296,400	
池田泉州ホールディングス	3,200	357.00	1,142,400	
F P G	800	2,864.00	2,291,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	400	1,129.00	451,600	
S B I ホールディングス	3,700	3,592.00	13,290,400	
ジャフコ グループ	700	2,050.00	1,435,000	
大和証券グループ本社	16,500	1,079.00	17,803,500	
野村ホールディングス	38,700	886.20	34,295,940	
岡三証券グループ	1,800	628.00	1,130,400	
丸三証券	800	979.00	783,200	
東洋証券	700	549.00	384,300	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2,700	480.00	1,296,000	
水戸証券	600	522.00	313,200	
いちよし証券	500	847.00	423,500	
松井証券	1,600	839.00	1,342,400	
マネックスグループ	2,200	800.00	1,760,000	
極東証券	300	1,335.00	400,500	
岩井コスモホールディングス	300	2,210.00	663,000	
アイザワ証券グループ	300	1,712.00	513,600	

スパークス・グループ	200	1,367.00	273,400	
かんぽ生命保険	2,700	2,672.50	7,215,750	
S O M P Oホールディングス	11,200	3,484.00	39,020,800	
アニコム ホールディングス	800	678.00	542,400	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	16,900	3,661.00	61,870,900	
第一生命ホールディングス	10,800	4,267.00	46,083,600	
東京海上ホールディングス	22,400	5,902.00	132,204,800	
T & Dホールディングス	6,200	2,608.50	16,172,700	
アドバンスクリエイト	200	773.00	154,600	
全国保証	600	5,509.00	3,305,400	
あんしん保証	100	171.00	17,100	
ジェイリース	200	1,350.00	270,000	
S B I アルヒ	200	825.00	165,000	
プレミアグループ	400	2,327.00	930,800	
ネットプロテクションズホールディングス	800	342.00	273,600	
クレディセゾン	1,500	3,581.00	5,371,500	
芙蓉総合リース	200	11,490.00	2,298,000	
みずほリース	1,700	1,060.00	1,802,000	
東京センチュリー	1,700	1,607.50	2,732,750	
日本証券金融	800	2,040.00	1,632,000	
アイフル	3,800	324.00	1,231,200	
リコーリース	200	5,190.00	1,038,000	
イオンフィナンシャルサービス	1,300	1,258.00	1,635,400	
アコム	5,400	368.70	1,990,980	
ジャックス	300	3,975.00	1,192,500	
オリエントコーポレーション	800	841.00	672,800	
オリックス	13,800	3,387.00	46,740,600	
三菱H C キャピタル	11,500	1,084.00	12,466,000	
日本取引所グループ	13,700	1,877.00	25,714,900	
イー・ギャランティ	400	1,522.00	608,800	
N E C キャピタルソリューション	100	3,815.00	381,500	
大東建託	800	17,300.00	13,840,000	
サムティホールディングス	500	3,295.00	1,647,500	
いちご	2,000	407.00	814,000	
日本駐車場開発	2,800	226.00	632,800	
スター・マイカ・ホールディングス	300	658.00	197,400	
S R E ホールディングス	100	3,645.00	364,500	
A D ワークスグループ	300	204.00	61,200	
ヒューリック	5,300	1,484.50	7,867,850	
野村不動産ホールディングス	1,400	3,853.00	5,394,200	
三重交通グループホールディングス	500	492.00	246,000	
ディア・ライフ	400	877.00	350,800	

地主	200	2,150.00	430,000	
プレサンスコーポレーション	300	1,943.00	582,900	
THE グローバル社	100	627.00	62,700	
J P M C	100	1,152.00	115,200	
フージャースホールディングス	400	1,043.00	417,200	
オープンハウスグループ	800	5,670.00	4,536,000	
東急不動産ホールディングス	6,900	985.50	6,799,950	
飯田グループホールディングス	2,200	2,193.00	4,824,600	
A n d D oホールディングス	200	1,068.00	213,600	
シーアールイー	100	1,211.00	121,100	
ケイアイスター不動産	100	3,860.00	386,000	
グッドコムアセット	200	833.00	166,600	
ジェイ・エス・ビー	100	2,734.00	273,400	
ロードスターキャピタル	100	2,409.00	240,900	
霞ヶ関キャピタル	100	14,300.00	1,430,000	
パーク 2 4	1,800	1,875.00	3,375,000	
パラカ	100	1,834.00	183,400	
宮越ホールディングス	100	1,859.00	185,900	
三井不動産	31,900	1,374.00	43,830,600	
三菱地所	13,300	2,279.50	30,317,350	
平和不動産	400	4,245.00	1,698,000	
東京建物	2,000	2,621.50	5,243,000	
京阪神ビルディング	400	1,579.00	631,600	
住友不動産	3,700	4,838.00	17,900,600	
テーオーシー	400	600.00	240,000	
レオパレス 2 1	2,000	564.00	1,128,000	
スターツコーポレーション	400	3,555.00	1,422,000	
フジ住宅	300	771.00	231,300	
空港施設	300	585.00	175,500	
明和地所	200	991.00	198,200	
ゴールドクレスト	200	3,020.00	604,000	
エスリード	100	4,435.00	443,500	
日神グループホールディングス	400	515.00	206,000	
日本エスコン	600	1,013.00	607,800	
M I R A R T Hホールディングス	1,400	500.00	700,000	
A V A N T I A	100	772.00	77,200	
イオンモール	1,400	2,053.00	2,874,200	
カチタス	600	2,058.00	1,234,800	
トーセイ	400	2,478.00	991,200	
サンフロンティア不動産	400	1,846.00	738,400	
F J ネクストホールディングス	200	1,116.00	223,200	
ランドビジネス	100	191.00	19,100	

グランディハウス	200	563.00	112,600	
日本空港ビルディング	800	5,623.00	4,498,400	
L I F U L L	600	152.00	91,200	
M I X I	500	2,794.00	1,397,000	
ジェイエイシーリクルートメント	900	729.00	656,100	
日本M & A センターホールディングス	3,500	687.30	2,405,550	
メンバーズ	100	1,011.00	101,100	
U T グループ	300	2,688.00	806,400	
アイティメディア	100	1,595.00	159,500	
ケアネット	500	653.00	326,500	
E ・ J ホールディングス	100	1,718.00	171,800	
オープンアップグループ	700	1,984.00	1,388,800	
コシダカホールディングス	700	1,194.00	835,800	
パソナグループ	300	2,007.00	602,100	
リンクアンドモチベーション	600	541.00	324,600	
エス・エム・エス	900	1,680.00	1,512,000	
パーソルホールディングス	22,500	257.90	5,802,750	
リニカル	100	366.00	36,600	
クックパッド	600	171.00	102,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	100	735.00	73,500	
学情	100	1,755.00	175,500	
スタジオアリス	100	2,054.00	205,400	
N J S	100	4,050.00	405,000	
総合警備保障	4,000	1,102.50	4,410,000	
カカクコム	1,700	2,475.50	4,208,350	
アイロムグループ	100	2,700.00	270,000	
セントケア・ホールディング	200	752.00	150,400	
ルネサンス	200	1,016.00	203,200	
ディップ	400	2,713.00	1,085,200	
デジタルホールディングス	100	1,166.00	116,600	
新日本科学	300	1,470.00	441,000	
エムスリー	4,700	1,416.50	6,657,550	
ツカダ・グローバルホールディング	100	417.00	41,700	
ウェルネット	100	882.00	88,200	
ワールドホールディングス	100	1,958.00	195,800	
ディー・エヌ・エー	1,000	2,058.00	2,058,000	
博報堂D Y ホールディングス	2,700	1,216.50	3,284,550	
ぐるなび	500	309.00	154,500	
タカミヤ	300	442.00	132,600	
ファンコミュニケーションズ	300	414.00	124,200	
ライク	100	1,396.00	139,600	
エスプール	800	357.00	285,600	

W D Bホールディングス	100	1,749.00	174,900	
ティア	100	427.00	42,700	
アドウェイズ	300	336.00	100,800	
バリューコマース	200	1,114.00	222,800	
インフォマート	2,300	303.00	696,900	
J Pホールディングス	600	692.00	415,200	
エコナックホールディングス	100	114.00	11,400	
C Lホールディングス	100	936.00	93,600	
プレステージ・インターナショナル	1,100	685.00	753,500	
プロトコーポレーション	300	1,425.00	427,500	
アミューズ	100	1,336.00	133,600	
ドリームインキュベータ	100	2,998.00	299,800	
クイック	200	2,031.00	406,200	
T A C	100	241.00	24,100	
電通グループ	2,600	4,814.00	12,516,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	880.00	88,000	
ぴあ	100	3,140.00	314,000	
イオンファンタジー	100	2,821.00	282,100	
シーティーエス	300	916.00	274,800	
H . U . グループホールディングス	700	2,624.00	1,836,800	
アルプス技研	200	2,810.00	562,000	
サニックス	300	280.00	84,000	
日本空調サービス	300	1,045.00	313,500	
オリエンタルランド	14,300	3,868.00	55,312,400	
ダスキン	500	3,798.00	1,899,000	
明光ネットワークジャパン	300	692.00	207,600	
ファルコホールディングス	100	2,366.00	236,600	
ラウンドワン	2,300	1,002.00	2,304,600	
リゾートトラスト	900	2,795.00	2,515,500	
ビー・エム・エル	300	2,797.00	839,100	
リソー教育	1,500	282.00	423,000	
早稲田アカデミー	100	1,791.00	179,100	
ユー・エス・エス	5,000	1,313.00	6,565,000	
東京個別指導学院	300	399.00	119,700	
サイバーエージェント	5,300	1,064.50	5,641,850	
楽天グループ	16,800	929.00	15,607,200	
クリーク・アンド・リバー社	100	1,623.00	162,300	
S B I グローバルアセットマネジメント	500	635.00	317,500	
テー・オー・ダブリュー	500	323.00	161,500	
山田コンサルティンググループ	100	2,167.00	216,700	
セントラルスポーツ	100	2,449.00	244,900	
フルキャストホールディングス	200	1,547.00	309,400	

エン・ジャパン	400	2,405.00	962,000	
テクノプロ・ホールディングス	1,400	2,922.50	4,091,500	
アトラグループ	100	132.00	13,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	100	873.00	87,300	
K e e P e r 技研	200	3,770.00	754,000	
G u n o s y	200	705.00	141,000	
デザインワン・ジャパン	100	111.00	11,100	
イー・ガーディアン	100	1,771.00	177,100	
リブセンス	100	164.00	16,400	
ジャパンマテリアル	700	1,806.00	1,264,200	
ベクトル	300	966.00	289,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	200	1,247.00	249,400	
キャリアリンク	100	2,555.00	255,500	
I B J	200	668.00	133,600	
アサンテ	100	1,688.00	168,800	
バリューHR	200	1,745.00	349,000	
M & A キャピタルパートナーズ	200	2,581.00	516,200	
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	1,002.00	100,200	
シグマクシス・ホールディングス	400	1,901.00	760,400	
ウィルグループ	200	1,001.00	200,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	143.00	14,300	
メドピア	200	556.00	111,200	
リクルートホールディングス	18,700	9,549.00	178,566,300	
エラン	300	796.00	238,800	
日本郵政	26,900	1,505.00	40,484,500	
ベルシステム24ホールディングス	300	1,309.00	392,700	
鎌倉新書	200	535.00	107,000	
エアトリ	200	1,037.00	207,400	
アトラエ	200	798.00	159,600	
ストライク	100	3,800.00	380,000	
ソラスト	700	480.00	336,000	
セラク	100	1,362.00	136,200	
インソース	500	1,046.00	523,000	
ベイカレント	1,800	5,042.00	9,075,600	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	100	872.00	87,200	
アイモバイル	300	516.00	154,800	
M S - J a p a n	100	1,064.00	106,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	900	2,846.00	2,561,400	
ミダックホールディングス	100	1,829.00	182,900	
キュービーネットホールディングス	100	1,043.00	104,300	
オープングループ	400	200.00	80,000	
マネジメントソリューションズ	100	1,849.00	184,900	

プロレド・パートナーズ	100	465.00	46,500	
フロンティア・マネジメント	100	1,181.00	118,100	
アンビスホールディングス	500	1,914.00	957,000	
カーブスホールディングス	600	789.00	473,400	
フォーラムエンジニアリング	300	889.00	266,700	
F a s t F i t n e s s J a p a n	100	1,340.00	134,000	
M a c b e e P l a n e t	100	2,657.00	265,700	
ダイレクトマーケティングミックス	300	237.00	71,100	
L I T A L I C O	200	1,107.00	221,400	
リログループ	1,300	1,854.50	2,410,850	
東祥	200	685.00	137,000	
I D & Eホールディングス	100	4,340.00	434,000	
サンウェルズ	100	1,402.00	140,200	
T R Eホールディングス	500	1,783.00	891,500	
人・夢・技術グループ	100	1,666.00	166,600	
N I S S Oホールディングス	200	836.00	167,200	
大栄環境	500	3,035.00	1,517,500	
日本管財ホールディングス	300	2,620.00	786,000	
M & A総研ホールディングス	300	2,303.00	690,900	
エイチ・アイ・エス	800	1,813.00	1,450,400	
ラックランド	100	2,007.00	200,700	
共立メンテナンス	700	2,472.50	1,730,750	
イチネンホールディングス	200	1,943.00	388,600	
建設技術研究所	100	4,710.00	471,000	
スペース	200	1,141.00	228,200	
燦ホールディングス	200	1,152.00	230,400	
スバル興業	100	3,225.00	322,500	
タナベコンサルティンググループ	100	1,196.00	119,600	
ナガワ	100	6,780.00	678,000	
東京都競馬	200	4,220.00	844,000	
カナモト	400	2,790.00	1,116,000	
ニシオホールディングス	200	3,780.00	756,000	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	600	55.00	33,000	
トランス・コスモス	300	3,505.00	1,051,500	
乃村工藝社	1,000	778.00	778,000	
藤田観光	100	8,890.00	889,000	
K N T - C Tホールディングス	100	1,333.00	133,300	
トーカイ	200	2,224.00	444,800	
セコム	4,900	5,403.00	26,474,700	
セントラル警備保障	100	2,838.00	283,800	
丹青社	500	809.00	404,500	
メイテックグループホールディングス	900	2,975.00	2,677,500	

応用地質	200	2,569.00	513,800	
船井総研ホールディングス	500	2,449.00	1,224,500	
学究社	100	1,888.00	188,800	
イオンディライト	300	4,350.00	1,305,000	
ナック	300	577.00	173,100	
ダイセキ	600	3,835.00	2,301,000	
ステップ	100	2,036.00	203,600	
合 計	4,391,200		9,171,154,090	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年11月 8日から2025年 5月 7日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【インデックスポートフォリオ】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 2024年11月 7日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,097,646	32,631,165
親投資信託受益証券	9,284,544,609	8,965,433,790
未収入金	1,688,117	295,409
未収利息	217	432
流動資産合計	9,320,330,589	8,998,360,796
資産合計	9,320,330,589	8,998,360,796
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,766,249	-
未払解約金	4,081,362	373,971
未払受託者報酬	2,571,467	2,468,222
未払委託者報酬	22,629,435	21,720,848
その他未払費用	205,659	197,406
流動負債合計	33,254,172	24,760,447
負債合計	33,254,172	24,760,447
純資産の部		
元本等		
元本	7,532,498,175	7,327,790,502
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,754,578,242	1,645,809,847
（ 分配準備積立金 ）	4,849,742,892	4,715,801,792
元本等合計	9,287,076,417	8,973,600,349
純資産合計	9,287,076,417	8,973,600,349
負債純資産合計	9,320,330,589	8,998,360,796

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年11月 8日 至 2024年 5月 7日	当中間計算期間 自 2024年11月 8日 至 2025年 5月 7日
営業収益		
受取利息	3,124	42,486
有価証券売買等損益	1,567,115,190	37,193,755
営業収益合計	1,567,118,314	37,151,269
営業費用		
支払利息	250	-
受託者報酬	2,462,387	2,468,222
委託者報酬	21,669,580	21,720,848
その他費用	196,932	197,406
営業費用合計	24,329,149	24,386,476
営業利益又は営業損失（ ）	1,542,789,165	61,537,745
経常利益又は経常損失（ ）	1,542,789,165	61,537,745
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,542,789,165	61,537,745
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	38,165,415	464,427
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	252,565,098	1,754,578,242
剰余金増加額又は欠損金減少額	233,364	781,690
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	233,364	781,690
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,934,424	48,476,767
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,934,424	48,476,767
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,746,487,788	1,645,809,847

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	前計算期間末 2024年11月 7日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 7日現在
1. 期首元本額	8,154,583,290円	7,532,498,175円
期中追加設定元本額	6,597,043円	3,404,194円
期中一部解約元本額	628,682,158円	208,111,867円
2. 受益権の総数	7,532,498,175口	7,327,790,502口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2023年11月 8日 至 2024年 5月 7日	当中間計算期間 自 2024年11月 8日 至 2025年 5月 7日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2024年11月 7日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 7日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（１口当たり情報）

前計算期間末 2024年11月 7日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2329円 (12,329円)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2246円 (12,246円)

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

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月 7日現在	2025年 5月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	217,202	400,772
コール・ローン	87,440,216	32,265,238
株式	9,171,154,090	8,891,473,760
派生商品評価勘定	4,149,900	178,900
未収配当金	90,908,059	106,575,633
未収利息	556	427
前払金	-	2,973,100

	2024年11月 7日現在	2025年 5月 7日現在
流動資産合計	9,353,870,023	9,033,867,830
資産合計	9,353,870,023	9,033,867,830
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,904,750
前受金	3,493,200	-
未払解約金	1,688,117	295,409
流動負債合計	5,181,317	3,200,159
負債合計	5,181,317	3,200,159
純資産の部		
元本等		
元本	2,946,574,792	2,857,900,002
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,402,113,914	6,172,767,669
元本等合計	9,348,688,706	9,030,667,671
純資産合計	9,348,688,706	9,030,667,671
負債純資産合計	9,353,870,023	9,033,867,830

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2024年11月 7日現在	2025年 5月 7日現在
1. 期首	2023年11月 8日	2024年11月 8日
期首元本額	3,211,761,216円	2,946,574,792円
期首からの追加設定元本額	3,257,207円	1,504,960円
期首からの一部解約元本額	268,443,631円	90,179,750円
元本の内訳		
インデックスポートフォリオ	2,926,109,237円	2,837,162,592円
バランスポートフォリオ	20,465,555円	20,737,410円
計	2,946,574,792円	2,857,900,002円
2. 受益権の総数	2,946,574,792口	2,857,900,002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	125,872,000円	141,545,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月 7日現在	2025年 5月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	2024年11月 7日現在	2025年 5月 7日現在
	売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2024年11月 7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	160,066,800	-	164,220,000	4,153,200
合計		160,066,800	-	164,220,000	4,153,200

（2025年 5月 7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	137,323,100	-	134,600,000	2,723,100
合計		137,323,100	-	134,600,000	2,723,100

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

2024年11月 7日現在		2025年 5月 7日現在	
1口当たり純資産額	3.173円	1口当たり純資産額	3.160円
(1千口当たり純資産額)	(3,173円)	(1千口当たり純資産額)	(3,160円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2025年 5月30日現在です。

【インデックスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	9,320,955,902円
負債総額	10,222,149円
純資産総額（ - ）	9,310,733,753円
発行済口数	7,316,576,725口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2726円

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,386,573,485円
負債総額	13,981,837円
純資産総額（ - ）	9,372,591,648円
発行済口数	2,853,273,503口
1口当たり純資産額（ / ）	3.285円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2025年5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（2025年5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（2025年5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、2025年5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	761	304,468
株式投資信託	717	267,366
単位型	257	6,326
追加型	460	261,040
公社債投資信託	44	37,101
単位型	31	852
追加型	13	36,248

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。

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66期事業年度（2024年4月1日から2025年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：百万円)				
		第65期 (2024年3月31日)		第66期 (2025年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,198		26,334
金銭の信託		3,899		17,070
有価証券		1		-
前払費用		814		822
未収入金		179		358
未収委託者報酬		21,592		22,244
未収収益	3	647	3	900
立替金		1,089		1,214
その他	2	2,011	2	3,024
流動資産合計		61,434		71,969
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	233	1	187
器具備品	1	134	1	108
有形固定資産合計		368		295
無形固定資産				
ソフトウェア		438		478
無形固定資産合計		438		478
投資その他の資産				
投資有価証券		28,465		18,012
関係会社株式		37,647		45,007
長期差入保証金		285		725
繰延税金資産		-		496
その他投資		-		765
投資その他の資産合計		66,398		65,006
固定資産合計		67,205		65,781
資産合計		128,640		137,750

(単位：百万円)				
		第65期 (2024年3月31日)		第66期 (2025年3月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		451		1,631
未払金		9,211		9,544
未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		8,330		8,462

その他未払金		803		1,002
未払費用	3	4,082	3	4,202
未払法人税等		1,644		3,378
未払消費税等	4	620	4	693
関係会社短期借入金		-		6,690
賞与引当金		2,619		2,881
役員賞与引当金		232		225
その他		683		44
流動負債合計		19,547		29,291
固定負債				
退職給付引当金		1,448		1,455
賞与引当金		565		529
役員賞与引当金		56		121
繰延税金負債		295		-
その他		251		231
固定負債合計		2,617		2,337
負債合計		22,165		31,629
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		82,591		83,753
利益剰余金合計		82,591		83,753
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		103,107		104,269
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		4,523		2,466
繰延ヘッジ損益		1,155		615
評価・換算差額等合計		3,367		1,851
純資産合計		106,475		106,120
負債純資産合計		128,640		137,750

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

		第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		第66期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		75,874		83,264
その他営業収益	1	3,714	1	4,604
営業収益合計		79,588		87,869
営業費用				
支払手数料		32,917		37,898
広告宣伝費		711		645
公告費		3		5
調査費		17,736		18,976
調査費		1,266		1,433
委託調査費		16,445		17,516

図書費	23	26
委託計算費	610	617
営業雑経費	881	867
通信費	135	136
印刷費	308	278
協会費	48	50
諸会費	11	18
その他	375	382
営業費用計	52,860	59,011
一般管理費		
給料	10,550	11,085
役員報酬	459	592
役員賞与引当金繰入額	273	289
給料・手当	6,791	7,151
賞与	277	216
賞与引当金繰入額	2,747	2,835
交際費	71	49
寄付金	22	22
旅費交通費	260	273
租税公課	389	646
不動産賃借料	906	836
退職給付費用	388	403
退職金	36	38
固定資産減価償却費	199	193
福利費	1,208	1,187
諸経費	4,661	4,821
一般管理費計	18,694	19,559
営業利益	8,033	9,298

(単位：百万円)

	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		第66期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		4		10
受取配当金	2	4,946	2	4,356
デリバティブ収益		-		193
有価証券評価益	3	1,113	3	3,063
金銭の信託運用益		399		170
時効成立分配金・償還金		2		2
為替差益		-		162
その他		50		81
営業外収益合計		6,517		8,039
営業外費用				
支払利息		569	2	907
デリバティブ費用		3,494		-
時効成立後支払分配金・償還金		1		2
為替差損		165		-
その他		0		9
営業外費用合計		4,231		919
経常利益		10,319		16,418
特別利益				
投資有価証券売却益		815		210

特別利益合計	815	210
特別損失		
投資有価証券売却損	174	81
固定資産処分損	52	10
損害賠償損失	167	-
特別損失合計	394	91
税引前当期純利益	10,740	16,537
法人税、住民税及び事業税	2,415	4,349
法人税等調整額	51	157
法人税等合計	2,364	4,192
当期純利益	8,376	12,345

（３）【株主資本等変動計算書】

第65期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

(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	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823
当期変動額							
剰余金の配当				5,092	5,092		5,092
当期純利益				8,376	8,376		8,376
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	-	-	-	3,284	3,284	-	3,284
当期末残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	2,067	103,107

	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
当期変動額				
剰余金の配当				5,092
当期純利益				8,376
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,467	666	1,800	1,800
当期変動額合計	2,467	666	1,800	5,084
当期末残高	4,523	1,155	3,367	106,475

第66期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：百万円）

(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	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	2,067	103,107

	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	4,523	1,155	3,367	106,475
当期変動額				
剰余金の配当				11,183
当期純利益				12,345
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,056	539	1,516	1,516
当期変動額合計	2,056	539	1,516	354
当期末残高	2,466	615	1,851	106,120

4 収益の計上基準 5 ヘッジ会計の方法 6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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。 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。 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。 当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 (1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。 (2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。 (3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。 (1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。 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。
---	--

（未適用の会計基準等）

- ・ 「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日）
- ・ 「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日）等

（1）概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリースについて資産・負債を計上する等の取扱いを定めるもの。

（2）適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

（重要な会計上の見積り）

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
該当事項はありません。

（貸借対照表関係）

第65期 (2024年3月31日)	第66期 (2025年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,482百万円 器具備品 920百万円 2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益 248百万円 (流動負債) 未払費用 1,873百万円 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。 5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円（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。	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,484百万円 器具備品 872百万円 2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益 282百万円 (流動負債) 未払費用 1,921百万円 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。 5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大469百万円（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65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第66期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
1 営業収益合計には、成功報酬212百万円が含まれております。 2 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 4,889百万円 3 有価証券評価益 保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額1,113百万円を営業外収益に計上しております。	1 営業収益合計には、成功報酬354百万円が含まれております。 2 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 4,048百万円 支払利息 286百万円 3 有価証券評価益 保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額3,063百万円を営業外収益に計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）

第65期（自 2023年4月1日 至 2024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(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)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000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
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
2024年5月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	11,183	57.60	2024年3月31日	2024年6月25日

第66期（自 2024年4月1日 至 2025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(2)	普通株式	121,000	-	121,000	-	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	346,000	-	154,000	192,000	-
合計		467,000	-	275,000	192,000	-

(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 2017年度ストックオプション(1)192,000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
2024年5月29日 取締役会	普通株式	11,183	57.60	2024年3月31日	2024年6月25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
2025年5月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	7,486	38.56	2025年3月31日	2025年6月27日

(リース取引関係)

第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		第66期 (自 2024年4月1日 至 2025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	891百万円	1年内	916百万円
1年超	2,613百万円	1年超	6,829百万円
合計	3,505百万円	合計	7,745百万円

(金融商品関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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金銭の信託及び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、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	3,899	-	3,899
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	7,785	18,141	-	25,927
資産計	7,785	22,041	-	29,827
デリバティブ取引(*1)				
株式関連(*2)	309	-	-	309
通貨関連(*3)	-	367	-	367
デリバティブ取引計	309	367	-	677

(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 309百万円は、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 367百万円は、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、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、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。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

株価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	2,540
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

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	31,198			

未収委託者報酬	21,592			
未収収益	647			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	169	2,483	-
合計	53,440	169	2,483	-

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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金銭の信託及び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。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

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、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、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			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券 その他有価証券 投資信託	2,418	14,651	-	17,070
資産計	4,097	11,342	-	15,440
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3)	6,516	25,994	-	32,510
デリバティブ取引計	159	-	-	159
	-	341	-	341
	159	341	-	501

- (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159百万円は、貸借対照表上流動資産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341百万円は、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。

(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、関係会社短期借入金、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

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、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。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

株価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	2,571
子会社株式	26,371
関連会社株式	18,635

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	26,334			
未収委託者報酬	22,244			
未収収益	900			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	803	1,176	110
合計	49,479	803	1,176	110

(有価証券関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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	19,011
関連会社株式	18,635

(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	24,313	17,701	6,611
	小計	24,313	17,701	6,611
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,613	1,769	156
	小計	1,613	1,769	156
合計		25,927	19,471	6,455

(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2,540百万円）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	8,145	1,057	167
合計	8,145	1,057	167

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係） 3 有価証券評価益」をご参照ください。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	26,371
関連会社株式	18,635

(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	12,903	9,123	3,780
	小計	12,903	9,123	3,780
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	2,536	2,809	273
	小計	2,536	2,809	273
合計		15,440	11,933	3,506

(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2,571百万円）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	5,849	764	45
合計	5,849	764	45

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係） 3 有価証券評価益」をご参照ください。

（金銭の信託関係）

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた 評価差額
運用目的の金銭の信託	3,899	399

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた 評価差額
運用目的の金銭の信託	17,070	170

（デリバティブ取引関係）

第65期(2024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	15,077	-	309	309
合計	15,077	-	309	309

(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

該当事項はありません。

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 米ドル 豪ドル 香港ドル 人民元 ユーロ	投資有価証券	6,465 84 542 2,979 2,172	- - - - -	268 2 17 17 60
	合計		12,243	-	367

(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66期(2025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	17,846	-	159	159
合計		17,846	-	159	159

(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 買建 シンガポールドル	6,696	-	39	39
合計		6,696	-	39	39

(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

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		6,651	-	326
	豪ドル		180	-	1
	ユーロ		2,796	-	2
	香港ドル		1,067	-	38
	人民元		1,473	-	18
	合計		12,167	-	381

(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65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		第66期 (自 2024年4月1日 至 2025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	5,342	(1) 関連会社に対する投資の金額	5,341
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,691	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	18,436
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,474	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,427

(退職給付関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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	1,366
勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	110
退職給付債務の期末残高	1,407

(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	1,407
未積立退職給付債務	1,407
未認識数理計算上の差異	40
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の費用処理額	7
確定給付制度に係る退職給付費用	134

(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	0.7%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、253百万円でありました。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	1,407
勤務費用	138
利息費用	9
数理計算上の差異の発生額	34
退職給付の支払額	133
退職給付債務の期末残高	1,387

(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	1,387
未積立退職給付債務	1,387
未認識数理計算上の差異	67
貸借対照表に計上された負債の額	1,455

退職給付引当金	1,455
貸借対照表に計上された負債の額	1,455

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	138
利息費用	9
数理計算上の差異の費用処理額	7
確定給付制度に係る退職給付費用	140

(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	1.5%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、262百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(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

	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	217,000	752,000
付与	0	0
失効	96,000	406,000
権利確定	0	0
権利未確定残	121,000	346,000
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(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年 4月27日	2018年 4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円)（注）1	0	0

（注） 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 104百万円

第66期(自 2024年 4月 1日 至 2025年 3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(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(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	121,000	346,000
付与	0	0
失効	121,000	154,000
権利確定	0	0
権利未確定残	0	192,000
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(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 58百万円

(税効果会計関係)

第65期 (2024年3月31日)	第66期 (2025年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円) <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td>975</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>8</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価損</td><td>52</td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td>443</td></tr> <tr><td>固定資産減価償却費</td><td>80</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ損益</td><td>510</td></tr> <tr><td>その他</td><td>679</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>2,750</td></tr> <tr><td>評価性引当金</td><td>52</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td>2,697</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td>2,044</td></tr> <tr><td>その他</td><td>948</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td>2,992</td></tr> <tr><td>繰延税金負債の純額</td><td>295</td></tr> </table>	繰延税金資産		賞与引当金	975	投資有価証券評価損	8	関係会社株式評価損	52	退職給付引当金	443	固定資産減価償却費	80	繰延ヘッジ損益	510	その他	679	繰延税金資産小計	2,750	評価性引当金	52	繰延税金資産合計	2,697	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	2,044	その他	948	繰延税金負債合計	2,992	繰延税金負債の純額	295	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円) <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td>1,047</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>8</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価損</td><td>54</td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td>457</td></tr> <tr><td>固定資産減価償却費</td><td>69</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ損益</td><td>283</td></tr> <tr><td>その他</td><td>828</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>2,748</td></tr> <tr><td>評価性引当金</td><td>54</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td>2,694</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td>1,221</td></tr> <tr><td>その他</td><td>976</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td>2,198</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>496</td></tr> </table>	繰延税金資産		賞与引当金	1,047	投資有価証券評価損	8	関係会社株式評価損	54	退職給付引当金	457	固定資産減価償却費	69	繰延ヘッジ損益	283	その他	828	繰延税金資産小計	2,748	評価性引当金	54	繰延税金資産合計	2,694	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	1,221	その他	976	繰延税金負債合計	2,198	繰延税金資産の純額	496
繰延税金資産																																																																	
賞与引当金	975																																																																
投資有価証券評価損	8																																																																
関係会社株式評価損	52																																																																
退職給付引当金	443																																																																
固定資産減価償却費	80																																																																
繰延ヘッジ損益	510																																																																
その他	679																																																																
繰延税金資産小計	2,750																																																																
評価性引当金	52																																																																
繰延税金資産合計	2,697																																																																
繰延税金負債																																																																	
その他有価証券評価差額金	2,044																																																																
その他	948																																																																
繰延税金負債合計	2,992																																																																
繰延税金負債の純額	295																																																																
繰延税金資産																																																																	
賞与引当金	1,047																																																																
投資有価証券評価損	8																																																																
関係会社株式評価損	54																																																																
退職給付引当金	457																																																																
固定資産減価償却費	69																																																																
繰延ヘッジ損益	283																																																																
その他	828																																																																
繰延税金資産小計	2,748																																																																
評価性引当金	54																																																																
繰延税金資産合計	2,694																																																																
繰延税金負債																																																																	
その他有価証券評価差額金	1,221																																																																
その他	976																																																																
繰延税金負債合計	2,198																																																																
繰延税金資産の純額	496																																																																
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 <table> <tr><td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr><td>（調整）</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>1.2%</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>10.9%</td></tr> <tr><td>その他</td><td>1.1%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>22.0%</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	（調整）		交際費等永久に損金に算入されない項目	1.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	10.9%	その他	1.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.0%	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 <table> <tr><td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr><td>（調整）</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.6%</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>6.3%</td></tr> <tr><td>その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>25.3%</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	（調整）		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.3%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.3%																																								
法定実効税率	30.6%																																																																
（調整）																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.2%																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	10.9%																																																																
その他	1.1%																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.0%																																																																
法定実効税率	30.6%																																																																
（調整）																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.3%																																																																
その他	0.4%																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.3%																																																																
	3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 「所得税法等の一部を改正する法律（令和7年法律第13号）」が2025年3月31日に成立したことに伴い、2026年4月1日以後に開始する事業年度から「防衛特別法人税」の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.6%から、2026年4月1日以後開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については31.5%になります。この税率変更により、当事業年度の繰延税金資産（繰延税金負債を控除した金額）が26百万円減少し、法人税等調整額は2百万円減少し、その他有価証券評価差額金が32百万円減少し、繰延ヘッジ損失は8百万円減少しております。																																																																

（関連当事者情報）

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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	-	資金の返済 (シンガポール ドル貸建) (注1)	3,318 (SGD 33,000千)	関係会社 短期 貸付金	-
							貸付金利息 (シンガポール ドル貸建) (注1)	22 (SGD 223千)	未収収益	-
							関係会社株式 の取得 (注2)	13,412	-	-
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	2,950 (USD 20,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	3,378	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	増資の引受 (注4)	1,828	-	-

(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年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しておりました。
- Nikko Asset Management International Limitedが保有する関連会社AHAM Asset Management 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。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- Nikko AM Global Holdings Limitedの行った1,828,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロンドン)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2023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	41,322百万円
負債合計	8,314百万円
純資産合計	33,008百万円
営業収益	18,682百万円
税引前当期純利益	6,005百万円
当期純利益	4,538百万円

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	-	資金の借入 (シンガポール ドル貨建) (注1)	6,690 (SGD 60,000千)	関係会社 短期 借入金	6,690 (SGD 60,000千)
							借入金利息 (シンガポール ドル貨建) (注1)	286 (SGD 2,532千)	未払費用	286 (SGD 2,532千)
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,641 (USD 18,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	10,738	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	7,360	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠70万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. 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。
3. Nikko AM Global Holdings Limitedの行った7,360,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラストグループ株式会社（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2024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 46,582百万円

負債合計 7,834百万円

純資産合計 38,748百万円

営業収益 18,712百万円

税引前当期純利益 6,127百万円

当期純利益 4,588百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

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

関連情報

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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66期(自 2024年4月1日 至 2025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65期 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	第66期 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
1 株当たり純資産額	548円41銭	546円58銭
1 株当たり当期純利益金額	43円14銭	63円58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65期 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	第66期 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
当期純利益（百万円）	8,376	12,345
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）	8,376	12,345
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	2017年度ストックオプション (1) 192,000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 (2024年 3 月31日)	第66期 (2025年 3 月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	106,475	106,120
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）	106,475	106,120
1 株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	194,152	194,152

(重要な後発事象)
該当事項はありません。

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。
以下の変更について、2024年9月26日の臨時株主総会で決議されており、2025年9月1日付で定款の変更を行ないます。

・商号の変更（アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社に変更）

（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 (2025年3月末現在)	事業の内容
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額：10,000百万円（2025年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

（２）販売会社

名 称	資本金の額 (2025年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	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。
松井証券株式会社	11,945百万円	

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

（２）販売会社

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

３【資本関係】

（１）受託会社

該当事項はありません。

（２）販売会社

該当事項はありません。

第３【その他】

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

（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

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

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

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

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

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

2025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2024年4月1日から2025年3月31日までの第66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2025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

2025年1月29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」に掲げられているインデックスポートフォリオの2023年11月8日から2024年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの2024年11月7日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年6月18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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスポートフォリオの2024年11月8日から2025年5月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスポートフォリオの2025年5月7日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年11月8日から2025年5月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。