

## 【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】	2021年8月6日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 佐谷戸 淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスポートフォリオ バランスポートフォリオ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	インデックスポートフォリオ 1兆円を上限とします。 バランスポートフォリオ 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】

ミリオン

インデックスポートフォリオ

バランスポートフォリオ

- ・以下、上記を総称して、また各々を称して「ミリオン」、「ファンド」または「ポートフォリオ」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ポートフォリオ毎に、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

勤務先の事務局を通じて販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

### （７）【申込期間】

2021年8月7日から2022年2月8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。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## ( 9 ) 【払込期日】

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

## ( 1 0 ) 【払込取扱場所】

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

## ( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

## ( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

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

###### ファンドの基本的性格

###### <インデックスポートフォリオ>

###### 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 不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ( ) 資産複合	特殊型

(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 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年5回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ( )	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米		
	その他	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、株式に投資を行いません。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「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。

## < バランスポートフォリオ >

### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

**1. ミリオンには2つのポートフォリオがあり、皆様のニーズにあったポートフォリオをお選びいただけます。****「インデックスポートフォリオ」**

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)\*の動きに連動する投資成果をめざします。

**「バランスポートフォリオ」**

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50%程度投資を行ないます。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。

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。

\*TOPIX(東証株価指数)は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄(算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。)の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

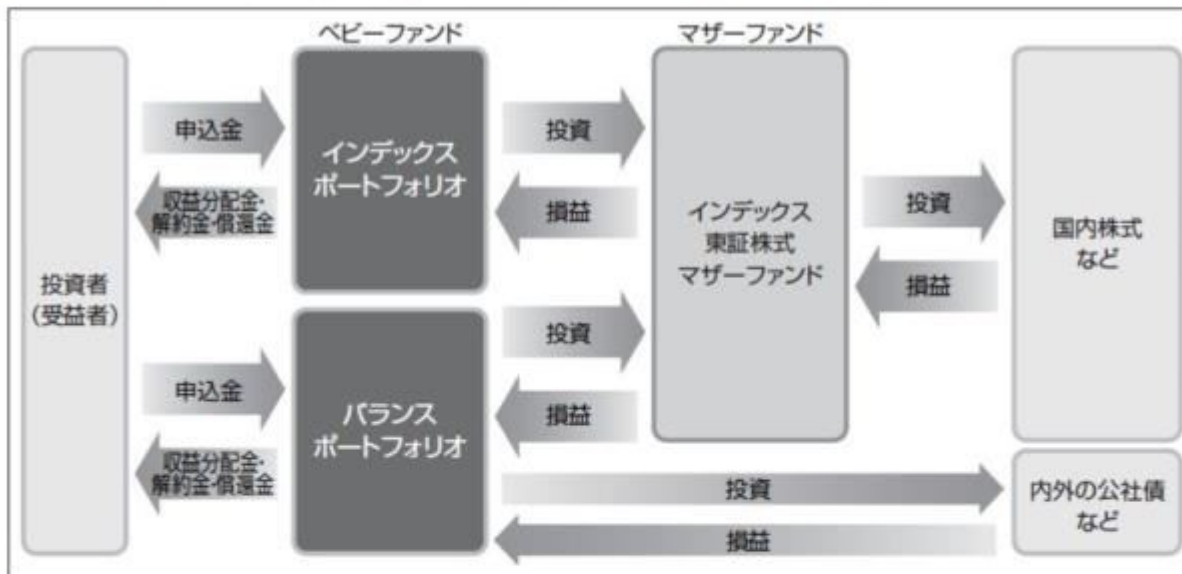
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

**2. お買付けは、原則として給与天引きです。****3. お買付けは、無手数料です。****4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。**

ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買い付けることによって、一定量(口数)ずつ買い付けた場合に比べて、平均買付コストを低く抑えることが期待できます。長期にわたり定期的に継続して積み立てることにより、ドル・コスト平均法が活かされます。

## 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いません。



### (主な投資制限)

#### 「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」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。

#### 「バランスポートフォリオ」

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

### (分配方針)

#### 「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

- ・毎決算時に、利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行いますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### 信託金限度額

- ・各ポートフォリオ毎に、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】

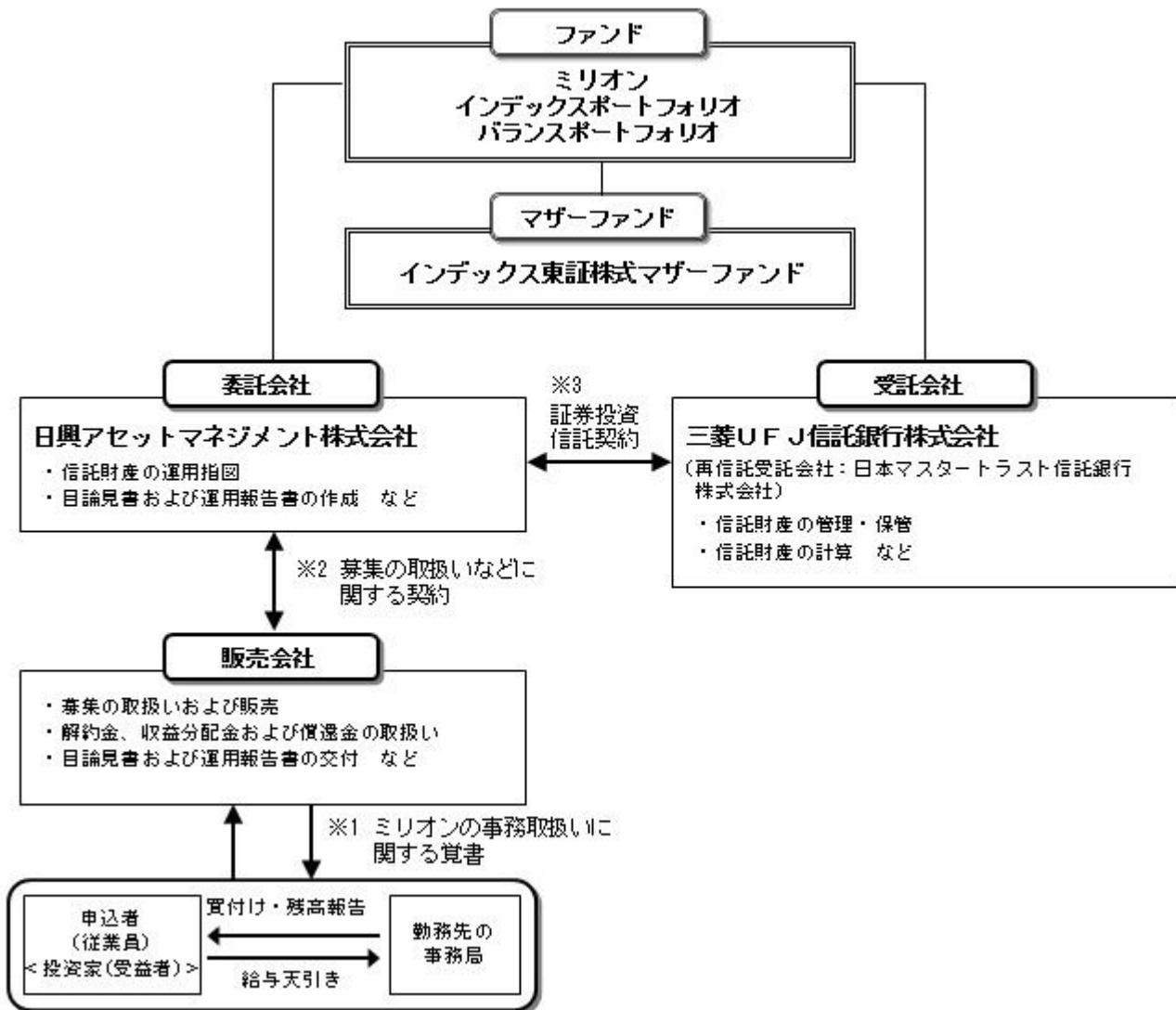
1987年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み





- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンのお申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 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です。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。
- 3 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です。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（2021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
- 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「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。
- ・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。

#### < バランスポートフォリオ >

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の75%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

#### < 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

#### < バランスポートフォリオ >

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第17条の2に定めるものに限ります。）

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

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

<インデックス東証株式マザーファンド>

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券

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

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

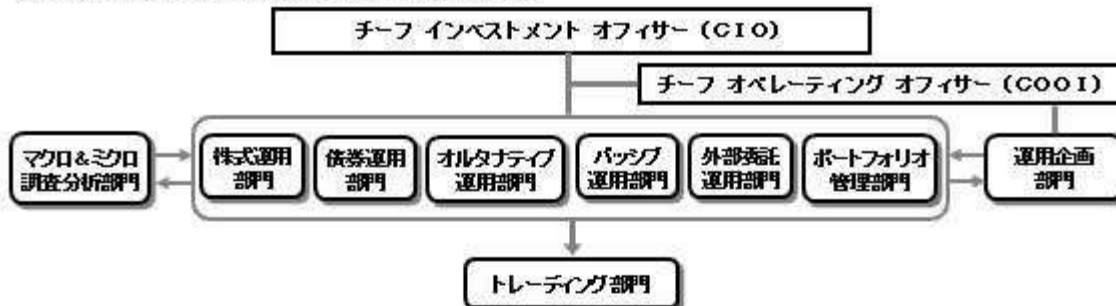
##### <インデックス東証株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資成果をTOPIX（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バラ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行ないます。 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないます。 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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には制限を設けません</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

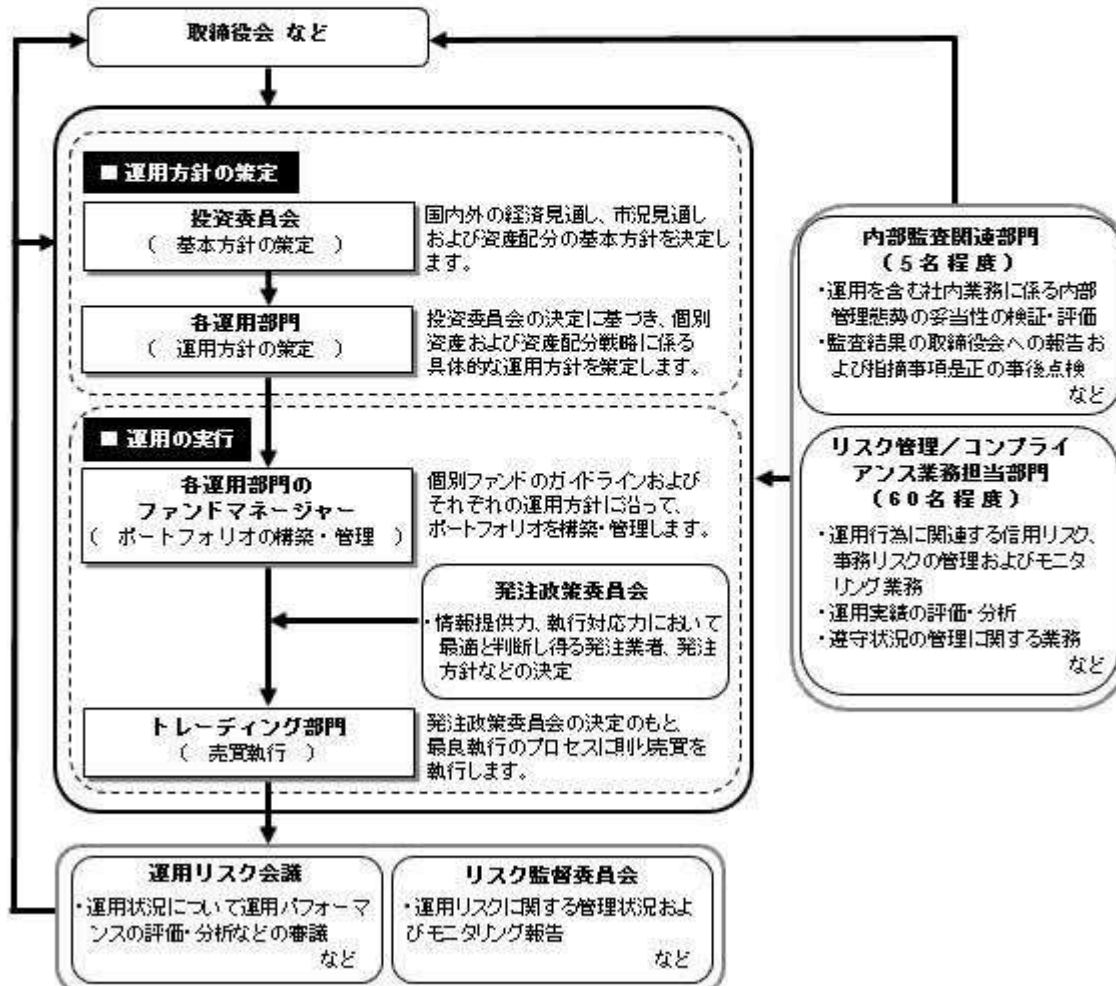
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1986年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

## (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



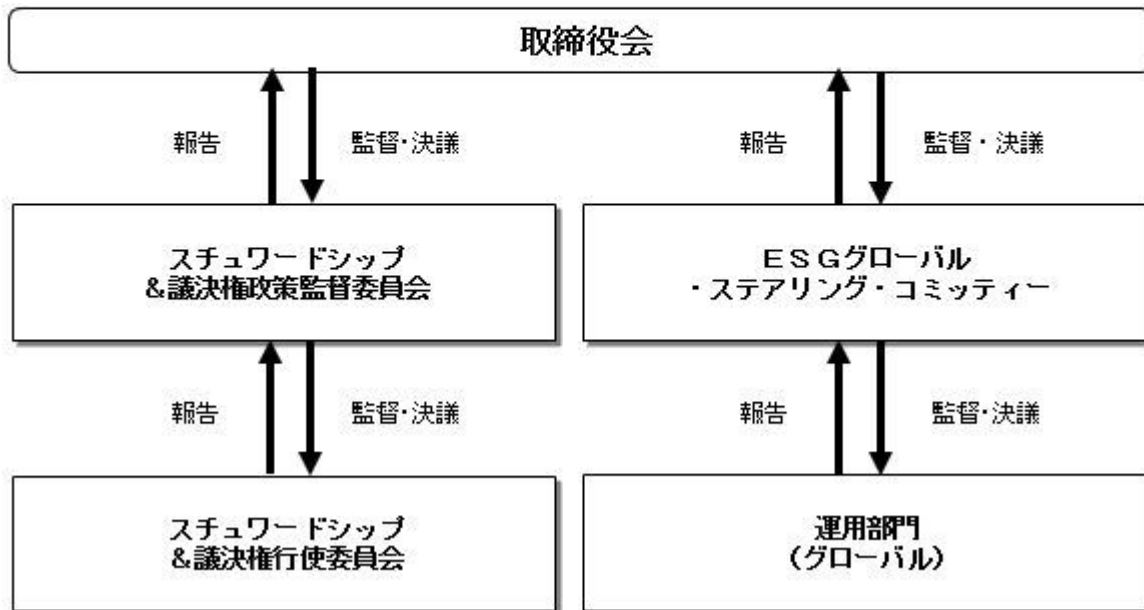
#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2021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

## &lt;インデックスポートフォリオ&gt;

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

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

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

- 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。

## &lt; バランスポートフォリオ &gt;

- 1）「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2）同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 4）信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5）信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6）信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取



引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## &lt;インデックス東証株式マザーファンド&gt;

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

とします。

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

<インデックスポートフォリオ>

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）と基準価額の主なカイ離要因 >

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

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

### < バランスポートフォリオ >

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せん。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

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

### < その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

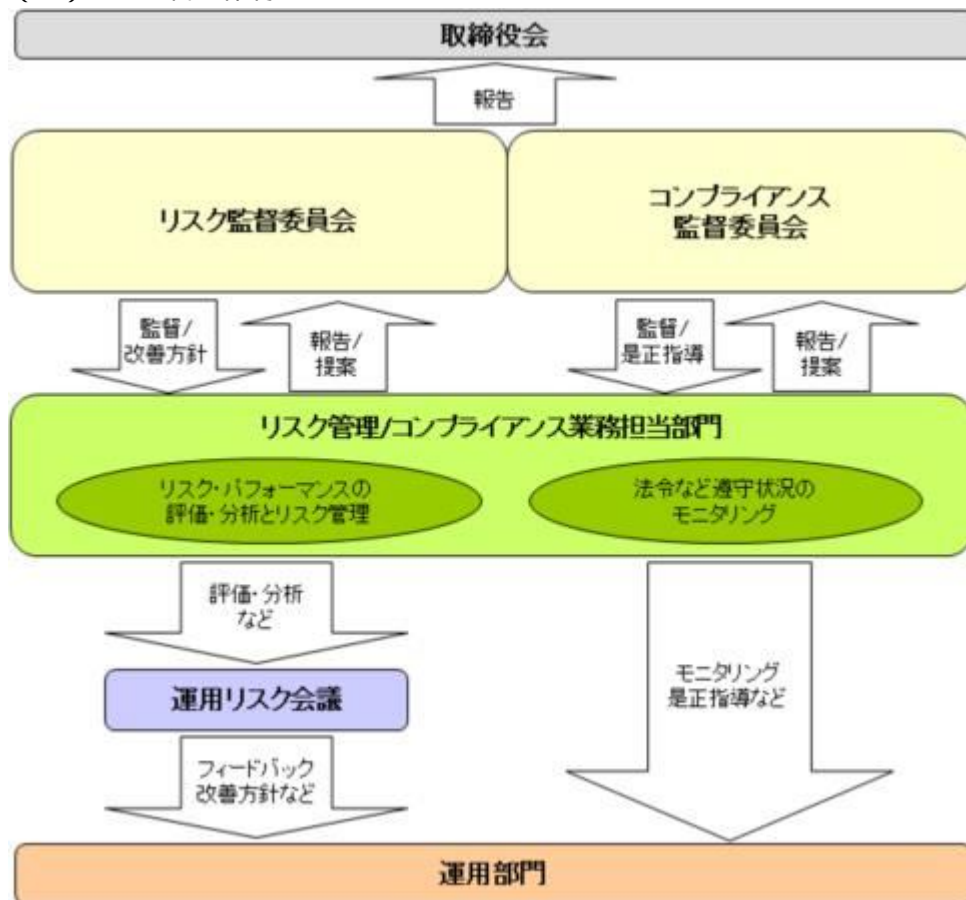
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## （２）リスク管理体制



### 全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議において



は、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）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、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

### 法令など遵守状況のモニタリング

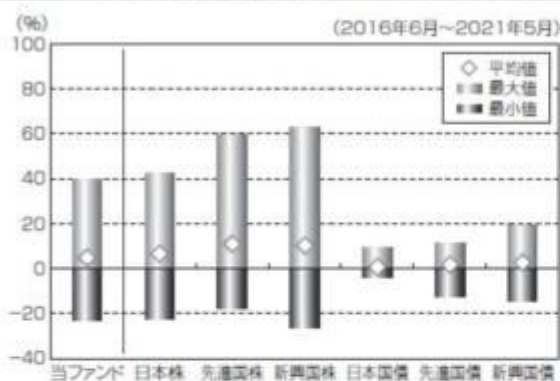
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2021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）

### インデックスポートフォリオ

#### 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(%)）

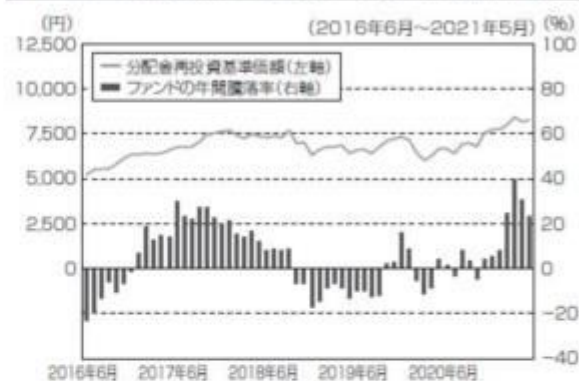
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	5.0%	6.7%	11.0%	10.3%	0.8%	1.8%	2.7%
最大値	39.7%	42.1%	59.8%	62.7%	9.3%	11.4%	18.3%
最小値	-23.2%	-22.0%	-17.5%	-26.0%	-4.0%	-12.3%	-14.5%

※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2016年6月から2021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。

#### 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



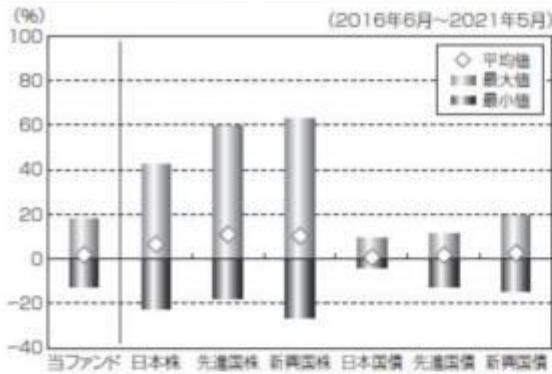
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016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。

## バランスポートフォリオ

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.9%	6.7%	11.0%	10.3%	0.8%	1.8%	2.7%
最大値	17.9%	42.1%	59.8%	62.7%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-12.1%	-22.0%	-17.5%	-26.0%	-4.0%	-12.3%	-14.5%

※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2016年6月から2021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……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株…MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

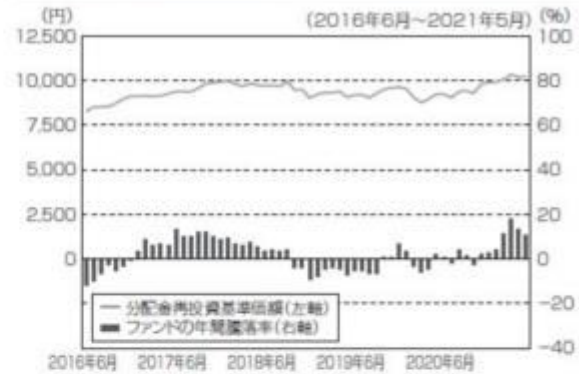
日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバルレディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

### 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、2016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。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

### 東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄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、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

### MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、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、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を

負いません。

#### FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、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1.672%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）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
1.52%	0.34%	1.10%	0.08%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

##### （4）【その他の手数料等】

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

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



信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

### 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）<sup>\*</sup>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。

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)

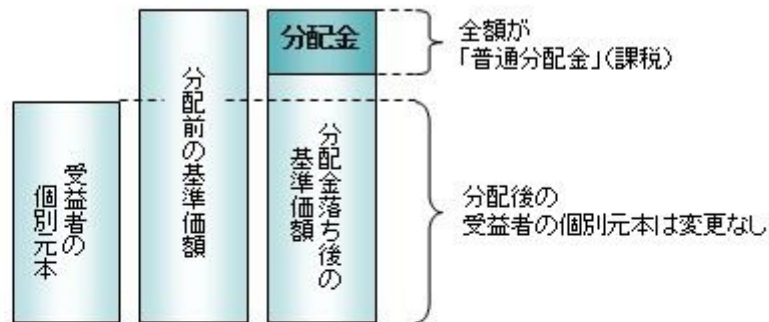
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から

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。

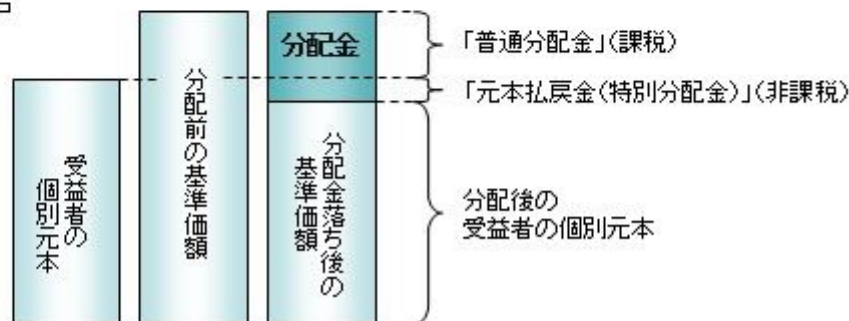
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <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2021年8月6日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	9,450,995,576	99.94
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,672,494	0.06
合計(純資産総額)		9,456,668,070	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	4,619,254,925	1.7690	8,171,461,963	2.0460	9,450,995,576	99.94

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

#### 【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24計算期間末 (2011年11月 7日)	7,970	7,983	0.3088	0.3093
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	7,945	7,958	0.3085	0.3090
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	11,931	11,943	0.4906	0.4911
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	12,764	12,776	0.5660	0.5665
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
2020年 5月末日	8,936		0.6668	
6月末日	8,894		0.6646	
7月末日	8,493		0.6372	
8月末日	9,150		0.6880	
9月末日	9,227		0.6960	
10月末日	8,887		0.6755	
11月末日	9,558		0.7493	
12月末日	9,646		0.7701	

2021年 1月末日	9,464		0.7711
2月末日	9,478		0.7939
3月末日	9,839		0.8378
4月末日	9,374		0.8129
5月末日	9,456		0.8230

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005
当中間期	2020年11月10日～2021年 5月 9日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	10.14
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.06
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	59.19
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	15.47
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
当中間期	2020年11月10日～2021年 5月 9日	15.22

(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24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	1,083,821,347	1,275,668,411
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	1,098,402,396	1,156,956,048
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	726,814,196	2,160,223,460
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	540,447,887	2,308,575,579
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
当中間期	2020年11月10日～2021年 5月 9日	84,108,369	1,627,531,215

### 【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### （１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	日本	54,708,320	26.20
親投資信託受益証券	日本	105,311,431	50.43
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		48,811,968	23.37
合計（純資産総額）		208,831,719	100.00

#### （２）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
日本	親投資信託 受益証券	インデックス東証 株式マザーファン ド	51,471,863	1.7690	91,053,726	2.0460	105,311,431			50.43
日本	地方債証券	平成24年度第1 0回静岡県公募公 債	18,000,000	101.55	18,279,900	101.20	18,217,440	0.678	2023/3/22	8.72
日本	地方債証券	第401回大阪府 公募公債（10 年）	15,000,000	102.21	15,332,700	102.01	15,302,250	0.477	2025/10/29	7.33
日本	地方債証券	平成26年度第1 回滋賀県公募公 債	11,000,000	101.92	11,211,530	101.69	11,186,230	0.495	2024/11/28	5.36
日本	地方債証券	平成30年度第1 回鹿児島県公募公 債（5年）	10,000,000	100.00	10,000,000	100.02	10,002,400	0.020	2023/10/31	4.79

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	26.20
親投資信託受益証券	50.43
合 計	76.63

## 【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24計算期間末 (2011年11月 7日)	381	381	0.6403	0.6408
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	366	366	0.6377	0.6382
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	436	437	0.8067	0.8072
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	382	382	0.8619	0.8624
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	322	322	0.9300	0.9305
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	271	271	0.8629	0.8634
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	268	268	0.9920	0.9925
第31計算期間末 (2018年11月 7日)	218	218	0.9443	0.9448
第32計算期間末 (2019年11月 7日)	217	217	0.9565	0.9570
第33計算期間末 (2020年11月 9日)	213	213	0.9545	0.9550
2020年 5月末日	207		0.9225	
6月末日	206		0.9204	
7月末日	203		0.9009	
8月末日	211		0.9351	
9月末日	209		0.9405	
10月末日	207		0.9262	
11月末日	218		0.9748	
12月末日	218		0.9877	
2021年 1月末日	212		0.9879	
2月末日	207		1.0020	
3月末日	213		1.0296	

4月末日	209		1.0136
5月末日	208		1.0191

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005
当中間期	2020年11月10日～2021年 5月 9日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	5.05
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.33
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.58
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	6.90
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	7.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	7.16
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	15.02
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	4.76
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	1.34
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.16
当中間期	2020年11月10日～2021年 5月 9日	7.12

(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24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	24,624,836	57,559,266

第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	21,493,518	42,290,225
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	14,701,201	47,759,106
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	11,634,468	109,900,290
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	9,591,772	106,409,569
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	9,326,069	41,548,116
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	7,480,324	50,984,226
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	6,405,223	46,051,030
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	6,506,949	10,601,618
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	7,044,581	10,651,253
当中間期	2020年11月10日～2021年 5月 9日	3,121,885	22,187,733

（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2021年 5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	9,388,638,440	98.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		167,127,466	1.75
合計（純資産総額）		9,555,765,906	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	154,280,000	1.61

（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	36,000	7,009.00	252,324,000	9,115.00	328,140,000	3.43
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	22,300	7,922.71	176,676,433	10,785.00	240,505,500	2.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	27,700	7,101.02	196,698,254	8,256.00	228,691,200	2.39
日本	株式	キーエンス	電気機器	3,500	50,323.00	176,130,500	53,870.00	188,545,000	1.97



日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	240,000	425.39	102,093,600	620.00	148,800,000	1.56
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	24,400	4,351.84	106,184,896	5,555.00	135,542,000	1.42
日本	株式	任天堂	その他製品	2,000	56,250.00	112,500,000	67,700.00	135,400,000	1.42
日本	株式	信越化学工業	化学	6,400	14,861.84	95,115,776	18,855.00	120,672,000	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	40,800	2,249.00	91,759,200	2,931.50	119,605,200	1.25
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	29,600	3,538.70	104,745,520	3,719.00	110,082,400	1.15
日本	株式	日本電産	電気機器	8,600	10,335.00	88,881,000	12,530.00	107,758,000	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	28,000	2,831.25	79,275,000	3,717.00	104,076,000	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,100	29,100.00	61,110,000	48,660.00	102,186,000	1.07
日本	株式	HOYA	精密機器	7,000	12,220.00	85,540,000	14,350.00	100,450,000	1.05
日本	株式	日立製作所	電気機器	17,100	3,615.55	61,825,905	5,736.00	98,085,600	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,500	19,873.27	89,429,715	21,605.00	97,222,500	1.02
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	24,300	2,997.73	72,844,839	3,951.00	96,009,300	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	28,000	2,613.30	73,172,400	3,353.00	93,884,000	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	10,400	7,309.77	76,021,608	8,279.00	86,101,600	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	3,100	21,200.00	65,720,000	26,300.00	81,530,000	0.85
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	47,700	1,312.88	62,624,376	1,673.00	79,802,100	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	24,000	2,585.00	62,040,000	3,249.00	77,976,000	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	28,000	2,763.47	77,377,160	2,530.00	70,840,000	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	28,000	1,782.00	49,896,000	2,414.00	67,592,000	0.71
日本	株式	S M C	機械	1,000	57,390.00	57,390,000	65,520.00	65,520,000	0.69
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	13,700	3,571.45	48,928,865	4,736.00	64,883,200	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	21,300	2,470.00	52,611,000	2,984.00	63,559,200	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	35,600	1,382.84	49,229,104	1,692.00	60,235,200	0.63
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	11,600	4,867.00	56,457,200	5,179.00	60,076,400	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	3,600	15,100.00	54,360,000	16,310.00	58,716,000	0.61

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.29
		食料品	3.33
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.25
		医薬品	4.99
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.65
		ガラス・土石製品	0.77

	鉄鋼	0.83
	非鉄金属	0.75
	金属製品	0.61
	機械	5.52
	電気機器	17.48
	輸送用機器	7.50
	精密機器	2.66
	その他製品	2.52
	電気・ガス業	1.20
	陸運業	3.26
	海運業	0.27
	空運業	0.47
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	8.87
	卸売業	4.64
	小売業	4.44
	銀行業	5.09
	証券、商品先物取引業	0.81
	保険業	1.91
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.97
	サービス業	5.52
合 計		98.25

### 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 2021年06月	買建	8	日本円	155,044,400	154,280,000	1.61

(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(インデックスポートフォリオ)

2021年5月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 .....8,230円

純資産総額 .....94.56億円

※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、2011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)を再投資したもとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	165円

## 主要な資産の状況

## ＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	98.19%
株式先物	1.61%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.81%

※当ファンドの実質組入比率です。

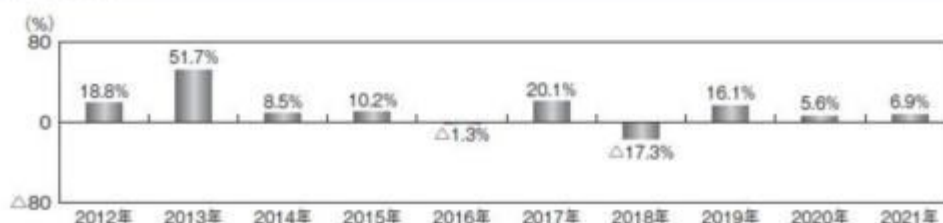
## ＜組入上位10銘柄＞

## 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	3.43%
2 ソニーグループ	電気機器	2.52%
3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.39%
4 キーエンス	電気機器	1.97%
5 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.56%
6 リクルートホールディングス	サービス業	1.42%
7 任天堂	その他製品	1.42%
8 信越化学工業	化学	1.26%
9 日本電信電話	情報・通信業	1.25%
10 武田薬品工業	医薬品	1.15%

※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)を再投資したもとして計算しております。

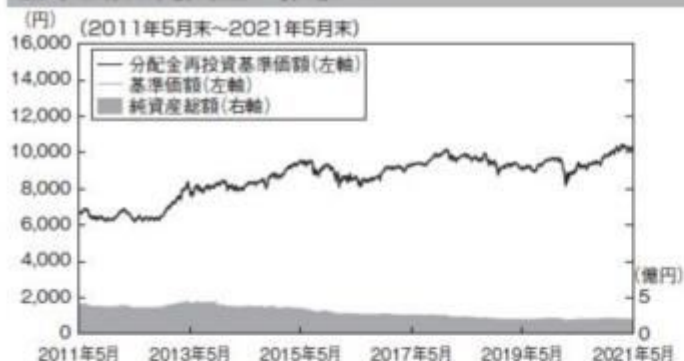
※2021年は、2021年5月末までの騰落率です。

※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。

## 運用実績(バランスポートフォリオ)

2021年5月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 ..... 10,191円

純資産総額 ..... 2.08億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2011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)を再投資したもとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	設定以来累計
5円	5円	5円	5円	5円	165円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
株式	49.54%
株式先物	0.81%
債券	26.20%
債券先物	0.00%
現金その他	24.26%

※当ファンドの実質組入比率です。

## &lt;組入上位銘柄&gt;

## 当ファンド

銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1 インデックス東証株式マザーファンド	積投資信託受益証券	—	—	50.43%
2 平成24年度第10回静岡県公募公債	地方債証券	0.678%	2023年3月22日	8.72%
3 第401回大阪府公募公債(10年)	地方債証券	0.477%	2025年10月29日	7.33%
4 平成26年度第1回滋賀県公募公債	地方債証券	0.495%	2024年11月28日	5.36%
5 平成30年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	地方債証券	0.020%	2023年10月31日	4.79%

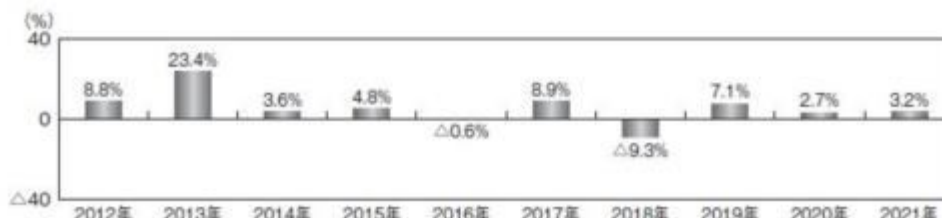
※当ファンドの対純資産総額比です。

## インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.43%
2 ソニーグループ	電気機器	2.52%
3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.39%
4 キーエンス	電気機器	1.97%
5 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.56%

※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)を再投資したもとして計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2021年は、2021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

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

(2) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(3) 申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

(4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(5) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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号に規定する外国金融商品市場をいいます。

## 2【換金（解約）手続等】

### < 解約請求による換金 >

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(2) 解約制限

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

(3) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(4) 手取額

1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。

(5) 解約単位

1口単位

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

(6) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(7) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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。

## &lt; 買取請求による換金 &gt;

## (1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

## (2) 買取制限

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

## (3) 買取価額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

## (4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

## (5) 買取単位

1口単位

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

## (6) 受付の中止および取消

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

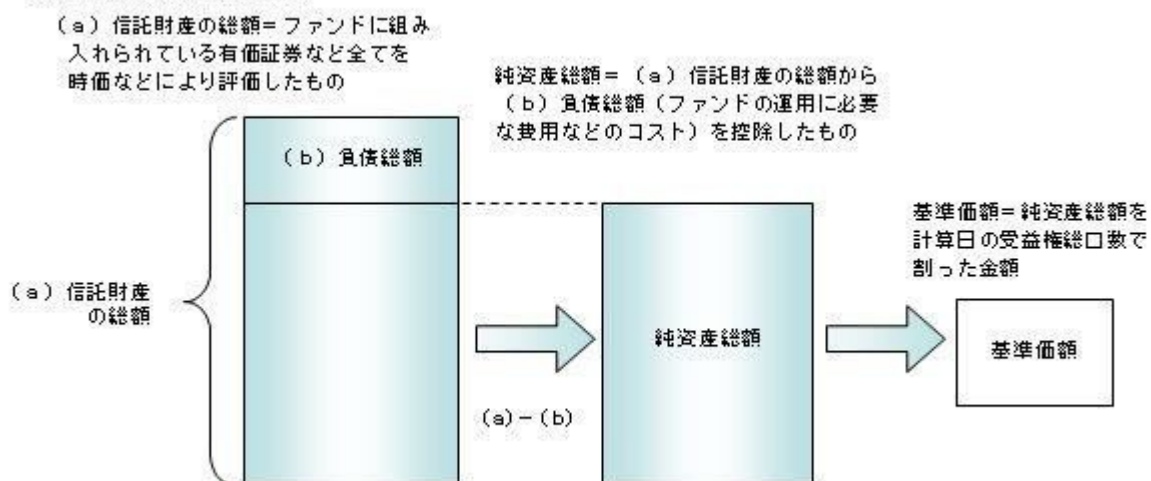
## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

## 基準価額の算出

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

## &lt; 基準価額算出の流れ &gt;



## 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。

## &lt; 主な資産の評価方法 &gt;

インデックスポートフォリオ	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。
バランスポートフォリオ	マザーファンド受益証券 基準価額計算日の基準価額で評価します。 国内上場株式 原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。 公社債（国内・外国）  原則として、基準価額計算日 <sup>*</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。） c) 価格情報会社の提供する価額 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。 <sup>*</sup> 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします（1987年11月27日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4) 【計算期間】

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

## (5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）



- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - <インデックスポートフォリオ>
    - 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
  - <バランスポートフォリオ>
    - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
    - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
  - 二) 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ことができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
  - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、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、每期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

<インデックスポートフォリオ>

<バランスポートフォリオ>

- (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33期計算期間（2019年11月8日から2020年11月9日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【インデックスポートフォリオ】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第32期 2019年11月 7日現在	第33期 2020年11月 9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	88,063,328	84,370,205
親投資信託受益証券	10,191,277,391	9,416,916,044
未収入金	4,688,446	4,172,077
流動資産合計	10,284,029,165	9,505,458,326
資産合計	10,284,029,165	9,505,458,326
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,069,129	6,535,141
未払解約金	17,047,199	34,878,965
未払受託者報酬	4,127,759	4,023,525
未払委託者報酬	74,300,830	72,424,571
未払利息	56	61
その他未払費用	206,330	201,116
流動負債合計	102,751,303	118,063,379
負債合計	102,751,303	118,063,379
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,138,258,485	13,070,282,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	3,956,980,623	3,682,887,183
( 分配準備積立金 )	2,508,680,347	2,274,004,168
元本等合計	10,181,277,862	9,387,394,947
純資産合計	10,181,277,862	9,387,394,947
負債純資産合計	10,284,029,165	9,505,458,326

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第32期		第33期	
	自 2018年11月 8日	至 2019年11月 7日	自 2019年11月 8日	至 2020年11月 9日
営業収益				
受取利息		301		27
有価証券売買等損益		505,843,198		108,094,208
営業収益合計		505,843,499		108,094,235
営業費用				
支払利息		17,285		12,849
受託者報酬		8,286,551		8,067,849
委託者報酬		149,160,125		145,223,485
その他費用		417,100		403,320
営業費用合計		157,881,061		153,707,503
営業利益又は営業損失( )		347,962,438		45,613,268
経常利益又は経常損失( )		347,962,438		45,613,268
当期純利益又は当期純損失( )		347,962,438		45,613,268
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( )		18,808,954		37,198,244
期首剰余金又は期首欠損金( )		4,465,922,253		3,956,980,623
剰余金増加額又は欠損金減少額		234,332,430		362,644,534
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		234,332,430		362,644,534
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		85,093,063		73,600,929
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		85,093,063		73,600,929
分配金		7,069,129		6,535,141
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,956,980,623		3,682,887,183

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2019年11月8日から2020年11月9日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

		第32期 2019年11月7日現在	第33期 2020年11月9日現在
1.	期首元本額	14,654,068,810円	14,138,258,485円
	期中追加設定元本額	252,391,538円	226,616,601円
	期中一部解約元本額	768,201,863円	1,294,592,956円
2.	受益権の総数	14,138,258,485口	13,070,282,130口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,956,980,623円	3,682,887,183円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第32期 自 2018年11月8日 至 2019年11月7日		第33期 自 2019年11月8日 至 2020年11月9日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	1,800,220,111円	C 信託約款に定める収益調整金 1,702,878,166円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	2,515,749,476円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 2,280,539,309円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,315,969,587円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 3,983,417,475円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,052円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,047円
G	分配金額	7,069,129円	G 分配金額 6,535,141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32期 自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日	第33期 自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9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32期 2019年11月 7日現在	第33期 2020年11月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第32期（2019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	637,320,272
合計	637,320,272

第33期（2020年11月 9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	223,578,560
合計	223,578,560

（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32期 2019年11月 7日現在		第33期 2020年11月 9日現在	
1口当たり純資産額	0.7201円	1口当たり純資産額	0.7182円
(1万口当たり純資産額)	(7,201円)	(1万口当たり純資産額)	(7,182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	5,323,299,064	9,416,916,044	
合計		5,323,299,064	9,416,916,044	

(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。



## 【バランスポートフォリオ】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第32期 2019年11月 7日現在	第33期 2020年11月 9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	52,952,066	52,717,478
国債証券	20,008,076	-
地方債証券	33,831,240	54,824,130
親投資信託受益証券	112,314,192	107,693,399
未収利息	24,688	42,818
流動資産合計	219,130,262	215,277,825
<b>資産合計</b>		
219,130,262		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	113,589	111,785
未払受託者報酬	90,572	93,025
未払委託者報酬	1,631,418	1,675,571
未払利息	33	38
その他未払費用	4,471	4,605
流動負債合計	1,840,083	1,885,024
<b>負債合計</b>		
1,840,083		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	227,178,234	223,571,562
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	9,888,055	10,178,761
( 分配準備積立金 )	26,939,487	25,581,671
元本等合計	217,290,179	213,392,801
<b>純資産合計</b>		
217,290,179		
<b>負債純資産合計</b>		
219,130,262		

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第32期		第33期	
	自 至	2018年11月 8日 2019年11月 7日	自 至	2019年11月 8日 2020年11月 9日
営業収益				
受取利息		138,792		246,495
有価証券売買等損益		6,056,360		2,942,853
営業収益合計		6,195,152		3,189,348
営業費用				
支払利息		21,264		14,297
受託者報酬		180,260		184,052
委託者報酬		3,246,826		3,315,124
その他費用		11,826		9,232
営業費用合計		3,460,176		3,522,705
営業利益又は営業損失（ ）		2,734,976		333,357
経常利益又は経常損失（ ）		2,734,976		333,357
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,734,976		333,357
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（ ）		284,096		210,060
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		12,876,367		9,888,055
剰余金増加額又は欠損金減少額		591,144		467,009
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		591,144		467,009
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		508,315		522,633
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		508,315		522,633
分配金		113,589		111,785
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,888,055		10,178,761

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2019年11月 8日から2020年11月 9日までとなっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

		第32期 2019年11月 7日現在	第33期 2020年11月 9日現在
1.	期首元本額	231,272,903円	227,178,234円
	期中追加設定元本額	6,506,949円	7,044,581円
	期中一部解約元本額	10,601,618円	10,651,253円
2.	受益権の総数	227,178,234口	223,571,562口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	9,888,055円	10,178,761円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第32期 自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日	第33期 自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9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	54,940円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	33,705,960円	C	信託約款に定める収益調整金	33,989,225円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	26,998,136円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	25,693,456円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	60,759,036円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	59,682,681円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,674円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,669円
G	分配金額	113,589円	G	分配金額	111,785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32期 自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日	第33期 自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9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32期 2019年11月 7日現在	第33期 2020年11月 9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

	<p>売買目的有価証券</p> <p>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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>同左</p>

（有価証券に関する注記）

第32期（2019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
国債証券	46,524
地方債証券	41,940
親投資信託受益証券	6,572,602
合計	6,484,138

第33期（2020年11月 9日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
地方債証券	257,610
親投資信託受益証券	4,504,980
合計	4,247,370

（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32期 2019年11月 7日現在		第33期 2020年11月 9日現在	
1口当たり純資産額	0.9565円	1口当たり純資産額	0.9545円
(1万口当たり純資産額)	(9,565円)	(1万口当たり純資産額)	(9,545円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	第401回大阪府公募公債（10年）	15,000,000	15,332,700	
	平成24年度第10回静岡県公募公債	18,000,000	18,279,900	
	平成26年度第1回滋賀県公募公債	11,000,000	11,211,530	
	平成30年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	10,000,000	10,000,000	
地方債証券 合計		54,000,000	54,824,130	
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	60,878,123	107,693,399	
親投資信託受益証券 合計		60,878,123	107,693,399	
	合計	114,878,123	162,517,529	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」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）	
	2019年11月 7日現在	2020年11月 9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	331,881	993,497
コール・ローン	71,013,131	58,507,336
株式	10,141,204,820	9,358,426,120
派生商品評価勘定	7,386,210	3,096,150
未収入金	1,788,910	30,486,960
未収配当金	95,923,382	81,498,829
流動資産合計	10,317,648,334	9,533,008,892
資産合計	10,317,648,334	9,533,008,892
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	8,695,000	1,665,000
未払解約金	4,688,446	4,172,077
未払利息	45	42
流動負債合計	13,383,491	5,837,119
負債合計	13,383,491	5,837,119
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,911,412,269	5,384,177,187
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,392,852,574	4,142,994,586
元本等合計	10,304,264,843	9,527,171,773
純資産合計	10,304,264,843	9,527,171,773
負債純資産合計	10,317,648,334	9,533,008,892

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p>
--------------------	---

	<p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められ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られた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年11月 7日現在	2020年11月 9日現在
1.	期首	2018年11月 8日	2019年11月 8日
	期首元本額	6,224,405,085円	5,911,412,269円
	期首からの追加設定元本額	54,893,709円	50,641,251円
	期首からの一部解約元本額	367,886,525円	577,876,333円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	5,846,974,981円	5,323,299,064円
	バランスポートフォリオ	64,437,288円	60,878,123円
	計	5,911,412,269円	5,384,177,187円
2.	受益権の総数	5,911,412,269口	5,384,177,187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	70,487,060円	67,760,550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 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日	自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9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

	2019年11月 7日現在	2020年11月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019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	412,314,790
合計	412,314,790

(2020年11月 9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	247,055,270
合計	247,055,270

(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)

(2019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	111,890,000	-	119,280,000	7,390,000
合計		111,890,000	-	119,280,000	7,390,000

(2020年11月 9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	114,570,000	-	117,670,000	3,100,000
合計		114,570,000	-	117,670,000	3,100,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2019年11月 7日現在		2020年11月 9日現在	
1口当たり純資産額	1.743円	1口当たり純資産額	1.769円
(1千口当たり純資産額)	(1,743円)	(1千口当たり純資産額)	(1,769円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	200	2,795.00	559,000	
日本水産	5,500	423.00	2,326,500	
マルハニチロ	800	2,252.00	1,801,600	
雪国まいたけ	300	1,993.00	597,900	
カネコ種苗	100	1,550.00	155,000	
サカタのタネ	600	3,685.00	2,211,000	
ホクト	400	2,145.00	858,000	
ホクリヨウ	100	677.00	67,700	
住石ホールディングス	1,300	126.00	163,800	
日鉄鉱業	100	5,280.00	528,000	
三井松島ホールディングス	300	718.00	215,400	
国際石油開発帝石	19,800	500.00	9,900,000	
石油資源開発	700	1,692.00	1,184,400	
K & O エナジーグループ	300	1,499.00	449,700	
ヒノキヤグループ	100	2,267.00	226,700	
ショーボンドホールディングス	800	5,360.00	4,288,000	
ミライト・ホールディングス	1,600	1,563.00	2,500,800	
タマホーム	300	1,471.00	441,300	

日本アクア	200	706.00	141,200
ファーストコーポレーション	200	750.00	150,000
ベステラ	100	1,408.00	140,800
キャンディル	100	610.00	61,000
スペースバリューホールディングス	600	602.00	361,200
ダイセキ環境ソリューション	100	700.00	70,000
第一カッター興業	100	2,236.00	223,600
安藤・間	3,200	679.00	2,172,800
東急建設	1,600	486.00	777,600
コムシスホールディングス	1,900	3,010.00	5,719,000
ビーアールホールディングス	600	775.00	465,000
高松コンストラクショングループ	300	2,188.00	656,400
東建コーポレーション	200	8,080.00	1,616,000
ソネック	100	871.00	87,100
ヤマウラ	200	906.00	181,200
大成建設	4,200	3,440.00	14,448,000
大林組	12,400	901.00	11,172,400
清水建設	12,600	777.00	9,790,200
飛鳥建設	400	1,125.00	450,000
長谷工コーポレーション	4,800	1,292.00	6,201,600
松井建設	500	725.00	362,500
銭高組	100	4,695.00	469,500
鹿島建設	9,800	1,161.00	11,377,800
不動テトラ	300	1,510.00	453,000
大末建設	100	849.00	84,900
鉄建建設	300	1,998.00	599,400
西松建設	1,000	1,950.00	1,950,000
三井住友建設	3,000	429.00	1,287,000
大豊建設	300	3,465.00	1,039,500
前田建設工業	3,100	793.00	2,458,300
佐田建設	300	454.00	136,200
ナカノフドー建設	400	419.00	167,600
奥村組	600	2,468.00	1,480,800
東鉄工業	500	2,889.00	1,444,500
イチケン	100	1,626.00	162,600
富士ピー・エス	200	594.00	118,800
浅沼組	100	4,155.00	415,500
戸田建設	5,200	620.00	3,224,000
熊谷組	600	2,476.00	1,485,600
北野建設	100	2,553.00	255,300
植木組	100	2,810.00	281,000
矢作建設工業	600	893.00	535,800

ピーエス三菱	400	569.00	227,600
日本ハウスホールディングス	800	236.00	188,800
大東建託	1,400	9,510.00	13,314,000
新日本建設	500	947.00	473,500
N I P P O	1,000	2,857.00	2,857,000
東亜道路工業	100	3,715.00	371,500
前田道路	1,100	1,822.00	2,004,200
日本道路	100	8,020.00	802,000
東亜建設工業	400	2,027.00	810,800
日本国土開発	1,200	567.00	680,400
若築建設	200	1,222.00	244,400
東洋建設	1,400	411.00	575,400
五洋建設	4,900	705.00	3,454,500
世紀東急工業	600	837.00	502,200
福田組	100	5,230.00	523,000
住友林業	3,100	1,671.00	5,180,100
日本基礎技術	400	456.00	182,400
巴コーポレーション	600	377.00	226,200
大和ハウス工業	12,300	2,848.50	35,036,550
ライト工業	700	1,575.00	1,102,500
積水ハウス	13,500	1,788.00	24,138,000
日特建設	300	802.00	240,600
北陸電気工事	200	1,273.00	254,600
ユアテック	700	680.00	476,000
日本リーテック	300	2,394.00	718,200
四電工	100	2,399.00	239,900
中電工	500	2,139.00	1,069,500
関電工	1,800	814.00	1,465,200
きんでん	2,900	1,687.00	4,892,300
東京エネシス	400	834.00	333,600
トーエネック	100	3,645.00	364,500
住友電設	400	2,778.00	1,111,200
日本電設工業	700	2,195.00	1,536,500
協和エクシオ	1,900	2,614.00	4,966,600
新日本空調	300	2,215.00	664,500
九電工	900	3,015.00	2,713,500
三機工業	900	1,189.00	1,070,100
日揮ホールディングス	3,800	893.00	3,393,400
中外炉工業	100	1,498.00	149,800
ヤマト	400	748.00	299,200
太平電業	300	2,360.00	708,000
高砂熱学工業	900	1,485.00	1,336,500

三晃金属工業	100	2,680.00	268,000
朝日工業社	100	2,946.00	294,600
明星工業	800	875.00	700,000
大気社	600	2,864.00	1,718,400
ダイダン	300	2,758.00	827,400
日比谷総合設備	400	1,768.00	707,200
フィル・カンパニー	100	2,106.00	210,600
OSJBホールディングス	2,000	249.00	498,000
東洋エンジニアリング	500	311.00	155,500
レイズネクスト	700	1,225.00	857,500
日本製粉	1,200	1,731.00	2,077,200
日清製粉グループ本社	4,500	1,658.00	7,461,000
昭和産業	400	3,315.00	1,326,000
鳥越製粉	400	1,080.00	432,000
中部飼料	500	1,478.00	739,000
フィード・ワン	500	898.00	449,000
東洋精糖	100	1,266.00	126,600
日本甜菜製糖	200	1,791.00	358,200
三井製糖	400	1,839.00	735,600
塩水港精糖	500	222.00	111,000
日新製糖	200	1,900.00	380,000
森永製菓	900	4,210.00	3,789,000
中村屋	100	4,200.00	420,000
江崎グリコ	1,100	4,335.00	4,768,500
名糖産業	200	1,479.00	295,800
井村屋グループ	200	2,550.00	510,000
不二家	300	2,420.00	726,000
山崎製パン	3,000	1,731.00	5,193,000
第一屋製パン	100	1,004.00	100,400
モロゾフ	100	6,100.00	610,000
亀田製菓	200	4,840.00	968,000
寿スピリッツ	400	5,030.00	2,012,000
カルビー	1,800	3,090.00	5,562,000
森永乳業	700	5,350.00	3,745,000
六甲バター	300	1,795.00	538,500
ヤクルト本社	2,800	5,170.00	14,476,000
明治ホールディングス	2,600	7,760.00	20,176,000
雪印メグミルク	1,000	2,425.00	2,425,000
プリマハム	600	3,075.00	1,845,000
日本ハム	1,500	4,495.00	6,742,500
林兼産業	100	574.00	57,400
丸大食品	400	1,684.00	673,600

S Foods	300	3,315.00	994,500
柿安本店	100	2,551.00	255,100
伊藤ハム米久ホールディングス	2,600	722.00	1,877,200
サッポロホールディングス	1,400	1,904.00	2,665,600
アサヒグループホールディングス	8,700	3,690.00	32,103,000
キリンホールディングス	16,900	2,094.00	35,388,600
宝ホールディングス	3,000	1,162.00	3,486,000
オエノンホールディングス	1,100	423.00	465,300
養命酒製造	100	1,830.00	183,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	3,100	1,510.00	4,681,000
サントリー食品インターナショナル	2,700	3,665.00	9,895,500
ダイドーグループホールディングス	200	5,570.00	1,114,000
伊藤園	1,200	7,290.00	8,748,000
キーコーヒー	400	2,154.00	861,600
ユニカフェ	100	1,073.00	107,300
ジャパンフーズ	100	1,266.00	126,600
日清オイリオグループ	500	3,045.00	1,522,500
不二製油グループ本社	1,000	3,085.00	3,085,000
J - オイルミルズ	200	3,785.00	757,000
キッコーマン	2,900	6,260.00	18,154,000
味の素	8,800	2,284.00	20,099,200
キューピー	2,200	2,220.00	4,884,000
ハウス食品グループ本社	1,500	3,645.00	5,467,500
カゴメ	1,600	3,850.00	6,160,000
焼津水産化学工業	200	1,000.00	200,000
アリアケジャパン	400	7,130.00	2,852,000
ピエトロ	100	1,698.00	169,800
エバラ食品工業	100	2,332.00	233,200
ニチレイ	1,900	2,893.00	5,496,700
東洋水産	2,100	5,520.00	11,592,000
イートアンドホールディングス	100	1,880.00	188,000
大冷	100	2,133.00	213,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	877.00	175,400
日清食品ホールディングス	1,700	9,090.00	15,453,000
永谷園ホールディングス	200	2,360.00	472,000
一正蒲鉾	200	1,105.00	221,000
フジッコ	400	2,027.00	810,800
ロック・フィールド	400	1,500.00	600,000
日本たばこ産業	21,400	2,071.00	44,319,400
ケンコーマヨネーズ	200	1,871.00	374,200
わらべや日洋ホールディングス	300	1,464.00	439,200
なとり	200	2,073.00	414,600

イフジ産業	100	910.00	91,000
ピクルスコーポレーション	100	3,010.00	301,000
北の達人コーポレーション	1,500	495.00	742,500
ユーグレナ	1,800	886.00	1,594,800
ミヨシ油脂	200	1,224.00	244,800
理研ビタミン	400	1,555.00	622,000
片倉工業	500	1,218.00	609,000
ゲンゼ	300	3,765.00	1,129,500
東洋紡	1,500	1,455.00	2,182,500
ユニチカ	1,200	359.00	430,800
富士紡ホールディングス	200	3,645.00	729,000
倉敷紡績	400	1,849.00	739,600
シキボウ	200	951.00	190,200
日本毛織	1,300	1,077.00	1,400,100
ダイトウボウ	600	101.00	60,600
トーア紡コーポレーション	100	460.00	46,000
ダイドーリミテッド	400	200.00	80,000
帝国繊維	400	2,744.00	1,097,600
帝人	3,200	1,713.00	5,481,600
東レ	28,200	500.50	14,114,100
サカイオーベックス	100	2,034.00	203,400
住江織物	100	2,070.00	207,000
日本フェルト	200	480.00	96,000
イチカワ	100	1,329.00	132,900
アツギ	300	555.00	166,500
ダイニック	100	791.00	79,100
セーレン	1,000	1,634.00	1,634,000
ソトー	200	949.00	189,800
東海染工	100	1,137.00	113,700
小松マテーレ	600	915.00	549,000
ワコールホールディングス	1,000	2,097.00	2,097,000
ホギメディカル	400	3,215.00	1,286,000
クラウディアホールディングス	100	297.00	29,700
T S Iホールディングス	1,300	230.00	299,000
マツオカコーポレーション	100	2,408.00	240,800
ワールド	600	1,404.00	842,400
三陽商会	200	512.00	102,400
ナイガイ	100	363.00	36,300
オンワードホールディングス	2,300	200.00	460,000
ルックホールディングス	100	994.00	99,400
ゴールドウイン	700	7,260.00	5,082,000
デサント	800	1,741.00	1,392,800



キング	200	557.00	111,400
ヤマトインターナショナル	300	327.00	98,100
特種東海製紙	300	5,000.00	1,500,000
王子ホールディングス	16,200	465.00	7,533,000
日本製紙	1,700	1,209.00	2,055,300
三菱製紙	400	326.00	130,400
北越コーポレーション	2,400	366.00	878,400
中越パルプ工業	200	1,346.00	269,200
巴川製紙所	100	945.00	94,500
大王製紙	1,700	1,630.00	2,771,000
阿波製紙	100	429.00	42,900
レンゴー	3,700	845.00	3,126,500
トーモク	200	1,750.00	350,000
ザ・パック	300	3,005.00	901,500
クラレ	6,100	1,016.00	6,197,600
旭化成	25,800	943.30	24,337,140
共和レザー	200	632.00	126,400
昭和電工	3,000	1,889.00	5,667,000
住友化学	28,700	372.00	10,676,400
住友精化	200	3,710.00	742,000
日産化学	2,200	5,970.00	13,134,000
ラサ工業	100	2,116.00	211,600
クレハ	300	4,550.00	1,365,000
多木化学	200	6,920.00	1,384,000
テイカ	300	1,429.00	428,700
石原産業	700	625.00	437,500
片倉コープアグリ	100	1,219.00	121,900
日本曹達	600	2,803.00	1,681,800
東ソー	6,000	1,730.00	10,380,000
トクヤマ	1,100	2,287.00	2,515,700
セントラル硝子	800	2,242.00	1,793,600
東亜合成	2,500	1,131.00	2,827,500
大阪ソーダ	400	2,623.00	1,049,200
関東電化工業	900	744.00	669,600
デンカ	1,400	3,295.00	4,613,000
信越化学工業	6,700	15,100.00	101,170,000
日本カーバイド工業	100	1,241.00	124,100
堺化学工業	300	2,065.00	619,500
第一稀元素化学工業	400	715.00	286,000
エア・ウォーター	3,600	1,556.00	5,601,600
日本酸素ホールディングス	3,700	1,641.00	6,071,700
日本化学工業	100	2,543.00	254,300

東邦アセチレン	100	1,239.00	123,900
日本パーカラライジング	2,000	1,124.00	2,248,000
高圧ガス工業	600	823.00	493,800
四国化成工業	600	1,200.00	720,000
戸田工業	100	2,067.00	206,700
ステラ ケミファ	200	3,445.00	689,000
保土谷化学工業	200	4,510.00	902,000
日本触媒	600	5,230.00	3,138,000
大日精化工業	400	2,211.00	884,400
カネカ	1,000	3,055.00	3,055,000
三菱瓦斯化学	3,600	1,890.00	6,804,000
三井化学	3,600	2,781.00	10,011,600
J S R	3,600	2,559.00	9,212,400
東京応化工業	700	6,310.00	4,417,000
大阪有機化学工業	400	2,784.00	1,113,600
三菱ケミカルホールディングス	26,100	566.80	14,793,480
K Hネオケム	600	2,699.00	1,619,400
ダイセル	4,900	766.00	3,753,400
住友ベークライト	600	2,893.00	1,735,800
積水化学工業	8,300	1,695.00	14,068,500
日本ゼオン	3,500	1,295.00	4,532,500
アイカ工業	1,200	3,885.00	4,662,000
宇部興産	2,000	1,751.00	3,502,000
積水樹脂	700	2,280.00	1,596,000
タキロンシーアイ	900	686.00	617,400
旭有機材	200	1,484.00	296,800
ニチバン	200	1,664.00	332,800
リケンテクノス	1,000	432.00	432,000
大倉工業	200	1,996.00	399,200
積水化成品工業	600	594.00	356,400
群栄化学工業	100	2,600.00	260,000
タイガースポリマー	200	437.00	87,400
ミライアル	100	1,247.00	124,700
ダイキアクシス	100	895.00	89,500
ダイキョーニシカワ	800	679.00	543,200
竹本容器	200	931.00	186,200
森六ホールディングス	200	2,043.00	408,600
日本化薬	2,400	929.00	2,229,600
カーリットホールディングス	400	555.00	222,000
日本精化	300	1,538.00	461,400
扶桑化学工業	400	3,300.00	1,320,000
トリケミカル研究所	100	12,950.00	1,295,000

A D E K A	1,800	1,482.00	2,667,600
日油	1,500	4,265.00	6,397,500
新日本理化	600	165.00	99,000
ハリマ化成グループ	300	1,020.00	306,000
花王	9,500	7,669.00	72,855,500
第一工業製薬	100	4,370.00	437,000
石原ケミカル	100	2,110.00	211,000
日華化学	100	925.00	92,500
ニイタカ	100	3,280.00	328,000
三洋化成工業	200	4,490.00	898,000
有機合成薬品工業	300	306.00	91,800
大日本塗料	400	1,009.00	403,600
日本ペイントホールディングス	3,200	10,370.00	33,184,000
関西ペイント	4,400	2,891.00	12,720,400
神東塗料	300	175.00	52,500
中国塗料	1,100	1,025.00	1,127,500
日本特殊塗料	300	970.00	291,000
藤倉化成	500	516.00	258,000
太陽ホールディングス	300	5,800.00	1,740,000
D I C	1,600	2,580.00	4,128,000
サカタインクス	900	1,126.00	1,013,400
東洋インキS Cホールディングス	800	1,965.00	1,572,000
T & K T O K A	300	882.00	264,600
富士フィルムホールディングス	7,600	5,514.00	41,906,400
資生堂	7,900	7,041.00	55,623,900
ライオン	5,200	2,432.00	12,646,400
高砂香料工業	300	2,198.00	659,400
マンダム	900	1,636.00	1,472,400
ミルボン	500	5,720.00	2,860,000
ファンケル	1,600	3,730.00	5,968,000
コーセー	800	15,430.00	12,344,000
コタ	200	1,361.00	272,200
シーボン	100	1,925.00	192,500
ポーラ・オルビスホールディングス	1,700	2,101.00	3,571,700
ノエビアホールディングス	300	4,705.00	1,411,500
アジュバンコスメジャパン	100	1,016.00	101,600
エステー	300	2,059.00	617,700
アグロ カネショウ	100	1,693.00	169,300
コニシ	700	1,541.00	1,078,700
長谷川香料	700	2,177.00	1,523,900
星光P M C	200	664.00	132,800
小林製薬	1,100	11,120.00	12,232,000

荒川化学工業	400	1,131.00	452,400
メック	300	2,266.00	679,800
日本高純度化学	100	2,730.00	273,000
タカラバイオ	1,000	2,972.00	2,972,000
JCU	500	3,450.00	1,725,000
新田ゼラチン	300	704.00	211,200
OATアグリオ	100	1,333.00	133,300
デクセリアルズ	1,000	1,160.00	1,160,000
アース製薬	300	6,960.00	2,088,000
北興化学工業	400	1,108.00	443,200
大成ラミック	100	2,877.00	287,700
クミアイ化学工業	1,700	1,053.00	1,790,100
日本農薬	700	512.00	358,400
アキレス	300	1,567.00	470,100
有沢製作所	600	967.00	580,200
日東電工	2,700	7,770.00	20,979,000
レック	400	1,595.00	638,000
三光合成	500	302.00	151,000
きもと	700	184.00	128,800
藤森工業	400	4,405.00	1,762,000
前澤化成工業	200	999.00	199,800
未来工業	200	1,983.00	396,600
ウェーブロックホールディングス	100	718.00	71,800
JSP	200	1,529.00	305,800
エフピコ	800	4,460.00	3,568,000
天馬	300	1,892.00	567,600
信越ポリマー	700	949.00	664,300
東リ	1,000	263.00	263,000
ニフコ	1,500	3,330.00	4,995,000
バルカー	300	1,869.00	560,700
ユニ・チャーム	8,400	5,248.00	44,083,200
ショーエイコーポレーション	100	1,187.00	118,700
協和キリン	4,000	2,876.00	11,504,000
武田薬品工業	33,100	3,475.00	115,022,500
アステラス製薬	34,500	1,581.00	54,544,500
大日本住友製薬	3,000	1,326.00	3,978,000
塩野義製薬	5,000	5,600.00	28,000,000
わかもと製薬	400	260.00	104,000
あすか製薬	400	1,557.00	622,800
日本新薬	1,000	7,810.00	7,810,000
バイオフェルミン製薬	100	2,485.00	248,500
中外製薬	12,400	4,473.00	55,465,200

科研製薬	700	4,200.00	2,940,000
エーザイ	4,800	7,819.00	37,531,200
ロート製薬	2,100	3,495.00	7,339,500
小野薬品工業	9,100	3,221.00	29,311,100
久光製薬	1,100	5,470.00	6,017,000
持田製薬	600	4,115.00	2,469,000
参天製薬	7,400	1,764.00	13,053,600
扶桑薬品工業	100	2,849.00	284,900
ツムラ	1,200	3,375.00	4,050,000
日医工	1,100	1,088.00	1,196,800
キッセイ薬品工業	700	2,136.00	1,495,200
生化学工業	800	1,037.00	829,600
栄研化学	700	2,067.00	1,446,900
日水製薬	100	1,005.00	100,500
鳥居薬品	200	3,090.00	618,000
JCRファーマ	1,100	2,994.00	3,293,400
東和薬品	500	2,042.00	1,021,000
富士製薬工業	300	1,258.00	377,400
沢井製薬	800	5,250.00	4,200,000
ゼリア新薬工業	700	1,920.00	1,344,000
第一三共	34,100	3,344.00	114,030,400
キョーリン製薬ホールディングス	900	1,925.00	1,732,500
大幸薬品	500	2,006.00	1,003,000
ダイト	200	4,075.00	815,000
大塚ホールディングス	8,300	4,195.00	34,818,500
大正製薬ホールディングス	800	6,490.00	5,192,000
ペプチドリーム	2,000	5,080.00	10,160,000
日本コークス工業	3,100	72.00	223,200
ニチレキ	500	1,761.00	880,500
ユシロ化学工業	200	1,319.00	263,800
ビーピー・カストロール	100	1,259.00	125,900
富士石油	1,000	189.00	189,000
MORESCO	200	1,017.00	203,400
出光興産	4,400	2,152.00	9,468,800
ENEOSホールディングス	59,700	363.50	21,700,950
コスモエネルギーホールディングス	1,200	1,597.00	1,916,400
横浜ゴム	2,300	1,505.00	3,461,500
TOYO TIRE	2,100	1,610.00	3,381,000
ブリヂストン	10,600	3,541.00	37,534,600
住友ゴム工業	3,600	962.00	3,463,200
藤倉コンポジット	400	349.00	139,600
オカモト	200	4,200.00	840,000

フコク	200	712.00	142,400
ニッタ	500	2,261.00	1,130,500
住友理工	800	529.00	423,200
三ツ星ベルト	500	1,737.00	868,500
バンドー化学	700	601.00	420,700
日東紡績	600	3,955.00	2,373,000
A G C	3,600	3,280.00	11,808,000
日本板硝子	1,900	392.00	744,800
石塚硝子	100	1,925.00	192,500
日本山村硝子	100	856.00	85,600
日本電気硝子	1,500	2,184.00	3,276,000
オハラ	100	1,261.00	126,100
住友大阪セメント	800	3,295.00	2,636,000
太平洋セメント	2,500	2,562.00	6,405,000
日本ヒューム	400	805.00	322,000
日本コンクリート工業	800	321.00	256,800
三谷セキサン	200	4,915.00	983,000
アジアパイルホールディングス	500	471.00	235,500
東海カーボン	3,900	1,199.00	4,676,100
日本カーボン	200	3,785.00	757,000
東洋炭素	200	1,803.00	360,600
ノリタケカンパニーリミテド	200	3,035.00	607,000
T O T O	2,800	5,350.00	14,980,000
日本碍子	4,800	1,582.00	7,593,600
日本特殊陶業	3,000	1,831.00	5,493,000
ダントーホールディングス	100	546.00	54,600
M A R U W A	200	10,740.00	2,148,000
品川リフラクトリーズ	100	2,214.00	221,400
黒崎播磨	100	2,955.00	295,500
ヨータイ	300	818.00	245,400
イソライト工業	200	467.00	93,400
東京窯業	400	344.00	137,600
ニッカトー	200	698.00	139,600
フジミインコーポレーテッド	400	3,575.00	1,430,000
クニミネ工業	100	1,099.00	109,900
エーアンドエーマテリアル	100	1,098.00	109,800
ニチアス	1,100	2,348.00	2,582,800
ニチハ	500	3,180.00	1,590,000
日本製鉄	17,600	1,098.50	19,333,600
神戸製鋼所	7,300	459.00	3,350,700
中山製鋼所	600	374.00	224,400
合同製鐵	200	1,885.00	377,000

ジェイ エフ イー ホールディングス	10,700	809.00	8,656,300
東京製鐵	1,900	693.00	1,316,700
共英製鋼	500	1,393.00	696,500
大和工業	800	2,610.00	2,088,000
東京鐵鋼	200	2,010.00	402,000
大阪製鐵	200	1,144.00	228,800
淀川製鋼所	500	2,057.00	1,028,500
丸一鋼管	1,300	2,450.00	3,185,000
モリ工業	100	2,490.00	249,000
大同特殊鋼	600	3,725.00	2,235,000
日本高周波鋼業	100	335.00	33,500
日本冶金工業	300	1,513.00	453,900
山陽特殊製鋼	300	1,044.00	313,200
愛知製鋼	200	2,651.00	530,200
日立金属	4,300	1,389.00	5,972,700
日本金属	100	632.00	63,200
大平洋金属	300	1,650.00	495,000
新日本電工	2,600	260.00	676,000
栗本鐵工所	200	1,849.00	369,800
三菱製鋼	300	526.00	157,800
日亜鋼業	600	314.00	188,400
日本精線	100	3,490.00	349,000
エンビプロ・ホールディングス	100	540.00	54,000
シンニッタン	600	200.00	120,000
新家工業	100	1,157.00	115,700
大紀アルミニウム工業所	600	666.00	399,600
日本軽金属ホールディングス	1,000	1,737.00	1,737,000
三井金属鉱業	1,000	2,813.00	2,813,000
東邦亜鉛	200	2,144.00	428,800
三菱マテリアル	2,600	1,960.00	5,096,000
住友金属鉱山	5,000	3,595.00	17,975,000
D O W Aホールディングス	1,000	3,220.00	3,220,000
古河機械金属	700	1,162.00	813,400
エス・サイエンス	1,000	46.00	46,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	400	797.00	318,800
東邦チタニウム	700	663.00	464,100
U A C J	600	1,592.00	955,200
C Kサンエツ	100	3,740.00	374,000
古河電気工業	1,200	2,426.00	2,911,200
住友電気工業	14,700	1,254.00	18,433,800
フジクラ	4,700	393.00	1,847,100
昭和電線ホールディングス	400	1,355.00	542,000

東京特殊電線	100	2,360.00	236,000
タツタ電線	800	589.00	471,200
カナレ電気	100	1,754.00	175,400
平河ヒューテック	200	1,090.00	218,000
リョービ	500	1,223.00	611,500
アーレスティ	400	317.00	126,800
アサヒホールディングス	700	3,765.00	2,635,500
稲葉製作所	200	1,387.00	277,400
宮地エンジニアリンググループ	100	2,055.00	205,500
トーカロ	1,100	1,117.00	1,228,700
アルファC o	100	982.00	98,200
SUMCO	5,000	1,627.00	8,135,000
川田テクノロジーズ	100	4,345.00	434,500
RS Technologies	100	3,700.00	370,000
信和	200	720.00	144,000
東洋製罐グループホールディングス	2,500	1,031.00	2,577,500
ホッカンホールディングス	200	1,492.00	298,400
コロナ	200	1,010.00	202,000
横河ブリッジホールディングス	700	1,966.00	1,376,200
駒井ハルテック	100	1,550.00	155,000
三和ホールディングス	3,700	1,273.00	4,710,100
文化シャッター	1,100	921.00	1,013,100
三協立山	500	922.00	461,000
アルインコ	300	913.00	273,900
東洋シャッター	100	745.00	74,500
LIXILグループ	5,800	2,364.00	13,711,200
日本フィルコン	300	545.00	163,500
ノーリツ	800	1,692.00	1,353,600
長府製作所	400	2,105.00	842,000
リンナイ	800	11,600.00	9,280,000
ダイニチ工業	200	818.00	163,600
日東精工	500	491.00	245,500
三洋工業	100	1,966.00	196,600
岡部	800	818.00	654,400
ジーテクト	500	1,426.00	713,000
東プレ	800	1,060.00	848,000
高周波熱錬	700	488.00	341,600
東京製綱	300	502.00	150,600
サンコール	300	428.00	128,400
モリテック スチール	300	302.00	90,600
パイオラックス	600	1,531.00	918,600
エイチワン	400	624.00	249,600



日本発條	4,200	616.00	2,587,200
アドバネクス	100	1,272.00	127,200
立川ブラインド工業	200	1,328.00	265,600
三益半導体工業	300	2,636.00	790,800
日本ドライケミカル	100	1,520.00	152,000
日本製鋼所	1,200	2,393.00	2,871,600
三浦工業	1,700	5,400.00	9,180,000
タクマ	1,300	1,681.00	2,185,300
ツガミ	800	1,516.00	1,212,800
オークマ	500	5,480.00	2,740,000
芝浦機械	400	2,162.00	864,800
アマダ	4,800	929.00	4,459,200
アイダエンジニアリング	1,000	851.00	851,000
滝澤鉄工所	100	990.00	99,000
F U J I	1,700	2,391.00	4,064,700
牧野フライス製作所	500	3,935.00	1,967,500
オーエスジー	1,900	1,642.00	3,119,800
旭ダイヤモンド工業	1,000	457.00	457,000
D M G 森精機	2,500	1,493.00	3,732,500
ソディック	900	811.00	729,900
ディスコ	500	29,540.00	14,770,000
日東工器	200	1,696.00	339,200
日進工具	100	2,304.00	230,400
パンチ工業	300	488.00	146,400
富士ダイス	200	638.00	127,600
豊和工業	200	823.00	164,600
O K K	100	364.00	36,400
石川製作所	100	1,739.00	173,900
東洋機械金属	300	408.00	122,400
津田駒工業	100	909.00	90,900
エンシュウ	100	974.00	97,400
島精機製作所	600	1,610.00	966,000
オプトラン	500	2,284.00	1,142,000
N C ホールディングス	100	617.00	61,700
イワキポンプ	200	849.00	169,800
フリー	400	1,191.00	476,400
ヤマシンフィルタ	800	1,082.00	865,600
日阪製作所	500	912.00	456,000
やまびこ	700	1,363.00	954,100
平田機工	200	6,710.00	1,342,000
ペガサスミシン製造	400	291.00	116,400
マルマエ	100	912.00	91,200

タツモ	200	1,775.00	355,000
ナブテスコ	2,300	4,075.00	9,372,500
三井海洋開発	400	1,616.00	646,400
レオン自動機	400	1,049.00	419,600
S M C	1,300	60,680.00	78,884,000
ホソカワミクロン	100	5,500.00	550,000
ユニオンツール	100	3,185.00	318,500
オイレス工業	500	1,589.00	794,500
日精エー・エス・ビー機械	100	4,220.00	422,000
サトーホールディングス	500	2,109.00	1,054,500
技研製作所	300	3,890.00	1,167,000
日本エアージェット	100	1,859.00	185,900
カワタ	100	812.00	81,200
日精樹脂工業	300	896.00	268,800
オカダアイヨン	100	1,010.00	101,000
ワイエイシイホールディングス	100	669.00	66,900
小松製作所	18,000	2,453.50	44,163,000
住友重機械工業	2,300	2,421.00	5,568,300
日立建機	1,600	2,705.00	4,328,000
日工	500	688.00	344,000
巴工業	200	1,944.00	388,800
井関農機	400	1,507.00	602,800
T O W A	400	1,313.00	525,200
丸山製作所	100	1,326.00	132,600
北川鉄工所	200	1,379.00	275,800
ローツェ	200	5,020.00	1,004,000
タカキタ	100	687.00	68,700
クボタ	21,100	2,084.50	43,982,950
荏原実業	100	3,775.00	377,500
三菱化工機	100	2,065.00	206,500
月島機械	700	1,281.00	896,700
帝国電機製作所	300	1,257.00	377,100
東京機械製作所	200	276.00	55,200
新東工業	900	723.00	650,700
澁谷工業	300	3,430.00	1,029,000
アイチ コーポレーション	700	943.00	660,100
小森コーポレーション	1,000	687.00	687,000
鶴見製作所	300	1,809.00	542,700
住友精密工業	100	1,973.00	197,300
日本ギア工業	100	293.00	29,300
酒井重工業	100	2,366.00	236,600
荏原製作所	1,600	2,950.00	4,720,000

石井鐵工所	100	2,766.00	276,600
西島製作所	400	810.00	324,000
北越工業	400	1,080.00	432,000
ダイキン工業	5,100	22,530.00	114,903,000
オルガノ	100	5,560.00	556,000
トーヨーカネツ	200	2,237.00	447,400
栗田工業	2,100	3,455.00	7,255,500
椿本チエイン	600	2,498.00	1,498,800
大同工業	200	647.00	129,400
木村化工機	300	473.00	141,900
アネスト岩田	600	905.00	543,000
ダイフク	2,000	12,370.00	24,740,000
サムコ	100	2,801.00	280,100
加藤製作所	200	1,068.00	213,600
油研工業	100	1,491.00	149,100
タダノ	1,900	759.00	1,442,100
フジテック	1,400	2,200.00	3,080,000
C K D	1,100	1,889.00	2,077,900
キトー	300	1,440.00	432,000
平和	1,100	1,703.00	1,873,300
理想科学工業	300	1,220.00	366,000
S A N K Y O	900	2,747.00	2,472,300
日本金銭機械	400	540.00	216,000
マースグループホールディングス	300	1,667.00	500,100
フクシマガリレイ	200	4,255.00	851,000
オーイズミ	100	378.00	37,800
ダイコク電機	200	952.00	190,400
竹内製作所	700	2,401.00	1,680,700
アマノ	1,000	2,564.00	2,564,000
J U K I	500	452.00	226,000
サンデンホールディングス	500	350.00	175,000
蛇の目マシン工業	300	692.00	207,600
マックス	600	1,485.00	891,000
グローリー	1,000	2,322.00	2,322,000
新晃工業	400	1,597.00	638,800
大和冷機工業	600	950.00	570,000
セガサミーホールディングス	3,900	1,481.00	5,775,900
日本ピストンリング	100	1,027.00	102,700
リケン	200	2,531.00	506,200
T P R	500	1,332.00	666,000
ツバキ・ナカシマ	700	835.00	584,500
ホシザキ	1,200	9,660.00	11,592,000

大豊工業	300	595.00	178,500
日本精工	7,400	859.00	6,356,600
NTN	9,100	211.00	1,920,100
ジェイテクト	3,800	866.00	3,290,800
不二越	400	4,300.00	1,720,000
日本トムソン	1,200	365.00	438,000
THK	2,500	2,933.00	7,332,500
ユーシン精機	300	730.00	219,000
前澤給装工業	100	2,245.00	224,500
イーグル工業	500	887.00	443,500
前澤工業	200	480.00	96,000
日本ピラー工業	400	1,550.00	620,000
キッツ	1,600	577.00	923,200
マキタ	5,200	5,330.00	27,716,000
日立造船	3,100	423.00	1,311,300
三菱重工業	6,700	2,320.50	15,547,350
IHI	2,800	1,347.00	3,771,600
スター精密	600	1,471.00	882,600
日清紡ホールディングス	2,400	725.00	1,740,000
イビデン	2,500	4,440.00	11,100,000
コニカミノルタ	8,800	274.00	2,411,200
ブラザー工業	4,900	1,704.00	8,349,600
ミネベアミツミ	7,400	1,875.00	13,875,000
日立製作所	19,100	3,591.00	68,588,100
三菱電機	39,800	1,360.00	54,128,000
富士電機	2,400	3,465.00	8,316,000
東洋電機製造	100	1,132.00	113,200
安川電機	4,300	4,330.00	18,619,000
シンフォニアテクノロジー	500	1,244.00	622,000
明電舎	700	1,687.00	1,180,900
オリジン	100	1,372.00	137,200
山洋電気	200	4,770.00	954,000
デンヨー	300	2,445.00	733,500
東芝テック	500	4,305.00	2,152,500
芝浦メカトロニクス	100	3,555.00	355,500
マブチモーター	1,100	4,370.00	4,807,000
日本電産	9,600	11,450.00	109,920,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	300.00	60,000
トレックス・セミコンダクター	200	1,407.00	281,400
東光高岳	200	1,181.00	236,200
宮越ホールディングス	100	701.00	70,100
ダイヘン	400	4,425.00	1,770,000

ヤーマン	700	1,674.00	1,171,800	
JVCケンウッド	3,200	152.00	486,400	
ミマキエンジニアリング	400	473.00	189,200	
I-PEX	200	1,914.00	382,800	
日新電機	1,000	1,127.00	1,127,000	
大崎電気工業	800	590.00	472,000	
オムロン	3,600	8,180.00	29,448,000	
日東工業	600	2,058.00	1,234,800	
I D E C	600	1,932.00	1,159,200	
正興電機製作所	100	1,739.00	173,900	
不二電機工業	100	1,306.00	130,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,300	1,964.00	2,553,200	
サクサホールディングス	100	1,438.00	143,800	
メルコホールディングス	100	2,954.00	295,400	
テクノメディカ	100	1,601.00	160,100	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	100	826.00	82,600	
日本電気	4,800	5,760.00	27,648,000	
富士通	3,800	13,610.00	51,718,000	
沖電気工業	1,600	960.00	1,536,000	
岩崎通信機	200	850.00	170,000	
電気興業	200	2,747.00	549,400	
サンケン電気	500	3,630.00	1,815,000	
ナカヨ	100	1,444.00	144,400	
アイホン	200	1,534.00	306,800	
ルネサスエレクトロニクス	17,100	937.00	16,022,700	
セイコーエプソン	5,000	1,304.00	6,520,000	
ワコム	2,700	781.00	2,108,700	
アルバック	700	4,125.00	2,887,500	
アクセル	200	938.00	187,600	
E I Z O	300	3,655.00	1,096,500	
日本信号	1,000	938.00	938,000	
京三製作所	900	438.00	394,200	
能美防災	500	2,470.00	1,235,000	
ホーチキ	300	1,288.00	386,400	
星和電機	100	637.00	63,700	
エレコム	500	5,100.00	2,550,000	
パナソニック	45,500	1,018.00	46,319,000	
シャープ	4,600	1,176.00	5,409,600	
アンリツ	2,600	2,342.00	6,089,200	
富士通ゼネラル	1,100	3,295.00	3,624,500	
ソニー	24,900	9,220.00	229,578,000	代用有価証券 2,000株

T D K	1,900	13,320.00	25,308,000
帝国通信工業	200	1,175.00	235,000
タムラ製作所	1,400	523.00	732,200
アルプスアルパイン	3,600	1,445.00	5,202,000
池上通信機	100	812.00	81,200
鈴木	200	700.00	140,000
ローランド ディー・ジー・	200	1,280.00	256,000
フォスター電機	400	1,189.00	475,600
S M K	100	2,796.00	279,600
ヨコオ	300	2,741.00	822,300
ティアック	300	120.00	36,000
ホシデン	1,100	914.00	1,005,400
ヒロセ電機	600	14,280.00	8,568,000
日本航空電子工業	900	1,458.00	1,312,200
T O A	400	896.00	358,400
マクセルホールディングス	900	1,114.00	1,002,600
古野電気	500	1,195.00	597,500
ユニデンホールディングス	100	2,002.00	200,200
スミダコーポレーション	300	1,009.00	302,700
アイコム	200	2,960.00	592,000
リオン	200	2,543.00	508,600
本多通信工業	400	469.00	187,600
船井電機	400	435.00	174,000
横河電機	3,700	1,719.00	6,360,300
新電元工業	100	2,415.00	241,500
アズビル	2,500	4,595.00	11,487,500
東亜ディーケーケー	200	847.00	169,400
日本光電工業	1,700	3,555.00	6,043,500
チノー	100	1,408.00	140,800
共和電業	500	434.00	217,000
日本電子材料	200	1,670.00	334,000
堀場製作所	800	5,580.00	4,464,000
アドバンテスト	3,000	6,610.00	19,830,000
小野測器	100	510.00	51,000
エスベック	400	1,774.00	709,600
キーエンス	3,600	52,470.00	188,892,000
日置電機	200	3,870.00	774,000
シスメックス	2,800	10,425.00	29,190,000
日本マイクロニクス	700	1,088.00	761,600
メガチップス	400	2,879.00	1,151,600
O B A R A G R O U P	200	3,810.00	762,000
原田工業	200	900.00	180,000

コーセル	500	1,046.00	523,000
イリソ電子工業	300	4,380.00	1,314,000
オブテックスグループ	700	1,707.00	1,194,900
千代田インテグレ	200	1,630.00	326,000
アイ・オー・データ機器	100	1,077.00	107,700
レーザーテック	1,800	9,950.00	17,910,000
スタンレー電気	2,800	2,988.00	8,366,400
岩崎電気	100	1,342.00	134,200
ウシオ電機	2,200	1,257.00	2,765,400
岡谷電機産業	200	365.00	73,000
ハリオス テクノ ホールディング	300	312.00	93,600
エノモト	100	1,118.00	111,800
日本セラミック	400	2,715.00	1,086,000
遠藤照明	200	570.00	114,000
古河電池	300	1,227.00	368,100
双信電機	200	412.00	82,400
山一電機	300	1,364.00	409,200
図研	300	2,946.00	883,800
日本電子	800	3,575.00	2,860,000
カシオ計算機	3,500	1,742.00	6,097,000
ファナック	3,700	22,900.00	84,730,000
日本シイエムケイ	900	437.00	393,300
エンプラス	200	2,215.00	443,000
大真空	100	2,365.00	236,500
ローム	1,700	8,410.00	14,297,000
浜松ホトニクス	2,900	5,850.00	16,965,000
三井ハイテック	400	2,279.00	911,600
新光電気工業	1,300	1,900.00	2,470,000
京セラ	5,600	5,949.00	33,314,400
太陽誘電	1,800	4,055.00	7,299,000
村田製作所	11,700	7,690.00	89,973,000
双葉電子工業	600	900.00	540,000
北陸電気工業	200	967.00	193,400
ニチコン	1,400	922.00	1,290,800
日本ケミコン	300	1,510.00	453,000
K O A	700	1,326.00	928,200
市光工業	600	463.00	277,800
小糸製作所	2,400	5,450.00	13,080,000
ミツバ	800	439.00	351,200
S C R E E Nホールディングス	700	6,020.00	4,214,000
キヤノン電子	400	1,479.00	591,600
キヤノン	19,800	1,790.00	35,442,000

リコー	10,200	637.00	6,497,400	
象印マホービン	1,100	1,943.00	2,137,300	
東京エレクトロン	2,500	29,935.00	74,837,500	
トヨタ紡織	1,200	1,482.00	1,778,400	
芦森工業	100	898.00	89,800	
ユニプレス	800	843.00	674,400	
豊田自動織機	3,200	6,800.00	21,760,000	
モリタホールディングス	700	2,010.00	1,407,000	
三櫻工業	500	627.00	313,500	
デンソー	8,700	5,013.00	43,613,100	
東海理化電機製作所	1,000	1,586.00	1,586,000	
三井E & Sホールディングス	1,400	373.00	522,200	
川崎重工業	3,100	1,408.00	4,364,800	
名村造船所	1,300	152.00	197,600	
サノヤスホールディングス	500	163.00	81,500	
日本車輛製造	100	2,408.00	240,800	
三菱ロジスネクスト	500	950.00	475,000	
近畿車輛	100	1,321.00	132,100	
日産自動車	46,800	386.50	18,088,200	
いすゞ自動車	11,500	912.00	10,488,000	
トヨタ自動車	44,300	7,173.00	317,763,900	代用有価証券 2,300株
日野自動車	4,900	878.00	4,302,200	
三菱自動車工業	14,700	188.00	2,763,600	
エフテック	300	562.00	168,600	
レシップホールディングス	100	546.00	54,600	
G M B	100	605.00	60,500	
ファルテック	100	624.00	62,400	
武蔵精密工業	900	1,289.00	1,160,100	
日産車体	800	953.00	762,400	
新明和工業	1,100	823.00	905,300	
極東開発工業	700	1,379.00	965,300	
トピー工業	300	1,111.00	333,300	
ティラド	100	1,275.00	127,500	
タチエス	700	1,106.00	774,200	
N O K	2,100	1,260.00	2,646,000	
フタバ産業	1,100	506.00	556,600	
K Y B	400	2,267.00	906,800	
大同メタル工業	800	558.00	446,400	
プレス工業	1,900	307.00	583,300	
ミクニ	500	279.00	139,500	
太平洋工業	800	1,018.00	814,400	
河西工業	500	368.00	184,000	



アイシン精機	3,300	3,135.00	10,345,500	
マツダ	11,600	579.00	6,716,400	
今仙電機製作所	400	659.00	263,600	
本田技研工業	31,300	2,833.50	88,688,550	代用有価証券 4,700株
スズキ	7,900	5,000.00	39,500,000	
S U B A R U	12,300	2,052.50	25,245,750	
安永	200	1,129.00	225,800	
ヤマハ発動機	5,600	1,561.00	8,741,600	
T B K	500	448.00	224,000	
エクセディ	600	1,324.00	794,400	
豊田合成	1,300	2,670.00	3,471,000	
愛三工業	700	471.00	329,700	
盟和産業	100	871.00	87,100	
日本プラスト	300	449.00	134,700	
ヨロズ	400	1,203.00	481,200	
エフ・シー・シー	600	2,019.00	1,211,400	
シマノ	1,500	24,665.00	36,997,500	
テイ・エス テック	900	3,060.00	2,754,000	
ジャムコ	200	577.00	115,400	
テルモ	11,200	4,199.00	47,028,800	
クリエートメディック	100	1,007.00	100,700	
日機装	1,200	1,052.00	1,262,400	
日本エム・ディ・エム	200	2,280.00	456,000	
島津製作所	4,800	3,185.00	15,288,000	
J M S	300	823.00	246,900	
長野計器	300	808.00	242,400	
ブイ・テクノロジー	200	4,915.00	983,000	
東京計器	300	904.00	271,200	
インターアクション	200	1,827.00	365,400	
オーバル	300	227.00	68,100	
東京精密	700	3,800.00	2,660,000	
マニー	1,600	2,923.00	4,676,800	
ニコン	6,100	675.00	4,117,500	
トプコン	2,000	1,201.00	2,402,000	
オリンパス	22,000	2,227.00	48,994,000	
理研計器	400	3,025.00	1,210,000	
タムロン	300	1,558.00	467,400	
H O Y A	7,900	13,050.00	103,095,000	
シード	200	635.00	127,000	
ノーリツ鋼機	300	2,047.00	614,100	
エー・アンド・デイ	300	756.00	226,800	
朝日インテック	4,500	3,435.00	15,457,500	

シチズン時計	4,600	280.00	1,288,000
リズム	100	624.00	62,400
大研医器	300	528.00	158,400
メニコン	600	7,770.00	4,662,000
松風	200	1,555.00	311,000
セイコーホールディングス	600	1,339.00	803,400
ニプロ	2,800	1,182.00	3,309,600
中本パックス	100	1,565.00	156,500
スノーピーク	200	2,040.00	408,000
パラマウントベッドホールディングス	400	4,535.00	1,814,000
トランザクション	200	960.00	192,000
粧美堂	100	352.00	35,200
ニホンフラッシュ	300	1,336.00	400,800
前田工織	400	2,925.00	1,170,000
永大産業	300	307.00	92,100
アートネイチャー	300	654.00	196,200
バンダイナムコホールディングス	4,100	8,996.00	36,883,600
アイフィスジャパン	100	759.00	75,900
共立印刷	200	128.00	25,600
SHOEI	300	3,240.00	972,000
フランスベッドホールディングス	500	903.00	451,500
パイロットコーポレーション	700	3,075.00	2,152,500
萩原工業	200	1,600.00	320,000
トッパン・フォームズ	800	1,010.00	808,000
フジシールインターナショナル	800	2,093.00	1,674,400
タカラトミー	1,700	950.00	1,615,000
廣濟堂	200	639.00	127,800
タカノ	100	610.00	61,000
プロネクサス	300	1,141.00	342,300
ホクシン	300	118.00	35,400
ウッドワン	100	1,150.00	115,000
大建工業	200	2,041.00	408,200
凸版印刷	5,500	1,401.00	7,705,500
大日本印刷	5,200	2,105.00	10,946,000
共同印刷	100	2,569.00	256,900
NISSHA	700	1,236.00	865,200
TAKARA & COMPANY	200	2,017.00	403,400
アシックス	3,400	1,646.00	5,596,400
ツツミ	100	2,263.00	226,300
小松ウオール工業	100	1,747.00	174,700
ヤマハ	2,300	5,350.00	12,305,000
河合楽器製作所	100	2,552.00	255,200

クリナップ	300	458.00	137,400
ピジョン	2,500	4,445.00	11,112,500
オリバー	100	2,420.00	242,000
キングジム	300	900.00	270,000
リンテック	900	2,322.00	2,089,800
イトーキ	500	336.00	168,000
任天堂	2,500	56,550.00	141,375,000
三菱鉛筆	600	1,459.00	875,400
タカラスタンド	800	1,479.00	1,183,200
コクヨ	1,800	1,413.00	2,543,400
ナカバヤシ	300	613.00	183,900
グローブライド	200	3,910.00	782,000
オカムラ	1,300	850.00	1,105,000
美津濃	300	1,896.00	568,800
東京電力ホールディングス	31,700	281.00	8,907,700
中部電力	12,200	1,257.00	15,335,400
関西電力	15,100	978.70	14,778,370
中国電力	5,700	1,380.00	7,866,000
北陸電力	3,600	779.00	2,804,400
東北電力	9,900	940.00	9,306,000
四国電力	3,600	774.00	2,786,400
九州電力	8,200	901.00	7,388,200
北海道電力	3,700	421.00	1,557,700
沖縄電力	800	1,594.00	1,275,200
電源開発	3,100	1,465.00	4,541,500
エフオン	200	1,021.00	204,200
イーレックス	600	1,374.00	824,400
レノバ	700	1,863.00	1,304,100
東京瓦斯	7,600	2,474.00	18,802,400
大阪瓦斯	7,700	2,039.00	15,700,300
東邦瓦斯	2,000	5,940.00	11,880,000
北海道瓦斯	200	1,547.00	309,400
広島ガス	800	379.00	303,200
西部瓦斯	400	2,787.00	1,114,800
静岡ガス	1,100	1,012.00	1,113,200
メタウォーター	400	2,518.00	1,007,200
SBSホールディングス	300	2,559.00	767,700
東武鉄道	4,100	3,190.00	13,079,000
相鉄ホールディングス	1,300	2,678.00	3,481,400
東急	10,000	1,300.00	13,000,000
京浜急行電鉄	5,100	1,566.00	7,986,600
小田急電鉄	5,900	2,784.00	16,425,600

京王電鉄	2,100	6,740.00	14,154,000
京成電鉄	2,800	3,225.00	9,030,000
富士急行	500	4,830.00	2,415,000
新京成電鉄	100	2,211.00	221,100
東日本旅客鉄道	7,000	5,529.00	38,703,000
西日本旅客鉄道	3,500	4,517.00	15,809,500
東海旅客鉄道	3,300	12,865.00	42,454,500
西武ホールディングス	5,200	1,093.00	5,683,600
鴻池運輸	600	1,129.00	677,400
西日本鉄道	1,100	3,020.00	3,322,000
ハマキョウレックス	300	3,115.00	934,500
サカイ引越センター	200	4,885.00	977,000
近鉄グループホールディングス	3,800	4,435.00	16,853,000
阪急阪神ホールディングス	5,000	3,380.00	16,900,000
南海電気鉄道	1,800	2,536.00	4,564,800
京阪ホールディングス	1,700	4,185.00	7,114,500
神戸電鉄	100	3,740.00	374,000
名古屋鉄道	3,100	2,908.00	9,014,800
山陽電気鉄道	300	2,141.00	642,300
日本通運	1,300	6,720.00	8,736,000
ヤマトホールディングス	6,600	2,688.00	17,740,800
山九	1,000	3,915.00	3,915,000
丸運	300	244.00	73,200
丸全昭和運輸	300	3,385.00	1,015,500
センコーグループホールディングス	2,100	980.00	2,058,000
トナミホールディングス	100	6,100.00	610,000
ニッコンホールディングス	1,300	2,110.00	2,743,000
福山通運	500	4,810.00	2,405,000
セイノーホールディングス	2,800	1,427.00	3,995,600
エスライン	100	998.00	99,800
神奈川中央交通	100	3,935.00	393,500
日立物流	700	3,590.00	2,513,000
丸和運輸機関	400	4,785.00	1,914,000
C & F ロジホールディングス	400	1,862.00	744,800
九州旅客鉄道	3,300	2,272.00	7,497,600
S Gホールディングス	8,000	2,747.00	21,976,000
日本郵船	3,100	2,052.00	6,361,200
商船三井	2,400	2,520.00	6,048,000
川崎汽船	1,200	1,473.00	1,767,600
N S ユナイテッド海運	200	1,439.00	287,800
明治海運	400	405.00	162,000
飯野海運	1,800	393.00	707,400

共栄タンカー	100	771.00	77,100
乾汽船	200	905.00	181,000
日本航空	6,600	1,641.00	10,830,600
ANAホールディングス	6,900	2,253.00	15,545,700
パスコ	100	1,309.00	130,900
ランコム	100	7,990.00	799,000
日新	300	1,584.00	475,200
三菱倉庫	1,200	3,100.00	3,720,000
三井倉庫ホールディングス	400	2,059.00	823,600
住友倉庫	1,400	1,369.00	1,916,600
澁澤倉庫	200	2,232.00	446,400
東陽倉庫	700	355.00	248,500
日本トランスシティ	900	549.00	494,100
ケイヒン	100	1,362.00	136,200
中央倉庫	200	1,215.00	243,000
川西倉庫	100	1,180.00	118,000
安田倉庫	300	957.00	287,100
ファイズホールディングス	100	1,146.00	114,600
東洋埠頭	100	1,460.00	146,000
宇徳	300	502.00	150,600
上組	2,100	1,940.00	4,074,000
サンリツ	100	650.00	65,000
キムラユニティー	100	1,044.00	104,400
キューソー流通システム	100	1,752.00	175,200
近鉄エクスプレス	800	2,455.00	1,964,000
東海運	300	308.00	92,400
エーアイティー	300	1,051.00	315,300
内外トランスライン	100	1,224.00	122,400
日本コンセプト	100	1,598.00	159,800
NEC ネットエスアイ	1,100	2,000.00	2,200,000
クロスキャット	100	1,403.00	140,300
システナ	1,400	2,030.00	2,842,000
デジタルアーツ	200	9,410.00	1,882,000
日鉄ソリューションズ	600	3,185.00	1,911,000
キューブシステム	200	1,540.00	308,000
エイジア	100	1,987.00	198,700
コア	200	1,388.00	277,600
ラクーンホールディングス	200	2,348.00	469,600
ソリトンシステムズ	200	2,250.00	450,000
ソフトクリエイティブホールディングス	200	4,015.00	803,000
TIS	3,900	2,218.00	8,650,200
JNSホールディングス	200	665.00	133,000

電算システム	100	3,410.00	341,000
グリー	2,500	564.00	1,410,000
コーエーテクモホールディングス	800	5,620.00	4,496,000
三菱総合研究所	200	4,220.00	844,000
ボルテージ	100	567.00	56,700
A G S	200	910.00	182,000
ファインデックス	300	1,407.00	422,100
ブレインパッド	100	4,130.00	413,000
K L a b	800	992.00	793,600
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	500	966.00	483,000
イーブックイニシアティブジャパン	100	2,986.00	298,600
ネクソン	9,800	3,055.00	29,939,000
アイスタイル	1,100	465.00	511,500
エムアップホールディングス	100	2,658.00	265,800
エイチーム	300	879.00	263,700
エニグモ	400	1,449.00	579,600
テクノスジャパン	300	780.00	234,000
コロプラ	1,300	947.00	1,231,100
ブロードリーフ	2,000	594.00	1,188,000
クロス・マーケティンググループ	200	356.00	71,200
デジタルハーツホールディングス	200	1,104.00	220,800
システム情報	300	1,282.00	384,600
メディアドゥ	100	7,530.00	753,000
じげん	1,000	338.00	338,000
ブイキューブ	200	2,652.00	530,400
エンカレッジ・テクノロジー	100	860.00	86,000
サイバーリンクス	100	4,490.00	449,000
フィックスターズ	400	1,042.00	416,800
C A R T A H O L D I N G S	200	1,443.00	288,600
オブティム	200	3,305.00	661,000
セレス	100	2,158.00	215,800
S H I F T	200	14,750.00	2,950,000
ティーガイア	400	1,902.00	760,800
セック	100	3,115.00	311,500
日本アジアグループ	400	512.00	204,800
テクマトリックス	600	2,034.00	1,220,400
プロシップ	100	1,541.00	154,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	900	2,548.00	2,293,200
G M O ペイメントゲートウェイ	800	14,460.00	11,568,000
ザッパラス	200	454.00	90,800
システムリサーチ	100	1,689.00	168,900
インターネットイニシアティブ	600	5,290.00	3,174,000

さくらインターネット	400	777.00	310,800
ヴィンクス	100	1,261.00	126,100
GMOグローバルサイン・ホールディングス	100	12,010.00	1,201,000
SRAホールディングス	200	2,520.00	504,000
システムインテグレータ	100	720.00	72,000
朝日ネット	300	978.00	293,400
eBASE	500	1,035.00	517,500
アバント	400	1,131.00	452,400
アドソル日進	100	2,819.00	281,900
フリービット	200	892.00	178,400
コムチュア	400	2,913.00	1,165,200
サイバーコム	100	1,918.00	191,800
アステリア	300	821.00	246,300
アイル	200	1,396.00	279,200
マークライnz	200	2,470.00	494,000
メディカル・データ・ビジョン	500	2,851.00	1,425,500
gumi	500	883.00	441,500
ショーケース	100	822.00	82,200
モバイルファクトリー	100	1,029.00	102,900
テラスカイ	100	4,825.00	482,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	200	1,408.00	281,600
PCIホールディングス	200	1,154.00	230,800
パイプドHD	100	1,760.00	176,000
アイビーシー	100	1,093.00	109,300
ネオジャパン	100	2,559.00	255,900
ランドコンピュータ	100	1,141.00	114,100
ダブルスタンダード	100	4,900.00	490,000
オープンドア	200	1,084.00	216,800
マイネット	100	1,225.00	122,500
アカツキ	100	5,150.00	515,000
Ubicomホールディングス	100	2,947.00	294,700
LINE	900	5,390.00	4,851,000
カナミックネットワーク	400	887.00	354,800
ノムラシステムコーポレーション	200	435.00	87,000
チェンジ	200	9,410.00	1,882,000
シンクロ・フード	200	300.00	60,000
オークネット	200	1,442.00	288,400
エイトレッド	100	2,764.00	276,400
AOI TYO Holdings	400	406.00	162,400
マクロミル	800	673.00	538,400
ビーグリー	100	2,200.00	220,000
オロ	100	3,680.00	368,000

テモナ	100	1,328.00	132,800
ニーズウェル	100	870.00	87,000
サインポスト	100	942.00	94,200
ソルクシーズ	200	1,112.00	222,400
フェイス	100	995.00	99,500
プロトコーポレーション	400	1,119.00	447,600
野村総合研究所	5,500	3,425.00	18,837,500
サイバネットシステム	300	888.00	266,400
C Eホールディングス	200	627.00	125,400
日本システム技術	100	1,783.00	178,300
インテージホールディングス	500	1,070.00	535,000
東邦システムサイエンス	100	917.00	91,700
ソースネクスト	1,900	306.00	581,400
インフォコム	400	4,080.00	1,632,000
HEROZ	100	3,075.00	307,500
ラクスル	300	5,470.00	1,641,000
F I G	500	268.00	134,000
システムサポート	100	1,608.00	160,800
イーソル	200	1,270.00	254,000
アルテリア・ネットワークス	400	1,763.00	705,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,500.00	150,000
フォーカスシステムズ	300	947.00	284,100
クレスコ	300	1,340.00	402,000
フジ・メディア・ホールディングス	3,800	1,025.00	3,895,000
オービック	1,400	20,750.00	29,050,000
ジャストシステム	600	7,660.00	4,596,000
T D Cソフト	400	1,083.00	433,200
Zホールディングス	53,500	663.50	35,497,250
トレンドマイクロ	2,100	6,200.00	13,020,000
I Dホールディングス	200	1,361.00	272,200
日本オラクル	800	11,540.00	9,232,000
アルファシステムズ	100	3,335.00	333,500
フューチャー	500	1,800.00	900,000
C A C Holdings	300	1,369.00	410,700
S Bテクノロジー	100	3,950.00	395,000
トーセ	100	881.00	88,100
オービックビジネスコンサルタント	400	6,210.00	2,484,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,800	3,870.00	6,966,000
アイティフォー	500	933.00	466,500
東計電算	100	4,440.00	444,000
エクスネット	100	1,048.00	104,800
大塚商会	2,100	5,230.00	10,983,000



サイボウズ	500	3,250.00	1,625,000
ソフトブレーン	200	866.00	173,200
電通国際情報サービス	200	5,710.00	1,142,000
A C C E S S	400	797.00	318,800
デジタルガレージ	700	3,970.00	2,779,000
E Mシステムズ	600	816.00	489,600
ウェザーニューズ	100	5,650.00	565,000
C I J	300	1,015.00	304,500
日本エンタープライズ	400	239.00	95,600
WOWOW	200	2,930.00	586,000
スカラ	300	946.00	283,800
インテリジェント ウェイブ	200	743.00	148,600
I M A G I C A G R O U P	400	401.00	160,400
ネットワンシステムズ	1,500	3,790.00	5,685,000
システムソフト	900	96.00	86,400
アルゴグラフィックス	300	3,400.00	1,020,000
マーベラス	600	761.00	456,600
エイベックス	700	985.00	689,500
日本ユニシス	1,200	3,665.00	4,398,000
兼松エレクトロニクス	200	4,575.00	915,000
都築電気	100	1,548.00	154,800
T B S ホールディングス	2,400	1,653.00	3,967,200
日本テレビホールディングス	3,300	1,111.00	3,666,300
朝日放送グループホールディングス	400	694.00	277,600
テレビ朝日ホールディングス	1,100	1,609.00	1,769,900
スカパー J S A T ホールディングス	2,600	465.00	1,209,000
テレビ東京ホールディングス	300	2,453.00	735,900
日本 B S 放送	100	1,080.00	108,000
ビジョン	400	989.00	395,600
スマートバリュー	100	1,213.00	121,300
U S E N - N E X T H O L D I N G S	200	1,398.00	279,600
コネクシオ	200	1,238.00	247,600
クロップス	100	820.00	82,000
日本電信電話	52,100	2,406.00	125,352,600
K D D I	28,400	3,028.00	85,995,200
ソフトバンク	35,400	1,237.00	43,789,800
光通信	400	25,850.00	10,340,000
N T T ドコモ	27,900	3,890.00	108,531,000
エムティーアイ	400	903.00	361,200
G M O インターネット	1,400	3,040.00	4,256,000
ファイバーゲート	100	2,020.00	202,000
アйдママーケティングコミュニケーション	100	396.00	39,600

KADOKAWA	1,100	3,350.00	3,685,000
学研ホールディングス	500	1,446.00	723,000
ゼンリン	800	1,263.00	1,010,400
昭文社ホールディングス	200	460.00	92,000
インプレスホールディングス	400	179.00	71,600
アイネット	200	1,464.00	292,800
松竹	300	13,120.00	3,936,000
東宝	2,300	4,275.00	9,832,500
東映	100	17,200.00	1,720,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,400	1,364.00	14,185,600
ピー・シー・エー	100	4,750.00	475,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,513.00	302,600
D T S	900	2,298.00	2,068,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,700	5,560.00	9,452,000
シーイーシー	400	1,556.00	622,400
カプコン	1,800	5,960.00	10,728,000
アイ・エス・ビー	100	2,776.00	277,600
ジャステック	300	1,535.00	460,500
S C S K	900	5,780.00	5,202,000
日本システムウエア	100	2,134.00	213,400
アイネス	400	1,545.00	618,000
T K C	300	7,040.00	2,112,000
富士ソフト	400	6,140.00	2,456,000
N S D	1,300	2,023.00	2,629,900
コナミホールディングス	1,400	5,070.00	7,098,000
福井コンピュータホールディングス	200	3,700.00	740,000
J B C Cホールディングス	300	1,611.00	483,300
ミロク情報サービス	400	2,294.00	917,600
ソフトバンクグループ	30,900	7,083.00	218,864,700
高千穂交易	200	960.00	192,000
カワニシホールディングス	100	1,386.00	138,600
伊藤忠食品	100	5,410.00	541,000
エレマテック	400	1,054.00	421,600
J A L U X	100	1,387.00	138,700
あらた	300	5,060.00	1,518,000
トーメンデバイス	100	3,715.00	371,500
東京エレクトロン デバイス	100	3,260.00	326,000
フィールズ	300	328.00	98,400
双日	21,500	231.00	4,966,500
アルフレッサ ホールディングス	4,300	2,008.00	8,634,400
横浜冷凍	1,000	877.00	877,000
神栄	100	617.00	61,700

ラサ商事	200	909.00	181,800
アルコニックス	400	1,446.00	578,400
神戸物産	2,800	3,060.00	8,568,000
ハイパー	100	572.00	57,200
あい ホールディングス	600	1,922.00	1,153,200
ディーブイエックス	200	1,059.00	211,800
ダイワボウホールディングス	300	6,580.00	1,974,000
マクニカ・富士エレホールディングス	900	2,056.00	1,850,400
ラクト・ジャパン	200	3,155.00	631,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	700	936.00	655,200
八洲電機	300	955.00	286,500
メディアスホールディングス	200	884.00	176,800
レスターホールディングス	400	2,360.00	944,000
ジューテックホールディングス	100	993.00	99,300
大光	200	708.00	141,600
OCHIホールディングス	100	1,502.00	150,200
TOKAIホールディングス	2,100	1,075.00	2,257,500
黒谷	100	573.00	57,300
Cominix	100	712.00	71,200
三洋貿易	400	974.00	389,600
ビューティガレージ	100	2,882.00	288,200
ウイン・パートナーズ	300	1,121.00	336,300
ミタチ産業	100	622.00	62,200
シップヘルスケアホールディングス	600	5,330.00	3,198,000
明治電機工業	100	1,339.00	133,900
デリカフーズホールディングス	100	605.00	60,500
スターティアホールディングス	100	712.00	71,200
コメダホールディングス	900	1,905.00	1,714,500
富士興産	100	918.00	91,800
小野建	400	1,266.00	506,400
南陽	100	1,757.00	175,700
佐島電機	300	821.00	246,300
エコートレーディング	100	616.00	61,600
伯東	200	1,166.00	233,200
コンドーテック	300	1,070.00	321,000
中山福	200	500.00	100,000
ナガイレーベン	500	2,771.00	1,385,500
三菱食品	400	2,843.00	1,137,200
松田産業	300	1,571.00	471,300
第一興商	600	3,660.00	2,196,000
メディバルホールディングス	4,200	1,850.00	7,770,000
SPK	200	1,305.00	261,000

萩原電気ホールディングス	200	2,314.00	462,800
アズワン	300	16,420.00	4,926,000
スズデン	100	1,158.00	115,800
尾家産業	100	1,394.00	139,400
シモジマ	300	1,338.00	401,400
ドウシシャ	400	1,919.00	767,600
小津産業	100	1,856.00	185,600
高速	200	1,583.00	316,600
たけびし	100	1,454.00	145,400
リックス	100	1,690.00	169,000
丸文	300	485.00	145,500
ハピネット	300	1,499.00	449,700
橋本総業ホールディングス	100	2,349.00	234,900
日本ライフライン	1,200	1,410.00	1,692,000
タカショー	300	702.00	210,600
マルカ	100	2,234.00	223,400
I D O M	1,000	566.00	566,000
進和	200	2,042.00	408,400
エスケイジャパン	100	573.00	57,300
ダイトロン	200	1,488.00	297,600
シークス	500	1,339.00	669,500
田中商事	100	703.00	70,300
オーハシテクニカ	200	1,456.00	291,200
白銅	200	1,311.00	262,200
伊藤忠商事	26,700	2,605.00	69,553,500
丸紅	40,700	582.80	23,719,960
高島	100	1,845.00	184,500
長瀬産業	2,200	1,408.00	3,097,600
蝶理	300	1,703.00	510,900
豊田通商	4,400	3,250.00	14,300,000
三共生興	600	447.00	268,200
兼松	1,500	1,299.00	1,948,500
ツカモトコーポレーション	100	1,214.00	121,400
三井物産	33,900	1,723.00	58,409,700
日本紙パルプ商事	200	3,830.00	766,000
カメイ	500	1,130.00	565,000
東都水産	100	4,165.00	416,500
O U Gホールディングス	100	2,862.00	286,200
スターゼン	100	4,250.00	425,000
山善	1,500	1,076.00	1,614,000
椿本興業	100	3,770.00	377,000
住友商事	24,700	1,250.00	30,875,000

内田洋行	200	5,460.00	1,092,000
三菱商事	25,700	2,414.00	62,039,800
第一実業	200	3,970.00	794,000
キャノンマーケティングジャパン	1,000	2,260.00	2,260,000
西華産業	200	1,231.00	246,200
佐藤商事	300	1,025.00	307,500
菱洋エレクトロ	400	3,000.00	1,200,000
東京産業	400	553.00	221,200
ユアサ商事	400	3,125.00	1,250,000
神鋼商事	100	1,853.00	185,300
トルク	300	292.00	87,600
阪和興業	700	2,462.00	1,723,400
正栄食品工業	300	3,885.00	1,165,500
カナデン	300	1,324.00	397,200
菱電商事	300	1,597.00	479,100
フルサト工業	200	1,379.00	275,800
岩谷産業	900	4,840.00	4,356,000
ナイス	200	1,416.00	283,200
昭光通商	100	609.00	60,900
ニチモウ	100	1,844.00	184,400
極東貿易	100	1,503.00	150,300
イワキ	500	536.00	268,000
三愛石油	1,000	1,107.00	1,107,000
稲畑産業	900	1,372.00	1,234,800
G S Iクレオス	100	1,962.00	196,200
明和産業	400	423.00	169,200
クワザワホールディングス	100	572.00	57,200
ヤマエ久野	300	1,249.00	374,700
ワキタ	800	1,141.00	912,800
東邦ホールディングス	1,300	1,989.00	2,585,700
サンゲツ	1,100	1,590.00	1,749,000
ミツウロコグループホールディングス	600	1,226.00	735,600
シナネンホールディングス	200	3,110.00	622,000
伊藤忠エネクス	900	975.00	877,500
サンリオ	1,100	1,853.00	2,038,300
サンワテクノス	300	950.00	285,000
リョーサン	400	2,010.00	804,000
新光商事	600	889.00	533,400
トーホー	200	1,940.00	388,000
三信電気	200	2,147.00	429,400
東陽テクニカ	400	1,110.00	444,000
モスフードサービス	500	2,845.00	1,422,500

加賀電子	400	2,043.00	817,200
ソーダニッカ	400	575.00	230,000
立花エレテック	300	1,762.00	528,600
フォーバル	200	947.00	189,400
PALTAC	600	5,600.00	3,360,000
三谷産業	600	448.00	268,800
太平洋興発	200	611.00	122,200
西本Wismettacホールディングス	100	1,866.00	186,600
国際紙パルプ商事	900	258.00	232,200
ヤマタネ	200	1,404.00	280,800
日鉄物産	300	3,110.00	933,000
泉州電業	100	2,998.00	299,800
トラスコ中山	900	2,847.00	2,562,300
オートボックスセブン	1,400	1,345.00	1,883,000
モリト	300	622.00	186,600
加藤産業	600	3,560.00	2,136,000
北恵	100	996.00	99,600
イノテック	200	1,029.00	205,800
イエローハット	700	1,647.00	1,152,900
J Kホールディングス	400	830.00	332,000
日伝	400	2,382.00	952,800
北沢産業	300	291.00	87,300
杉本商事	200	2,188.00	437,600
因幡電機産業	1,100	2,623.00	2,885,300
東テク	100	2,568.00	256,800
ミスミグループ本社	4,900	3,360.00	16,464,000
アルテック	300	303.00	90,900
タキヒヨー	100	1,795.00	179,500
蔵王産業	100	1,335.00	133,500
スズケン	1,700	3,770.00	6,409,000
ジェコス	300	962.00	288,600
グローセル	400	413.00	165,200
ローソン	1,000	4,905.00	4,905,000
サンエー	300	4,350.00	1,305,000
カワチ薬品	300	3,170.00	951,000
エービーシー・マート	600	5,820.00	3,492,000
ハードオフコーポレーション	200	669.00	133,800
アスクル	400	4,220.00	1,688,000
ゲオホールディングス	700	1,596.00	1,117,200
アダストリア	600	1,694.00	1,016,400
ジーフット	200	439.00	87,800
シー・ヴィ・エス・バイエリア	100	430.00	43,000

くら寿司	200	6,380.00	1,276,000
キャンドウ	200	1,952.00	390,400
パルグループホールディングス	400	1,170.00	468,000
エディオン	1,800	1,013.00	1,823,400
サーラコーポレーション	800	597.00	477,600
ワッツ	200	806.00	161,200
ハローズ	100	3,440.00	344,000
フジオフードグループ本社	300	1,428.00	428,400
あみやき亭	100	2,913.00	291,300
ひらまつ	800	196.00	156,800
大黒天物産	100	5,930.00	593,000
ハニーズホールディングス	400	979.00	391,600
ファーマライズホールディングス	100	769.00	76,900
アルペン	300	2,538.00	761,400
ハブ	100	595.00	59,500
クオールホールディングス	600	1,127.00	676,200
ジinzホールディングス	200	7,950.00	1,590,000
ビックカメラ	2,300	1,167.00	2,684,100
D C Mホールディングス	2,200	1,296.00	2,851,200
Monotaro	2,800	6,120.00	17,136,000
東京一番フーズ	100	577.00	57,700
きちりホールディングス	100	658.00	65,800
アークランドサービスホールディングス	300	2,081.00	624,300
J.フロント リテイリング	4,700	802.00	3,769,400
ドトール・日レスホールディングス	600	1,452.00	871,200
マツモトキヨシホールディングス	1,600	4,185.00	6,696,000
ブロンコビリー	200	2,333.00	466,600
Z O Z O	2,700	2,964.00	8,002,800
トレジャー・ファクトリー	100	712.00	71,200
物語コーポレーション	100	11,290.00	1,129,000
ココカラファイン	400	6,920.00	2,768,000
三越伊勢丹ホールディングス	6,900	508.00	3,505,200
Hamee	100	1,820.00	182,000
ウエルシアホールディングス	2,300	4,395.00	10,108,500
クリエイティブSDホールディングス	700	3,685.00	2,579,500
丸善CHIホールディングス	500	370.00	185,000
ミサワ	100	777.00	77,700
ティーライフ	100	1,172.00	117,200
チムニー	100	1,218.00	121,800
シュッピン	300	905.00	271,500
オイシックス・ラ・大地	400	3,720.00	1,488,000
ネクステージ	600	1,243.00	745,800

ジョイフル本田	1,200	1,619.00	1,942,800
鳥貴族	100	1,559.00	155,900
キリン堂ホールディングス	200	3,490.00	698,000
ホットランド	300	1,224.00	367,200
すかいらーくホールディングス	4,400	1,537.00	6,762,800
SFPホールディングス	200	1,277.00	255,400
綿半ホールディングス	200	1,357.00	271,400
ヨシックス	100	1,687.00	168,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,200	1,143.00	1,371,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	905.00	181,000
B E E N O S	200	2,393.00	478,600
あさひ	300	1,651.00	495,300
日本調剤	200	1,687.00	337,400
コスモス薬品	300	18,690.00	5,607,000
トーエル	200	799.00	159,800
オンリー	100	484.00	48,400
セブン&アイ・ホールディングス	15,300	3,143.00	48,087,900
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2,100	553.00	1,161,300
ツルハホールディングス	900	15,280.00	13,752,000
サンマルクホールディングス	300	1,478.00	443,400
フェリシモ	100	1,356.00	135,600
トリドールホールディングス	1,000	1,367.00	1,367,000
T O K Y O B A S E	400	440.00	176,000
ウイルプラスホールディングス	100	582.00	58,200
J Mホールディングス	300	2,447.00	734,100
サツドラホールディングス	100	2,010.00	201,000
アレンザホールディングス	200	1,408.00	281,600
串カツ田中ホールディングス	100	1,779.00	177,900
パロックジャパンリミテッド	300	673.00	201,900
クスリのアオキホールディングス	400	8,850.00	3,540,000
力の源ホールディングス	200	607.00	121,400
スシローグローバルホールディングス	2,100	3,365.00	7,066,500
メディカルシステムネットワーク	400	524.00	209,600
はるやまホールディングス	200	687.00	137,400
ノジマ	700	3,090.00	2,163,000
カッパ・クリエイト	600	1,470.00	882,000
ライトオン	300	646.00	193,800
ジーンズメイト	200	310.00	62,000
良品計画	5,200	2,240.00	11,648,000
三城ホールディングス	400	282.00	112,800
アドヴァン	600	1,377.00	826,200



アルビス	200	2,657.00	531,400
コナカ	500	231.00	115,500
G - 7ホールディングス	200	2,335.00	467,000
イオン北海道	500	897.00	448,500
コジマ	700	695.00	486,500
ヒマラヤ	100	897.00	89,700
コーナン商事	600	3,615.00	2,169,000
エコス	100	2,386.00	238,600
ワタミ	500	967.00	483,500
マルシェ	100	543.00	54,300
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	8,600	2,388.00	20,536,800
西松屋チェーン	900	1,704.00	1,533,600
ゼンショーホールディングス	1,900	2,539.00	4,824,100
幸楽苑ホールディングス	300	1,795.00	538,500
ハークスレイ	100	909.00	90,900
サイゼリヤ	600	1,817.00	1,090,200
V Tホールディングス	1,600	376.00	601,600
魚力	100	1,753.00	175,300
フジ・コーポレーション	100	2,225.00	222,500
ユナイテッドアローズ	400	1,372.00	548,800
ハイデイ日高	600	1,687.00	1,012,200
京都きもの友禅	300	231.00	69,300
コロワイド	1,300	1,622.00	2,108,600
ピーシーデポコーポレーション	500	679.00	339,500
壱番屋	300	5,380.00	1,614,000
トップカルチャー	100	364.00	36,400
P L A N T	100	781.00	78,100
スギホールディングス	800	7,290.00	5,832,000
薬王堂ホールディングス	200	2,607.00	521,400
スクロール	600	725.00	435,000
ヨンドシーホールディングス	400	1,862.00	744,800
木曽路	500	2,485.00	1,242,500
S R S ホールディングス	500	906.00	453,000
千趣会	700	324.00	226,800
タカキュー	400	139.00	55,600
リテールパートナーズ	500	1,447.00	723,500
ケーヨー	800	781.00	624,800
上新電機	500	2,612.00	1,306,000
日本瓦斯	600	5,150.00	3,090,000
ロイヤルホールディングス	700	1,847.00	1,292,900
いなげや	500	1,871.00	935,500
島忠	700	5,500.00	3,850,000

チヨダ	400	953.00	381,200
ライフコーポレーション	300	3,660.00	1,098,000
リンガーハット	500	2,232.00	1,116,000
MrMaxHD	600	821.00	492,600
テンアライド	400	352.00	140,800
AOKIホールディングス	800	413.00	330,400
オークワ	600	1,414.00	848,400
コメリ	600	3,070.00	1,842,000
青山商事	800	488.00	390,400
しまむら	500	11,380.00	5,690,000
はせがわ	200	285.00	57,000
高島屋	2,900	796.00	2,308,400
松屋	800	720.00	576,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,900	608.00	1,155,200
近鉄百貨店	200	3,305.00	661,000
丸井グループ	3,600	1,946.00	7,005,600
アクシアル リテイリング	300	4,730.00	1,419,000
井筒屋	200	182.00	36,400
イオン	15,100	2,842.00	42,914,200
イズミ	800	3,475.00	2,780,000
平和堂	800	2,141.00	1,712,800
フジ	500	2,000.00	1,000,000
ヤオコー	400	7,630.00	3,052,000
ゼビオホールディングス	500	728.00	364,000
ケーズホールディングス	3,800	1,319.00	5,012,200
Olympicグループ	200	970.00	194,000
日産東京販売ホールディングス	600	251.00	150,600
シルバーライフ	100	2,055.00	205,500
Genky DrugStores	200	4,370.00	874,000
ナルミヤ・インターナショナル	100	810.00	81,000
ブックオフグループホールディングス	200	875.00	175,000
アインホールディングス	500	7,730.00	3,865,000
元気寿司	100	2,318.00	231,800
ヤマダホールディングス	11,900	507.00	6,033,300
アークランドサカモト	600	1,991.00	1,194,600
ニトリホールディングス	1,700	22,380.00	38,046,000
グルメ杵屋	300	976.00	292,800
愛眼	300	226.00	67,800
ケーユーホールディングス	200	791.00	158,200
吉野家ホールディングス	1,300	1,959.00	2,546,700
松屋フーズホールディングス	200	3,465.00	693,000
サガミホールディングス	500	1,304.00	652,000

関西スーパーマーケット	300	1,254.00	376,200	
王将フードサービス	300	6,050.00	1,815,000	
プレナス	500	1,720.00	860,000	
ミニストップ	300	1,376.00	412,800	
アークス	800	2,250.00	1,800,000	
パローホールディングス	900	2,617.00	2,355,300	
藤久	100	1,043.00	104,300	
ベルク	200	6,610.00	1,322,000	
大庄	200	1,089.00	217,800	
ファーストリテイリング	500	78,310.00	39,155,000	
サンドラッグ	1,500	4,185.00	6,277,500	
サクスパー ホールディングス	400	537.00	214,800	
ヤマザワ	100	1,745.00	174,500	
やまや	100	2,196.00	219,600	
ペルーナ	900	873.00	785,700	
島根銀行	100	605.00	60,500	
じもとホールディングス	200	1,032.00	206,400	
めぶきフィナンシャルグループ	20,200	214.00	4,322,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	500	1,157.00	578,500	
九州フィナンシャルグループ	8,500	521.00	4,428,500	
ゆうちょ銀行	11,100	864.00	9,590,400	
富山第一銀行	900	293.00	263,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	22,400	362.00	8,108,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	2,600	721.00	1,874,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	2,300	405.00	931,500	
三十三フィナンシャルグループ	400	1,381.00	552,400	
第四北越フィナンシャルグループ	700	2,048.00	1,433,600	
ひろぎんホールディングス	5,800	585.00	3,393,000	
新生銀行	2,900	1,342.00	3,891,800	
あおぞら銀行	2,300	1,756.00	4,038,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	268,100	428.00	114,746,800	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	42,600	352.70	15,025,020	
三井住友トラスト・ホールディングス	7,500	2,865.50	21,491,250	
三井住友フィナンシャルグループ	27,100	2,956.00	80,107,600	代用有価証券 3,500株
千葉銀行	13,000	567.00	7,371,000	
群馬銀行	7,500	339.00	2,542,500	
武蔵野銀行	600	1,553.00	931,800	
千葉興業銀行	1,100	247.00	271,700	
筑波銀行	1,600	187.00	299,200	
七十七銀行	1,300	1,515.00	1,969,500	
青森銀行	300	2,373.00	711,900	

秋田銀行	300	1,516.00	454,800
山形銀行	400	1,317.00	526,800
岩手銀行	300	2,430.00	729,000
東邦銀行	3,500	235.00	822,500
東北銀行	200	1,088.00	217,600
みちのく銀行	300	1,170.00	351,000
ふくおかフィナンシャルグループ	3,300	1,844.00	6,085,200
静岡銀行	9,500	726.00	6,897,000
十六銀行	500	1,973.00	986,500
スルガ銀行	4,000	353.00	1,412,000
八十二銀行	9,400	392.00	3,684,800
山梨中央銀行	500	894.00	447,000
大垣共立銀行	800	2,455.00	1,964,000
福井銀行	300	1,979.00	593,700
北國銀行	400	2,910.00	1,164,000
清水銀行	200	1,809.00	361,800
富山銀行	100	3,330.00	333,000
滋賀銀行	800	2,355.00	1,884,000
南都銀行	700	1,929.00	1,350,300
百五銀行	3,600	328.00	1,180,800
京都銀行	1,400	4,910.00	6,874,000
紀陽銀行	1,400	1,688.00	2,363,200
ほくほくフィナンシャルグループ	2,600	1,016.00	2,641,600
山陰合同銀行	2,300	554.00	1,274,200
中国銀行	3,400	950.00	3,230,000
鳥取銀行	100	1,150.00	115,000
伊予銀行	5,600	675.00	3,780,000
百十四銀行	400	1,700.00	680,000
四国銀行	600	765.00	459,000
阿波銀行	600	2,667.00	1,600,200
大分銀行	200	2,536.00	507,200
宮崎銀行	300	2,383.00	714,900
佐賀銀行	200	1,370.00	274,000
沖縄銀行	400	3,070.00	1,228,000
琉球銀行	900	891.00	801,900
セブン銀行	13,100	248.00	3,248,800
みずほフィナンシャルグループ	53,200	1,346.00	71,607,200
高知銀行	100	754.00	75,400
山口フィナンシャルグループ	4,900	715.00	3,503,500
長野銀行	100	1,449.00	144,900
名古屋銀行	300	2,774.00	832,200
北洋銀行	5,900	227.00	1,339,300

愛知銀行	100	3,080.00	308,000
中京銀行	200	2,165.00	433,000
大光銀行	100	1,400.00	140,000
愛媛銀行	600	1,158.00	694,800
トマト銀行	100	1,085.00	108,500
京葉銀行	1,700	494.00	839,800
栃木銀行	1,900	186.00	353,400
北日本銀行	100	1,985.00	198,500
東和銀行	700	708.00	495,600
福島銀行	300	230.00	69,000
大東銀行	200	625.00	125,000
トモニホールディングス	3,100	331.00	1,026,100
フィデアホールディングス	3,800	107.00	406,600
池田泉州ホールディングス	4,600	159.00	731,400
F P G	1,200	466.00	559,200
マーキュリアインベストメント	200	645.00	129,000
S B Iホールディングス	4,400	2,665.00	11,726,000
日本アジア投資	300	222.00	66,600
ジャフコ グループ	600	4,785.00	2,871,000
大和証券グループ本社	31,500	437.30	13,774,950
野村ホールディングス	69,000	500.40	34,527,600
岡三証券グループ	3,400	347.00	1,179,800
丸三証券	1,200	481.00	577,200
東洋証券	1,500	120.00	180,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,600	289.00	1,329,400
光世証券	100	668.00	66,800
水戸証券	1,100	218.00	239,800
いちよし証券	700	424.00	296,800
松井証券	2,300	866.00	1,991,800
マネックスグループ	3,000	271.00	813,000
極東証券	500	708.00	354,000
岩井コスモホールディングス	400	1,294.00	517,600
藍澤証券	700	705.00	493,500
マネーパートナーズグループ	400	203.00	81,200
スパークス・グループ	1,900	244.00	463,600
小林洋行	100	268.00	26,800
かんぽ生命保険	1,400	1,690.00	2,366,000
S O M P Oホールディングス	7,400	4,007.00	29,651,800
アニコム ホールディングス	1,200	1,252.00	1,502,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	10,200	2,974.00	30,334,800
第一生命ホールディングス	22,100	1,598.00	35,315,800
東京海上ホールディングス	13,800	4,896.00	67,564,800

T & Dホールディングス	11,700	1,069.00	12,507,300
アドバンスクリエイト	100	1,991.00	199,100
全国保証	1,100	4,535.00	4,988,500
ジェイリース	100	768.00	76,800
イントラスト	200	906.00	181,200
日本モーゲージサービス	200	1,088.00	217,600
C a s a	100	1,278.00	127,800
アルヒ	600	2,128.00	1,276,800
プレミアグループ	200	2,048.00	409,600
クレディセゾン	2,800	1,213.00	3,396,400
芙蓉総合リース	400	6,140.00	2,456,000
みずほリース	600	2,648.00	1,588,800
東京センチュリー	800	5,690.00	4,552,000
日本証券金融	1,800	514.00	925,200
アイフル	6,000	309.00	1,854,000
リコーリース	300	2,944.00	883,200
イオンフィナンシャルサービス	2,400	1,116.00	2,678,400
アコム	7,900	486.00	3,839,400
ジャックス	500	1,837.00	918,500
オリエントコーポレーション	10,700	113.00	1,209,100
日立キャピタル	900	2,267.00	2,040,300
オリックス	24,300	1,375.50	33,424,650
三菱UFJリース	9,900	454.00	4,494,600
九州リースサービス	200	619.00	123,800
日本取引所グループ	11,300	2,523.00	28,509,900
イー・ギャランティ	400	2,179.00	871,600
アサックス	200	751.00	150,200
NECキャピタルソリューション	200	1,805.00	361,000
いちご	5,000	317.00	1,585,000
日本駐車場開発	4,000	131.00	524,000
スター・マイカ・ホールディングス	200	1,534.00	306,800
ADワークスグループ	800	155.00	124,000
ヒューリック	8,300	1,024.00	8,499,200
三栄建築設計	200	1,882.00	376,400
野村不動産ホールディングス	2,400	1,920.00	4,608,000
三重交通グループホールディングス	800	500.00	400,000
サムティ	600	1,766.00	1,059,600
ディア・ライフ	600	395.00	237,000
コーセーアールイー	100	551.00	55,100
日本商業開発	300	1,786.00	535,800
プレサンスコーポレーション	700	1,556.00	1,089,200
THEグローバル社	200	209.00	41,800

ハウスコム	100	1,295.00	129,500
日本管理センター	300	1,406.00	421,800
サンセイランディック	100	762.00	76,200
エストラスト	100	765.00	76,500
フージャースホールディングス	800	702.00	561,600
オープンハウス	1,200	4,070.00	4,884,000
東急不動産ホールディングス	10,600	479.00	5,077,400
飯田グループホールディングス	3,300	1,986.00	6,553,800
イーランド	100	794.00	79,400
ムゲンエステート	300	543.00	162,900
ビーロット	200	783.00	156,600
ファーストブラザーズ	100	1,003.00	100,300
ハウストゥ	200	1,312.00	262,400
シーアールイー	100	1,421.00	142,100
プロパティエージェント	100	1,433.00	143,300
ケイアイスター不動産	100	2,795.00	279,500
アグレ都市デザイン	100	641.00	64,100
グッドコムアセット	200	1,528.00	305,600
テンポイノベーション	100	878.00	87,800
グローバル・リンク・マネジメント	100	745.00	74,500
パーク24	2,100	1,336.00	2,805,600
パラカ	100	1,699.00	169,900
三井不動産	19,100	1,846.00	35,258,600
三菱地所	27,500	1,666.50	45,828,750
平和不動産	700	3,270.00	2,289,000
東京建物	3,900	1,270.00	4,953,000
ダイビル	1,000	1,285.00	1,285,000
京阪神ビルディング	700	2,140.00	1,498,000
住友不動産	8,800	3,050.00	26,840,000
テーオーシー	800	667.00	533,600
東京楽天地	100	4,535.00	453,500
スターツコーポレーション	500	2,581.00	1,290,500
フジ住宅	500	598.00	299,000
空港施設	400	489.00	195,600
明和地所	200	465.00	93,000
ゴールドクレスト	300	1,382.00	414,600
エスリード	200	1,362.00	272,400
日神グループホールディングス	600	387.00	232,200
日本エスコン	700	904.00	632,800
タカラレーベン	1,900	294.00	558,600
A V A N T I A	200	908.00	181,600
イオンモール	2,000	1,724.00	3,448,000

毎日コムネット	100	736.00	73,600
ファースト住建	200	999.00	199,800
カチタス	1,000	3,410.00	3,410,000
トーセイ	600	1,106.00	663,600
サンフロンティア不動産	600	902.00	541,200
エフ・ジェー・ネクスト	400	1,025.00	410,000
インテリックス	100	525.00	52,500
ランドビジネス	100	339.00	33,900
サンネクスタグループ	100	1,024.00	102,400
グランディハウス	300	379.00	113,700
日本空港ビルデング	1,200	4,400.00	5,280,000
明豊ファシリティワークス	200	647.00	129,400
日本工営	300	2,914.00	874,200
L I F U L L	1,400	404.00	565,600
ミクシィ	700	3,220.00	2,254,000
ジェイエイシーリクルートメント	300	1,386.00	415,800
日本M&Aセンター	2,900	6,530.00	18,937,000
メンバーズ	100	2,070.00	207,000
中広	100	460.00	46,000
UTグループ	600	3,310.00	1,986,000
アイティメディア	200	2,987.00	597,400
タケエイ	400	1,075.00	430,000
E・Jホールディングス	100	2,268.00	226,800
ビーネックスグループ	500	1,057.00	528,500
コシダカホールディングス	900	387.00	348,300
アルトナー	100	909.00	90,900
パソナグループ	400	1,778.00	711,200
C D S	100	1,323.00	132,300
リンクアンドモチベーション	800	439.00	351,200
G C A	500	679.00	339,500
エス・エム・エス	1,200	3,325.00	3,990,000
サニーサイドアップグループ	100	659.00	65,900
パーソルホールディングス	3,800	1,680.00	6,384,000
リニカル	200	764.00	152,800
クックパッド	1,200	348.00	417,600
エスクリ	100	321.00	32,100
アイ・ケイ・ケイ	200	653.00	130,600
学情	100	988.00	98,800
スタジオアリス	200	1,968.00	393,600
シミックホールディングス	200	1,400.00	280,000
エプコ	100	1,060.00	106,000
N J S	100	1,972.00	197,200



総合警備保障	1,500	5,150.00	7,725,000
カカクコム	2,800	3,105.00	8,694,000
アイロムグループ	100	1,906.00	190,600
セントケア・ホールディング	200	766.00	153,200
サイネックス	100	828.00	82,800
ルネサンス	200	816.00	163,200
ディップ	500	2,106.00	1,053,000
デジタルホールディングス	200	1,415.00	283,000
新日本科学	400	676.00	270,400
ツクイホールディングス	900	554.00	498,600
キャリアデザインセンター	100	1,021.00	102,100
ベネフィット・ワン	1,400	2,984.00	4,177,600
エムスリー	8,400	8,198.00	68,863,200
ツカダ・グローバルホールディング	200	257.00	51,400
プラス	100	416.00	41,600
アウトソーシング	2,200	1,266.00	2,785,200
ウェルネット	400	532.00	212,800
ワールドホールディングス	100	2,266.00	226,600
ディー・エヌ・エー	1,600	1,850.00	2,960,000
博報堂D Yホールディングス	5,300	1,439.00	7,626,700
ぐるなび	700	626.00	438,200
タカミヤ	400	505.00	202,000
ジャパンベストレスキューシステム	300	970.00	291,000
ファンコミュニケーションズ	1,100	477.00	524,700
ライク	100	2,273.00	227,300
ビジネス・ブレークスルー	200	405.00	81,000
エスプール	1,000	736.00	736,000
WDBホールディングス	200	3,250.00	650,000
ティア	200	407.00	81,400
バリューコマース	300	3,545.00	1,063,500
インフォマート	3,900	1,002.00	3,907,800
J Pホールディングス	1,200	303.00	363,600
エコナックホールディングス	700	91.00	63,700
E P Sホールディングス	500	993.00	496,500
レッグス	100	1,499.00	149,900
プレステージ・インターナショナル	1,400	936.00	1,310,400
アミューズ	200	2,620.00	524,000
ドリームインキュベータ	100	1,544.00	154,400
クイック	200	1,105.00	221,000
T A C	200	231.00	46,200
ケネディクス	3,300	668.00	2,204,400
電通グループ	4,300	3,135.00	13,480,500

テイクアンドギヴ・ニーズ	100	516.00	51,600
ぴあ	100	2,904.00	290,400
イオンファンタジー	100	2,174.00	217,400
シーティーエス	400	916.00	366,400
ネクシィーズグループ	100	1,007.00	100,700
H.U.グループホールディングス	1,100	2,729.00	3,001,900
アルプス技研	300	2,058.00	617,400
サニックス	700	271.00	189,700
ダイオーズ	100	947.00	94,700
日本空調サービス	400	770.00	308,000
オリエンタルランド	4,000	15,850.00	63,400,000
ダスキン	1,000	2,808.00	2,808,000
明光ネットワークジャパン	500	607.00	303,500
ファルコホールディングス	200	1,631.00	326,200
秀英予備校	100	407.00	40,700
ラウンドワン	1,100	799.00	878,900
リゾートトラスト	1,800	1,541.00	2,773,800
ビー・エム・エル	500	3,105.00	1,552,500
ワタベウェディング	100	269.00	26,900
りらいあコミュニケーションズ	700	1,216.00	851,200
リソー教育	1,800	329.00	592,200
早稲田アカデミー	200	986.00	197,200
ユー・エス・エス	4,300	2,040.00	8,772,000
東京個別指導学院	100	601.00	60,100
サイバーエージェント	2,300	6,590.00	15,157,000
楽天	17,700	1,116.00	19,753,200
クリーク・アンド・リバー社	200	1,066.00	213,200
テー・オー・ダブリュー	600	286.00	171,600
山田コンサルティンググループ	200	1,000.00	200,000
セントラルスポーツ	100	2,270.00	227,000
フルキャストホールディングス	300	1,568.00	470,400
エン・ジャパン	700	2,594.00	1,815,800
テクノプロ・ホールディングス	800	7,190.00	5,752,000
アトラ	100	279.00	27,900
インターワークス	100	330.00	33,000
アイ・アールジャパンホールディングス	200	13,030.00	2,606,000
Keeper 技研	200	1,567.00	313,400
ファーストロジック	100	821.00	82,100
三機サービス	100	963.00	96,300
Gunosy	200	786.00	157,200
デザインワン・ジャパン	100	239.00	23,900
イー・ガーディアン	200	3,565.00	713,000

リブセンス	200	269.00	53,800
ジャパンマテリアル	1,200	1,498.00	1,797,600
ベクトル	500	888.00	444,000
ウチヤマホールディングス	200	307.00	61,400
チャーム・ケア・コーポレーション	300	1,144.00	343,200
キャリアリンク	100	1,592.00	159,200
I B J	300	980.00	294,000
アサンテ	200	1,616.00	323,200
N・フィールド	300	816.00	244,800
バリューHR	100	1,650.00	165,000
M&Aキャピタルパートナーズ	300	5,920.00	1,776,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	2,394.00	239,400
E R Iホールディングス	100	650.00	65,000
アビスト	100	2,885.00	288,500
シグマクシス	300	1,540.00	462,000
ウィルグループ	200	830.00	166,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	500	320.00	160,000
メドピア	200	5,870.00	1,174,000
リクルートホールディングス	27,200	4,530.00	123,216,000
エラン	300	2,602.00	780,600
土木管理総合試験所	200	403.00	80,600
ネットマーケティング	100	631.00	63,100
日本郵政	31,200	740.00	23,088,000
ベルシステム24ホールディングス	600	1,664.00	998,400
鎌倉新書	300	1,141.00	342,300
S M N	100	809.00	80,900
L I T A L I C O	100	3,130.00	313,000
グローバルキッズCOMPANY	100	770.00	77,000
エアトリ	200	1,259.00	251,800
アトラエ	100	2,806.00	280,600
ストライク	100	6,230.00	623,000
ソラスト	1,100	1,380.00	1,518,000
セラク	100	2,167.00	216,700
インソース	200	3,255.00	651,000
バイカレント・コンサルティング	200	17,040.00	3,408,000
Orchestra Holdings	100	2,435.00	243,500
アイモバイル	100	1,318.00	131,800
キャリアインデックス	200	489.00	97,800
M S - J a p a n	100	821.00	82,100
船場	100	914.00	91,400
グレイステクノロジー	200	5,950.00	1,190,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	400	4,430.00	1,772,000

フルテック	100	1,438.00	143,800
グリーンズ	100	472.00	47,200
ツナググループ・ホールディングス	100	416.00	41,600
GameWith	100	557.00	55,700
ソウルドアウト	100	1,485.00	148,500
MS&Consulting	100	610.00	61,000
日総工産	300	776.00	232,800
キュービーネットホールディングス	200	1,595.00	319,000
RPAホールディングス	300	707.00	212,100
スプリックス	100	948.00	94,800
マネジメントソリューションズ	200	1,554.00	310,800
プロレド・パートナーズ	100	5,060.00	506,000
カーブスホールディングス	1,100	681.00	749,100
フォーラムエンジニアリング	200	890.00	178,000
アドバンテッジリスクマネジメント	200	672.00	134,400
リログループ	2,100	2,621.00	5,504,100
東祥	200	1,123.00	224,600
エイチ・アイ・エス	600	1,418.00	850,800
ラックランド	100	2,314.00	231,400
共立メンテナンス	600	3,945.00	2,367,000
イチネンホールディングス	400	1,277.00	510,800
建設技術研究所	300	2,043.00	612,900
スペース	300	835.00	250,500
長大	200	1,281.00	256,200
燦ホールディングス	200	1,269.00	253,800
東京テアトル	200	1,292.00	258,400
タナベ経営	100	1,409.00	140,900
ナガワ	100	8,520.00	852,000
よみうりランド	100	5,500.00	550,000
東京都競馬	200	5,200.00	1,040,000
常磐興産	200	1,482.00	296,400
カナモト	700	2,221.00	1,554,700
東京ドーム	1,500	887.00	1,330,500
西尾レントオール	400	2,036.00	814,400
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	2,100	27.00	56,700
トランス・コスモス	400	3,125.00	1,250,000
乃村工藝社	1,600	734.00	1,174,400
藤田観光	100	1,497.00	149,700
KNT-CTホールディングス	200	866.00	173,200
日本管財	400	2,148.00	859,200
トーカイ	400	2,064.00	825,600
セコム	4,000	9,425.00	37,700,000

セントラル警備保障	200	3,390.00	678,000	
丹青社	700	750.00	525,000	
メイテック	500	5,170.00	2,585,000	
応用地質	400	1,263.00	505,200	
船井総研ホールディングス	800	2,517.00	2,013,600	
進学会ホールディングス	100	423.00	42,300	
オオバ	300	799.00	239,700	
いであ	100	1,720.00	172,000	
学究社	100	1,040.00	104,000	
ベネッセホールディングス	1,300	2,534.00	3,294,200	
イオンディライト	500	2,855.00	1,427,500	
ナック	200	952.00	190,400	
ダイセキ	600	2,756.00	1,653,600	
ステップ	100	1,606.00	160,600	
合 計	4,185,500		9,358,426,120	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

**【中間財務諸表】**

<インデックスポートフォリオ>

<バランスポートフォリオ>

- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年11月10日から2021年 5月 9日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【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 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	84,370,205	86,979,596
親投資信託受益証券	9,416,916,044	9,531,792,080
未収入金	4,172,077	4,860,797
流動資産合計	9,505,458,326	9,623,632,473
資産合計	9,505,458,326	9,623,632,473
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,535,141	-
未払解約金	34,878,965	5,258,328
未払受託者報酬	4,023,525	4,192,519
未払委託者報酬	72,424,571	75,466,411
未払利息	61	21
その他未払費用	201,116	209,570
流動負債合計	118,063,379	85,126,849
負債合計	118,063,379	85,126,849
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	13,070,282,130	11,526,859,284
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	3,682,887,183	1,988,353,660
( 分配準備積立金 )	2,274,004,168	1,991,771,253
元本等合計	9,387,394,947	9,538,505,624
純資産合計	9,387,394,947	9,538,505,624
負債純資産合計	9,505,458,326	9,623,632,473

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2019年11月 8日 至 2020年 5月 7日	当中間計算期間 自 2020年11月10日 至 2021年 5月 9日
営業収益		
受取利息	-	29
有価証券売買等損益	1,425,465,311	1,456,059,512
営業収益合計	1,425,465,311	1,456,059,541
営業費用		
支払利息	6,111	1,666
受託者報酬	4,044,324	4,192,519
委託者報酬	72,798,914	75,466,411
その他費用	202,204	209,570
営業費用合計	77,051,553	79,870,166
営業利益又は営業損失（ ）	1,502,516,864	1,376,189,375
経常利益又は経常損失（ ）	1,502,516,864	1,376,189,375
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,502,516,864	1,376,189,375
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（ ）	17,919,726	122,061,278
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,956,980,623	3,682,887,183
剰余金増加額又は欠損金減少額	225,277,284	458,344,931
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	225,277,284	458,344,931
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,101,343	17,939,505
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,101,343	17,939,505
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,250,401,820	1,988,353,660



## (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 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在
1. 期首元本額	14,138,258,485円	13,070,282,130円
期中追加設定元本額	226,616,601円	84,108,369円
期中一部解約元本額	1,294,592,956円	1,627,531,215円
2. 受益権の総数	13,070,282,130口	11,526,859,284口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,682,887,183円	1,988,353,660円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2019年11月 8日 至 2020年 5月 7日	当中間計算期間 自 2020年11月10日 至 2021年 5月 9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 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
-------------------------	---	----

## （ 1口当たり情報）

前計算期間末 2020年11月 9日現在		当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在	
1口当たり純資産額	0.7182円	1口当たり純資産額	0.8275円
(1万口当たり純資産額)	(7,182円)	(1万口当たり純資産額)	(8,275円)

## 【バランスポートフォリオ】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	前計算期間末 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	52,717,478	52,305,422
地方債証券	54,824,130	54,732,830
親投資信託受益証券	107,693,399	105,774,678
未収利息	42,818	40,807
流動資産合計	215,277,825	212,853,737
資産合計	215,277,825	212,853,737
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	111,785	-
未払解約金	-	1,975,614
未払受託者報酬	93,025	92,739
未払委託者報酬	1,675,571	1,670,459
未払利息	38	12
その他未払費用	4,605	4,585
流動負債合計	1,885,024	3,743,409
負債合計	1,885,024	3,743,409
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	223,571,562	204,505,714
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	10,178,761	4,604,614
( 分配準備積立金 )	25,581,671	23,063,144
元本等合計	213,392,801	209,110,328
純資産合計	213,392,801	209,110,328
負債純資産合計	215,277,825	212,853,737

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2019年11月 8日 至 2020年 5月 7日	当中間計算期間 自 2020年11月10日 至 2021年 5月 9日
<b>営業収益</b>		
受取利息	119,585	123,056
有価証券売買等損益	15,189,631	16,607,965
営業収益合計	15,070,046	16,731,021
<b>営業費用</b>		
支払利息	6,412	2,418
受託者報酬	91,027	92,739
委託者報酬	1,639,553	1,670,459
その他費用	4,627	4,585
営業費用合計	1,741,619	1,770,201
営業利益又は営業損失( )	16,811,665	14,960,820
経常利益又は経常損失( )	16,811,665	14,960,820
中間純利益又は中間純損失( )	16,811,665	14,960,820
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( )	123,804	1,183,316
期首剰余金又は期首欠損金( )	9,888,055	10,178,761
剰余金増加額又は欠損金減少額	289,852	1,005,871
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	289,852	1,004,320
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,551
剰余金減少額又は欠損金増加額	263,005	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	263,005	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	26,549,069	4,604,614

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

## (中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在
1.	期首元本額	227,178,234円	223,571,562円
	期中追加設定元本額	7,044,581円	3,121,885円
	期中一部解約元本額	10,651,253円	22,187,733円
2.	受益権の総数	223,571,562口	204,505,714口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	10,178,761円	- 円

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2019年11月 8日 至 2020年 5月 7日	当中間計算期間 自 2020年11月10日 至 2021年 5月 9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 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## ( 1口当たり情報 )

前計算期間末 2020年11月 9日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
0.9545円 (9,545円)	1.0225円 (10,225円)

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」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

	2020年11月 9日現在	2021年 5月 9日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	993,497	395,034

	2020年11月 9日現在	2021年 5月 9日現在
コール・ローン	58,507,336	71,372,248
株式	9,358,426,120	9,480,979,810
派生商品評価勘定	3,096,150	518,900
未収入金	30,486,960	-
未収配当金	81,498,829	91,283,680
前払金	-	1,405,000
流動資産合計	9,533,008,892	9,645,954,672
資産合計	9,533,008,892	9,645,954,672
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,227,750
前受金	1,665,000	-
未払解約金	4,172,077	4,860,797
未払利息	42	17
流動負債合計	5,837,119	6,088,564
負債合計	5,837,119	6,088,564
純資産の部		
元本等		
元本	5,384,177,187	4,689,813,508
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	4,142,994,586	4,950,052,600
元本等合計	9,527,171,773	9,639,866,108
純資産合計	9,527,171,773	9,639,866,108
負債純資産合計	9,533,008,892	9,645,954,672

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2020年11月 9日現在	2021年 5月 9日現在
1. 期首	2019年11月 8日	2020年11月10日

期首元本額	5,911,412,269円	5,384,177,187円
期首からの追加設定元本額	50,641,251円	3,048,273円
期首からの一部解約元本額	577,876,333円	697,411,952円
元本の内訳		
インデックスポートフォリオ	5,323,299,064円	4,638,341,645円
バランスポートフォリオ	60,878,123円	51,471,863円
計	5,384,177,187円	4,689,813,508円
2. 受益権の総数	5,384,177,187口	4,689,813,508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	67,760,550円	82,715,320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

	2020年11月 9日現在	2021年 5月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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）

（2020年11月 9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	114,570,000	-	117,670,000	3,100,000
合計		114,570,000	-	117,670,000	3,100,000

(2021年 5月 9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	136,085,000	-	135,380,000	705,000
合計		136,085,000	-	135,380,000	705,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

2020年11月 9日現在		2021年 5月 9日現在	
1口当たり純資産額	1.769円	1口当たり純資産額	2.055円
(1千口当たり純資産額)	(1,769円)	(1千口当たり純資産額)	(2,055円)

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 5月31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	9,472,750,591円
負債総額	16,082,521円
純資産総額（ - ）	9,456,668,070円
発行済口数	11,490,740,996口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8230円

### 【バランスポートフォリオ】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	209,061,017円
負債総額	229,298円
純資産総額（ - ）	208,831,719円
発行済口数	204,919,386口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0191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	9,559,313,842円
負債総額	3,547,936円
純資産総額（ - ）	9,555,765,906円
発行済口数	4,670,726,788口
1口当たり純資産額（ / ）	2.046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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （４）受益証券の再発行

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

### （５）受益権の再分割

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

### （６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【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

2021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（2021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（2021年5月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、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、2021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	851	261,058
株式投資信託	784	226,178
単位型	279	11,091
追加型	505	215,087
公社債投資信託	67	34,879
単位型	54	2,000
追加型	13	32,879

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（2020年4月1日から2021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】

	第61期 (2020年3月31日)		第62期 (2021年3月31日)	
(単位：百万円)				
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,591		24,698
有価証券		19		17
前払費用		603		785
未収入金		14		225
未収委託者報酬		16,912		24,738
未収収益	3	1,412	3	891
関係会社短期貸付金		2,371		2,403
立替金		1,437		930
その他	2	1,316	2	361
流動資産合計		48,679		55,053
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	182	1	245
器具備品	1	135	1	190
有形固定資産合計		318		436
無形固定資産				
ソフトウェア		120		241
無形固定資産合計		120		241
投資その他の資産				
投資有価証券		17,826		22,903
関係会社株式		25,769		25,987
長期差入保証金		484		678

繰延税金資産	2,022	1,845
投資その他の資産合計	46,102	51,414
固定資産合計	46,540	52,092
資産合計	95,220	107,145

(単位：百万円)

	第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	554	844
未払金	5,881	9,834
未払収益分配金	8	8
未払償還金	71	71
未払手数料	5,202	8,956
その他未払金	599	798
未払費用	3 4,289	3 4,660
未払法人税等	1,439	1,090
未払消費税等	4 746	4 775
賞与引当金	2,718	3,034
役員賞与引当金	55	55
その他	42	643
流動負債合計	15,726	20,938
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,395	1,456
賞与引当金	-	156
その他	695	544
固定負債合計	2,091	2,157
負債合計	17,818	23,095
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	55,395	61,956
利益剰余金合計	55,395	61,956
自己株式	905	2,067
株主資本合計	77,073	82,472
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	60	1,461
繰延ヘッジ損益	389	115
評価・換算差額等合計	329	1,577
純資産合計	77,402	84,049
負債純資産合計	95,220	107,145

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,265	78,975
その他営業収益	2,994	3,973
営業収益合計	77,259	82,948
営業費用		
支払手数料	31,322	34,050
広告宣伝費	953	953
公告費	2	1
調査費	17,275	17,813
調査費	920	966
委託調査費	16,333	16,825
図書費	21	22
委託計算費	534	545
営業雑経費	1,058	1,053
通信費	116	174
印刷費	337	331
協会費	52	51
諸会費	10	11
その他	541	483
営業費用計	51,148	54,419
一般管理費		
給料	9,857	10,383
役員報酬	360	243
役員賞与引当金繰入額	55	55
給料・手当	6,675	6,766
賞与	64	159
賞与引当金繰入額	2,702	3,158
交際費	92	14
寄付金	29	30
旅費交通費	420	57
租税公課	440	485
不動産賃借料	901	939
退職給付費用	387	388
退職金	82	10
固定資産減価償却費	118	138
福利費	1,014	1,084
諸経費	3,229	4,286
一般管理費計	16,573	17,817
営業利益	9,538	10,711

	(単位：百万円)	
	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取利息	99	75
受取配当金	1 4,881	1 2,555
有価証券償還益	-	14

デリバティブ収益	223	-
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	5	-
その他	145	62
営業外収益合計	5,357	2,710
営業外費用		
支払利息	185	122
有価証券償還損	0	-
デリバティブ費用	-	804
時効成立後支払分配金・償還金	1	25
為替差損	-	59
その他	12	42
営業外費用合計	199	1,054
経常利益	14,695	12,367
特別利益		
投資有価証券売却益	164	774
その他	-	0
特別利益合計	164	774
特別損失		
投資有価証券売却損	19	237
投資有価証券評価損	21	5
固定資産処分損	0	0
役員退職一時金	-	125
特別損失合計	41	369
税引前当期純利益	14,818	12,773
法人税、住民税及び事業税	3,307	3,722
法人税等調整額	45	373
法人税等合計	3,353	3,348
当期純利益	11,465	9,424

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	8,252	8,252	71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073



	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	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				3,212
当期純利益				11,465
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	553	204	349	349
当期変動額合計	553	204	349	7,831
当期末残高	60	389	329	77,402

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073
当期変動額							
剰余金の配当				2,862	2,862		2,862
当期純利益				9,424	9,424		9,424
自己株式の取得						1,161	1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,561	6,561	1,161	5,399
当期末残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	60	389	329	77,402
当期変動額				
剰余金の配当				2,862
当期純利益				9,424
自己株式の取得				1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,521	273	1,247	1,247
当期変動額合計	1,521	273	1,247	6,647
当期末残高	1,461	115	1,577	84,049

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="526 795 1037 873"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法</p> <p>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p> <p>ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、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)

- 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

## (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

2022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

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

## (貸借対照表関係)

第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,311百万円 器具備品 707百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,349百万円 器具備品 764百万円
2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 151百万円 (流動負債) 未払費用 623百万円	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 257百万円 (流動負債) 未払費用 1,247百万円
4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。	4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。
5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が ロンドン ウォール リミテッド パートナーシップ に支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対し て保証を行っております。	

## (損益計算書関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 4,849百万円	1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 2,498百万円

## (株主資本等変動計算書関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

## (変動事由の概要)

2019年8月13日の取締役会決議による自己株式の取得 88,800株

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	871,200	1,184,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	2,272,000	1,346,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,417,000	2,394,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,417,000	2,939,000	-
合計		15,088,300	-	7,224,600	7,863,700	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)1,184,700株、2016年度ストックオプション(1)881,000株及び2016年度ストックオプション(2)804,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)465,000株、2016年度ストックオプション(2)1,590,000株及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24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
2020年6月12日 取締役会	普通株式	利益剰余金	2,862	14.64	2020年3月31日	2020年7月1日

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500
---------	-------------	---	---	-------------

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,454,500	1,405,500	-	2,860,000

## (変動事由の概要)

2020年3月25日の取締役会決議による自己株式の取得 594,300株

2020年7月17日の取締役会決議による自己株式の取得 811,200株

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,184,700	-	752,400	432,300	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,346,000	-	330,000	1,016,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	2,394,000	-	622,000	1,772,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,939,000	-	332,000	2,607,000	-
合計		7,863,700	-	2,036,400	5,827,300	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)432,300株、2016年度ストックオプション(1)1,016,000株、2016年度ストックオプション(2)1,088,000株及び2017年度ストックオプション874,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(2)684,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,733,000株は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月12日 取締役会	普通株式	2,862	14.64	2020年3月31日	2020年7月1日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29日

## (リース取引関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第62期 (自 2020年4月1日 至 2021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	912百万円	1年内	911百万円
1年超	6,148百万円	1年超	5,236百万円
合計	7,060百万円	合計	6,148百万円

## (金融商品関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

クを管理しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	-
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	-
(3) 未収収益	1,412	1,412	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	17,828	17,828	-
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	-
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	-
(8) デリバティブ取引( 2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	-
デリバティブ取引計	142	142	-

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

( 2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

### (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

#### (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

#### (6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

#### (8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち15百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、41百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち167百万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。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	-	-	-
未収委託者報酬	16,912	-	-	-

未収収益	1,412	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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



週次ペ - スで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	24,698	24,698	-
(2) 未収委託者報酬	24,738	24,738	-
(3) 未収収益	891	891	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,403	2,403	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,905	22,905	-
(6) 未払金	(9,834)	(9,834)	-
(7) 未払費用	(4,660)	(4,660)	-
(8) デリバティブ取引( 2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(188)	(188)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(453)	(453)	-
デリバティブ取引計	(642)	(642)	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

( 2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

### (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

#### (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

#### (6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

#### (8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

## (有価証券関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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	22,876
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	5,381	4,912	469
	小計	5,381	4,912	469
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	12,447	13,003	556
	小計	12,447	13,003	556
合計		17,828	17,915	86

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,230	164	19
合計	2,230	164	19

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094

関連会社株式	2,892
--------	-------

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第61期(2020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	1,913	-	41	41
	買建	-	-	-	-
合計		1,913	-	41	41

(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	為替予約取引 売建				

の取引	米ドル	1,808	-	15	15
合計		1,808	-	15	15

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,427	-	20
	豪ドル		48	-	9
	シンガポール ドル		944	-	58
	香港ドル		529	-	2
	人民元		2,017	-	76
	ユーロ		70	-	1
合計			7,038	-	167

## (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62期(2021年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

## 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
----------	--------------	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル				
			4,620	-	273
			862	-	57
			1,684	-	117
			180	-	5
	合計		7,347	-	453

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751

## (退職給付関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	31
退職給付の支払額	164
退職給付債務の期末残高	1,363

## (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	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の費用処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用	154

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎  
割引率 0.2%

### 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

#### 1 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,456
貸借対照表に計上された負債の額	1,456

##### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

##### (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎  
割引率 0.2%

### 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

#### 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

##### (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48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 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日

権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
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	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日

権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,171,500	75,900
付与	0	0
失効	1,171,500	75,900
権利確定	0	0
権利未確定残	-	-
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,055,900	3,618,000
付与	0	0
失効	871,200	2,272,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,184,700	1,346,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-



権利未行使残	-	-
--------	---	---

	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	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。  
 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円  
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) ス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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	1,184,700	1,346,000
付与	0	0
失効	752,400	330,000

権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

#### (税効果会計関係)

第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021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)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	822	賞与引当金	929
投資有価証券評価損	102	投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	427	退職給付引当金	446
固定資産減価償却費	96	固定資産減価償却費	90
その他	744	その他	978
繰延税金資産小計	3,624	繰延税金資産小計	3,972
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,194	繰延税金資産合計	2,541
繰延税金負債		繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172	繰延ヘッジ利益	51
繰延税金負債合計	172	その他有価証券評価差額金	645
繰延税金資産の純額	2,022	繰延税金負債合計	696
		繰延税金資産の純額	1,845
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	9.6%	受取配当金等永久に益金に参入されない項目	5.7%
その他	1.0%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%

## (関連当事者情報)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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	シンガポール	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント	直接 100.00	-	資金の貸付 (米国ドル貸建) (注1)	-	関係会社 短期貸付金	1,793 (USD) 16,500 (千)
							貸付金利息 (米国ドル貸建) (注1)	86 (USD) 798(千)	未収収益	13 (USD) 122 (千)

	Limited	国		ト業			資金の貸付 (円貨建) (注1)		関係会社 短期 貸付金	
							-		577	
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	1,526 (USD 14,000 千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,700	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019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	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円
営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業 の内容	議決権等 の所有 (被所有 割合(%))	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
							資金の貸付 (米国ドル 貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500 千)

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,783 (USD 17,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

## 関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	395円50銭	432円90銭
1株当たり当期純利益金額	58円61銭	48円45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61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,465	9,424
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)	11,465	9,424
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,599	194,509
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株	2011年度ストックオプション(1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株

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61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	77,402	84,049
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)	77,402	84,049
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)	195,558	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) 通常の見積り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



において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2021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(2021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 (2021年3月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	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。
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	

## 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。
  - 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

2021年6月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62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2021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。

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年12月16日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
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2019年11月8日から2020年11月9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2020年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべ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。

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年12月16日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスポートフォリオの2019年11月8日から2020年11月9日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの2020年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべ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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的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。継続企業的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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の中間監査報告書

2021年6月16日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
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2020年11月10日から2021年5月9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2021年5月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月10日から2021年5月9日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2021年6月16日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
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」に掲げられているバランスポートフォリオの2020年11月10日から2021年5月9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、バランスポートフォリオの2021年5月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月10日から2021年5月9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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。