

## 【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】                                    | 2022年8月8日提出  |
| 【発行者名】                                   | 日興アセットマネジメント株式会社   |
| 【代表者の役職氏名】                               | 代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ                                       |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都港区赤坂九丁目7番1号   |
| 【事務連絡者氏名】                                | 新屋敷 昇  |
| 【電話番号】                                   | 03-6447-6147   |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>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<br>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<br>信託受益証券の金額】        | インデックスポートフォリオ<br>1兆円を上限とします。<br>バランスポートフォリオ<br>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】

2022年8月9日から2023年2月7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<br>(収益の源泉) | 補足分類    |
|-------------|--------|-------------------|---------|
| 単位型投信       | 国内     | 株式                | インデックス型 |
|             | 海外     | 債券                |         |
| 追加型投信       | 内外     | 不動産投信             | 特殊型     |
|             |        | その他資産<br>( )      |         |
|             |        | 資産複合              |         |

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 追加型投信

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

###### 国内

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

###### 株式

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

###### インデックス型

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

###### 2) 属性区分

| 投資対象資産                      | 決算頻度       | 投資対象地域      | 投資形態             | 対象インデックス   |
|-----------------------------|------------|-------------|------------------|------------|
| 株式<br>一般                    | 年1回        | グローバル       |                  |            |
| 大型株<br>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<br>( )              | (毎月)       | オセアニア       |                  |            |
| 不動産投信                       | 日々         | 中南米         | ファンド・オブ・<br>ファンズ |            |
| その他資産<br>(投資信託証券(株式<br>一般)) | その他<br>( ) | アフリカ        |                  | その他<br>( ) |
|                             |            | 中近東<br>(中東) |                  |            |
| 資産複合<br>( )                 |            | エマージング      |                  |            |
| 資産配分固定型<br>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・<br>追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉) |
|-----------------|--------|-------------------|
| 単位型投信           | 国内     | 株式<br>債券          |
|                 | 海外     | 不動産投信             |
| 追加型投信           | 内外     | その他資産<br>( )      |
|                 |        | 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<br>一般                                   | 年1回        | グローバル       |              |
| 大型株<br>中小型株                                | 年2回        | 日本          |              |
|  | 年4回        | 北米          | ファミリーファンド    |
| 債券<br>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<br>( )                             | (毎月)       | オセアニア       |              |
|  | 日々         | 中南米         |              |
| 不動産投信                                      | その他<br>( ) | アフリカ        | ファンド・オブ・ファンズ |
| その他資産<br>(投資信託証券(資産複合 資産配分<br>固定型(株式、債券))) |            | 中近東<br>(中東) |              |
|  |            | エマージング      |              |
| 資産複合<br>( )<br>資産配分固定型<br>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。

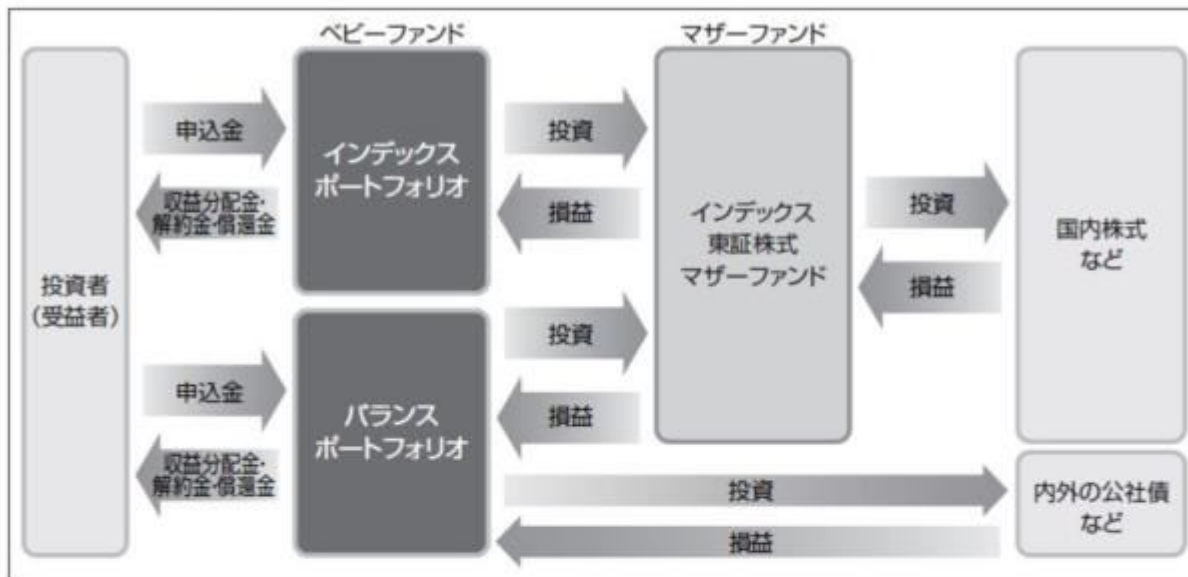
\*TOPIX(東証株価指数)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

**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ないます。



### (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ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

### 信託金限度額

- ・ 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】

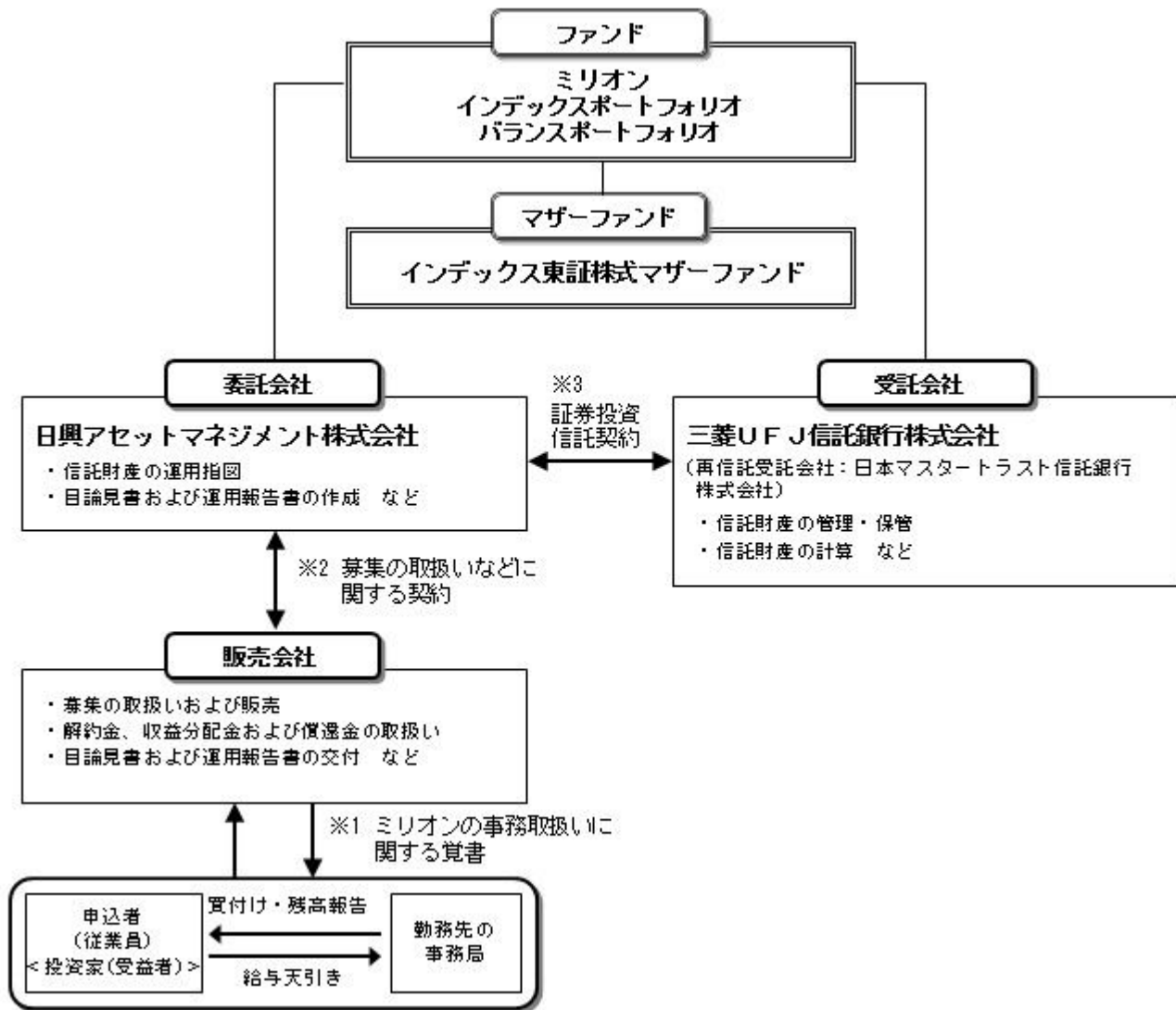
1987年11月27日

- ・ 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（2022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です。)

- 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。)に限りです。)
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りです。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 有価証券の貸付
- 4) 外国為替予約取引
- 5) 資金の借入

#### <インデックス東証株式マザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

##### <インデックス東証株式マザーファンド>

| 運用の基本方針 |  |
|---------|--|
| 基本方針    | わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざします。  |
| 主な投資対象  | わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  |
| 投資方針    | <ul style="list-style-type: none"> <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、パラー日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。</li> <li>・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いません。</li> <li>・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>                               |

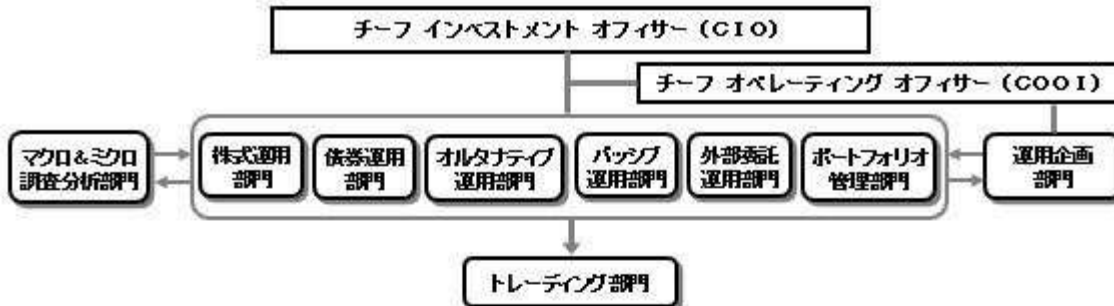
|                  |   |
|------------------|---|
| 収益分配             | 収益分配は行ないません。  |
| <b>ファンドに係る費用</b> |   |
| 信託報酬             | ありません。  |
| 申込手数料            | ありません。  |
| 信託財産留保額          | ありません。  |
| その他の費用など         | 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。<br>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。 |
| <b>その他</b>       |   |
| 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）   |

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

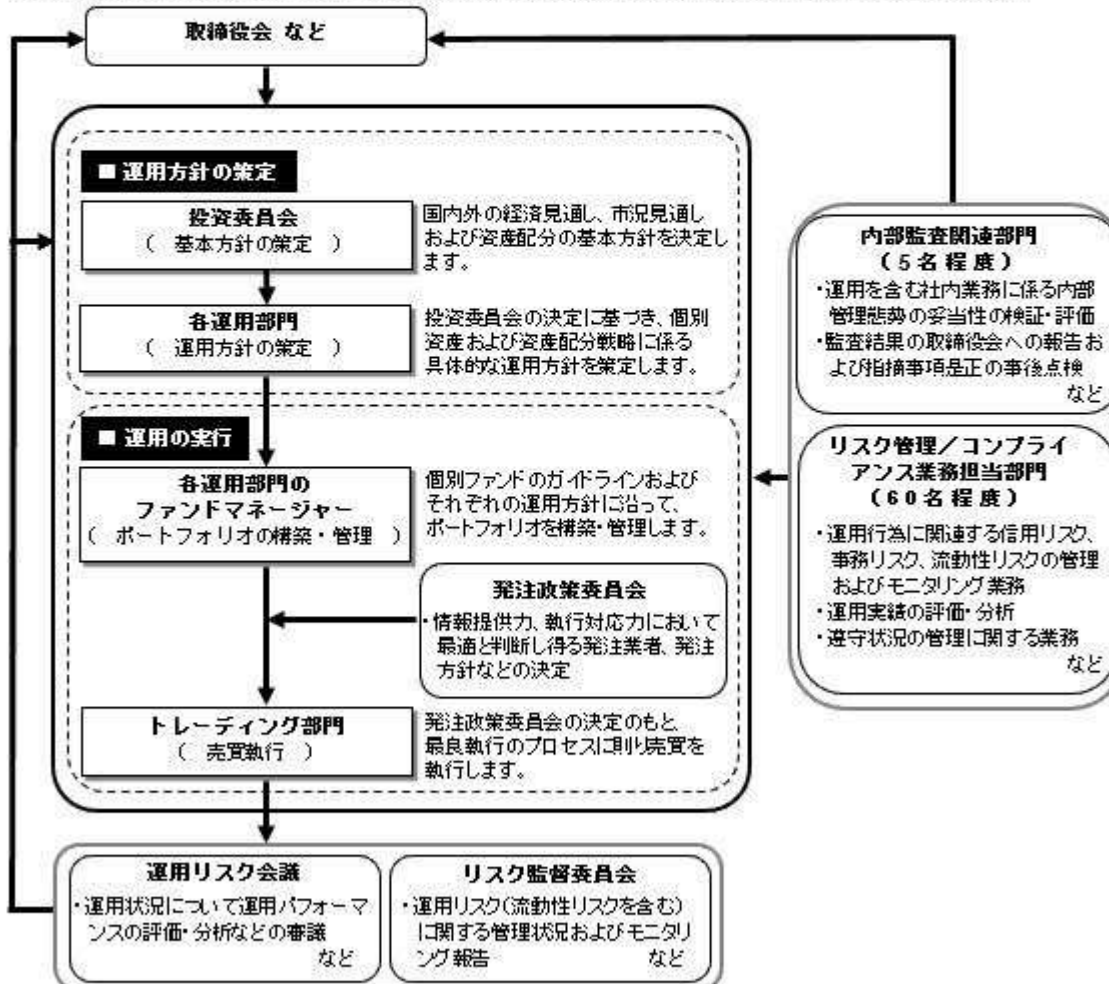
T O P I Xの指数値およびT O P I Xに係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ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

### （３）【運用体制】

## ◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



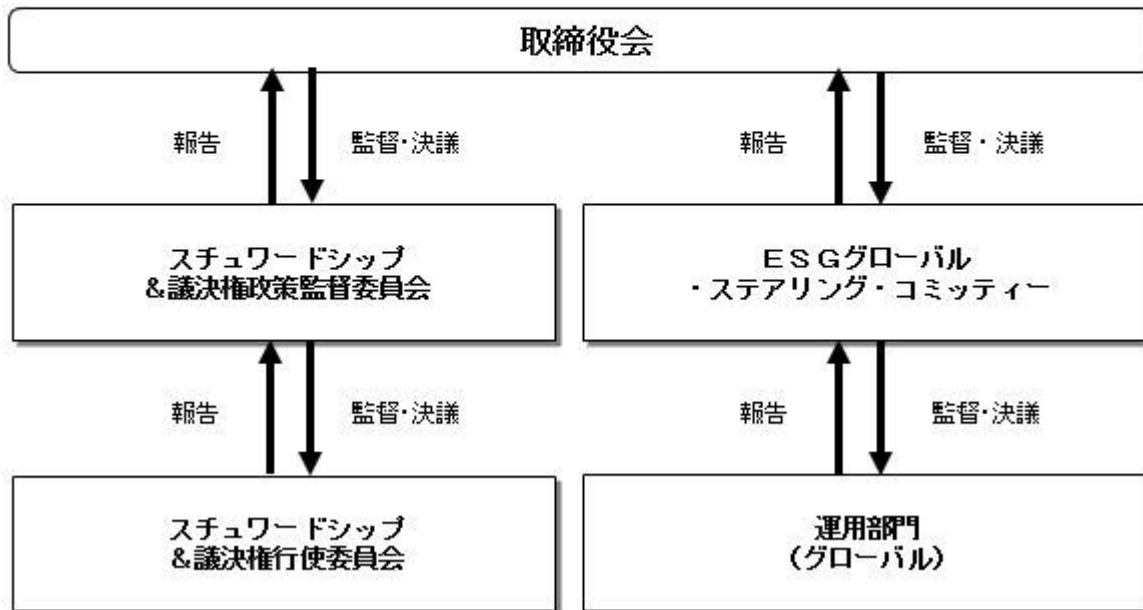
## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2022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。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
- 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、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

#### 為替変動リスク

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

### < その他の留意事項 >

#### ・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、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。

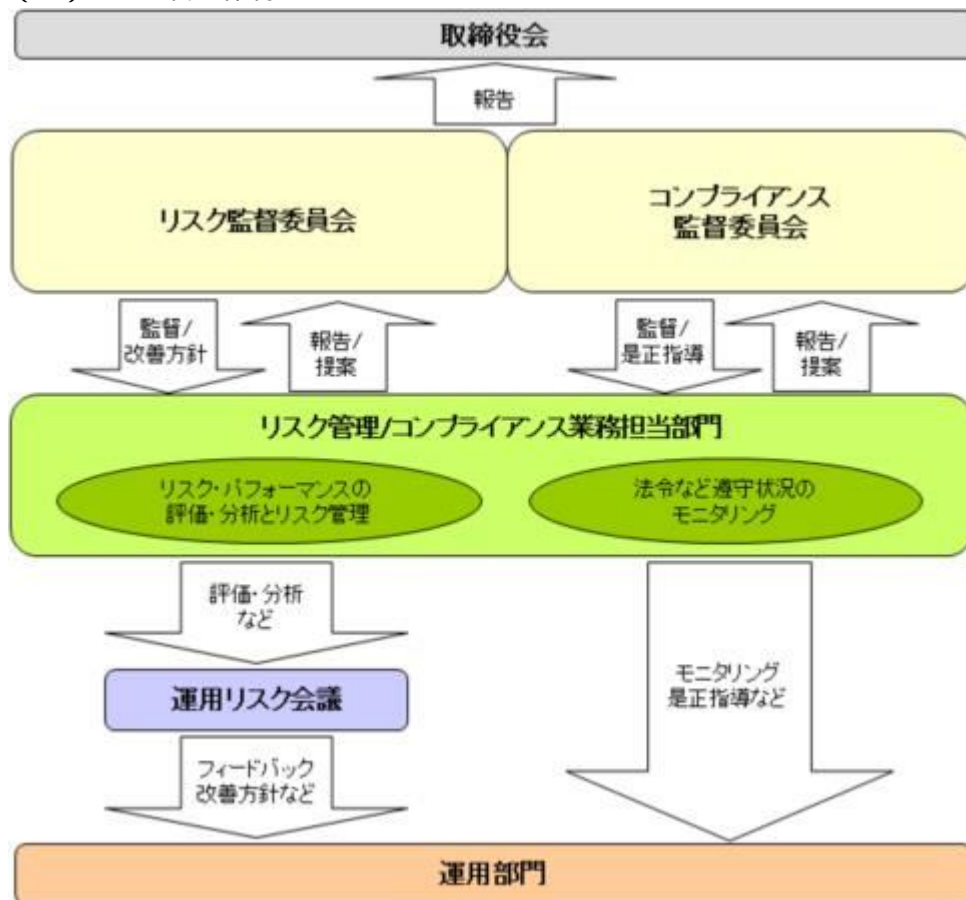
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

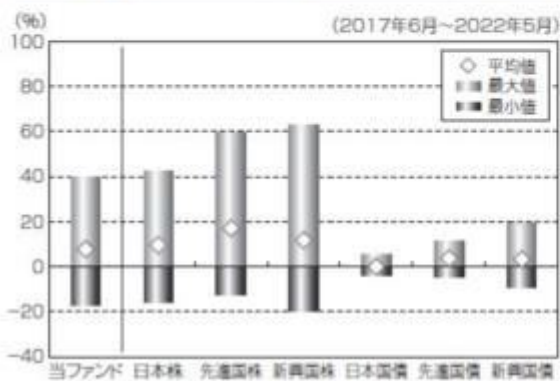
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2022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(%)）

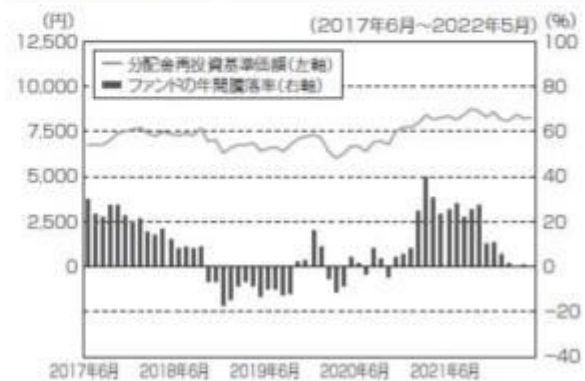
|     | 当ファンド  | 日本株    | 先進国株   | 新興国株   | 日本国債  | 先進国債  | 新興国債  |
|-----|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 平均値 | 7.8%   | 9.6%   | 17.1%  | 11.8%  | 0.1%  | 3.7%  | 3.3%  |
| 最大値 | 39.7%  | 42.1%  | 59.8%  | 62.7%  | 5.4%  | 11.4% | 19.3% |
| 最小値 | -17.3% | -16.0% | -12.4% | -19.4% | -4.0% | -4.5% | -9.4% |

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2017年6月から2022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



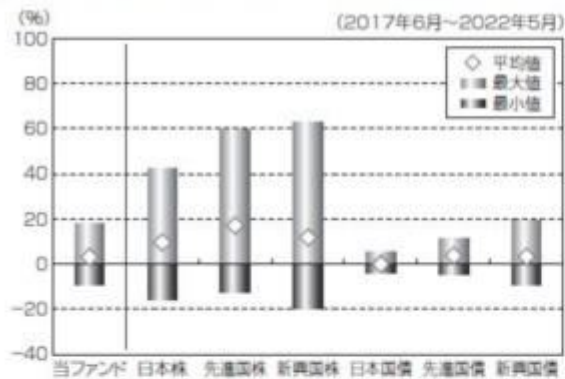
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017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 | 3.2%  | 9.6%   | 17.1%  | 11.8%  | 0.1%  | 3.7%  | 3.3%  |
| 最大値 | 17.9% | 42.1%  | 59.8%  | 62.7%  | 5.4%  | 11.4% | 18.3% |
| 最小値 | -9.3% | -16.0% | -12.4% | -19.4% | -4.0% | -4.5% | -9.4% |

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2017年6月から2022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グローバルレティバースィファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

### 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

#### 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

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

#### MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

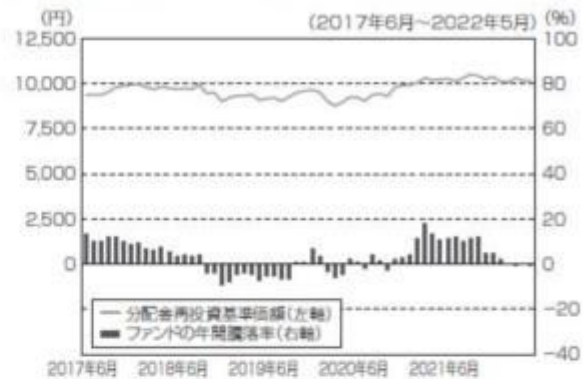
#### MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース)

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

### 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、2017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。

負いません。

#### FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、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】

###### <インデックスポートフォリオ>

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.539%（税抜0.49%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

| 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 |       |       |       |
|---------------------------|-------|-------|-------|
| 合計                        | 委託会社  | 販売会社  | 受託会社  |
| 0.49%                     | 0.22% | 0.22% | 0.05% |

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

###### <バランスポートフォリオ>

信託報酬

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

信託報酬の配分



信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

| 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 |       |       |       |
|---------------------------|-------|-------|-------|
| 合計                        | 委託会社  | 販売会社  | 受託会社  |
| 0.52%                     | 0.22% | 0.22% | 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）\*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ます。)と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益(譲渡益)、普通分配金および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限ります。)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

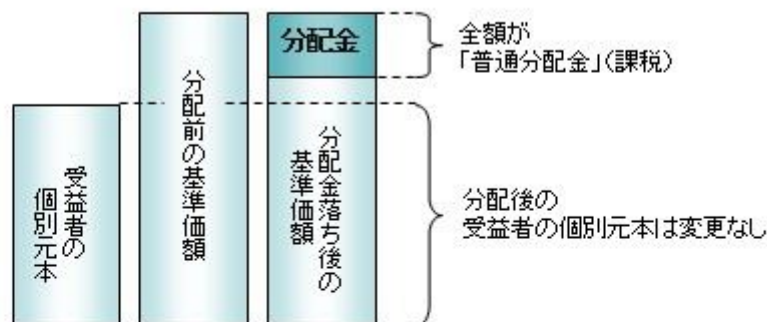
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

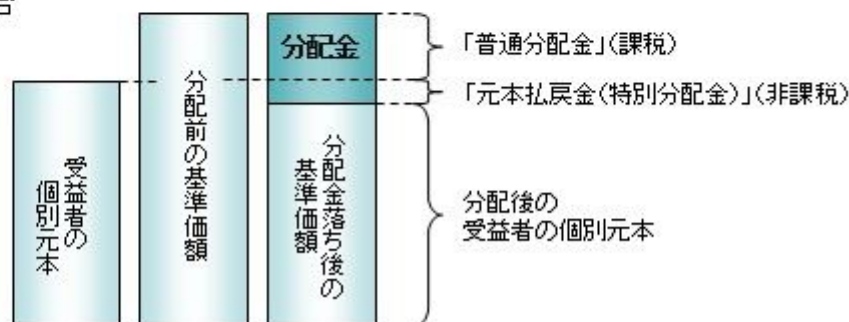
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
  - 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2022年8月8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2022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   | 9,113,086,922 | 99.91   |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） |      | 8,224,561     | 0.09    |
| 合計（純資産総額）             |      | 9,121,311,483 | 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<br>額面総額  | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|------|-----------|-------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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 | 4,374,981,720 | 2.1660          | 9,476,210,406   | 2.0830          | 9,113,086,922   | 99.91           |

## ロ. 種類別の投資比率

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.91   |
| 合計        | 99.91   |

## 【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25計算期間末<br>(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 |
| 第34計算期間末 | (2021年11月 8日) | 9,766  | 9,771  | 0.8723 | 0.8728 |
|          | 2021年 5月末日    | 9,456  |        | 0.8230 |        |
|          | 6月末日          | 9,522  |        | 0.8315 |        |
|          | 7月末日          | 9,287  |        | 0.8123 |        |
|          | 8月末日          | 9,535  |        | 0.8367 |        |
|          | 9月末日          | 9,805  |        | 0.8720 |        |
|          | 10月末日         | 9,630  |        | 0.8588 |        |
|          | 11月末日         | 9,242  |        | 0.8260 |        |
|          | 12月末日         | 9,529  |        | 0.8531 |        |
|          | 2022年 1月末日    | 9,039  |        | 0.8110 |        |
|          | 2月末日          | 8,973  |        | 0.8064 |        |
|          | 3月末日          | 9,335  |        | 0.8397 |        |
|          | 4月末日          | 9,063  |        | 0.8184 |        |
|          | 5月末日          | 9,121  |        | 0.8235 |        |

## 【分配の推移】

| 期    | 期間                      | 1口当たりの分配金（円） |
|------|-------------------------|--------------|
| 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       |
| 第34期 | 2020年11月10日～2021年11月 8日 | 0.0005       |
| 当中間期 | 2021年11月 9日～2022年 5月 8日 |              |

## 【収益率の推移】

| 期 | 期間 | 収益率（％） |
|---|----|--------|
|---|----|--------|

|      |                         |       |
|------|-------------------------|-------|
| 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  |
| 第34期 | 2020年11月10日～2021年11月 8日 | 21.53 |
| 当中間期 | 2021年11月 9日～2022年 5月 8日 | 5.40  |

(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 |
| 第34期 | 2020年11月10日～2021年11月 8日 | 170,327,435   | 2,044,549,305 |
| 当中間期 | 2021年11月 9日～2022年 5月 8日 | 72,711,424    | 196,857,571   |

#### 【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2022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   | 54,447,390  | 26.34   |
| 親投資信託受益証券             | 日本   | 102,241,984 | 49.46   |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） |      | 50,016,530  | 24.20   |
| 合計（純資産総額）             |      | 206,705,904 | 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|---------------|---------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | インデックス東証<br>株式マザーファンド     | 49,084,006   | 2.1730          | 106,659,546     | 2.0830          | 102,241,984     |           |            | 49.46           |
| 日本   | 地方債証券         | 平成24年度第1<br>0回静岡県公募公債     | 18,000,000   | 100.54          | 18,097,490      | 100.54          | 18,097,490      | 0.678     | 2023/3/22  | 8.76            |
| 日本   | 地方債証券         | 第401回大阪府<br>公募公債(10<br>年) | 15,000,000   | 101.85          | 15,278,400      | 101.45          | 15,218,250      | 0.477     | 2025/10/29 | 7.36            |
| 日本   | 地方債証券         | 平成26年度第1<br>回滋賀県公募公債      | 11,000,000   | 101.50          | 11,165,110      | 101.18          | 11,130,350      | 0.495     | 2024/11/28 | 5.38            |
| 日本   | 地方債証券         | 平成30年度第1<br>回鹿児島県公募公債(5年) | 10,000,000   | 100.03          | 10,003,900      | 100.01          | 10,001,300      | 0.020     | 2023/10/31 | 4.84            |

## ロ. 種類別の投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 地方債証券     | 26.34   |
| 親投資信託受益証券 | 49.46   |
| 合 計       | 75.80   |

## 【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25計算期間末<br>(2012年11月 7日) | 366        | 366  | 0.6377       | 0.6382 |
| 第26計算期間末<br>(2013年11月 7日) | 436        | 437  | 0.8067       | 0.8072 |
| 第27計算期間末<br>(2014年11月 7日) | 382        | 382  | 0.8619       | 0.8624 |
| 第28計算期間末<br>(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 |
| 第34計算期間末 | (2021年11月 8日) | 212 | 213 | 1.0465 | 1.0470 |
|          | 2021年 5月末日    | 208 |     | 1.0191 |        |
|          | 6月末日          | 209 |     | 1.0238 |        |
|          | 7月末日          | 204 |     | 1.0110 |        |
|          | 8月末日          | 208 |     | 1.0258 |        |
|          | 9月末日          | 212 |     | 1.0474 |        |
|          | 10月末日         | 211 |     | 1.0388 |        |
|          | 11月末日         | 205 |     | 1.0177 |        |
|          | 12月末日         | 208 |     | 1.0335 |        |
|          | 2022年 1月末日    | 203 |     | 1.0070 |        |
|          | 2月末日          | 203 |     | 1.0034 |        |
|          | 3月末日          | 208 |     | 1.0257 |        |
|          | 4月末日          | 206 |     | 1.0121 |        |
|          | 5月末日          | 206 |     | 1.0144 |        |

## 【分配の推移】

| 期    | 期間                      | 1口当たりの分配金（円） |
|------|-------------------------|--------------|
| 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       |
| 第34期 | 2020年11月10日～2021年11月 8日 | 0.0005       |
| 当中間期 | 2021年11月 9日～2022年 5月 8日 |              |

## 【収益率の推移】

| 期    | 期間                      | 収益率（％） |
|------|-------------------------|--------|
| 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  |
| 第34期 | 2020年11月10日～2021年11月 8日 | 9.69  |
| 当中間期 | 2021年11月 9日～2022年 5月 8日 | 2.91  |

(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  |
| 第34期 | 2020年11月10日～2021年11月 8日 | 5,792,929  | 25,835,192  |
| 当中間期 | 2021年11月 9日～2022年 5月 8日 | 2,692,897  | 2,423,536   |

（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2022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   | 9,017,944,130 | 97.85   |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） |      | 197,847,681   | 2.15    |
| 合計（純資産総額）             |      | 9,215,791,811 | 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   | 171,810,000 | 1.86    |

(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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------|--------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 169,700      | 1,983.51        | 336,601,647     | 2,122.50        | 360,188,250     | 3.91            |
| 日本   | 株式 | ソニーグループ           | 電気機器   | 22,500       | 12,630.68       | 284,190,500     | 12,115.00       | 272,587,500     | 2.96            |
| 日本   | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 3,300        | 66,263.93       | 218,671,000     | 51,590.00       | 170,247,000     | 1.85            |
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 212,200      | 654.80          | 138,948,560     | 729.70          | 154,842,340     | 1.68            |
| 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 38,600       | 3,197.65        | 123,429,600     | 3,911.00        | 150,964,600     | 1.64            |
| 日本   | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 2,300        | 49,428.26       | 113,685,000     | 58,980.00       | 135,654,000     | 1.47            |
| 日本   | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 25,200       | 7,072.98        | 178,239,096     | 4,734.00        | 119,296,800     | 1.29            |
| 日本   | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 17,300       | 6,679.86        | 115,561,600     | 6,725.00        | 116,342,500     | 1.26            |
| 日本   | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 25,700       | 3,749.01        | 96,349,800      | 4,486.00        | 115,290,200     | 1.25            |
| 日本   | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 2,000        | 50,060.00       | 100,120,000     | 57,420.00       | 114,840,000     | 1.25            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 21,100       | 6,530.32        | 137,789,800     | 5,379.00        | 113,496,900     | 1.23            |
| 日本   | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 24,300       | 3,572.10        | 86,802,030      | 4,433.00        | 107,721,900     | 1.17            |
| 日本   | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 5,700        | 19,145.00       | 109,126,500     | 18,335.00       | 104,509,500     | 1.13            |
| 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 28,200       | 3,223.53        | 90,903,700      | 3,703.00        | 104,424,600     | 1.13            |
| 日本   | 株式 | HOYA              | 精密機器   | 6,900        | 16,938.18       | 116,873,500     | 13,810.00       | 95,289,000      | 1.03            |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 23,500       | 3,872.00        | 90,992,000      | 3,922.00        | 92,167,000      | 1.00            |
| 日本   | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 26,800       | 2,734.31        | 73,279,508      | 3,419.00        | 91,629,200      | 0.99            |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 26,900       | 3,416.00        | 91,890,400      | 3,187.00        | 85,730,300      | 0.93            |
| 日本   | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 4,100        | 25,396.00       | 104,123,600     | 20,685.00       | 84,808,500      | 0.92            |
| 日本   | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 26,200       | 2,587.50        | 67,792,500      | 3,232.00        | 84,678,400      | 0.92            |
| 日本   | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 10,000       | 8,509.00        | 85,090,000      | 8,300.00        | 83,000,000      | 0.90            |
| 日本   | 株式 | 伊藤忠商事             | 卸売業    | 21,900       | 3,262.00        | 71,437,800      | 3,695.00        | 80,920,500      | 0.88            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンク            | 情報・通信業 | 53,300       | 1,536.59        | 81,900,256      | 1,480.00        | 78,884,000      | 0.86            |
| 日本   | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 10,300       | 6,094.00        | 62,768,200      | 7,466.00        | 76,899,800      | 0.83            |
| 日本   | 株式 | S M C             | 機械     | 1,100        | 66,029.09       | 72,632,000      | 66,610.00       | 73,271,000      | 0.80            |
| 日本   | 株式 | オリエンタルランド         | サービス業  | 3,800        | 17,989.35       | 68,359,530      | 19,200.00       | 72,960,000      | 0.79            |
| 日本   | 株式 | 日本電産              | 電気機器   | 8,400        | 12,491.53       | 104,928,852     | 8,679.00        | 72,903,600      | 0.79            |
| 日本   | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業    | 12,500       | 4,773.00        | 59,662,500      | 5,410.00        | 67,625,000      | 0.73            |
| 日本   | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 43,400       | 1,555.50        | 67,508,700      | 1,519.00        | 65,924,600      | 0.72            |

|    |    |       |      |       |           |            |           |            |      |
|----|----|-------|------|-------|-----------|------------|-----------|------------|------|
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 3,100 | 24,370.00 | 75,547,000 | 21,105.00 | 65,425,500 | 0.71 |
|----|----|-------|------|-------|-----------|------------|-----------|------------|------|

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類         | 国内/国外 | 業種       | 投資比率(%) |
|------------|-------|----------|---------|
| 株式         | 国内    | 水産・農林業   | 0.09    |
|            |       | 鉱業       | 0.36    |
|            |       | 建設業      | 2.08    |
|            |       | 食料品      | 3.15    |
|            |       | 繊維製品     | 0.43    |
|            |       | パルプ・紙    | 0.18    |
|            |       | 化学       | 6.25    |
|            |       | 医薬品      | 5.07    |
|            |       | 石油・石炭製品  | 0.52    |
|            |       | ゴム製品     | 0.69    |
|            |       | ガラス・土石製品 | 0.70    |
|            |       | 鉄鋼       | 0.83    |
|            |       | 非鉄金属     | 0.75    |
|            |       | 金属製品     | 0.59    |
|            |       | 機械       | 5.29    |
|            |       | 電気機器     | 17.93   |
|            |       | 輸送用機器    | 7.80    |
|            |       | 精密機器     | 2.68    |
|            |       | その他製品    | 2.37    |
|            |       | 電気・ガス業   | 1.21    |
|            |       | 陸運業      | 2.88    |
|            |       | 海運業      | 0.67    |
|            |       | 空運業      | 0.42    |
|            |       | 倉庫・運輸関連業 | 0.19    |
|            |       | 情報・通信業   | 8.77    |
|            |       | 卸売業      | 5.59    |
|            |       | 小売業      | 4.01    |
| 銀行業        | 5.05  |          |         |
| 証券、商品先物取引業 | 0.72  |          |         |
| 保険業        | 2.21  |          |         |
| その他金融業     | 1.14  |          |         |
| 不動産業       | 1.94  |          |         |
| サービス業      | 5.29  |          |         |
| 合計         |       |          | 97.85   |

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 2022年06月 | 買建 |    | 9日本円 | 174,089,950 | 171,810,000 | 1.86    |

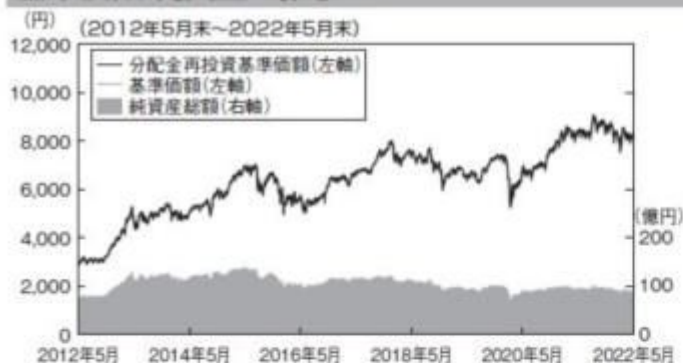
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績(インデックスポートフォリオ)

2022年5月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 .....8,235円

純資産総額 .....91.21億円

※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、2012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)

| 2017年11月 | 2018年11月 | 2019年11月 | 2020年11月 | 2021年11月 | 設定来累計 |
|----------|----------|----------|----------|----------|-------|
| 5円       | 5円       | 5円       | 5円       | 5円       | 170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    | 97.77% |
| 株式先物  | 1.86%  |
| 債券    | —      |
| 債券先物  | —      |
| 現金その他 | 2.23%  |

※当ファンドの実質組入比率です。

## &lt;組入上位10銘柄&gt;

## 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  | 3.91% |
| 2 ソニーグループ          | 電気機器   | 2.96% |
| 3 キーエンス            | 電気機器   | 1.85% |
| 4 三菱UFJフィナンシャルグループ | 銀行業    | 1.68% |
| 5 日本電信電話           | 情報・通信業 | 1.64% |
| 6 東京エレクトロン         | 電気機器   | 1.47% |
| 7 リクルートホールディングス    | サービス業  | 1.29% |
| 8 日立製作所            | 電気機器   | 1.26% |
| 9 KDDI             | 情報・通信業 | 1.25% |
| 10 任天堂             | その他製品  | 1.25% |

※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。

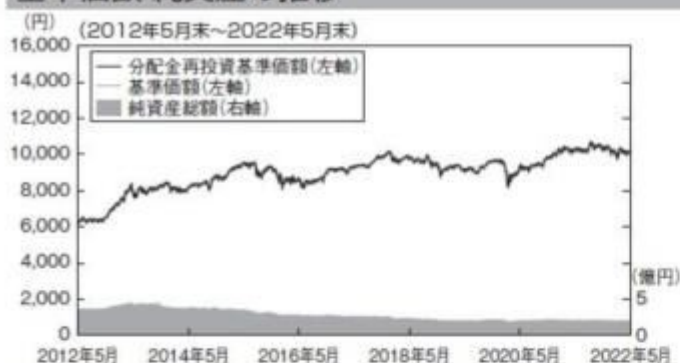
※2022年は、2022年5月末までの騰落率です。

※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)

2022年5月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 ..... 10,144円

純資産総額 ..... 2.06億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2012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)

| 2017年11月 | 2018年11月 | 2019年11月 | 2020年11月 | 2021年11月 | 設定未累計 |
|----------|----------|----------|----------|----------|-------|
| 5円       | 5円       | 5円       | 5円       | 5円       | 170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    | 48.40% |
| 株式先物  | 0.92%  |
| 債券    | 26.34% |
| 債券先物  | 0.00%  |
| 現金その他 | 25.26% |

※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     | 親投資信託受益証券 | —      | —           | 49.46% |
| 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  | 8.76%  |
| 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 | 7.36%  |
| 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 | 5.38%  |
| 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 | 4.84%  |

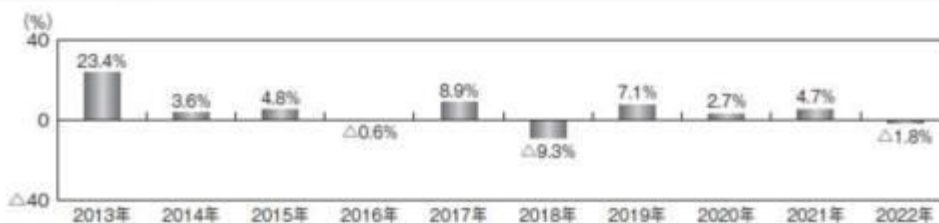
※当ファンドの対純資産総額比です。

## 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  | 3.91% |
| 2 ソニーグループ          | 電気機器   | 2.96% |
| 3 キーエンス            | 電気機器   | 1.85% |
| 4 三菱UFJフィナンシャルグループ | 銀行業    | 1.68% |
| 5 日本電信電話           | 情報・通信業 | 1.64% |

※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。

※2022年は、2022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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

## 2【換金(解約)手続等】

### <解約請求による換金>

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(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。

### <買取請求による換金>

## (1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

## (2) 買取制限

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

## (3) 買取価額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

## (4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

## (5) 買取単位

1口単位

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

## (6) 受付の中止および取消

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

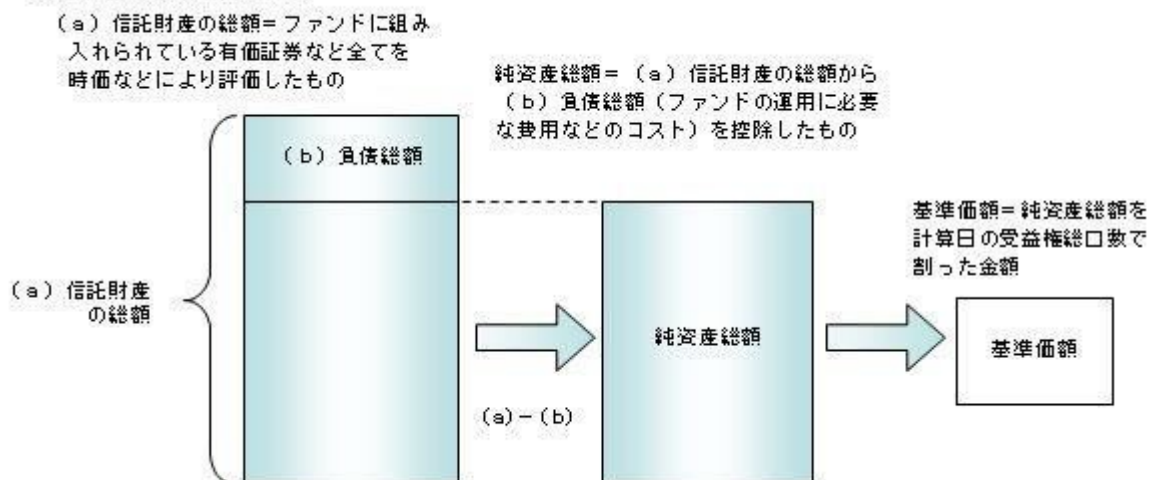
## 3【資産管理等の概要】

## (1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

|               |  |
|---------------|--|
| インデックスポートフォリオ | マザーファンド受益証券<br>基準価額計算日の基準価額で評価します。<br>国内上場株式<br>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<br>基準価額計算日の基準価額で評価します。<br>国内上場株式<br>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。<br>公社債（国内・外国）<br>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。<br>a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）<br>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。）<br>c) 価格情報会社の提供する価額<br>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。<br><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。

< 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。

## （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。

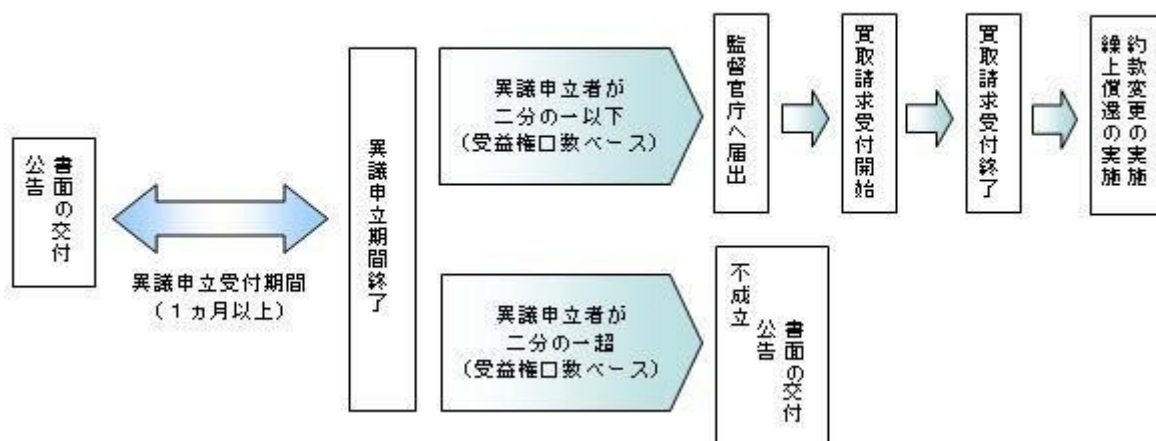
信託約款の変更

- 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、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知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34期計算期間（2020年11月10日から2021年11月8日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【インデックスポートフォリオ】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

|                  | 第33期<br>2020年11月 9日現在 | 第34期<br>2021年11月 8日現在 |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>資産の部</b>      |                       |                       |
| 流動資産             |                       |                       |
| コール・ローン          | 84,370,205            | 89,580,335            |
| 親投資信託受益証券        | 9,416,916,044         | 9,764,564,850         |
| 未収入金             | 4,172,077             | 1,364,283             |
| 流動資産合計           | 9,505,458,326         | 9,855,509,468         |
| 資産合計             | 9,505,458,326         | 9,855,509,468         |
| <b>負債の部</b>      |                       |                       |
| 流動負債             |                       |                       |
| 未払収益分配金          | 6,535,141             | 5,598,030             |
| 未払解約金            | 34,878,965            | 2,343,824             |
| 未払受託者報酬          | 4,023,525             | 4,273,559             |
| 未払委託者報酬          | 72,424,571            | 76,925,218            |
| 未払利息             | 61                    | 48                    |
| その他未払費用          | 201,116               | 213,619               |
| 流動負債合計           | 118,063,379           | 89,354,298            |
| 負債合計             | 118,063,379           | 89,354,298            |
| <b>純資産の部</b>     |                       |                       |
| 元本等              |                       |                       |
| 元本               | 13,070,282,130        | 11,196,060,260        |
| 剰余金              |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金 ( ) | 3,682,887,183         | 1,429,905,090         |
| ( 分配準備積立金 )      | 2,274,004,168         | 3,224,063,371         |
| 元本等合計            | 9,387,394,947         | 9,766,155,170         |
| 純資産合計            | 9,387,394,947         | 9,766,155,170         |
| 負債純資産合計          | 9,505,458,326         | 9,855,509,468         |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

|   | 第33期             |                  | 第34期             |                  |
|---|------------------|------------------|------------------|------------------|
|   | 自<br>2019年11月 8日 | 至<br>2020年11月 9日 | 自<br>2020年11月10日 | 至<br>2021年11月 8日 |
| 営業収益                                      |                  |                  |                  |                  |
| 受取利息                                      |                  | 27               |                  | 78               |
| 有価証券売買等損益                                 |                  | 108,094,208      |                  | 2,054,710,777    |
| 営業収益合計                                    |                  | 108,094,235      |                  | 2,054,710,855    |
| 営業費用                                      |                  |                  |                  |                  |
| 支払利息                                      |                  | 12,849           |                  | 5,508            |
| 受託者報酬                                     |                  | 8,067,849        |                  | 8,466,078        |
| 委託者報酬                                     |                  | 145,223,485      |                  | 152,391,629      |
| その他費用                                     |                  | 403,320          |                  | 423,189          |
| 営業費用合計                                    |                  | 153,707,503      |                  | 161,286,404      |
| 営業利益又は営業損失( )                             |                  | 45,613,268       |                  | 1,893,424,451    |
| 経常利益又は経常損失( )                             |                  | 45,613,268       |                  | 1,893,424,451    |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |                  | 45,613,268       |                  | 1,893,424,451    |
| 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( ) |                  | 37,198,244       |                  | 178,570,079      |
| 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                            |                  | 362,644,534      |                  | 575,440,882      |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                  | 362,644,534      |                  | 575,440,882      |
| 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                            |                  | 73,600,929       |                  | 31,715,131       |
| 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                   |                  | 73,600,929       |                  | 31,715,131       |
| 分配金                                       |                  | 6,535,141        |                  | 5,598,030        |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           |                  | 3,682,887,183    |                  | 1,429,905,090    |

## (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<br>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礎となる事項 | 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2020年11月10日から2021年11月8日までとなっております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

|    |                                  | 第33期<br>2020年11月9日現在 | 第34期<br>2021年11月8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         | 170,327,435円         |
|    | 期中一部解約元本額                        | 1,294,592,956円       | 2,044,549,305円       |
| 2. | 受益権の総数                           | 13,070,282,130口      | 11,196,060,260口      |
| 3. | 元本の欠損<br>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       | 1,429,905,090円       |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第33期<br>自 2019年11月8日<br>至 2020年11月9日 |                              | 第34期<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年11月8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<br>配当等収益      | 0円                                    | A 計算期末における費用控除後の<br>配当等収益 0円                  |
| B                                    | 費用控除後、繰越欠損金補填後<br>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<br>の有価証券売買等損益 1,309,631,325円 |
| C                                    | 信託約款に定める収益調整金                | 1,702,878,166円                        | C 信託約款に定める収益調整金 1,486,589,180円                |
| D                                    | 信託約款に定める分配準備積立<br>金          | 2,280,539,309円                        | D 信託約款に定める分配準備積立<br>金 1,920,030,076円          |
| E                                    | 分配対象収益(A+B+C+D)              | 3,983,417,475円                        | E 分配対象収益(A+B+C+D) 4,716,250,581円              |
| F                                    | 分配対象収益(1万口当たり)               | 3,047円                                | F 分配対象収益(1万口当たり) 4,212円                       |
| G                                    | 分配金額                         | 6,535,141円                            | G 分配金額 5,598,030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33期<br>自 2019年11月 8日<br>至 2020年11月 9日  | 第34期<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年11月 8日 |
|-----------------------|---|--|
| 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                                     |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、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33期<br>2020年11月 9日現在   | 第34期<br>2021年11月 8日現在                                    |
|-------------------------|---|--|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。   | 同左   |
| 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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       |

第34期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 1,862,682,315     |
| 合計        | 1,862,682,315     |

（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33期<br>2020年11月 9日現在 |          | 第34期<br>2021年11月 8日現在 |          |
|-----------------------|----------|-----------------------|----------|
| 1口当たり純資産額             | 0.7182円  | 1口当たり純資産額             | 0.8723円  |
| (1万口当たり純資産額)          | (7,182円) | (1万口当たり純資産額)          | (8,723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 | 4,466,864,067 | 9,764,564,850 |  |
| 合計        |                   | 4,466,864,067 | 9,764,564,850 |  |

(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33期<br>2020年11月 9日現在 | 第34期<br>2021年11月 8日現在 |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>資産の部</b>      |                       |                       |
| 流動資産             |                       |                       |
| コール・ローン          | 52,717,478            | 52,712,505            |
| 地方債証券            | 54,824,130            | 54,614,090            |
| 親投資信託受益証券        | 107,693,399           | 107,506,555           |
| 未収利息             | 42,818                | 42,134                |
| 流動資産合計           | 215,277,825           | 214,875,284           |
| 資産合計             | 215,277,825           | 214,875,284           |
| <b>負債の部</b>      |                       |                       |
| 流動負債             |                       |                       |
| 未払収益分配金          | 111,785               | 101,764               |
| 未払受託者報酬          | 93,025                | 93,519                |
| 未払委託者報酬          | 1,675,571             | 1,684,503             |
| 未払利息             | 38                    | 28                    |
| その他未払費用          | 4,605                 | 4,618                 |
| 流動負債合計           | 1,885,024             | 1,884,432             |
| 負債合計             | 1,885,024             | 1,884,432             |
| <b>純資産の部</b>     |                       |                       |
| 元本等              |                       |                       |
| 元本               | 223,571,562           | 203,529,299           |
| 剰余金              |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金 ( ) | 10,178,761            | 9,461,553             |
| ( 分配準備積立金 )      | 25,581,671            | 34,724,773            |
| 元本等合計            | 213,392,801           | 212,990,852           |
| 純資産合計            | 213,392,801           | 212,990,852           |
| 負債純資産合計          | 215,277,825           | 214,875,284           |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第33期             |                  | 第34期             |                  |
|---|------------------|------------------|------------------|------------------|
|   | 自<br>2019年11月 8日 | 至<br>2020年11月 9日 | 自<br>2020年11月10日 | 至<br>2021年11月 8日 |
| 営業収益                                      |                  |                  |                  |                  |
| 受取利息                                      |                  | 246,495          |                  | 249,452          |
| 有価証券売買等損益                                 |                  | 2,942,853        |                  | 23,206,824       |
| 営業収益合計                                    |                  | 3,189,348        |                  | 23,456,276       |
| 営業費用                                      |                  |                  |                  |                  |
| 支払利息                                      |                  | 14,297           |                  | 6,235            |
| 受託者報酬                                     |                  | 184,052          |                  | 186,258          |
| 委託者報酬                                     |                  | 3,315,124        |                  | 3,354,962        |
| その他費用                                     |                  | 9,232            |                  | 9,203            |
| 営業費用合計                                    |                  | 3,522,705        |                  | 3,556,658        |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |                  | 333,357          |                  | 19,899,618       |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |                  | 333,357          |                  | 19,899,618       |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |                  | 333,357          |                  | 19,899,618       |
| 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（ ） |                  | 210,060          |                  | 1,404,604        |
| 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                            |                  | 467,009          |                  | 1,247,064        |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                  | 467,009          |                  | 1,166,470        |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                  | -                |                  | 80,594           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |                  | 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                   |                  | 522,633          |                  | -                |
| 分配金                                       |                  | 111,785          |                  | 101,764          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |                  | 10,178,761       |                  | 9,461,553        |

## (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>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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礎となる事項 | <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2020年11月10日から2021年11月8日までとなっております。</p>  |

## (貸借対照表に関する注記)

|    |                                  | 第33期<br>2020年11月9日現在 | 第34期<br>2021年11月8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           | 5,792,929円           |
|    | 期中一部解約元本額                        | 10,651,253円          | 25,835,192円          |
| 2. | 受益権の総数                           | 223,571,562口         | 203,529,299口         |
| 3. | 元本の欠損<br>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                  |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第33期<br>自 2019年11月8日<br>至 2020年11月9日 |                         | 第34期<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年11月8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<br>配当等収益 | 0円                                    | A 計算期末における費用控除後の<br>配当等収益 203,202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 | 11,969,130円 |
| C 信託約款に定める収益調整金            | 33,989,225円 | C 信託約款に定める収益調整金            | 31,576,641円 |
| D 信託約款に定める分配準備積立金          | 25,693,456円 | D 信託約款に定める分配準備積立金          | 22,654,205円 |
| E 分配対象収益(A+B+C+D)          | 59,682,681円 | E 分配対象収益(A+B+C+D)          | 66,403,178円 |
| F 分配対象収益(1万口当たり)           | 2,669円      | F 分配対象収益(1万口当たり)           | 3,262円      |
| G 分配金額                     | 111,785円    | G 分配金額                     | 101,764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33期<br>自 2019年11月 8日<br>至 2020年11月 9日  | 第34期<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年11月 8日 |
|-----------------------|---|--|
| 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                                     |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、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33期<br>2020年11月 9日現在  | 第34期<br>2021年11月 8日現在 |
|-------------------|--|-----------------------|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。                                  | 同左                    |
| 時価の算定方法           | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 | (1)有価証券<br>同左         |

|                         |   |   |
|-------------------------|---|---|
|                         | (2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。                   | (2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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         |

第34期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 地方債証券     | 210,040           |
| 親投資信託受益証券 | 20,507,883        |
| 合計        | 20,297,843        |

## （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33期<br>2020年11月 9日現在 |          | 第34期<br>2021年11月 8日現在 |           |
|-----------------------|----------|-----------------------|-----------|
| 1口当たり純資産額             | 0.9545円  | 1口当たり純資産額             | 1.0465円   |
| (1万口当たり純資産額)          | (9,545円) | (1万口当たり純資産額)          | (10,465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  | 15,278,400  |    |
|              | 平成24年度第10回静岡県公募公債     | 18,000,000  | 18,166,680  |    |
|              | 平成26年度第1回滋賀県公募公債      | 11,000,000  | 11,165,110  |    |
|              | 平成30年度第1回鹿児島県公募公債(5年) | 10,000,000  | 10,003,900  |    |
| 地方債証券 合計     |                       | 54,000,000  | 54,614,090  |    |
| 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     | 49,179,577  | 107,506,555 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                       | 49,179,577  | 107,506,555 |    |
|              | 合計                    | 103,179,577 | 162,120,645 |    |

(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)        |               |
|--------------|---------------|---------------|
|              | 2020年11月 9日現在 | 2021年11月 8日現在 |
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 流動資産         |               |               |
| 金銭信託         | 993,497       | 806,211       |
| コール・ローン      | 58,507,336    | 47,909,393    |
| 株式           | 9,358,426,120 | 9,744,487,560 |
| 派生商品評価勘定     | 3,096,150     | 937,250       |
| 未収入金         | 30,486,960    | -             |
| 未収配当金        | 81,498,829    | 82,395,476    |
| 流動資産合計       | 9,533,008,892 | 9,876,535,890 |
| 資産合計         | 9,533,008,892 | 9,876,535,890 |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 流動負債         |               |               |
| 派生商品評価勘定     | -             | 675,550       |
| 前受金          | 1,665,000     | 385,000       |
| 未払解約金        | 4,172,077     | 1,364,283     |
| 未払利息         | 42            | 25            |
| 流動負債合計       | 5,837,119     | 2,424,858     |
| 負債合計         | 5,837,119     | 2,424,858     |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 元本等          |               |               |
| 元本           | 5,384,177,187 | 4,516,043,644 |
| 剰余金          |               |               |
| 剰余金又は欠損金( )  | 4,142,994,586 | 5,358,067,388 |
| 元本等合計        | 9,527,171,773 | 9,874,111,032 |
| 純資産合計        | 9,527,171,773 | 9,874,111,032 |
| 負債純資産合計      | 9,533,008,892 | 9,876,535,890 |

### 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<br/>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<br/>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> |
|--------------------|--|



|                       |  |
|-----------------------|--|
|                       | 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | デリバティブ取引<br>個別法に基づき原則として時価で評価しております。   |

## (貸借対照表に関する注記)

|    |   | 2020年11月 9日現在  | 2021年11月 8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    | 18,387,773円    |
|    | 期首からの一部解約元本額                                      | 577,876,333円   | 886,521,316円   |
|    | 元本の内訳   |                |                |
|    | インデックスポートフォリオ                                     | 5,323,299,064円 | 4,466,864,067円 |
|    | バランスポートフォリオ                                       | 60,878,123円    | 49,179,577円    |
|    | 計   | 5,384,177,187円 | 4,516,043,644円 |
| 2. | 受益権の総数  | 5,384,177,187口 | 4,516,043,644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    | 102,746,700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 2019年11月 8日<br>至 2020年11月 9日  | 自 2020年11月10日<br>至 2021年11月 8日 |
|-----------------------|---|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                             |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、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

|                         | 2020年11月 9日現在   | 2021年11月 8日現在  |
|-------------------------|---|--|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 同左   |
| 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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)

(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       |

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----|-------------------|
| 株式 | 168,586,790       |
| 合計 | 168,586,790       |

(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)

(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 |

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

| 区分   | 種類       | 契約額等        |       | 時価          | 評価損益    |
|------|----------|-------------|-------|-------------|---------|
|      |          |             | うち1年超 |             |         |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 |             |       |             |         |
|      | 買建       | 121,745,000 | -     | 122,010,000 | 265,000 |
| 合計   |          | 121,745,000 | -     | 122,010,000 | 265,000 |

(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)

| 2020年11月 9日現在 |          | 2021年11月 8日現在 |          |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 1口当たり純資産額     | 1.769円   | 1口当たり純資産額     | 2.186円   |
| (1千口当たり純資産額)  | (1,769円) | (1千口当たり純資産額)  | (2,186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    | 3,065.00 | 613,000    |    |
| 日本水産             | 4,800  | 629.00   | 3,019,200  |    |
| マルハニチロ           | 700    | 2,588.00 | 1,811,600  |    |
| 雪国まいたけ           | 300    | 1,413.00 | 423,900    |    |
| カネコ種苗            | 100    | 1,494.00 | 149,400    |    |
| サカタのタネ           | 600    | 3,370.00 | 2,022,000  |    |
| ホクト              | 400    | 1,957.00 | 782,800    |    |
| ホクリヨウ            | 100    | 748.00   | 74,800     |    |
| 住石ホールディングス       | 800    | 139.00   | 111,200    |    |
| 日鉄鉱業             | 100    | 6,500.00 | 650,000    |    |
| 三井松島ホールディングス     | 200    | 1,389.00 | 277,800    |    |
| I N P E X        | 19,000 | 970.00   | 18,430,000 |    |
| 石油資源開発           | 600    | 2,208.00 | 1,324,800  |    |
| K & O エナジーグループ   | 200    | 1,605.00 | 321,000    |    |
| ヒノキヤグループ         | 100    | 2,342.00 | 234,200    |    |
| ショーボンドホールディングス   | 700    | 4,815.00 | 3,370,500  |    |
| ミライト・ホールディングス    | 1,500  | 2,189.00 | 3,283,500  |    |
| タマホーム            | 300    | 2,279.00 | 683,700    |    |
| サンヨーホームズ         | 100    | 729.00   | 72,900     |    |
| 日本アクア            | 200    | 625.00   | 125,000    |    |
| ファーストコーポレーション    | 200    | 777.00   | 155,400    |    |
| ベステラ             | 100    | 1,409.00 | 140,900    |    |
| キャンディル           | 100    | 520.00   | 52,000     |    |
| スペースバリューホールディングス | 500    | 928.00   | 464,000    |    |
| ダイセキ環境ソリューション    | 100    | 1,911.00 | 191,100    |    |
| 第一カッター興業         | 100    | 1,398.00 | 139,800    |    |
| 安藤・間             | 2,600  | 753.00   | 1,957,800  |    |
| 東急建設             | 1,400  | 804.00   | 1,125,600  |    |
| コムシスホールディングス     | 1,500  | 2,844.00 | 4,266,000  |    |

|                 |        |           |            |
|-----------------|--------|-----------|------------|
| ビーアールホールディングス   | 600    | 432.00    | 259,200    |
| 高松コンストラクショングループ | 300    | 2,006.00  | 601,800    |
| 東建コーポレーション      | 100    | 9,340.00  | 934,000    |
| ソネック            | 100    | 1,083.00  | 108,300    |
| ヤマウラ            | 200    | 928.00    | 185,600    |
| オリエンタル白石        | 1,700  | 271.00    | 460,700    |
| 大成建設            | 3,200  | 3,465.00  | 11,088,000 |
| 大林組             | 11,000 | 900.00    | 9,900,000  |
| 清水建設            | 10,300 | 809.00    | 8,332,700  |
| 飛鳥建設            | 300    | 1,056.00  | 316,800    |
| 長谷工コーポレーション     | 3,300  | 1,516.00  | 5,002,800  |
| 松井建設            | 500    | 728.00    | 364,000    |
| 銭高組             | 100    | 4,080.00  | 408,000    |
| 鹿島建設            | 8,000  | 1,359.00  | 10,872,000 |
| 不動テトラ           | 200    | 1,817.00  | 363,400    |
| 大末建設            | 100    | 1,120.00  | 112,000    |
| 鉄建建設            | 200    | 1,820.00  | 364,000    |
| 西松建設            | 700    | 3,340.00  | 2,338,000  |
| 三井住友建設          | 2,500  | 493.00    | 1,232,500  |
| 大豊建設            | 200    | 3,740.00  | 748,000    |
| 佐田建設            | 300    | 481.00    | 144,300    |
| ナカノフドー建設        | 300    | 339.00    | 101,700    |
| 奥村組             | 600    | 2,976.00  | 1,785,600  |
| 東鉄工業            | 500    | 2,504.00  | 1,252,000  |
| イチケン            | 100    | 1,908.00  | 190,800    |
| 富士ピー・エス         | 200    | 533.00    | 106,600    |
| 浅沼組             | 100    | 4,575.00  | 457,500    |
| 戸田建設            | 4,600  | 722.00    | 3,321,200  |
| 熊谷組             | 600    | 2,809.00  | 1,685,400  |
| 北野建設            | 100    | 2,167.00  | 216,700    |
| 植木組             | 100    | 1,473.00  | 147,300    |
| 矢作建設工業          | 500    | 731.00    | 365,500    |
| ピーエス三菱          | 400    | 682.00    | 272,800    |
| 日本ハウスホールディングス   | 700    | 379.00    | 265,300    |
| 大東建託            | 1,100  | 13,510.00 | 14,861,000 |
| 新日本建設           | 500    | 850.00    | 425,000    |
| N I P P O       | 900    | 4,040.00  | 3,636,000  |
| 東亜道路工業          | 100    | 5,140.00  | 514,000    |
| 日本道路            | 100    | 8,050.00  | 805,000    |
| 東亜建設工業          | 300    | 2,563.00  | 768,900    |
| 日本国土開発          | 1,100  | 586.00    | 644,600    |
| 若築建設            | 200    | 2,017.00  | 403,400    |

|                 |        |          |            |  |
|-----------------|--------|----------|------------|--|
| 東洋建設            | 1,200  | 569.00   | 682,800    |  |
| 五洋建設            | 4,400  | 788.00   | 3,467,200  |  |
| 世紀東急工業          | 600    | 810.00   | 486,000    |  |
| 福田組             | 100    | 4,535.00 | 453,500    |  |
| 住友林業            | 2,800  | 2,325.00 | 6,510,000  |  |
| 日本基礎技術          | 300    | 483.00   | 144,900    |  |
| 巴コーポレーション       | 500    | 457.00   | 228,500    |  |
| 大和ハウス工業         | 10,100 | 3,615.00 | 36,511,500 |  |
| ライト工業           | 700    | 2,018.00 | 1,412,600  |  |
| 積水ハウス           | 11,900 | 2,409.50 | 28,673,050 |  |
| 日特建設            | 200    | 696.00   | 139,200    |  |
| 北陸電気工事          | 200    | 1,030.00 | 206,000    |  |
| ユアテック           | 600    | 653.00   | 391,800    |  |
| 日本リーテック         | 200    | 1,496.00 | 299,200    |  |
| 四電工             | 100    | 1,606.00 | 160,600    |  |
| 中電工             | 500    | 2,180.00 | 1,090,000  |  |
| 関電工             | 1,800  | 874.00   | 1,573,200  |  |
| きんでん            | 2,500  | 1,846.00 | 4,615,000  |  |
| 東京エネシス          | 400    | 1,084.00 | 433,600    |  |
| トーエネック          | 100    | 3,340.00 | 334,000    |  |
| 住友電設            | 300    | 2,095.00 | 628,500    |  |
| 日本電設工業          | 600    | 1,727.00 | 1,036,200  |  |
| エクシオグループ        | 1,700  | 2,678.00 | 4,552,600  |  |
| 新日本空調           | 300    | 2,353.00 | 705,900    |  |
| 九電工             | 900    | 3,505.00 | 3,154,500  |  |
| 三機工業            | 700    | 1,447.00 | 1,012,900  |  |
| 日揮ホールディングス      | 3,400  | 1,099.00 | 3,736,600  |  |
| 中外炉工業           | 100    | 1,728.00 | 172,800    |  |
| ヤマト             | 300    | 766.00   | 229,800    |  |
| 太平電業            | 200    | 2,652.00 | 530,400    |  |
| 高砂熱学工業          | 1,000  | 2,076.00 | 2,076,000  |  |
| 朝日工業社           | 100    | 3,420.00 | 342,000    |  |
| 明星工業            | 700    | 658.00   | 460,600    |  |
| 大気社             | 500    | 3,260.00 | 1,630,000  |  |
| ダイダン            | 200    | 2,302.00 | 460,400    |  |
| 日比谷総合設備         | 400    | 1,958.00 | 783,200    |  |
| フィル・カンパニー       | 100    | 2,848.00 | 284,800    |  |
| テスホールディングス      | 200    | 2,474.00 | 494,800    |  |
| インフロニア・ホールディングス | 4,700  | 929.00   | 4,366,300  |  |
| 東洋エンジニアリング      | 500    | 860.00   | 430,000    |  |
| レイズネクスト         | 500    | 1,229.00 | 614,500    |  |
| ニッポン            | 1,000  | 1,617.00 | 1,617,000  |  |

|                          |        |          |            |
|--------------------------|--------|----------|------------|
| 日清製粉グループ本社               | 4,000  | 1,751.00 | 7,004,000  |
| 日東富士製粉                   | 100    | 3,515.00 | 351,500    |
| 昭和産業                     | 300    | 2,779.00 | 833,700    |
| 鳥越製粉                     | 300    | 767.00   | 230,100    |
| 中部飼料                     | 400    | 1,066.00 | 426,400    |
| フィード・ワン                  | 500    | 760.00   | 380,000    |
| 東洋精糖                     | 100    | 1,164.00 | 116,400    |
| 日本甜菜製糖                   | 200    | 1,643.00 | 328,600    |
| D M三井製糖ホールディングス          | 300    | 1,964.00 | 589,200    |
| 塩水港精糖                    | 500    | 219.00   | 109,500    |
| 日新製糖                     | 200    | 1,703.00 | 340,600    |
| 森永製菓                     | 800    | 3,965.00 | 3,172,000  |
| 中村屋                      | 100    | 3,735.00 | 373,500    |
| 江崎グリコ                    | 1,000  | 3,950.00 | 3,950,000  |
| 名糖産業                     | 200    | 1,710.00 | 342,000    |
| 井村屋グループ                  | 200    | 2,309.00 | 461,800    |
| 不二家                      | 200    | 2,343.00 | 468,600    |
| 山崎製パン                    | 2,600  | 1,680.00 | 4,368,000  |
| 第一屋製パン                   | 100    | 696.00   | 69,600     |
| モロゾフ                     | 100    | 5,440.00 | 544,000    |
| 亀田製菓                     | 200    | 4,490.00 | 898,000    |
| 寿スピリッツ                   | 300    | 7,500.00 | 2,250,000  |
| カルビー                     | 1,600  | 2,873.00 | 4,596,800  |
| 森永乳業                     | 700    | 6,660.00 | 4,662,000  |
| 六甲バター                    | 300    | 1,668.00 | 500,400    |
| ヤクルト本社                   | 2,600  | 5,850.00 | 15,210,000 |
| 明治ホールディングス               | 2,300  | 7,150.00 | 16,445,000 |
| 雪印メグミルク                  | 800    | 2,209.00 | 1,767,200  |
| プリマハム                    | 400    | 2,572.00 | 1,028,800  |
| 日本ハム                     | 1,300  | 4,070.00 | 5,291,000  |
| 林兼産業                     | 100    | 589.00   | 58,900     |
| 丸大食品                     | 300    | 1,719.00 | 515,700    |
| S Foods                  | 300    | 3,435.00 | 1,030,500  |
| 柿安本店                     | 100    | 2,581.00 | 258,100    |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 2,300  | 689.00   | 1,584,700  |
| サッポロホールディングス             | 1,200  | 2,457.00 | 2,948,400  |
| アサヒグループホールディングス          | 8,200  | 5,180.00 | 42,476,000 |
| キリンホールディングス              | 12,900 | 2,006.00 | 25,877,400 |
| 宝ホールディングス                | 2,400  | 1,536.00 | 3,686,400  |
| オエノンホールディングス             | 1,000  | 380.00   | 380,000    |
| 養命酒製造                    | 100    | 1,816.00 | 181,600    |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 2,500  | 1,601.00 | 4,002,500  |

|                   |        |          |            |
|-------------------|--------|----------|------------|
| サントリー食品インターナショナル  | 2,400  | 4,425.00 | 10,620,000 |
| ダイドーグループホールディングス  | 200    | 5,520.00 | 1,104,000  |
| 伊藤園               | 1,100  | 7,590.00 | 8,349,000  |
| キーコーヒー            | 300    | 2,212.00 | 663,600    |
| ユニカフェ             | 100    | 1,096.00 | 109,600    |
| ジャパンフーズ           | 100    | 1,219.00 | 121,900    |
| 日清オイリオグループ        | 400    | 3,000.00 | 1,200,000  |
| 不二製油グループ本社        | 800    | 2,716.00 | 2,172,800  |
| J・オイルミルズ          | 300    | 1,760.00 | 528,000    |
| キッコーマン            | 2,500  | 9,440.00 | 23,600,000 |
| 味の素               | 7,700  | 3,406.00 | 26,226,200 |
| ブルドックソース          | 200    | 2,165.00 | 433,000    |
| キューピー             | 1,900  | 2,517.00 | 4,782,300  |
| ハウス食品グループ本社       | 1,300  | 3,110.00 | 4,043,000  |
| カゴメ               | 1,300  | 2,970.00 | 3,861,000  |
| 焼津水産化学工業          | 200    | 987.00   | 197,400    |
| アリアケジャパン          | 300    | 7,150.00 | 2,145,000  |
| ピエトロ              | 100    | 1,779.00 | 177,900    |
| エバラ食品工業           | 100    | 2,479.00 | 247,900    |
| ニチレイ              | 1,700  | 2,722.00 | 4,627,400  |
| 東洋水産              | 1,700  | 4,895.00 | 8,321,500  |
| イトアンドホールディングス     | 100    | 2,184.00 | 218,400    |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 200    | 793.00   | 158,600    |
| 日清食品ホールディングス      | 1,400  | 8,960.00 | 12,544,000 |
| 永谷園ホールディングス       | 200    | 2,050.00 | 410,000    |
| 一正蒲鉾              | 100    | 910.00   | 91,000     |
| フジッコ              | 400    | 1,905.00 | 762,000    |
| ロック・フィールド         | 400    | 1,766.00 | 706,400    |
| 日本たばこ産業           | 18,800 | 2,344.00 | 44,067,200 |
| ケンコーマヨネーズ         | 200    | 1,499.00 | 299,800    |
| わらべや日洋ホールディングス    | 200    | 2,156.00 | 431,200    |
| なとり               | 200    | 1,958.00 | 391,600    |
| イフジ産業             | 100    | 962.00   | 96,200     |
| ピックルスコーポレーション     | 200    | 1,818.00 | 363,600    |
| ファーマフーズ           | 300    | 2,636.00 | 790,800    |
| ユーグレナ             | 1,800  | 858.00   | 1,544,400  |
| 紀文食品              | 200    | 1,186.00 | 237,200    |
| ミヨシ油脂             | 100    | 1,311.00 | 131,100    |
| 理研ビタミン            | 400    | 1,801.00 | 720,400    |
| 片倉工業              | 400    | 1,822.00 | 728,800    |
| ゲンゼ               | 200    | 4,335.00 | 867,000    |
| 東洋紡               | 1,400  | 1,371.00 | 1,919,400  |



|                |        |          |            |
|----------------|--------|----------|------------|
| ユニチカ           | 1,000  | 357.00   | 357,000    |
| 富士紡ホールディングス    | 200    | 4,120.00 | 824,000    |
| 倉敷紡績           | 300    | 1,905.00 | 571,500    |
| シキボウ           | 200    | 921.00   | 184,200    |
| 日本毛織           | 1,000  | 916.00   | 916,000    |
| ダイトウボウ         | 600    | 99.00    | 59,400     |
| トーア紡コーポレーション   | 100    | 436.00   | 43,600     |
| ダイドーリミテッド      | 500    | 170.00   | 85,000     |
| 帝国繊維           | 400    | 2,083.00 | 833,200    |
| 帝人             | 3,200  | 1,495.00 | 4,784,000  |
| 東レ             | 24,800 | 757.40   | 18,783,520 |
| 住江織物           | 100    | 1,770.00 | 177,000    |
| 日本フェルト         | 200    | 442.00   | 88,400     |
| アツギ            | 300    | 646.00   | 193,800    |
| ダイニック          | 100    | 762.00   | 76,200     |
| セーレン           | 700    | 2,383.00 | 1,668,100  |
| ソトー            | 100    | 827.00   | 82,700     |
| 小松マテーレ         | 600    | 1,082.00 | 649,200    |
| ワコールホールディングス   | 800    | 2,218.00 | 1,774,400  |
| ホギメディカル        | 500    | 3,095.00 | 1,547,500  |
| クラウディアホールディングス | 100    | 285.00   | 28,500     |
| T S Iホールディングス  | 1,200  | 379.00   | 454,800    |
| マツオカコーポレーション   | 100    | 1,403.00 | 140,300    |
| ワールド           | 400    | 1,512.00 | 604,800    |
| 三陽商会           | 200    | 903.00   | 180,600    |
| ナイガイ           | 100    | 326.00   | 32,600     |
| オンワードホールディングス  | 2,000  | 370.00   | 740,000    |
| ルックホールディングス    | 100    | 1,432.00 | 143,200    |
| ゴールドウイン        | 600    | 7,270.00 | 4,362,000  |
| デサント           | 700    | 4,435.00 | 3,104,500  |
| キング            | 200    | 540.00   | 108,000    |
| ヤマトインターナショナル   | 300    | 311.00   | 93,300     |
| 特種東海製紙         | 200    | 4,380.00 | 876,000    |
| 王子ホールディングス     | 14,300 | 572.00   | 8,179,600  |
| 日本製紙           | 1,600  | 1,172.00 | 1,875,200  |
| 三菱製紙           | 500    | 350.00   | 175,000    |
| 北越コーポレーション     | 2,200  | 748.00   | 1,645,600  |
| 中越パルプ工業        | 100    | 1,150.00 | 115,000    |
| 巴川製紙所          | 100    | 834.00   | 83,400     |
| 大王製紙           | 1,700  | 2,079.00 | 3,534,300  |
| 阿波製紙           | 100    | 380.00   | 38,000     |
| レンゴー           | 3,200  | 828.00   | 2,649,600  |

|              |        |           |             |
|--------------|--------|-----------|-------------|
| トーマック        | 200    | 1,870.00  | 374,000     |
| ザ・バック        | 300    | 2,893.00  | 867,900     |
| 北の達人コーポレーション | 1,200  | 417.00    | 500,400     |
| クラレ          | 5,000  | 1,044.00  | 5,220,000   |
| 旭化成          | 22,600 | 1,171.00  | 26,464,600  |
| 共和レザー        | 200    | 662.00    | 132,400     |
| 昭和電工         | 3,000  | 2,819.00  | 8,457,000   |
| 住友化学         | 25,100 | 583.00    | 14,633,300  |
| 住友精化         | 100    | 3,300.00  | 330,000     |
| 日産化学         | 1,900  | 6,540.00  | 12,426,000  |
| ラサ工業         | 100    | 1,914.00  | 191,400     |
| クレハ          | 300    | 8,020.00  | 2,406,000   |
| 多木化学         | 100    | 6,080.00  | 608,000     |
| テイカ          | 300    | 1,316.00  | 394,800     |
| 石原産業         | 600    | 1,286.00  | 771,600     |
| 片倉コープアグリ     | 100    | 1,175.00  | 117,500     |
| 日本曹達         | 400    | 3,320.00  | 1,328,000   |
| 東ソー          | 4,900  | 1,815.00  | 8,893,500   |
| トクヤマ         | 1,100  | 2,022.00  | 2,224,200   |
| セントラル硝子      | 600    | 2,119.00  | 1,271,400   |
| 東亜合成         | 1,900  | 1,255.00  | 2,384,500   |
| 大阪ソーダ        | 300    | 2,773.00  | 831,900     |
| 関東電化工業       | 700    | 1,040.00  | 728,000     |
| デンカ          | 1,300  | 3,685.00  | 4,790,500   |
| 信越化学工業       | 5,900  | 20,230.00 | 119,357,000 |
| 日本カーバイド工業    | 100    | 1,384.00  | 138,400     |
| 堺化学工業        | 200    | 2,168.00  | 433,600     |
| 第一稀元素化学工業    | 300    | 1,475.00  | 442,500     |
| エア・ウォーター     | 3,200  | 1,761.00  | 5,635,200   |
| 日本酸素ホールディングス | 3,300  | 2,711.00  | 8,946,300   |
| 日本化学工業       | 100    | 2,915.00  | 291,500     |
| 東邦アセチレン      | 100    | 1,219.00  | 121,900     |
| 日本パーカライジング   | 1,700  | 1,141.00  | 1,939,700   |
| 高圧ガス工業       | 500    | 765.00    | 382,500     |
| 四国化成工業       | 400    | 1,417.00  | 566,800     |
| 戸田工業         | 100    | 3,370.00  | 337,000     |
| ステラ ケミファ     | 200    | 2,826.00  | 565,200     |
| 保土谷化学工業      | 100    | 5,270.00  | 527,000     |
| 日本触媒         | 600    | 5,650.00  | 3,390,000   |
| 大日精化工業       | 300    | 2,622.00  | 786,600     |
| カネカ          | 900    | 4,365.00  | 3,928,500   |
| 三菱瓦斯化学       | 3,200  | 2,195.00  | 7,024,000   |

|                |        |          |            |
|----------------|--------|----------|------------|
| 三井化学           | 3,100  | 3,420.00 | 10,602,000 |
| J S R          | 3,200  | 4,200.00 | 13,440,000 |
| 東京応化工業         | 600    | 7,490.00 | 4,494,000  |
| 大阪有機化学工業       | 300    | 3,460.00 | 1,038,000  |
| 三菱ケミカルホールディングス | 22,800 | 945.30   | 21,552,840 |
| K Hネオケム        | 600    | 3,330.00 | 1,998,000  |
| ダイセル           | 4,900  | 841.00   | 4,120,900  |
| 住友ベークライト       | 500    | 5,360.00 | 2,680,000  |
| 積水化学工業         | 7,200  | 1,911.00 | 13,759,200 |
| 日本ゼオン          | 3,100  | 1,338.00 | 4,147,800  |
| アイカ工業          | 1,000  | 3,415.00 | 3,415,000  |
| 宇部興産           | 1,600  | 2,119.00 | 3,390,400  |
| 積水樹脂           | 500    | 2,143.00 | 1,071,500  |
| タキロンシーアイ       | 700    | 570.00   | 399,000    |
| 旭有機材           | 200    | 1,469.00 | 293,800    |
| ニチバン           | 200    | 1,908.00 | 381,600    |
| リケンテクノス        | 800    | 540.00   | 432,000    |
| 大倉工業           | 200    | 2,134.00 | 426,800    |
| 積水化成成品工業       | 400    | 534.00   | 213,600    |
| 群栄化学工業         | 100    | 3,245.00 | 324,500    |
| タイガースポリマー      | 200    | 432.00   | 86,400     |
| ミライアル          | 100    | 1,572.00 | 157,200    |
| ダイキアクシス        | 100    | 920.00   | 92,000     |
| ダイキョーニシカワ      | 700    | 700.00   | 490,000    |
| 竹本容器           | 100    | 864.00   | 86,400     |
| 森六ホールディングス     | 200    | 1,871.00 | 374,200    |
| 恵和             | 100    | 5,200.00 | 520,000    |
| 日本化薬           | 2,700  | 1,234.00 | 3,331,800  |
| カーリットホールディングス  | 300    | 772.00   | 231,600    |
| 日本精化           | 300    | 2,036.00 | 610,800    |
| 扶桑化学工業         | 300    | 4,840.00 | 1,452,000  |
| トリケミカル研究所      | 300    | 3,430.00 | 1,029,000  |
| A D E K A      | 1,600  | 2,584.00 | 4,134,400  |
| 日油             | 1,200  | 5,890.00 | 7,068,000  |
| 新日本理化          | 500    | 302.00   | 151,000    |
| ハリマ化成グループ      | 200    | 864.00   | 172,800    |
| 花王             | 7,700  | 6,310.00 | 48,587,000 |
| 第一工業製薬         | 100    | 3,435.00 | 343,500    |
| 石原ケミカル         | 200    | 1,449.00 | 289,800    |
| 日華化学           | 100    | 905.00   | 90,500     |
| ニイタカ           | 100    | 2,340.00 | 234,000    |
| 三洋化成工業         | 200    | 5,480.00 | 1,096,000  |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| 有機合成薬品工業         | 200    | 304.00    | 60,800     |
| 大日本塗料            | 400    | 850.00    | 340,000    |
| 日本ペイントホールディングス   | 12,900 | 1,191.00  | 15,363,900 |
| 関西ペイント           | 3,500  | 2,620.00  | 9,170,000  |
| 神東塗料             | 200    | 189.00    | 37,800     |
| 中国塗料             | 800    | 844.00    | 675,200    |
| 日本特殊塗料           | 200    | 1,019.00  | 203,800    |
| 藤倉化成             | 400    | 529.00    | 211,600    |
| 太陽ホールディングス       | 500    | 3,075.00  | 1,537,500  |
| D I C            | 1,400  | 3,050.00  | 4,270,000  |
| サカタインクス          | 700    | 1,091.00  | 763,700    |
| 東洋インキS Cホールディングス | 700    | 2,015.00  | 1,410,500  |
| T & K T O K A    | 300    | 825.00    | 247,500    |
| 富士フィルムホールディングス   | 6,100  | 9,104.00  | 55,534,400 |
| 資生堂              | 6,500  | 7,825.00  | 50,862,500 |
| ライオン             | 4,200  | 1,798.00  | 7,551,600  |
| 高砂香料工業           | 200    | 2,930.00  | 586,000    |
| マンダム             | 700    | 1,712.00  | 1,198,400  |
| ミルボン             | 400    | 6,840.00  | 2,736,000  |
| ファンケル            | 1,400  | 3,665.00  | 5,131,000  |
| コーセー             | 700    | 14,030.00 | 9,821,000  |
| コタ               | 200    | 1,577.00  | 315,400    |
| シーボン             | 100    | 1,819.00  | 181,900    |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 1,500  | 2,364.00  | 3,546,000  |
| ノエビアホールディングス     | 300    | 5,690.00  | 1,707,000  |
| アジュバンホールディングス    | 100    | 1,251.00  | 125,100    |
| 新日本製薬            | 100    | 1,671.00  | 167,100    |
| エステー             | 200    | 1,604.00  | 320,800    |
| アグロ カネショウ        | 100    | 1,335.00  | 133,500    |
| コニシ              | 600    | 1,757.00  | 1,054,200  |
| 長谷川香料            | 600    | 2,786.00  | 1,671,600  |
| 星光P M C          | 200    | 777.00    | 155,400    |
| 小林製薬             | 1,000  | 9,470.00  | 9,470,000  |
| 荒川化学工業           | 300    | 1,196.00  | 358,800    |
| メック              | 300    | 3,310.00  | 993,000    |
| 日本高純度化学          | 100    | 2,823.00  | 282,300    |
| タカラバイオ           | 900    | 3,005.00  | 2,704,500  |
| J C U            | 400    | 4,655.00  | 1,862,000  |
| 新田ゼラチン           | 200    | 618.00    | 123,600    |
| O A T アグリオ       | 100    | 2,050.00  | 205,000    |
| デクセリアルズ          | 900    | 3,285.00  | 2,956,500  |
| アース製薬            | 300    | 6,900.00  | 2,070,000  |

|                 |        |          |            |
|-----------------|--------|----------|------------|
| 北興化学工業          | 300    | 988.00   | 296,400    |
| 大成ラミック          | 100    | 2,790.00 | 279,000    |
| クミアイ化学工業        | 1,300  | 866.00   | 1,125,800  |
| 日本農薬            | 600    | 545.00   | 327,000    |
| アキレス            | 200    | 1,330.00 | 266,000    |
| 有沢製作所           | 500    | 954.00   | 477,000    |
| 日東電工            | 2,100  | 8,800.00 | 18,480,000 |
| レック             | 400    | 993.00   | 397,200    |
| 三光合成            | 400    | 417.00   | 166,800    |
| きもと             | 500    | 231.00   | 115,500    |
| 藤森工業            | 300    | 4,730.00 | 1,419,000  |
| 前澤化成工業          | 200    | 1,299.00 | 259,800    |
| 未来工業            | 100    | 1,668.00 | 166,800    |
| ウェーブロックホールディングス | 100    | 718.00   | 71,800     |
| JSP             | 200    | 1,596.00 | 319,200    |
| エフピコ            | 600    | 3,780.00 | 2,268,000  |
| 天馬              | 300    | 2,714.00 | 814,200    |
| 信越ポリマー          | 600    | 1,021.00 | 612,600    |
| 東リ              | 800    | 232.00   | 185,600    |
| ニフコ             | 1,200  | 3,665.00 | 4,398,000  |
| バルカー            | 300    | 2,485.00 | 745,500    |
| ユニ・チャーム         | 6,700  | 4,649.00 | 31,148,300 |
| ショーエイコーポレーション   | 100    | 787.00   | 78,700     |
| 協和キリン           | 4,100  | 3,790.00 | 15,539,000 |
| 武田薬品工業          | 27,500 | 3,246.00 | 89,265,000 |
| アステラス製薬         | 30,300 | 1,984.50 | 60,130,350 |
| 大日本住友製薬         | 2,200  | 1,555.00 | 3,421,000  |
| 塩野義製薬           | 4,400  | 7,087.00 | 31,182,800 |
| わかもと製薬          | 500    | 317.00   | 158,500    |
| 日本新薬            | 900    | 9,060.00 | 8,154,000  |
| 中外製薬            | 10,900 | 4,100.00 | 44,690,000 |
| 科研製薬            | 600    | 4,200.00 | 2,520,000  |
| エーザイ            | 4,200  | 8,315.00 | 34,923,000 |
| ロート製薬           | 1,800  | 3,440.00 | 6,192,000  |
| 小野薬品工業          | 8,000  | 2,441.50 | 19,532,000 |
| 久光製薬            | 900    | 3,860.00 | 3,474,000  |
| 持田製薬            | 400    | 3,310.00 | 1,324,000  |
| 参天製薬            | 6,500  | 1,632.00 | 10,608,000 |
| 扶桑薬品工業          | 100    | 2,557.00 | 255,700    |
| ツムラ             | 1,100  | 3,605.00 | 3,965,500  |
| 日医工             | 1,100  | 889.00   | 977,900    |
| キッセイ薬品工業        | 600    | 2,340.00 | 1,404,000  |

|                  |        |          |            |
|------------------|--------|----------|------------|
| 生化学工業            | 600    | 1,005.00 | 603,000    |
| 栄研化学             | 600    | 1,872.00 | 1,123,200  |
| 日水製薬             | 100    | 967.00   | 96,700     |
| 鳥居薬品             | 200    | 2,941.00 | 588,200    |
| JCRファーマ          | 1,000  | 2,839.00 | 2,839,000  |
| 東和薬品             | 500    | 2,983.00 | 1,491,500  |
| 富士製薬工業           | 200    | 1,159.00 | 231,800    |
| ゼリア新薬工業          | 600    | 2,083.00 | 1,249,800  |
| 第一三共             | 27,500 | 2,791.00 | 76,752,500 |
| キョーリン製薬ホールディングス  | 700    | 1,761.00 | 1,232,700  |
| 大幸薬品             | 600    | 768.00   | 460,800    |
| ダイト              | 200    | 3,120.00 | 624,000    |
| 大塚ホールディングス       | 7,300  | 4,499.00 | 32,842,700 |
| 大正製薬ホールディングス     | 800    | 6,060.00 | 4,848,000  |
| ペプチドリーム          | 1,800  | 2,660.00 | 4,788,000  |
| あすか製薬ホールディングス    | 400    | 1,012.00 | 404,800    |
| サワイグループホールディングス  | 800    | 5,060.00 | 4,048,000  |
| 日本コークス工業         | 3,000  | 138.00   | 414,000    |
| ニチレキ             | 400    | 1,321.00 | 528,400    |
| ユシロ化学工業          | 200    | 1,179.00 | 235,800    |
| ビーピー・カストロール      | 100    | 1,406.00 | 140,600    |
| 富士石油             | 900    | 268.00   | 241,200    |
| MORESCO          | 100    | 1,182.00 | 118,200    |
| 出光興産             | 3,900  | 3,155.00 | 12,304,500 |
| ENEOSホールディングス    | 52,500 | 465.70   | 24,449,250 |
| コスモエネルギーホールディングス | 1,000  | 2,305.00 | 2,305,000  |
| 横浜ゴム             | 2,000  | 2,037.00 | 4,074,000  |
| TOYO TIRE        | 1,800  | 1,980.00 | 3,564,000  |
| ブリヂストン           | 10,100 | 5,158.00 | 52,095,800 |
| 住友ゴム工業           | 3,100  | 1,493.00 | 4,628,300  |
| 藤倉コンポジット         | 300    | 752.00   | 225,600    |
| オカモト             | 200    | 3,995.00 | 799,000    |
| フコク              | 100    | 1,015.00 | 101,500    |
| ニッタ              | 400    | 2,717.00 | 1,086,800  |
| 住友理工             | 700    | 634.00   | 443,800    |
| 三ツ星ベルト           | 400    | 2,006.00 | 802,400    |
| バンドー化学           | 600    | 890.00   | 534,000    |
| 日東紡績             | 500    | 3,420.00 | 1,710,000  |
| AGC              | 3,200  | 5,800.00 | 18,560,000 |
| 日本板硝子            | 1,600  | 607.00   | 971,200    |
| 石塚硝子             | 100    | 2,115.00 | 211,500    |
| 日本山村硝子           | 100    | 843.00   | 84,300     |

|                    |        |           |            |
|--------------------|--------|-----------|------------|
| 日本電気硝子             | 1,400  | 2,737.00  | 3,831,800  |
| オハラ                | 100    | 1,402.00  | 140,200    |
| 住友大阪セメント           | 600    | 3,365.00  | 2,019,000  |
| 太平洋セメント            | 2,000  | 2,466.00  | 4,932,000  |
| 日本ヒューム             | 300    | 744.00    | 223,200    |
| 日本コンクリート工業         | 600    | 295.00    | 177,000    |
| 三谷セキサン             | 200    | 8,120.00  | 1,624,000  |
| アジアパイルホールディングス     | 500    | 455.00    | 227,500    |
| 東海カーボン             | 2,900  | 1,361.00  | 3,946,900  |
| 日本カーボン             | 200    | 4,355.00  | 871,000    |
| 東洋炭素               | 200    | 3,230.00  | 646,000    |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 200    | 5,020.00  | 1,004,000  |
| TOTO               | 2,500  | 5,420.00  | 13,550,000 |
| 日本碍子               | 3,800  | 1,961.00  | 7,451,800  |
| 日本特殊陶業             | 2,700  | 1,936.00  | 5,227,200  |
| ダントーホールディングス       | 200    | 233.00    | 46,600     |
| MARUWA             | 100    | 13,330.00 | 1,333,000  |
| 品川リフラクトリーズ         | 100    | 3,705.00  | 370,500    |
| 黒崎播磨               | 100    | 4,245.00  | 424,500    |
| ヨータイ               | 200    | 1,270.00  | 254,000    |
| イソライト工業            | 100    | 853.00    | 85,300     |
| 東京窯業               | 400    | 323.00    | 129,200    |
| ニッカトー              | 100    | 760.00    | 76,000     |
| フジインコーポレーテッド       | 300    | 7,500.00  | 2,250,000  |
| クニミネ工業             | 100    | 1,112.00  | 111,200    |
| エーアンドエーマテリアル       | 100    | 953.00    | 95,300     |
| ニチアス               | 800    | 2,811.00  | 2,248,800  |
| ニチハ                | 500    | 3,200.00  | 1,600,000  |
| 日本製鉄               | 15,400 | 1,918.00  | 29,537,200 |
| 神戸製鋼所              | 5,900  | 609.00    | 3,593,100  |
| 中山製鋼所              | 500    | 446.00    | 223,000    |
| 合同製鐵               | 200    | 1,435.00  | 287,000    |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 9,300  | 1,500.00  | 13,950,000 |
| 東京製鐵               | 1,200  | 1,195.00  | 1,434,000  |
| 共英製鋼               | 400    | 1,351.00  | 540,400    |
| 大和工業               | 700    | 3,560.00  | 2,492,000  |
| 東京鐵鋼               | 100    | 1,463.00  | 146,300    |
| 大阪製鐵               | 200    | 1,101.00  | 220,200    |
| 淀川製鋼所              | 400    | 2,431.00  | 972,400    |
| 丸一鋼管               | 1,200  | 2,602.00  | 3,122,400  |
| モリ工業               | 100    | 2,730.00  | 273,000    |
| 大同特殊鋼              | 600    | 4,165.00  | 2,499,000  |

|                 |        |          |            |
|-----------------|--------|----------|------------|
| 日本高周波鋼業         | 100    | 385.00   | 38,500     |
| 日本冶金工業          | 200    | 2,336.00 | 467,200    |
| 山陽特殊製鋼          | 300    | 2,049.00 | 614,700    |
| 愛知製鋼            | 200    | 2,663.00 | 532,600    |
| 日立金属            | 3,700  | 2,152.00 | 7,962,400  |
| 日本金属            | 100    | 1,019.00 | 101,900    |
| 大太平洋金属          | 200    | 2,130.00 | 426,000    |
| 新日本電工           | 2,200  | 357.00   | 785,400    |
| 栗本鐵工所           | 200    | 1,587.00 | 317,400    |
| 三菱製鋼            | 200    | 1,056.00 | 211,200    |
| 日亜鋼業            | 400    | 287.00   | 114,800    |
| 日本精線            | 100    | 4,650.00 | 465,000    |
| エンビプロ・ホールディングス  | 100    | 2,471.00 | 247,100    |
| シンニッタン          | 400    | 230.00   | 92,000     |
| 新家工業            | 100    | 1,721.00 | 172,100    |
| 大紀アルミニウム工業所     | 500    | 1,610.00 | 805,000    |
| 日本軽金属ホールディングス   | 900    | 1,825.00 | 1,642,500  |
| 三井金属鉱業          | 900    | 3,205.00 | 2,884,500  |
| 東邦亜鉛            | 200    | 2,937.00 | 587,400    |
| 三菱マテリアル         | 2,300  | 2,212.00 | 5,087,600  |
| 住友金属鉱山          | 4,400  | 4,434.00 | 19,509,600 |
| D O W Aホールディングス | 900    | 4,795.00 | 4,315,500  |
| 古河機械金属          | 600    | 1,264.00 | 758,400    |
| エス・サイエンス        | 1,700  | 30.00    | 51,000     |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ  | 400    | 865.00   | 346,000    |
| 東邦チタニウム         | 600    | 1,142.00 | 685,200    |
| U A C J         | 500    | 2,807.00 | 1,403,500  |
| C Kサンエツ         | 100    | 3,380.00 | 338,000    |
| 古河電気工業          | 1,100  | 2,467.00 | 2,713,700  |
| 住友電気工業          | 12,900 | 1,524.00 | 19,659,600 |
| フジクラ            | 3,800  | 620.00   | 2,356,000  |
| 昭和電線ホールディングス    | 300    | 1,969.00 | 590,700    |
| 東京特殊電線          | 100    | 2,853.00 | 285,300    |
| タツタ電線           | 600    | 504.00   | 302,400    |
| カナレ電気           | 100    | 1,720.00 | 172,000    |
| 平河ヒューテック        | 200    | 1,215.00 | 243,000    |
| リョービ            | 400    | 1,183.00 | 473,200    |
| アーレスティ          | 400    | 395.00   | 158,000    |
| アサヒホールディングス     | 1,400  | 2,061.00 | 2,885,400  |
| 稲葉製作所           | 200    | 1,357.00 | 271,400    |
| 宮地エンジニアリンググループ  | 100    | 2,631.00 | 263,100    |
| トーカロ            | 900    | 1,355.00 | 1,219,500  |



|                  |       |           |            |
|------------------|-------|-----------|------------|
| アルファC o          | 100   | 1,238.00  | 123,800    |
| SUMCO            | 5,300 | 2,427.00  | 12,863,100 |
| 川田テクノロジーズ        | 100   | 3,810.00  | 381,000    |
| RS Technologies  | 100   | 6,590.00  | 659,000    |
| 信和               | 200   | 790.00    | 158,000    |
| 東洋製罐グループホールディングス | 2,200 | 1,465.00  | 3,223,000  |
| ホッカンホールディングス     | 200   | 1,513.00  | 302,600    |
| コロナ              | 200   | 903.00    | 180,600    |
| 横河ブリッジホールディングス   | 600   | 2,194.00  | 1,316,400  |
| 駒井ハルテック          | 100   | 1,614.00  | 161,400    |
| 三和ホールディングス       | 3,300 | 1,299.00  | 4,286,700  |
| 文化シャッター          | 1,100 | 1,083.00  | 1,191,300  |
| 三協立山             | 400   | 746.00    | 298,400    |
| アルインコ            | 200   | 959.00    | 191,800    |
| 東洋シャッター          | 100   | 647.00    | 64,700     |
| LIXIL            | 5,400 | 2,959.00  | 15,978,600 |
| 日本フィルコン          | 200   | 546.00    | 109,200    |
| ノーリツ             | 700   | 1,831.00  | 1,281,700  |
| 長府製作所            | 300   | 2,051.00  | 615,300    |
| リンナイ             | 700   | 12,060.00 | 8,442,000  |
| ダイニチ工業           | 200   | 784.00    | 156,800    |
| 日東精工             | 400   | 658.00    | 263,200    |
| 岡部               | 700   | 675.00    | 472,500    |
| ジーテクト            | 400   | 1,437.00  | 574,800    |
| 東プレ              | 600   | 1,347.00  | 808,200    |
| 高周波熱錬            | 600   | 600.00    | 360,000    |
| 東京製綱             | 200   | 872.00    | 174,400    |
| サンコール            | 300   | 478.00    | 143,400    |
| モリテック スチール       | 200   | 414.00    | 82,800     |
| パイオラックス          | 500   | 1,667.00  | 833,500    |
| エイチワン            | 300   | 703.00    | 210,900    |
| 日本発條             | 3,200 | 876.00    | 2,803,200  |
| 中央発條             | 200   | 919.00    | 183,800    |
| 立川ブラインド工業        | 100   | 1,240.00  | 124,000    |
| 三益半導体工業          | 300   | 2,514.00  | 754,200    |
| 日本ドライケミカル        | 100   | 1,969.00  | 196,900    |
| 日本製綱所            | 1,000 | 3,455.00  | 3,455,000  |
| 三浦工業             | 1,500 | 4,445.00  | 6,667,500  |
| タクマ              | 1,200 | 1,505.00  | 1,806,000  |
| ツガミ              | 800   | 1,547.00  | 1,237,600  |
| オークマ             | 400   | 5,470.00  | 2,188,000  |
| 芝浦機械             | 400   | 2,707.00  | 1,082,800  |

|              |       |           |            |
|--------------|-------|-----------|------------|
| アマダ          | 5,500 | 1,157.00  | 6,363,500  |
| アイダエンジニアリング  | 900   | 1,045.00  | 940,500    |
| 滝澤鉄工所        | 100   | 1,133.00  | 113,300    |
| F U J I      | 1,600 | 2,744.00  | 4,390,400  |
| 牧野フライス製作所    | 400   | 3,915.00  | 1,566,000  |
| オーエスジー       | 1,600 | 1,890.00  | 3,024,000  |
| 旭ダイヤモンド工業    | 900   | 714.00    | 642,600    |
| D M G 森精機    | 2,100 | 2,041.00  | 4,286,100  |
| ソディック        | 800   | 875.00    | 700,000    |
| ディスコ         | 500   | 32,700.00 | 16,350,000 |
| 日東工器         | 200   | 1,857.00  | 371,400    |
| 日進工具         | 300   | 1,584.00  | 475,200    |
| パンチ工業        | 300   | 583.00    | 174,900    |
| 富士ダイス        | 200   | 640.00    | 128,000    |
| 豊和工業         | 200   | 813.00    | 162,600    |
| O K K        | 100   | 350.00    | 35,000     |
| 石川製作所        | 100   | 1,464.00  | 146,400    |
| 東洋機械金属       | 200   | 575.00    | 115,000    |
| 津田駒工業        | 100   | 810.00    | 81,000     |
| エンシュウ        | 100   | 718.00    | 71,800     |
| 島精機製作所       | 500   | 2,257.00  | 1,128,500  |
| オプトラン        | 400   | 2,362.00  | 944,800    |
| N C ホールディングス | 100   | 1,602.00  | 160,200    |
| イワキポンプ       | 200   | 1,077.00  | 215,400    |
| フリー          | 300   | 1,633.00  | 489,900    |
| ヤマシンフィルタ     | 700   | 648.00    | 453,600    |
| 日阪製作所        | 400   | 861.00    | 344,400    |
| やまびこ         | 700   | 1,284.00  | 898,800    |
| 野村マイクロ・サイエンス | 100   | 5,100.00  | 510,000    |
| 平田機工         | 200   | 7,030.00  | 1,406,000  |
| ペガサスミシン製造    | 400   | 517.00    | 206,800    |
| マルマエ         | 100   | 2,422.00  | 242,200    |
| タツモ          | 200   | 1,746.00  | 349,200    |
| ナブテスコ        | 2,000 | 3,650.00  | 7,300,000  |
| 三井海洋開発       | 400   | 1,609.00  | 643,600    |
| レオン自動機       | 400   | 1,395.00  | 558,000    |
| S M C        | 1,000 | 71,400.00 | 71,400,000 |
| ホソカワミクロン     | 200   | 3,165.00  | 633,000    |
| ユニオンツール      | 100   | 3,900.00  | 390,000    |
| オイレス工業       | 500   | 1,700.00  | 850,000    |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 100   | 3,820.00  | 382,000    |
| サトーホールディングス  | 500   | 2,611.00  | 1,305,500  |

|                |        |           |             |
|----------------|--------|-----------|-------------|
| 技研製作所          | 300    | 4,420.00  | 1,326,000   |
| 日本エアージェット      | 200    | 1,262.00  | 252,400     |
| カワタ            | 100    | 981.00    | 98,100      |
| 日精樹脂工業         | 200    | 1,119.00  | 223,800     |
| オカダアイヨン        | 100    | 1,272.00  | 127,200     |
| ワイエイシイホールディングス | 100    | 951.00    | 95,100      |
| 小松製作所          | 15,800 | 3,103.00  | 49,027,400  |
| 住友重機械工業        | 2,000  | 2,950.00  | 5,900,000   |
| 日立建機           | 1,400  | 3,715.00  | 5,201,000   |
| 日工             | 500    | 661.00    | 330,500     |
| 巴工業            | 100    | 2,278.00  | 227,800     |
| 井関農機           | 300    | 1,671.00  | 501,300     |
| TOWA           | 300    | 2,654.00  | 796,200     |
| 丸山製作所          | 100    | 1,531.00  | 153,100     |
| 北川鉄工所          | 200    | 1,582.00  | 316,400     |
| ローツェ           | 200    | 12,120.00 | 2,424,000   |
| タカキタ           | 100    | 663.00    | 66,300      |
| クボタ            | 17,000 | 2,285.00  | 38,845,000  |
| 荏原実業           | 200    | 2,661.00  | 532,200     |
| 三菱化工機          | 100    | 2,489.00  | 248,900     |
| 月島機械           | 600    | 1,158.00  | 694,800     |
| 帝国電機製作所        | 200    | 1,440.00  | 288,000     |
| 東京機械製作所        | 200    | 1,700.00  | 340,000     |
| 新東工業           | 800    | 737.00    | 589,600     |
| 澁谷工業           | 300    | 3,005.00  | 901,500     |
| アイチ コーポレーション   | 500    | 803.00    | 401,500     |
| 小森コーポレーション     | 900    | 729.00    | 656,100     |
| 鶴見製作所          | 300    | 1,851.00  | 555,300     |
| 住友精密工業         | 100    | 2,367.00  | 236,700     |
| 日本ギア工業         | 100    | 289.00    | 28,900      |
| 酒井重工業          | 100    | 2,547.00  | 254,700     |
| 荏原製作所          | 1,500  | 6,470.00  | 9,705,000   |
| 西島製作所          | 300    | 929.00    | 278,700     |
| 北越工業           | 300    | 1,001.00  | 300,300     |
| ダイキン工業         | 4,500  | 25,550.00 | 114,975,000 |
| オルガノ           | 100    | 6,820.00  | 682,000     |
| トーヨーカネツ        | 100    | 2,621.00  | 262,100     |
| 栗田工業           | 1,900  | 5,850.00  | 11,115,000  |
| 椿本チエイン         | 500    | 3,195.00  | 1,597,500   |
| 大同工業           | 200    | 1,019.00  | 203,800     |
| 木村化工機          | 300    | 777.00    | 233,100     |
| アネスト岩田         | 500    | 959.00    | 479,500     |

|                 |       |           |            |  |
|-----------------|-------|-----------|------------|--|
| ダイフク            | 1,900 | 10,050.00 | 19,095,000 |  |
| サムコ             | 100   | 2,854.00  | 285,400    |  |
| 加藤製作所           | 200   | 835.00    | 167,000    |  |
| 油研工業            | 100   | 1,742.00  | 174,200    |  |
| タダノ             | 1,800 | 1,140.00  | 2,052,000  |  |
| フジテック           | 1,300 | 2,545.00  | 3,308,500  |  |
| C K D           | 1,000 | 2,415.00  | 2,415,000  |  |
| キトー             | 300   | 1,742.00  | 522,600    |  |
| 平和              | 1,000 | 2,107.00  | 2,107,000  |  |
| 理想科学工業          | 300   | 2,039.00  | 611,700    |  |
| S A N K Y O     | 800   | 2,858.00  | 2,286,400  |  |
| 日本金銭機械          | 300   | 808.00    | 242,400    |  |
| マースグループホールディングス | 200   | 1,639.00  | 327,800    |  |
| フクシマガリレイ        | 200   | 4,575.00  | 915,000    |  |
| オーイズミ           | 100   | 382.00    | 38,200     |  |
| ダイコク電機          | 200   | 1,254.00  | 250,800    |  |
| 竹内製作所           | 500   | 3,010.00  | 1,505,000  |  |
| アマノ             | 900   | 2,768.00  | 2,491,200  |  |
| J U K I         | 500   | 805.00    | 402,500    |  |
| サンデンホールディングス    | 500   | 272.00    | 136,000    |  |
| ジャノメ            | 300   | 694.00    | 208,200    |  |
| マックス            | 500   | 1,858.00  | 929,000    |  |
| グローリー           | 900   | 2,405.00  | 2,164,500  |  |
| 新晃工業            | 300   | 2,099.00  | 629,700    |  |
| 大和冷機工業          | 500   | 1,294.00  | 647,000    |  |
| セガサミーホールディングス   | 3,500 | 1,838.00  | 6,433,000  |  |
| 日本ピストンリング       | 100   | 1,328.00  | 132,800    |  |
| リケン             | 200   | 2,776.00  | 555,200    |  |
| T P R           | 500   | 1,473.00  | 736,500    |  |
| ツバキ・ナカシマ        | 800   | 1,600.00  | 1,280,000  |  |
| ホシザキ            | 1,000 | 9,680.00  | 9,680,000  |  |
| 大豊工業            | 300   | 808.00    | 242,400    |  |
| 日本精工            | 6,600 | 770.00    | 5,082,000  |  |
| N T N           | 7,500 | 236.00    | 1,770,000  |  |
| ジェイテクト          | 3,400 | 1,039.00  | 3,532,600  |  |
| 不二越             | 300   | 4,340.00  | 1,302,000  |  |
| 日本トムソン          | 1,000 | 603.00    | 603,000    |  |
| T H K           | 2,000 | 2,434.00  | 4,868,000  |  |
| ユーシン精機          | 300   | 780.00    | 234,000    |  |
| 前澤給装工業          | 200   | 1,055.00  | 211,000    |  |
| イーグル工業          | 400   | 1,233.00  | 493,200    |  |
| 前澤工業            | 200   | 665.00    | 133,000    |  |

|                   |        |           |             |
|-------------------|--------|-----------|-------------|
| 日本ピラー工業           | 400    | 2,797.00  | 1,118,800   |
| キット               | 1,200  | 787.00    | 944,400     |
| マキタ               | 4,200  | 5,253.00  | 22,062,600  |
| 三井E & Sホールディングス   | 1,200  | 441.00    | 529,200     |
| 日立造船              | 2,900  | 875.00    | 2,537,500   |
| 三菱重工業             | 5,500  | 2,919.50  | 16,057,250  |
| I H I             | 2,200  | 2,851.00  | 6,272,200   |
| サノヤスホールディングス      | 500    | 132.00    | 66,000      |
| スター精密             | 500    | 1,493.00  | 746,500     |
| 日清紡ホールディングス       | 2,100  | 901.00    | 1,892,100   |
| イビデン              | 1,800  | 6,750.00  | 12,150,000  |
| コニカミノルタ           | 7,700  | 515.00    | 3,965,500   |
| ブラザー工業            | 4,300  | 2,171.00  | 9,335,300   |
| ミネベアミツミ           | 6,000  | 3,140.00  | 18,840,000  |
| 日立製作所             | 16,800 | 7,111.00  | 119,464,800 |
| 東芝                | 6,100  | 4,975.00  | 30,347,500  |
| 三菱電機              | 34,900 | 1,534.00  | 53,536,600  |
| 富士電機              | 2,100  | 5,710.00  | 11,991,000  |
| 東洋電機製造            | 100    | 1,055.00  | 105,500     |
| 安川電機              | 3,800  | 5,130.00  | 19,494,000  |
| シンフォニアテクノロジー      | 400    | 1,374.00  | 549,600     |
| 明電舎               | 600    | 2,644.00  | 1,586,400   |
| オリジン              | 100    | 1,290.00  | 129,000     |
| 山洋電気              | 200    | 6,250.00  | 1,250,000   |
| デンヨー              | 300    | 1,978.00  | 593,400     |
| 東芝テック             | 400    | 4,580.00  | 1,832,000   |
| 芝浦メカトロニクス         | 100    | 7,780.00  | 778,000     |
| マブチモーター           | 800    | 3,805.00  | 3,044,000   |
| 日本電産              | 9,100  | 13,025.00 | 118,527,500 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 200    | 650.00    | 130,000     |
| トレックス・セミコンダクター    | 200    | 2,647.00  | 529,400     |
| 東光高岳              | 200    | 1,414.00  | 282,800     |
| ダブル・スコープ          | 1,000  | 929.00    | 929,000     |
| ダイヘン              | 400    | 4,700.00  | 1,880,000   |
| ヤーマン              | 600    | 1,418.00  | 850,800     |
| JVCケンウッド          | 2,900  | 182.00    | 527,800     |
| ミマキエンジニアリング       | 300    | 1,029.00  | 308,700     |
| I - P E X         | 200    | 2,113.00  | 422,600     |
| 日新電機              | 800    | 1,455.00  | 1,164,000   |
| 大崎電気工業            | 700    | 515.00    | 360,500     |
| オムロン              | 2,900  | 11,495.00 | 33,335,500  |
| 日東工業              | 500    | 1,674.00  | 837,000     |

|                       |        |           |             |                  |
|-----------------------|--------|-----------|-------------|------------------|
| I D E C               | 400    | 2,640.00  | 1,056,000   |                  |
| 正興電機製作所               | 100    | 1,219.00  | 121,900     |                  |
| 不二電機工業                | 100    | 1,281.00  | 128,100     |                  |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション     | 1,200  | 2,264.00  | 2,716,800   |                  |
| サクサホールディングス           | 100    | 1,427.00  | 142,700     |                  |
| メルコホールディングス           | 100    | 4,260.00  | 426,000     |                  |
| テクノメディカ               | 100    | 1,685.00  | 168,500     |                  |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディングス | 100    | 2,087.00  | 208,700     |                  |
| 日本電気                  | 4,400  | 5,650.00  | 24,860,000  |                  |
| 富士通                   | 3,100  | 20,680.00 | 64,108,000  |                  |
| 沖電気工業                 | 1,400  | 990.00    | 1,386,000   |                  |
| 岩崎通信機                 | 100    | 880.00    | 88,000      |                  |
| 電気興業                  | 200    | 2,550.00  | 510,000     |                  |
| サンケン電気                | 300    | 5,730.00  | 1,719,000   |                  |
| ナカヨ                   | 100    | 1,351.00  | 135,100     |                  |
| アイホン                  | 200    | 2,345.00  | 469,000     |                  |
| ルネサスエレクトロニクス          | 18,900 | 1,473.00  | 27,839,700  |                  |
| セイコーエプソン              | 4,300  | 1,983.00  | 8,526,900   |                  |
| ワコム                   | 2,700  | 826.00    | 2,230,200   |                  |
| アルバック                 | 600    | 6,790.00  | 4,074,000   |                  |
| アクセル                  | 200    | 758.00    | 151,600     |                  |
| E I Z O               | 300    | 4,215.00  | 1,264,500   |                  |
| 日本信号                  | 900    | 990.00    | 891,000     |                  |
| 京三製作所                 | 800    | 481.00    | 384,800     |                  |
| 能美防災                  | 500    | 2,059.00  | 1,029,500   |                  |
| ホーチキ                  | 200    | 1,287.00  | 257,400     |                  |
| 星和電機                  | 200    | 521.00    | 104,200     |                  |
| エレコム                  | 800    | 1,710.00  | 1,368,000   |                  |
| パナソニック                | 37,200 | 1,368.50  | 50,908,200  |                  |
| シャープ                  | 4,000  | 1,330.00  | 5,320,000   |                  |
| アンリツ                  | 2,300  | 1,959.00  | 4,505,700   |                  |
| 富士通ゼネラル               | 900    | 2,746.00  | 2,471,400   |                  |
| ソニーグループ               | 21,900 | 13,985.00 | 306,271,500 | 代用有価証券<br>4,300株 |
| T D K                 | 5,100  | 4,435.00  | 22,618,500  |                  |
| 帝国通信工業                | 200    | 1,394.00  | 278,800     |                  |
| タムラ製作所                | 1,300  | 703.00    | 913,900     |                  |
| アルプスアルパイン             | 3,100  | 1,130.00  | 3,503,000   |                  |
| 池上通信機                 | 100    | 775.00    | 77,500      |                  |
| 日本電波工業                | 300    | 930.00    | 279,000     |                  |
| 鈴木                    | 200    | 908.00    | 181,600     |                  |
| メイコー                  | 300    | 3,845.00  | 1,153,500   |                  |

|               |       |           |             |
|---------------|-------|-----------|-------------|
| 日本トリム         | 100   | 3,440.00  | 344,000     |
| ローランド ディー.ジー. | 200   | 3,100.00  | 620,000     |
| フォスター電機       | 300   | 809.00    | 242,700     |
| SMK           | 100   | 2,403.00  | 240,300     |
| ヨコオ           | 300   | 2,582.00  | 774,600     |
| ティアック         | 300   | 119.00    | 35,700      |
| ホシデン          | 800   | 1,350.00  | 1,080,000   |
| ヒロセ電機         | 500   | 18,950.00 | 9,475,000   |
| 日本航空電子工業      | 800   | 1,864.00  | 1,491,200   |
| TOA           | 400   | 816.00    | 326,400     |
| マクセル          | 700   | 1,361.00  | 952,700     |
| 古野電気          | 400   | 1,268.00  | 507,200     |
| ユニデンホールディングス  | 100   | 3,275.00  | 327,500     |
| スミダコーポレーション   | 300   | 1,306.00  | 391,800     |
| アイコム          | 100   | 2,407.00  | 240,700     |
| リオン           | 100   | 2,343.00  | 234,300     |
| 本多通信工業        | 300   | 448.00    | 134,400     |
| 横河電機          | 3,500 | 2,329.00  | 8,151,500   |
| 新電元工業         | 100   | 4,110.00  | 411,000     |
| アズビル          | 2,000 | 5,110.00  | 10,220,000  |
| 東亜ディーケーケー     | 200   | 844.00    | 168,800     |
| 日本光電工業        | 1,400 | 3,620.00  | 5,068,000   |
| チノー           | 100   | 1,427.00  | 142,700     |
| 共和電業          | 300   | 402.00    | 120,600     |
| 日本電子材料        | 200   | 1,927.00  | 385,400     |
| 堀場製作所         | 600   | 7,680.00  | 4,608,000   |
| アドバンテスト       | 2,600 | 10,070.00 | 26,182,000  |
| 小野測器          | 200   | 504.00    | 100,800     |
| エスベック         | 300   | 2,340.00  | 702,000     |
| キーエンス         | 3,200 | 72,460.00 | 231,872,000 |
| 日置電機          | 200   | 8,310.00  | 1,662,000   |
| シスメックス        | 3,000 | 13,950.00 | 41,850,000  |
| 日本マイクロニクス     | 600   | 1,549.00  | 929,400     |
| メガチップス        | 300   | 4,090.00  | 1,227,000   |
| OBARA GROUP   | 200   | 3,710.00  | 742,000     |
| 原田工業          | 200   | 981.00    | 196,200     |
| コーセル          | 400   | 932.00    | 372,800     |
| イリソ電子工業       | 300   | 5,260.00  | 1,578,000   |
| オブテックスグループ    | 600   | 1,511.00  | 906,600     |
| 千代田インテグレ      | 100   | 2,170.00  | 217,000     |
| アイ・オー・データ機器   | 100   | 914.00    | 91,400      |
| レーザーテック       | 1,500 | 27,475.00 | 41,212,500  |

|                     |        |           |             |
|---------------------|--------|-----------|-------------|
| スタンレー電気             | 2,500  | 3,035.00  | 7,587,500   |
| 岩崎電気                | 100    | 2,121.00  | 212,100     |
| ウシオ電機               | 1,800  | 2,323.00  | 4,181,400   |
| 岡谷電機産業              | 300    | 345.00    | 103,500     |
| ハリオス テクノ ホールディング    | 300    | 309.00    | 92,700      |
| エノモト                | 100    | 1,767.00  | 176,700     |
| 日本セラミック             | 300    | 2,927.00  | 878,100     |
| 遠藤照明                | 200    | 1,141.00  | 228,200     |
| 古河電池                | 300    | 1,526.00  | 457,800     |
| 双信電機                | 200    | 654.00    | 130,800     |
| 山一電機                | 300    | 2,033.00  | 609,900     |
| 図研                  | 200    | 4,665.00  | 933,000     |
| 日本電子                | 700    | 9,290.00  | 6,503,000   |
| カシオ計算機              | 2,500  | 1,600.00  | 4,000,000   |
| ファナック               | 3,100  | 22,630.00 | 70,153,000  |
| 日本シイエムケイ            | 700    | 470.00    | 329,000     |
| エンプラス               | 100    | 2,827.00  | 282,700     |
| 大真空                 | 400    | 1,043.00  | 417,200     |
| ローム                 | 1,600  | 11,080.00 | 17,728,000  |
| 浜松ホトニクス             | 2,500  | 6,880.00  | 17,200,000  |
| 三井ハイテック             | 300    | 8,790.00  | 2,637,000   |
| 新光電気工業              | 1,000  | 4,925.00  | 4,925,000   |
| 京セラ                 | 4,900  | 7,150.00  | 35,035,000  |
| 太陽誘電                | 1,700  | 5,920.00  | 10,064,000  |
| 村田製作所               | 10,300 | 8,461.00  | 87,148,300  |
| 双葉電子工業              | 600    | 822.00    | 493,200     |
| 北陸電気工業              | 100    | 1,020.00  | 102,000     |
| ニチコン                | 1,100  | 1,035.00  | 1,138,500   |
| 日本ケミコン              | 300    | 1,968.00  | 590,400     |
| K O A               | 500    | 1,578.00  | 789,000     |
| 市光工業                | 400    | 579.00    | 231,600     |
| 小糸製作所               | 1,900  | 6,690.00  | 12,711,000  |
| ミツバ                 | 600    | 626.00    | 375,600     |
| S C R E E Nホールディングス | 600    | 11,360.00 | 6,816,000   |
| キャノン電子              | 300    | 1,576.00  | 472,800     |
| キャノン                | 17,400 | 2,605.50  | 45,335,700  |
| リコー                 | 9,700  | 1,082.00  | 10,495,400  |
| 象印マホービン             | 900    | 1,580.00  | 1,422,000   |
| 東京エレクトロン            | 2,200  | 57,310.00 | 126,082,000 |
| トヨタ紡織               | 1,400  | 2,273.00  | 3,182,200   |
| 芦森工業                | 100    | 989.00    | 98,900      |
| ユニプレス               | 500    | 909.00    | 454,500     |



|              |         |          |             |                  |
|--------------|---------|----------|-------------|------------------|
| 豊田自動織機       | 2,800   | 9,850.00 | 27,580,000  |                  |
| モリタホールディングス  | 600     | 1,426.00 | 855,600     |                  |
| 三櫻工業         | 500     | 1,013.00 | 506,500     |                  |
| デンソー         | 7,700   | 8,301.00 | 63,917,700  |                  |
| 東海理化電機製作所    | 900     | 1,606.00 | 1,445,400   |                  |
| 川崎重工業        | 2,600   | 2,327.00 | 6,050,200   |                  |
| 名村造船所        | 1,100   | 227.00   | 249,700     |                  |
| 日本車輛製造       | 100     | 2,113.00 | 211,300     |                  |
| 三菱ロジスネクスト    | 500     | 1,017.00 | 508,500     |                  |
| 近畿車輛         | 100     | 1,084.00 | 108,400     |                  |
| 日産自動車        | 41,200  | 591.20   | 24,357,440  |                  |
| いすゞ自動車       | 11,000  | 1,593.00 | 17,523,000  |                  |
| トヨタ自動車       | 177,000 | 2,028.00 | 358,956,000 |                  |
| 日野自動車        | 4,400   | 1,104.00 | 4,857,600   |                  |
| 三菱自動車工業      | 13,000  | 370.00   | 4,810,000   |                  |
| エフテック        | 300     | 570.00   | 171,000     |                  |
| レシップホールディングス | 200     | 589.00   | 117,800     |                  |
| G M B        | 100     | 770.00   | 77,000      |                  |
| ファルテック       | 100     | 699.00   | 69,900      |                  |
| 武蔵精密工業       | 800     | 1,920.00 | 1,536,000   |                  |
| 日産車体         | 500     | 788.00   | 394,000     |                  |
| 新明和工業        | 1,000   | 919.00   | 919,000     |                  |
| 極東開発工業       | 600     | 1,551.00 | 930,600     |                  |
| トピー工業        | 300     | 1,146.00 | 343,800     |                  |
| ティラド         | 100     | 3,130.00 | 313,000     |                  |
| タチエス         | 600     | 1,416.00 | 849,600     |                  |
| N O K        | 1,700   | 1,374.00 | 2,335,800   |                  |
| フタバ産業        | 900     | 440.00   | 396,000     |                  |
| K Y B        | 400     | 3,200.00 | 1,280,000   |                  |
| 大同メタル工業      | 700     | 606.00   | 424,200     |                  |
| プレス工業        | 1,800   | 406.00   | 730,800     |                  |
| ミクニ          | 500     | 316.00   | 158,000     |                  |
| 太平洋工業        | 700     | 1,231.00 | 861,700     |                  |
| 河西工業         | 500     | 336.00   | 168,000     |                  |
| アイシン         | 2,600   | 4,150.00 | 10,790,000  |                  |
| マツダ          | 11,000  | 1,027.00 | 11,297,000  |                  |
| 今仙電機製作所      | 200     | 655.00   | 131,000     |                  |
| 本田技研工業       | 27,500  | 3,295.00 | 90,612,500  | 代用有価証券<br>4,700株 |
| スズキ          | 8,000   | 5,446.00 | 43,568,000  |                  |
| S U B A R U  | 10,000  | 2,213.00 | 22,130,000  |                  |
| 安永           | 200     | 1,083.00 | 216,600     |                  |
| ヤマハ発動機       | 4,600   | 3,050.00 | 14,030,000  |                  |

|              |        |           |             |
|--------------|--------|-----------|-------------|
| T B K        | 400    | 413.00    | 165,200     |
| エクセディ        | 500    | 1,743.00  | 871,500     |
| 豊田合成         | 1,100  | 2,358.00  | 2,593,800   |
| 愛三工業         | 600    | 832.00    | 499,200     |
| 盟和産業         | 100    | 1,020.00  | 102,000     |
| 日本プラスト       | 300    | 628.00    | 188,400     |
| ヨロズ          | 300    | 1,218.00  | 365,400     |
| エフ・シー・シー     | 600    | 1,617.00  | 970,200     |
| シマノ          | 1,400  | 31,450.00 | 44,030,000  |
| テイ・エス テック    | 1,500  | 1,458.00  | 2,187,000   |
| ジャムコ         | 200    | 1,007.00  | 201,400     |
| テルモ          | 9,900  | 4,889.00  | 48,401,100  |
| クリエートメディック   | 100    | 980.00    | 98,000      |
| 日機装          | 1,000  | 1,027.00  | 1,027,000   |
| 日本エム・ディ・エム   | 200    | 2,158.00  | 431,600     |
| 島津製作所        | 4,500  | 4,675.00  | 21,037,500  |
| J M S        | 300    | 645.00    | 193,500     |
| 長野計器         | 300    | 1,421.00  | 426,300     |
| ブイ・テクノロジー    | 200    | 4,300.00  | 860,000     |
| 東京計器         | 200    | 1,010.00  | 202,000     |
| インターアクション    | 200    | 2,363.00  | 472,600     |
| オーバル         | 300    | 256.00    | 76,800      |
| 東京精密         | 600    | 5,270.00  | 3,162,000   |
| マニー          | 1,400  | 1,855.00  | 2,597,000   |
| ニコン          | 5,300  | 1,242.00  | 6,582,600   |
| トプコン         | 1,600  | 2,041.00  | 3,265,600   |
| オリンパス        | 18,300 | 2,656.50  | 48,613,950  |
| 理研計器         | 300    | 3,170.00  | 951,000     |
| タムロン         | 300    | 2,575.00  | 772,500     |
| H O Y A      | 6,800  | 18,035.00 | 122,638,000 |
| シード          | 200    | 622.00    | 124,400     |
| ノーリツ鋼機       | 300    | 2,463.00  | 738,900     |
| エー・アンド・デイ    | 300    | 1,052.00  | 315,600     |
| 朝日インテック      | 3,800  | 2,841.00  | 10,795,800  |
| シチズン時計       | 4,100  | 496.00    | 2,033,600   |
| リズム          | 100    | 1,359.00  | 135,900     |
| 大研医器         | 300    | 560.00    | 168,000     |
| メニコン         | 1,200  | 4,345.00  | 5,214,000   |
| 松風           | 100    | 2,286.00  | 228,600     |
| セイコーホールディングス | 500    | 2,484.00  | 1,242,000   |
| ニプロ          | 2,600  | 1,162.00  | 3,021,200   |
| 中本パックス       | 100    | 1,743.00  | 174,300     |

|                   |       |           |            |
|-------------------|-------|-----------|------------|
| スノーピーク            | 200   | 6,230.00  | 1,246,000  |
| パラマウントベッドホールディングス | 700   | 2,026.00  | 1,418,200  |
| トランザクション          | 200   | 1,109.00  | 221,800    |
| 粧美堂               | 100   | 408.00    | 40,800     |
| ニホンフラッシュ          | 300   | 1,109.00  | 332,700    |
| 前田工織              | 400   | 3,500.00  | 1,400,000  |
| 永大産業              | 400   | 294.00    | 117,600    |
| アートネイチャー          | 300   | 695.00    | 208,500    |
| バンダイナムコホールディングス   | 3,100 | 9,262.00  | 28,712,200 |
| アイフィスジャパン         | 100   | 667.00    | 66,700     |
| 共立印刷              | 500   | 155.00    | 77,500     |
| SHOEI             | 300   | 5,140.00  | 1,542,000  |
| フランスベッドホールディングス   | 400   | 903.00    | 361,200    |
| パイロットコーポレーション     | 600   | 4,155.00  | 2,493,000  |
| 萩原工業              | 200   | 1,506.00  | 301,200    |
| トッパン・フォームズ        | 500   | 1,038.00  | 519,000    |
| フジシールインターナショナル    | 800   | 2,553.00  | 2,042,400  |
| タカラトミー            | 1,400 | 1,105.00  | 1,547,000  |
| 広済堂ホールディングス       | 200   | 937.00    | 187,400    |
| エステールホールディングス     | 100   | 638.00    | 63,800     |
| タカノ               | 100   | 737.00    | 73,700     |
| プロネクサス            | 200   | 1,062.00  | 212,400    |
| ホクシン              | 100   | 179.00    | 17,900     |
| ウッドワン             | 100   | 1,062.00  | 106,200    |
| 大建工業              | 200   | 2,449.00  | 489,800    |
| 凸版印刷              | 5,300 | 1,840.00  | 9,752,000  |
| 大日本印刷             | 4,100 | 2,859.00  | 11,721,900 |
| 共同印刷              | 100   | 2,620.00  | 262,000    |
| NISSHA            | 700   | 1,832.00  | 1,282,400  |
| TAKARA & COMPANY  | 100   | 1,797.00  | 179,700    |
| アシックス             | 3,100 | 2,978.00  | 9,231,800  |
| ツツミ               | 100   | 2,283.00  | 228,300    |
| ローランド             | 200   | 4,765.00  | 953,000    |
| 小松ウオール工業          | 100   | 1,967.00  | 196,700    |
| ヤマハ               | 2,100 | 6,520.00  | 13,692,000 |
| 河合楽器製作所           | 100   | 3,410.00  | 341,000    |
| クリナップ             | 300   | 545.00    | 163,500    |
| ピジョン              | 2,100 | 2,406.00  | 5,052,600  |
| キングジム             | 300   | 886.00    | 265,800    |
| リンテック             | 700   | 2,501.00  | 1,750,700  |
| イトーキ              | 600   | 385.00    | 231,000    |
| 任天堂               | 2,000 | 49,260.00 | 98,520,000 |

|              |        |           |            |
|--------------|--------|-----------|------------|
| 三菱鉛筆         | 600    | 1,285.00  | 771,000    |
| タカスタンダード     | 700    | 1,453.00  | 1,017,100  |
| コクヨ          | 1,700  | 1,729.00  | 2,939,300  |
| ナカバヤシ        | 300    | 551.00    | 165,300    |
| グロープライド      | 300    | 3,335.00  | 1,000,500  |
| オカムラ         | 1,200  | 1,378.00  | 1,653,600  |
| 美津濃          | 300    | 2,657.00  | 797,100    |
| 東京電力ホールディングス | 26,200 | 308.00    | 8,069,600  |
| 中部電力         | 10,700 | 1,140.00  | 12,198,000 |
| 関西電力         | 13,200 | 1,050.00  | 13,860,000 |
| 中国電力         | 5,500  | 870.00    | 4,785,000  |
| 北陸電力         | 3,200  | 530.00    | 1,696,000  |
| 東北電力         | 8,200  | 739.00    | 6,059,800  |
| 四国電力         | 3,100  | 701.00    | 2,173,100  |
| 九州電力         | 7,200  | 814.00    | 5,860,800  |
| 北海道電力        | 3,000  | 457.00    | 1,371,000  |
| 沖縄電力         | 700    | 1,400.00  | 980,000    |
| 電源開発         | 3,000  | 1,455.00  | 4,365,000  |
| エフオン         | 200    | 798.00    | 159,600    |
| イーレックス       | 500    | 2,555.00  | 1,277,500  |
| レノバ          | 700    | 5,450.00  | 3,815,000  |
| 東京瓦斯         | 6,700  | 2,003.00  | 13,420,100 |
| 大阪瓦斯         | 6,300  | 1,838.00  | 11,579,400 |
| 東邦瓦斯         | 1,600  | 3,185.00  | 5,096,000  |
| 北海道瓦斯        | 200    | 1,516.00  | 303,200    |
| 広島ガス         | 700    | 369.00    | 258,300    |
| 西部ガスホールディングス | 400    | 2,195.00  | 878,000    |
| 静岡ガス         | 900    | 1,149.00  | 1,034,100  |
| メタウォーター      | 400    | 1,969.00  | 787,600    |
| SBSホールディングス  | 300    | 3,900.00  | 1,170,000  |
| 東武鉄道         | 3,400  | 2,857.00  | 9,713,800  |
| 相鉄ホールディングス   | 1,100  | 2,176.00  | 2,393,600  |
| 東急           | 8,800  | 1,673.00  | 14,722,400 |
| 京浜急行電鉄       | 4,500  | 1,320.00  | 5,940,000  |
| 小田急電鉄        | 5,200  | 2,394.00  | 12,448,800 |
| 京王電鉄         | 1,800  | 5,560.00  | 10,008,000 |
| 京成電鉄         | 2,400  | 3,740.00  | 8,976,000  |
| 富士急行         | 400    | 4,810.00  | 1,924,000  |
| 新京成電鉄        | 100    | 2,051.00  | 205,100    |
| 東日本旅客鉄道      | 6,100  | 7,337.00  | 44,755,700 |
| 西日本旅客鉄道      | 4,200  | 5,620.00  | 23,604,000 |
| 東海旅客鉄道       | 2,900  | 17,570.00 | 50,953,000 |

|                  |       |          |            |
|------------------|-------|----------|------------|
| 西武ホールディングス       | 4,600 | 1,369.00 | 6,297,400  |
| 鴻池運輸             | 600   | 1,221.00 | 732,600    |
| 西日本鉄道            | 1,000 | 2,858.00 | 2,858,000  |
| 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   | 4,550.00 | 910,000    |
| 近鉄グループホールディングス   | 3,300 | 3,680.00 | 12,144,000 |
| 阪急阪神ホールディングス     | 4,100 | 3,670.00 | 15,047,000 |
| 南海電気鉄道           | 1,500 | 2,255.00 | 3,382,500  |
| 京阪ホールディングス       | 1,500 | 3,075.00 | 4,612,500  |
| 神戸電鉄             | 100   | 3,440.00 | 344,000    |
| 名古屋鉄道            | 2,700 | 1,995.00 | 5,386,500  |
| 山陽電気鉄道           | 300   | 2,026.00 | 607,800    |
| アルプス物流           | 300   | 1,032.00 | 309,600    |
| 日本通運             | 1,200 | 7,210.00 | 8,652,000  |
| ヤマトホールディングス      | 4,600 | 2,783.00 | 12,801,800 |
| 山九               | 900   | 4,955.00 | 4,459,500  |
| 丸運               | 300   | 266.00   | 79,800     |
| 丸全昭和運輸           | 300   | 3,445.00 | 1,033,500  |
| センコーグループホールディングス | 1,700 | 1,014.00 | 1,723,800  |
| トナミホールディングス      | 100   | 4,395.00 | 439,500    |
| ニッコンホールディングス     | 1,100 | 2,190.00 | 2,409,000  |
| 福山通運             | 500   | 4,680.00 | 2,340,000  |
| セイノーホールディングス     | 2,300 | 1,387.00 | 3,190,100  |
| エスライン            | 100   | 934.00   | 93,400     |
| 神奈川中央交通          | 100   | 3,465.00 | 346,500    |
| 日立物流             | 600   | 4,650.00 | 2,790,000  |
| 丸和運輸機関           | 700   | 1,519.00 | 1,063,300  |
| C & F ロジホールディングス | 300   | 1,700.00 | 510,000    |
| 九州旅客鉄道           | 2,600 | 2,759.00 | 7,173,400  |
| S Gホールディングス      | 6,300 | 2,671.00 | 16,827,300 |
| 日本郵船             | 2,800 | 7,730.00 | 21,644,000 |
| 商船三井             | 1,900 | 7,000.00 | 13,300,000 |
| 川崎汽船             | 1,000 | 5,130.00 | 5,130,000  |
| N S ユナイテッド海運     | 200   | 3,330.00 | 666,000    |
| 飯野海運             | 1,700 | 527.00   | 895,900    |
| 乾汽船              | 300   | 2,096.00 | 628,800    |
| 日本航空             | 7,600 | 2,630.00 | 19,988,000 |
| A N A ホールディングス   | 8,400 | 2,891.00 | 24,284,400 |
| パスコ              | 100   | 1,518.00 | 151,800    |
| トランコム            | 100   | 8,520.00 | 852,000    |
| 日新               | 300   | 1,808.00 | 542,400    |
| 三菱倉庫             | 1,000 | 3,120.00 | 3,120,000  |

|                        |       |           |            |
|------------------------|-------|-----------|------------|
| 三井倉庫ホールディングス           | 300   | 2,376.00  | 712,800    |
| 住友倉庫                   | 1,200 | 1,844.00  | 2,212,800  |
| 澁澤倉庫                   | 200   | 2,216.00  | 443,200    |
| 東陽倉庫                   | 500   | 332.00    | 166,000    |
| 日本トランスシティ              | 700   | 624.00    | 436,800    |
| ケイヒン                   | 100   | 1,423.00  | 142,300    |
| 中央倉庫                   | 200   | 962.00    | 192,400    |
| 川西倉庫                   | 100   | 1,212.00  | 121,200    |
| 安田倉庫                   | 300   | 961.00    | 288,300    |
| ファイズホールディングス           | 100   | 710.00    | 71,000     |
| 東洋埠頭                   | 100   | 1,440.00  | 144,000    |
| 宇徳                     | 200   | 525.00    | 105,000    |
| 上組                     | 1,800 | 2,300.00  | 4,140,000  |
| サンリツ                   | 100   | 860.00    | 86,000     |
| キムラユニティー               | 100   | 1,324.00  | 132,400    |
| キューソー流通システム            | 100   | 2,053.00  | 205,300    |
| 近鉄エクスプレス               | 600   | 2,716.00  | 1,629,600  |
| 東海運                    | 200   | 315.00    | 63,000     |
| エーアイティー                | 200   | 1,146.00  | 229,200    |
| 内外トランスライン              | 100   | 2,002.00  | 200,200    |
| 日本コンセプト                | 100   | 1,747.00  | 174,700    |
| NEC ネットエスアイ            | 1,100 | 1,897.00  | 2,086,700  |
| クロスキャット                | 100   | 1,256.00  | 125,600    |
| システナ                   | 1,200 | 2,060.00  | 2,472,000  |
| デジタルアーツ                | 200   | 10,050.00 | 2,010,000  |
| 日鉄ソリューションズ             | 500   | 3,590.00  | 1,795,000  |
| キューブシステム               | 200   | 1,001.00  | 200,200    |
| コア                     | 100   | 1,603.00  | 160,300    |
| ラクーンホールディングス           | 200   | 1,596.00  | 319,200    |
| ソリトンシステムズ              | 200   | 1,323.00  | 264,600    |
| ソフトクリエイイトホールディングス      | 100   | 4,070.00  | 407,000    |
| T I S                  | 3,300 | 3,275.00  | 10,807,500 |
| J N S ホールディングス         | 100   | 494.00    | 49,400     |
| グリー                    | 2,100 | 1,052.00  | 2,209,200  |
| コーエーテクモホールディングス        | 1,100 | 5,280.00  | 5,808,000  |
| 三菱総合研究所                | 100   | 4,040.00  | 404,000    |
| ボルテージ                  | 100   | 391.00    | 39,100     |
| A G S                  | 200   | 885.00    | 177,000    |
| ファインデックス               | 300   | 927.00    | 278,100    |
| ブレインパッド                | 100   | 5,820.00  | 582,000    |
| K L a b                | 600   | 627.00    | 376,200    |
| ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 500   | 1,029.00  | 514,500    |

|                           |       |           |            |
|---------------------------|-------|-----------|------------|
| イーブックイニシアティブジャパン          | 100   | 4,735.00  | 473,500    |
| ネクソン                      | 7,700 | 2,117.00  | 16,300,900 |
| アイスタイル                    | 1,000 | 370.00    | 370,000    |
| エムアップホールディングス             | 100   | 4,065.00  | 406,500    |
| エイチーム                     | 200   | 1,774.00  | 354,800    |
| エニグモ                      | 400   | 1,123.00  | 449,200    |
| テクノスジャパン                  | 300   | 585.00    | 175,500    |
| e n i s h                 | 200   | 406.00    | 81,200     |
| コロプラ                      | 1,100 | 780.00    | 858,000    |
| ブロードリーフ                   | 1,700 | 552.00    | 938,400    |
| クロス・マーケティンググループ           | 100   | 869.00    | 86,900     |
| デジタルハーツホールディングス           | 100   | 1,810.00  | 181,000    |
| システム情報                    | 200   | 967.00    | 193,400    |
| メディアドゥ                    | 100   | 5,070.00  | 507,000    |
| じげん                       | 1,000 | 415.00    | 415,000    |
| ブイキューブ                    | 300   | 1,317.00  | 395,100    |
| エンカレッジ・テクノロジー             | 100   | 655.00    | 65,500     |
| サイバーリンクス                  | 100   | 1,203.00  | 120,300    |
| フィックスターズ                  | 300   | 761.00    | 228,300    |
| C A R T A H O L D I N G S | 100   | 2,578.00  | 257,800    |
| オブティム                     | 200   | 1,776.00  | 355,200    |
| セレス                       | 100   | 2,868.00  | 286,800    |
| S H I F T                 | 200   | 28,180.00 | 5,636,000  |
| ティーガイア                    | 300   | 1,813.00  | 543,900    |
| テクマトリックス                  | 600   | 1,840.00  | 1,104,000  |
| プロシップ                     | 100   | 1,614.00  | 161,400    |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント      | 900   | 2,223.00  | 2,000,700  |
| G M O ペイメントゲートウェイ         | 700   | 15,080.00 | 10,556,000 |
| ザッパラス                     | 100   | 548.00    | 54,800     |
| システムリサーチ                  | 100   | 1,951.00  | 195,100    |
| インターネットイニシアティブ            | 900   | 4,385.00  | 3,946,500  |
| さくらインターネット                | 300   | 596.00    | 178,800    |
| ヴィンクス                     | 100   | 985.00    | 98,500     |
| G M O グローバルサイン・ホールディングス   | 100   | 4,460.00  | 446,000    |
| S R A ホールディングス            | 200   | 2,918.00  | 583,600    |
| システムインテグレータ               | 100   | 609.00    | 60,900     |
| 朝日ネット                     | 300   | 707.00    | 212,100    |
| e B A S E                 | 400   | 721.00    | 288,400    |
| アバント                      | 400   | 1,395.00  | 558,000    |
| アドソル日進                    | 100   | 2,137.00  | 213,700    |
| O D K ソリューションズ            | 100   | 689.00    | 68,900     |
| フリービット                    | 200   | 1,365.00  | 273,000    |

|                       |       |          |            |
|-----------------------|-------|----------|------------|
| コムチュア                 | 400   | 3,360.00 | 1,344,000  |
| アステリア                 | 200   | 714.00   | 142,800    |
| アイル                   | 200   | 1,674.00 | 334,800    |
| マークラインズ               | 200   | 3,230.00 | 646,000    |
| メディカル・データ・ビジョン        | 400   | 1,395.00 | 558,000    |
| g u m i               | 500   | 879.00   | 439,500    |
| ショーケース                | 100   | 584.00   | 58,400     |
| モバイルファクトリー            | 100   | 1,040.00 | 104,000    |
| テラスカイ                 | 100   | 2,504.00 | 250,400    |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 100   | 1,781.00 | 178,100    |
| P C Iホールディングス         | 100   | 1,055.00 | 105,500    |
| パイプドHD                | 100   | 2,931.00 | 293,100    |
| ネオジャパン                | 100   | 1,297.00 | 129,700    |
| P R T I M E S         | 100   | 3,260.00 | 326,000    |
| ラクス                   | 1,200 | 3,650.00 | 4,380,000  |
| ランドコンピュータ             | 100   | 813.00   | 81,300     |
| ダブルスタンダード             | 100   | 3,760.00 | 376,000    |
| オープンドア                | 200   | 2,830.00 | 566,000    |
| マイネット                 | 100   | 687.00   | 68,700     |
| アカツキ                  | 200   | 3,235.00 | 647,000    |
| U b i c o mホールディングス   | 100   | 2,819.00 | 281,900    |
| カナミックネットワーク           | 300   | 600.00   | 180,000    |
| ノムラシステムコーポレーション       | 200   | 289.00   | 57,800     |
| チェンジ                  | 600   | 2,026.00 | 1,215,600  |
| シンクロ・フード              | 200   | 381.00   | 76,200     |
| オークネット                | 200   | 2,405.00 | 481,000    |
| キャピタル・アセット・プランニング     | 100   | 883.00   | 88,300     |
| マクロミル                 | 700   | 832.00   | 582,400    |
| ビーグリー                 | 100   | 1,662.00 | 166,200    |
| オロ                    | 100   | 3,730.00 | 373,000    |
| ユーザーローカル              | 100   | 1,874.00 | 187,400    |
| テモナ                   | 100   | 726.00   | 72,600     |
| ニーズウェル                | 100   | 703.00   | 70,300     |
| マネーフォワード              | 500   | 8,130.00 | 4,065,000  |
| サインポスト                | 100   | 1,929.00 | 192,900    |
| 電算システムホールディングス        | 100   | 2,625.00 | 262,500    |
| ソルクシーズ                | 300   | 506.00   | 151,800    |
| フェイス                  | 100   | 650.00   | 65,000     |
| プロトコーポレーション           | 400   | 1,370.00 | 548,000    |
| ハイマックス                | 100   | 1,176.00 | 117,600    |
| 野村総合研究所               | 6,600 | 4,600.00 | 30,360,000 |
| サイバネットシステム            | 200   | 697.00   | 139,400    |



|                        |        |           |            |
|------------------------|--------|-----------|------------|
| C Eホールディングス            | 200    | 540.00    | 108,000    |
| 日本システム技術               | 100    | 2,231.00  | 223,100    |
| インテージホールディングス          | 400    | 2,063.00  | 825,200    |
| 東邦システムサイエンス            | 100    | 999.00    | 99,900     |
| ソースネクスト                | 1,400  | 198.00    | 277,200    |
| インフォコム                 | 400    | 2,364.00  | 945,600    |
| シンプレクス・ホールディングス        | 400    | 2,720.00  | 1,088,000  |
| HEROZ                  | 100    | 1,683.00  | 168,300    |
| ラクスル                   | 400    | 6,860.00  | 2,744,000  |
| I P S                  | 100    | 1,799.00  | 179,900    |
| F I G                  | 400    | 315.00    | 126,000    |
| システムサポート               | 100    | 1,363.00  | 136,300    |
| イーソル                   | 200    | 799.00    | 159,800    |
| アルテリア・ネットワークス          | 400    | 1,680.00  | 672,000    |
| 東海ソフト                  | 100    | 1,213.00  | 121,300    |
| ウイングアーク1st             | 200    | 2,188.00  | 437,600    |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 100    | 2,499.00  | 249,900    |
| サーバーワークス               | 100    | 4,110.00  | 411,000    |
| トピラシステムズ               | 100    | 1,048.00  | 104,800    |
| S a n s a n            | 300    | 13,560.00 | 4,068,000  |
| L i n k - U            | 100    | 1,201.00  | 120,100    |
| ギフトィ                   | 300    | 3,875.00  | 1,162,500  |
| ベース                    | 100    | 4,880.00  | 488,000    |
| フォーカスシステムズ             | 200    | 1,036.00  | 207,200    |
| クレスコ                   | 200    | 2,177.00  | 435,400    |
| フジ・メディア・ホールディングス       | 3,300  | 1,271.00  | 4,194,300  |
| オービック                  | 1,100  | 20,740.00 | 22,814,000 |
| ジャストシステム               | 500    | 5,850.00  | 2,925,000  |
| T D Cソフト               | 300    | 1,273.00  | 381,900    |
| Zホールディングス              | 49,800 | 785.00    | 39,093,000 |
| トレンドマイクロ               | 1,800  | 6,520.00  | 11,736,000 |
| I Dホールディングス            | 200    | 919.00    | 183,800    |
| 日本オラクル                 | 700    | 10,370.00 | 7,259,000  |
| アルファシステムズ              | 100    | 4,290.00  | 429,000    |
| フューチャー                 | 400    | 3,765.00  | 1,506,000  |
| C A C H o l d i n g s  | 200    | 1,663.00  | 332,600    |
| S Bテクノロジー              | 100    | 3,105.00  | 310,500    |
| トーセ                    | 100    | 794.00    | 79,400     |
| オービックビジネスコンサルタント       | 300    | 5,430.00  | 1,629,000  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ         | 1,600  | 3,750.00  | 6,000,000  |
| アイティフォー                | 400    | 872.00    | 348,800    |
| エクスネット                 | 100    | 996.00    | 99,600     |

|                                   |        |           |             |
|-----------------------------------|--------|-----------|-------------|
| 大塚商会                              | 1,900  | 5,290.00  | 10,051,000  |
| サイボウズ                             | 500    | 2,646.00  | 1,323,000   |
| 電通国際情報サービス                        | 500    | 4,020.00  | 2,010,000   |
| A C C E S S                       | 400    | 861.00    | 344,400     |
| デジタルガレージ                          | 600    | 5,530.00  | 3,318,000   |
| E Mシステムズ                          | 600    | 766.00    | 459,600     |
| ウェザーニューズ                          | 100    | 8,670.00  | 867,000     |
| C I J                             | 200    | 850.00    | 170,000     |
| 日本エンタープライズ                        | 300    | 198.00    | 59,400      |
| WOWOW                             | 200    | 2,222.00  | 444,400     |
| スカラ                               | 300    | 726.00    | 217,800     |
| インテリジェント ウェイブ                     | 200    | 563.00    | 112,600     |
| I M A G I C A G R O U P           | 300    | 681.00    | 204,300     |
| ネットワンシステムズ                        | 1,300  | 3,815.00  | 4,959,500   |
| システムソフト                           | 700    | 134.00    | 93,800      |
| アルゴグラフィックス                        | 300    | 3,080.00  | 924,000     |
| マーベラス                             | 500    | 779.00    | 389,500     |
| エイベックス                            | 600    | 1,667.00  | 1,000,200   |
| 日本ユニシス                            | 1,100  | 3,490.00  | 3,839,000   |
| 兼松エレクトロニクス                        | 200    | 3,730.00  | 746,000     |
| 都築電気                              | 200    | 1,818.00  | 363,600     |
| T B Sホールディングス                     | 2,100  | 1,896.00  | 3,981,600   |
| 日本テレビホールディングス                     | 2,900  | 1,307.00  | 3,790,300   |
| 朝日放送グループホールディングス                  | 300    | 714.00    | 214,200     |
| テレビ朝日ホールディングス                     | 800    | 1,805.00  | 1,444,000   |
| スカパーJ S A Tホールディングス               | 2,900  | 436.00    | 1,264,400   |
| テレビ東京ホールディングス                     | 200    | 2,230.00  | 446,000     |
| 日本BS放送                            | 100    | 1,125.00  | 112,500     |
| ビジョン                              | 600    | 1,559.00  | 935,400     |
| スマートバリュー                          | 100    | 577.00    | 57,700      |
| U S E N - N E X T H O L D I N G S | 300    | 3,600.00  | 1,080,000   |
| コネクシオ                             | 200    | 1,418.00  | 283,600     |
| 日本通信                              | 2,800  | 205.00    | 574,000     |
| クロップス                             | 100    | 985.00    | 98,500      |
| 日本電信電話                            | 40,100 | 3,224.00  | 129,282,400 |
| K D D I                           | 25,000 | 3,396.00  | 84,900,000  |
| ソフトバンク                            | 51,900 | 1,491.50  | 77,408,850  |
| 光通信                               | 400    | 18,130.00 | 7,252,000   |
| エムティーアイ                           | 300    | 689.00    | 206,700     |
| G M Oインターネット                      | 1,200  | 3,225.00  | 3,870,000   |
| ファイバーゲート                          | 100    | 1,338.00  | 133,800     |
| アйдママーケティングコミュニケーション              | 100    | 385.00    | 38,500      |

|                      |        |           |             |
|----------------------|--------|-----------|-------------|
| KADOKAWA             | 1,000  | 6,530.00  | 6,530,000   |
| 学研ホールディングス           | 500    | 1,087.00  | 543,500     |
| ゼンリン                 | 600    | 1,039.00  | 623,400     |
| 昭文社ホールディングス          | 100    | 492.00    | 49,200      |
| インプレスホールディングス        | 300    | 270.00    | 81,000      |
| アイネット                | 200    | 1,375.00  | 275,000     |
| 松竹                   | 200    | 12,440.00 | 2,488,000   |
| 東宝                   | 2,000  | 5,600.00  | 11,200,000  |
| 東映                   | 100    | 23,320.00 | 2,332,000   |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 9,100  | 2,380.00  | 21,658,000  |
| ピー・シー・エー             | 200    | 1,646.00  | 329,200     |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 100    | 1,897.00  | 189,700     |
| D T S                | 700    | 2,466.00  | 1,726,200   |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 1,600  | 6,500.00  | 10,400,000  |
| シーイーシー               | 400    | 1,357.00  | 542,800     |
| カプコン                 | 3,200  | 3,175.00  | 10,160,000  |
| アイ・エス・ビー             | 200    | 1,154.00  | 230,800     |
| ジャステック               | 200    | 1,297.00  | 259,400     |
| S C S K              | 2,400  | 2,183.00  | 5,239,200   |
| 日本システムウエア            | 100    | 2,425.00  | 242,500     |
| アイネス                 | 300    | 1,460.00  | 438,000     |
| T K C                | 600    | 3,530.00  | 2,118,000   |
| 富士ソフト                | 400    | 5,760.00  | 2,304,000   |
| N S D                | 1,100  | 2,150.00  | 2,365,000   |
| コナミホールディングス          | 1,200  | 6,520.00  | 7,824,000   |
| 福井コンピュータホールディングス     | 200    | 3,985.00  | 797,000     |
| J B C Cホールディングス      | 200    | 1,747.00  | 349,400     |
| ミロク情報サービス            | 300    | 1,815.00  | 544,500     |
| ソフトバンクグループ           | 20,600 | 6,161.00  | 126,916,600 |
| 高千穂交易                | 100    | 1,239.00  | 123,900     |
| オルバヘルスケアホールディングス     | 100    | 1,578.00  | 157,800     |
| 伊藤忠食品                | 100    | 5,120.00  | 512,000     |
| エレマテック               | 300    | 1,120.00  | 336,000     |
| J A L U X            | 100    | 2,552.00  | 255,200     |
| あらた                  | 300    | 4,110.00  | 1,233,000   |
| トーメンデバイス             | 100    | 6,140.00  | 614,000     |
| 東京エレクトロン デバイス        | 100    | 7,470.00  | 747,000     |
| フィールズ                | 300    | 542.00    | 162,600     |
| 双日                   | 3,800  | 1,722.00  | 6,543,600   |
| アルフレッサ ホールディングス      | 3,800  | 1,671.00  | 6,349,800   |
| 横浜冷凍                 | 1,000  | 882.00    | 882,000     |
| 神栄                   | 100    | 1,004.00  | 100,400     |

|                     |       |          |            |
|---------------------|-------|----------|------------|
| ラサ商事                | 200   | 925.00   | 185,000    |
| アルコニックス             | 400   | 1,628.00 | 651,200    |
| 神戸物産                | 2,700 | 4,065.00 | 10,975,500 |
| ハイパー                | 100   | 555.00   | 55,500     |
| あい ホールディングス         | 500   | 2,182.00 | 1,091,000  |
| ディーブイエックス           | 100   | 1,103.00 | 110,300    |
| ダイワボウホールディングス       | 1,700 | 2,004.00 | 3,406,800  |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 800   | 2,692.00 | 2,153,600  |
| ラクト・ジャパン            | 100   | 2,697.00 | 269,700    |
| グリムス                | 200   | 2,634.00 | 526,800    |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 600   | 786.00   | 471,600    |
| 八洲電機                | 200   | 937.00   | 187,400    |
| メディアスホールディングス       | 200   | 864.00   | 172,800    |
| レスターホールディングス        | 300   | 1,902.00 | 570,600    |
| ジューテックホールディングス      | 100   | 1,215.00 | 121,500    |
| 大光                  | 100   | 717.00   | 71,700     |
| OCHIホールディングス        | 100   | 1,269.00 | 126,900    |
| TOKAIホールディングス       | 1,700 | 872.00   | 1,482,400  |
| 黒谷                  | 100   | 656.00   | 65,600     |
| Cominix             | 100   | 731.00   | 73,100     |
| 三洋貿易                | 400   | 1,072.00 | 428,800    |
| ビューティガレージ           | 100   | 4,265.00 | 426,500    |
| ウイン・パートナーズ          | 300   | 946.00   | 283,800    |
| ミタチ産業               | 100   | 947.00   | 94,700     |
| シップヘルスケアホールディングス    | 1,100 | 2,984.00 | 3,282,400  |
| 明治電機工業              | 100   | 1,338.00 | 133,800    |
| デリカフーズホールディングス      | 100   | 623.00   | 62,300     |
| スターティアホールディングス      | 100   | 1,459.00 | 145,900    |
| コメダホールディングス         | 800   | 2,066.00 | 1,652,800  |
| ピーバンドットコム           | 100   | 671.00   | 67,100     |
| アセンテック              | 100   | 1,329.00 | 132,900    |
| 富士興産                | 100   | 1,067.00 | 106,700    |
| フルサト・マルカホールディングス    | 300   | 1,986.00 | 595,800    |
| ヤマエグループホールディングス     | 200   | 1,122.00 | 224,400    |
| 小野建                 | 300   | 1,667.00 | 500,100    |
| 南陽                  | 100   | 2,011.00 | 201,100    |
| 佐島電機                | 200   | 1,100.00 | 220,000    |
| エコートレーディング          | 100   | 637.00   | 63,700     |
| 伯東                  | 200   | 2,237.00 | 447,400    |
| コンドーテック             | 300   | 941.00   | 282,300    |
| 中山福                 | 200   | 388.00   | 77,600     |
| ナガイレーベン             | 500   | 2,383.00 | 1,191,500  |

|               |        |           |            |
|---------------|--------|-----------|------------|
| 三菱食品          | 300    | 2,826.00  | 847,800    |
| 松田産業          | 300    | 3,360.00  | 1,008,000  |
| 第一興商          | 700    | 4,190.00  | 2,933,000  |
| メディバルホールディングス | 3,700  | 2,100.00  | 7,770,000  |
| S P K         | 100    | 1,376.00  | 137,600    |
| 萩原電気ホールディングス  | 100    | 2,201.00  | 220,100    |
| アズワン          | 200    | 14,610.00 | 2,922,000  |
| スズデン          | 100    | 1,718.00  | 171,800    |
| 尾家産業          | 100    | 1,078.00  | 107,800    |
| シモジマ          | 200    | 1,121.00  | 224,200    |
| ドウシシャ         | 300    | 1,649.00  | 494,700    |
| 小津産業          | 100    | 1,912.00  | 191,200    |
| 高速            | 200    | 1,544.00  | 308,800    |
| たけびし          | 100    | 1,478.00  | 147,800    |
| リックス          | 100    | 1,534.00  | 153,400    |
| 丸文            | 300    | 842.00    | 252,600    |
| ハピネット         | 300    | 1,536.00  | 460,800    |
| 橋本総業ホールディングス  | 100    | 2,151.00  | 215,100    |
| 日本ライフライン      | 1,000  | 1,191.00  | 1,191,000  |
| タカショー         | 300    | 824.00    | 247,200    |
| I D O M       | 1,100  | 782.00    | 860,200    |
| 進和            | 200    | 2,110.00  | 422,000    |
| エスケイジャパン      | 100    | 492.00    | 49,200     |
| ダイトロン         | 200    | 2,145.00  | 429,000    |
| シークス          | 500    | 1,273.00  | 636,500    |
| 田中商事          | 100    | 666.00    | 66,600     |
| オーハシテクニカ      | 200    | 1,460.00  | 292,000    |
| 白銅            | 100    | 2,910.00  | 291,000    |
| 伊藤忠商事         | 23,600 | 3,449.00  | 81,396,400 |
| 丸紅            | 33,900 | 1,037.50  | 35,171,250 |
| 高島            | 100    | 1,914.00  | 191,400    |
| 長瀬産業          | 1,900  | 1,807.00  | 3,433,300  |
| 蝶理            | 200    | 1,853.00  | 370,600    |
| 豊田通商          | 3,500  | 5,290.00  | 18,515,000 |
| 三共生興          | 500    | 572.00    | 286,000    |
| 兼松            | 1,300  | 1,311.00  | 1,704,300  |
| ツカモトコーポレーション  | 100    | 1,339.00  | 133,900    |
| 三井物産          | 26,700 | 2,540.00  | 67,818,000 |
| 日本紙パルプ商事      | 200    | 3,900.00  | 780,000    |
| カメイ           | 400    | 1,143.00  | 457,200    |
| O U Gホールディングス | 100    | 2,721.00  | 272,100    |
| スターゼン         | 300    | 2,152.00  | 645,600    |

|                   |        |          |            |
|-------------------|--------|----------|------------|
| 山善                | 1,500  | 1,055.00 | 1,582,500  |
| 椿本興業              | 100    | 3,825.00 | 382,500    |
| 住友商事              | 21,700 | 1,665.50 | 36,141,350 |
| 内田洋行              | 100    | 4,900.00 | 490,000    |
| 三菱商事              | 25,800 | 3,435.00 | 88,623,000 |
| 第一実業              | 200    | 5,190.00 | 1,038,000  |
| キャノンマーケティングジャパン   | 900    | 2,305.00 | 2,074,500  |
| 西華産業              | 200    | 1,663.00 | 332,600    |
| 佐藤商事              | 300    | 1,193.00 | 357,900    |
| 菱洋エレクトロ           | 200    | 2,360.00 | 472,000    |
| 東京産業              | 300    | 747.00   | 224,100    |
| ユアサ商事             | 300    | 3,020.00 | 906,000    |
| 神鋼商事              | 100    | 3,460.00 | 346,000    |
| トルク               | 200    | 220.00   | 44,000     |
| 阪和興業              | 700    | 3,340.00 | 2,338,000  |
| 正栄食品工業            | 200    | 4,005.00 | 801,000    |
| カナデン              | 300    | 1,044.00 | 313,200    |
| 菱電商事              | 300    | 1,741.00 | 522,300    |
| 岩谷産業              | 800    | 6,800.00 | 5,440,000  |
| ナイス               | 100    | 1,847.00 | 184,700    |
| ニチモウ              | 100    | 2,100.00 | 210,000    |
| 極東貿易              | 100    | 2,592.00 | 259,200    |
| アステナホールディングス      | 500    | 572.00   | 286,000    |
| 三愛石油              | 800    | 1,400.00 | 1,120,000  |
| 稲畑産業              | 800    | 1,674.00 | 1,339,200  |
| G S Iクレオス         | 200    | 900.00   | 180,000    |
| 明和産業              | 300    | 825.00   | 247,500    |
| クワザワホールディングス      | 100    | 660.00   | 66,000     |
| ワキタ               | 700    | 1,042.00 | 729,400    |
| 東邦ホールディングス        | 1,100  | 1,810.00 | 1,991,000  |
| サンゲツ              | 900    | 1,580.00 | 1,422,000  |
| ミツウロコグループホールディングス | 500    | 1,351.00 | 675,500    |
| シナネンホールディングス      | 100    | 3,450.00 | 345,000    |
| 伊藤忠エネクス           | 800    | 1,009.00 | 807,200    |
| サンリオ              | 1,100  | 2,800.00 | 3,080,000  |
| サンワテクノス           | 200    | 1,498.00 | 299,600    |
| リョーサン             | 400    | 2,391.00 | 956,400    |
| 新光商事              | 500    | 862.00   | 431,000    |
| トーホー              | 200    | 1,540.00 | 308,000    |
| 三信電気              | 200    | 1,668.00 | 333,600    |
| 東陽テクニカ            | 400    | 1,126.00 | 450,400    |
| モスフードサービス         | 500    | 3,150.00 | 1,575,000  |

|                     |       |          |            |
|---------------------|-------|----------|------------|
| 加賀電子                | 300   | 3,010.00 | 903,000    |
| ソーダニッカ              | 400   | 625.00   | 250,000    |
| 立花エレテック             | 300   | 1,590.00 | 477,000    |
| フォーバル               | 200   | 1,141.00 | 228,200    |
| PALTA C             | 500   | 4,990.00 | 2,495,000  |
| 三谷産業                | 400   | 349.00   | 139,600    |
| 太平洋興発               | 100   | 651.00   | 65,100     |
| 西本Wismettacホールディングス | 100   | 4,095.00 | 409,500    |
| コア商事ホールディングス        | 300   | 693.00   | 207,900    |
| 国際紙パルプ商事            | 700   | 407.00   | 284,900    |
| ヤマタネ                | 200   | 1,606.00 | 321,200    |
| 日鉄物産                | 200   | 4,960.00 | 992,000    |
| 泉州電業                | 100   | 4,735.00 | 473,500    |
| トラスコ中山              | 700   | 2,691.00 | 1,883,700  |
| オートボックスセブン          | 1,200 | 1,405.00 | 1,686,000  |
| モリト                 | 300   | 678.00   | 203,400    |
| 加藤産業                | 500   | 3,185.00 | 1,592,500  |
| 北恵                  | 100   | 1,004.00 | 100,400    |
| イノテック               | 200   | 1,500.00 | 300,000    |
| イエローハット             | 600   | 1,729.00 | 1,037,400  |
| J Kホールディングス         | 300   | 1,039.00 | 311,700    |
| 日伝                  | 300   | 2,270.00 | 681,000    |
| 北沢産業                | 300   | 248.00   | 74,400     |
| 杉本商事                | 200   | 2,359.00 | 471,800    |
| 因幡電機産業              | 900   | 2,708.00 | 2,437,200  |
| 東テク                 | 100   | 2,591.00 | 259,100    |
| ミスミグループ本社           | 4,300 | 4,845.00 | 20,833,500 |
| アルテック               | 300   | 318.00   | 95,400     |
| タキヒヨー               | 100   | 1,775.00 | 177,500    |
| 蔵王産業                | 100   | 1,884.00 | 188,400    |
| スズケン                | 1,300 | 3,170.00 | 4,121,000  |
| ジェコス                | 200   | 836.00   | 167,200    |
| グローセル               | 400   | 403.00   | 161,200    |
| ローソン                | 800   | 5,850.00 | 4,680,000  |
| サンエー                | 300   | 4,195.00 | 1,258,500  |
| カワチ薬品               | 300   | 2,329.00 | 698,700    |
| エービーシー・マート          | 500   | 5,630.00 | 2,815,000  |
| ハードオフコーポレーション       | 100   | 758.00   | 75,800     |
| アスクル                | 500   | 1,545.00 | 772,500    |
| ゲオホールディングス          | 400   | 1,224.00 | 489,600    |
| アダストリア              | 400   | 2,140.00 | 856,000    |
| ジーフット               | 200   | 399.00   | 79,800     |

|                    |       |          |            |
|--------------------|-------|----------|------------|
| くら寿司               | 400   | 3,815.00 | 1,526,000  |
| キャンドウ              | 200   | 2,557.00 | 511,400    |
| アイケイ               | 100   | 515.00   | 51,500     |
| パルグループホールディングス     | 300   | 1,690.00 | 507,000    |
| エディオン              | 1,600 | 1,071.00 | 1,713,600  |
| サーラコーポレーション        | 700   | 631.00   | 441,700    |
| ワッツ                | 100   | 763.00   | 76,300     |
| ハローズ               | 200   | 2,829.00 | 565,800    |
| フジオフードグループ本社       | 300   | 1,406.00 | 421,800    |
| あみやき亭              | 100   | 3,050.00 | 305,000    |
| ひらまつ               | 700   | 211.00   | 147,700    |
| 大黒天物産              | 100   | 6,620.00 | 662,000    |
| ハニーズホールディングス       | 200   | 1,095.00 | 219,000    |
| ファーマライズホールディングス    | 100   | 806.00   | 80,600     |
| アルペン               | 300   | 2,458.00 | 737,400    |
| ハブ                 | 100   | 746.00   | 74,600     |
| クオールホールディングス       | 400   | 1,632.00 | 652,800    |
| ジinzホールディングス       | 200   | 7,370.00 | 1,474,000  |
| ビックカメラ             | 2,000 | 1,004.00 | 2,008,000  |
| D C Mホールディングス      | 2,100 | 1,121.00 | 2,354,100  |
| MonotaRO           | 4,300 | 2,431.00 | 10,453,300 |
| 東京一番フーズ            | 100   | 599.00   | 59,900     |
| アークランドサービスホールディングス | 200   | 2,286.00 | 457,200    |
| J.フロント リテイリング      | 4,100 | 1,111.00 | 4,555,100  |
| ドトール・日レスホールディングス   | 600   | 1,666.00 | 999,600    |
| マツキヨココカラ&カンパニー     | 2,100 | 4,910.00 | 10,311,000 |
| ブロンコビリー            | 200   | 2,449.00 | 489,800    |
| Z O Z O            | 2,400 | 3,660.00 | 8,784,000  |
| トレジャー・ファクトリー       | 100   | 1,011.00 | 101,100    |
| 物語コーポレーション         | 200   | 7,280.00 | 1,456,000  |
| 三越伊勢丹ホールディングス      | 6,000 | 891.00   | 5,346,000  |
| H a m e e          | 100   | 1,260.00 | 126,000    |
| ウエルシアホールディングス      | 1,800 | 4,250.00 | 7,650,000  |
| クリエイイトSDホールディングス   | 500   | 3,455.00 | 1,727,500  |
| 丸善C H Iホールディングス    | 400   | 378.00   | 151,200    |
| シュッピン              | 300   | 1,313.00 | 393,900    |
| オイシックス・ラ・大地        | 500   | 4,785.00 | 2,392,500  |
| ネクステージ             | 700   | 2,256.00 | 1,579,200  |
| ジョイフル本田            | 1,000 | 1,562.00 | 1,562,000  |
| 鳥貴族ホールディングス        | 100   | 1,975.00 | 197,500    |
| ホットランド             | 200   | 1,385.00 | 277,000    |
| すかいらくホールディングス      | 4,400 | 1,553.00 | 6,833,200  |



|                                   |        |           |            |
|-----------------------------------|--------|-----------|------------|
| SFPホールディングス                       | 200    | 1,480.00  | 296,000    |
| 綿半ホールディングス                        | 200    | 1,236.00  | 247,200    |
| ヨシックスホールディングス                     | 100    | 2,141.00  | 214,100    |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス         | 1,000  | 1,026.00  | 1,026,000  |
| ゴルフダイジェスト・オンライン                   | 200    | 1,285.00  | 257,000    |
| B E E N O S                       | 200    | 2,595.00  | 519,000    |
| あさひ                               | 300    | 1,371.00  | 411,300    |
| 日本調剤                              | 200    | 1,510.00  | 302,000    |
| コスモス薬品                            | 300    | 17,860.00 | 5,358,000  |
| トーエル                              | 100    | 798.00    | 79,800     |
| セブン&アイ・ホールディングス                   | 13,500 | 4,987.00  | 67,324,500 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス             | 1,600  | 745.00    | 1,192,000  |
| ツルハホールディングス                       | 800    | 14,230.00 | 11,384,000 |
| サンマルクホールディングス                     | 300    | 1,556.00  | 466,800    |
| フェリシモ                             | 100    | 1,432.00  | 143,200    |
| トリドールホールディングス                     | 800    | 2,984.00  | 2,387,200  |
| T O K Y O B A S E                 | 300    | 819.00    | 245,700    |
| J Mホールディングス                       | 200    | 1,884.00  | 376,800    |
| アレンザホールディングス                      | 200    | 1,176.00  | 235,200    |
| 串カツ田中ホールディングス                     | 100    | 2,333.00  | 233,300    |
| パロックジャパンリミテッド                     | 200    | 877.00    | 175,400    |
| クスリのアオキホールディングス                   | 300    | 7,590.00  | 2,277,000  |
| F O O D & L I F E C O M P A N I E | 2,000  | 4,975.00  | 9,950,000  |
| メディカルシステムネットワーク                   | 300    | 682.00    | 204,600    |
| はるやまホールディングス                      | 100    | 585.00    | 58,500     |
| ノジマ                               | 600    | 2,395.00  | 1,437,000  |
| カップ・クリエイト                         | 500    | 1,421.00  | 710,500    |
| ライトオン                             | 200    | 706.00    | 141,200    |
| 良品計画                              | 4,000  | 2,130.00  | 8,520,000  |
| 三城ホールディングス                        | 400    | 259.00    | 103,600    |
| アドヴァングループ                         | 300    | 967.00    | 290,100    |
| アルビス                              | 100    | 2,315.00  | 231,500    |
| コナカ                               | 300    | 333.00    | 99,900     |
| G - 7ホールディングス                     | 400    | 1,862.00  | 744,800    |
| イオン北海道                            | 600    | 1,353.00  | 811,800    |
| コジマ                               | 600    | 581.00    | 348,600    |
| ヒマラヤ                              | 100    | 1,010.00  | 101,000    |
| コーナン商事                            | 500    | 3,580.00  | 1,790,000  |
| エコス                               | 100    | 1,859.00  | 185,900    |
| 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       | 6,900  | 2,405.00  | 16,594,500 |

|                                     |       |          |           |
|-------------------------------------|-------|----------|-----------|
| 西松屋チェーン                             | 700   | 1,482.00 | 1,037,400 |
| ゼンショーホールディングス                       | 1,700 | 2,737.00 | 4,652,900 |
| 幸楽苑ホールディングス                         | 200   | 1,509.00 | 301,800   |
| ハークスレイ                              | 100   | 473.00   | 47,300    |
| サイゼリヤ                               | 500   | 3,080.00 | 1,540,000 |
| V Tホールディングス                         | 1,200 | 513.00   | 615,600   |
| 魚力                                  | 100   | 2,000.00 | 200,000   |
| フジ・コーポレーション                         | 200   | 1,216.00 | 243,200   |
| ユナイテッドアローズ                          | 400   | 2,188.00 | 875,200   |
| ハイデイ日高                              | 500   | 1,662.00 | 831,000   |
| Y U - W A C r e a t i o n H o l d i | 100   | 229.00   | 22,900    |
| コロワイド                               | 1,400 | 1,689.00 | 2,364,600 |
| ピーシーデポコーポレーション                      | 400   | 474.00   | 189,600   |
| 壱番屋                                 | 200   | 4,620.00 | 924,000   |
| トップカルチャー                            | 100   | 319.00   | 31,900    |
| P L A N T                           | 100   | 720.00   | 72,000    |
| スギホールディングス                          | 700   | 8,310.00 | 5,817,000 |
| 薬王堂ホールディングス                         | 200   | 2,414.00 | 482,800   |
| スクロール                               | 500   | 919.00   | 459,500   |
| ヨンドシーホールディングス                       | 300   | 1,716.00 | 514,800   |
| 木曽路                                 | 400   | 2,201.00 | 880,400   |
| S R Sホールディングス                       | 400   | 785.00   | 314,000   |
| 千趣会                                 | 600   | 397.00   | 238,200   |
| リテールパートナーズ                          | 400   | 1,207.00 | 482,800   |
| ケーヨー                                | 600   | 832.00   | 499,200   |
| 上新電機                                | 400   | 2,256.00 | 902,400   |
| 日本瓦斯                                | 1,700 | 1,419.00 | 2,412,300 |
| ロイヤルホールディングス                        | 600   | 2,144.00 | 1,286,400 |
| いなげや                                | 400   | 1,407.00 | 562,800   |
| チヨダ                                 | 300   | 771.00   | 231,300   |
| ライフコーポレーション                         | 300   | 3,625.00 | 1,087,500 |
| リンガーハット                             | 400   | 2,266.00 | 906,400   |
| M r M a x H D                       | 400   | 589.00   | 235,600   |
| A O K Iホールディングス                     | 600   | 723.00   | 433,800   |
| オークワ                                | 500   | 1,114.00 | 557,000   |
| コメリ                                 | 500   | 2,641.00 | 1,320,500 |
| 青山商事                                | 700   | 837.00   | 585,900   |
| しまむら                                | 400   | 9,500.00 | 3,800,000 |
| はせがわ                                | 100   | 260.00   | 26,000    |
| 高島屋                                 | 2,500 | 1,169.00 | 2,922,500 |
| 松屋                                  | 700   | 1,029.00 | 720,300   |
| エイチ・ツー・オー リテイリング                    | 1,600 | 926.00   | 1,481,600 |

|                   |        |           |            |
|-------------------|--------|-----------|------------|
| 近鉄百貨店             | 100    | 2,661.00  | 266,100    |
| 丸井グループ            | 2,900  | 2,302.00  | 6,675,800  |
| アクシアル リテイリング      | 300    | 3,435.00  | 1,030,500  |
| 井筒屋               | 200    | 325.00    | 65,000     |
| イオン               | 13,200 | 2,691.50  | 35,527,800 |
| イズミ               | 600    | 3,580.00  | 2,148,000  |
| 平和堂               | 600    | 2,006.00  | 1,203,600  |
| フジ                | 400    | 2,014.00  | 805,600    |
| ヤオコー              | 400    | 6,790.00  | 2,716,000  |
| ゼビオホールディングス       | 500    | 1,033.00  | 516,500    |
| ケーズホールディングス       | 3,200  | 1,158.00  | 3,705,600  |
| Olympicグループ       | 200    | 724.00    | 144,800    |
| 日産東京販売ホールディングス    | 400    | 241.00    | 96,400     |
| シルバーライフ           | 100    | 1,430.00  | 143,000    |
| Genky DrugStores  | 100    | 5,160.00  | 516,000    |
| ナルミヤ・インターナショナル    | 100    | 1,206.00  | 120,600    |
| ブックオフグループホールディングス | 200    | 994.00    | 198,800    |
| アインホールディングス       | 500    | 6,350.00  | 3,175,000  |
| 元気寿司              | 100    | 2,708.00  | 270,800    |
| ヤマダホールディングス       | 12,600 | 425.00    | 5,355,000  |
| アークランドサカモト        | 500    | 1,748.00  | 874,000    |
| ニトリホールディングス       | 1,400  | 21,160.00 | 29,624,000 |
| グルメ杵屋             | 300    | 997.00    | 299,100    |
| 愛眼                | 200    | 201.00    | 40,200     |
| ケーユーホールディングス      | 200    | 1,070.00  | 214,000    |
| 吉野家ホールディングス       | 1,200  | 2,388.00  | 2,865,600  |
| 松屋フーズホールディングス     | 200    | 3,655.00  | 731,000    |
| サガミホールディングス       | 500    | 1,050.00  | 525,000    |
| 関西スーパーマーケット       | 300    | 1,235.00  | 370,500    |
| 王将フードサービス         | 200    | 5,970.00  | 1,194,000  |
| プレナス              | 400    | 1,951.00  | 780,400    |
| ミニストップ            | 200    | 1,415.00  | 283,000    |
| アークス              | 600    | 2,209.00  | 1,325,400  |
| バローホールディングス       | 800    | 2,425.00  | 1,940,000  |
| 藤久                | 100    | 786.00    | 78,600     |
| ベルク               | 100    | 5,500.00  | 550,000    |
| 大庄                | 200    | 1,027.00  | 205,400    |
| ファーストリテイリング       | 500    | 78,510.00 | 39,255,000 |
| サンドラッグ            | 1,300  | 3,305.00  | 4,296,500  |
| サクスパー ホールディングス    | 300    | 600.00    | 180,000    |
| ヤマザワ              | 100    | 1,720.00  | 172,000    |
| やまや               | 100    | 2,440.00  | 244,000    |

|                     |         |          |             |                   |
|---------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| ペルーナ                | 700     | 767.00   | 536,900     |                   |
| 島根銀行                | 100     | 579.00   | 57,900      |                   |
| じもとホールディングス         | 300     | 642.00   | 192,600     |                   |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 18,000  | 237.00   | 4,266,000   |                   |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 400     | 1,473.00 | 589,200     |                   |
| 九州フィナンシャルグループ       | 7,100   | 398.00   | 2,825,800   |                   |
| ゆうちょ銀行              | 8,200   | 861.00   | 7,060,200   |                   |
| 富山第一銀行              | 800     | 289.00   | 231,200     |                   |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 19,700  | 455.00   | 8,963,500   |                   |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 2,300   | 717.00   | 1,649,100   |                   |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 300     | 1,391.00 | 417,300     |                   |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 600     | 2,613.00 | 1,567,800   |                   |
| ひろぎんホールディングス        | 5,100   | 651.00   | 3,320,100   |                   |
| おきなわフィナンシャルグループ     | 300     | 2,499.00 | 749,700     |                   |
| 十六フィナンシャルグループ       | 500     | 2,054.00 | 1,027,000   |                   |
| 北國フィナンシャルホールディングス   | 300     | 2,110.00 | 633,000     |                   |
| 新生銀行                | 2,300   | 1,749.00 | 4,022,700   |                   |
| あおぞら銀行              | 1,900   | 2,667.00 | 5,067,300   |                   |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 221,000 | 638.00   | 140,998,000 | 代用有価証券<br>21,400株 |
| りそなホールディングス         | 39,500  | 437.50   | 17,281,250  |                   |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 6,500   | 3,904.00 | 25,376,000  |                   |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 23,800  | 3,849.00 | 91,606,200  | 代用有価証券<br>3,500株  |
| 千葉銀行                | 11,500  | 719.00   | 8,268,500   |                   |
| 群馬銀行                | 6,600   | 354.00   | 2,336,400   |                   |
| 武蔵野銀行               | 500     | 1,752.00 | 876,000     |                   |
| 千葉興業銀行              | 800     | 265.00   | 212,000     |                   |
| 筑波銀行                | 1,400   | 167.00   | 233,800     |                   |
| 七十七銀行               | 1,100   | 1,210.00 | 1,331,000   |                   |
| 青森銀行                | 300     | 1,986.00 | 595,800     |                   |
| 秋田銀行                | 200     | 1,460.00 | 292,000     |                   |
| 山形銀行                | 400     | 813.00   | 325,200     |                   |
| 岩手銀行                | 200     | 1,655.00 | 331,000     |                   |
| 東邦銀行                | 2,900   | 204.00   | 591,600     |                   |
| 東北銀行                | 200     | 1,004.00 | 200,800     |                   |
| みちのく銀行              | 200     | 874.00   | 174,800     |                   |
| ふくおかフィナンシャルグループ     | 2,900   | 2,098.00 | 6,084,200   |                   |
| 静岡銀行                | 8,400   | 924.00   | 7,761,600   |                   |
| スルガ銀行               | 3,000   | 470.00   | 1,410,000   |                   |
| 八十二銀行               | 7,800   | 375.00   | 2,925,000   |                   |
| 山梨中央銀行              | 400     | 823.00   | 329,200     |                   |
| 大垣共立銀行              | 700     | 1,924.00 | 1,346,800   |                   |

|                 |        |          |            |
|-----------------|--------|----------|------------|
| 福井銀行            | 300    | 1,524.00 | 457,200    |
| 清水銀行            | 100    | 1,560.00 | 156,000    |
| 富山銀行            | 100    | 1,940.00 | 194,000    |
| 滋賀銀行            | 600    | 1,935.00 | 1,161,000  |
| 南都銀行            | 500    | 1,962.00 | 981,000    |
| 百五銀行            | 3,300  | 334.00   | 1,102,200  |
| 京都銀行            | 1,200  | 5,260.00 | 6,312,000  |
| 紀陽銀行            | 1,200  | 1,486.00 | 1,783,200  |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 2,200  | 838.00   | 1,843,600  |
| 山陰合同銀行          | 2,000  | 574.00   | 1,148,000  |
| 中国銀行            | 2,800  | 843.00   | 2,360,400  |
| 鳥取銀行            | 100    | 1,112.00 | 111,200    |
| 伊予銀行            | 4,600  | 568.00   | 2,612,800  |
| 百十四銀行           | 400    | 1,469.00 | 587,600    |
| 四国銀行            | 500    | 748.00   | 374,000    |
| 阿波銀行            | 500    | 2,113.00 | 1,056,500  |
| 大分銀行            | 200    | 1,811.00 | 362,200    |
| 宮崎銀行            | 200    | 2,018.00 | 403,600    |
| 佐賀銀行            | 200    | 1,400.00 | 280,000    |
| 琉球銀行            | 800    | 752.00   | 601,600    |
| セブン銀行           | 10,300 | 240.00   | 2,472,000  |
| みずほフィナンシャルグループ  | 44,100 | 1,547.00 | 68,222,700 |
| 高知銀行            | 100    | 756.00   | 75,600     |
| 山口フィナンシャルグループ   | 4,000  | 643.00   | 2,572,000  |
| 長野銀行            | 100    | 1,094.00 | 109,400    |
| 名古屋銀行           | 300    | 2,416.00 | 724,800    |
| 北洋銀行            | 5,200  | 239.00   | 1,242,800  |
| 愛知銀行            | 100    | 3,475.00 | 347,500    |
| 中京銀行            | 100    | 1,335.00 | 133,500    |
| 大光銀行            | 100    | 1,350.00 | 135,000    |
| 愛媛銀行            | 500    | 777.00   | 388,500    |
| トマト銀行           | 100    | 1,046.00 | 104,600    |
| 京葉銀行            | 1,500  | 448.00   | 672,000    |
| 栃木銀行            | 1,700  | 178.00   | 302,600    |
| 北日本銀行           | 100    | 1,530.00 | 153,000    |
| 東和銀行            | 600    | 510.00   | 306,000    |
| 福島銀行            | 500    | 231.00   | 115,500    |
| 大東銀行            | 200    | 692.00   | 138,400    |
| トモニホールディングス     | 2,700  | 304.00   | 820,800    |
| フィデアホールディングス    | 300    | 1,159.00 | 347,700    |
| 池田泉州ホールディングス    | 4,000  | 159.00   | 636,000    |
| F P G           | 1,200  | 621.00   | 745,200    |

|                               |        |          |            |
|-------------------------------|--------|----------|------------|
| ジャパンインベストメントアドバイザー            | 300    | 1,311.00 | 393,300    |
| マーキュリアホールディングス                | 100    | 744.00   | 74,400     |
| S B Iホールディングス                 | 4,300  | 2,880.00 | 12,384,000 |
| 日本アジア投資                       | 300    | 226.00   | 67,800     |
| ジャフコ グループ                     | 400    | 7,410.00 | 2,964,000  |
| 大和証券グループ本社                    | 25,800 | 649.40   | 16,754,520 |
| 野村ホールディングス                    | 52,600 | 510.40   | 26,847,040 |
| 岡三証券グループ                      | 2,700  | 385.00   | 1,039,500  |
| 丸三証券                          | 1,000  | 581.00   | 581,000    |
| 東洋証券                          | 1,100  | 153.00   | 168,300    |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス          | 4,000  | 390.00   | 1,560,000  |
| 光世証券                          | 100    | 543.00   | 54,300     |
| 水戸証券                          | 900    | 291.00   | 261,900    |
| いちよし証券                        | 700    | 635.00   | 444,500    |
| 松井証券                          | 1,700  | 813.00   | 1,382,100  |
| マネックスグループ                     | 2,800  | 1,045.00 | 2,926,000  |
| 極東証券                          | 500    | 772.00   | 386,000    |
| 岩井コスモホールディングス                 | 300    | 1,325.00 | 397,500    |
| アイザワ証券グループ                    | 600    | 1,065.00 | 639,000    |
| マネーパートナーズグループ                 | 400    | 254.00   | 101,600    |
| スパークス・グループ                    | 1,600  | 309.00   | 494,400    |
| 小林洋行                          | 100    | 254.00   | 25,400     |
| かんぽ生命保険                       | 3,500  | 1,807.00 | 6,324,500  |
| S O M P Oホールディングス             | 6,100  | 4,921.00 | 30,018,100 |
| アニコム ホールディングス                 | 1,100  | 882.00   | 970,200    |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 7,700  | 3,706.00 | 28,536,200 |
| 第一生命ホールディングス                  | 17,000 | 2,437.50 | 41,437,500 |
| 東京海上ホールディングス                  | 11,300 | 6,001.00 | 67,811,300 |
| T & Dホールディングス                 | 9,000  | 1,439.00 | 12,951,000 |
| アドバンスクリエイト                    | 200    | 1,051.00 | 210,200    |
| 全国保証                          | 800    | 5,270.00 | 4,216,000  |
| あんしん保証                        | 100    | 306.00   | 30,600     |
| ジェイリース                        | 100    | 2,327.00 | 232,700    |
| イントラスト                        | 100    | 830.00   | 83,000     |
| 日本モーゲージサービス                   | 200    | 1,094.00 | 218,800    |
| C a s a                       | 100    | 922.00   | 92,200     |
| アルヒ                           | 500    | 1,372.00 | 686,000    |
| プレミアグループ                      | 200    | 3,735.00 | 747,000    |
| クレディセゾン                       | 2,200  | 1,420.00 | 3,124,000  |
| 芙蓉総合リース                       | 400    | 7,530.00 | 3,012,000  |
| みずほリース                        | 500    | 3,560.00 | 1,780,000  |
| 東京センチュリー                      | 700    | 6,230.00 | 4,361,000  |

|                  |        |          |            |
|------------------|--------|----------|------------|
| 日本証券金融           | 1,300  | 809.00   | 1,051,700  |
| アイフル             | 5,700  | 387.00   | 2,205,900  |
| リコーリース           | 300    | 3,645.00 | 1,093,500  |
| イオンフィナンシャルサービス   | 1,900  | 1,440.00 | 2,736,000  |
| アコム              | 6,700  | 378.00   | 2,532,600  |
| ジャックス            | 400    | 3,075.00 | 1,230,000  |
| オリエントコーポレーション    | 9,300  | 147.00   | 1,367,100  |
| オリックス            | 20,900 | 2,253.00 | 47,087,700 |
| 三菱HCキャピタル        | 12,700 | 578.00   | 7,340,600  |
| 九州リースサービス        | 200    | 602.00   | 120,400    |
| 日本取引所グループ        | 8,700  | 2,584.50 | 22,485,150 |
| イー・ギャランティ        | 500    | 2,652.00 | 1,326,000  |
| アサックス            | 200    | 714.00   | 142,800    |
| NECキャピタルソリューション  | 100    | 2,016.00 | 201,600    |
| いちご              | 3,800  | 335.00   | 1,273,000  |
| 日本駐車場開発          | 3,800  | 147.00   | 558,600    |
| スター・マイカ・ホールディングス | 200    | 1,486.00 | 297,200    |
| SREホールディングス      | 100    | 8,640.00 | 864,000    |
| ADワークスグループ       | 700    | 162.00   | 113,400    |
| ヒューリック           | 8,200  | 1,133.00 | 9,290,600  |
| 三栄建築設計           | 100    | 1,765.00 | 176,500    |
| 野村不動産ホールディングス    | 1,800  | 2,723.00 | 4,901,400  |
| 三重交通グループホールディングス | 700    | 490.00   | 343,000    |
| サムティ             | 600    | 2,603.00 | 1,561,800  |
| ディア・ライフ          | 400    | 563.00   | 225,200    |
| コーセーアールイー        | 100    | 678.00   | 67,800     |
| 日本商業開発           | 200    | 1,776.00 | 355,200    |
| プレサンスコーポレーション    | 500    | 1,975.00 | 987,500    |
| THEグローバル社        | 300    | 222.00   | 66,600     |
| ハウスコム            | 100    | 1,278.00 | 127,800    |
| 日本管理センター         | 200    | 1,130.00 | 226,000    |
| サンセイランディック       | 100    | 830.00   | 83,000     |
| エストラスト           | 100    | 647.00   | 64,700     |
| フージャースホールディングス   | 400    | 696.00   | 278,400    |
| オープンハウス          | 1,100  | 7,100.00 | 7,810,000  |
| 東急不動産ホールディングス    | 10,200 | 641.00   | 6,538,200  |
| 飯田グループホールディングス   | 2,900  | 2,861.00 | 8,296,900  |
| イーランド            | 100    | 1,763.00 | 176,300    |
| ムゲンエステート         | 200    | 488.00   | 97,600     |
| ビーロッド            | 200    | 559.00   | 111,800    |
| ファーストブラザーズ       | 100    | 1,053.00 | 105,300    |
| ハウズドゥ            | 200    | 965.00   | 193,000    |

|                  |        |          |            |
|------------------|--------|----------|------------|
| シーアールイー          | 100    | 1,791.00 | 179,100    |
| ケイアイスター不動産       | 200    | 6,330.00 | 1,266,000  |
| アグレ都市デザイン        | 100    | 1,545.00 | 154,500    |
| グッドコムアセット        | 200    | 1,335.00 | 267,000    |
| ジェイ・エス・ビー        | 100    | 2,817.00 | 281,700    |
| テンポイノベーション       | 100    | 908.00   | 90,800     |
| グローバル・リンク・マネジメント | 100    | 1,053.00 | 105,300    |
| パーク24            | 1,900  | 1,893.00 | 3,596,700  |
| パラカ              | 100    | 1,633.00 | 163,300    |
| 宮越ホールディングス       | 100    | 1,171.00 | 117,100    |
| 三井不動産            | 15,700 | 2,677.00 | 42,028,900 |
| 三菱地所             | 22,600 | 1,727.50 | 39,041,500 |
| 平和不動産            | 600    | 3,465.00 | 2,079,000  |
| 東京建物             | 3,400  | 1,667.00 | 5,667,800  |
| ダイビル             | 900    | 1,525.00 | 1,372,500  |
| 京阪神ビルディング        | 600    | 1,408.00 | 844,800    |
| 住友不動産            | 7,200  | 4,111.00 | 29,599,200 |
| テオーシー            | 600    | 624.00   | 374,400    |
| 東京楽天地            | 100    | 4,135.00 | 413,500    |
| スターツコーポレーション     | 500    | 2,741.00 | 1,370,500  |
| フジ住宅             | 400    | 715.00   | 286,000    |
| 空港施設             | 400    | 580.00   | 232,000    |
| 明和地所             | 200    | 619.00   | 123,800    |
| ゴールドクレスト         | 300    | 1,538.00 | 461,400    |
| エスリード            | 100    | 1,707.00 | 170,700    |
| 日神グループホールディングス   | 500    | 500.00   | 250,000    |
| 日本エスコン           | 600    | 820.00   | 492,000    |
| タカラレーベン          | 1,500  | 297.00   | 445,500    |
| A V A N T I A    | 200    | 867.00   | 173,400    |
| イオンモール           | 1,700  | 1,710.00 | 2,907,000  |
| 毎日コムネット          | 100    | 777.00   | 77,700     |
| ファースト住建          | 100    | 1,224.00 | 122,400    |
| カチタス             | 900    | 4,175.00 | 3,757,500  |
| トーセイ             | 500    | 1,113.00 | 556,500    |
| サンフロンティア不動産      | 500    | 1,080.00 | 540,000    |
| F Jネクストホールディングス  | 400    | 1,078.00 | 431,200    |
| インテリックス          | 100    | 721.00   | 72,100     |
| ランドビジネス          | 200    | 276.00   | 55,200     |
| サンネクスタグループ       | 100    | 1,035.00 | 103,500    |
| グランディハウス         | 200    | 492.00   | 98,400     |
| 日本空港ビルデング        | 1,300  | 6,090.00 | 7,917,000  |
| 明豊ファシリティワークス     | 200    | 921.00   | 184,200    |



|                   |       |          |            |
|-------------------|-------|----------|------------|
| 日本工営              | 200   | 3,550.00 | 710,000    |
| L I F U L L       | 1,100 | 364.00   | 400,400    |
| ミクシィ              | 800   | 2,245.00 | 1,796,000  |
| ジェイエイシーリクルートメント   | 300   | 2,259.00 | 677,700    |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 5,500 | 3,655.00 | 20,102,500 |
| メンバーズ             | 100   | 2,556.00 | 255,600    |
| 中広                | 100   | 396.00   | 39,600     |
| UTグループ            | 500   | 4,020.00 | 2,010,000  |
| アイティメディア          | 200   | 2,207.00 | 441,400    |
| E・Jホールディングス       | 200   | 1,305.00 | 261,000    |
| 夢真ビーネックスグループ      | 900   | 1,634.00 | 1,470,600  |
| コシダカホールディングス      | 900   | 722.00   | 649,800    |
| アルトナー             | 100   | 875.00   | 87,500     |
| パソナグループ           | 400   | 3,645.00 | 1,458,000  |
| C D S             | 100   | 1,619.00 | 161,900    |
| リンクアンドモチベーション     | 800   | 1,140.00 | 912,000    |
| エス・エム・エス          | 1,100 | 4,720.00 | 5,192,000  |
| サニーサイドアップグループ     | 100   | 786.00   | 78,600     |
| パーソルホールディングス      | 3,300 | 3,125.00 | 10,312,500 |
| リニカル              | 200   | 824.00   | 164,800    |
| クックパッド            | 1,100 | 225.00   | 247,500    |
| エスクリ              | 200   | 596.00   | 119,200    |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス  | 200   | 670.00   | 134,000    |
| 学情                | 200   | 1,236.00 | 247,200    |
| スタジオアリス           | 100   | 2,209.00 | 220,900    |
| シミックホールディングス      | 200   | 1,600.00 | 320,000    |
| エプコ               | 100   | 835.00   | 83,500     |
| N J S             | 100   | 2,020.00 | 202,000    |
| 総合警備保障            | 1,300 | 4,795.00 | 6,233,500  |
| カカクコム             | 2,500 | 3,685.00 | 9,212,500  |
| アイロムグループ          | 100   | 1,918.00 | 191,800    |
| セントケア・ホールディング     | 200   | 933.00   | 186,600    |
| サイネックス            | 100   | 674.00   | 67,400     |
| ルネサンス             | 200   | 1,319.00 | 263,800    |
| ディップ              | 600   | 4,165.00 | 2,499,000  |
| デジタルホールディングス      | 200   | 1,799.00 | 359,800    |
| 新日本科学             | 400   | 1,673.00 | 669,200    |
| キャリアデザインセンター      | 100   | 1,171.00 | 117,100    |
| ベネフィット・ワン         | 1,200 | 5,840.00 | 7,008,000  |
| エムスリー             | 5,900 | 6,346.00 | 37,441,400 |
| ツカダ・グローバルホールディング  | 300   | 351.00   | 105,300    |
| プラス               | 100   | 834.00   | 83,400     |

|                      |       |           |            |
|----------------------|-------|-----------|------------|
| アウトソーシング             | 1,900 | 1,657.00  | 3,148,300  |
| ウェルネット               | 400   | 506.00    | 202,400    |
| ワールドホールディングス         | 100   | 2,981.00  | 298,100    |
| ディー・エヌ・エー            | 1,300 | 2,166.00  | 2,815,800  |
| 博報堂D Yホールディングス       | 4,700 | 1,940.00  | 9,118,000  |
| ぐるなび                 | 500   | 596.00    | 298,000    |
| タカミヤ                 | 400   | 448.00    | 179,200    |
| ジャパンベストレスキューシステム     | 200   | 1,001.00  | 200,200    |
| ファンコミュニケーションズ        | 900   | 450.00    | 405,000    |
| ライク                  | 100   | 1,850.00  | 185,000    |
| ビジネス・ブレークスルー         | 200   | 429.00    | 85,800     |
| エスプール                | 900   | 1,233.00  | 1,109,700  |
| WDBホールディングス          | 200   | 3,725.00  | 745,000    |
| ティア                  | 200   | 484.00    | 96,800     |
| アドウェイズ               | 500   | 879.00    | 439,500    |
| バリューコマース             | 300   | 4,990.00  | 1,497,000  |
| インフォマート              | 3,700 | 1,262.00  | 4,669,400  |
| J Pホールディングス          | 900   | 254.00    | 228,600    |
| エコナックホールディングス        | 800   | 99.00     | 79,200     |
| レグス                  | 100   | 1,585.00  | 158,500    |
| プレステージ・インターナショナル     | 1,300 | 763.00    | 991,900    |
| アミューズ                | 200   | 2,273.00  | 454,600    |
| ドリームインキュベータ          | 100   | 793.00    | 79,300     |
| クイック                 | 200   | 1,434.00  | 286,800    |
| T A C                | 300   | 239.00    | 71,700     |
| 電通グループ               | 3,400 | 4,420.00  | 15,028,000 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ         | 200   | 1,330.00  | 266,000    |
| ぴあ                   | 100   | 4,230.00  | 423,000    |
| イオンファンタジー            | 100   | 2,032.00  | 203,200    |
| シーティーエス              | 400   | 825.00    | 330,000    |
| ネクシィーズグループ           | 100   | 885.00    | 88,500     |
| H . U . グループホールディングス | 900   | 2,677.00  | 2,409,300  |
| アルプス技研               | 300   | 2,085.00  | 625,500    |
| サニックス                | 600   | 335.00    | 201,000    |
| ダイオーズ                | 100   | 1,025.00  | 102,500    |
| 日本空調サービス             | 400   | 794.00    | 317,600    |
| オリエンタルランド            | 3,900 | 18,690.00 | 72,891,000 |
| ダスキン                 | 800   | 2,713.00  | 2,170,400  |
| 明光ネットワークジャパン         | 400   | 565.00    | 226,000    |
| ファルコホールディングス         | 200   | 1,710.00  | 342,000    |
| 秀英予備校                | 100   | 416.00    | 41,600     |
| ラウンドワン               | 900   | 1,472.00  | 1,324,800  |

|                     |        |          |            |
|---------------------|--------|----------|------------|
| リゾートトラスト            | 1,500  | 2,077.00 | 3,115,500  |
| ビー・エム・エル            | 400    | 3,985.00 | 1,594,000  |
| りらいあコミュニケーションズ      | 500    | 1,184.00 | 592,000    |
| リソー教育               | 1,500  | 448.00   | 672,000    |
| 早稲田アカデミー            | 200    | 1,040.00 | 208,000    |
| ユー・エス・エス            | 3,800  | 1,845.00 | 7,011,000  |
| 東京個別指導学院            | 300    | 694.00   | 208,200    |
| サイバーエージェント          | 8,200  | 2,001.00 | 16,408,200 |
| 楽天グループ              | 17,100 | 1,238.00 | 21,169,800 |
| クリーク・アンド・リバー社       | 200    | 2,026.00 | 405,200    |
| モーニングスター            | 600    | 535.00   | 321,000    |
| テー・オー・ダブリュー         | 600    | 340.00   | 204,000    |
| 山田コンサルティンググループ      | 200    | 1,213.00 | 242,600    |
| セントラルスポーツ           | 100    | 2,526.00 | 252,600    |
| フルキャストホールディングス      | 300    | 2,785.00 | 835,500    |
| エン・ジャパン             | 500    | 4,615.00 | 2,307,500  |
| テクノプロ・ホールディングス      | 2,000  | 3,485.00 | 6,970,000  |
| アトラグループ             | 100    | 315.00   | 31,500     |
| インターワークス            | 100    | 409.00   | 40,900     |
| アイ・アールジャパンホールディングス  | 200    | 9,050.00 | 1,810,000  |
| Keeper 技研           | 200    | 3,280.00 | 656,000    |
| ファーストロジック           | 100    | 794.00   | 79,400     |
| 三機サービス              | 100    | 1,063.00 | 106,300    |
| Gunosy              | 200    | 624.00   | 124,800    |
| デザインワン・ジャパン         | 200    | 226.00   | 45,200     |
| イー・ガーディアン           | 100    | 3,300.00 | 330,000    |
| リブセンス               | 300    | 240.00   | 72,000     |
| ジャパンマテリアル           | 1,000  | 1,616.00 | 1,616,000  |
| ベクトル                | 500    | 1,341.00 | 670,500    |
| ウチヤマホールディングス        | 200    | 372.00   | 74,400     |
| チャーム・ケア・コーポレーション    | 300    | 1,656.00 | 496,800    |
| キャリアリンク             | 100    | 1,433.00 | 143,300    |
| I B J               | 300    | 1,128.00 | 338,400    |
| アサンテ                | 200    | 1,735.00 | 347,000    |
| バリューHR              | 100    | 1,967.00 | 196,700    |
| M&Aキャピタルパートナーズ      | 300    | 6,130.00 | 1,839,000  |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 100    | 1,460.00 | 146,000    |
| E R Iホールディングス       | 100    | 1,705.00 | 170,500    |
| アピスト                | 100    | 2,886.00 | 288,600    |
| シグマクシス・ホールディングス     | 200    | 2,944.00 | 588,800    |
| ウィルグループ             | 200    | 1,398.00 | 279,600    |
| エスクロー・エージェント・ジャパン   | 500    | 198.00   | 99,000     |

|                        |        |           |             |
|------------------------|--------|-----------|-------------|
| メドピア                   | 300    | 3,070.00  | 921,000     |
| レアジョブ                  | 100    | 1,202.00  | 120,200     |
| リクルートホールディングス          | 25,800 | 7,899.00  | 203,794,200 |
| エラン                    | 500    | 1,239.00  | 619,500     |
| 土木管理総合試験所              | 200    | 349.00    | 69,800      |
| ネットマーケティング             | 200    | 536.00    | 107,200     |
| 日本郵政                   | 43,600 | 853.00    | 37,190,800  |
| ベルシステム24ホールディングス       | 500    | 1,416.00  | 708,000     |
| 鎌倉新書                   | 400    | 957.00    | 382,800     |
| S MN                   | 100    | 690.00    | 69,000      |
| 一蔵                     | 100    | 457.00    | 45,700      |
| グローバルキッズCOMPANY        | 100    | 905.00    | 90,500      |
| エアトリ                   | 200    | 4,310.00  | 862,000     |
| アトラエ                   | 200    | 2,449.00  | 489,800     |
| ストライク                  | 100    | 5,830.00  | 583,000     |
| ソラスト                   | 800    | 1,413.00  | 1,130,400   |
| セラク                    | 100    | 2,101.00  | 210,100     |
| インソース                  | 300    | 2,606.00  | 781,800     |
| ベイカレント・コンサルティング        | 200    | 53,400.00 | 10,680,000  |
| Orchestra Holdings     | 100    | 4,975.00  | 497,500     |
| アイモバイル                 | 100    | 1,486.00  | 148,600     |
| キャリアインデックス             | 100    | 1,010.00  | 101,000     |
| MS - Japan             | 100    | 1,006.00  | 100,600     |
| 船場                     | 100    | 789.00    | 78,900      |
| グレイステクノロジー             | 400    | 1,021.00  | 408,400     |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 1,100  | 2,538.00  | 2,791,800   |
| フルテック                  | 100    | 1,480.00  | 148,000     |
| ツナググループ・ホールディングス       | 100    | 323.00    | 32,300      |
| GameWith               | 100    | 540.00    | 54,000      |
| ソウルドアウト                | 100    | 1,383.00  | 138,300     |
| MS&Consulting          | 100    | 771.00    | 77,100      |
| ウェルビー                  | 200    | 1,681.00  | 336,200     |
| ミダックホールディングス           | 100    | 5,530.00  | 553,000     |
| 日総工産                   | 300    | 735.00    | 220,500     |
| キュービーネットホールディングス       | 200    | 1,983.00  | 396,600     |
| RPAホールディングス            | 500    | 426.00    | 213,000     |
| スプリックス                 | 100    | 1,265.00  | 126,500     |
| マネジメントソリューションズ         | 200    | 3,365.00  | 673,000     |
| プロレド・パートナーズ            | 100    | 1,280.00  | 128,000     |
| and factory            | 100    | 474.00    | 47,400      |
| テノ・ホールディングス            | 100    | 823.00    | 82,300      |
| フロンティア・マネジメント          | 100    | 919.00    | 91,900      |

|                     |       |           |            |
|---------------------|-------|-----------|------------|
| ピアラ                 | 100   | 728.00    | 72,800     |
| コプロ・ホールディングス        | 100   | 1,241.00  | 124,100    |
| ギークス                | 100   | 1,477.00  | 147,700    |
| カーブスホールディングス        | 900   | 946.00    | 851,400    |
| フォーラムエンジニアリング       | 200   | 880.00    | 176,000    |
| ダイレクトマーケティングミックス    | 200   | 4,175.00  | 835,000    |
| ポピンズホールディングス        | 100   | 3,690.00  | 369,000    |
| L I T A L I C O     | 300   | 3,685.00  | 1,105,500  |
| アドバンテッジリスクマネジメント    | 200   | 840.00    | 168,000    |
| リログループ              | 1,800 | 2,257.00  | 4,062,600  |
| 東祥                  | 300   | 2,195.00  | 658,500    |
| T R Eホールディングス       | 500   | 1,635.00  | 817,500    |
| 人・夢・技術グループ          | 100   | 1,959.00  | 195,900    |
| エイチ・アイ・エス           | 700   | 2,689.00  | 1,882,300  |
| ラックランド              | 100   | 3,000.00  | 300,000    |
| 共立メンテナンス            | 600   | 4,560.00  | 2,736,000  |
| イチネンホールディングス        | 400   | 1,432.00  | 572,800    |
| 建設技術研究所             | 200   | 2,776.00  | 555,200    |
| スペース                | 300   | 975.00    | 292,500    |
| 燦ホールディングス           | 200   | 1,402.00  | 280,400    |
| 東京テアトル              | 100   | 1,243.00  | 124,300    |
| タナベ経営               | 200   | 739.00    | 147,800    |
| ナガワ                 | 100   | 11,130.00 | 1,113,000  |
| 東京都競馬               | 300   | 4,580.00  | 1,374,000  |
| 常磐興産                | 100   | 1,446.00  | 144,600    |
| カナモト                | 600   | 2,466.00  | 1,479,600  |
| 西尾レントオール            | 300   | 2,874.00  | 862,200    |
| アゴラ ホスピタリティグループ     | 2,100 | 24.00     | 50,400     |
| トランス・コスモス           | 400   | 3,310.00  | 1,324,000  |
| 乃村工藝社               | 1,400 | 1,112.00  | 1,556,800  |
| 藤田観光                | 200   | 2,560.00  | 512,000    |
| K N T - C Tホールディングス | 200   | 1,780.00  | 356,000    |
| 日本管財                | 400   | 2,785.00  | 1,114,000  |
| トーカイ                | 300   | 2,221.00  | 666,300    |
| セコム                 | 3,300 | 7,682.00  | 25,350,600 |
| セントラル警備保障           | 200   | 2,693.00  | 538,600    |
| 丹青社                 | 700   | 927.00    | 648,900    |
| メイテック               | 400   | 7,000.00  | 2,800,000  |
| 応用地質                | 400   | 1,821.00  | 728,400    |
| 船井総研ホールディングス        | 700   | 2,635.00  | 1,844,500  |
| 進学会ホールディングス         | 200   | 401.00    | 80,200     |
| オオバ                 | 200   | 829.00    | 165,800    |

|              |           |          |               |  |
|--------------|-----------|----------|---------------|--|
| いであ          | 100       | 1,936.00 | 193,600       |  |
| 学究社          | 100       | 1,409.00 | 140,900       |  |
| ベネッセホールディングス | 1,100     | 2,443.00 | 2,687,300     |  |
| イオンディライト     | 400       | 3,515.00 | 1,406,000     |  |
| ナック          | 200       | 980.00   | 196,000       |  |
| ダイセキ         | 600       | 5,330.00 | 3,198,000     |  |
| ステップ         | 100       | 1,861.00 | 186,100       |  |
| 合 計          | 3,802,800 |          | 9,744,487,560 |  |

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

**【中間財務諸表】**

<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（2021年11月 9日から2022年 5月 8日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【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<br>2021年11月 8日現在 | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |
|------------------|-------------------------|---------------------------|
| <b>資産の部</b>      |                         |                           |
| 流動資産             |                         |                           |
| コール・ローン          | 89,580,335              | 83,801,140                |
| 親投資信託受益証券        | 9,764,564,850           | 9,133,394,950             |
| 未収入金             | 1,364,283               | -                         |
| 流動資産合計           | 9,855,509,468           | 9,217,196,090             |
| 資産合計             | 9,855,509,468           | 9,217,196,090             |
| <b>負債の部</b>      |                         |                           |
| 流動負債             |                         |                           |
| 未払収益分配金          | 5,598,030               | -                         |
| 未払解約金            | 2,343,824               | 3,966,244                 |
| 未払受託者報酬          | 4,273,559               | 3,997,425                 |
| 未払委託者報酬          | 76,925,218              | 71,954,746                |
| 未払利息             | 48                      | 28                        |
| その他未払費用          | 213,619                 | 199,816                   |
| 流動負債合計           | 89,354,298              | 80,118,259                |
| 負債合計             | 89,354,298              | 80,118,259                |
| <b>純資産の部</b>     |                         |                           |
| 元本等              |                         |                           |
| 元本               | 11,196,060,260          | 11,071,914,113            |
| 剰余金              |                         |                           |
| 中間剰余金又は中間欠損金 ( ) | 1,429,905,090           | 1,934,836,282             |
| ( 分配準備積立金 )      | 3,224,063,371           | 3,167,578,710             |
| 元本等合計            | 9,766,155,170           | 9,137,077,831             |
| 純資産合計            | 9,766,155,170           | 9,137,077,831             |
| 負債純資産合計          | 9,855,509,468           | 9,217,196,090             |



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 前中間計算期間<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年 5月 9日 | 当中間計算期間<br>自 2021年11月 9日<br>至 2022年 5月 8日 |
|---|---|---|
| 営業収益                                      |   |   |
| 受取利息                                      | 29  | -   |
| 有価証券売買等損益                                 | 1,456,059,512                             | 449,703,139                               |
| 営業収益合計                                    | 1,456,059,541                             | 449,703,139                               |
| 営業費用                                      |   |   |
| 支払利息                                      | 1,666                                     | 1,742                                     |
| 受託者報酬                                     | 4,192,519                                 | 3,997,425                                 |
| 委託者報酬                                     | 75,466,411                                | 71,954,746                                |
| その他費用                                     | 209,570                                   | 199,816                                   |
| 営業費用合計                                    | 79,870,166                                | 76,153,729                                |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 1,376,189,375                             | 525,856,868                               |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 1,376,189,375                             | 525,856,868                               |
| 中間純利益又は中間純損失（ ）                           | 1,376,189,375                             | 525,856,868                               |
| 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（ ） | 122,061,278                               | 7,908,804                                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 3,682,887,183                             | 1,429,905,090                             |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 458,344,931                               | 25,162,560                                |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 458,344,931                               | 25,162,560                                |
| 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                            | 17,939,505                                | 12,145,688                                |
| 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                   | 17,939,505                                | 12,145,688                                |
| 分配金                                       | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           | 1,988,353,660                             | 1,934,836,282                             |

## (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<br>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<br>2021年11月 8日現在 | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |
|-------------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 1. 期首元本額                            | 13,070,282,130円         | 11,196,060,260円           |
| 期中追加設定元本額                           | 170,327,435円            | 72,711,424円               |
| 期中一部解約元本額                           | 2,044,549,305円          | 196,857,571円              |
| 2. 受益権の総数                           | 11,196,060,260口         | 11,071,914,113口           |
| 3. 元本の欠損<br>純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | 1,429,905,090円          | 1,934,836,282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<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年 5月 9日 | 当中間計算期間<br>自 2021年11月 9日<br>至 2022年 5月 8日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。                               | 該当事項はありません。                               |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

|                     | 前計算期間末<br>2021年11月 8日現在   | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在                                |
|---------------------|---|--|
| 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 中間貸借対照表計上額は中間計算期間末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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>同左 |

|                         |   |   |
|-------------------------|---|---|
| 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
|-------------------------|---|---|

## （ 1口当たり情報）

| 前計算期間末<br>2021年11月 8日現在 |          | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |          |
|-------------------------|----------|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額               | 0.8723円  | 1口当たり純資産額                 | 0.8252円  |
| (1万口当たり純資産額)            | (8,723円) | (1万口当たり純資産額)              | (8,252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<br>2021年11月 8日現在 | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |
|-----------------|-------------------------|---------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                         |                           |
| 流動資産            |                         |                           |
| コール・ローン         | 52,712,505              | 51,924,627                |
| 地方債証券           | 54,614,090              | 54,454,575                |
| 親投資信託受益証券       | 107,506,555             | 102,340,152               |
| 未収利息            | 42,134                  | 40,123                    |
| 流動資産合計          | 214,875,284             | 208,759,477               |
| 資産合計            | 214,875,284             | 208,759,477               |
| <b>負債の部</b>     |                         |                           |
| 流動負債            |                         |                           |
| 未払収益分配金         | 101,764                 | -                         |
| 未払受託者報酬         | 93,519                  | 89,212                    |
| 未払委託者報酬         | 1,684,503               | 1,606,847                 |
| 未払利息            | 28                      | 17                        |
| その他未払費用         | 4,618                   | 4,403                     |
| 流動負債合計          | 1,884,432               | 1,700,479                 |
| 負債合計            | 1,884,432               | 1,700,479                 |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                           |
| 元本等             |                         |                           |
| 元本              | 203,529,299             | 203,798,660               |
| 剰余金             |                         |                           |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 9,461,553               | 3,260,338                 |
| (分配準備積立金)       | 34,724,773              | 34,312,148                |
| 元本等合計           | 212,990,852             | 207,058,998               |
| 純資産合計           | 212,990,852             | 207,058,998               |
| 負債純資産合計         | 214,875,284             | 208,759,477               |

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 前中間計算期間<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年 5月 9日 | 当中間計算期間<br>自 2021年11月 9日<br>至 2022年 5月 8日 |
|---|---|---|
| 営業収益                                      |   |   |
| 受取利息                                      | 123,056                                   | 123,009                                   |
| 有価証券売買等損益                                 | 16,607,965                                | 4,575,705                                 |
| 営業収益合計                                    | 16,731,021                                | 4,452,696                                 |
| 営業費用                                      |   |   |
| 支払利息                                      | 2,418                                     | 2,450                                     |
| 受託者報酬                                     | 92,739                                    | 89,212                                    |
| 委託者報酬                                     | 1,670,459                                 | 1,606,847                                 |
| その他費用                                     | 4,585                                     | 4,403                                     |
| 営業費用合計                                    | 1,770,201                                 | 1,702,912                                 |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 14,960,820                                | 6,155,608                                 |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 14,960,820                                | 6,155,608                                 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ）                           | 14,960,820                                | 6,155,608                                 |
| 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（ ） | 1,183,316                                 | 11,535                                    |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 10,178,761                                | 9,461,553                                 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 1,005,871                                 | 55,501                                    |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 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                                     | 55,501                                    |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | -   | 112,643                                   |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -   | 112,643                                   |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -   | -   |
| 分配金                                       | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           | 4,604,614                                 | 3,260,338                                 |

## (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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br>2021年11月 8日現在 | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |
|----|-----------|-------------------------|---------------------------|
| 1. | 期首元本額     | 223,571,562円            | 203,529,299円              |
|    | 期中追加設定元本額 | 5,792,929円              | 2,692,897円                |
|    | 期中一部解約元本額 | 25,835,192円             | 2,423,536円                |
| 2. | 受益権の総数    | 203,529,299口            | 203,798,660口              |

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間<br>自 2020年11月10日<br>至 2021年 5月 9日 | 当中間計算期間<br>自 2021年11月 9日<br>至 2022年 5月 8日 |
|---|---|
| 該当事項はありません。                               | 該当事項はありません。                               |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

|  | 前計算期間末<br>2021年11月 8日現在 | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |
|--|-------------------------|---------------------------|
|  |                         |                           |

|                         |   |  |
|-------------------------|---|--|
| 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額     | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 中間貸借対照表計上額は中間計算期間末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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br><br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br><br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br><br>同左 |
| 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。      |

## （1口当たり情報）

| 前計算期間末<br>2021年11月 8日現在 |           | 当中間計算期間末<br>2022年 5月 8日現在 |           |
|-------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
| 1口当たり純資産額               | 1.0465円   | 1口当たり純資産額                 | 1.0160円   |
| (1万口当たり純資産額)            | (10,465円) | (1万口当たり純資産額)              | (10,160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

（単位：円）

|          | 2021年11月 8日現在 | 2022年 5月 8日現在 |
|----------|---------------|---------------|
| 資産の部     |               |               |
| 流動資産     |               |               |
| 金銭信託     | 806,211       | 256,158       |
| コール・ローン  | 47,909,393    | 67,403,305    |
| 株式       | 9,744,487,560 | 9,059,972,210 |
| 派生商品評価勘定 | 937,250       | 1,528,900     |

|             | 2021年11月 8日現在 | 2022年 5月 8日現在 |
|-------------|---------------|---------------|
| 未収配当金       | 82,395,476    | 107,751,368   |
| 前払金         | -             | 3,160,000     |
| 流動資産合計      | 9,876,535,890 | 9,240,071,941 |
| 資産合計        | 9,876,535,890 | 9,240,071,941 |
| 負債の部        |               |               |
| 流動負債        |               |               |
| 派生商品評価勘定    | 675,550       | 2,813,300     |
| 前受金         | 385,000       | -             |
| 未払解約金       | 1,364,283     | -             |
| 未払利息        | 25            | 23            |
| 流動負債合計      | 2,424,858     | 2,813,323     |
| 負債合計        | 2,424,858     | 2,813,323     |
| 純資産の部       |               |               |
| 元本等         |               |               |
| 元本          | 4,516,043,644 | 4,429,609,162 |
| 剰余金         |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,358,067,388 | 4,807,649,456 |
| 元本等合計       | 9,874,111,032 | 9,237,258,618 |
| 純資産合計       | 9,874,111,032 | 9,237,258,618 |
| 負債純資産合計     | 9,876,535,890 | 9,240,071,941 |

## 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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)

|              | 2021年11月 8日現在  | 2022年 5月 8日現在  |
|--------------|----------------|----------------|
| 1. 期首        | 2020年11月10日    | 2021年11月 9日    |
| 期首元本額        | 5,384,177,187円 | 4,516,043,644円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 18,387,773円    | 15,719,530円    |
| 期首からの一部解約元本額 | 886,521,316円   | 102,154,012円   |



|    |   |   |   |
|----|---|---|---|
|    | 元本の内訳<br>インデックスポートフォリオ<br>バランスポートフォリオ<br>計                      | 4,466,864,067円<br>49,179,577円<br>4,516,043,644円 | 4,380,525,156円<br>49,084,006円<br>4,429,609,162円 |
| 2. | 受益権の総数  | 4,516,043,644口                                  | 4,429,609,162口                                  |
| 3. | 担保資産<br>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。<br>株式 | 102,746,700円                                    | 94,665,300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

|                         | 2021年11月 8日現在   | 2022年 5月 8日現在   |
|-------------------------|---|---|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 同左  |
| 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>同左        |
| 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（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）

（2021年11月 8日現在）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 |       | 時価 | 評価損益 |
|----|----|------|-------|----|------|
|    |    |      | うち1年超 |    |      |
|    |    |      |       |    |      |

|      |                |             |   |             |         |
|------|----------------|-------------|---|-------------|---------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 121,745,000 | - | 122,010,000 | 265,000 |
| 合計   |                | 121,745,000 | - | 122,010,000 | 265,000 |

(2022年 5月 8日現在)

(単位:円)

| 区分   | 種類             | 契約額等        |       | 時価          | 評価損益      |
|------|----------------|-------------|-------|-------------|-----------|
|      |                |             | うち1年超 |             |           |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 154,840,000 | -     | 153,560,000 | 1,280,000 |
| 合計   |                | 154,840,000 | -     | 153,560,000 | 1,280,000 |

## (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)

| 2021年11月 8日現在 |          | 2022年 5月 8日現在 |          |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 1口当たり純資産額     | 2.186円   | 1口当たり純資産額     | 2.085円   |
| (1千口当たり純資産額)  | (2,186円) | (1千口当たり純資産額)  | (2,085円) |

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022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           | 9,132,922,096円  |
| 負債総額           | 11,610,613円     |
| 純資産総額（ - ）     | 9,121,311,483円  |
| 発行済口数          | 11,076,163,892口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.8235円         |

### 【バランスポートフォリオ】

#### 【純資産額計算書】

|                |              |
|----------------|--------------|
| 資産総額           | 206,912,708円 |
| 負債総額           | 206,804円     |
| 純資産総額（ - ）     | 206,705,904円 |
| 発行済口数          | 203,773,730口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0144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           | 9,304,331,742円 |
| 負債総額           | 88,539,931円    |
| 純資産総額（ - ）     | 9,215,791,811円 |
| 発行済口数          | 4,424,065,726口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.083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

|            |          |                 |
|------------|----------|-----------------|
| 2022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（2022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（2022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（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2022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<br>(単位：億円) |
|---------|--------|-----------------|
| 投資信託総合計 | 871    | 240,056         |
| 株式投資信託  | 804    | 205,009         |
| 単位型     | 308    | 10,693          |
| 追加型     | 496    | 194,315         |
| 公社債投資信託 | 67     | 35,047          |
| 単位型     | 54     | 1,742           |
| 追加型     | 13     | 33,304          |

### 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63期事業年度（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

|           | 第62期<br>(2021年3月31日) |        | 第63期<br>(2022年3月31日) |        |
|-----------|----------------------|--------|----------------------|--------|
| 資産の部      |                      |        |                      |        |
| 流動資産      |                      |        |                      |        |
| 現金・預金     |                      | 24,698 |                      | 42,427 |
| 有価証券      |                      | 17     |                      | 170    |
| 前払費用      |                      | 785    |                      | 932    |
| 未収入金      |                      | 225    |                      | 96     |
| 未収委託者報酬   |                      | 24,738 |                      | 25,193 |
| 未収収益      | 3                    | 891    | 3                    | 1,048  |
| 関係会社短期貸付金 |                      | 2,403  |                      | 5,005  |
| 立替金       |                      | 930    |                      | 1,056  |
| その他       | 2                    | 361    | 2                    | 998    |
| 流動資産合計    |                      | 55,053 |                      | 76,928 |
| 固定資産      |                      |        |                      |        |
| 有形固定資産    |                      |        |                      |        |
| 建物        | 1                    | 245    | 1                    | 244    |
| 器具備品      | 1                    | 190    | 1                    | 153    |
| 有形固定資産合計  |                      | 436    |                      | 397    |
| 無形固定資産    |                      |        |                      |        |
| ソフトウェア    |                      | 241    |                      | 335    |
| 無形固定資産合計  |                      | 241    |                      | 335    |
| 投資その他の資産  |                      |        |                      |        |
| 投資有価証券    |                      | 22,903 |                      | 23,969 |
| 関係会社株式    |                      | 25,987 |                      | 22,366 |
| 長期差入保証金   |                      | 678    |                      | 652    |
| 繰延税金資産    |                      | 1,845  |                      | 3,678  |

|            |         |         |
|------------|---------|---------|
| 投資その他の資産合計 | 51,414  | 50,667  |
| 固定資産合計     | 52,092  | 51,399  |
| 資産合計       | 107,145 | 128,328 |

(単位：百万円)

|                 | 第62期<br>(2021年3月31日) | 第63期<br>(2022年3月31日) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| <b>負債の部</b>     |                      |                      |
| <b>流動負債</b>     |                      |                      |
| 預り金             | 844                  | 651                  |
| 未払金             | 9,834                | 9,693                |
| 未払収益分配金         | 8                    | 7                    |
| 未払償還金           | 71                   | 71                   |
| 未払手数料           | 8,956                | 8,783                |
| その他未払金          | 798                  | 831                  |
| 未払費用            | 3 4,660              | 3 5,572              |
| 未払法人税等          | 1,090                | 2,354                |
| 未払消費税等          | 4 775                | 4 3,669              |
| 賞与引当金           | 3,034                | 3,958                |
| 役員賞与引当金         | 55                   | 5                    |
| 訴訟損失引当金         | -                    | 7,847                |
| その他             | 643                  | 1,330                |
| 流動負債合計          | 20,938               | 35,083               |
| <b>固定負債</b>     |                      |                      |
| 退職給付引当金         | 1,456                | 1,395                |
| 賞与引当金           | 156                  | 423                  |
| その他             | 544                  | 390                  |
| 固定負債合計          | 2,157                | 2,209                |
| 負債合計            | 23,095               | 37,292               |
| <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         | 61,956               | 68,901               |
| 利益剰余金合計         | 61,956               | 68,901               |
| 自己株式            | 2,067                | 2,067                |
| 株主資本合計          | 82,472               | 89,417               |
| <b>評価・換算差額等</b> |                      |                      |
| その他有価証券評価差額金    | 1,461                | 2,350                |
| 繰延ヘッジ損益         | 115                  | 731                  |
| 評価・換算差額等合計      | 1,577                | 1,618                |
| 純資産合計           | 84,049               | 91,035               |
| 負債純資産合計         | 107,145              | 128,328              |

## (2) 【損益計算書】

|            | 第62期 |             | 第63期 |             |
|------------|------|-------------|------|-------------|
|            | (自   | 2020年4月1日   | (自   | 2021年4月1日   |
|            | 至    | 2021年3月31日) | 至    | 2022年3月31日) |
| 営業収益       |      |             |      |             |
| 委託者報酬      |      | 78,975      |      | 94,938      |
| その他営業収益    |      | 3,973       |      | 4,743       |
| 営業収益合計     |      | 82,948      |      | 99,682      |
| 営業費用       |      |             |      |             |
| 支払手数料      |      | 34,050      |      | 42,026      |
| 広告宣伝費      |      | 953         |      | 987         |
| 公告費        |      | 1           |      | 1           |
| 調査費        |      | 17,813      |      | 23,000      |
| 調査費        |      | 966         |      | 1,042       |
| 委託調査費      |      | 16,825      |      | 21,932      |
| 図書費        |      | 22          |      | 25          |
| 委託計算費      |      | 545         |      | 598         |
| 営業雑経費      |      | 1,053       |      | 1,014       |
| 通信費        |      | 174         |      | 143         |
| 印刷費        |      | 331         |      | 308         |
| 協会費        |      | 51          |      | 52          |
| 諸会費        |      | 11          |      | 13          |
| その他        |      | 483         |      | 494         |
| 営業費用計      |      | 54,419      |      | 67,628      |
| 一般管理費      |      |             |      |             |
| 給料         |      | 10,383      |      | 11,759      |
| 役員報酬       |      | 243         |      | 156         |
| 役員賞与引当金繰入額 |      | 55          |      | 5           |
| 給料・手当      |      | 6,766       |      | 7,229       |
| 賞与         |      | 159         |      | 143         |
| 賞与引当金繰入額   |      | 3,158       |      | 4,225       |
| 交際費        |      | 14          |      | 22          |
| 寄付金        |      | 30          |      | 29          |
| 旅費交通費      |      | 57          |      | 66          |
| 租税公課       |      | 485         |      | 429         |
| 不動産賃借料     |      | 939         |      | 937         |
| 退職給付費用     |      | 388         |      | 394         |
| 退職金        |      | 10          |      | 169         |
| 固定資産減価償却費  |      | 138         |      | 172         |
| 福利費        |      | 1,084       |      | 1,171       |
| 諸経費        |      | 4,286       |      | 3,888       |
| 一般管理費計     |      | 17,817      |      | 19,042      |
| 営業利益       |      | 10,711      |      | 13,010      |

(単位:百万円)

|             | 第62期 |             | 第63期 |             |
|-------------|------|-------------|------|-------------|
|             | (自   | 2020年4月1日   | (自   | 2021年4月1日   |
|             | 至    | 2021年3月31日) | 至    | 2022年3月31日) |
| 営業外収益       |      |             |      |             |
| 受取利息        |      | 75          |      | 71          |
| 受取配当金       | 1    | 2,555       | 1    | 5,257       |
| 有価証券償還益     |      | 14          |      | -           |
| 時効成立分配金・償還金 |      | 1           |      | 1           |
| 為替差益        |      | -           |      | 1,548       |
| その他         |      | 62          |      | 58          |



|                |        |        |
|----------------|--------|--------|
| 営業外収益合計        | 2,710  | 6,936  |
| 営業外費用          |        |        |
| 支払利息           | 122    | 177    |
| デリバティブ費用       | 804    | 49     |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | 25     | 9      |
| 為替差損           | 59     | -      |
| その他            | 42     | 39     |
| 営業外費用合計        | 1,054  | 275    |
| 経常利益           | 12,367 | 19,672 |
| 特別利益           |        |        |
| 投資有価証券売却益      | 774    | 253    |
| 子会社有償減資払戻益     | -      | 1,445  |
| その他            | 0      | -      |
| 特別利益合計         | 774    | 1,699  |
| 特別損失           |        |        |
| 投資有価証券売却損      | 237    | 132    |
| 投資有価証券評価損      | 5      | -      |
| 固定資産処分損        | 0      | 0      |
| 役員退職一時金        | 125    | -      |
| 訴訟損失引当金繰入額     | -      | 7,847  |
| 特別損失合計         | 369    | 7,980  |
| 税引前当期純利益       | 12,773 | 13,391 |
| 法人税、住民税及び事業税   | 3,722  | 3,435  |
| 法人税等還付税額       | -      | 2 329  |
| 法人税等調整額        | 373    | 1,851  |
| 法人税等合計         | 3,348  | 1,255  |
| 当期純利益          | 9,424  | 12,136 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

|                         | 株主資本   |       |             |                             |             |       | 株主資本<br>合計 |
|-------------------------|--------|-------|-------------|-----------------------------|-------------|-------|------------|
|                         | 資本金    | 資本剰余金 |             | 利益剰余金                       |             | 自己株式  |            |
|                         |        | 資本準備金 | 資本剰余金<br>合計 | その他利益<br>剰余金<br>繰越利益<br>剰余金 | 利益剰余金<br>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<br>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<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・<br>換算差額<br>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<br>当期変動額（純額） | 1,521                | 273         | 1,247              | 1,247  |
| 当期変動額合計                 | 1,521                | 273         | 1,247              | 6,647  |
| 当期末残高                   | 1,461                | 115         | 1,577              | 84,049 |

第63期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

|                         | 株主資本   |       |             |                             |             |       |            |
|-------------------------|--------|-------|-------------|-----------------------------|-------------|-------|------------|
|                         | 資本金    | 資本剰余金 |             | 利益剰余金                       |             | 自己株式  | 株主資本<br>合計 |
|                         |        | 資本準備金 | 資本剰余金<br>合計 | その他利益<br>剰余金<br>繰越利益<br>剰余金 | 利益剰余金<br>合計 |       |            |
| 当期首残高                   | 17,363 | 5,220 | 5,220       | 61,956                      | 61,956      | 2,067 | 82,472     |
| 当期変動額                   |        |       |             |                             |             |       |            |
| 剰余金の配当                  |        |       |             | 5,191                       | 5,191       |       | 5,191      |
| 当期純利益                   |        |       |             | 12,136                      | 12,136      |       | 12,136     |
| 自己株式の取得                 |        |       |             |                             |             |       |            |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |        |       |             |                             |             |       |            |
| 当期変動額合計                 | -      | -     | -           | 6,944                       | 6,944       | -     | 6,944      |
| 当期末残高                   | 17,363 | 5,220 | 5,220       | 68,901                      | 68,901      | 2,067 | 89,417     |

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

| 項目              | <p style="text-align: center;">第63期<br/>(自 2021年4月1日<br/>至 2022年3月31日)</p>  |
|-----------------|---|
| 1 資産の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 有価証券<br/> 子会社株式及び関連会社株式<br/> 総平均法による原価法<br/> その他有価証券<br/> 市場価格のない株式等以外のもの<br/> 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)<br/> 市場価格のない株式等<br/> 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ<br/> 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<br/> 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。<br/> なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。<br/> 建物 3年～15年<br/> 器具備品 3年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産<br/> 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>   |
| 3 引当金の計上基準      | <p>(1) 賞与引当金<br/> 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<br/> 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<br/> 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。<br/> 退職給付見込額の期間帰属方法<br/> 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。<br/> 数理計算上の差異の費用処理方法<br/> 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 訴訟損失引当金<br/> 訴訟による損失に備えるため、損失見込額を計上しております。</p> |
| 4 収益の計上基準       | <p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行業務の内容及び当該履行業務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務<br/> 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p>   |

|                           |   |
|---------------------------|---|
|                           | <p>(2) 投資顧問業務</p> <p>当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬</p> <p>当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> |
| 5 ヘッジ会計の方法                | <p>(1) ヘッジ会計の方法</p> <p>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p> <p>ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>              |
| 6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>消費税等の会計処理</p> <p>資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>  |

## (会計方針の変更)

|  |
|--|
| <p>第63期<br/>(自 2021年4月1日<br/>至 2022年3月31日)</p>   |
| <p>(収益認識に関する会計基準の適用)</p> <p>「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。</p> <p>収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。収益認識会計基準等の適用による、当財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>(時価の算定に関する会計基準の適用)</p> <p>「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、当財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては、記載していません。</p> |

## (未適用の会計基準等)

- ・ 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日)

## (1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

- (2) 適用予定日  
2023年3月期の期首より適用予定であります。
- (3) 当該会計基準等の適用による影響  
当該適用指針の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

## (重要な会計上の見積り)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

- 1 当事業年度の財務諸表に計上した金額  
訴訟損失引当金を7,847百万円計上しております。
- 2 会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報  
(1) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出方法  
訴訟について将来発生しうる損失の見込額を算出し、訴訟損失引当金として計上しています。
- (2) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出に用いた主要な仮定  
原告が主張する損害額に基づき、将来発生することが予想される損失の見積を行っています。
- (3) 翌事業年度の財務諸表に与える影響  
当社では、現在までに想定しうる最善の仮定に基づき訴訟損失引当金を計上しておりますが、今後の経過により、翌事業年度において訴訟損失引当金の追加計上または取り崩しを行う可能性があります。

## (貸借対照表関係)

| 第62期<br>(2021年3月31日)   | 第63期<br>(2022年3月31日)  |
|--|---|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額<br>建物 1,349百万円<br>器具備品 764百万円                                       | 1 有形固定資産の減価償却累計額<br>建物 1,390百万円<br>器具備品 823百万円  |
| 2 信託資産<br>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客<br>分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に<br>信託しております。             | 2 信託資産<br>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客<br>分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に<br>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<br>あります。<br>(流動資産)<br>未収収益 257百万円<br>(流動負債)<br>未払費用 1,247百万円 | 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで<br>あります。<br>(流動資産)<br>未収収益 233百万円<br>(流動負債)<br>未払費用 2,314百万円  |
| 4 消費税等の取扱い<br>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、<br>「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<br>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、<br>「未払消費税等」として表示しております。   |
|  | 5 保証債務<br>ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・<br>ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエ<br>クイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・<br>リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻<br>請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マ<br>ネジメント・リミテッドは最大5百万豪ドルを提供<br>する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタ<br>ル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供<br>義務を保証しております。 |

## (損益計算書関係)

| 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日)                     | 第63期<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日)                     |
|---|---|
| 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、<br>次のとおりであります。<br>受取配当金 2,498百万円 | 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、<br>次のとおりであります。<br>受取配当金 5,194百万円 |

|  |  |
|--|--|
|  | 2 法人税等還付税額<br>過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を計上しています。 |
|--|--|

## (株主資本等変動計算書関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## (変動事由の概要)

2020年3月25日の取締役会決議による自己株式の取得 594,300株

2020年7月17日の取締役会決議による自己株式の取得 811,200株

## 3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 当事業年度増加 | 当事業年度減少 | 当事業年度末 |
|-------|---------|---------|---------|--------|
|       |         |         |         |        |

|         |           |   |   |           |
|---------|-----------|---|---|-----------|
| 普通株式(株) | 2,860,000 | - | - | 2,860,000 |
|---------|-----------|---|---|-----------|

### 3 新株予約権等に関する事項

| 新株予約権の内訳               | 新株予約権の目的となる株式の種類 | 新株予約権の目的となる株式の数(株) |         |           |           | 当事業年度末残高(百万円) |
|------------------------|------------------|--------------------|---------|-----------|-----------|---------------|
|                        |                  | 当事業年度期首            | 当事業年度増加 | 当事業年度減少   | 当事業年度末    |               |
| 2011年度<br>ストックオプション(1) | 普通株式             | 432,300            | -       | 432,300   | -         | -             |
| 2016年度<br>ストックオプション(1) | 普通株式             | 1,016,000          | -       | 928,000   | 88,000    | -             |
| 2016年度<br>ストックオプション(2) | 普通株式             | 1,772,000          | -       | 956,000   | 816,000   | -             |
| 2017年度<br>ストックオプション(1) | 普通株式             | 2,607,000          | -       | 1,071,000 | 1,536,000 | -             |
| 合計                     |                  | 5,827,300          | -       | 3,387,300 | 2,440,000 | -             |

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2016年度ストックオプション(1)88,000株、2016年度ストックオプション(2)816,000株及び2017年度ストックオプション(1)847,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2017年度ストックオプション(1)689,000株は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

### 4 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

| 決議                 | 株式の種類 | 配当金の総額(百万円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|--------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 2021年5月25日<br>取締役会 | 普通株式  | 5,191       | 26.74       | 2021年3月31日 | 2021年6月29日 |

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

| 決議                 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額(百万円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|--------------------|-------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 2022年5月27日<br>取締役会 | 普通株式  | 利益剰余金 | 7,420       | 38.22       | 2022年3月31日 | 2022年6月27日 |

#### (リース取引関係)

| 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |          | 第63期<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日) |          |
|---------------------------------------|----------|---------------------------------------|----------|
| オペレーティング・リース取引<br>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<br>解約不能のものに係る未経過リース料   |          |
| 1年内                                   | 911百万円   | 1年内                                   | 911百万円   |
| 1年超                                   | 5,236百万円 | 1年超                                   | 4,324百万円 |
| 合計                                    | 6,148百万円 | 合計                                    | 5,236百万円 |

#### (金融商品関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

##### 1 金融商品の状況に関する事項

###### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主

に自己で設定した投資信託へのシ - ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

|                                     | 貸借対照表<br>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<br>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)<br>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<br>デリバティブ取引計        | (453)<br>(642)  | (453)<br>(642) | -<br>- |

(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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>投資信託 | 17     | 812         | 10,348       | 20   |
| 合計                   | 50,346 | 812         | 10,348       | 20   |

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

### (2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

#### (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位:百万円)

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

## 3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

|        | 貸借対照表計上額 |
|--------|----------|
| 子会社株式  | 23,094   |
| 関連会社株式 | 2,892    |

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

## 2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

|        | 貸借対照表計上額 |
|--------|----------|
| 子会社株式  | 17,183   |
| 関連会社株式 | 5,183    |

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第62期(2021年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

| 種類   |          | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|----|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
|----|---------------|-------------------------|-------------|---------------|

|           |                     |       |   |     |     |
|-----------|---------------------|-------|---|-----|-----|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>売建<br>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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) |
|-------------|--------------|---------|---------------|-------------------------|-------------|
| 原則的処理<br>方法 | 為替予約取引<br>売建 | 投資有価証券  |               |                         |             |
|             | 米ドル          |         | 4,620         | -                       | 273         |
|             | 香港ドル         |         | 862           | -                       | 57          |
|             | 人民元          |         | 1,684         | -                       | 117         |
|             | ユーロ          |         | 180           | -                       | 5           |
| 合計          |              |         | 7,347         | -                       | 453         |

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第63期(2022年3月31日)

### 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### (2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

## (退職給付関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

|      |     |
|------|-----|
| 勤務費用 | 142 |
| 利息費用 | 2   |

|                 |     |
|-----------------|-----|
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 2   |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 147 |

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.3%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 ス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<br>取締役・従業員 186名   | 当社及び関係会社の<br>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<br>2021年10月6日まで  | 2018年7月15日から<br>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<br>取締役・従業員 31名  | 当社及び関係会社の<br>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<br>2027年4月30日まで  | 2020年4月27日から<br>2028年4月30日まで  |

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

|     | 2011年度ストックオプション(1) | 2016年度ストックオプション(1) |
|-----|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 2011年10月7日         | 2016年7月15日         |



|          |           |           |
|----------|-----------|-----------|
| 権利確定前(株) |           |           |
| 期首       | 1,184,700 | 1,346,000 |
| 付与       | 0         | 0         |
| 失効       | 752,300   | 330,000   |
| 権利確定     | 0         | 0         |
| 権利未確定残   | 432,300   | 1,016,000 |
| 権利確定後(株) |           |           |
| 期首       | -         | -         |
| 権利確定     | -         | -         |
| 権利行使     | -         | -         |
| 失効       | -         | -         |
| 権利未行使残   | -         | -         |

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,738百万円

- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

|                         | 2011年度ストックオプション(1)  | 2016年度ストックオプション(1)  |
|-------------------------|---|---|
| 付与対象者の区分及び人数            | 当社及び関係会社の<br>取締役・従業員 186名   | 当社及び関係会社の<br>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<br>2021年10月6日まで  | 2018年7月15日から<br>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<br>取締役・従業員 31名  | 当社及び関係会社の<br>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<br>2027年4月30日まで  | 2020年4月27日から<br>2028年4月30日まで  |

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

|           | 2016年度ストックオプション(2) | 2017年度ストックオプション(1) |
|-----------|--------------------|--------------------|
| 付与日       | 2017年4月27日         | 2018年4月27日         |
| 権利行使価格(円) | 553                | 694                |

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

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

## (税効果会計関係)

| 第62期<br>(2021年3月31日)   | 第63期<br>(2022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<br>内訳<br><br>(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<br>内訳<br><br>(単位：百万円)                        |
| 繰延税金資産   | 繰延税金資産  |
| 賞与引当金 929  | 賞与引当金 1,341   |
| 投資有価証券評価損 97   | 投資有価証券評価損 97  |
| 関係会社株式評価損 1,430  | 関係会社株式評価損 52  |
| 退職給付引当金 446  | 退職給付引当金 427   |
| 固定資産減価償却費 90   | 固定資産減価償却費 87  |
| その他 978  | 繰延ヘッジ損益 322   |
| 繰延税金資産小計 3,972   | 訴訟損失引当金 2,403   |
| 評価性引当金 1,430   | その他 1,039   |
| 繰延税金資産合計 2,541   | 繰延税金資産小計 5,772  |
|  | 評価性引当金(注) 52  |
| 繰延税金負債   | 繰延税金資産合計 5,719  |
| 繰延ヘッジ利益 51   | 繰延税金負債  |
| その他有価証券評価差額金 645   | その他有価証券評価差額金 1,092  |
| 繰延税金負債合計 696   | その他 948   |
| 繰延税金資産の純額 1,845  | 繰延税金負債合計 2,041  |
|  | 繰延税金資産の純額 3,678   |
|  | (注)関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した<br>評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円<br>減少しております。 |
| 2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率<br>との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因と<br>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<br>との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因と<br>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 0.3%  | 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.1%   |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.7%  | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%  |
| その他 1.0%   | 評価性引当金の減少 10.3%   |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 26.2%  | その他 0.1%  |
|  | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 9.4%  |

## (関連当事者情報)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

|          |           |
|----------|-----------|
| 資産合計     | 34,450百万円 |
| 負債合計     | 6,257百万円  |
| 純資産合計    | 28,192百万円 |
| 営業収益     | 18,176百万円 |
| 税引前当期純利益 | 5,587百万円  |
| 当期純利益    | 3,956百万円  |

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

#### 関連情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目   | 第62期  | 第63期   |
|--|---|--|
|  | (自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日)   | (自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日)  |
| 当期純利益(百万円)   | 9,424   | 12,136   |
| 普通株主に帰属しない金額(百万円)                                  | -   | -  |
| 普通株式に係る当期純利益(百万円)                                  | 9,424   | 12,136   |
| 普通株式の期中平均株式数(千株)                                   | 194,509   | 194,152  |
| 希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要 | 2011年度ストックオプション(1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株 | 2016年度ストックオプション(1) 88,000株、2016年度ストックオプション(2) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000株 |

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目                     | 第62期         | 第63期         |
|------------------------|--------------|--------------|
|                        | (2021年3月31日) | (2022年3月31日) |
| 純資産の部の合計額(百万円)         | 84,049       | 91,035       |
| 純資産の部の合計額から控除する金額(百万円) | -            | -            |



|                                 |         |         |
|---------------------------------|---------|---------|
| 普通株式に係る期末の純資産額（百万円）             | 84,049  | 91,035  |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株） | 194,152 | 194,152 |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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<br>(2022年3月末現在) | 事業の内容   |
|---------------|-----------------------|---|
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 324,279百万円            | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。 |

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円（2022年3月末現在）

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

基づき信託業務を営んでいます。

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

## （２）販売会社

| 名 称              | 資本金の額<br>(2022年3月末現在) | 事業の内容                         |
|------------------|-----------------------|-------------------------------|
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000百万円             | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 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。

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

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

独立監査人の監査報告書

2022年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦  
業務執行社員

## 監査意見

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

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

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年12月15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2020年11月10日から2021年11月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの2021年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 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

2021年12月15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2020年11月10日から2021年11月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの2021年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 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

2022年6月15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2021年11月9日から2022年5月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスポートフォリオの2022年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年11月9日から2022年5月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2022年6月15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2021年11月9日から2022年5月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、バランスポートフォリオの2022年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年11月9日から2022年5月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. 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。