

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月8日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村 R A F I（R）日本株投信
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2020年10月8日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

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

<更新後>

わが国の株式を実質的な主要投資対象¹とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。

ファンダメンタル・インデックス構成手法²を活用して、委託会社が独自に銘柄・ウェイトを選定・計算し、これをベースに株式ポートフォリオを構築することを基本とします。

株式の実質組入比率は高位を基本とします。

- 1 ファンドは、「野村RAFI^(R) 日本株投信マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。
- 2 当該手法は、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル指標をもとに銘柄のウェイト付けを行なう運用手法で、2021年4月現在、リサーチ・アフィリエイツ社が知的所有権を申請中です。

《ファミリーファンド方式について》

ファンドは「野村RAFI^(R) 日本株投信マザーファンド」を親投資信託（マザーファンド）とするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



マザーファンドの運用の方針等については、『第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）マザーファンドの概要』をご参照ください。

ファンドは、マザーファンドのほかに、直接株式等に投資する場合があります。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されます。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りで

す。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に**網掛け表示**しております。

(野村RAFI^(R) 日本株投信)

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産(投資信託証券)）と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

(3) ファンドの仕組み

< 更新後 >

委託会社の概況(2021年2月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村
アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

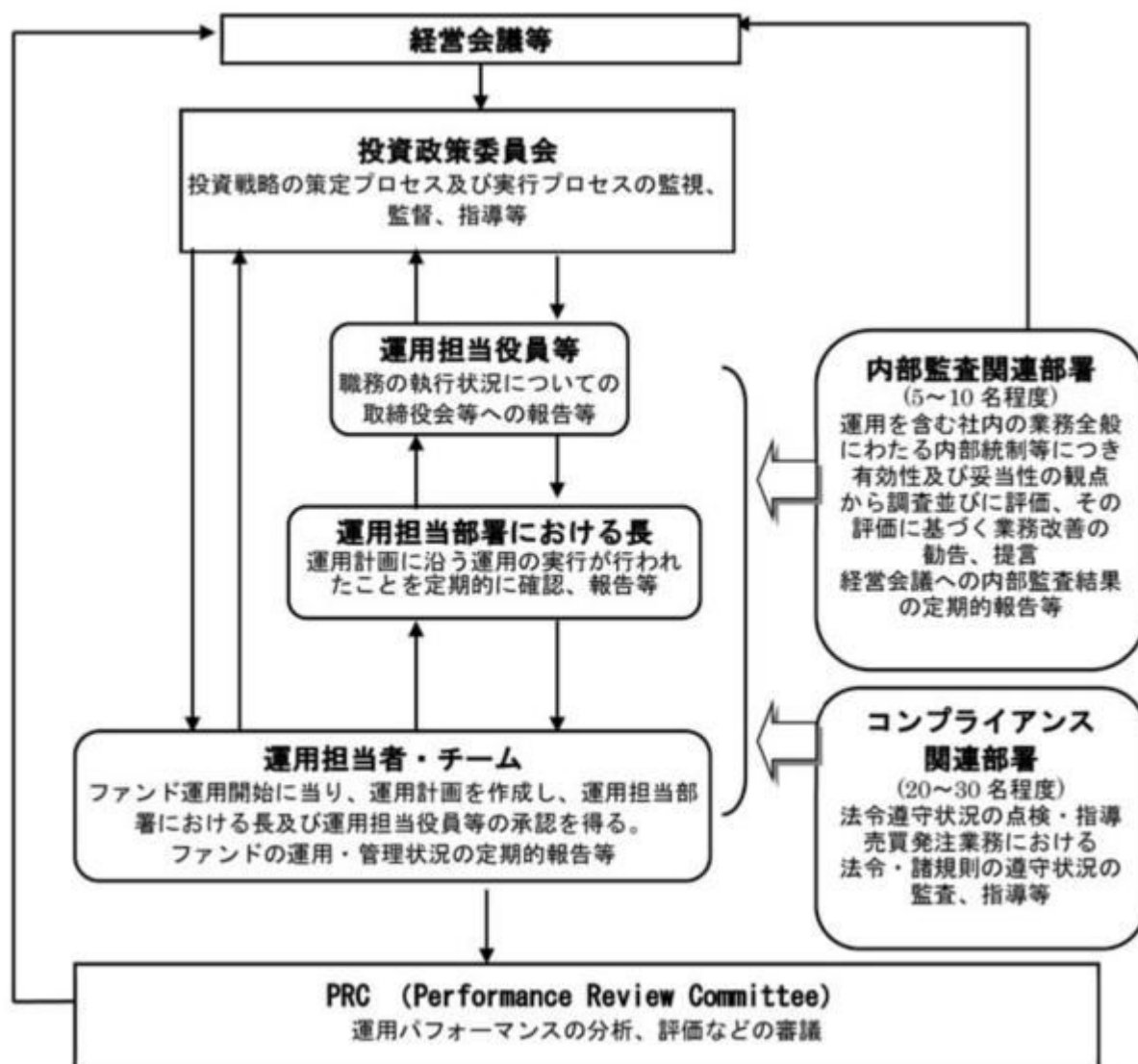
名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

2 投資方針

(3) 運用体制

< 更新後 >

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

3 投資リスク

< 更新後 >

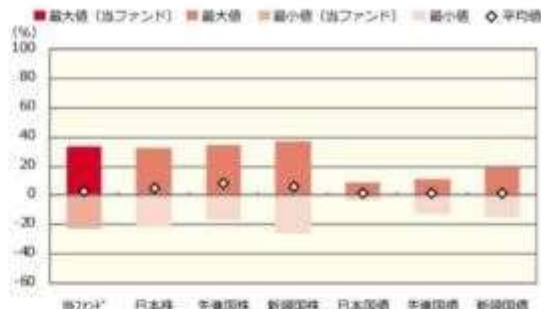
■ リスクの定量的比較（2016年3月末～2021年2月末：月次）

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



2016年3月 2017年2月 2018年2月 2019年2月 2020年2月 2021年2月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	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
最大値 (%)	33.6	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 23.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	2.2	4.4	7.8	6.4	1.2	1.2	1.5

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2016年3月末を10,000として指数化しております。
* 年間騰落率は、2016年3月から2021年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 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。
* 2016年3月から2021年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
* 決算日に対応した数値とは異なります。
* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
 - MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、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、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではありません。NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
 - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の平均収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は 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・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンパレーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を高めてポジションを持っており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPMI、J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC、他）

4 手数料等及び税金

（5）課税上の取扱い

< 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用があります。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)については、申告分離課税により20.315%(国税15.315%および地方税5%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

(注1)「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債(同族会社が発行した社債を除きます。)などの一定の公社債をいいます。

(注2)株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(国税15.315%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金(解約)時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

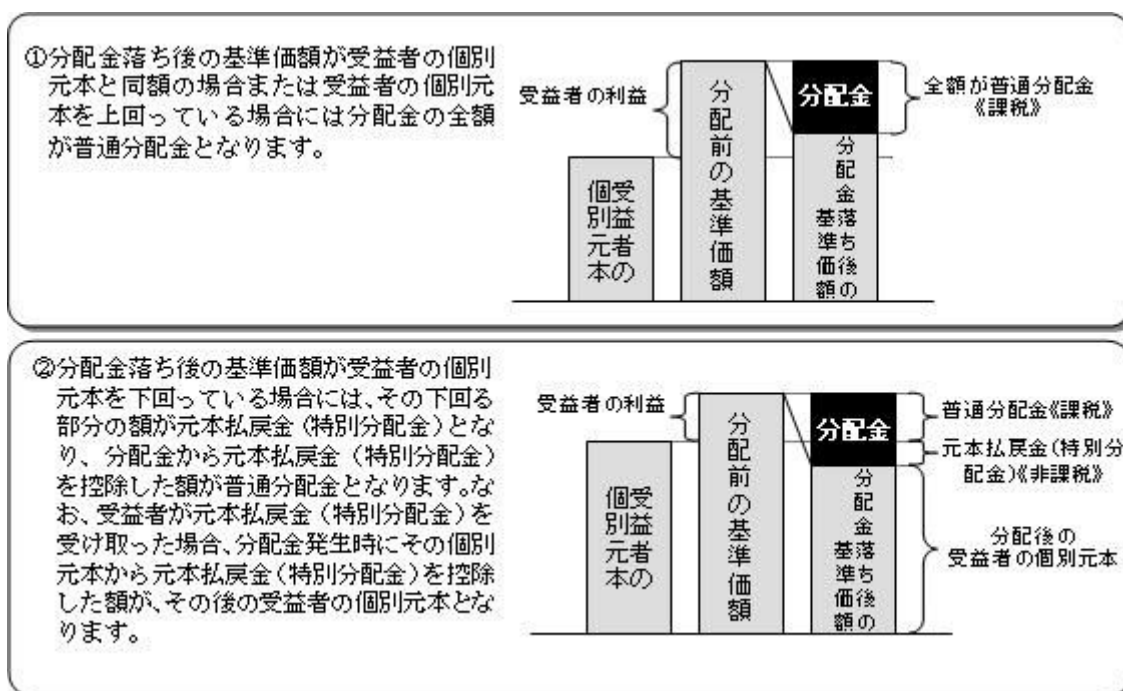
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

外貨建資産への投資により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。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2021年2月末現在)が変更になる場合があります。

5 運用状況

以下は2021年2月26日現在の運用状況であります。

また、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

野村 R A F I（R）日本株投信

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	2,130,368,484	99.79
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,336,736	0.20
合計（純資産総額）		2,134,705,220	100.00

（参考）野村 R A F I（R）日本株投信マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	4,431,126,800	99.28
現金・預金・その他資産（負債控除後）		31,741,389	0.71
合計（純資産総額）		4,462,868,189	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては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。

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	18,755,000	0.42

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

野村 R A F I（R）日本株投信

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
1	日本	親投資信託受益証券	野村 R A F I（R）日本株投信マザーファンド	1,316,017,102	1.5686	2,064,304,427	1.6188	2,130,368,484	99.79

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.79
合計	99.79

（参考）野村 R A F I（R）日本株投信マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	31,800	6,890.18	219,107,821	7,873.00	250,361,400	5.60
2	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	44,800	2,507.95	112,356,160	2,758.00	123,558,400	2.76
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	183,200	426.46	78,127,472	558.00	102,225,600	2.29
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	24,700	3,086.83	76,244,701	3,742.00	92,427,400	2.07
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	8,500	6,513.31	55,363,135	9,895.00	84,107,500	1.88
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	25,300	2,771.60	70,121,480	2,911.50	73,660,950	1.65
7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	21,300	3,177.67	67,684,486	3,290.00	70,077,000	1.57
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	43,700	1,343.18	58,696,966	1,559.00	68,128,300	1.52
9	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	98,500	400.69	39,467,965	574.70	56,607,950	1.26
10	日本	株式	三菱商事	卸売業	18,700	2,303.20	43,069,840	3,003.00	56,156,100	1.25
11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	26,600	1,974.60	52,524,500	1,925.00	51,205,000	1.14
12	日本	株式	ソニー	電気機器	4,100	8,154.47	33,433,327	11,120.00	45,592,000	1.02
13	日本	株式	三井物産	卸売業	19,700	1,632.41	32,158,546	2,263.50	44,590,950	0.99
14	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	2,300	15,267.51	35,115,273	17,410.00	40,043,000	0.89
15	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	12,600	2,379.67	29,983,842	3,168.00	39,916,800	0.89
16	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	27,500	1,364.73	37,530,347	1,441.00	39,627,500	0.88
17	日本	株式	キヤノン	電気機器	16,200	2,045.45	33,136,292	2,292.50	37,138,500	0.83
18	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	4,700	7,090.69	33,326,243	7,857.00	36,927,900	0.82
19	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	10,200	3,711.66	37,858,990	3,582.00	36,536,400	0.81
20	日本	株式	オリックス	その他金融業	20,200	1,318.51	26,633,932	1,801.50	36,390,300	0.81
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	6,800	4,780.98	32,510,703	5,253.00	35,720,400	0.80
22	日本	株式	日立製作所	電気機器	7,200	3,409.00	24,544,800	4,876.00	35,107,200	0.78
23	日本	株式	デンソー	輸送用機器	5,400	4,399.64	23,758,063	6,388.00	34,495,200	0.77
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	8,100	3,460.71	28,031,751	4,161.00	33,704,100	0.75
25	日本	株式	東京電力ホールディングス	電気・ガス業	89,800	324.37	29,128,870	342.00	30,711,600	0.68
26	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	7,100	3,479.42	24,703,922	4,037.00	28,662,700	0.64
27	日本	株式	住友商事	卸売業	18,600	1,262.12	23,475,462	1,540.50	28,653,300	0.64
28	日本	株式	SUBARU	輸送用機器	14,300	2,205.57	31,539,748	1,988.50	28,435,550	0.63
29	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	14,900	1,371.87	20,440,863	1,869.00	27,848,100	0.62
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	16,200	1,401.41	22,702,928	1,568.50	25,409,700	0.56

種類別及び業種別投資比率

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	0.55
		建設業	3.08

食料品	3.48
繊維製品	0.56
パルプ・紙	0.38
化学	5.76
医薬品	3.37
石油・石炭製品	0.81
ゴム製品	1.12
ガラス・土石製品	0.91
鉄鋼	1.36
非鉄金属	0.92
金属製品	0.66
機械	4.10
電気機器	9.47
輸送用機器	12.98
精密機器	0.88
その他製品	1.24
電気・ガス業	3.16
陸運業	3.92
海運業	0.22
空運業	0.73
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.63
卸売業	6.03
小売業	3.97
銀行業	9.88
証券、商品先物取引業	0.82
保険業	2.61
その他金融業	1.81
不動産業	1.90
サービス業	2.55
合 計	99.28

投資不動産物件

野村 R A F I (R) 日本株投信

該当事項はありません。

(参考) 野村 R A F I (R) 日本株投信マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

野村 R A F I (R) 日本株投信

該当事項はありません。

（参考）野村 R A F I（R）日本株投信マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては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。

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2021年03月限)	買建		1日本円	17,548,995	18,755,000	0.42

（3）運用実績

純資産の推移

野村 R A F I（R）日本株投信

2021年2月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第8計算期間	(2011年 7月13日)	6,712	6,712	0.5926	0.5926
第9計算期間	(2012年 1月13日)	5,347	5,347	0.5181	0.5181
第10計算期間	(2012年 7月13日)	4,827	4,827	0.5266	0.5266
第11計算期間	(2013年 1月15日)	5,324	5,324	0.6372	0.6372
第12計算期間	(2013年 7月16日)	5,588	5,588	0.8526	0.8526
第13計算期間	(2014年 1月14日)	5,427	5,427	0.8975	0.8975
第14計算期間	(2014年 7月14日)	5,083	5,083	0.9178	0.9178
第15計算期間	(2015年 1月13日)	4,724	4,724	0.9871	0.9871
第16計算期間	(2015年 7月13日)	4,452	4,490	1.1758	1.1858
第17計算期間	(2016年 1月13日)	3,634	3,644	1.0625	1.0655
第18計算期間	(2016年 7月13日)	3,058	3,058	0.9568	0.9568
第19計算期間	(2017年 1月13日)	3,213	3,240	1.1731	1.1831
第20計算期間	(2017年 7月13日)	2,776	2,799	1.2036	1.2136
第21計算期間	(2018年 1月15日)	2,841	2,862	1.3888	1.3988
第22計算期間	(2018年 7月13日)	2,486	2,510	1.2602	1.2722
第23計算期間	(2019年 1月15日)	2,299	2,319	1.1515	1.1615
第24計算期間	(2019年 7月16日)	2,194	2,213	1.1462	1.1562
第25計算期間	(2020年 1月14日)	2,293	2,311	1.2452	1.2552
第26計算期間	(2020年 7月13日)	1,902	1,919	1.0808	1.0908
第27計算期間	(2021年 1月13日)	2,101	2,118	1.2603	1.2703
	2020年 2月末日	1,978		1.0873	
	3月末日	1,821		1.0033	

4月末日	1,869		1.0386
5月末日	1,937		1.0965
6月末日	1,907		1.0833
7月末日	1,790		1.0159
8月末日	1,937		1.1121
9月末日	1,926		1.1090
10月末日	1,860		1.0775
11月末日	1,979		1.1764
12月末日	2,045		1.2228
2021年 1月末日	2,043		1.2288
2月末日	2,134		1.2989

分配の推移

野村 R A F I (R) 日本株投信

	計算期間	1口当たりの分配金
第8計算期間	2011年 1月14日～2011年 7月13日	0.0000円
第9計算期間	2011年 7月14日～2012年 1月13日	0.0000円
第10計算期間	2012年 1月14日～2012年 7月13日	0.0000円
第11計算期間	2012年 7月14日～2013年 1月15日	0.0000円
第12計算期間	2013年 1月16日～2013年 7月16日	0.0000円
第13計算期間	2013年 7月17日～2014年 1月14日	0.0000円
第14計算期間	2014年 1月15日～2014年 7月14日	0.0000円
第15計算期間	2014年 7月15日～2015年 1月13日	0.0000円
第16計算期間	2015年 1月14日～2015年 7月13日	0.0100円
第17計算期間	2015年 7月14日～2016年 1月13日	0.0030円
第18計算期間	2016年 1月14日～2016年 7月13日	0.0000円
第19計算期間	2016年 7月14日～2017年 1月13日	0.0100円
第20計算期間	2017年 1月14日～2017年 7月13日	0.0100円
第21計算期間	2017年 7月14日～2018年 1月15日	0.0100円
第22計算期間	2018年 1月16日～2018年 7月13日	0.0120円
第23計算期間	2018年 7月14日～2019年 1月15日	0.0100円
第24計算期間	2019年 1月16日～2019年 7月16日	0.0100円
第25計算期間	2019年 7月17日～2020年 1月14日	0.0100円
第26計算期間	2020年 1月15日～2020年 7月13日	0.0100円
第27計算期間	2020年 7月14日～2021年 1月13日	0.0100円

収益率の推移

野村 R A F I (R) 日本株投信

	計算期間	収益率
第8計算期間	2011年 1月14日～2011年 7月13日	6.8%
第9計算期間	2011年 7月14日～2012年 1月13日	12.6%
第10計算期間	2012年 1月14日～2012年 7月13日	1.6%
第11計算期間	2012年 7月14日～2013年 1月15日	21.0%
第12計算期間	2013年 1月16日～2013年 7月16日	33.8%
第13計算期間	2013年 7月17日～2014年 1月14日	5.3%
第14計算期間	2014年 1月15日～2014年 7月14日	2.3%
第15計算期間	2014年 7月15日～2015年 1月13日	7.6%
第16計算期間	2015年 1月14日～2015年 7月13日	20.1%
第17計算期間	2015年 7月14日～2016年 1月13日	9.4%
第18計算期間	2016年 1月14日～2016年 7月13日	9.9%
第19計算期間	2016年 7月14日～2017年 1月13日	23.7%
第20計算期間	2017年 1月14日～2017年 7月13日	3.5%
第21計算期間	2017年 7月14日～2018年 1月15日	16.2%
第22計算期間	2018年 1月16日～2018年 7月13日	8.4%
第23計算期間	2018年 7月14日～2019年 1月15日	7.8%
第24計算期間	2019年 1月16日～2019年 7月16日	0.4%
第25計算期間	2019年 7月17日～2020年 1月14日	9.5%
第26計算期間	2020年 1月15日～2020年 7月13日	12.4%
第27計算期間	2020年 7月14日～2021年 1月13日	17.5%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。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を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

野村 R A F I（R）日本株投信

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第8計算期間	2011年 1月14日～2011年 7月13日	2,167,402	1,671,312,476	11,328,426,017
第9計算期間	2011年 7月14日～2012年 1月13日	103,773,680	1,109,734,274	10,322,465,423
第10計算期間	2012年 1月14日～2012年 7月13日	4,671,625	1,159,998,799	9,167,138,249
第11計算期間	2012年 7月14日～2013年 1月15日	3,406,825	813,957,001	8,356,588,073
第12計算期間	2013年 1月16日～2013年 7月16日	32,655,646	1,834,249,186	6,554,994,533
第13計算期間	2013年 7月17日～2014年 1月14日	96,593,027	603,455,479	6,048,132,081
第14計算期間	2014年 1月15日～2014年 7月14日	93,473,265	603,124,402	5,538,480,944
第15計算期間	2014年 7月15日～2015年 1月13日	246,579,675	998,142,131	4,786,918,488
第16計算期間	2015年 1月14日～2015年 7月13日	271,758,131	1,271,677,504	3,786,999,115
第17計算期間	2015年 7月14日～2016年 1月13日	147,361,632	513,422,645	3,420,938,102
第18計算期間	2016年 1月14日～2016年 7月13日	111,331,351	335,788,991	3,196,480,462
第19計算期間	2016年 7月14日～2017年 1月13日	911,390	458,162,960	2,739,228,892

第20計算期間	2017年 1月14日～2017年 7月13日	13,094,147	445,652,480	2,306,670,559
第21計算期間	2017年 7月14日～2018年 1月15日	11,338,998	271,932,617	2,046,076,940
第22計算期間	2018年 1月16日～2018年 7月13日	11,122,487	84,130,596	1,973,068,831
第23計算期間	2018年 7月14日～2019年 1月15日	111,768,465	87,931,942	1,996,905,354
第24計算期間	2019年 1月16日～2019年 7月16日	9,896,807	92,086,180	1,914,715,981
第25計算期間	2019年 7月17日～2020年 1月14日	9,179,099	82,163,235	1,841,731,845
第26計算期間	2020年 1月15日～2020年 7月13日	7,626,272	89,444,825	1,759,913,292
第27計算期間	2020年 7月14日～2021年 1月13日	8,017,231	100,230,777	1,667,699,746

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

< 更新後 >



運用実績（2021年2月26日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2021年1月	100 円
2020年7月	100 円
2020年1月	100 円
2019年7月	100 円
2019年1月	100 円
設定来累計	1,050 円

■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	業種	投資比率（%）
1	トヨタ自動車	輸送用機器	5.6
2	日本電信電話	情報・通信業	2.8
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.3
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.1
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.9
6	本田技研工業	輸送用機器	1.6
7	KDDI	情報・通信業	1.6
8	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.5
9	日産自動車	輸送用機器	1.3
10	三菱商事	卸売業	1.2

実質的な業種別投資比率（上位）

順位	業種	投資比率（%）
1	輸送用機器	13.0
2	銀行業	9.9
3	情報・通信業	9.6
4	電気機器	9.5
5	卸売業	6.0

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●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。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。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27期計算期間(2020年7月14日から2021年1月13日まで)の財務諸表について、EY新日本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

野村 R A F I (R) 日本株投信

(1) 貸借対照表

	第26期 (2020年 7月13日現在)	第27期 (2021年 1月13日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	32,174,151	31,784,913
親投資信託受益証券	1,898,621,282	2,102,563,761
未収入金	-	400,000
流動資産合計	1,930,795,433	2,134,748,674
資産合計	1,930,795,433	2,134,748,674
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	17,599,132	16,676,997
未払解約金	520,935	5,360,360
未払受託者報酬	530,831	541,736
未払委託者報酬	10,085,792	10,292,780
未払利息	18	15
その他未払費用	31,792	32,444
流動負債合計	28,768,500	32,904,332
負債合計	28,768,500	32,904,332
純資産の部		
元本等		
元本	1,759,913,292	1,667,699,746
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	142,113,641	434,144,596
(分配準備積立金)	671,210,009	640,519,540
元本等合計	1,902,026,933	2,101,844,342
純資産合計	1,902,026,933	2,101,844,342
負債純資産合計	1,930,795,433	2,134,748,674

(2) 損益及び剰余金計算書

	第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日	第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日
(単位:円)		
営業収益		
有価証券売買等損益	276,073,457	332,442,479
営業収益合計	276,073,457	332,442,479
営業費用		
支払利息	1,712	1,425

	第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日	第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日
受託者報酬	530,831	541,736
委託者報酬	10,085,792	10,292,780
その他費用	31,792	32,444
営業費用合計	10,650,127	10,868,385
営業利益又は営業損失()	286,723,584	321,574,094
経常利益又は経常損失()	286,723,584	321,574,094
当期純利益又は当期純損失()	286,723,584	321,574,094
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	14,748,673	5,705,378
期首剰余金又は期首欠損金()	451,528,288	142,113,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,810,345	648,586
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,810,345	648,586
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,650,949	7,809,350
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,650,949	7,809,350
分配金	17,599,132	16,676,997
期末剰余金又は期末欠損金()	142,113,641	434,144,596

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 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。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年 7月14日から2021年 1月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第26期 2020年 7月13日現在	第27期 2021年 1月13日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,759,913,292口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,667,699,746口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0808円 (10,000口当たり純資産額) (10,808円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2603円 (10,000口当たり純資産額) (12,603円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日			第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	19,788,495円	費用控除後の配当等収益額	A	23,755,772円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	101,990,212円	収益調整金額	C	99,530,221円
分配準備積立金額	D	669,020,646円	分配準備積立金額	D	633,440,765円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	790,799,353円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	756,726,758円
当ファンドの期末残存口数	F	1,759,913,292口	当ファンドの期末残存口数	F	1,667,699,746口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,493円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,537円
10,000口当たり分配金額	H	100円	10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	17,599,132円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	16,676,997円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日		第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日	
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		1. 金融商品に対する取組方針 同左	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。		2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制		3. 金融商品に係るリスク管理体制	

<p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第26期 2020年 7月13日現在	第27期 2021年 1月13日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日	第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日	第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日
期首元本額	1,841,731,845円
	期首元本額
	1,759,913,292円

期中追加設定元本額	7,626,272円	期中追加設定元本額	8,017,231円
期中一部解約元本額	89,444,825円	期中一部解約元本額	100,230,777円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第26期 自 2020年 1月15日 至 2020年 7月13日	第27期 自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	257,823,328	323,976,578
合計	257,823,328	323,976,578

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年1月13日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年1月13日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	野村 R A F I (R) 日本株投信マ ザーファンド	1,340,407,855	2,102,563,761	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：100.0%	1,340,407,855	2,102,563,761 100.0%	
合計				2,102,563,761	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 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。

（参考）

当ファンドは「野村 R A F I (R) 日本株投信マザーファンド」受益証券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、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

野村 R A F I (R) 日本株投信マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 1月13日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,076,310
株式	4,397,169,050
派生商品評価勘定	1,081,005
未収入金	22,614,538
未収配当金	7,256,160
流動資産合計	4,454,197,063
資産合計	4,454,197,063
負債の部	
流動負債	
前受金	96,500
未払解約金	4,400,000
未払利息	13
流動負債合計	4,496,513
負債合計	4,496,513
純資産の部	
元本等	
元本	2,836,648,449
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,613,052,101
元本等合計	4,449,700,550
純資産合計	4,449,700,550
負債純資産合計	4,454,197,063

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

2021年 1月13日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5686円
(10,000口当たり純資産額)	(15,686円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年 7月14日 至 2021年 1月13日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月13日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 1月13日現在	
期首	2020年 7月14日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	2,929,595,185円
同期中における追加設定元本額	226,445,542円
同期中における一部解約元本額	319,392,278円
期末元本額	2,836,648,449円
期末元本額の内訳*	
野村 R A F I (R) 日本株投信	1,340,407,855円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	646,394,258円
野村 R A F I (R) 日本株投信 F (適格機関投資家専用)	849,846,336円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年1月13日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	日本水産	3,300	445.00	1,468,500	
		マルハニチロ	500	2,283.00	1,141,500	
		サカタのタネ	200	3,720.00	744,000	
		ホクト	300	2,146.00	643,800	
		日鉄鉱業	200	6,220.00	1,244,000	
		国際石油開発帝石	28,100	649.00	18,236,900	
		石油資源開発	1,100	2,092.00	2,301,200	
		K & O エナジーグループ	300	1,448.00	434,400	
		ショーボンドホールディングス	200	4,740.00	948,000	

ミライト・ホールディングス	800	1,767.00	1,413,600	
安藤・間	1,600	747.00	1,195,200	
東急建設	1,400	525.00	735,000	
コムシスホールディングス	700	3,205.00	2,243,500	
高松コンストラクショングループ	300	2,081.00	624,300	
東建コーポレーション	200	8,110.00	1,622,000	
大成建設	2,400	3,540.00	8,496,000	
大林組	10,200	924.00	9,424,800	
清水建設	9,200	761.00	7,001,200	
長谷工コーポレーション	3,900	1,218.00	4,750,200	
鹿島建設	6,000	1,442.00	8,652,000	
西松建設	700	2,329.00	1,630,300	
三井住友建設	1,700	448.00	761,600	
大豊建設	200	3,745.00	749,000	
前田建設工業	1,800	923.00	1,661,400	
奥村組	500	2,701.00	1,350,500	
東鉄工業	300	2,725.00	817,500	
戸田建設	3,500	741.00	2,593,500	
熊谷組	400	2,661.00	1,064,400	
大東建託	800	9,540.00	7,632,000	
新日本建設	800	868.00	694,400	
N I P P O	800	2,774.00	2,219,200	
前田道路	900	1,767.00	1,590,300	
日本道路	100	7,770.00	777,000	
日本国土開発	900	587.00	528,300	
東洋建設	1,000	482.00	482,000	
五洋建設	1,900	935.00	1,776,500	
福田組	200	5,510.00	1,102,000	
住友林業	1,600	2,072.00	3,315,200	
大和ハウス工業	7,000	3,105.00	21,735,000	
ライト工業	400	1,747.00	698,800	
積水ハウス	6,700	2,122.50	14,220,750	
ユアテック	1,400	820.00	1,148,000	
中電工	600	2,271.00	1,362,600	
関電工	2,200	909.00	1,999,800	
きんでん	1,700	1,744.00	2,964,800	

トーエネック	200	4,030.00	806,000
住友電設	200	2,628.00	525,600
日本電設工業	500	2,046.00	1,023,000
協和エクシオ	700	2,888.00	2,021,600
九電工	500	3,265.00	1,632,500
三機工業	500	1,260.00	630,000
日揮ホールディングス	2,000	1,118.00	2,236,000
太平電業	200	2,491.00	498,200
高砂熱学工業	500	1,608.00	804,000
大気社	300	2,834.00	850,200
日比谷総合設備	300	1,897.00	569,100
レイズネクスト	400	1,229.00	491,600
ニッポン	700	1,649.00	1,154,300
日清製粉グループ本社	1,400	1,682.00	2,354,800
昭和産業	300	3,105.00	931,500
三井製糖	400	1,865.00	746,000
森永製菓	200	3,890.00	778,000
江崎グリコ	400	4,590.00	1,836,000
山崎製パン	1,400	1,689.00	2,364,600
亀田製菓	100	4,920.00	492,000
カルビー	500	3,100.00	1,550,000
森永乳業	300	5,040.00	1,512,000
ヤクルト本社	600	5,160.00	3,096,000
明治ホールディングス	900	7,310.00	6,579,000
雪印メグミルク	600	2,202.00	1,321,200
プリマハム	400	3,335.00	1,334,000
日本ハム	800	4,590.00	3,672,000
丸大食品	300	1,715.00	514,500
S Foods	300	3,520.00	1,056,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,900	677.00	1,286,300
サッポロホールディングス	600	1,968.00	1,180,800
アサヒグループホールディングス	3,200	4,172.00	13,350,400
キリンホールディングス	5,500	2,305.00	12,677,500
宝ホールディングス	1,000	1,276.00	1,276,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホルデ	1,200	1,565.00	1,878,000

サントリー食品インターナショナル	2,200	3,595.00	7,909,000
ダイドーグループホールディングス	200	5,080.00	1,016,000
伊藤園	300	6,730.00	2,019,000
日清オイリオグループ	300	3,115.00	934,500
不二製油グループ本社	500	2,991.00	1,495,500
J - オイルミルズ	200	3,660.00	732,000
キッコーマン	500	7,380.00	3,690,000
味の素	2,800	2,412.00	6,753,600
キュービー	900	2,357.00	2,121,300
ハウス食品グループ本社	500	3,880.00	1,940,000
カゴメ	300	3,525.00	1,057,500
アリアケジャパン	100	7,030.00	703,000
ニチレイ	700	2,951.00	2,065,700
東洋水産	400	5,330.00	2,132,000
日清食品ホールディングス	300	9,100.00	2,730,000
フジッコ	300	2,032.00	609,600
日本たばこ産業	22,300	2,044.50	45,592,350
わらべや日洋ホールディングス	200	1,697.00	339,400
理研ビタミン	400	1,389.00	555,600
グンゼ	200	3,410.00	682,000
東洋紡	900	1,407.00	1,266,300
ユニチカ	1,200	410.00	492,000
倉敷紡績	300	1,862.00	558,600
日本毛織	600	1,015.00	609,000
帝人	2,300	1,994.00	4,586,200
東レ	18,800	663.90	12,481,320
セーレン	500	1,634.00	817,000
ワコールホールディングス	600	2,084.00	1,250,400
ホギメディカル	200	3,205.00	641,000
T S I ホールディングス	1,000	231.00	231,000
ワールド	400	1,266.00	506,400
オンワードホールディングス	1,700	232.00	394,400
ゴールドウイン	100	6,560.00	656,000
デサント	400	1,868.00	747,200
特種東海製紙	200	4,910.00	982,000
王子ホールディングス	11,700	640.00	7,488,000

日本製紙	1,900	1,260.00	2,394,000
三菱製紙	900	330.00	297,000
北越コーポレーション	3,500	431.00	1,508,500
大王製紙	1,100	2,000.00	2,200,000
レンゴー	2,500	891.00	2,227,500
トーモク	300	1,822.00	546,600
ザ・バック	200	2,655.00	531,000
クラレ	3,900	1,115.00	4,348,500
旭化成	14,100	1,139.50	16,066,950
昭和電工	2,300	2,441.00	5,614,300
住友化学	28,100	435.00	12,223,500
住友精化	200	4,355.00	871,000
日産化学	500	6,020.00	3,010,000
クレハ	200	7,220.00	1,444,000
石原産業	800	728.00	582,400
日本曹達	400	3,120.00	1,248,000
東ソー	3,800	1,743.00	6,623,400
トクヤマ	400	2,612.00	1,044,800
セントラル硝子	500	2,423.00	1,211,500
東亜合成	1,200	1,226.00	1,471,200
大阪ソーダ	200	2,741.00	548,200
関東電化工業	500	849.00	424,500
デンカ	800	4,365.00	3,492,000
信越化学工業	1,400	19,385.00	27,139,000
堺化学工業	200	2,069.00	413,800
エア・ウォーター	1,600	1,815.00	2,904,000
日本酸素ホールディングス	2,400	2,002.00	4,804,800
日本パーカライジング	1,100	1,132.00	1,245,200
高压ガス工業	500	816.00	408,000
四国化成工業	500	1,259.00	629,500
日本触媒	400	6,120.00	2,448,000
大日精化工業	300	2,432.00	729,600
カネカ	800	3,695.00	2,956,000
三菱瓦斯化学	2,400	2,457.00	5,896,800
三井化学	2,100	3,090.00	6,489,000
J S R	1,500	3,085.00	4,627,500

東京応化工業	200	7,860.00	1,572,000
三菱ケミカルホールディングス	27,600	655.40	18,089,040
KHネオケム	400	2,653.00	1,061,200
ダイセル	4,700	785.00	3,689,500
住友ベークライト	400	3,860.00	1,544,000
積水化学工業	3,300	2,025.00	6,682,500
日本ゼオン	1,700	1,528.00	2,597,600
アイカ工業	400	3,620.00	1,448,000
宇部興産	1,700	1,982.00	3,369,400
積水樹脂	400	2,207.00	882,800
タキロンシーアイ	900	670.00	603,000
積水化成成品工業	600	537.00	322,200
ダイキョーニシカワ	1,200	840.00	1,008,000
森六ホールディングス	300	2,272.00	681,600
日本化薬	1,900	999.00	1,898,100
扶桑化学工業	200	3,820.00	764,000
ADEKA	1,000	1,837.00	1,837,000
日油	500	5,060.00	2,530,000
花王	1,800	7,733.00	13,919,400
三洋化成工業	200	5,650.00	1,130,000
日本ペイントホールディングス	400	9,930.00	3,972,000
関西ペイント	900	3,065.00	2,758,500
中国塗料	500	1,049.00	524,500
太陽ホールディングス	200	6,380.00	1,276,000
エスケー化研	100	38,500.00	3,850,000
DIC	1,200	2,623.00	3,147,600
サカタインクス	700	1,148.00	803,600
東洋インキSCホールディングス	700	1,908.00	1,335,600
富士フイルムホールディングス	2,900	6,014.00	17,440,600
資生堂	600	6,637.00	3,982,200
ライオン	800	2,436.00	1,948,800
高砂香料工業	300	2,550.00	765,000
マンダム	300	1,631.00	489,300
ファンケル	300	3,835.00	1,150,500
コーセー	200	16,430.00	3,286,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,200	2,191.00	2,629,200

ノエビアホールディングス	200	4,515.00	903,000
コニシ	300	1,642.00	492,600
長谷川香料	300	2,120.00	636,000
上村工業	100	7,660.00	766,000
小林製薬	200	12,400.00	2,480,000
デクセリアルズ	600	1,422.00	853,200
アース製薬	100	5,910.00	591,000
クミアイ化学工業	500	896.00	448,000
日本農薬	700	497.00	347,900
日東電工	1,000	9,620.00	9,620,000
藤森工業	200	4,800.00	960,000
未来工業	200	1,682.00	336,400
J S P	400	1,766.00	706,400
エフピコ	400	4,260.00	1,704,000
天馬	300	2,157.00	647,100
信越ポリマー	600	988.00	592,800
ニフコ	700	3,985.00	2,789,500
ユニ・チャーム	1,000	4,850.00	4,850,000
協和キリン	1,900	2,761.00	5,245,900
武田薬品工業	9,200	3,746.00	34,463,200
アステラス製薬	13,400	1,656.50	22,197,100
大日本住友製薬	2,900	1,484.00	4,303,600
塩野義製薬	1,600	5,885.00	9,416,000
日本新薬	200	7,250.00	1,450,000
中外製薬	2,000	5,837.00	11,674,000
科研製薬	400	4,105.00	1,642,000
エーザイ	1,200	7,604.00	9,124,800
ロート製薬	400	3,115.00	1,246,000
小野薬品工業	1,800	3,106.00	5,590,800
久光製薬	500	6,410.00	3,205,000
持田製薬	300	3,985.00	1,195,500
参天製薬	1,600	1,686.00	2,697,600
ツムラ	500	3,375.00	1,687,500
日医工	700	1,010.00	707,000
キッセイ薬品工業	400	2,268.00	907,200
生化学工業	400	1,019.00	407,600

鳥居薬品	200	3,225.00	645,000
東和薬品	400	1,940.00	776,000
沢井製薬	300	4,805.00	1,441,500
ゼリア新薬工業	300	1,915.00	574,500
第一三共	3,700	3,635.00	13,449,500
キョーリン製薬ホールディングス	700	1,963.00	1,374,100
大塚ホールディングス	3,400	4,382.00	14,898,800
大正製薬ホールディングス	600	7,040.00	4,224,000
日本コークス工業	4,800	96.00	460,800
ニチレキ	400	1,593.00	637,200
出光興産	3,500	2,426.00	8,491,000
E N E O Sホールディングス	54,400	431.30	23,462,720
コスモエネルギーホールディングス	1,600	2,186.00	3,497,600
横浜ゴム	2,600	1,607.00	4,178,200
TOYO TIRE	1,100	1,630.00	1,793,000
ブリヂストン	9,300	3,710.00	34,503,000
住友ゴム工業	4,800	947.00	4,545,600
オカモト	200	4,040.00	808,000
西川ゴム工業	300	1,450.00	435,000
ニッタ	300	2,284.00	685,200
住友理工	2,000	588.00	1,176,000
三ツ星ベルト	400	1,745.00	698,000
バンドー化学	600	680.00	408,000
日東紡績	200	4,830.00	966,000
A G C	2,700	3,740.00	10,098,000
日本電気硝子	1,400	2,327.00	3,257,800
住友大阪セメント	400	3,050.00	1,220,000
太平洋セメント	1,700	2,726.00	4,634,200
東海カーボン	1,400	1,479.00	2,070,600
ノリタケカンパニーリミテド	200	3,180.00	636,000
T O T O	700	6,060.00	4,242,000
日本碍子	2,600	1,757.00	4,568,200
日本特殊陶業	2,100	1,868.00	3,922,800
M A R U W A	100	11,920.00	1,192,000
フジインコーポレーテッド	200	4,115.00	823,000
ニチアス	500	2,518.00	1,259,000

ニチハ	300	3,320.00	996,000
日本製鉄	15,900	1,473.00	23,420,700
神戸製鋼所	7,800	573.00	4,469,400
合同製鐵	200	2,044.00	408,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	12,800	1,086.00	13,900,800
東京製鐵	1,600	678.00	1,084,800
共英製鋼	400	1,455.00	582,000
大和工業	700	2,879.00	2,015,300
大阪製鐵	500	1,264.00	632,000
淀川製鋼所	400	2,206.00	882,400
丸一鋼管	700	2,356.00	1,649,200
大同特殊鋼	500	4,670.00	2,335,000
山陽特殊製鋼	800	1,471.00	1,176,800
愛知製鋼	300	3,410.00	1,023,000
日立金属	3,100	1,579.00	4,894,900
日本軽金属ホールディングス	800	2,033.00	1,626,400
三井金属鉱業	600	4,140.00	2,484,000
東邦亜鉛	200	2,552.00	510,400
三菱マテリアル	1,900	2,428.00	4,613,200
住友金属鉱山	1,600	5,056.00	8,089,600
DOWAホールディングス	600	4,180.00	2,508,000
古河機械金属	500	1,300.00	650,000
東邦チタニウム	500	952.00	476,000
UACJ	600	1,985.00	1,191,000
古河電気工業	800	2,985.00	2,388,000
住友電気工業	10,300	1,487.00	15,316,100
フジクラ	3,700	505.00	1,868,500
リョービ	800	1,265.00	1,012,000
アーレスティ	1,100	370.00	407,000
アサヒホールディングス	300	3,990.00	1,197,000
トーカロ	400	1,565.00	626,000
SUMCO	1,600	2,453.00	3,924,800
川田テクノロジーズ	100	4,255.00	425,500
東洋製罐グループホールディングス	2,500	1,162.00	2,905,000
ホッカンホールディングス	300	1,444.00	433,200

コロナ	300	958.00	287,400
横河ブリッジホールディングス	300	2,112.00	633,600
三和ホールディングス	1,500	1,264.00	1,896,000
文化シャッター	700	968.00	677,600
三協立山	500	854.00	427,000
L I X I L	2,100	2,475.00	5,197,500
ノーリツ	500	1,609.00	804,500
長府製作所	300	2,182.00	654,600
リンナイ	200	11,900.00	2,380,000
岡部	500	778.00	389,000
ジーテクト	700	1,507.00	1,054,900
東プレ	800	1,555.00	1,244,000
パイオラックス	400	1,575.00	630,000
エイチワン	900	823.00	740,700
日本発條	3,400	749.00	2,546,600
三益半導体工業	200	3,030.00	606,000
日本製鋼所	400	3,190.00	1,276,000
三浦工業	300	6,160.00	1,848,000
タクマ	600	2,065.00	1,239,000
オークマ	300	6,110.00	1,833,000
芝浦機械	200	2,331.00	466,200
アマダ	3,600	1,188.00	4,276,800
アイダエンジニアリング	700	1,030.00	721,000
F U J I	700	2,806.00	1,964,200
牧野フライス製作所	300	4,160.00	1,248,000
オーエスジー	700	2,082.00	1,457,400
旭ダイヤモンド工業	700	483.00	338,100
D M G 森精機	900	1,699.00	1,529,100
ソディック	600	911.00	546,600
ディスコ	100	38,250.00	3,825,000
日東工器	200	1,767.00	353,400
島精機製作所	300	1,803.00	540,900
やまびこ	500	1,360.00	680,000
ナブテスコ	500	4,960.00	2,480,000
三井海洋開発	600	2,118.00	1,270,800
S M C	200	67,260.00	13,452,000

ユニオンツール	200	3,185.00	637,000
オイレス工業	300	1,697.00	509,100
サトーホールディングス	200	2,275.00	455,000
小松製作所	7,100	3,023.00	21,463,300
住友重機械工業	1,500	2,857.00	4,285,500
日立建機	1,500	3,175.00	4,762,500
井関農機	300	1,417.00	425,100
ハーモニック・ドライブ・システムズ	200	9,060.00	1,812,000
クボタ	6,400	2,270.50	14,531,200
月島機械	300	1,450.00	435,000
新東工業	500	787.00	393,500
澁谷工業	200	3,650.00	730,000
アイチ コーポレーション	800	920.00	736,000
小森コーポレーション	700	734.00	513,800
荏原製作所	700	3,715.00	2,600,500
ダイキン工業	700	23,700.00	16,590,000
栗田工業	700	4,495.00	3,146,500
椿本チエイン	500	2,855.00	1,427,500
ダイフク	200	13,430.00	2,686,000
加藤製作所	300	981.00	294,300
タダノ	1,300	952.00	1,237,600
フジテック	600	2,345.00	1,407,000
C K D	400	2,440.00	976,000
平和	1,100	1,444.00	1,588,400
理想科学工業	400	1,405.00	562,000
SANKYO	700	2,822.00	1,975,400
マースグループホールディングス	200	1,561.00	312,200
フクシマガリレイ	200	4,400.00	880,000
ユニバーサルエンターテインメント	1,200	2,430.00	2,916,000
竹内製作所	500	2,686.00	1,343,000
アマノ	400	2,476.00	990,400
マックス	300	1,447.00	434,100
グローリー	500	2,084.00	1,042,000
大和冷機工業	400	1,004.00	401,600
セガサミーホールディングス	1,500	1,631.00	2,446,500

リケン	200	2,098.00	419,600
T P R	600	1,488.00	892,800
ツバキ・ナカシマ	400	1,211.00	484,400
ホシザキ	300	9,350.00	2,805,000
大豊工業	700	791.00	553,700
日本精工	6,400	951.00	6,086,400
N T N	9,100	268.00	2,438,800
ジェイテクト	5,600	868.00	4,860,800
不二越	300	4,685.00	1,405,500
T H K	900	3,750.00	3,375,000
イーグル工業	900	1,011.00	909,900
キッツ	1,100	636.00	699,600
マキタ	1,000	5,040.00	5,040,000
日立造船	1,700	663.00	1,127,100
三菱重工業	4,700	3,337.00	15,683,900
I H I	1,800	2,045.00	3,681,000
スター精密	400	1,640.00	656,000
日清紡ホールディングス	1,700	772.00	1,312,400
イビデン	400	4,895.00	1,958,000
コニカミノルタ	13,400	402.00	5,386,800
ブラザー工業	2,500	2,346.00	5,865,000
ミネベアミツミ	2,000	2,222.00	4,444,000
日立製作所	7,800	4,328.00	33,758,400
三菱電機	16,900	1,663.00	28,104,700
富士電機	1,100	4,185.00	4,603,500
安川電機	700	5,660.00	3,962,000
明電舎	400	2,847.00	1,138,800
山洋電気	100	5,990.00	599,000
東芝テック	200	3,810.00	762,000
マブチモーター	600	4,375.00	2,625,000
日本電産	900	14,475.00	13,027,500
ダイヘン	200	5,110.00	1,022,000
J V C ケンウッド	1,900	176.00	334,400
日新電機	800	1,377.00	1,101,600
オムロン	700	9,760.00	6,832,000
日東工業	300	2,070.00	621,000

I D E C	200	1,845.00	369,000
M C J	400	1,111.00	444,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	800	3,285.00	2,628,000
メルコホールディングス	200	3,510.00	702,000
日本電気	1,300	5,850.00	7,605,000
富士通	900	15,890.00	14,301,000
沖電気工業	900	1,015.00	913,500
サンケン電気	200	5,220.00	1,044,000
ルネサスエレクトロニクス	6,400	1,266.00	8,102,400
セイコーエプソン	4,200	1,561.00	6,556,200
アルバック	400	4,785.00	1,914,000
E I Z O	200	3,595.00	719,000
日本信号	400	958.00	383,200
能美防災	300	2,248.00	674,400
エレコム	200	5,060.00	1,012,000
パナソニック	19,500	1,299.00	25,330,500
シャープ	2,000	1,791.00	3,582,000
アンリツ	400	2,524.00	1,009,600
富士通ゼネラル	500	2,797.00	1,398,500
ソニー	4,500	10,700.00	48,150,000
T D K	600	17,110.00	10,266,000
アルプスアルパイン	2,200	1,480.00	3,256,000
フォスター電機	300	1,411.00	423,300
ホシデン	400	994.00	397,600
ヒロセ電機	200	15,900.00	3,180,000
日本航空電子工業	700	1,667.00	1,166,900
マクセルホールディングス	600	1,384.00	830,400
横河電機	1,300	2,287.00	2,973,100
新電元工業	200	2,890.00	578,000
アズビル	400	6,040.00	2,416,000
日本光電工業	400	3,150.00	1,260,000
堀場製作所	200	6,630.00	1,326,000
アドバンテスト	400	8,710.00	3,484,000
キーエンス	300	57,910.00	17,373,000
シスメックス	400	12,830.00	5,132,000

O B A R A G R O U P	200	4,165.00	833,000
イリソ電子工業	100	4,425.00	442,500
スタンレー電気	1,200	3,360.00	4,032,000
ウシオ電機	800	1,375.00	1,100,000
カシオ計算機	1,300	1,834.00	2,384,200
ファナック	800	27,075.00	21,660,000
フクダ電子	200	8,100.00	1,620,000
エンプラス	200	4,255.00	851,000
ローム	700	11,250.00	7,875,000
浜松ホトニクス	400	6,330.00	2,532,000
新光電気工業	600	2,669.00	1,601,400
京セラ	2,600	6,650.00	17,290,000
太陽誘電	600	5,450.00	3,270,000
村田製作所	2,000	10,170.00	20,340,000
双葉電子工業	400	1,016.00	406,400
K O A	300	1,557.00	467,100
市光工業	600	687.00	412,200
小糸製作所	1,000	6,860.00	6,860,000
ミツバ	800	463.00	370,400
S C R E E Nホールディングス	300	8,380.00	2,514,000
キャノン電子	500	1,516.00	758,000
キャノン	18,000	2,034.00	36,612,000
リコー	8,400	715.00	6,006,000
象印マホービン	300	1,853.00	555,900
東京エレクトロン	500	42,950.00	21,475,000
トヨタ紡織	2,400	1,684.00	4,041,600
ユニプレス	1,300	1,015.00	1,319,500
豊田自動織機	2,500	8,600.00	21,500,000
モリタホールディングス	400	1,798.00	719,200
デンソー	5,600	6,017.00	33,695,200
東海理化電機製作所	1,000	1,773.00	1,773,000
三井E & Sホールディングス	1,100	400.00	440,000
川崎重工業	2,100	2,635.00	5,533,500
三菱ロジスネクスト	600	1,249.00	749,400
日産自動車	100,600	533.80	53,700,280
いすゞ自動車	10,100	1,001.00	10,110,100

トヨタ自動車	30,700	7,846.00	240,872,200
日野自動車	6,300	912.00	5,745,600
三菱自動車工業	28,300	229.00	6,480,700
武蔵精密工業	700	1,767.00	1,236,900
日産車体	1,000	861.00	861,000
新明和工業	600	907.00	544,200
極東開発工業	500	1,432.00	716,000
トピー工業	400	1,294.00	517,600
タチエス	400	1,188.00	475,200
N O K	2,700	1,175.00	3,172,500
フタバ産業	900	537.00	483,300
K Y B	400	2,385.00	954,000
大同メタル工業	800	516.00	412,800
プレス工業	1,800	315.00	567,000
太平洋工業	600	1,166.00	699,600
河西工業	1,000	406.00	406,000
アイシン精機	4,900	3,225.00	15,802,500
マツダ	15,200	742.00	11,278,400
本田技研工業	23,400	2,921.00	68,351,400
スズキ	3,100	5,204.00	16,132,400
S U B A R U	12,700	2,123.50	26,968,450
ヤマハ発動機	4,200	2,169.00	9,109,800
エクセディ	1,300	1,373.00	1,784,900
ハイレックスコーポレーション	600	1,516.00	909,600
豊田合成	1,300	2,968.00	3,858,400
愛三工業	1,000	551.00	551,000
日本精機	700	1,220.00	854,000
ヨロズ	500	1,164.00	582,000
エフ・シー・シー	500	1,802.00	901,000
シマノ	200	25,000.00	5,000,000
テイ・エス テック	800	3,245.00	2,596,000
テルモ	1,700	4,228.00	7,187,600
日機装	500	1,050.00	525,000
島津製作所	800	4,150.00	3,320,000
ナカニシ	400	2,117.00	846,800
東京精密	300	5,460.00	1,638,000

ニコン	7,000	749.00	5,243,000
トプコン	600	1,463.00	877,800
オリンパス	2,200	2,067.50	4,548,500
タムロン	200	1,949.00	389,800
HOYA	800	14,135.00	11,308,000
朝日インテック	200	3,595.00	719,000
シチズン時計	6,000	316.00	1,896,000
セイコーホールディングス	500	1,369.00	684,500
ニプロ	1,500	1,235.00	1,852,500
パラマウントベッドホールディングス	200	4,655.00	931,000
バンダイナムコホールディングス	600	9,384.00	5,630,400
パイロットコーポレーション	300	3,010.00	903,000
トッパン・フォームズ	1,000	1,054.00	1,054,000
フジシールインターナショナル	400	1,999.00	799,600
タカラトミー	500	901.00	450,500
大建工業	300	1,735.00	520,500
凸版印刷	4,200	1,506.00	6,325,200
大日本印刷	3,200	1,896.00	6,067,200
共同印刷	200	3,305.00	661,000
NISSHA	900	1,452.00	1,306,800
アシックス	900	1,924.00	1,731,600
ヤマハ	700	6,120.00	4,284,000
ピジョン	300	4,365.00	1,309,500
リンテック	700	2,379.00	1,665,300
任天堂	300	65,790.00	19,737,000
三菱鉛筆	400	1,343.00	537,200
タカラスタANDARD	600	1,588.00	952,800
コクヨ	900	1,437.00	1,293,300
オカムラ	1,000	988.00	988,000
美津濃	200	2,051.00	410,200
東京電力ホールディングス	97,600	320.00	31,232,000
中部電力	14,100	1,321.00	18,626,100
関西電力	20,200	1,017.50	20,553,500
中国電力	5,100	1,266.00	6,456,600
北陸電力	3,700	707.00	2,615,900

東北電力	13,000	888.00	11,544,000
四国電力	3,900	716.00	2,792,400
九州電力	10,000	961.00	9,610,000
北海道電力	7,300	405.00	2,956,500
沖縄電力	600	1,438.00	862,800
電源開発	4,500	1,660.00	7,470,000
東京瓦斯	5,200	2,402.50	12,493,000
大阪瓦斯	4,400	2,089.00	9,191,600
東邦瓦斯	600	6,640.00	3,984,000
北海道瓦斯	300	1,577.00	473,100
西部瓦斯	400	3,155.00	1,262,000
静岡ガス	800	1,041.00	832,800
メタウォーター	400	2,389.00	955,600
S B Sホールディングス	100	2,501.00	250,100
東武鉄道	1,400	2,993.00	4,190,200
相鉄ホールディングス	600	2,462.00	1,477,200
東急	5,800	1,234.00	7,157,200
京浜急行電鉄	1,100	1,786.00	1,964,600
小田急電鉄	1,400	3,165.00	4,431,000
京王電鉄	500	7,990.00	3,995,000
京成電鉄	700	3,350.00	2,345,000
東日本旅客鉄道	4,800	6,628.00	31,814,400
西日本旅客鉄道	2,400	5,327.00	12,784,800
東海旅客鉄道	2,400	14,440.00	34,656,000
西武ホールディングス	3,600	983.00	3,538,800
鴻池運輸	600	1,013.00	607,800
西日本鉄道	600	3,015.00	1,809,000
ハマキョウレックス	200	2,951.00	590,200
サカイ引越センター	100	5,100.00	510,000
近鉄グループホールディングス	800	4,400.00	3,520,000
阪急阪神ホールディングス	2,200	3,405.00	7,491,000
南海電気鉄道	800	2,547.00	2,037,600
京阪ホールディングス	400	4,930.00	1,972,000
名古屋鉄道	1,200	2,696.00	3,235,200
日本通運	700	7,260.00	5,082,000
ヤマトホールディングス	1,500	2,782.00	4,173,000

山九	400	4,140.00	1,656,000
丸全昭和運輸	200	3,575.00	715,000
センコーグループホールディングス	1,400	1,012.00	1,416,800
トナミホールディングス	100	5,910.00	591,000
ニッコンホールディングス	600	2,247.00	1,348,200
福山通運	400	4,310.00	1,724,000
セイノーホールディングス	1,800	1,501.00	2,701,800
神奈川中央交通	200	3,890.00	778,000
日立物流	700	3,230.00	2,261,000
九州旅客鉄道	1,000	2,176.00	2,176,000
S Gホールディングス	1,600	2,945.00	4,712,000
日本郵船	1,500	2,707.00	4,060,500
商船三井	1,200	3,285.00	3,942,000
川崎汽船	600	2,214.00	1,328,400
N S ユナイテッド海運	500	1,496.00	748,000
飯野海運	1,900	450.00	855,000
日本航空	7,800	1,899.00	14,812,200
A N Aホールディングス	4,300	2,280.00	9,804,000
日新	300	1,249.00	374,700
三菱倉庫	600	3,155.00	1,893,000
三井倉庫ホールディングス	300	2,324.00	697,200
住友倉庫	800	1,338.00	1,070,400
日本トランスシティ	800	551.00	440,800
名港海運	400	1,146.00	458,400
上組	1,100	1,889.00	2,077,900
近鉄エクスプレス	600	2,608.00	1,564,800
N E C ネットエスアイ	500	1,884.00	942,000
日鉄ソリューションズ	400	3,235.00	1,294,000
T I S	900	2,103.00	1,892,700
グリー	2,100	603.00	1,266,300
コーエーテクモホールディングス	300	6,210.00	1,863,000
三菱総合研究所	100	4,220.00	422,000
ネクソン	2,000	3,290.00	6,580,000
コロブラ	900	951.00	855,900
ティーガイア	400	1,952.00	780,800
ガンホー・オンライン・エンターテ	900	2,457.00	2,211,300

イメント				
インターネットイニシアティブ	400	2,167.00	866,800	
アルテリア・ネットワークス	300	1,619.00	485,700	
フジ・メディア・ホールディングス	3,900	1,182.00	4,609,800	
オービック	200	21,180.00	4,236,000	
ジャストシステム	100	7,200.00	720,000	
Zホールディングス	18,300	697.90	12,771,570	
トレンドマイクロ	600	5,700.00	3,420,000	
日本オラクル	300	13,660.00	4,098,000	
オービックビジネスコンサルタント	200	6,830.00	1,366,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	600	3,730.00	2,238,000	
大塚商会	600	5,000.00	3,000,000	
電通国際情報サービス	200	3,475.00	695,000	
東映アニメーション	100	8,960.00	896,000	
デジタルガレージ	200	4,030.00	806,000	
WOWOW	300	2,833.00	849,900	
ネットワンシステムズ	300	3,505.00	1,051,500	
エイベックス	500	1,216.00	608,000	
日本ユニシス	400	4,050.00	1,620,000	
兼松エレクトロニクス	200	4,110.00	822,000	
TBSホールディングス	1,600	1,927.00	3,083,200	
日本テレビホールディングス	3,700	1,153.00	4,266,100	
朝日放送グループホールディングス	600	706.00	423,600	
テレビ朝日ホールディングス	1,000	1,827.00	1,827,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	3,700	479.00	1,772,300	
テレビ東京ホールディングス	300	2,425.00	727,500	
コネクション	400	1,447.00	578,800	
日本電信電話	44,000	2,750.50	121,022,000	
KDDI	21,500	3,252.00	69,918,000	
ソフトバンク	27,800	1,343.50	37,349,300	
光通信	200	20,490.00	4,098,000	
沖縄セルラー電話	300	4,620.00	1,386,000	
GMOインターネット	300	3,070.00	921,000	
KADOKAWA	300	3,265.00	979,500	
ゼンリン	300	1,249.00	374,700	
松竹	100	14,660.00	1,466,000	

東宝	700	4,155.00	2,908,500
東映	100	17,220.00	1,722,000
エヌ・ティ・ティ・データ	7,300	1,477.00	10,782,100
D T S	300	2,119.00	635,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	6,110.00	2,444,000
カブコン	300	6,930.00	2,079,000
S C S K	500	5,640.00	2,820,000
T K C	100	7,490.00	749,000
富士ソフト	200	5,140.00	1,028,000
N S D	400	2,106.00	842,400
コナミホールディングス	600	6,400.00	3,840,000
ソフトバンクグループ	10,200	8,325.00	84,915,000
伊藤忠食品	100	5,440.00	544,000
あらた	200	5,040.00	1,008,000
双日	22,400	250.00	5,600,000
アルフレッサ ホールディングス	1,700	1,981.00	3,367,700
横浜冷凍	400	874.00	349,600
神戸物産	200	3,000.00	600,000
あい ホールディングス	300	2,072.00	621,600
ダイワボウホールディングス	200	9,540.00	1,908,000
マクニカ・富士エレホールディングス	500	2,159.00	1,079,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	700	817.00	571,900
T O K A Iホールディングス	1,000	1,023.00	1,023,000
シップヘルスケアホールディングス	300	5,860.00	1,758,000
コメダホールディングス	200	1,866.00	373,200
小野建	400	1,285.00	514,000
ナガイレーベン	200	2,949.00	589,800
三菱食品	500	2,910.00	1,455,000
第一興商	400	3,530.00	1,412,000
メディバルホールディングス	1,800	2,039.00	3,670,200
アズワン	100	17,210.00	1,721,000
ドウシシャ	400	1,942.00	776,800
岡谷鋼機	200	8,250.00	1,650,000
日本ライフライン	300	1,618.00	485,400

シークス	400	1,607.00	642,800
伊藤忠商事	12,600	3,137.00	39,526,200
丸紅	23,300	748.80	17,447,040
長瀬産業	1,200	1,581.00	1,897,200
蝶理	300	1,597.00	479,100
豊田通商	3,300	4,370.00	14,421,000
兼松	900	1,354.00	1,218,600
三井物産	20,000	1,998.00	39,960,000
日本紙パルプ商事	200	3,660.00	732,000
カメイ	600	1,200.00	720,000
山善	900	1,033.00	929,700
住友商事	19,400	1,435.00	27,839,000
三菱商事	19,700	2,698.00	53,150,600
キャノンマーケティングジャパン	1,000	2,310.00	2,310,000
三谷商事	200	6,840.00	1,368,000
ユアサ商事	300	3,355.00	1,006,500
阪和興業	600	2,953.00	1,771,800
菱電商事	300	1,564.00	469,200
岩谷産業	400	7,340.00	2,936,000
三愛石油	700	1,127.00	788,900
稲畑産業	700	1,467.00	1,026,900
ワキタ	600	989.00	593,400
東邦ホールディングス	700	1,867.00	1,306,900
サンゲツ	500	1,584.00	792,000
ミツウロコグループホールディングス	400	1,438.00	575,200
伊藤忠エネクス	1,600	1,068.00	1,708,800
サンリオ	500	1,455.00	727,500
リョーサン	300	2,054.00	616,200
加賀電子	300	2,454.00	736,200
PALTAC	300	5,760.00	1,728,000
日鉄物産	400	3,910.00	1,564,000
トラスコ中山	400	2,862.00	1,144,800
オートバックスセブン	700	1,443.00	1,010,100
加藤産業	300	3,580.00	1,074,000
イエローハット	400	1,720.00	688,000

日伝	300	2,304.00	691,200
因幡電機産業	500	2,599.00	1,299,500
ミスミグループ本社	700	3,290.00	2,303,000
スズケン	700	3,885.00	2,719,500
ジェコス	500	978.00	489,000
ローソン	1,300	4,945.00	6,428,500
サンエー	200	4,335.00	867,000
カワチ薬品	300	3,045.00	913,500
エービーシー・マート	500	5,490.00	2,745,000
アスクル	200	3,965.00	793,000
ゲオホールディングス	700	1,220.00	854,000
アダストリア	300	1,911.00	573,300
くら寿司	100	5,960.00	596,000
日本マクドナルドホールディングス	200	5,090.00	1,018,000
パルグループホールディングス	400	1,237.00	494,800
エディオン	1,100	1,025.00	1,127,500
セリア	300	3,740.00	1,122,000
ナフコ	400	2,115.00	846,000
アルペン	400	2,311.00	924,400
ビックカメラ	1,000	1,156.00	1,156,000
D C Mホールディングス	1,400	1,095.00	1,533,000
MonotaRO	200	5,620.00	1,124,000
J . フロント リテイリング	4,300	823.00	3,538,900
ドトール・日レスホールディングス	400	1,484.00	593,600
マツモトキヨシホールディングス	500	4,325.00	2,162,500
Z O Z O	500	2,706.00	1,353,000
ココカラファイン	200	7,220.00	1,444,000
三越伊勢丹ホールディングス	4,200	625.00	2,625,000
ウエルシアホールディングス	400	3,605.00	1,442,000
クリエイトSDホールディングス	300	3,735.00	1,120,500
ジョイフル本田	600	1,453.00	871,800
すかいらーくホールディングス	900	1,549.00	1,394,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1,100	1,139.00	1,252,900
日本調剤	400	1,499.00	599,600
コスモス薬品	100	16,110.00	1,611,000

セブン&アイ・ホールディングス	7,400	3,909.00	28,926,600
ツルハホールディングス	200	14,560.00	2,912,000
サンマルクホールディングス	300	1,383.00	414,900
トリドールホールディングス	400	1,382.00	552,800
クスリのアオキホールディングス	100	9,110.00	911,000
スシローグローバルホールディングス	400	3,685.00	1,474,000
ノジマ	500	2,816.00	1,408,000
良品計画	1,000	2,446.00	2,446,000
コーナン商事	300	3,040.00	912,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,400	2,303.00	3,224,200
西松屋チェーン	600	1,544.00	926,400
ゼンショーホールディングス	500	2,694.00	1,347,000
ワークマン	100	8,480.00	848,000
サイゼリヤ	300	1,871.00	561,300
V Tホールディングス	1,300	443.00	575,900
ユナイテッドアローズ	200	1,474.00	294,800
壱番屋	100	5,030.00	503,000
スギホールディングス	300	6,880.00	2,064,000
ヨンドシーホールディングス	200	2,009.00	401,800
リテールパートナーズ	200	1,454.00	290,800
上新電機	300	2,894.00	868,200
日本瓦斯	200	5,660.00	1,132,000
ロイヤルホールディングス	200	1,667.00	333,400
チヨダ	400	893.00	357,200
ライフコーポレーション	200	3,505.00	701,000
A O K Iホールディングス	2,300	518.00	1,191,400
オークワ	400	1,289.00	515,600
コメリ	600	2,994.00	1,796,400
青山商事	2,700	584.00	1,576,800
しまむら	300	11,880.00	3,564,000
高島屋	2,900	883.00	2,560,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,600	711.00	1,137,600
丸井グループ	800	1,787.00	1,429,600
アクシアル リテイリング	200	5,270.00	1,054,000
イオン	3,700	3,368.00	12,461,600

イズミ	500	3,780.00	1,890,000
平和堂	600	2,187.00	1,312,200
フジ	300	2,006.00	601,800
ヤオコー	200	6,920.00	1,384,000
ゼビオホールディングス	500	827.00	413,500
ケーズホールディングス	1,600	1,403.00	2,244,800
A Tグループ	800	1,435.00	1,148,000
アインホールディングス	200	6,480.00	1,296,000
ヤマダホールディングス	7,600	545.00	4,142,000
アークランドサカモト	500	1,644.00	822,000
ニトリホールディングス	300	22,040.00	6,612,000
吉野家ホールディングス	200	1,912.00	382,400
王将フードサービス	100	5,710.00	571,000
プレナス	300	1,734.00	520,200
ミニストップ	300	1,410.00	423,000
アークス	600	2,401.00	1,440,600
バローホールディングス	600	2,662.00	1,597,200
ベルク	100	5,910.00	591,000
ファーストリテイリング	200	92,130.00	18,426,000
サンドラッグ	600	4,035.00	2,421,000
ベルーナ	1,100	1,096.00	1,205,600
めぶきフィナンシャルグループ	27,400	216.00	5,918,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,200	1,133.00	1,359,600
九州フィナンシャルグループ	6,900	446.00	3,077,400
ゆうちょ銀行	5,200	890.00	4,628,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	22,600	388.00	8,768,800
西日本フィナンシャルホールディングス	3,400	673.00	2,288,200
関西みらいフィナンシャルグループ	6,900	552.00	3,808,800
三十三フィナンシャルグループ	1,000	1,289.00	1,289,000
第四北越フィナンシャルグループ	900	2,302.00	2,071,800
ひろぎんホールディングス	5,800	616.00	3,572,800
新生銀行	3,600	1,409.00	5,072,400
あおぞら銀行	2,700	1,978.00	5,340,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	197,200	495.70	97,752,040

プ			
りそなホールディングス	55,100	393.60	21,687,360
三井住友トラスト・ホールディングス	6,000	3,353.00	20,118,000
三井住友フィナンシャルグループ	24,600	3,506.00	86,247,600
千葉銀行	9,800	607.00	5,948,600
群馬銀行	8,000	336.00	2,688,000
武蔵野銀行	800	1,561.00	1,248,800
千葉興業銀行	2,400	253.00	607,200
筑波銀行	1,800	189.00	340,200
七十七銀行	1,400	1,411.00	1,975,400
青森銀行	300	2,469.00	740,700
秋田銀行	400	1,412.00	564,800
山形銀行	500	1,047.00	523,500
岩手銀行	400	2,017.00	806,800
東邦銀行	4,100	209.00	856,900
ふくおかフィナンシャルグループ	3,000	1,994.00	5,982,000
静岡銀行	7,100	791.00	5,616,100
十六銀行	700	1,945.00	1,361,500
スルガ銀行	2,900	335.00	971,500
八十二銀行	9,000	360.00	3,240,000
山梨中央銀行	900	788.00	709,200
大垣共立銀行	700	2,089.00	1,462,300
福井銀行	400	1,978.00	791,200
北國銀行	400	2,649.00	1,059,600
滋賀銀行	700	2,097.00	1,467,900
南都銀行	600	1,777.00	1,066,200
百五銀行	4,600	302.00	1,389,200
京都銀行	800	5,950.00	4,760,000
紀陽銀行	900	1,470.00	1,323,000
ほくほくフィナンシャルグループ	3,200	997.00	3,190,400
山陰合同銀行	2,700	496.00	1,339,200
中国銀行	2,600	848.00	2,204,800
伊予銀行	4,100	666.00	2,730,600
百十四銀行	700	1,496.00	1,047,200
四国銀行	900	694.00	624,600
阿波銀行	600	2,328.00	1,396,800

大分銀行	400	2,119.00	847,600
宮崎銀行	400	2,276.00	910,400
佐賀銀行	400	1,377.00	550,800
沖縄銀行	300	2,805.00	841,500
琉球銀行	700	765.00	535,500
セブン銀行	12,000	228.00	2,736,000
みずほフィナンシャルグループ	46,400	1,439.50	66,792,800
山口フィナンシャルグループ	4,700	613.00	2,881,100
名古屋銀行	400	2,733.00	1,093,200
北洋銀行	9,600	223.00	2,140,800
愛知銀行	300	2,973.00	891,900
中京銀行	300	2,025.00	607,500
大光銀行	300	1,270.00	381,000
愛媛銀行	600	988.00	592,800
京葉銀行	2,700	420.00	1,134,000
栃木銀行	3,700	175.00	647,500
東和銀行	1,000	676.00	676,000
トモニホールディングス	3,200	313.00	1,001,600
フィデアホールディングス	5,100	110.00	561,000
池田泉州ホールディングス	8,400	150.00	1,260,000
F P G	1,300	498.00	647,400
G M O フィナンシャルホールディングス	800	798.00	638,400
S B I ホールディングス	1,700	2,706.00	4,600,200
ジャフコ グループ	400	5,750.00	2,300,000
大和証券グループ本社	41,800	506.20	21,159,160
岡三証券グループ	2,900	409.00	1,186,100
丸三証券	1,100	505.00	555,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,900	326.00	1,597,400
松井証券	2,000	813.00	1,626,000
マネックスグループ	2,000	464.00	928,000
極東証券	600	760.00	456,000
岩井コスモホールディングス	400	1,422.00	568,800
かんぽ生命保険	2,300	2,298.00	5,285,400
S O M P O ホールディングス	3,900	4,268.00	16,645,200
M S & A D インシュアランスグループ	7,200	3,274.00	23,572,800

ブホール			
第一生命ホールディングス	14,500	1,777.50	25,773,750
東京海上ホールディングス	6,600	5,686.00	37,527,600
T & Dホールディングス	7,400	1,405.00	10,397,000
全国保証	400	4,585.00	1,834,000
アルヒ	300	1,706.00	511,800
クレディセゾン	2,500	1,234.00	3,085,000
芙蓉総合リース	300	7,400.00	2,220,000
みずほリース	400	3,300.00	1,320,000
東京センチュリー	600	9,050.00	5,430,000
日本証券金融	1,800	532.00	957,600
リコーリース	300	3,190.00	957,000
イオンフィナンシャルサービス	3,600	1,326.00	4,773,600
アコム	4,100	469.00	1,922,900
ジャックス	400	1,949.00	779,600
オリエントコーポレーション	18,800	128.00	2,406,400
日立キャピタル	1,000	2,661.00	2,661,000
オリックス	19,100	1,844.00	35,220,400
三菱UFJリース	19,100	532.00	10,161,200
日本取引所グループ	2,200	2,656.50	5,844,300
NECキャピタルソリューション	300	1,992.00	597,600
いちご	1,900	312.00	592,800
ヒューリック	5,100	1,137.00	5,798,700
サムティ	300	1,693.00	507,900
プレサンスコーポレーション	500	1,747.00	873,500
オープンハウス	400	4,170.00	1,668,000
東急不動産ホールディングス	7,900	557.00	4,400,300
飯田グループホールディングス	2,800	2,219.00	6,213,200
パーク24	1,300	1,854.00	2,410,200
三井不動産	7,000	2,065.00	14,455,000
三菱地所	9,500	1,657.50	15,746,250
平和不動産	300	3,805.00	1,141,500
東京建物	1,600	1,495.00	2,392,000
ダイビル	800	1,270.00	1,016,000
京阪神ビルディング	400	1,812.00	724,800
住友不動産	3,500	3,119.00	10,916,500

テオーシー	800	745.00	596,000
スターツコーポレーション	500	2,859.00	1,429,500
ゴールドクレスト	400	1,647.00	658,800
タカラレーベン	2,600	314.00	816,400
イオンモール	2,000	1,738.00	3,476,000
シノケングループ	400	1,193.00	477,200
サンフロンティア不動産	400	897.00	358,800
日本空港ビルデング	300	6,260.00	1,878,000
ミクシィ	1,100	2,572.00	2,829,200
日本M & Aセンター	200	6,220.00	1,244,000
パーソルホールディングス	900	1,901.00	1,710,900
総合警備保障	400	5,340.00	2,136,000
カカクコム	500	2,829.00	1,414,500
ディップ	200	2,623.00	524,600
ベネフィット・ワン	100	3,110.00	311,000
エムスリー	200	10,165.00	2,033,000
アウトソーシング	800	1,323.00	1,058,400
ディー・エヌ・エー	800	1,922.00	1,537,600
博報堂D Yホールディングス	2,000	1,424.00	2,848,000
ぐるなび	400	491.00	196,400
電通グループ	2,500	2,974.00	7,435,000
H . U . グループホールディングス	600	2,977.00	1,786,200
オリエンタルランド	500	16,150.00	8,075,000
ダスキン	400	2,873.00	1,149,200
ラウンドワン	800	785.00	628,000
リゾートトラスト	800	1,473.00	1,178,400
ビー・エム・エル	300	3,360.00	1,008,000
りらいあコミュニケーションズ	300	1,339.00	401,700
ユー・エス・エス	1,300	2,126.00	2,763,800
サイバーエージェント	200	7,300.00	1,460,000
楽天	6,100	960.00	5,856,000
エン・ジャパン	100	3,100.00	310,000
テクノプロ・ホールディングス	200	8,880.00	1,776,000
リクルートホールディングス	3,300	4,473.00	14,760,900
日本郵政	21,600	856.70	18,504,720
ベルシステム2 4ホールディングス	400	1,717.00	686,800

	カーブスホールディングス	900	725.00	652,500	
	リログループ	300	2,487.00	746,100	
	エイチ・アイ・エス	400	1,652.00	660,800	
	共立メンテナンス	200	3,770.00	754,000	
	東京都競馬	200	4,350.00	870,000	
	カナモト	400	2,291.00	916,400	
	東京ドーム	900	1,297.00	1,167,300	
	西尾レントオール	300	2,153.00	645,900	
	帝国ホテル	300	1,963.00	588,900	
	トランス・コスモス	300	2,608.00	782,400	
	乃村工藝社	400	837.00	334,800	
	日本管財	200	2,069.00	413,800	
	トーカイ	200	2,015.00	403,000	
	セコム	1,100	9,542.00	10,496,200	
	メイテック	200	5,250.00	1,050,000	
	ベネッセホールディングス	600	1,993.00	1,195,800	
	イオンディライト	300	2,640.00	792,000	
	ダイセキ	200	3,350.00	670,000	
	小計 銘柄数：983			4,397,169,050	
	組入時価比率：98.8%			100.0%	
	合計			4,397,169,050	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2021年1月13日現在)

該当事項はありません。

第2 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

種類	2021年 1月13日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	17,548,500	-	18,630,000	1,081,005
合計	17,548,500	-	18,630,000	1,081,005

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

野村 R A F I (R) 日本株投信

2021年2月26日現在

資産総額	2,138,928,498円
負債総額	4,223,278円
純資産総額（ - ）	2,134,705,220円
発行済口数	1,643,517,998口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2989円

（参考）野村 R A F I (R) 日本株投信マザーファンド

2021年2月26日現在

資産総額	4,482,017,210円
負債総額	19,149,021円
純資産総額（ - ）	4,462,868,189円
発行済口数	2,756,931,265口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6188円

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

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2021年2月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

「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者は、証券投資信託の設定を行うとともに「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）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2021年1月29日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	999	35,039,893
単位型株式投資信託	191	827,799
追加型公社債投資信託	14	6,309,670
単位型公社債投資信託	491	1,670,742
合計	1,695	43,848,104

3 委託会社等の経理状況

< 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)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)、ならびに同規則第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)により作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57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)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		1,562	2,626
金銭の信託		45,493	41,524
有価証券		19,900	24,399
前払費用		27	106
未収入金		500	522
未収委託者報酬		25,246	23,936
未収運用受託報酬		5,933	4,336
その他		269	71

貸倒引当金			15		14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産			714		645
建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	
投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		0	
投資損失引当金		707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729

資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			119,196		115,736
運用受託報酬			21,440		17,170
その他営業収益			355		340
営業収益計			140,992		133,247
営業費用					
支払手数料			42,675		39,435
広告宣伝費			1,210		1,006
公告費			0		-
調査費			30,082		26,833
調査費		5,998		5,696	
委託調査費		24,083		21,136	
委託計算費			1,311		1,342
営業雑経費			5,435		5,823
通信費		92		75	
印刷費		970		958	
協会費		86		92	
諸経費		4,286		4,696	
営業費用計			80,715		74,440
一般管理費					
給料			11,113		11,418
役員報酬		379		109	
給料・手当		7,067		7,173	
賞与		3,666		4,134	
交際費			107		86
旅費交通費			514		391
租税公課			1,048		1,029
不動産賃借料			1,223		1,227
退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348

諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
剰余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によるっております。

4．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
5．消費税等の会計処理方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してまいります。</p>
6．連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>

[未適用の会計基準等]

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

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

す。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「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）
- ・「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）
- ・「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）
- ・「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 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,434百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,296百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 736百万円 器具備品 3,106 合計 3,842	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 761百万円 器具備品 2,347 合計 3,109

損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するもの は、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するもの は、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソフトウェア 307 合計 310	2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 合計 67
3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう 清算配当です。	

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ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かか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、投資信託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。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、

親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31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す。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-

(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-

未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ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かか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、投資信託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。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日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す。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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

その他有価証券

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパーは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上してありました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2019年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2020年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年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	
退職給付債務の期首残高	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 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

確定給付型企業年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年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

退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 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

確定給付型企业年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.4%
タックスヘイブン税制	2.6%	タックスヘイブン税制	2.6%
外国税額控除	0.6%	外国税額控除	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	1.3%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%

セグメント情報等

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域

ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

関連当事者情報

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等 役員の兼任	資金の借入 (*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	1	未払費用	-

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	34,646	未払手数料	6,410

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
(*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

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

野村ホールディングス(株) (東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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)
----	--------	-----	-----	-------	--------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

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

野村ホールディングス(株) (東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		2020年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,307
金銭の信託		40,828
有価証券		10,500
未収委託者報酬		24,249
未収運用受託報酬		4,560
その他		894
貸倒引当金		14
流動資産計		83,326
固定資産		
有形固定資産	1	2,998
無形固定資産		5,462
ソフトウェア		5,461
その他		0
投資その他の資産		15,942
投資有価証券		1,701
関係会社株式		10,171
前払年金費用		1,429
繰延税金資産		2,003
その他		636
固定資産計		24,403
資産合計		107,730

		2020年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		11,513
未払収益分配金		0
未払償還金		0
未払手数料		6,651
関係会社未払金		4,007
その他未払金	2	853
未払費用		9,953
未払法人税等		1,444
賞与引当金		2,005
その他		147
流動負債計		25,063
固定負債		
退職給付引当金		3,350
時効後支払損引当金		579
資産除去債務		1,371
固定負債計		5,300
負債合計		30,364
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		77,365
資本剰余金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		46,455

利益準備金		685
その他利益剰余金		45,770
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,163
評価・換算差額等		0
その他有価証券評価差額金		0
純資産合計		77,366
負債・純資産合計		107,730

中間損益計算書

		自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		52,814
運用受託報酬		7,648
その他営業収益		178
営業収益計		60,641
営業費用		
支払手数料		16,811
調査費		11,994
その他営業費用		3,835
営業費用計		32,641
一般管理費	1	13,883
営業利益		14,115
営業外収益	2	6,145
営業外費用	3	33
経常利益		20,227
特別利益	4	2,228
特別損失	5	445
税引前中間純利益		22,011
法人税、住民税及び事業税		5,226
法人税等調整額		739
中間純利益		16,045

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当中間期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
中間純利益							16,045	16,045	16,045
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	7,905	7,905	7,905
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,163	46,455	77,365

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当中間期変動額			
剰余金の配当			23,950
中間純利益			16,045
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	10	10	10
当中間期変動額合計	10	10	7,915
当中間期末残高	0	0	77,366

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。

3 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、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>
4 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
5 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
6 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2020年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	648百万円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

中間損益計算書関係

		自 2020年4月 1日	至 2020年9月30日
1	減価償却実施額		
	有形固定資産	180百万円	
	無形固定資産	1,125百万円	
2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	4,540百万円	
	金銭信託運用益	1,360百万円	
3	営業外費用のうち主要なもの		
	時効後支払損引当金繰入	10百万円	
	為替差損	9百万円	
4	特別利益の内訳		
	投資有価証券等売却益	71百万円	
	株式報酬受入益	26百万円	
	移転補償金	2,130百万円	
5	特別損失の内訳		
	投資有価証券等評価損	36百万円	
	固定資産除却損	2百万円	
	事務所移転費用	406百万円	

中間株主資本等変動計算書関係

		自 2020年4月 1日	至 2020年9月30日										
1	発行済株式に関する事項												
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>当事業年度期首</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当中間会計期間末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式</td> <td>5,150,693株</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,150,693株</td> </tr> </tbody> </table>	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株		
株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末									
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株									
2	配当に関する事項												
	配当金支払額 2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。 ・普通株式の配当に関する事項												
	(1) 配当金の総額	23,950百万円											
	(2) 1株当たり配当額	4,650円											
	(3) 基準日	2020年3月31日											
	(4) 効力発生日	2020年6月30日											

金融商品関係

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりで

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)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,307	2,307	-
(2)金銭の信託	40,828	40,828	-
(3)未収委託者報酬	24,249	24,249	-
(4)未収運用受託報酬	4,560	4,560	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	10,500	10,500	-
資産計	82,445	82,445	-
(6)未払金	11,513	11,513	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	0	0	-
未払手数料	6,651	6,651	-
関係会社未払金	4,007	4,007	-
その他未払金	853	853	-
(7)未払費用	9,953	9,953	-
(8)未払法人税等	1,444	1,444	-
負債計	22,911	22,911	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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

 その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,701百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、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」には含めておりません。なお、当中間会計期間において、非上場株式について35百万円（投資有価証券35百万円）減損処理を行っております。

有価証券関係

当中間会計期間末（2020年9月30日）

1．満期保有目的の債券(2020年9月30日)

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式(2020年9月30日)

該当事項はありません。

3．その他有価証券(2020年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	10,500	10,500	-
小計	10,500	10,500	-
合計	10,500	10,500	-

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減（単位：百万円）

	自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
期首残高	-
有形固定資産の取得に伴う増加 時の経過による調整額	1,371
中間期末残高	1,371

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

1 株当たり情報

		自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
1 株当たり純資産額		15,020円52銭
1 株当たり中間純利益		3,115円15銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
	中間純利益	16,045百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	16,045百万円
	期中平均株式数	5,150千株

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

< 更新後 >

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	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(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2021年1月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	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。

* 2021年1月末現在

独立監査人の監査報告書

2021年3月12日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 亀井純子
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」に掲げられている野村RAFI(R)日本株投信の2020年7月14日から2021年1月13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、野村RAFI(R)日本株投信の2021年1月13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、野村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

野村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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中**EY新日本有限責任監査法人**

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井純子
--------------------	-------	------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	櫻井雄一郎
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村健二郎
--------------------	-------	-------

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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61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、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月25日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村健二郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水永真太郎

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査等委員会の責任

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

断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。