

## 目論見書補完書面

この書面は、金融商品取引法第37条の3の規定に基づき、お客様が当投資信託（ファンド）をご購入するにあたり、ご理解していただく必要のある重要事項の情報を、あらかじめ提供するものです。お取引にあたっては、この書面及び目論見書の内容をよくお読みいただき、ご不明な点は、お取引開始前にご確認ください。

※この書面は、投資信託説明書（目論見書）の一部ではなく、マネックス証券の責任の下で作成しているものです。

### 手数料等の諸経費について

- ・当ファンドの手数料など諸経費の詳細は目論見書をご覧ください。
- ・お客様にご負担いただくお申込手数料、信託報酬など諸経費の種類ごとの金額及びその合計額等については、実際のお申込み金額、保有期間等に応じて異なる場合があります。

当社における申込手数料は、購入金額（購入口数×1口あたりの購入価額）に、ファンドごとの申込手数料率を乗じて計算します。

＜口数指定でご購入する場合（例）＞

申込手数料率3.0%（税抜）のファンドを購入価額10,000円（1万口あたり）で100万口ご購入いただく場合は、

申込手数料（税抜）＝100万口×10,000円÷10,000口×3.0%＝30,000円となり、合計1,030,000円（税抜）お支払いいただくことになります。

＜金額指定でご購入する場合（例）＞

100万円の金額指定でご購入いただく場合、お支払いいただく100万円の中から申込手数料（税込）をいただきますので、100万円全額がファンドの購入金額となるものではありません。

### クーリング・オフの適用について

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定の適用はなく、クーリング・オフの対象とはなりませんので、ご注意ください。

## 1. 当ファンドに係る金融商品取引契約の概要

当社は、ファンドの販売会社として、募集の取扱い及び販売等に関する事務を行います。

## 2. 当社が行う金融商品取引業の内容及び方法の概要

当社が行う金融商品取引業は、主に金融商品取引法第 28 条第 1 項の規定に基づく第一種金融商品取引業であり、当社においてファンドのお取引や保護預けを行われる場合は、以下によります。

- ・お取引にあたっては、保護預り口座、振替決済口座又は外国証券取引口座の開設が必要となります。
- ・お取引のご注文をいただいたときは、原則として、あらかじめ当該ご注文に係る代金又は有価証券の全部（前受金等）をお預けいただいた上で、ご注文をお受けいたします。
- ・ご注文いただいたお取引が成立した場合（法令に定める場合を除きます。）には、契約締結時交付書面（取引報告書）をお客様にお渡しいたします（郵送又は電磁的方法による場合を含みます）。万一、記載内容が相違しているときは、速やかに当社お問合せ窓口へ直接ご連絡ください。

## 3. 当社の概要

- ・ 商号等                   : マネックス証券株式会社  
                              金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 165 号
- ・ 本店所在地           : 〒107-6025 東京都港区赤坂一丁目 12 番 32 号
- ・ 設立                   : 1999 年 5 月
- ・ 資本金                : 12,200 百万円
- ・ 主な事業             : 金融商品取引業
- ・ 加入協会             : 日本証券業協会、一般社団法人 金融先物取引業協会、  
                              一般社団法人 日本投資顧問業協会
- ・ 指定紛争             : 特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター  
  解決機関
- ・ 連絡先                : ご不明な点がございましたら、下記までお問合せください。  
                              お客様ダイヤル           : 0120-846-365（通話料無料）  
  03-6737-1666（携帯電話・PHS・一部 IP 電話）  
  ログイン ID と暗証番号をご用意ください。  
                              当社ウェブサイト       : ログイン後の「ヘルプ・お問合せ」の入力  
  フォームからお問合せいただけます。

以 上  
(平成 29 年 2 月)  
KTM\_TOUSHIN\_1.2

当資料は全ての投資信託の「目論見書補完書面」「投資信託説明書（交付目論見書）」に添付しているものです  
申込手数料や解約手数料がかからない投資信託につきましては、以下の説明は該当しません。

## 申込手数料に関するご説明

■ 投資信託の申込手数料は購入時に負担いただくものですが、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率はしだいに減っていきます。

例えば、申込手数料が3%（税抜き）の場合

【保有期間】                      【1年あたりのご負担率（税抜き）】



※投資信託によっては、申込手数料をいただくず、解約時に保有期間に応じた解約手数料をお支払いいただく場合があります。その場合も、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率はしだいに減っていきます。

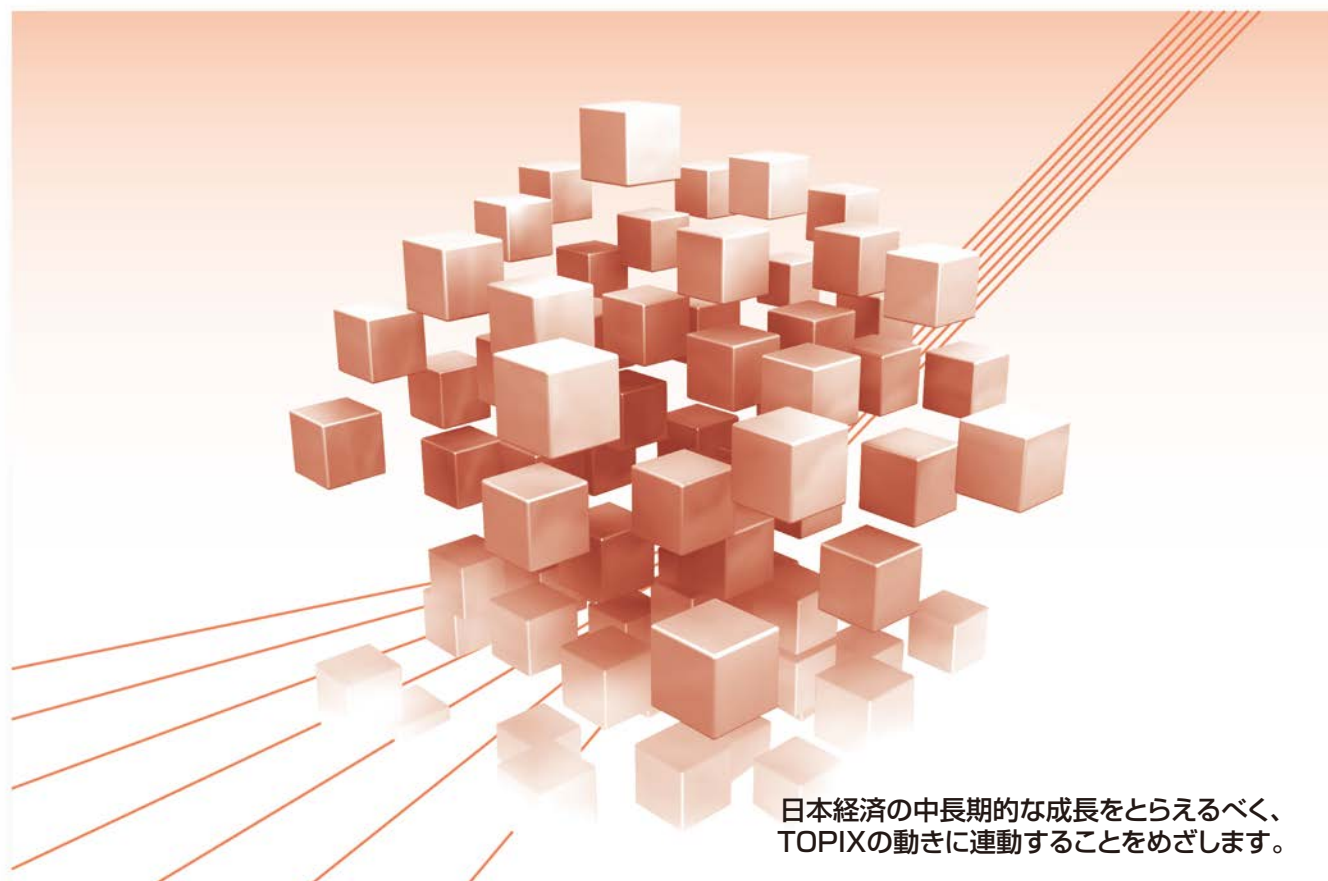
※上記の図の手数料率や保有期間は例示です。実際にお買付いただく投資信託の手数料率や残存期間については、当社ウェブサイトや「投資信託説明書（交付目論見書）」にてご確認ください。

※投資信託をご購入いただいた場合には、上記の申込手数料のほか、信託報酬やその他費用等をご負担いただきます。また、投資信託の種類に応じて、信託財産留保額等をご負担いただく場合があります。実際の手数料率等の詳細は、当社ウェブサイトや「投資信託説明書（交付目論見書）」にてご確認ください。

（2017年10月）

# インデックスファンドTSP

追加型投信／国内／株式／インデックス型



日本経済の中長期的な成長をとらえるべく、  
TOPIXの動きに連動することをめざします。

- 本書は金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みいただき、ご自身でご判断ください。
  - ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。また、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
  - 本書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載しています。
  - ファンドの基準価額、販売会社などについては、以下の委託会社の照会先にお問い合わせください。
- <委託会社>[ファンドの運用の指図を行なう者]  
日興アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第368号  
ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)  
コールセンター 電話番号 0120-25-1404 (午前9時～午後5時。土、日、祝・休日は除きます。)
- <受託会社>[ファンドの財産の保管および管理を行なう者]  
三井住友信託銀行株式会社

設定・運用は

**日興アセットマネジメント**

- ファンドの内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に投資者(受益者)の意向を確認いたします。
- ファンドの財産は、信託法(平成18年法律第108号)に基づき受託会社において分別管理されています。
- この目論見書により行なう「インデックスファンドTSP」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2021年5月12日に関東財務局長に提出しており、2021年5月13日にその効力が発生しております。

商品分類				属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象 インデックス
追加型	国内	株式	インデックス型	その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	年1回	日本	ファミリー ファンド	TOPIX

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

#### <委託会社の情報>

委託会社名	日興アセットマネジメント株式会社
設立年月日	1959年12月1日
資本金	173億6,304万円
運用する投資信託財産の 合計純資産総額	25兆370億円
	(2021年2月末現在)

# ファンドの目的・特色

## ファンドの目的

わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

### 1 TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

- ・主として、「インデックス マザーファンド TOPIX」への投資を通じて、東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行ない、日本株式市場全体の動きをとらえ、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・中長期にわたって保有することで、日本経済の成長を享受することが期待できます。

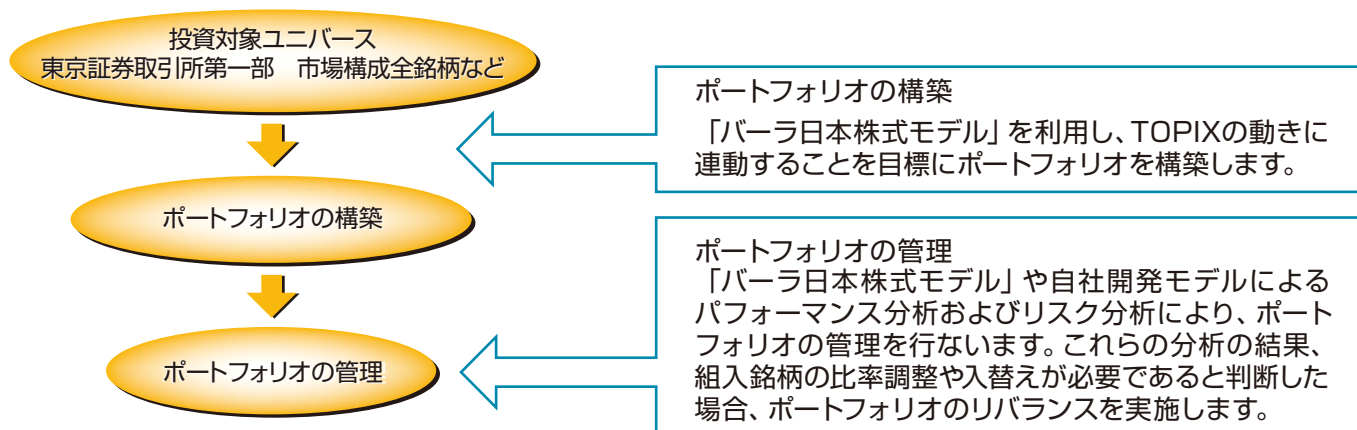
TOPIX(東証株価指数)とは

- ・東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄(算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。)の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
- ・TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

### 2 株式の実質組入比率は高位を保ちます。

株式組入比率(マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。)は、原則として高位を維持します。したがって、基準価額は大きく変動することがあります。

#### <「インデックス マザーファンド TOPIX」の運用プロセス>



※上記は、2021年2月末現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

なお、当ファンドの基準価額とTOPIX(東証株価指数)の動きのカイ離は、主として株式の配当金、信託報酬の費用負担、組入銘柄の選定に伴う影響などにより生じます。

#### バーラ日本株式モデル

日本株式への投資から期待される収益(必然的にリスクを伴います。)の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指標、③業種指標、④ポートフォリオ(または個別銘柄)固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し、数値化します。これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適のポートフォリオを求めます。

#### ファンドの仕組み

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



(主な投資制限) ・株式への実質投資割合には制限を設けません。  
・外貨建資産への投資は行ないません。

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



## 投資リスク

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

### 基準価額の変動要因

投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

主なリスクは以下の通りです。

### 価格変動リスク

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

### 流動性リスク

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

### 信用リスク

投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

### <TOPIX(東証株価指数)と基準価額の主な乖離要因>

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

・TOPIX(東証株価指数)の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとTOPIX(東証株価指数)の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

※ 基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### その他の留意点

○当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

○当ファンドは、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。

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

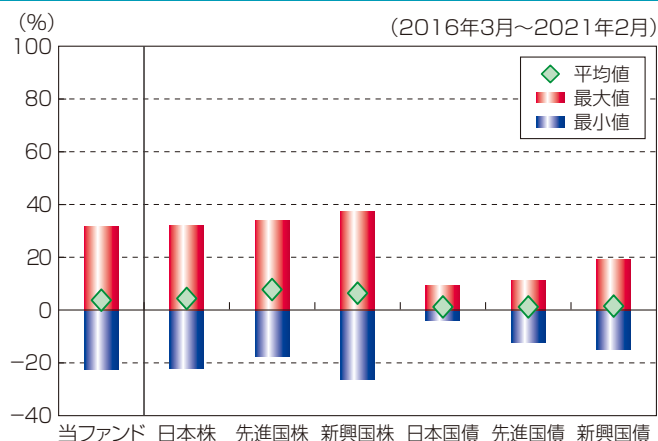
### リスクの管理体制

○運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令などの遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当しています。

○上記部門はリスク管理/コンプライアンス関連の委員会へ報告/提案を行なうと共に、必要に応じて運用部門に改善案策定の指示などを行ない、適切な運用体制を維持できるように努めています。

## (参考情報)

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.8%	4.4%	7.8%	6.4%	1.2%	1.2%	1.5%
最大値	31.5%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-22.4%	-22.0%	-17.5%	-26.3%	-4.0%	-12.3%	-15.0%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年3月から2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### <各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

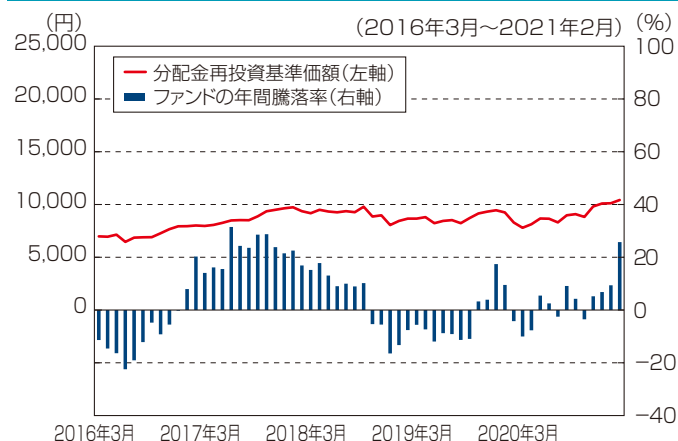
日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

### 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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



## 基準価額・純資産の推移



基準価額..... 9,684円

純資産総額..... 217.08億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2011年2月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	設定来累計
100円	120円	120円	140円	180円	4,740円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
株式	100.1%
うち先物	1.5%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	1.4%
外貨建資産	0.0%

※当ファンドの実質組入比率です。

## &lt;株式組入上位5業種&gt;

	業種	比率
1	電気機器	17.7%
2	情報・通信業	9.6%
3	化学	7.3%
4	輸送用機器	7.0%
5	サービス業	5.8%

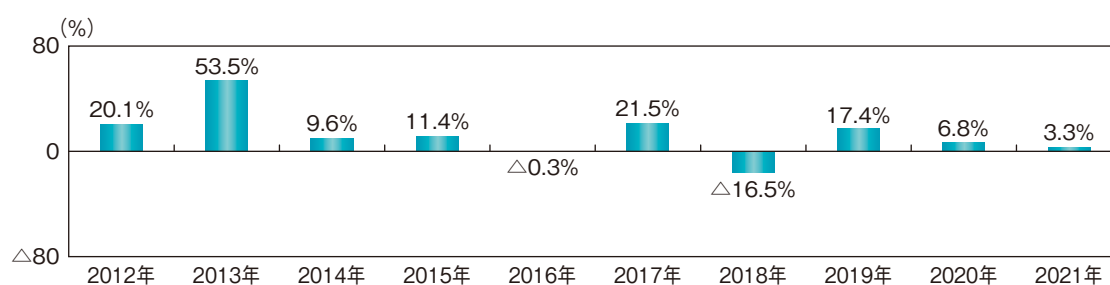
※マザーファンドの対組入株式時価総額比です。

## &lt;株式組入上位10銘柄&gt; (銘柄数:2,138銘柄)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.11%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.01%
3	ソニー	電気機器	2.72%
4	キーエンス	電気機器	1.94%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.47%
6	任天堂	その他製品	1.45%
7	リクルートホールディングス	サービス業	1.41%
8	日本電産	電気機器	1.27%
9	日本電信電話	情報・通信業	1.24%
10	信越化学工業	化学	1.22%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※2021年は、2021年2月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位 ※販売会社の照会先にお問い合わせください。
購入価額	購入申込受付日の基準価額
購入代金	販売会社が指定する日までにお支払いください。
換金単位	1口単位 ※販売会社によって異なる場合があります。
換金価額	換金申込受付日の基準価額
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として、販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
購入の申込期間	2021年5月13日から2021年11月12日までとします。 ※上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。
換金制限	ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入および換金の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた購入および換金の申込みの受付を取り消すことができます。
信託期間	無期限(1986年2月13日設定)
繰上償還	次のいずれかの場合等には、繰上償還することがあります。 ・ファンドの受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき ・対象インデックスが改廃の場合 ・やむを得ない事情が発生したとき
決算日	毎年2月12日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1回、分配方針に基づいて分配を行ないます。 ※販売会社との契約によっては再投資が可能です。
信託金の限度額	1兆円
公告	日本経済新聞に掲載します。
運用報告書	毎期決算後および償還後に交付運用報告書は作成され、知れている受益者に対して交付されます。
課税関係	課税上は、株式投資信託として取り扱われます。 ・公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 ・配当控除の適用があります。 ・益金不算入制度は適用されません。

## ファンドの費用・税金

### ファンドの費用

#### 投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	<b>購入時の基準価額に対し2.2%(税抜2%)以内</b> ※購入時手数料は販売会社が定めます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 ※購入時手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。
信託財産留保額	<b>ありません。</b>

#### 投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用 (信託報酬)	<b>ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.572%(税抜0.52%)以内</b> 運用管理費用は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払われます。				
	＜運用管理費用の配分(年率)＞ 上記が税抜0.52%(有価証券届出書提出日現在)の場合				
	販売会社毎の 純資産総額	運用管理費用(信託報酬)=運用期間中の基準価額×信託報酬率			
		合計	委託会社	販売会社	受託会社
		1,000億円以下の部分	0.52%	0.22%	0.20%
	1,000億円超の部分	0.17%		0.25%	
	委託会社	委託した資金の運用の対価			
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価				
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価				
※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。					
その他の費用・手数料	監査費用、組入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息および立替金の利息などがその都度、信託財産から支払われます。 ※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。 ※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。				

投資者の皆様にご負担いただくファンドの費用などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

### 税金

- ・税金は表に記載の時期に適用されます。
- ・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時 期	項 目	税 金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

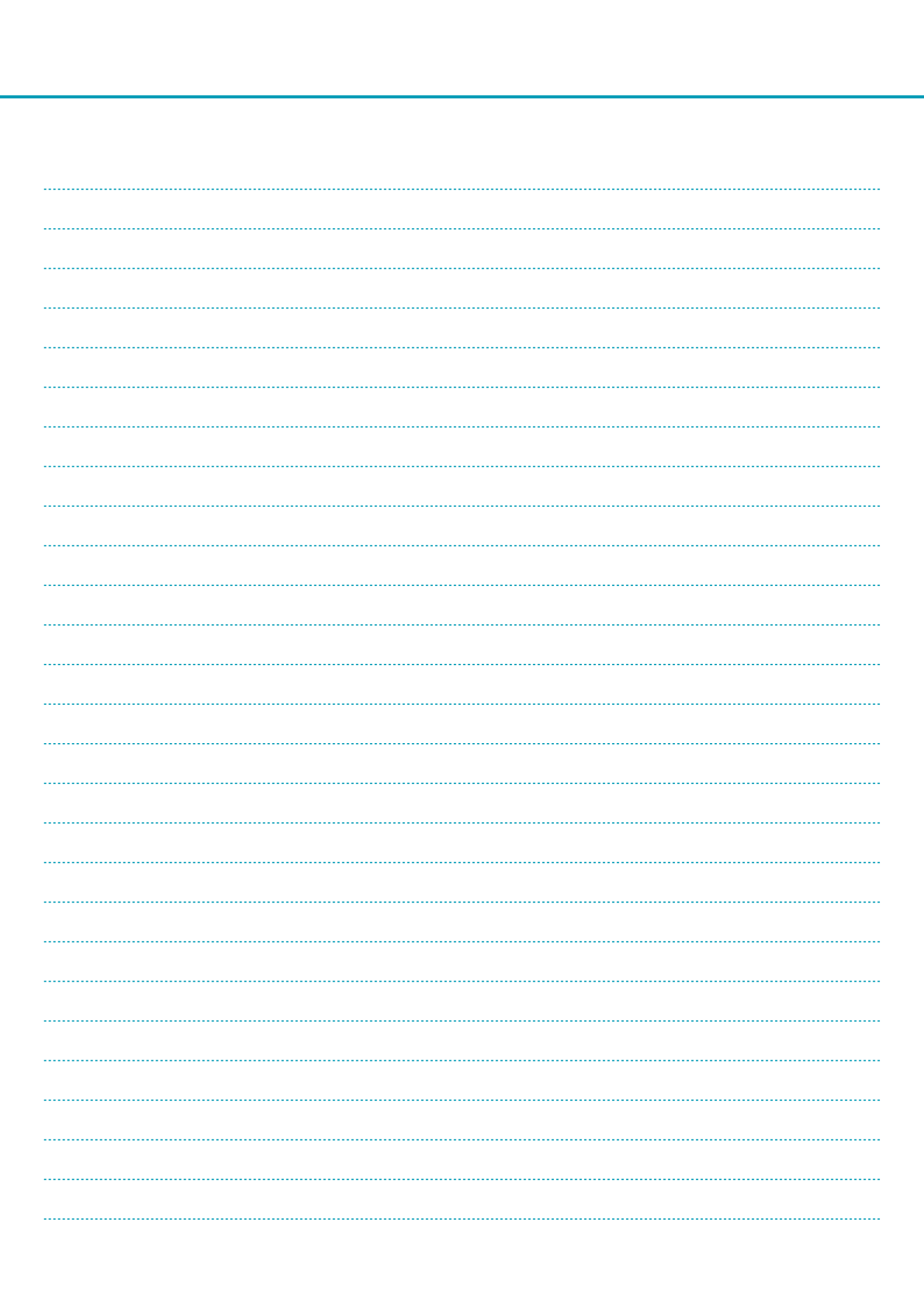
※少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度(ジュニアNISA)をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

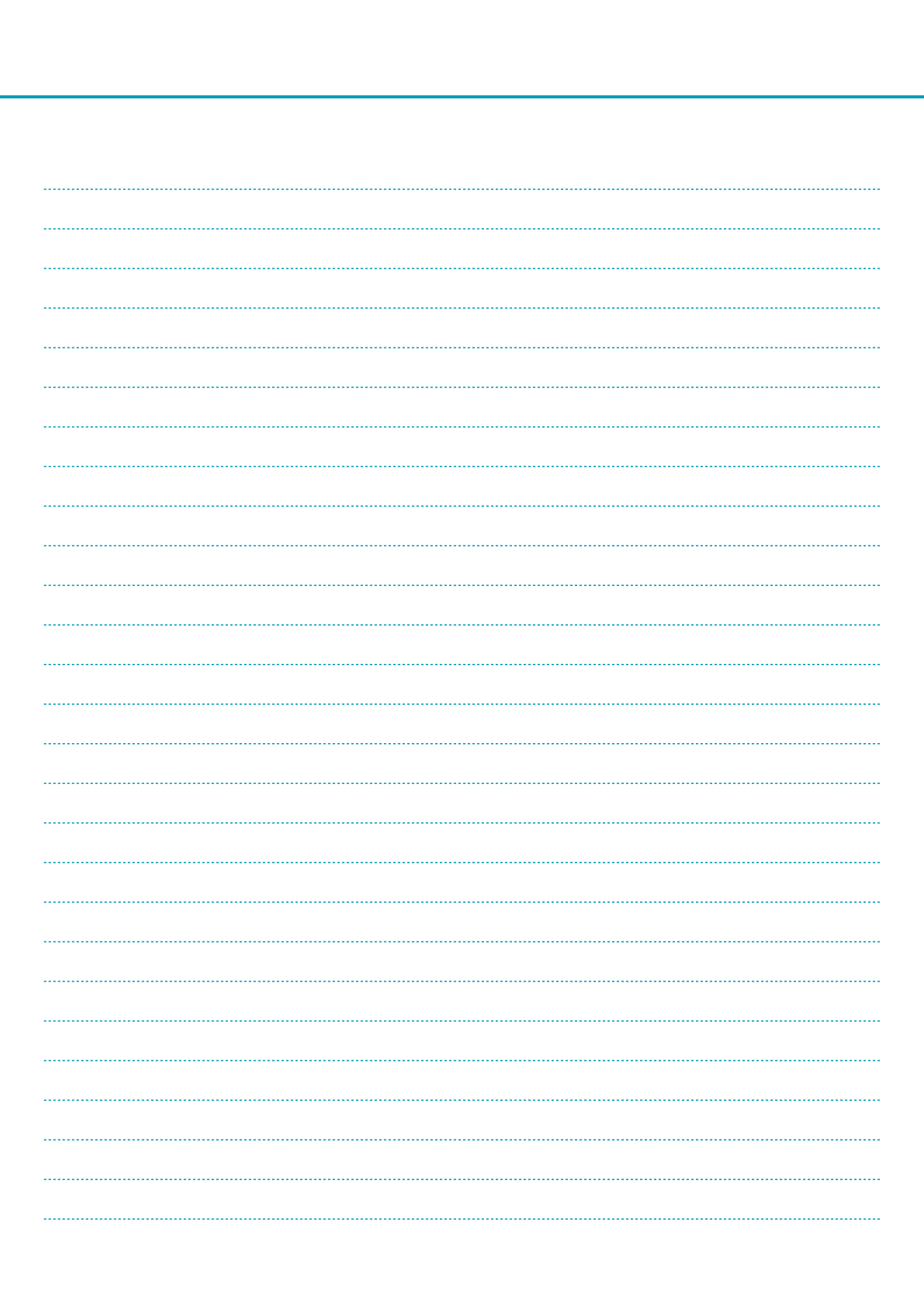
※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※上記は2021年5月12日現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

Lined area for notes, consisting of multiple horizontal dashed lines.









2021. 5. 13

# インデックスファンドTSP

追加型投信／国内／株式／インデックス型

◆この目論見書により行なう「インデックスファンドTSP」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2021年5月12日に関東財務局長に提出しており、2021年5月13日にその効力が発生しております。

有価証券届出書提出日	: 2021年5月12日
発行者名	: 日興アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 代表取締役社長 佐谷戸 淳一
本店の所在の場所	: 東京都港区赤坂九丁目7番1号
有価証券届出書（訂正届出書を含みます。） の写しを縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

設定・運用は

**日興アセットマネジメント**

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。  
また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

## － 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】 .....	1
第二部【ファンド情報】 .....	3
第1【ファンドの状況】 .....	3
第2【管理及び運営】 .....	29
第3【ファンドの経理状況】 .....	34
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】 .....	107
第三部【委託会社等の情報】 .....	108
約款 .....	168

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

インデックスファンドTSP（以下「ファンド」といいます。）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

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

### (5)【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。

### (6)【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

### (7)【申込期間】

2021年5月13日から2021年11月12日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### (8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

### (9)【払込期日】

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ① ファンドの目的

わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

###### ② ファンドの基本的性格

###### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### ◇追加型投信

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

###### ◇国内

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

###### ◇株式

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

###### ◇インデックス型

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



## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX
その他債券	(毎月)	中南米		
クレジット属性 ( )	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
不動産投信	その他 ( )	中近東 (中東)		
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				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### ◇その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

### ◇年1回

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

### ◇日本

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

### ◇ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

### ③ ファンドの特色

## 1 TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

- ・主として、「インデックス マザーファンド TOPIX」への投資を通じて、東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行ない、日本株式市場全体の動きをとらえ、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・中長期にわたって保有することで、日本経済の成長を享受することが期待できます。

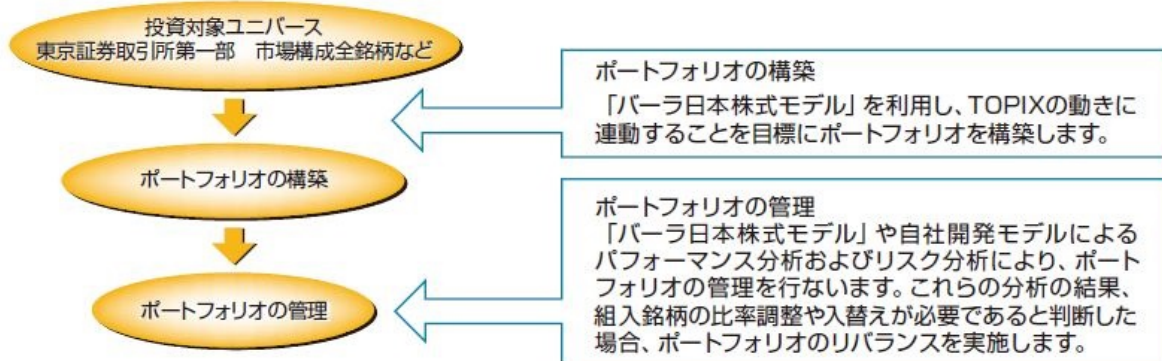
#### TOPIX(東証株価指数)とは

- ・東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄(算出対象除外後の調整ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。)の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
- ・TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

## 2 株式の実質組入比率は高位を保ちます。

株式組入比率(マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。)は、原則として高位を維持します。したがって、基準価額は大きく変動することがあります。

#### <「インデックス マザーファンド TOPIX」の運用プロセス>



※上記は、2021年2月末現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

なお、当ファンドの基準価額とTOPIX(東証株価指数)の動きのカイ離は、主として株式の配当金、信託報酬の費用負担、組入銘柄の選定に伴う影響などにより生じます。

#### バーラ日本株式モデル

日本株式への投資から期待される収益(必然的にリスクを伴います。)の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指標、③業種指標、④ポートフォリオ(または個別銘柄)固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し、数値化します。これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適なポートフォリオを求めます。

#### ファンドの仕組み

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



(主な投資制限) ・株式への実質投資割合には制限を設けません。  
・外貨建資産への投資は行ないません。

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

④ 信託金限度額

- ・ 1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

1986年2月13日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

2001年10月26日

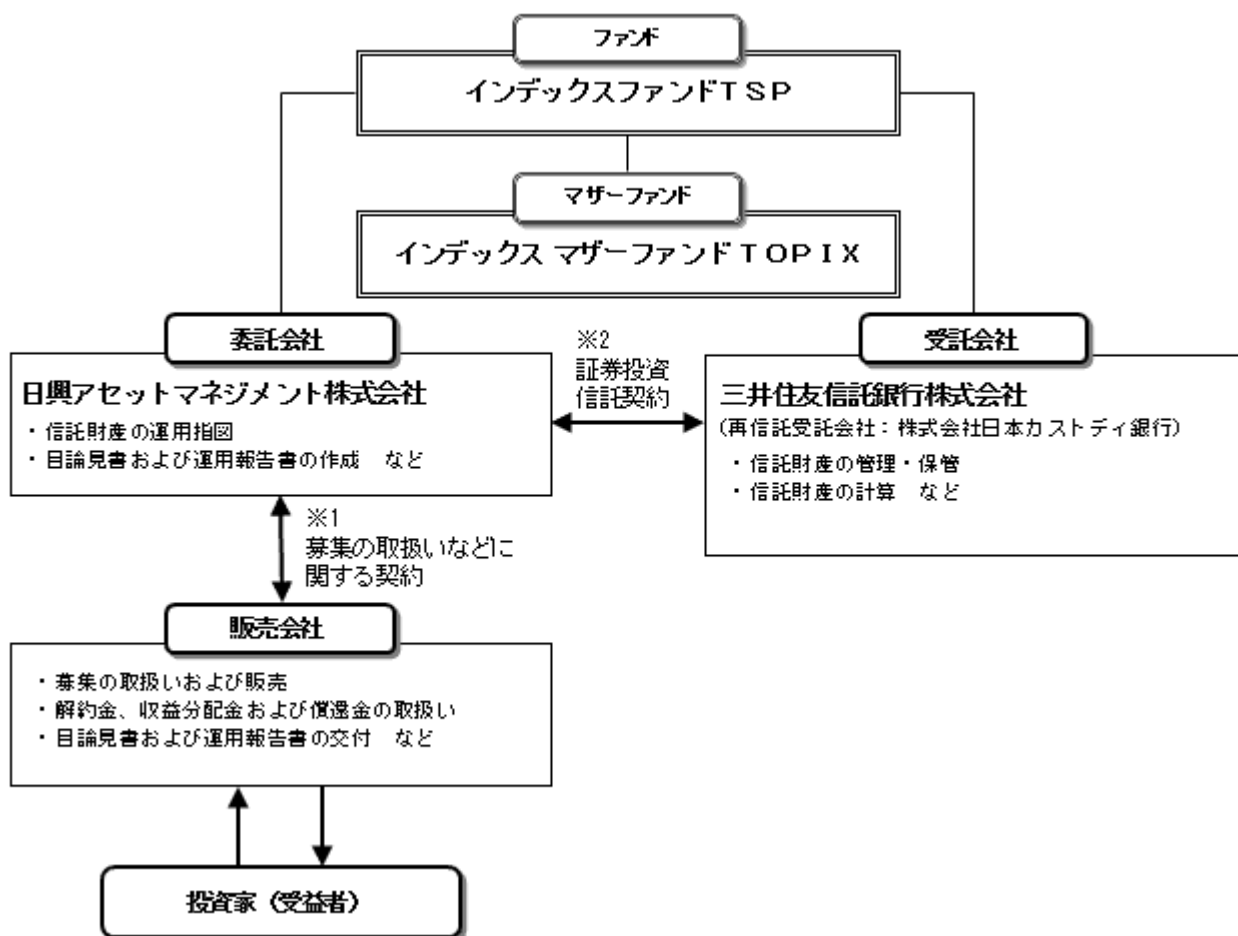
- ・ ファミリーファンド方式の導入

2002年11月13日

- ・ 信託期間を無期限に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況（2021 年 2 月末現在）

1) 資本金

17,363 百万円

2) 沿革

1959 年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999 年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 1 号	194,152,500 株	98.54%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券に投資を行なうとともに、わが国の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざします。
- ・投資成果を T O P I X（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、株式（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）への投資にあたっては、「バレー日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。
  - ①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。
  - ②資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。
  - ③株式の組入比率は、高位を保ちます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の 50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<インデックスファンドTSP>

「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券ならびに東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、約款第 20 条の 2 および第 20 条の 6 に定めるものに限りま。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第 66 条第 1 号に規定する短期社債、同法第 117 条に規定する相互会社の社債、同法第 118 条に規定する特定社債および同法第 120 条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2) の証券の性質を有するもの
- 4) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 5) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。）
- 7) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券

に表示されるべきもの

- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

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

- ④ 次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 資金の借入

<インデックス マザーファンド TOPIX>

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限りします。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 5) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
- 7) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

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

- ④ 次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 有価証券の貸付

◆投資対象とするマザーファンドの概要  
 <インデックス マザーファンド T O P I X>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数）*の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資成果をT O P I X（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。</li> <li>①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。</li> <li>②資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。</li> <li>③株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の 50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の 5 %以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001 年 10 月 26 日設定）
決算日	毎年 2 月 12 日（休業日の場合は翌営業日）

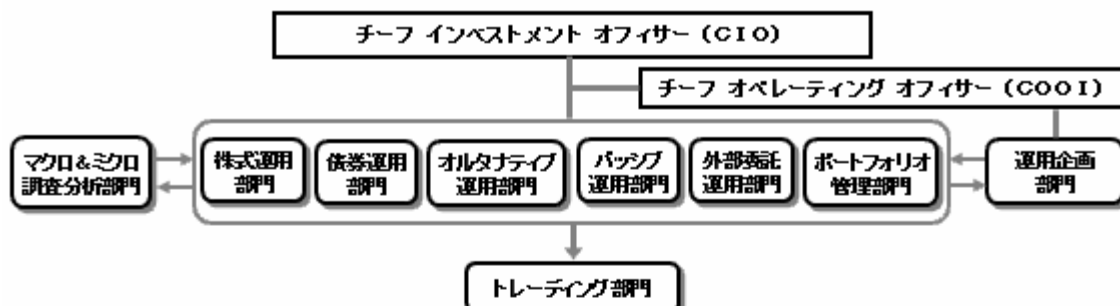
\* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

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

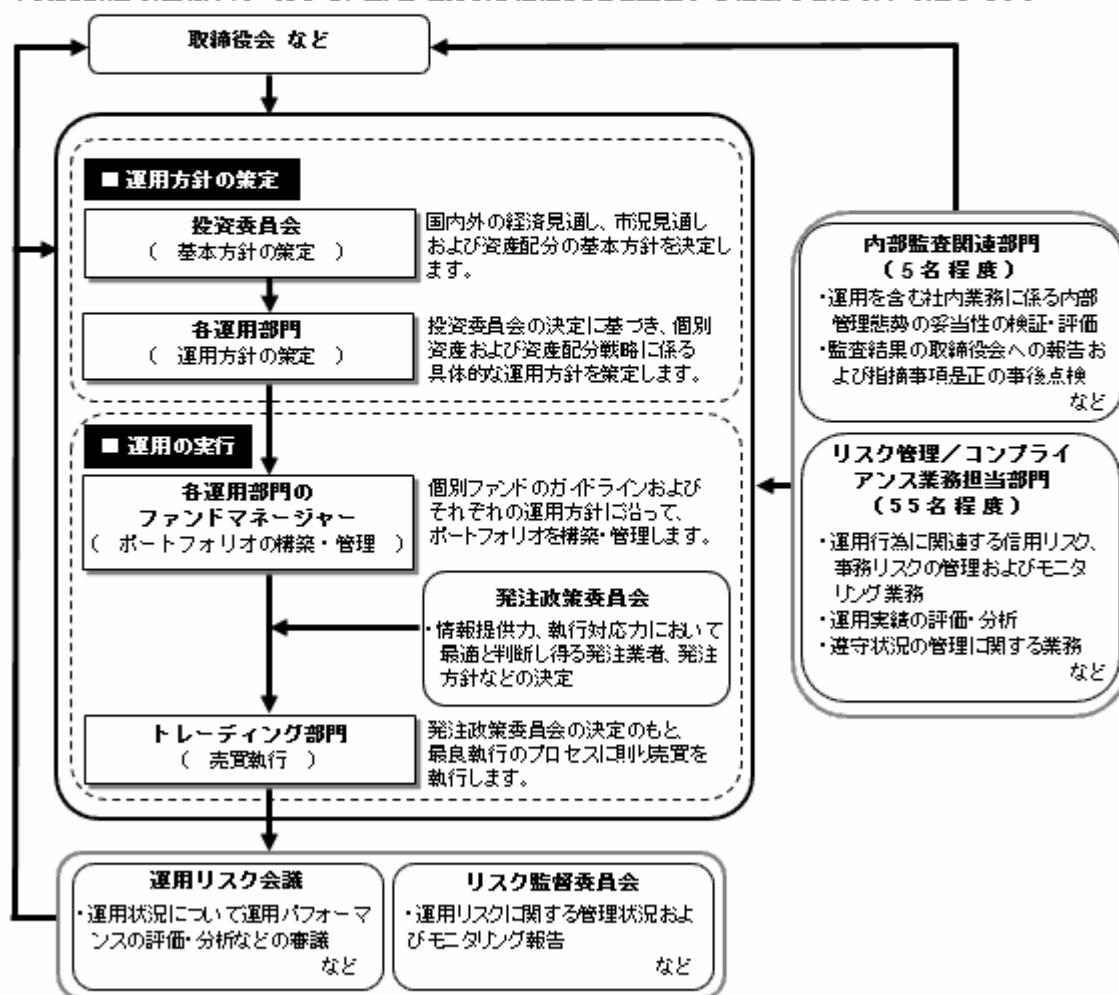


### (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



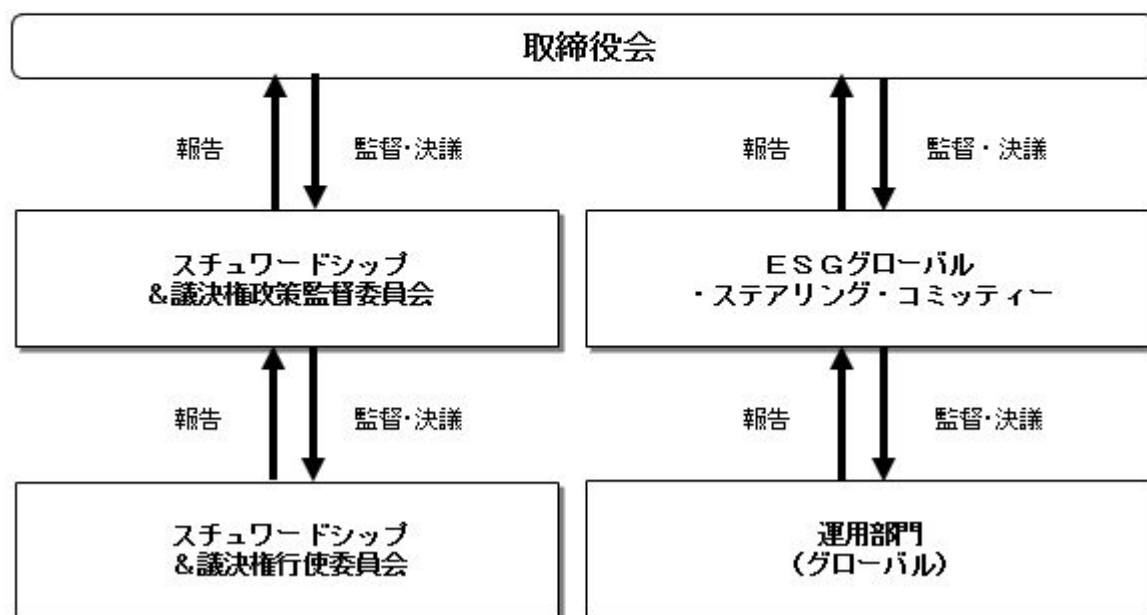
#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

#### ◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

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

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



※上記体制は 2021 年 2 月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### ① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

###### 1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

###### 2) 分配対象額についての分配方針

利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

###### 3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行います。

##### ② 収益分配金の支払い

###### <分配金再投資コース>

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

###### <分配金受取りコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

#### (5) 【投資制限】

##### ① 約款に定める投資制限

###### <インデックスファンドTSP>

###### 1) 株式への実質投資割合には制限を設けません。

###### 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

###### 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

###### 4) 外貨建資産への投資は行ないません。

###### 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ) 株式分割により取得する株券

ハ) 有償増資により取得する株券

ニ) 売り出しにより取得する株券

ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限りま。）の行使により取得可能な株券

ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権ホ)に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

###### 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

###### 7) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第 17 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の 5 %を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5 %を上回らない範囲内とします。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の 50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の 10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 11) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 12) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### <インデックス マザーファンド TOPIX>

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の 5 %以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- ロ) 株式分割により取得する株券
- ハ) 有償増資により取得する株券
- ニ) 売り出しにより取得する株券
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）

ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 7) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第13条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第13条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## ② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

## 3 【投資リスク】

### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### ① 価格変動リスク

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

#### ② 流動性リスク

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

### ③ 信用リスク

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

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

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

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

#### < その他の留意事項 >

##### ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

##### ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

##### ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

##### ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

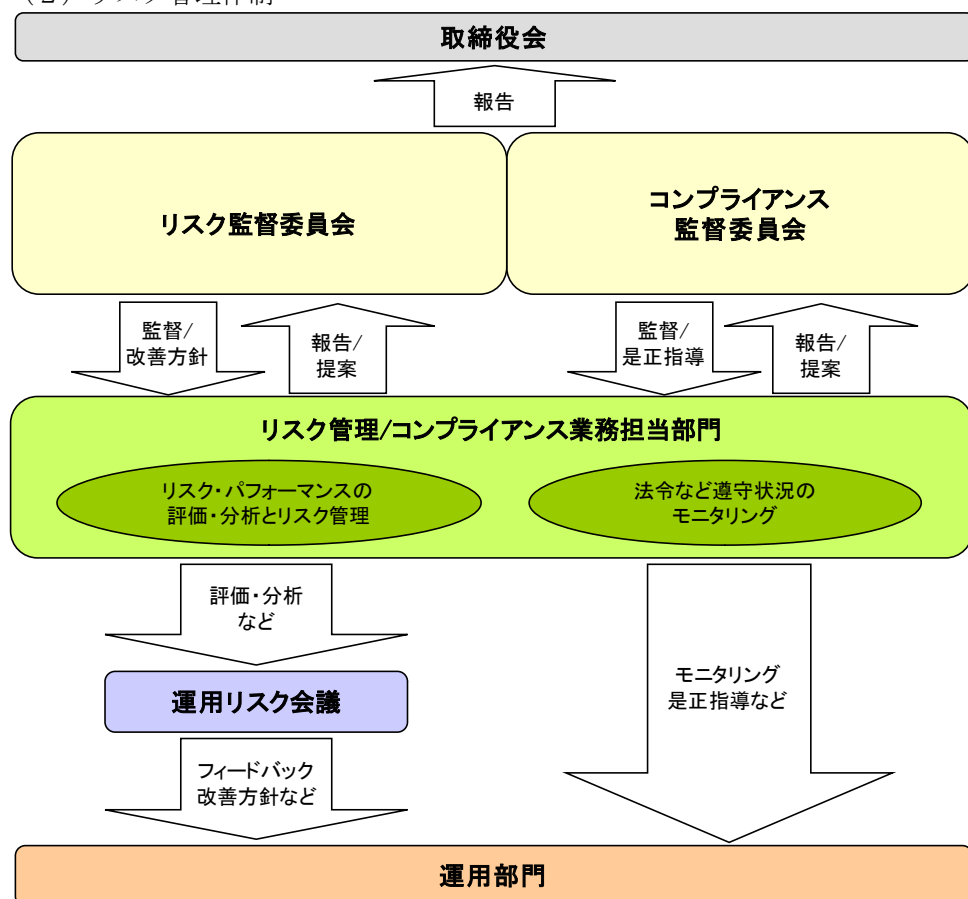
##### ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

##### ・法令・税制・会計方針などの変更にに関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### ■全社的リスク管理

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

### ■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### ■法令など遵守状況のモニタリング

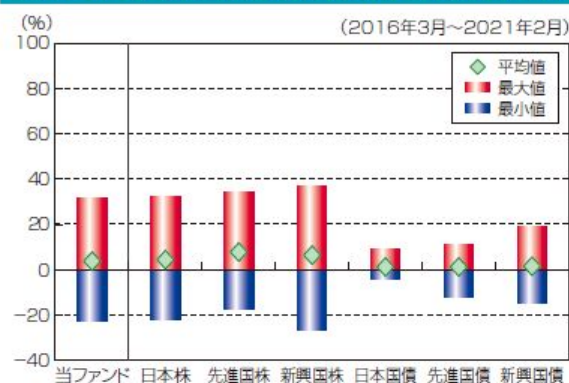
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

※上記体制は2021年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## (参考情報)

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.8%	4.4%	7.8%	6.4%	1.2%	1.2%	1.5%
最大値	31.5%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-22.4%	-22.0%	-17.5%	-26.3%	-4.0%	-12.3%	-15.0%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年3月から2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

#### <各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

### 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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



## ○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

### 東証株価指数（TOPIX、配当込）

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### MSCI-KOKUSAI インデックス（配当込、円ベース）

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

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

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

### NOMURA-BPI 国債

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

### FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

##### (2)【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料  
ありません。
- ② 信託財産留保額  
ありません。

##### (3)【信託報酬等】

- ① 信託報酬  
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.572%（税抜0.52%）以内の率を乗じて得た額とします。
- ② 信託報酬の配分  
信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

販売会社毎の純資産総額	信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
	合 計	委託会社	販売会社	受託会社
1,000 億円以下の部分	0.52%	0.22%	0.20%	0.10%
1,000 億円超の部分		0.17%	0.25%	

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

- ③ 支払時期  
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

##### (4)【その他の手数料等】

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

- ① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
- ③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞

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

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

##### ① 個人受益者の場合

###### 1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

###### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間 120 万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が 5 年間非課税となります。ご利用になれるのは、満 20 歳以上の方で、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。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニア NISA）をご利用の場合、20 歳未満の居住者などを対象に、年間 80 万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が 5 年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### ② 法人受益者の場合

###### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

###### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

##### ③ 個別元本

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

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

##### ④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

###### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

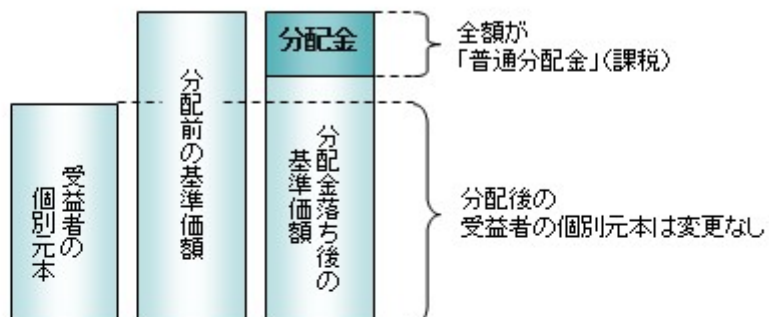
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の 1 口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、

当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

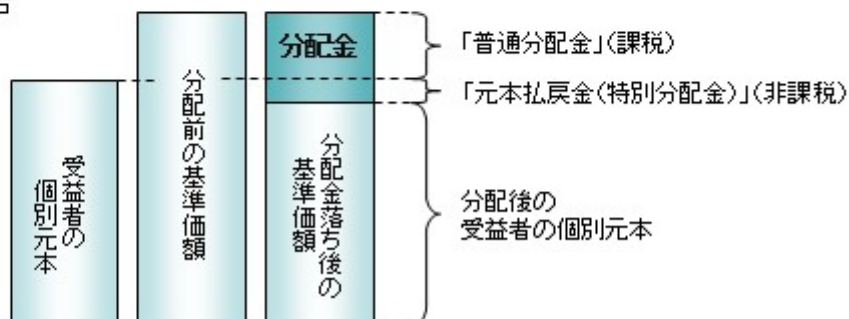
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

※上記は 2021 年 5 月 12 日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【インデックスファンドTSP】

以下の運用状況は2021年2月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,462,634,119	98.87
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	246,057,820	1.13
合計（純資産総額）		21,708,691,939	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	262,570,000	1.21

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

#### (2)【投資資産】

#### ①【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	8,904,548,861	2.4991	22,253,945,192	2.4103	21,462,634,119	98.87

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.87
合 計	98.87

#### ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### ③【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2021年03月	買建	14	日本円	268,741,100	262,570,000	1.21

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

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第26計算期間末（2012年2月13日）	20,778	21,089	0.4011	0.4071
第27計算期間末（2013年2月12日）	25,203	25,608	0.4980	0.5060
第28計算期間末（2014年2月12日）	26,006	26,338	0.6275	0.6355
第29計算期間末（2015年2月12日）	27,404	27,771	0.7464	0.7564
第30計算期間末（2016年2月12日）	20,550	20,885	0.6143	0.6243
第31計算期間末（2017年2月13日）	24,644	24,951	0.8013	0.8113
第32計算期間末（2018年2月13日）	23,554	23,873	0.8864	0.8984
第33計算期間末（2019年2月12日）	21,725	22,046	0.8132	0.8252
第34計算期間末（2020年2月12日）	21,993	22,338	0.8920	0.9060
第35計算期間末（2021年2月12日）	22,391	22,792	1.0041	1.0221
2020年2月末日	19,517	—	0.7840	—
3月末日	18,439	—	0.7367	—
4月末日	19,179	—	0.7682	—
5月末日	20,385	—	0.8201	—
6月末日	20,225	—	0.8184	—
7月末日	19,297	—	0.7850	—
8月末日	20,684	—	0.8487	—
9月末日	20,873	—	0.8594	—
10月末日	20,118	—	0.8346	—
11月末日	21,546	—	0.9274	—
12月末日	21,867	—	0.9545	—
2021年1月末日	21,453	—	0.9562	—
2月末日	21,708	—	0.9684	—

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第26期	2011年2月15日～2012年2月13日	0.0060
第27期	2012年2月14日～2013年2月12日	0.0080
第28期	2013年2月13日～2014年2月12日	0.0080
第29期	2014年2月13日～2015年2月12日	0.0100
第30期	2015年2月13日～2016年2月12日	0.0100
第31期	2016年2月13日～2017年2月13日	0.0100

第 32 期	2017 年 2 月 14 日～2018 年 2 月 13 日	0.0120
第 33 期	2018 年 2 月 14 日～2019 年 2 月 12 日	0.0120
第 34 期	2019 年 2 月 13 日～2020 年 2 月 12 日	0.0140
第 35 期	2020 年 2 月 13 日～2021 年 2 月 12 日	0.0180

### ③【収益率の推移】

期	期間	収益率 (%)
第 26 期	2011 年 2 月 15 日～2012 年 2 月 13 日	△17.07
第 27 期	2012 年 2 月 14 日～2013 年 2 月 12 日	26.15
第 28 期	2013 年 2 月 13 日～2014 年 2 月 12 日	27.61
第 29 期	2014 年 2 月 13 日～2015 年 2 月 12 日	20.54
第 30 期	2015 年 2 月 13 日～2016 年 2 月 12 日	△16.36
第 31 期	2016 年 2 月 13 日～2017 年 2 月 13 日	32.07
第 32 期	2017 年 2 月 14 日～2018 年 2 月 13 日	12.12
第 33 期	2018 年 2 月 14 日～2019 年 2 月 12 日	△6.90
第 34 期	2019 年 2 月 13 日～2020 年 2 月 12 日	11.41
第 35 期	2020 年 2 月 13 日～2021 年 2 月 12 日	14.59

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に 100 を乗じた数です。

### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第 26 期	2011 年 2 月 15 日～2012 年 2 月 13 日	8,796,604,597	7,398,051,340
第 27 期	2012 年 2 月 14 日～2013 年 2 月 12 日	9,449,720,873	10,636,174,809
第 28 期	2013 年 2 月 13 日～2014 年 2 月 12 日	13,799,258,867	22,968,753,955
第 29 期	2014 年 2 月 13 日～2015 年 2 月 12 日	6,408,687,971	11,137,684,985
第 30 期	2015 年 2 月 13 日～2016 年 2 月 12 日	6,211,940,096	9,472,751,226
第 31 期	2016 年 2 月 13 日～2017 年 2 月 13 日	3,331,269,772	6,027,353,049
第 32 期	2017 年 2 月 14 日～2018 年 2 月 13 日	6,031,038,498	10,213,544,441
第 33 期	2018 年 2 月 14 日～2019 年 2 月 12 日	3,915,213,807	3,773,318,387
第 34 期	2019 年 2 月 13 日～2020 年 2 月 12 日	2,511,981,095	4,570,922,254
第 35 期	2020 年 2 月 13 日～2021 年 2 月 12 日	2,282,429,644	4,640,604,376

(参考)

## インデックス マザーファンド T O P I X

以下の運用状況は 2021 年 2 月 26 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	41,413,425,450	99.74
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	108,525,412	0.26
合計 (純資産総額)		41,521,950,862	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	112,530,000	0.27

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	164,100	8,413.00	1,380,573,300	7,873.00	1,291,959,300	3.11
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	126,100	9,797.00	1,235,401,700	9,895.00	1,247,759,500	3.01
日本	株式	ソニー	電気機器	101,500	11,845.00	1,202,267,500	11,120.00	1,128,680,000	2.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	57,690.00	917,271,000	50,560.00	803,904,000	1.94
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,092,700	528.60	577,601,220	558.00	609,726,600	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	9,300	66,340.00	616,962,000	64,750.00	602,175,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	110,800	5,128.00	568,182,400	5,281.00	585,134,800	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	39,000	14,800.00	577,200,000	13,520.00	527,280,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	186,000	2,805.50	521,823,000	2,758.00	512,988,000	1.24
日本	株式	信越化学工業	化学	29,300	18,285.00	535,750,500	17,350.00	508,355,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	134,800	3,688.00	497,142,400	3,582.00	482,853,600	1.16
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,600	9,752.00	464,195,200	9,081.00	432,255,600	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,600	23,040.00	474,624,000	20,720.00	426,832,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	127,600	3,315.00	422,994,000	3,290.00	419,804,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	139,000	3,251.00	451,889,000	3,010.00	418,390,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,500	42,990.00	408,405,000	43,550.00	413,725,000	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	110,500	3,601.00	397,910,500	3,742.00	413,491,000	1.00



日本	株式	HOYA	精密機器	32,100	13,060.00	419,226,000	12,100.00	388,410,000	0.94
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,900	4,892.00	381,086,800	4,876.00	379,840,400	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	14,200	28,050.00	398,310,000	26,340.00	374,028,000	0.90
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	127,500	3,019.00	384,922,500	2,911.50	371,216,250	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	111,400	3,117.00	347,233,800	3,168.00	352,915,200	0.85
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	217,000	1,530.00	332,010,000	1,559.00	338,303,000	0.81
日本	株式	SMC	機械	4,800	66,440.00	318,912,000	62,900.00	301,920,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	129,400	2,009.00	259,964,600	2,263.50	292,896,900	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,400	17,735.00	290,854,000	17,840.00	292,576,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	97,000	2,853.00	276,741,000	3,003.00	291,291,000	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	53,000	5,534.00	293,302,000	5,253.00	278,409,000	0.67
日本	株式	花王	化学	38,800	7,486.00	290,456,800	7,144.00	277,187,200	0.67
日本	株式	資生堂	化学	32,200	7,995.00	257,439,000	7,913.00	254,798,600	0.61

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.28
		食料品	3.32
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.28
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.79
		鉄鋼	0.69
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.63
		機械	5.57
		電気機器	17.61
		輸送用機器	6.97
		精密機器	2.55
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	3.62
		海運業	0.21
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.58
		卸売業	4.69

		小売業	4. 71
		銀行業	5. 04
		証券、商品先物取引業	0. 82
		保険業	1. 89
		その他金融業	1. 09
		不動産業	1. 99
		サービス業	5. 74
		合　　計	

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2021年03月	買建	6	日本円	115,680,000	112,530,000	0.27

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

## 運用実績

2021年2月26日現在

### 基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,684円

純資産総額……………217.08億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2011年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

### 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	設定来累計
100円	120円	120円	140円	180円	4,740円

### 主要な資産の状況

#### <資産構成比率>

組入資産	比率
株式	100.1%
うち先物	1.5%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	1.4%
外貨建資産	0.0%

※当ファンドの実質組入比率です。

#### <株式組入上位5業種>

	業種	比率
1	電気機器	17.7%
2	情報・通信業	9.6%
3	化学	7.3%
4	輸送用機器	7.0%
5	サービス業	5.8%

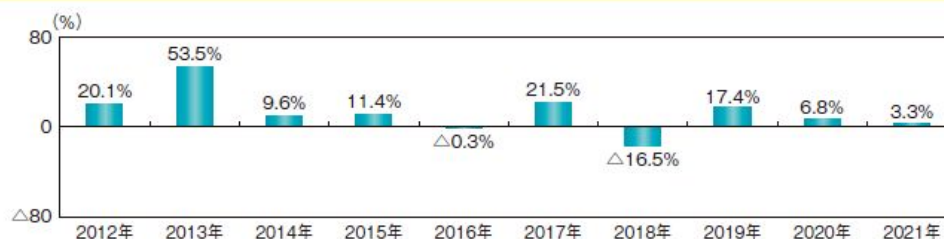
※マザーファンドの対組入株式時価総額比です。

#### <株式組入上位10銘柄> (銘柄数:2,138銘柄)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.11%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.01%
3	ソニー	電気機器	2.72%
4	キーエンス	電気機器	1.94%
5	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.47%
6	任天堂	その他製品	1.45%
7	リクルートホールディングス	サービス業	1.41%
8	日本電産	電気機器	1.27%
9	日本電信電話	情報・通信業	1.24%
10	信越化学工業	化学	1.22%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

### 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※2021年は、2021年2月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込方法  
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択  
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。  
＜分配金再投資コース＞  
収益分配金を自動的に再投資するコースです。  
＜分配金受取りコース＞  
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の扱いとなります。
- (5) 申込金額  
取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (6) 申込単位  
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (7) 申込代金の支払い  
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (8) 受付の中止および取消  
委託会社は、金融商品取引所<sup>※</sup>における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。  
※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。
- (9) 償還乗換
  - ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができます場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
  - ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (10) 乗換優遇  
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 2【換金（解約）手続等】

#### ＜解約請求による換金＞

- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の扱いとなります。
- (3) 解約制限  
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約価額  
解約請求受付日の基準価額とします。

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

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。  
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。  
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

＜買取請求による換金＞

(1) 買取りの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 買取制限

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

(4) 買取価額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(6) 買取単位

1口単位

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

(7) 受付の中止および取消

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

3 【資産管理等の概要】

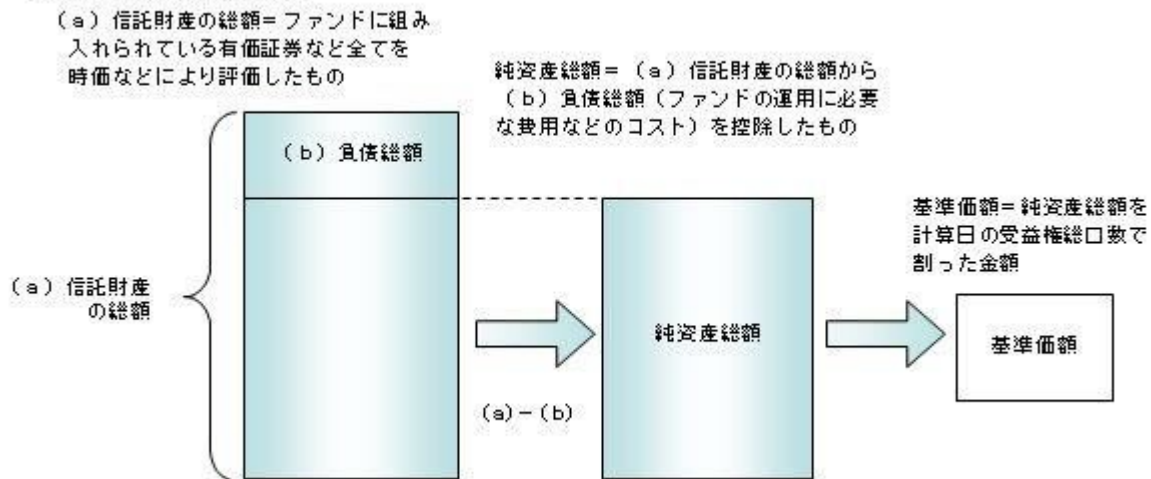
(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

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

#### <基準価額算出の流れ>



#### ② 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

##### ◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### ◇国内上場株式

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

#### ③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

無期限とします（1986年2月13日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4) 【計算期間】

毎年2月13日から翌年2月12日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

#### (5) 【その他】

##### ① 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

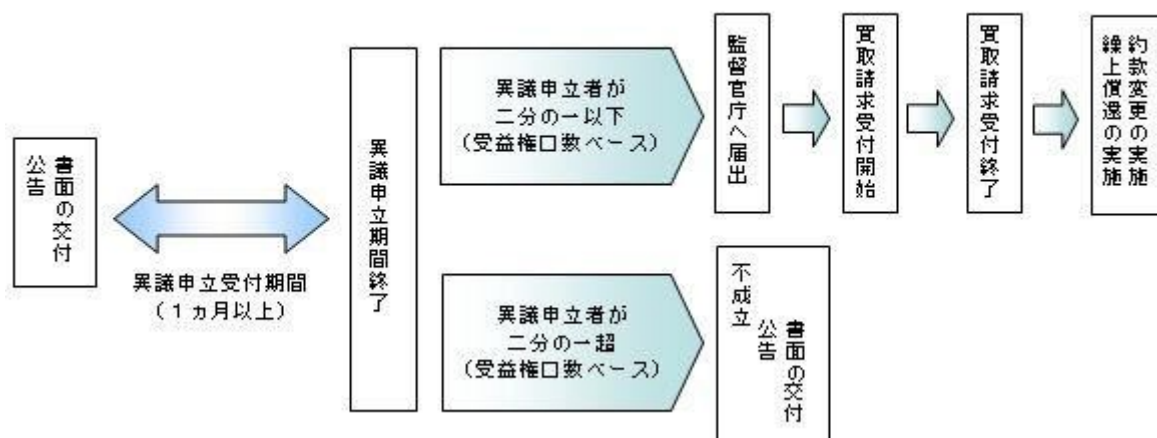
ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) 対象インデックスが改廃の場合



- ニ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
  - 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
  - 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
    - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
    - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
    - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
    - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
  - 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- ② 償還金について
- ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
  - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
- ③ 信託約款の変更
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
  - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
  - 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
  - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。
- ④ 異議の申立て
- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
  - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
  - 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



- ⑤ 公告  
公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

- ・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

⑦ 関係法人との契約について

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

#### 4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期計算期間(2020年2月13日から2021年2月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

2021年3月24日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスファンドTSPの2020年2月13日から2021年2月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスファンドTSPの2021年2月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要

な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 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。

# 1 【財務諸表】

## 【インデックスファンドTSP】

### (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 34 期 2020 年 2 月 12 日現在	第 35 期 2021 年 2 月 12 日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	463,942,861	232,249,414
親投資信託受益証券	21,936,473,375	22,175,677,856
派生商品評価勘定	1,316,700	5,185,150
未収入金	13,000,000	458,979,500
前払金	2,510,000	-
差入委託証拠金	11,040,000	30,240,000
流動資産合計	22,428,282,936	22,902,331,920
資産合計	22,428,282,936	22,902,331,920
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,542,150	-
前受金	-	7,040,000
未払金	844,400	-
未払収益分配金	345,195,107	401,375,135
未払解約金	21,910,322	41,002,048
未払受託者報酬	12,317,916	11,796,375
未払委託者報酬	51,735,498	49,545,017
未払利息	52	13
その他未払費用	492,655	471,797
流動負債合計	435,038,100	511,230,385
負債合計	435,038,100	511,230,385
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	24,656,793,385	22,298,618,653
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△2,663,548,549	92,482,882
(分配準備積立金)	4,506,281,875	6,350,289,348
元本等合計	21,993,244,836	22,391,101,535
純資産合計	21,993,244,836	22,391,101,535
負債純資産合計	22,428,282,936	22,902,331,920

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 34 期 自 2019 年 2 月 13 日 至 2020 年 2 月 12 日	第 35 期 自 2020 年 2 月 13 日 至 2021 年 2 月 12 日
営業収益		
受取利息	439	411
有価証券売買等損益	2,544,649,396	3,014,204,481
派生商品取引等損益	40,174,070	67,039,900
営業収益合計	2,584,823,905	3,081,244,792
営業費用		
支払利息	148,765	97,174
受託者報酬	24,133,788	22,484,902
委託者報酬	101,362,434	94,437,118
その他費用	979,180	899,455
営業費用合計	126,624,167	117,918,649
営業利益又は営業損失（△）	2,458,199,738	2,963,326,143
経常利益又は経常損失（△）	2,458,199,738	2,963,326,143
当期純利益又は当期純損失（△）	2,458,199,738	2,963,326,143
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（△）	223,228,445	△76,078,865
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△4,990,095,816	△2,663,548,549
剰余金増加額又は欠損金減少額	851,168,871	529,102,001
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	851,168,871	529,102,001
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	414,397,790	411,100,443
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	414,397,790	411,100,443
分配金	345,195,107	401,375,135
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,663,548,549	92,482,882

### (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 34 期 2020 年 2 月 12 日現在	第 35 期 2021 年 2 月 12 日現在
1. 期首元本額	26,715,734,544 円	24,656,793,385 円
期中追加設定元本額	2,511,981,095 円	2,282,429,644 円
期中一部解約元本額	4,570,922,254 円	4,640,604,376 円
2. 受益権の総数	24,656,793,385 口	22,298,618,653 口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	2,663,548,549 円	－円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 34 期 自 2019 年 2 月 13 日 至 2020 年 2 月 12 日	第 35 期 自 2020 年 2 月 13 日 至 2021 年 2 月 12 日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 486,756,646 円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 415,990,332 円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 46,349,351 円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 2,623,414,676 円
C 信託約款に定める収益調整金 12,753,056,669 円	C 信託約款に定める収益調整金 11,903,034,125 円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,318,370,985 円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 3,712,259,475 円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 17,604,533,651 円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 18,654,698,608 円
F 分配対象収益(1 万口当たり) 7,139 円	F 分配対象収益(1 万口当たり) 8,365 円
G 分配金額 345,195,107 円	G 分配金額 401,375,135 円
H 分配金額(1 万口当たり) 140 円	H 分配金額(1 万口当たり) 180 円

(金融商品に関する注記)

#### I 金融商品の状況に関する事項

	第 34 期 自 2019 年 2 月 13 日 至 2020 年 2 月 12 日	第 35 期 自 2020 年 2 月 13 日 至 2021 年 2 月 12 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリ	同左

	スク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	
--	-------------------------------	--

## Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

	第 34 期 2020 年 2 月 12 日現在	第 35 期 2021 年 2 月 12 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券  同左  (2) デリバティブ取引  同左  (3) 上記以外の金融商品  同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第 34 期 (2020 年 2 月 12 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,327,423,597
合計	2,327,423,597

第 35 期 (2021 年 2 月 12 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,094,174,089
合計	3,094,174,089

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

第 34 期 (2020 年 2 月 12 日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1 年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	327,825,000	—	326,610,000	△1,215,000
合計		327,825,000	—	326,610,000	△1,215,000

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1 年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	515,360,000	—	520,560,000	5,200,000
合計		515,360,000	—	520,560,000	5,200,000

## （注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

第 34 期 2020 年 2 月 12 日現在		第 35 期 2021 年 2 月 12 日現在	
1 口当たり純資産額	0.8920 円	1 口当たり純資産額	1.0041 円
(1 万口当たり純資産額)	(8,920 円)	(1 万口当たり純資産額)	(10,041 円)

## （4）【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	8,873,110,538	22,175,677,856	
合計		8,873,110,538	22,175,677,856	

（注）券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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



(参考)

インデックス マザーファンド T O P I X

貸借対照表

(単位：円)

	2020 年 2 月 12 日現在	2021 年 2 月 12 日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	62,357,798	555,781,535
株式	40,370,774,260	42,868,520,230
派生商品評価勘定	38,900	9,644,700
未収入金	-	367,182
未収配当金	65,320,891	57,448,280
前払金	390,000	-
流動資産合計	40,498,881,849	43,491,761,927
資産合計	40,498,881,849	43,491,761,927
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	282,200	-
前受金	-	9,288,000
未払解約金	37,969,495	512,971,194
未払利息	7	32
流動負債合計	38,251,702	522,259,226
負債合計	38,251,702	522,259,226
純資産の部		
元本等		
元本	18,664,275,035	17,193,201,813
剰余金		
剰余金又は欠損金 (△)	21,796,355,112	25,776,300,888
元本等合計	40,460,630,147	42,969,502,701
純資産合計	40,460,630,147	42,969,502,701
負債純資産合計	40,498,881,849	43,491,761,927

# 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	2020 年 2 月 12 日現在	2021 年 2 月 12 日現在
1. 期首	2019 年 2 月 13 日	2020 年 2 月 13 日
期首元本額	20,051,564,010 円	18,664,275,035 円
期首からの追加設定元本額	1,626,166,247 円	2,076,202,654 円
期首からの一部解約元本額	3,013,455,222 円	3,547,275,876 円
元本の内訳 ※		
インデックスファンド T S P	10,119,233,036 円	8,873,110,538 円
財形株投（一般財形 3 0）	13,739,467 円	14,240,080 円
財形株投（一般財形 5 0）	48,226,582 円	40,116,367 円
財形株投（年金・住宅財形 3 0）	27,278,156 円	27,122,417 円
インデックスファンド T O P I X（日本株式）	7,882,311,349 円	7,692,572,923 円
T O P I X インデックスファンド（個人型年金向け）	461,549,833 円	457,323,608 円
時間分散型バランスファンド（安定指向） 2 0 1 6 - 0 8	30,022,653 円	25,135,591 円
時間分散型バランスファンド（成長指向） 2 0 1 6 - 0 8	16,425,193 円	12,932,357 円
時間分散型バランスファンド（安定指向） 2 0 1 6 - 1 1	11,826,344 円	9,268,925 円
時間分散型バランスファンド（成長指向） 2 0 1 6 - 1 1	24,743,151 円	18,757,161 円
時間分散型バランスファンド（安定指向） 2 0 1 7 - 0 2	10,027,835 円	8,791,308 円
時間分散型バランスファンド（成長指向） 2 0 1 7 - 0 2	18,891,436 円	13,830,538 円
計	18,664,275,035 円	17,193,201,813 円
2. 受益権の総数	18,664,275,035 口	17,193,201,813 口
3. 担保資産		
デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
株式	287,576,000 円	293,172,000 円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

### I 金融商品の状況に関する事項

	自 2019 年 2 月 13 日 至 2020 年 2 月 12 日	自 2020 年 2 月 13 日 至 2021 年 2 月 12 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の	同左

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

## II 金融商品の時価等に関する事項

	2020 年 2 月 12 日現在	2021 年 2 月 12 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020 年 2 月 12 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,395,585,100
合計	3,395,585,100

(2021 年 2 月 12 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,803,274,347

合計	4,803,274,347
----	---------------

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2020 年 2 月 12 日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1 年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	103,380,000	—	103,140,000	△240,000
合計		103,380,000	—	103,140,000	△240,000

(2021 年 2 月 12 日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1 年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	106,032,000	—	115,680,000	9,648,000
合計		106,032,000	—	115,680,000	9,648,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020 年 2 月 12 日現在		2021 年 2 月 12 日現在	
1 口当たり純資産額	2.1678 円	1 口当たり純資産額	2.4992 円
(1 万口当たり純資産額)	(21,678 円)	(1 万口当たり純資産額)	(24,992 円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	

極洋	700	3,080.00	2,156,000	
日本水産	20,400	506.00	10,322,400	
マルハニチロ	3,500	2,464.00	8,624,000	
雪国まいたけ	1,400	1,850.00	2,590,000	
カネコ種苗	700	1,592.00	1,114,400	
サカタのタネ	2,600	3,935.00	10,231,000	
ホクト	1,800	2,150.00	3,870,000	
ホクリヨウ	400	702.00	280,800	
住石ホールディングス	4,400	111.00	488,400	
日鉄鉱業	500	5,430.00	2,715,000	
三井松島ホールディングス	900	915.00	823,500	
国際石油開発帝石	80,800	723.00	58,418,400	
石油資源開発	2,900	2,313.00	6,707,700	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,471.00	1,618,100	
ヒノキヤグループ	600	2,240.00	1,344,000	
ショーボンドホールディングス	3,200	4,825.00	15,440,000	
ミライト・ホールディングス	7,600	1,785.00	13,566,000	
タマホーム	1,400	1,904.00	2,665,600	
サンヨーホームズ	300	843.00	252,900	
日本アクア	900	636.00	572,400	
ファーストコーポレーション	800	714.00	571,200	
ベステラ	500	1,680.00	840,000	
キャンディル	500	541.00	270,500	
スペースバリューホールディングス	2,700	695.00	1,876,500	
ダイセキ環境ソリューション	500	795.00	397,500	
第一カッター興業	600	1,350.00	810,000	
安藤・間	14,200	768.00	10,905,600	
東急建設	6,600	563.00	3,715,800	
コムシスホールディングス	7,800	3,375.00	26,325,000	
ビーアールホールディングス	2,700	756.00	2,041,200	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,116.00	2,750,800	
東建コーポレーション	700	8,730.00	6,111,000	
ソネック	300	828.00	248,400	
ヤマウラ	1,000	942.00	942,000	
大成建設	15,800	3,785.00	59,803,000	
大林組	50,700	910.00	46,137,000	

清水建設	47,600	794.00	37,794,400	
飛島建設	1,500	1,106.00	1,659,000	
長谷工コーポレーション	16,600	1,392.00	23,107,200	
松井建設	2,000	718.00	1,436,000	
銭高組	200	4,530.00	906,000	
鹿島建設	37,200	1,492.00	55,502,400	
不動テトラ	1,300	1,828.00	2,376,400	
大末建設	600	881.00	528,600	
鉄建建設	1,100	1,953.00	2,148,300	
西松建設	3,600	2,655.00	9,558,000	
三井住友建設	12,400	480.00	5,952,000	
大豊建設	1,100	3,830.00	4,213,000	
前田建設工業	12,700	929.00	11,798,300	
ナカノフドー建設	1,300	400.00	520,000	
奥村組	2,800	2,737.00	7,663,600	
東鉄工業	2,200	2,715.00	5,973,000	
イチケン	400	2,002.00	800,800	
富士ピー・エス	700	607.00	424,900	
浅沼組	600	4,695.00	2,817,000	
戸田建設	21,000	767.00	16,107,000	
熊谷組	2,300	2,853.00	6,561,900	
北野建設	300	2,455.00	736,500	
植木組	200	2,909.00	581,800	
矢作建設工業	2,300	855.00	1,966,500	
ピーエス三菱	1,700	699.00	1,188,300	
日本ハウスホールディングス	3,800	341.00	1,295,800	
大東建託	5,600	12,000.00	67,200,000	
新日本建設	2,100	857.00	1,799,700	
N I P P O	4,200	2,793.00	11,730,600	
東亜道路工業	300	3,970.00	1,191,000	
前田道路	3,200	2,000.00	6,400,000	
日本道路	500	7,730.00	3,865,000	
東亜建設工業	1,400	2,119.00	2,966,600	
日本国土開発	5,000	557.00	2,785,000	
若築建設	900	1,252.00	1,126,800	
東洋建設	5,800	560.00	3,248,000	

五洋建設	21,600	841.00	18,165,600	
世紀東急工業	2,400	889.00	2,133,600	
福田組	600	5,210.00	3,126,000	
住友林業	12,000	2,274.00	27,288,000	
日本基礎技術	1,500	507.00	760,500	
巴コーポレーション	2,300	396.00	910,800	
大和ハウス工業	46,900	3,269.00	153,316,100	
ライト工業	2,900	1,727.00	5,008,300	
積水ハウス	55,000	2,094.50	115,197,500	
日特建設	1,400	788.00	1,103,200	
北陸電気工事	900	1,238.00	1,114,200	
ユアテック	3,000	845.00	2,535,000	
日本リーテック	1,100	2,550.00	2,805,000	
四電工	300	2,853.00	855,900	
中電工	2,300	2,231.00	5,131,300	
関電工	8,300	903.00	7,494,900	
きんでん	11,000	1,834.00	20,174,000	
東京エネシス	1,700	957.00	1,626,900	
トーエネック	500	3,945.00	1,972,500	
住友電設	1,500	2,588.00	3,882,000	
日本電設工業	2,800	1,972.00	5,521,600	
協和エクシオ	7,700	2,844.00	21,898,800	
新日本空調	1,300	2,221.00	2,887,300	
九電工	3,600	3,540.00	12,744,000	
三機工業	3,600	1,298.00	4,672,800	
日揮ホールディングス	17,000	1,307.00	22,219,000	
中外炉工業	600	1,760.00	1,056,000	
ヤマト	1,700	714.00	1,213,800	
太平電業	1,100	2,552.00	2,807,200	
高砂熱学工業	4,600	1,662.00	7,645,200	
三晃金属工業	200	2,996.00	599,200	
朝日工業社	400	2,898.00	1,159,200	
明星工業	3,300	818.00	2,699,400	
大気社	2,500	2,933.00	7,332,500	
ダイダン	1,100	2,840.00	3,124,000	
日比谷総合設備	1,700	1,877.00	3,190,900	

フィル・カンパニー	300	2, 110. 00	633, 000	
東洋エンジニアリング	2, 400	479. 00	1, 149, 600	
レイズネクスト	2, 700	1, 172. 00	3, 164, 400	
ニッポン	4, 700	1, 619. 00	7, 609, 300	
日清製粉グループ本社	18, 300	1, 741. 00	31, 860, 300	
日東富士製粉	100	6, 710. 00	671, 000	
昭和産業	1, 300	3, 245. 00	4, 218, 500	
鳥越製粉	1, 400	874. 00	1, 223, 600	
中部飼料	1, 900	1, 465. 00	2, 783, 500	
フィード・ワン	2, 200	937. 00	2, 061, 400	
東洋精糖	300	1, 244. 00	373, 200	
日本甜菜製糖	800	1, 675. 00	1, 340, 000	
三井製糖	1, 300	1, 937. 00	2, 518, 100	
塩水港精糖	2, 100	229. 00	480, 900	
日新製糖	700	1, 877. 00	1, 313, 900	
森永製菓	3, 800	4, 290. 00	16, 302, 000	
中村屋	400	3, 960. 00	1, 584, 000	
江崎グリコ	4, 500	4, 735. 00	21, 307, 500	
名糖産業	700	1, 509. 00	1, 056, 300	
井村屋グループ	900	2, 546. 00	2, 291, 400	
不二家	1, 100	2, 385. 00	2, 623, 500	
山崎製パン	12, 200	1, 973. 00	24, 070, 600	
第一屋製パン	500	974. 00	487, 000	
モロゾフ	300	5, 700. 00	1, 710, 000	
亀田製菓	900	4, 880. 00	4, 392, 000	
寿スピリッツ	1, 600	6, 570. 00	10, 512, 000	
カルビー	7, 400	3, 050. 00	22, 570, 000	
森永乳業	3, 000	5, 050. 00	15, 150, 000	
六甲バター	1, 100	1, 832. 00	2, 015, 200	
ヤクルト本社	11, 200	5, 220. 00	58, 464, 000	
明治ホールディングス	10, 700	7, 100. 00	75, 970, 000	
雪印メグミルク	3, 900	2, 245. 00	8, 755, 500	
プリマハム	2, 300	3, 335. 00	7, 670, 500	
日本ハム	6, 200	4, 590. 00	28, 458, 000	
林兼産業	500	625. 00	312, 500	
丸大食品	1, 500	1, 717. 00	2, 575, 500	



S F o o d s	1, 500	3, 495. 00	5, 242, 500	
柿安本店	600	2, 775. 00	1, 665, 000	
伊藤ハム米久ホールディングス	10, 300	756. 00	7, 786, 800	
サッポロホールディングス	5, 600	2, 191. 00	12, 269, 600	
アサヒグループホールディングス	35, 500	4, 428. 00	157, 194, 000	
キリンホールディングス	69, 000	2, 223. 00	153, 387, 000	
宝ホールディングス	12, 000	1, 530. 00	18, 360, 000	
オエノンホールディングス	4, 600	383. 00	1, 761, 800	
養命酒製造	500	1, 986. 00	993, 000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12, 500	1, 810. 00	22, 625, 000	
サントリー食品インターナショナル	10, 900	3, 785. 00	41, 256, 500	
ダイドーグループホールディングス	900	5, 380. 00	4, 842, 000	
伊藤園	4, 900	6, 600. 00	32, 340, 000	
キーコーヒー	1, 600	2, 171. 00	3, 473, 600	
ユニカフェ	600	1, 014. 00	608, 400	
ジャパンフーズ	300	1, 243. 00	372, 900	
日清オイリオグループ	2, 100	3, 310. 00	6, 951, 000	
不二製油グループ本社	4, 000	3, 325. 00	13, 300, 000	
かどや製油	200	4, 145. 00	829, 000	
Jーオイルミルズ	700	3, 870. 00	2, 709, 000	
キッコーマン	11, 700	7, 240. 00	84, 708, 000	
味の素	38, 700	2, 273. 00	87, 965, 100	
キューピー	9, 100	2, 412. 00	21, 949, 200	
ハウス食品グループ本社	6, 100	3, 860. 00	23, 546, 000	
カゴメ	6, 600	3, 420. 00	22, 572, 000	
焼津水産化学工業	700	1, 000. 00	700, 000	
アリアケジャパン	1, 500	6, 920. 00	10, 380, 000	
ピエトロ	300	1, 770. 00	531, 000	
エバラ食品工業	400	2, 799. 00	1, 119, 600	
やまみ	200	2, 170. 00	434, 000	
ニチレイ	7, 800	2, 867. 00	22, 362, 600	
東洋水産	8, 400	4, 625. 00	38, 850, 000	
イトアンドホールディングス	700	1, 911. 00	1, 337, 700	
大冷	200	1, 936. 00	387, 200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1, 000	943. 00	943, 000	

日清食品ホールディングス	6,400	8,550.00	54,720,000	
永谷園ホールディングス	800	2,408.00	1,926,400	
一正蒲鉾	600	1,194.00	716,400	
フジッコ	1,700	2,044.00	3,474,800	
ロック・フィールド	1,800	1,601.00	2,881,800	
日本たばこ産業	87,200	1,981.00	172,743,200	
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,947.00	1,947,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,694.00	1,863,400	
なとり	900	2,024.00	1,821,600	
イフジ産業	300	926.00	277,800	
ピククルスコーポレーション	400	3,630.00	1,452,000	
北の達人コーポレーション	5,700	648.00	3,693,600	
ユーグレナ	7,100	982.00	6,972,200	
ミヨシ油脂	500	1,202.00	601,000	
理研ビタミン	1,600	1,432.00	2,291,200	
片倉工業	2,100	1,418.00	2,977,800	
グンゼ	1,100	3,720.00	4,092,000	
東洋紡	6,300	1,384.00	8,719,200	
ユニチカ	4,900	475.00	2,327,500	
富士紡ホールディングス	800	4,485.00	3,588,000	
倉敷紡績	1,500	1,891.00	2,836,500	
シキボウ	900	1,041.00	936,900	
日本毛織	5,000	974.00	4,870,000	
ダイトウボウ	3,100	110.00	341,000	
トーア紡コーポレーション	700	469.00	328,300	
ダイドーリミテッド	2,600	186.00	483,600	
帝国繊維	1,800	2,309.00	4,156,200	
帝人	14,900	1,880.00	28,012,000	
東レ	114,900	702.20	80,682,780	
サカイオーベックス	400	2,910.00	1,164,000	
住江織物	400	2,064.00	825,600	
日本フェルト	900	448.00	403,200	
日東製網	200	1,534.00	306,800	
アツギ	1,200	507.00	608,400	
ダイニック	600	783.00	469,800	
セーレン	3,900	1,996.00	7,784,400	

ソトー	700	817.00	571,900	
東海染工	200	1,131.00	226,200	
小松マテーレ	2,600	1,042.00	2,709,200	
ワコールホールディングス	4,000	2,343.00	9,372,000	
ホギメディカル	2,100	3,250.00	6,825,000	
クラウディアホールディングス	600	292.00	175,200	
T S I ホールディングス	4,900	276.00	1,352,400	
マツオカコーポレーション	500	2,151.00	1,075,500	
ワールド	2,100	1,403.00	2,946,300	
三陽商会	900	716.00	644,400	
ナイガイ	700	330.00	231,000	
オンワードホールディングス	9,800	280.00	2,744,000	
ルックホールディングス	500	1,020.00	510,000	
ゴールドウイン	2,600	7,630.00	19,838,000	
デサント	2,700	1,800.00	4,860,000	
キング	800	581.00	464,800	
ヤマトインターナショナル	1,400	340.00	476,000	
特種東海製紙	1,000	4,655.00	4,655,000	
王子ホールディングス	71,400	686.00	48,980,400	
日本製紙	7,000	1,437.00	10,059,000	
三菱製紙	2,500	365.00	912,500	
北越コーポレーション	11,200	488.00	5,465,600	
中越パルプ工業	600	1,182.00	709,200	
巴川製紙所	600	808.00	484,800	
大王製紙	7,700	2,117.00	16,300,900	
阿波製紙	500	455.00	227,500	
レンゴー	16,300	885.00	14,425,500	
トーモク	900	1,852.00	1,666,800	
ザ・パック	1,200	2,758.00	3,309,600	
クラレ	25,000	1,214.00	30,350,000	
旭化成	105,100	1,184.00	124,438,400	
共和レザー	800	662.00	529,600	
昭和電工	12,100	2,657.00	32,149,700	
住友化学	125,100	516.00	64,551,600	
住友精化	800	4,065.00	3,252,000	
日産化学	8,800	5,990.00	52,712,000	

ラサ工業	500	2, 402. 00	1, 201, 000	
クレハ	1, 300	7, 260. 00	9, 438, 000	
多木化学	600	6, 050. 00	3, 630, 000	
テイカ	1, 200	1, 463. 00	1, 755, 600	
石原産業	2, 900	786. 00	2, 279, 400	
片倉コープアグリ	400	1, 290. 00	516, 000	
日本曹達	2, 200	3, 455. 00	7, 601, 000	
東ソー	24, 500	1, 894. 00	46, 403, 000	
トクヤマ	4, 700	2, 626. 00	12, 342, 200	
セントラル硝子	3, 000	2, 223. 00	6, 669, 000	
東亜合成	9, 600	1, 212. 00	11, 635, 200	
大阪ソーダ	1, 600	2, 653. 00	4, 244, 800	
関東電化工業	3, 800	851. 00	3, 233, 800	
デンカ	5, 800	4, 230. 00	24, 534, 000	
信越化学工業	29, 300	18, 285. 00	535, 750, 500	
日本カーバイド工業	600	1, 359. 00	815, 400	
堺化学工業	1, 100	2, 087. 00	2, 295, 700	
第一稀元素化学工業	1, 700	1, 029. 00	1, 749, 300	
エア・ウォーター	16, 200	1, 750. 00	28, 350, 000	
日本酸素ホールディングス	13, 100	2, 056. 00	26, 933, 600	
日本化学工業	500	3, 310. 00	1, 655, 000	
東邦アセチレン	300	1, 451. 00	435, 300	
日本パーカライジング	8, 000	1, 155. 00	9, 240, 000	
高压ガス工業	2, 500	755. 00	1, 887, 500	
四国化成工業	2, 100	1, 235. 00	2, 593, 500	
戸田工業	400	2, 150. 00	860, 000	
ステラ ケミファ	900	3, 410. 00	3, 069, 000	
保土谷化学工業	500	5, 020. 00	2, 510, 000	
日本触媒	2, 900	5, 850. 00	16, 965, 000	
大日精化工業	1, 300	2, 387. 00	3, 103, 100	
カネカ	4, 100	4, 230. 00	17, 343, 000	
三菱瓦斯化学	15, 900	2, 522. 00	40, 099, 800	
三井化学	13, 700	3, 360. 00	46, 032, 000	
J S R	15, 900	3, 250. 00	51, 675, 000	
東京応化工業	2, 700	7, 360. 00	19, 872, 000	
大阪有機化学工業	1, 500	3, 870. 00	5, 805, 000	

三菱ケミカルホールディングス	106,100	734.40	77,919,840	
KHネオケム	2,600	2,407.00	6,258,200	
ダイセル	21,400	849.00	18,168,600	
住友ベークライト	2,500	4,265.00	10,662,500	
積水化学工業	33,500	2,025.00	67,837,500	
日本ゼオン	14,300	1,642.00	23,480,600	
アイカ工業	4,400	3,950.00	17,380,000	
宇部興産	8,000	2,058.00	16,464,000	
積水樹脂	2,600	2,137.00	5,556,200	
タキロンシーアイ	3,400	696.00	2,366,400	
旭有機材	900	1,524.00	1,371,600	
ニチバン	800	1,852.00	1,481,600	
リケンテクノス	3,800	505.00	1,919,000	
大倉工業	700	1,919.00	1,343,300	
積水化成成品工業	2,000	560.00	1,120,000	
群栄化学工業	400	2,508.00	1,003,200	
タイガースポリマー	700	462.00	323,400	
ミライアル	500	1,259.00	629,500	
ダイキアクシス	600	1,050.00	630,000	
ダイキョーニシカワ	3,300	864.00	2,851,200	
竹本容器	700	907.00	634,900	
森六ホールディングス	800	2,116.00	1,692,800	
恵和	300	2,033.00	609,900	
日本化薬	9,800	1,037.00	10,162,600	
カーリットホールディングス	1,600	749.00	1,198,400	
日本精化	1,200	1,439.00	1,726,800	
扶桑化学工業	1,300	3,695.00	4,803,500	
トリケミカル研究所	1,200	4,130.00	4,956,000	
ADEKA	7,200	1,928.00	13,881,600	
日油	6,000	5,500.00	33,000,000	
新日本理化	2,900	267.00	774,300	
ハリマ化成グループ	1,200	957.00	1,148,400	
花王	38,800	7,486.00	290,456,800	
第一工業製薬	600	3,770.00	2,262,000	
石原ケミカル	400	2,150.00	860,000	
日華化学	600	904.00	542,400	

ニイタカ	300	2,922.00	876,600	
三洋化成工業	900	5,400.00	4,860,000	
有機合成薬品工業	1,400	304.00	425,600	
大日本塗料	1,800	939.00	1,690,200	
日本ペイントホールディングス	13,100	8,850.00	115,935,000	
関西ペイント	17,800	3,050.00	54,290,000	
神東塗料	1,300	205.00	266,500	
中国塗料	3,900	935.00	3,646,500	
日本特殊塗料	1,200	1,148.00	1,377,600	
藤倉化成	2,200	527.00	1,159,400	
太陽ホールディングス	1,200	6,000.00	7,200,000	
D I C	6,700	2,710.00	18,157,000	
サカタインクス	3,500	1,078.00	3,773,000	
東洋インキＳＣホールディングス	3,300	1,890.00	6,237,000	
T＆K　T O K A	1,200	846.00	1,015,200	
富士フイルムホールディングス	28,500	6,384.00	181,944,000	
資生堂	32,200	7,995.00	257,439,000	
ライオン	21,100	2,389.00	50,407,900	
高砂香料工業	1,000	2,546.00	2,546,000	
マンダム	3,400	1,780.00	6,052,000	
ミルボン	2,200	7,030.00	15,466,000	
ファンケル	5,900	4,070.00	24,013,000	
コーセー	3,000	18,190.00	54,570,000	
コタ	900	1,650.00	1,485,000	
シーボン	300	1,995.00	598,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,900	2,516.00	17,360,400	
ノエビアホールディングス	1,400	4,985.00	6,979,000	
アジュバンコスメジャパン	400	1,073.00	429,200	
新日本製薬	400	2,853.00	1,141,200	
エスデー	1,100	2,055.00	2,260,500	
アグロ　カネショウ	600	1,592.00	955,200	
コニシ	2,600	1,637.00	4,256,200	
長谷川香料	2,800	2,005.00	5,614,000	
星光PMC	1,000	790.00	790,000	
小林製薬	4,500	11,160.00	50,220,000	
荒川化学工業	1,300	1,277.00	1,660,100	

メック	1, 100	2, 116. 00	2, 327, 600	
日本高純度化学	500	2, 743. 00	1, 371, 500	
タカラバイオ	4, 200	3, 330. 00	13, 986, 000	
J C U	1, 800	3, 505. 00	6, 309, 000	
新田ゼラチン	1, 000	672. 00	672, 000	
O A Tアグリオ	400	1, 361. 00	544, 400	
デクセリアルズ	4, 600	1, 436. 00	6, 605, 600	
アース製薬	1, 200	6, 420. 00	7, 704, 000	
北興化学工業	1, 500	1, 134. 00	1, 701, 000	
大成ラミック	600	2, 942. 00	1, 765, 200	
クミアイ化学工業	6, 700	888. 00	5, 949, 600	
日本農薬	2, 900	527. 00	1, 528, 300	
アキレス	1, 200	1, 509. 00	1, 810, 800	
有沢製作所	2, 300	992. 00	2, 281, 600	
日東電工	10, 400	9, 870. 00	102, 648, 000	
レック	1, 900	1, 375. 00	2, 612, 500	
三光合成	1, 900	452. 00	858, 800	
きもと	2, 900	200. 00	580, 000	
藤森工業	1, 400	4, 770. 00	6, 678, 000	
前澤化成工業	1, 000	980. 00	980, 000	
未来工業	500	1, 744. 00	872, 000	
ウェーブロックホールディングス	600	780. 00	468, 000	
J S P	1, 100	1, 842. 00	2, 026, 200	
エフピコ	3, 000	4, 150. 00	12, 450, 000	
天馬	1, 200	2, 365. 00	2, 838, 000	
信越ポリマー	2, 500	1, 066. 00	2, 665, 000	
東リ	3, 600	248. 00	892, 800	
ニフコ	5, 900	4, 050. 00	23, 895, 000	
バルカー	1, 300	2, 157. 00	2, 804, 100	
ユニ・チャーム	34, 300	4, 691. 00	160, 901, 300	
ショーエイコーポレーション	400	1, 032. 00	412, 800	
協和キリン	16, 300	3, 125. 00	50, 937, 500	
武田薬品工業	134, 800	3, 688. 00	497, 142, 400	
アステラス製薬	140, 400	1, 777. 50	249, 561, 000	
大日本住友製薬	12, 000	1, 702. 00	20, 424, 000	
塩野義製薬	20, 400	5, 976. 00	121, 910, 400	

わかもと製薬	2,000	245.00	490,000	
あすか製薬	1,900	1,515.00	2,878,500	
日本新薬	4,600	7,740.00	35,604,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,588.00	517,600	
中外製薬	50,600	5,147.00	260,438,200	
科研製薬	2,800	4,095.00	11,466,000	
エーザイ	17,900	7,780.00	139,262,000	
ロート製薬	7,700	3,120.00	24,024,000	
小野薬品工業	37,200	3,121.00	116,101,200	
久光製薬	4,700	6,830.00	32,101,000	
持田製薬	2,200	4,260.00	9,372,000	
参天製薬	28,200	1,616.00	45,571,200	
扶桑薬品工業	500	2,693.00	1,346,500	
日本ケミファ	200	2,240.00	448,000	
ツムラ	5,400	3,400.00	18,360,000	
日医工	4,700	1,028.00	4,831,600	
キッセイ薬品工業	2,800	2,254.00	6,311,200	
生化学工業	2,900	1,070.00	3,103,000	
栄研化学	2,900	2,252.00	6,530,800	
日水製薬	600	1,015.00	609,000	
鳥居薬品	1,000	3,035.00	3,035,000	
J C R ファーマ	4,600	3,180.00	14,628,000	
東和薬品	2,300	2,123.00	4,882,900	
富士製薬工業	1,100	1,367.00	1,503,700	
沢井製薬	3,600	4,925.00	17,730,000	
ゼリア新薬工業	2,900	2,069.00	6,000,100	
第一三共	139,000	3,251.00	451,889,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,600	1,946.00	7,005,600	
大幸薬品	2,000	1,595.00	3,190,000	
ダイト	1,000	3,745.00	3,745,000	
大塚ホールディングス	33,600	4,587.00	154,123,200	
大正製薬ホールディングス	3,800	7,070.00	26,866,000	
ペプチドリーム	8,200	5,820.00	47,724,000	
日本コークス工業	14,000	103.00	1,442,000	
ニチレキ	1,900	1,560.00	2,964,000	
ユシロ化学工業	900	1,154.00	1,038,600	



ビーピー・カストロール	600	1, 241. 00	744, 600	
富士石油	4, 600	218. 00	1, 002, 800	
MORESCO	700	1, 171. 00	819, 700	
出光興産	18, 000	2, 671. 00	48, 078, 000	
ENEOSホールディングス	243, 500	445. 10	108, 381, 850	
コスモエネルギーホールディングス	5, 100	2, 509. 00	12, 795, 900	
横浜ゴム	9, 400	1, 822. 00	17, 126, 800	
TOYO TIRE	8, 500	1, 880. 00	15, 980, 000	
ブリヂストン	43, 100	4, 410. 00	190, 071, 000	
住友ゴム工業	14, 700	1, 158. 00	17, 022, 600	
藤倉コンポジット	1, 500	436. 00	654, 000	
オカモト	1, 000	4, 025. 00	4, 025, 000	
フコク	800	693. 00	554, 400	
ニッタ	1, 600	2, 517. 00	4, 027, 200	
住友理工	3, 100	658. 00	2, 039, 800	
三ツ星ベルト	2, 000	1, 762. 00	3, 524, 000	
バンドー化学	2, 800	735. 00	2, 058, 000	
日東紡績	2, 400	4, 585. 00	11, 004, 000	
AGC	14, 800	3, 630. 00	53, 724, 000	
日本板硝子	8, 500	549. 00	4, 666, 500	
石塚硝子	300	1, 885. 00	565, 500	
日本山村硝子	600	891. 00	534, 600	
日本電気硝子	6, 000	2, 393. 00	14, 358, 000	
オハラ	700	1, 919. 00	1, 343, 300	
住友大阪セメント	2, 900	3, 600. 00	10, 440, 000	
太平洋セメント	9, 600	2, 534. 00	24, 326, 400	
日本ヒューム	1, 500	778. 00	1, 167, 000	
日本コンクリート工業	3, 600	342. 00	1, 231, 200	
三谷セキサン	800	5, 050. 00	4, 040, 000	
アジアパイルホールディングス	2, 400	491. 00	1, 178, 400	
東海カーボン	15, 800	1, 543. 00	24, 379, 400	
日本カーボン	900	4, 090. 00	3, 681, 000	
東洋炭素	1, 000	2, 044. 00	2, 044, 000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	3, 595. 00	3, 235, 500	
TOTO	11, 600	7, 140. 00	82, 824, 000	
日本碍子	17, 900	1, 900. 00	34, 010, 000	

日本特殊陶業	12,300	1,932.00	23,763,600	
ダントーホールディングス	1,300	380.00	494,000	
MARUWA	600	10,920.00	6,552,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,847.00	1,138,800	
黒崎播磨	300	4,710.00	1,413,000	
ヨータイ	1,100	942.00	1,036,200	
イソライト工業	800	592.00	473,600	
東京窯業	1,900	332.00	630,800	
ニッカトー	800	752.00	601,600	
フジミインコーポレーテッド	1,300	4,165.00	5,414,500	
クニミネ工業	500	1,287.00	643,500	
エーアンドエーマテリアル	200	1,086.00	217,200	
ニチアス	4,100	2,509.00	10,286,900	
ニチハ	2,200	3,300.00	7,260,000	
日本製鉄	76,500	1,488.00	113,832,000	
神戸製鋼所	29,400	655.00	19,257,000	
合同製鐵	800	2,097.00	1,677,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	46,400	1,088.00	50,483,200	
東京製鐵	6,300	743.00	4,680,900	
共英製鋼	1,800	1,422.00	2,559,600	
大和工業	3,400	2,782.00	9,458,800	
東京鐵鋼	600	2,004.00	1,202,400	
大阪製鐵	800	1,262.00	1,009,600	
淀川製鋼所	2,100	2,318.00	4,867,800	
丸一鋼管	5,200	2,482.00	12,906,400	
モリ工業	500	2,359.00	1,179,500	
大同特殊鋼	2,600	4,715.00	12,259,000	
日本高周波鋼業	700	372.00	260,400	
日本冶金工業	1,300	2,042.00	2,654,600	
山陽特殊製鋼	1,900	1,764.00	3,351,600	
愛知製鋼	900	3,360.00	3,024,000	
日立金属	15,100	1,740.00	26,274,000	
日本金属	400	1,193.00	477,200	
大平洋金属	1,100	2,209.00	2,429,900	
新日本電工	10,500	291.00	3,055,500	
栗本鐵工所	700	1,747.00	1,222,900	

虹技	200	1, 183. 00	236, 600	
日本鋳鉄管	200	1, 386. 00	277, 200	
三菱製鋼	1, 300	739. 00	960, 700	
日亜鋼業	2, 200	295. 00	649, 000	
日本精線	300	3, 800. 00	1, 140, 000	
エンビプロ・ホールディングス	800	784. 00	627, 200	
シンニッタン	1, 800	224. 00	403, 200	
新家工業	400	1, 407. 00	562, 800	
大紀アルミニウム工業所	2, 400	781. 00	1, 874, 400	
日本軽金属ホールディングス	4, 400	2, 024. 00	8, 905, 600	
三井金属鉱業	4, 300	3, 795. 00	16, 318, 500	
東邦亜鉛	900	2, 446. 00	2, 201, 400	
三菱マテリアル	10, 600	2, 407. 00	25, 514, 200	
住友金属鉱山	20, 500	4, 959. 00	101, 659, 500	
DOWAホールディングス	4, 000	3, 985. 00	15, 940, 000	
古河機械金属	2, 600	1, 322. 00	3, 437, 200	
エス・サイエンス	10, 600	44. 00	466, 400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1, 800	809. 00	1, 456, 200	
東邦チタニウム	2, 900	924. 00	2, 679, 600	
U A C J	2, 400	2, 222. 00	5, 332, 800	
C K サンエツ	300	3, 740. 00	1, 122, 000	
古河電気工業	5, 000	2, 900. 00	14, 500, 000	
住友電気工業	55, 800	1, 595. 50	89, 028, 900	
フジクラ	19, 600	496. 00	9, 721, 600	
昭和電線ホールディングス	1, 600	1, 830. 00	2, 928, 000	
タツタ電線	2, 900	683. 00	1, 980, 700	
カナレ電気	300	1, 768. 00	530, 400	
平河ヒューテック	900	1, 213. 00	1, 091, 700	
リョービ	2, 000	1, 360. 00	2, 720, 000	
アーレスティ	2, 200	420. 00	924, 000	
アサヒホールディングス	3, 000	4, 320. 00	12, 960, 000	
稲葉製作所	1, 100	1, 440. 00	1, 584, 000	
宮地エンジニアリンググループ	500	2, 222. 00	1, 111, 000	
トーカロ	4, 100	1, 431. 00	5, 867, 100	
アルファ C o	600	1, 054. 00	632, 400	
S U M C O	20, 500	2, 429. 00	49, 794, 500	

川田テクノロジーズ	300	4,625.00	1,387,500	
R S   T e c h n o l o g i e s	500	6,790.00	3,395,000	
ジェイテックコーポレーション	100	3,750.00	375,000	
信和	1,000	725.00	725,000	
東洋製罐グループホールディングス	10,100	1,299.00	13,119,900	
ホッカンホールディングス	800	1,465.00	1,172,000	
コロナ	1,000	977.00	977,000	
横河ブリッジホールディングス	2,800	1,988.00	5,566,400	
駒井ハルテック	400	2,168.00	867,200	
高田機工	100	2,604.00	260,400	
三和ホールディングス	15,100	1,331.00	20,098,100	
文化シャッター	4,700	1,017.00	4,779,900	
三協立山	2,100	836.00	1,755,600	
アルインコ	1,100	980.00	1,078,000	
東洋シャッター	300	701.00	210,300	
L I X I L	22,100	3,000.00	66,300,000	
日本ファイルコン	1,100	501.00	551,100	
ノーリツ	3,300	1,657.00	5,468,100	
長府製作所	1,700	2,117.00	3,598,900	
リンナイ	3,100	12,120.00	37,572,000	
ダイニチ工業	900	902.00	811,800	
日東精工	2,000	513.00	1,026,000	
三洋工業	200	1,877.00	375,400	
岡部	3,300	788.00	2,600,400	
ジーテクト	2,000	1,530.00	3,060,000	
東プレ	3,000	1,630.00	4,890,000	
高周波熱錬	3,100	534.00	1,655,400	
東京製綱	1,200	1,426.00	1,711,200	
サンコール	1,300	507.00	659,100	
モリテック   スチール	1,400	415.00	581,000	
パイオラックス	2,400	1,717.00	4,120,800	
エイチワン	1,600	844.00	1,350,400	
日本発條	15,900	838.00	13,324,200	
中央発條	100	2,880.00	288,000	
アドバネクス	300	1,630.00	489,000	
立川ブラインド工業	700	1,326.00	928,200	

三益半導体工業	1, 200	2, 682. 00	3, 218, 400	
日本ドライケミカル	400	1, 600. 00	640, 000	
日本製鋼所	4, 900	3, 250. 00	15, 925, 000	
三浦工業	6, 900	6, 250. 00	43, 125, 000	
タクマ	5, 400	2, 163. 00	11, 680, 200	
ツガミ	3, 300	1, 654. 00	5, 458, 200	
オークマ	1, 900	6, 120. 00	11, 628, 000	
芝浦機械	1, 700	2, 928. 00	4, 977, 600	
アマダ	23, 400	1, 275. 00	29, 835, 000	
アイダエンジニアリング	4, 100	981. 00	4, 022, 100	
滝澤鉄工所	500	1, 067. 00	533, 500	
F U J I	6, 400	2, 804. 00	17, 945, 600	
牧野フライス製作所	1, 900	4, 190. 00	7, 961, 000	
オーエスジー	7, 900	1, 958. 00	15, 468, 200	
ダイジェット工業	200	1, 342. 00	268, 400	
旭ダイヤモンド工業	4, 300	502. 00	2, 158, 600	
DMG 森精機	10, 200	1, 675. 00	17, 085, 000	
ソディック	3, 500	988. 00	3, 458, 000	
ディスコ	2, 200	34, 650. 00	76, 230, 000	
日東工器	800	1, 867. 00	1, 493, 600	
日進工具	600	2, 690. 00	1, 614, 000	
パンチ工業	1, 400	541. 00	757, 400	
富士ダイス	700	668. 00	467, 600	
豊和工業	900	887. 00	798, 300	
ＯＫＫ	900	452. 00	406, 800	
東洋機械金属	1, 200	471. 00	565, 200	
津田駒工業	400	911. 00	364, 400	
島精機製作所	2, 400	2, 274. 00	5, 457, 600	
オプトラン	2, 000	2, 549. 00	5, 098, 000	
N C ホールディングス	500	675. 00	337, 500	
イワキポンプ	1, 000	849. 00	849, 000	
フリュー	1, 600	1, 163. 00	1, 860, 800	
ヤマシンフィルタ	3, 300	844. 00	2, 785, 200	
日阪製作所	1, 800	851. 00	1, 531, 800	
やまびこ	3, 100	1, 370. 00	4, 247, 000	
平田機工	800	7, 860. 00	6, 288, 000	

ペガサスミシン製造	1, 800	414. 00	745, 200	
マルマエ	600	1, 292. 00	775, 200	
タツモ	700	1, 586. 00	1, 110, 200	
ナブテスコ	9, 400	4, 985. 00	46, 859, 000	
三井海洋開発	1, 700	1, 786. 00	3, 036, 200	
レオン自動機	1, 600	1, 206. 00	1, 929, 600	
SMC	4, 800	66, 440. 00	318, 912, 000	
ホソカワミクロン	600	6, 220. 00	3, 732, 000	
ユニオンツール	600	3, 545. 00	2, 127, 000	
オイレス工業	2, 200	1, 690. 00	3, 718, 000	
日精エー・エス・ビー機械	500	6, 030. 00	3, 015, 000	
サトーホールディングス	2, 200	2, 607. 00	5, 735, 400	
技研製作所	1, 400	5, 110. 00	7, 154, 000	
日本エアータック	500	1, 461. 00	730, 500	
カワタ	400	965. 00	386, 000	
日精樹脂工業	1, 300	931. 00	1, 210, 300	
オカダアイヨン	500	1, 169. 00	584, 500	
ワイエイシイホールディングス	700	1, 079. 00	755, 300	
小松製作所	73, 300	3, 166. 00	232, 067, 800	
住友重機械工業	9, 300	2, 912. 00	27, 081, 600	
日立建機	7, 600	3, 080. 00	23, 408, 000	
日工	2, 400	759. 00	1, 821, 600	
巴工業	600	2, 056. 00	1, 233, 600	
井関農機	1, 600	1, 464. 00	2, 342, 400	
TOWA	1, 500	2, 070. 00	3, 105, 000	
丸山製作所	300	1, 637. 00	491, 100	
北川鉄工所	700	1, 514. 00	1, 059, 800	
ローツェ	700	8, 100. 00	5, 670, 000	
タカキタ	600	707. 00	424, 200	
クボタ	85, 100	2, 554. 00	217, 345, 400	
荏原実業	400	4, 815. 00	1, 926, 000	
三菱化工機	500	3, 070. 00	1, 535, 000	
月島機械	2, 900	1, 360. 00	3, 944, 000	
帝国電機製作所	1, 100	1, 233. 00	1, 356, 300	
新東工業	3, 800	772. 00	2, 933, 600	
澁谷工業	1, 400	3, 675. 00	5, 145, 000	

アイチ コーポレーション	2,700	927.00	2,502,900	
小森コーポレーション	4,100	700.00	2,870,000	
鶴見製作所	1,200	1,769.00	2,122,800	
住友精密工業	200	2,060.00	412,000	
日本ギア工業	800	312.00	249,600	
酒井重工業	300	2,179.00	653,700	
荏原製作所	6,700	3,700.00	24,790,000	
石井鐵工所	200	2,896.00	579,200	
西島製作所	1,600	866.00	1,385,600	
北越工業	1,700	1,094.00	1,859,800	
ダイキン工業	20,600	23,040.00	474,624,000	
オルガノ	500	6,390.00	3,195,000	
トーヨーカネツ	600	2,621.00	1,572,600	
栗田工業	8,800	4,265.00	37,532,000	
椿本チエイン	2,300	2,835.00	6,520,500	
大同工業	800	771.00	616,800	
木村化工機	1,400	619.00	866,600	
アネスト岩田	2,700	1,120.00	3,024,000	
ダイフク	8,900	10,870.00	96,743,000	
サムコ	400	3,760.00	1,504,000	
加藤製作所	900	974.00	876,600	
油研工業	200	1,692.00	338,400	
タダノ	7,900	998.00	7,884,200	
フジテック	5,600	2,760.00	15,456,000	
C K D	3,800	2,503.00	9,511,400	
キトー	1,400	1,524.00	2,133,600	
平和	4,600	1,575.00	7,245,000	
理想科学工業	1,300	1,418.00	1,843,400	
SANKYO	3,900	2,953.00	11,516,700	
日本金銭機械	2,200	541.00	1,190,200	
マースグループホールディングス	1,000	1,616.00	1,616,000	
フクシマガリレイ	1,100	4,320.00	4,752,000	
オーイズミ	800	420.00	336,000	
ダイコク電機	700	957.00	669,900	
竹内製作所	2,700	2,648.00	7,149,600	
アマノ	4,300	2,577.00	11,081,100	

J U K I	2, 400	687. 00	1, 648, 800	
サンデンホールディングス	2, 600	420. 00	1, 092, 000	
蛇の目ミシン工業	1, 500	917. 00	1, 375, 500	
マックス	2, 200	1, 611. 00	3, 544, 200	
グローリー	4, 200	2, 321. 00	9, 748, 200	
新晃工業	1, 500	2, 068. 00	3, 102, 000	
大和冷機工業	2, 600	1, 096. 00	2, 849, 600	
セガサミーホールディングス	14, 700	1, 818. 00	26, 724, 600	
日本ピストンリング	600	1, 123. 00	673, 800	
リケン	700	2, 376. 00	1, 663, 200	
T P R	2, 200	1, 633. 00	3, 592, 600	
ツバキ・ナカシマ	3, 200	1, 336. 00	4, 275, 200	
ホシザキ	5, 100	10, 480. 00	53, 448, 000	
大豊工業	1, 300	773. 00	1, 004, 900	
日本精工	33, 300	1, 048. 00	34, 898, 400	
N T N	38, 400	307. 00	11, 788, 800	
ジェイテクト	15, 500	1, 167. 00	18, 088, 500	
不二越	1, 500	4, 435. 00	6, 652, 500	
日本トムソン	4, 600	520. 00	2, 392, 000	
T H K	10, 100	3, 700. 00	37, 370, 000	
ユーシン精機	1, 100	1, 007. 00	1, 107, 700	
前澤給装工業	600	2, 310. 00	1, 386, 000	
イーグル工業	2, 000	1, 197. 00	2, 394, 000	
前澤工業	1, 000	585. 00	585, 000	
日本ピラー工業	1, 600	1, 840. 00	2, 944, 000	
キッツ	5, 000	616. 00	3, 080, 000	
マキタ	21, 100	4, 805. 00	101, 385, 500	
日立造船	12, 900	658. 00	8, 488, 200	
三菱重工業	25, 400	3, 026. 00	76, 860, 400	
I H I	10, 900	1, 930. 00	21, 037, 000	
スター精密	2, 500	1, 647. 00	4, 117, 500	
日清紡ホールディングス	9, 800	818. 00	8, 016, 400	
イビデン	7, 800	4, 910. 00	38, 298, 000	
コニカミノルタ	33, 000	571. 00	18, 843, 000	
ブラザー工業	19, 800	2, 403. 00	47, 579, 400	
ミネベアミツミ	27, 900	2, 710. 00	75, 609, 000	



日立製作所	77,900	4,892.00	381,086,800	
三菱電機	161,900	1,698.50	274,987,150	
富士電機	9,800	4,490.00	44,002,000	
東洋電機製造	700	1,218.00	852,600	
安川電機	17,400	5,760.00	100,224,000	
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,378.00	3,031,600	
明電舎	2,800	2,438.00	6,826,400	
オリジン	400	1,348.00	539,200	
山洋電気	800	6,280.00	5,024,000	
デンヨー	1,400	2,089.00	2,924,600	
東芝テック	1,800	4,025.00	7,245,000	
芝浦メカトロニクス	300	5,050.00	1,515,000	
マブチモーター	4,500	4,780.00	21,510,000	
日本電産	39,000	14,800.00	577,200,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	632.00	695,200	
トレックス・セミコンダクター	900	1,509.00	1,358,100	
東光高岳	800	1,643.00	1,314,400	
ダイヘン	1,800	4,945.00	8,901,000	
ヤーマン	2,600	1,905.00	4,953,000	
JVCケンウッド	14,600	205.00	2,993,000	
ミマキエンジニアリング	1,600	568.00	908,800	
IPEX	800	2,208.00	1,766,400	
日新電機	3,800	1,307.00	4,966,600	
大崎電気工業	3,300	624.00	2,059,200	
オムロン	13,500	9,650.00	130,275,000	
日東工業	2,300	2,202.00	5,064,600	
IDEC	2,200	1,830.00	4,026,000	
正興電機製作所	400	2,459.00	983,600	
不二電機工業	300	1,292.00	387,600	
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,800	3,410.00	19,778,000	
サクサホールディングス	400	1,447.00	578,800	
メルコホールディングス	600	3,745.00	2,247,000	
テクノメディカ	400	1,630.00	652,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,980.00	990,000	
日本電気	20,600	6,260.00	128,956,000	
富士通	14,600	16,025.00	233,965,000	

沖電気工業	6,600	1,093.00	7,213,800	
岩崎通信機	700	873.00	611,100	
電気興業	800	2,949.00	2,359,200	
サンケン電気	1,900	5,690.00	10,811,000	
ナカヨ	300	1,439.00	431,700	
アイホン	900	1,771.00	1,593,900	
ルネサスエレクトロニクス	69,700	1,282.00	89,355,400	
セイコーエプソン	20,200	1,837.00	37,107,400	
ワコム	11,700	854.00	9,991,800	
アルバック	3,000	5,180.00	15,540,000	
アクセル	700	810.00	567,000	
E I Z O	1,400	3,745.00	5,243,000	
日本信号	3,700	953.00	3,526,100	
京三製作所	3,500	435.00	1,522,500	
能美防災	2,100	2,300.00	4,830,000	
ホーチキ	1,200	1,296.00	1,555,200	
星和電機	800	666.00	532,800	
エレコム	1,800	4,930.00	8,874,000	
パナソニック	172,800	1,471.50	254,275,200	
シャープ	18,800	2,330.00	43,804,000	
アンリツ	9,700	2,540.00	24,638,000	
富士通ゼネラル	5,000	3,225.00	16,125,000	
ソニー	101,500	11,845.00	1,202,267,500	
TDK	7,800	16,170.00	126,126,000	
帝国通信工業	700	1,091.00	763,700	
タムラ製作所	6,100	562.00	3,428,200	
アルプスアルパイン	13,300	1,513.00	20,122,900	
池上通信機	600	852.00	511,200	
鈴木	800	1,178.00	942,400	
日本トリム	400	4,465.00	1,786,000	
ローランド ディー. ジー.	1,000	1,745.00	1,745,000	
フォスター電機	1,800	1,455.00	2,619,000	
SMK	500	3,050.00	1,525,000	
ヨコオ	1,200	3,070.00	3,684,000	
ホシデン	4,500	1,073.00	4,828,500	
ヒロセ電機	2,500	16,110.00	40,275,000	

日本航空電子工業	3,700	1,684.00	6,230,800	
TOA	1,900	928.00	1,763,200	
マクセルホールディングス	3,300	1,448.00	4,778,400	
古野電気	2,100	1,165.00	2,446,500	
ユニデンホールディングス	400	2,486.00	994,400	
スミダコーポレーション	1,400	1,020.00	1,428,000	
アイコム	700	2,867.00	2,006,900	
リオン	700	3,135.00	2,194,500	
本多通信工業	1,500	503.00	754,500	
船井電機	2,000	451.00	902,000	
横河電機	16,200	2,196.00	35,575,200	
新電元工業	700	3,235.00	2,264,500	
アズビル	10,900	4,905.00	53,464,500	
東亜ディーケーケー	800	861.00	688,800	
日本光電工業	6,700	3,095.00	20,736,500	
チノー	500	1,431.00	715,500	
共和電業	1,600	382.00	611,200	
日本電子材料	600	1,824.00	1,094,400	
堀場製作所	3,200	7,210.00	23,072,000	
アドバンテスト	12,100	9,150.00	110,715,000	
小野測器	600	547.00	328,200	
エスベック	1,400	1,946.00	2,724,400	
キーエンス	15,900	57,690.00	917,271,000	
日置電機	800	4,000.00	3,200,000	
シスメックス	12,600	12,010.00	151,326,000	
日本マイクロニクス	2,800	1,640.00	4,592,000	
メガチップス	1,600	2,993.00	4,788,800	
OBARA GROUP	900	4,015.00	3,613,500	
澤藤電機	200	2,175.00	435,000	
原田工業	700	925.00	647,500	
コーセル	2,100	1,177.00	2,471,700	
イリソ電子工業	1,400	5,210.00	7,294,000	
オブテックスグループ	2,700	1,952.00	5,270,400	
千代田インテグレ	700	1,798.00	1,258,600	
アイ・オー・データ機器	500	1,010.00	505,000	
レーザーテック	7,100	14,290.00	101,459,000	

スタンレー電気	11,300	3,645.00	41,188,500	
岩崎電気	600	1,551.00	930,600	
ウシオ電機	8,400	1,402.00	11,776,800	
岡谷電機産業	1,400	387.00	541,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,800	354.00	637,200	
エノモト	500	1,833.00	916,500	
日本セラミック	1,700	3,035.00	5,159,500	
遠藤照明	800	582.00	465,600	
古河電池	1,200	1,663.00	1,995,600	
双信電機	900	448.00	403,200	
山一電機	1,100	1,514.00	1,665,400	
図研	1,000	2,943.00	2,943,000	
日本電子	2,900	4,265.00	12,368,500	
カシオ計算機	13,100	2,001.00	26,213,100	
ファナック	14,200	28,050.00	398,310,000	
日本シイエムケイ	3,600	432.00	1,555,200	
エンプラス	700	4,820.00	3,374,000	
大真空	600	2,392.00	1,435,200	
ローム	6,700	11,680.00	78,256,000	
浜松ホトニクス	11,600	6,900.00	80,040,000	
三井ハイテック	1,600	4,165.00	6,664,000	
新光電気工業	5,400	2,876.00	15,530,400	
京セラ	24,700	6,977.00	172,331,900	
太陽誘電	7,200	5,470.00	39,384,000	
村田製作所	47,600	9,752.00	464,195,200	
双葉電子工業	2,900	986.00	2,859,400	
北陸電気工業	700	946.00	662,200	
ニチコン	5,100	1,392.00	7,099,200	
日本ケミコン	1,700	1,753.00	2,980,100	
KOA	2,300	1,616.00	3,716,800	
市光工業	2,500	819.00	2,047,500	
小糸製作所	9,700	7,990.00	77,503,000	
ミツバ	3,200	613.00	1,961,600	
S C R E E Nホールディングス	2,800	8,710.00	24,388,000	
キャノン電子	1,600	1,723.00	2,756,800	
キャノン	80,600	2,386.50	192,351,900	

リコー	41,400	950.00	39,330,000	
象印マホービン	4,400	1,880.00	8,272,000	
MUTOHホールディングス	200	1,580.00	316,000	
東京エレクトロン	9,500	42,990.00	408,405,000	
トヨタ紡織	4,700	1,873.00	8,803,100	
芦森工業	400	1,068.00	427,200	
ユニプレス	2,700	1,073.00	2,897,100	
豊田自動織機	13,100	9,680.00	126,808,000	
モリタホールディングス	2,600	1,820.00	4,732,000	
三櫻工業	2,300	936.00	2,152,800	
デンソー	35,600	6,969.00	248,096,400	
東海理化電機製作所	4,200	1,910.00	8,022,000	
三井E&Sホールディングス	6,500	427.00	2,775,500	
川崎重工業	12,600	2,315.00	29,169,000	
名村造船所	5,600	193.00	1,080,800	
日本車輛製造	600	2,620.00	1,572,000	
三菱ロジスネクスト	2,200	1,190.00	2,618,000	
近畿車輛	200	1,236.00	247,200	
日産自動車	191,200	627.70	120,016,240	
いすゞ自動車	46,900	1,122.00	52,621,800	
トヨタ自動車	164,100	8,413.00	1,380,573,300	代用有価証券 23,000株
日野自動車	20,300	970.00	19,691,000	
三菱自動車工業	60,400	317.00	19,146,800	
エフテック	1,200	675.00	810,000	
レンシップホールディングス	600	599.00	359,400	
GMB	400	932.00	372,800	
ファルテック	300	874.00	262,200	
武蔵精密工業	3,600	1,910.00	6,876,000	
日産車体	2,300	875.00	2,012,500	
新明和工業	4,600	955.00	4,393,000	
極東開発工業	2,700	1,607.00	4,338,900	
トピー工業	1,400	1,428.00	1,999,200	
ティラド	500	1,782.00	891,000	
タチエス	2,500	1,185.00	2,962,500	
NOK	7,900	1,417.00	11,194,300	

フタバ産業	4,100	562.00	2,304,200	
K Y B	1,900	3,190.00	6,061,000	
大同メタル工業	3,400	592.00	2,012,800	
プレス工業	7,900	337.00	2,662,300	
ミクニ	2,200	302.00	664,400	
太平洋工業	3,400	1,316.00	4,474,400	
河西工業	2,600	445.00	1,157,000	
アイシン精機	11,900	3,700.00	44,030,000	
マツダ	50,900	890.00	45,301,000	
今仙電機製作所	1,400	750.00	1,050,000	
本田技研工業	127,500	3,019.00	384,922,500	
スズキ	32,100	4,906.00	157,482,600	
S U B A R U	46,400	2,200.00	102,080,000	
安永	900	1,252.00	1,126,800	
ヤマハ発動機	22,900	2,460.00	56,334,000	
T B K	1,900	445.00	845,500	
エクセディ	2,200	1,638.00	3,603,600	
豊田合成	5,200	3,035.00	15,782,000	
愛三工業	2,600	589.00	1,531,400	
盟和産業	200	915.00	183,000	
日本プラスト	1,400	559.00	782,600	
ヨロズ	1,500	1,417.00	2,125,500	
エフ・シー・シー	2,700	1,685.00	4,549,500	
シマノ	6,100	26,325.00	160,582,500	
テイ・エス テック	3,800	3,220.00	12,236,000	
ジャムコ	1,100	752.00	827,200	
テルモ	49,600	4,512.00	223,795,200	
クリエートメディック	500	978.00	489,000	
日機装	5,300	1,064.00	5,639,200	
日本エム・ディ・エム	900	2,138.00	1,924,200	
島津製作所	20,800	4,325.00	89,960,000	
J M S	1,400	1,083.00	1,516,200	
長野計器	1,200	955.00	1,146,000	
ブイ・テクノロジー	800	6,210.00	4,968,000	
東京計器	1,000	922.00	922,000	
愛知時計電機	200	4,390.00	878,000	

インターアクション	800	2,564.00	2,051,200	
オーバル	1,600	295.00	472,000	
東京精密	2,700	4,835.00	13,054,500	
マニー	6,400	2,804.00	17,945,600	
ニコン	24,900	913.00	22,733,700	
トプコン	8,200	1,429.00	11,717,800	
オリンパス	89,600	2,062.00	184,755,200	
理研計器	1,400	3,040.00	4,256,000	
タムロン	1,400	2,008.00	2,811,200	
HOYA	32,100	13,060.00	419,226,000	
シード	800	640.00	512,000	
ノーリツ鋼機	1,500	2,355.00	3,532,500	
エー・アンド・デイ	1,400	1,367.00	1,913,800	
朝日インテック	17,000	3,400.00	57,800,000	
シチズン時計	21,400	387.00	8,281,800	
リズム	600	721.00	432,600	
大研医器	1,400	574.00	803,600	
メニコン	2,500	7,050.00	17,625,000	
シンシア	200	694.00	138,800	
松風	800	1,911.00	1,528,800	
セイコーホールディングス	2,500	1,602.00	4,005,000	
ニプロ	12,100	1,261.00	15,258,100	
中本パックス	400	1,793.00	717,200	
スノーピーク	1,000	2,049.00	2,049,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,795.00	7,192,500	
トランザクション	900	1,152.00	1,036,800	
粧美堂	700	401.00	280,700	
ニホンフラッシュ	1,400	1,238.00	1,733,200	
前田工織	1,800	2,939.00	5,290,200	
永大産業	2,000	306.00	612,000	
アートネイチャー	1,500	695.00	1,042,500	
バンダイナムコホールディングス	13,400	8,801.00	117,933,400	
アイフィスジャパン	400	722.00	288,800	
共立印刷	2,600	131.00	340,600	
SHOEI	1,400	4,255.00	5,957,000	
フランスベッドホールディングス	2,400	972.00	2,332,800	

パイロットコーポレーション	2,900	3,180.00	9,222,000	
萩原工業	900	1,486.00	1,337,400	
トッパン・フォームズ	2,900	1,121.00	3,250,900	
フジシールインターナショナル	3,300	2,191.00	7,230,300	
タカラトミー	7,500	973.00	7,297,500	
廣済堂	1,200	880.00	1,056,000	
エステールホールディングス	700	660.00	462,000	
タカノ	700	608.00	425,600	
プロネクス	1,300	1,177.00	1,530,100	
ホクシン	1,500	115.00	172,500	
ウッドワン	500	1,110.00	555,000	
大建工業	1,100	2,033.00	2,236,300	
凸版印刷	24,500	1,571.00	38,489,500	
大日本印刷	19,500	1,941.00	37,849,500	
共同印刷	500	3,365.00	1,682,500	
N I S S H A	3,300	1,508.00	4,976,400	
光村印刷	100	1,745.00	174,500	
TAKARA & COMPANY	800	1,782.00	1,425,600	
アシックス	14,300	1,985.00	28,385,500	
ツツミ	500	1,979.00	989,500	
小松ウオール工業	600	1,807.00	1,084,200	
ヤマハ	9,700	6,040.00	58,588,000	
河合楽器製作所	500	3,525.00	1,762,500	
クリナップ	1,400	496.00	694,400	
ピジョン	10,400	4,565.00	47,476,000	
オリバー	400	2,593.00	1,037,200	
兼松サステック	200	1,785.00	357,000	
キングジム	1,500	892.00	1,338,000	
リンテック	3,400	2,400.00	8,160,000	
イトーキ	3,500	355.00	1,242,500	
任天堂	9,300	66,340.00	616,962,000	
三菱鉛筆	2,600	1,418.00	3,686,800	
タカラスタンダード	3,300	1,657.00	5,468,100	
コクヨ	8,000	1,460.00	11,680,000	
ナカバヤシ	1,400	618.00	865,200	
オカムラ	6,400	1,047.00	6,700,800	



美津濃	1,700	2,283.00	3,881,100	
東京電力ホールディングス	137,500	390.00	53,625,000	
中部電力	49,500	1,338.50	66,255,750	
関西電力	61,300	1,080.00	66,204,000	
中国電力	23,400	1,310.00	30,654,000	
北陸電力	14,800	694.00	10,271,200	
東北電力	37,900	943.00	35,739,700	
四国電力	13,500	756.00	10,206,000	
九州電力	35,800	950.00	34,010,000	
北海道電力	15,400	472.00	7,268,800	
沖縄電力	3,200	1,431.00	4,579,200	
電源開発	12,900	1,736.00	22,394,400	
エフオン	1,000	1,120.00	1,120,000	
イーレックス	2,400	1,837.00	4,408,800	
レノバ	2,700	3,555.00	9,598,500	
東京瓦斯	31,200	2,281.50	71,182,800	
大阪瓦斯	29,300	1,974.00	57,838,200	
東邦瓦斯	8,000	6,590.00	52,720,000	
北海道瓦斯	800	1,603.00	1,282,400	
広島ガス	3,100	380.00	1,178,000	
西部瓦斯	1,800	2,896.00	5,212,800	
静岡ガス	4,500	953.00	4,288,500	
メタウォーター	1,800	2,219.00	3,994,200	
S B S ホールディングス	1,200	2,822.00	3,386,400	
東武鉄道	16,900	3,175.00	53,657,500	
相鉄ホールディングス	5,600	2,586.00	14,481,600	
東急	40,900	1,425.00	58,282,500	
京浜急行電鉄	20,800	1,764.00	36,691,200	
小田急電鉄	26,000	3,375.00	87,750,000	
京王電鉄	9,100	8,620.00	78,442,000	
京成電鉄	12,100	3,985.00	48,218,500	
富士急行	2,200	5,780.00	12,716,000	
東日本旅客鉄道	28,500	7,796.00	222,186,000	
西日本旅客鉄道	14,500	6,499.00	94,235,500	
東海旅客鉄道	13,500	17,420.00	235,170,000	
西武ホールディングス	19,600	1,192.00	23,363,200	

鴻池運輸	2,500	1,076.00	2,690,000	
西日本鉄道	4,500	3,120.00	14,040,000	
ハマキョウレックス	1,200	3,175.00	3,810,000	
サカイ引越センター	700	5,210.00	3,647,000	
近鉄グループホールディングス	15,300	4,660.00	71,298,000	
阪急阪神ホールディングス	20,400	3,645.00	74,358,000	
南海電気鉄道	7,300	2,708.00	19,768,400	
京阪ホールディングス	6,800	5,130.00	34,884,000	
神戸電鉄	400	3,790.00	1,516,000	
名古屋鉄道	12,600	2,851.00	35,922,600	
山陽電気鉄道	1,100	2,027.00	2,229,700	
日本通運	5,300	7,630.00	40,439,000	
ヤマトホールディングス	21,500	2,867.00	61,640,500	
山九	3,900	4,345.00	16,945,500	
丸運	500	256.00	128,000	
丸全昭和運輸	1,200	3,425.00	4,110,000	
センコーグループホールディングス	8,400	1,051.00	8,828,400	
トナミホールディングス	400	5,720.00	2,288,000	
ニッコンホールディングス	5,100	2,221.00	11,327,100	
日本石油輸送	200	2,665.00	533,000	
福山通運	1,900	4,475.00	8,502,500	
セイノーホールディングス	11,400	1,544.00	17,601,600	
エスライン	300	900.00	270,000	
神奈川中央交通	400	3,850.00	1,540,000	
日立物流	3,400	3,300.00	11,220,000	
丸和運輸機関	3,200	2,176.00	6,963,200	
C&Fロジホールディングス	1,500	1,926.00	2,889,000	
九州旅客鉄道	11,900	2,650.00	31,535,000	
S Gホールディングス	29,000	2,639.00	76,531,000	
日本郵船	12,800	2,796.00	35,788,800	
商船三井	9,100	2,941.00	26,763,100	
川崎汽船	4,800	1,846.00	8,860,800	
N S ユナイテッド海運	700	1,532.00	1,072,400	
明治海運	1,700	391.00	664,700	
飯野海運	7,300	440.00	3,212,000	
共栄タンカー	300	966.00	289,800	

乾汽船	900	949.00	854,100	
日本航空	37,400	2,240.00	83,776,000	
ANAホールディングス	41,400	2,391.00	98,987,400	
パスコ	300	1,446.00	433,800	
トランコム	500	8,590.00	4,295,000	
日新	1,200	1,412.00	1,694,400	
三菱倉庫	5,300	3,240.00	17,172,000	
三井倉庫ホールディングス	1,600	2,275.00	3,640,000	
住友倉庫	5,500	1,411.00	7,760,500	
澁澤倉庫	800	2,367.00	1,893,600	
東陽倉庫	2,500	336.00	840,000	
日本トランスシティ	3,300	550.00	1,815,000	
ケイヒン	200	1,373.00	274,600	
中央倉庫	900	1,191.00	1,071,900	
川西倉庫	300	1,196.00	358,800	
安田倉庫	1,200	953.00	1,143,600	
ファイズホールディングス	300	1,076.00	322,800	
東洋埠頭	400	1,425.00	570,000	
宇徳	1,000	469.00	469,000	
上組	8,500	2,002.00	17,017,000	
サンリツ	400	718.00	287,200	
キムラユニティー	300	1,120.00	336,000	
キューソー流通システム	400	1,595.00	638,000	
近鉄エクスプレス	2,900	2,786.00	8,079,400	
東海運	1,000	318.00	318,000	
エーアイテイー	1,000	1,072.00	1,072,000	
内外トランスライン	600	1,330.00	798,000	
日本コンセプト	500	1,704.00	852,000	
NECネットエスアイ	5,200	1,946.00	10,119,200	
クロスキャット	400	1,180.00	472,000	
システナ	5,700	1,981.00	11,291,700	
デジタルアーツ	900	10,520.00	9,468,000	
日鉄ソリューションズ	2,400	3,400.00	8,160,000	
キューブシステム	900	1,182.00	1,063,800	
エイジア	200	1,860.00	372,000	
コア	700	1,572.00	1,100,400	

ラクーンホールディングス	1,200	2,112.00	2,534,400	
ソリトンシステムズ	800	1,936.00	1,548,800	
ソフトクリエイトホールディングス	600	2,689.00	1,613,400	
T I S	15,900	2,395.00	38,080,500	
J N Sホールディングス	800	574.00	459,200	
電算システム	600	3,150.00	1,890,000	
グリー	9,800	631.00	6,183,800	
GMOペパボ	100	6,100.00	610,000	
コーエーテクモホールディングス	3,200	6,490.00	20,768,000	
三菱総合研究所	700	4,205.00	2,943,500	
ボルテージ	500	563.00	281,500	
電算	200	2,545.00	509,000	
A G S	800	864.00	691,200	
ファインデックス	1,400	1,206.00	1,688,400	
ブレインパッド	400	4,280.00	1,712,000	
K L a b	3,000	908.00	2,724,000	
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディングス	2,100	1,273.00	2,673,300	
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,440.00	488,000	
ネクソン	40,100	3,315.00	132,931,500	
アイスタイル	5,000	492.00	2,460,000	
エムアップホールディングス	400	2,481.00	992,400	
エイチーム	1,100	1,278.00	1,405,800	
エニグモ	1,500	1,317.00	1,975,500	
テクノスジャパン	1,200	739.00	886,800	
コロプラ	5,200	964.00	5,012,800	
ブロードリーフ	7,900	647.00	5,111,300	
クロス・マーケティンググループ	800	397.00	317,600	
デジタルハーツホールディングス	700	1,454.00	1,017,800	
システム情報	1,200	1,106.00	1,327,200	
メディアドゥ	600	6,430.00	3,858,000	
じげん	4,000	419.00	1,676,000	
ブイキューブ	900	3,060.00	2,754,000	
エンカレッジ・テクノロジー	300	670.00	201,000	
サイバーリンクス	600	2,125.00	1,275,000	
フィックスターズ	1,800	1,020.00	1,836,000	

CARTA HOLDINGS	600	1,368.00	820,800	
オブティム	1,100	3,330.00	3,663,000	
セレス	500	2,782.00	1,391,000	
SHIFT	700	13,290.00	9,303,000	
ティーガイア	1,700	1,914.00	3,253,800	
セック	200	2,875.00	575,000	
日本アジアグループ	1,600	1,226.00	1,961,600	
テクマトリックス	2,500	1,982.00	4,955,000	
プロシップ	400	1,410.00	564,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	2,676.00	10,436,400	
GMOペイメントゲートウェイ	3,400	15,610.00	53,074,000	
ザッパラス	700	475.00	332,500	
システムリサーチ	500	1,795.00	897,500	
インターネットイニシアティブ	4,200	2,379.00	9,991,800	
さくらインターネット	1,800	703.00	1,265,400	
ヴィンクス	400	1,252.00	500,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	10,110.00	4,044,000	
SRAホールディングス	800	2,607.00	2,085,600	
システムインテグレータ	500	632.00	316,000	
朝日ネット	1,300	854.00	1,110,200	
eBASE	1,900	992.00	1,884,800	
アバント	1,700	1,452.00	2,468,400	
アドソル日進	600	2,888.00	1,732,800	
ODKソリューションズ	200	778.00	155,600	
フリービット	1,000	1,001.00	1,001,000	
コムチュア	1,500	3,060.00	4,590,000	
サイバーコム	300	1,667.00	500,100	
アステリア	1,200	1,058.00	1,269,600	
アイル	900	1,526.00	1,373,400	
マークライNZ	700	2,698.00	1,888,600	
メディカル・データ・ビジョン	1,800	2,386.00	4,294,800	
gumi	2,300	949.00	2,182,700	
ショーケース	400	962.00	384,800	
モバイルファクトリー	400	1,047.00	418,800	
テラスカイ	500	4,000.00	2,000,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,660.00	1,328,000	

P C I ホールディングス	600	1, 366. 00	819, 600	
パイプドHD	300	1, 587. 00	476, 100	
アイビーシー	300	1, 110. 00	333, 000	
ネオジャパン	300	1, 839. 00	551, 700	
P R T I M E S	300	3, 655. 00	1, 096, 500	
ランドコンピュータ	200	1, 139. 00	227, 800	
ダブルスタンダード	200	4, 435. 00	887, 000	
オーブンドア	1, 000	2, 186. 00	2, 186, 000	
マイネット	600	929. 00	557, 400	
アカツキ	700	4, 330. 00	3, 031, 000	
ベネフィットジャパン	100	1, 883. 00	188, 300	
U b i c o mホールディングス	400	3, 205. 00	1, 282, 000	
カナミックネットワーク	1, 500	803. 00	1, 204, 500	
ノムラシステムコーポレーション	800	367. 00	293, 600	
チェンジ	2, 200	3, 810. 00	8, 382, 000	
シンクロ・フード	1, 000	376. 00	376, 000	
オークネット	900	1, 331. 00	1, 197, 900	
キャピタル・アセット・プランニング	200	1, 008. 00	201, 600	
セグエグループ	400	1, 288. 00	515, 200	
エイトレッド	300	2, 572. 00	771, 600	
A O I T Y O H o l d i n g s	1, 700	464. 00	788, 800	
マクロミル	3, 400	867. 00	2, 947, 800	
ビーグリー	300	1, 671. 00	501, 300	
オロ	500	3, 820. 00	1, 910, 000	
ユーザーローカル	300	4, 430. 00	1, 329, 000	
テモナ	400	989. 00	395, 600	
ニーズウェル	400	683. 00	273, 200	
サインポスト	400	1, 011. 00	404, 400	
ソルクシーズ	600	1, 015. 00	609, 000	
フェイス	500	836. 00	418, 000	
プロトコーポレーション	1, 400	1, 218. 00	1, 705, 200	
ハイマックス	400	1, 494. 00	597, 600	
野村総合研究所	29, 000	3, 615. 00	104, 835, 000	
サイバネットシステム	1, 200	911. 00	1, 093, 200	
C E ホールディングス	900	591. 00	531, 900	
日本システム技術	300	1, 542. 00	462, 600	

インテージホールディングス	2,000	1,222.00	2,444,000	
東邦システムサイエンス	400	947.00	378,800	
ソースネクスト	7,700	312.00	2,402,400	
インフォコム	1,400	3,080.00	4,312,000	
HEROZ	500	3,485.00	1,742,500	
ラクスル	1,300	3,935.00	5,115,500	
I P S	300	2,719.00	815,700	
F I G	1,900	265.00	503,500	
システムサポート	500	1,536.00	768,000	
イーソル	900	1,416.00	1,274,400	
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,669.00	3,004,200	
E d u L a b	200	7,450.00	1,490,000	
東海ソフト	200	1,174.00	234,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	2,144.00	643,200	
東名	100	1,095.00	109,500	
ヴィッツ	100	2,256.00	225,600	
トビラシステムズ	200	1,642.00	328,400	
L i n k - U	100	1,426.00	142,600	
ギフトイ	700	3,375.00	2,362,500	
ベース	100	5,380.00	538,000	
フォーカスシステムズ	1,100	971.00	1,068,100	
クレスコ	1,100	1,425.00	1,567,500	
フジ・メディア・ホールディングス	16,400	1,309.00	21,467,600	
オービック	5,000	19,470.00	97,350,000	
ジャストシステム	2,200	7,620.00	16,764,000	
T D C ソフト	1,400	983.00	1,376,200	
Zホールディングス	218,300	675.00	147,352,500	
トレンドマイクロ	8,500	6,020.00	51,170,000	
I Dホールディングス	600	1,234.00	740,400	
日本オラクル	3,200	12,660.00	40,512,000	
アルファシステムズ	400	3,820.00	1,528,000	
フューチャー	1,900	1,936.00	3,678,400	
C A C   H o l d i n g s	1,000	1,435.00	1,435,000	
S Bテクノロジー	600	3,160.00	1,896,000	
トーセ	500	806.00	403,000	

オービックビジネスコンサルタント	1,600	6,610.00	10,576,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,200	3,570.00	25,704,000	
アイティフォー	2,100	888.00	1,864,800	
東計電算	200	4,315.00	863,000	
エックスネット	200	1,005.00	201,000	
大塚商会	8,600	5,280.00	45,408,000	
サイボウズ	1,800	2,754.00	4,957,200	
電通国際情報サービス	2,000	3,785.00	7,570,000	
A C C E S S	1,500	779.00	1,168,500	
デジタルガレージ	2,600	4,280.00	11,128,000	
EMシステムズ	2,600	895.00	2,327,000	
ウェザーニューズ	500	5,180.00	2,590,000	
C I J	1,100	902.00	992,200	
ビジネスエンジニアリング	200	3,380.00	676,000	
日本エンタープライズ	1,800	241.00	433,800	
WOWOW	800	2,892.00	2,313,600	
スカラ	1,500	825.00	1,237,500	
インテリジェント ウェイブ	1,000	698.00	698,000	
I M A G I C A G R O U P	1,400	459.00	642,600	
ネットワンシステムズ	6,500	3,535.00	22,977,500	
システムソフト	4,800	119.00	571,200	
アルゴグラフィックス	1,200	3,115.00	3,738,000	
マーベラス	2,600	943.00	2,451,800	
エイベックス	2,800	1,472.00	4,121,600	
日本ユニシス	5,500	3,535.00	19,442,500	
兼松エレクトロニクス	900	3,795.00	3,415,500	
都築電気	600	1,594.00	956,400	
T B S ホールディングス	10,500	2,124.00	22,302,000	
日本テレビホールディングス	13,200	1,398.00	18,453,600	
朝日放送グループホールディングス	1,500	714.00	1,071,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,900	2,254.00	11,044,600	
スカパー J S A T ホールディングス	10,400	468.00	4,867,200	
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,436.00	2,923,200	
日本B S 放送	600	1,171.00	702,600	
ビジョン	2,000	989.00	1,978,000	
スマートバリュー	500	941.00	470,500	



USEN-NEXT HOLDINGS	700	1,880.00	1,316,000	
コネクシオ	1,100	1,415.00	1,556,500	
クロップス	300	793.00	237,900	
日本電信電話	186,000	2,805.50	521,823,000	
KDDI	127,600	3,315.00	422,994,000	
ソフトバンク	144,700	1,432.00	207,210,400	
光通信	1,900	22,460.00	42,674,000	
エムティーアイ	1,600	892.00	1,427,200	
GMOインターネット	5,700	3,620.00	20,634,000	
ファイバーゲート	600	2,244.00	1,346,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	470.00	235,000	
KADOKAWA	4,300	3,815.00	16,404,500	
学研ホールディングス	2,100	1,893.00	3,975,300	
ゼンリン	2,900	1,412.00	4,094,800	
昭文社ホールディングス	800	479.00	383,200	
インプレスホールディングス	1,500	195.00	292,500	
アイネット	800	1,547.00	1,237,600	
松竹	1,100	15,290.00	16,819,000	
東宝	9,400	4,340.00	40,796,000	
東映	500	21,210.00	10,605,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	42,200	1,668.00	70,389,600	
ピー・シー・エー	300	4,375.00	1,312,500	
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,803.00	1,081,800	
DTS	3,300	2,468.00	8,144,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,800	7,140.00	48,552,000	
シーイーシー	1,700	1,464.00	2,488,800	
カプコン	6,800	6,880.00	46,784,000	
アイ・エス・ビー	700	1,363.00	954,100	
ジャステック	1,000	1,250.00	1,250,000	
SCSK	3,700	6,650.00	24,605,000	
日本システムウェア	500	2,095.00	1,047,500	
アイネス	1,600	1,397.00	2,235,200	
TKC	1,300	6,960.00	9,048,000	
富士ソフト	1,700	5,890.00	10,013,000	
NSD	5,100	2,002.00	10,210,200	
コナミホールディングス	5,800	7,210.00	41,818,000	

福井コンピュータホールディングス	700	3,970.00	2,779,000	
J B C Cホールディングス	1,100	1,505.00	1,655,500	
ミロク情報サービス	1,600	2,210.00	3,536,000	
ソフトバンクグループ	126,100	9,797.00	1,235,401,700	
ハウスイ	100	999.00	99,900	
高千穂交易	600	1,228.00	736,800	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,591.00	477,300	
伊藤忠食品	400	5,300.00	2,120,000	
エレマテック	1,300	1,031.00	1,340,300	
J A L U X	500	1,557.00	778,500	
あらた	1,300	4,925.00	6,402,500	
トーメンデバイス	200	4,005.00	801,000	
東京エレクトロン デバイス	500	3,915.00	1,957,500	
フィールズ	1,500	493.00	739,500	
双日	88,700	260.00	23,062,000	
アルフレッサ ホールディングス	16,500	2,225.00	36,712,500	
横浜冷凍	4,300	907.00	3,900,100	
神栄	300	1,517.00	455,100	
ラサ商事	900	916.00	824,400	
アルコニックス	1,700	1,661.00	2,823,700	
神戸物産	11,000	2,909.00	31,999,000	
ハイパー	200	542.00	108,400	
あい ホールディングス	2,300	2,102.00	4,834,600	
ディーブイエックス	500	1,061.00	530,500	
ダイワボウホールディングス	1,500	8,410.00	12,615,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	2,209.00	8,394,200	
ラクト・ジャパン	700	2,735.00	1,914,500	
グリムス	300	1,716.00	514,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	829.00	2,238,300	
八洲電機	1,200	969.00	1,162,800	
メディアスホールディングス	900	875.00	787,500	
レスターホールディングス	1,700	2,167.00	3,683,900	
ジューテックホールディングス	400	1,080.00	432,000	
大光	800	667.00	533,600	
O C H I ホールディングス	500	1,374.00	687,000	
T O K A I ホールディングス	7,700	980.00	7,546,000	

黒谷	500	705.00	352,500	
C o m i n i x	400	772.00	308,800	
三洋貿易	1,600	1,105.00	1,768,000	
ビューティガレージ	300	2,529.00	758,700	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,179.00	1,296,900	
ミタチ産業	400	592.00	236,800	
シップヘルスケアホールディングス	2,800	6,310.00	17,668,000	
明治電機工業	500	1,440.00	720,000	
デリカフーズホールディングス	800	636.00	508,800	
スターティアホールディングス	300	1,050.00	315,000	
コメダホールディングス	3,500	1,999.00	6,996,500	
ピーバンドットコム	300	929.00	278,700	
アセンテック	400	1,881.00	752,400	
富士興産	500	1,270.00	635,000	
協栄産業	200	1,390.00	278,000	
小野建	1,400	1,306.00	1,828,400	
南陽	300	1,665.00	499,500	
佐鳥電機	1,000	785.00	785,000	
エコートレーディング	300	689.00	206,700	
伯東	1,000	1,316.00	1,316,000	
コンドーテック	1,200	1,074.00	1,288,800	
中山福	1,100	525.00	577,500	
ナガイレーベン	2,100	3,030.00	6,363,000	
三菱食品	1,700	2,955.00	5,023,500	
松田産業	1,200	1,982.00	2,378,400	
第一興商	2,400	3,940.00	9,456,000	
メディパルホールディングス	15,900	2,239.00	35,600,100	
S P K	700	1,280.00	896,000	
萩原電気ホールディングス	600	2,737.00	1,642,200	
アズワン	1,100	15,480.00	17,028,000	
スズデン	600	1,247.00	748,200	
シモジマ	900	1,398.00	1,258,200	
ドウシシャ	1,500	1,885.00	2,827,500	
小津産業	400	1,922.00	768,800	
高速	800	1,555.00	1,244,000	
たけびし	500	1,559.00	779,500	

リックス	400	1,643.00	657,200	
丸文	1,400	557.00	779,800	
ハピネット	1,400	1,551.00	2,171,400	
橋本総業ホールディングス	300	2,522.00	756,600	
日本ライフライン	5,200	1,397.00	7,264,400	
タカショー	1,200	774.00	928,800	
マルカ	500	2,014.00	1,007,000	
I D O M	5,500	631.00	3,470,500	
進和	900	2,210.00	1,989,000	
エスケイジャパン	500	456.00	228,000	
ダイترون	700	1,595.00	1,116,500	
シークス	2,100	1,741.00	3,656,100	
田中商事	500	694.00	347,000	
オーハシテクニカ	800	1,495.00	1,196,000	
白銅	600	1,450.00	870,000	
ダイコー通産	200	1,596.00	319,200	
伊藤忠商事	111,400	3,117.00	347,233,800	
丸紅	157,300	734.90	115,599,770	
高島	200	1,706.00	341,200	
長瀬産業	8,900	1,762.00	15,681,800	
蝶理	1,000	1,581.00	1,581,000	
豊田通商	16,000	4,565.00	73,040,000	
三共生興	2,200	495.00	1,089,000	
兼松	6,400	1,429.00	9,145,600	
ツカモトコーポレーション	300	1,534.00	460,200	
三井物産	129,400	2,009.00	259,964,600	
日本紙パルプ商事	800	3,660.00	2,928,000	
カメイ	1,900	1,240.00	2,356,000	
東都水産	200	3,675.00	735,000	
O U G ホールディングス	300	2,838.00	851,400	
スターゼン	600	4,435.00	2,661,000	
山善	6,200	1,023.00	6,342,600	
椿本興業	300	3,765.00	1,129,500	
住友商事	100,800	1,489.50	150,141,600	
内田洋行	600	4,535.00	2,721,000	
三菱商事	97,000	2,853.00	276,741,000	

第一実業	700	4,080.00	2,856,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,900	2,500.00	9,750,000	
西華産業	800	1,407.00	1,125,600	
佐藤商事	1,300	985.00	1,280,500	
菱洋エレクトロ	1,200	2,938.00	3,525,600	
東京産業	1,300	666.00	865,800	
ユアサ商事	1,600	3,160.00	5,056,000	
神鋼商事	400	1,944.00	777,600	
トルク	1,000	264.00	264,000	
阪和興業	3,200	2,888.00	9,241,600	
正栄食品工業	1,000	3,855.00	3,855,000	
カナデン	1,300	1,283.00	1,667,900	
菱電商事	1,100	1,594.00	1,753,400	
フルサト工業	700	1,314.00	919,800	
岩谷産業	3,800	6,420.00	24,396,000	
ナイス	700	1,608.00	1,125,600	
昭光通商	700	684.00	478,800	
ニチモウ	300	1,930.00	579,000	
極東貿易	500	1,410.00	705,000	
イワキ	2,100	632.00	1,327,200	
三愛石油	3,900	1,116.00	4,352,400	
稲畑産業	3,800	1,545.00	5,871,000	
G S I クレオス	400	2,512.00	1,004,800	
明和産業	1,500	490.00	735,000	
クワザワホールディングス	600	676.00	405,600	
ヤマエ久野	1,100	1,107.00	1,217,700	
ワキタ	3,100	1,036.00	3,211,600	
東邦ホールディングス	5,100	2,028.00	10,342,800	
サンゲツ	4,200	1,634.00	6,862,800	
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,266.00	2,911,800	
シナネンホールディングス	600	3,255.00	1,953,000	
伊藤忠エネクス	3,400	1,031.00	3,505,400	
サンリオ	4,600	1,657.00	7,622,200	
サンワテクノス	1,100	1,099.00	1,208,900	
リョーサン	1,800	2,316.00	4,168,800	
新光商事	2,200	778.00	1,711,600	

トーホー	700	1, 840. 00	1, 288, 000	
三信電気	900	2, 137. 00	1, 923, 300	
東陽テクニカ	1, 700	1, 155. 00	1, 963, 500	
モスフードサービス	2, 300	3, 130. 00	7, 199, 000	
加賀電子	1, 400	2, 478. 00	3, 469, 200	
ソーダニッカ	1, 500	535. 00	802, 500	
立花エレテック	1, 200	1, 621. 00	1, 945, 200	
フォーバル	600	848. 00	508, 800	
P A L T A C	2, 600	5, 620. 00	14, 612, 000	
三谷産業	2, 200	444. 00	976, 800	
太平洋興発	600	651. 00	390, 600	
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	2, 845. 00	1, 138, 000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1, 570. 00	157, 000	
コーア商事ホールディングス	500	1, 386. 00	693, 000	
国際紙パルプ商事	3, 500	249. 00	871, 500	
ヤマタネ	700	1, 451. 00	1, 015, 700	
丸紅建材リース	100	1, 849. 00	184, 900	
日鉄物産	1, 100	3, 800. 00	4, 180, 000	
泉州電業	500	3, 430. 00	1, 715, 000	
トラスコ中山	3, 700	2, 768. 00	10, 241, 600	
オートバックスセブン	5, 900	1, 416. 00	8, 354, 400	
モリト	1, 100	615. 00	676, 500	
加藤産業	2, 300	3, 540. 00	8, 142, 000	
北恵	500	943. 00	471, 500	
イノテック	900	1, 300. 00	1, 170, 000	
イエローハット	3, 000	1, 722. 00	5, 166, 000	
J Kホールディングス	1, 400	823. 00	1, 152, 200	
日伝	1, 300	2, 228. 00	2, 896, 400	
北沢産業	1, 200	265. 00	318, 000	
杉本商事	800	2, 418. 00	1, 934, 400	
因幡電機産業	4, 200	2, 552. 00	10, 718, 400	
東テク	500	2, 845. 00	1, 422, 500	
ミスミグループ本社	20, 000	3, 520. 00	70, 400, 000	
アルテック	1, 200	284. 00	340, 800	
タキヒヨー	600	1, 974. 00	1, 184, 400	
蔵王産業	300	1, 387. 00	416, 100	

スズケン	6,700	4,330.00	29,011,000	
ジェコス	1,000	971.00	971,000	
グローセル	1,700	526.00	894,200	
ローソン	4,100	5,320.00	21,812,000	
サンエー	1,200	4,265.00	5,118,000	
カワチ薬品	1,100	3,030.00	3,333,000	
エービーシー・マート	2,500	6,230.00	15,575,000	
ハードオフコーポレーション	700	786.00	550,200	
アスクル	1,400	3,815.00	5,341,000	
ゲオホールディングス	2,100	1,223.00	2,568,300	
アダストリア	2,200	2,063.00	4,538,600	
ジーフット	1,300	426.00	553,800	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	420.00	126,000	
くら寿司	1,000	6,950.00	6,950,000	
キャンドウ	800	1,903.00	1,522,400	
アイケイ	400	901.00	360,400	
パルグループホールディングス	1,400	1,603.00	2,244,200	
エディオン	6,700	1,080.00	7,236,000	
サーラコーポレーション	3,200	581.00	1,859,200	
ワッツ	800	870.00	696,000	
ハローズ	600	3,105.00	1,863,000	
フジオフードグループ本社	1,400	1,336.00	1,870,400	
あみやき亭	400	2,981.00	1,192,400	
ひらまつ	3,800	176.00	668,800	
大黒天物産	400	6,000.00	2,400,000	
ハニーズホールディングス	1,300	989.00	1,285,700	
ファーマライズホールディングス	300	790.00	237,000	
アルペン	1,200	2,298.00	2,757,600	
ハブ	600	706.00	423,600	
クオールホールディングス	2,200	1,363.00	2,998,600	
ジンズホールディングス	900	7,430.00	6,687,000	
ビックカメラ	9,500	1,199.00	11,390,500	
DCMホールディングス	9,800	1,124.00	11,015,200	
M o n o t a R O	11,400	6,310.00	71,934,000	
東京一番フーズ	600	584.00	350,400	
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,225.00	3,115,000	

J. フロント リテイリング	19,100	1,014.00	19,367,400	
ドトール・日レスホールディングス	2,500	1,681.00	4,202,500	
マツモトキヨシホールディングス	6,600	4,640.00	30,624,000	
ブロンコビリー	900	2,303.00	2,072,700	
Z O Z O	9,400	3,465.00	32,571,000	
トレジャー・ファクトリー	500	840.00	420,000	
物語コーポレーション	400	12,040.00	4,816,000	
ココカラファイン	1,400	7,870.00	11,018,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,000	732.00	20,496,000	
H a m e e	400	1,785.00	714,000	
ウエルシアホールディングス	8,500	3,620.00	30,770,000	
クリエイトS Dホールディングス	2,300	3,425.00	7,877,500	
丸善C H I ホールディングス	1,700	377.00	640,900	
ミサワ	400	675.00	270,000	
ティーライフ	200	1,225.00	245,000	
チムニー	600	1,399.00	839,400	
シュッピン	1,200	950.00	1,140,000	
オイシックス・ラ・大地	1,600	3,100.00	4,960,000	
ネクステージ	2,700	1,558.00	4,206,600	
ジョイフル本田	4,600	1,439.00	6,619,400	
鳥貴族ホールディングス	500	1,703.00	851,500	
ホットランド	1,300	1,236.00	1,606,800	
すかいらーくホールディングス	18,000	1,660.00	29,880,000	
S F Pホールディングス	800	1,483.00	1,186,400	
綿半ホールディングス	1,200	1,329.00	1,594,800	
ヨシックス	300	2,170.00	651,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,600	1,154.00	5,308,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,027.00	924,300	
B E E N O S	800	2,649.00	2,119,200	
あさひ	1,200	1,637.00	1,964,400	
日本調剤	1,000	1,673.00	1,673,000	
コスモス薬品	1,600	16,060.00	25,696,000	
トーエル	700	832.00	582,400	
オンリー	300	468.00	140,400	
セブン&アイ・ホールディングス	62,400	4,141.00	258,398,400	



クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,600	880.00	7,568,000	
ツルハホールディングス	3,500	14,500.00	50,750,000	
サンマルクホールディングス	1,400	1,567.00	2,193,800	
フェリシモ	400	1,303.00	521,200	
トリドールホールディングス	4,000	1,606.00	6,424,000	
TOKYO BASE	1,500	678.00	1,017,000	
ウイルプラスホールディングス	300	1,035.00	310,500	
JMホールディングス	1,200	2,065.00	2,478,000	
サツドラホールディングス	300	2,058.00	617,400	
アレンザホールディングス	900	1,421.00	1,278,900	
串カツ田中ホールディングス	400	1,859.00	743,600	
バロックジャパンリミテッド	1,100	818.00	899,800	
クスリのアオキホールディングス	1,600	8,580.00	13,728,000	
スシログローバルホールディングス	8,800	4,345.00	38,236,000	
メディカルシステムネットワーク	1,400	773.00	1,082,200	
はるやまホールディングス	600	705.00	423,000	
ノジマ	2,800	2,789.00	7,809,200	
カッパ・クリエイト	2,400	1,511.00	3,626,400	
ライトオン	1,400	646.00	904,400	
ジーンズメイト	700	292.00	204,400	
良品計画	21,200	2,566.00	54,399,200	
三城ホールディングス	2,000	304.00	608,000	
アドヴァン	1,700	1,105.00	1,878,500	
アルビス	500	2,462.00	1,231,000	
コナカ	2,100	333.00	699,300	
ハウス オブ ローゼ	200	1,707.00	341,400	
G-7ホールディングス	900	2,431.00	2,187,900	
イオン北海道	2,100	1,056.00	2,217,600	
コジマ	2,700	672.00	1,814,400	
ヒマラヤ	600	965.00	579,000	
コーナン商事	2,300	2,932.00	6,743,600	
エコス	600	1,950.00	1,170,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	31,900	2,638.00	84,152,200	
西松屋チェーン	3,500	1,530.00	5,355,000	
ゼンショーホールディングス	8,600	2,905.00	24,983,000	

幸楽苑ホールディングス	1, 100	1, 774. 00	1, 951, 400	
ハークスレイ	300	930. 00	279, 000	
サイゼリヤ	2, 400	2, 140. 00	5, 136, 000	
V Tホールディングス	6, 100	433. 00	2, 641, 300	
魚力	500	1, 859. 00	929, 500	
フジ・コーポレーション	400	2, 263. 00	905, 200	
ユナイテッドアローズ	1, 900	1, 929. 00	3, 665, 100	
ハイデイ日高	2, 300	1, 866. 00	4, 291, 800	
京都きもの友禅	1, 400	237. 00	331, 800	
コロワイド	5, 300	1, 943. 00	10, 297, 900	
ピーシーデポコーポレーション	1, 900	612. 00	1, 162, 800	
壺番屋	1, 100	5, 170. 00	5, 687, 000	
P L A N T	400	758. 00	303, 200	
スギホールディングス	3, 200	7, 290. 00	23, 328, 000	
薬王堂ホールディングス	700	2, 706. 00	1, 894, 200	
スクロール	2, 300	1, 307. 00	3, 006, 100	
ヨンドシーホールディングス	1, 500	2, 055. 00	3, 082, 500	
木曽路	2, 100	2, 398. 00	5, 035, 800	
S R Sホールディングス	2, 300	864. 00	1, 987, 200	
千趣会	2, 900	335. 00	971, 500	
タカキュー	1, 800	149. 00	268, 200	
リテールパートナーズ	1, 900	1, 452. 00	2, 758, 800	
ケーヨー	3, 000	746. 00	2, 238, 000	
上新電機	1, 800	3, 315. 00	5, 967, 000	
日本瓦斯	2, 600	5, 330. 00	13, 858, 000	
ロイヤルホールディングス	2, 800	1, 908. 00	5, 342, 400	
東天紅	100	935. 00	93, 500	
いなげや	1, 800	1, 740. 00	3, 132, 000	
島忠	1, 100	5, 480. 00	6, 028, 000	
チヨダ	1, 700	979. 00	1, 664, 300	
ライフコーポレーション	1, 200	3, 330. 00	3, 996, 000	
リンガーハット	2, 000	2, 523. 00	5, 046, 000	
M r M a x H D	2, 200	775. 00	1, 705, 000	
A O K Iホールディングス	3, 200	596. 00	1, 907, 200	
オークワ	2, 500	1, 256. 00	3, 140, 000	
コメリ	2, 500	2, 841. 00	7, 102, 500	

青山商事	3,700	706.00	2,612,200	
しまむら	1,900	11,760.00	22,344,000	
はせがわ	1,200	292.00	350,400	
高島屋	11,700	1,054.00	12,331,800	
松屋	3,600	934.00	3,362,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,600	828.00	6,292,800	
近鉄百貨店	600	3,425.00	2,055,000	
丸井グループ	13,500	1,957.00	26,419,500	
アクシアル リテイリング	1,300	5,010.00	6,513,000	
イオン	61,400	3,489.00	214,224,600	
イズミ	3,200	4,015.00	12,848,000	
平和堂	2,900	2,186.00	6,339,400	
フジ	1,900	2,029.00	3,855,100	
ヤオコー	1,800	6,870.00	12,366,000	
ゼビオホールディングス	1,900	925.00	1,757,500	
ケーズホールディングス	14,200	1,509.00	21,427,800	
O l y m p i c グループ	800	916.00	732,800	
日産東京販売ホールディングス	2,100	265.00	556,500	
シルバーライフ	200	2,187.00	437,400	
G e n k y D r u g S t o r e s	700	3,850.00	2,695,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	976.00	292,800	
ブックオフグループホールディングス	1,000	878.00	878,000	
ギフト	200	2,048.00	409,600	
アインホールディングス	2,300	7,330.00	16,859,000	
元気寿司	500	2,520.00	1,260,000	
ヤマダホールディングス	53,500	549.00	29,371,500	
アークランドサカモト	2,500	1,581.00	3,952,500	
ニトリホールディングス	6,300	20,675.00	130,252,500	
愛眼	1,200	237.00	284,400	
ケーユーホールディングス	800	870.00	696,000	
吉野家ホールディングス	5,300	2,211.00	11,718,300	
松屋フーズホールディングス	800	3,700.00	2,960,000	
サガミホールディングス	2,300	1,204.00	2,769,200	
関西スーパーマーケット	1,200	1,169.00	1,402,800	
王将フードサービス	1,000	5,920.00	5,920,000	
プレナス	1,800	1,953.00	3,515,400	

ミニストップ	1,200	1,454.00	1,744,800	
アークス	3,000	2,363.00	7,089,000	
バローホールディングス	3,200	2,378.00	7,609,600	
藤久	400	804.00	321,600	
ベルク	800	5,910.00	4,728,000	
大庄	1,000	1,053.00	1,053,000	
ファーストリテイリング	2,100	95,550.00	200,655,000	
サンドラッグ	6,000	4,155.00	24,930,000	
サックスパー ホールディングス	1,400	570.00	798,000	
ヤマザワ	300	1,738.00	521,400	
やまや	300	2,254.00	676,200	
ベルーナ	3,400	1,035.00	3,519,000	
島根銀行	700	668.00	467,600	
じもとホールディングス	1,200	823.00	987,600	
めぶきフィナンシャルグループ	83,000	219.00	18,177,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,182.00	2,482,200	
九州フィナンシャルグループ	32,700	441.00	14,420,700	
ゆうちょ銀行	45,000	1,019.00	45,855,000	
富山第一銀行	3,600	291.00	1,047,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	96,900	398.00	38,566,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,600	679.00	7,197,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,500	586.00	4,395,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,333.00	1,866,200	
第四北越フィナンシャルグループ	2,600	2,305.00	5,993,000	
ひろぎんホールディングス	23,500	631.00	14,828,500	
新生銀行	13,000	1,373.00	17,849,000	
あおぞら銀行	9,500	2,209.00	20,985,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,092,700	528.60	577,601,220	代用有価証券 100,000 株
りそなホールディングス	173,600	418.60	72,668,960	
三井住友トラスト・ホールディングス	30,200	3,505.00	105,851,000	
三井住友フィナンシャルグループ	110,500	3,601.00	397,910,500	代用有価証券 13,000 株
千葉銀行	53,100	631.00	33,506,100	
群馬銀行	32,800	333.00	10,922,400	
武蔵野銀行	2,300	1,585.00	3,645,500	
千葉興業銀行	4,300	250.00	1,075,000	

筑波銀行	7, 100	182. 00	1, 292, 200	
七十七銀行	5, 000	1, 404. 00	7, 020, 000	
青森銀行	1, 300	2, 426. 00	3, 153, 800	
秋田銀行	1, 000	1, 406. 00	1, 406, 000	
山形銀行	1, 900	1, 066. 00	2, 025, 400	
岩手銀行	1, 100	2, 076. 00	2, 283, 600	
東邦銀行	14, 400	210. 00	3, 024, 000	
東北銀行	800	1, 084. 00	867, 200	
みちのく銀行	1, 200	1, 050. 00	1, 260, 000	
ふくおかフィナンシャルグループ	14, 400	1, 989. 00	28, 641, 600	
静岡銀行	38, 800	793. 00	30, 768, 400	
十六銀行	2, 000	1, 989. 00	3, 978, 000	
スルガ銀行	14, 100	339. 00	4, 779, 900	
八十二銀行	36, 000	363. 00	13, 068, 000	
山梨中央銀行	1, 900	862. 00	1, 637, 800	
大垣共立銀行	3, 100	2, 046. 00	6, 342, 600	
福井銀行	1, 400	1, 889. 00	2, 644, 600	
北國銀行	1, 500	2, 618. 00	3, 927, 000	
清水銀行	700	1, 705. 00	1, 193, 500	
富山銀行	300	2, 841. 00	852, 300	
滋賀銀行	3, 200	1, 988. 00	6, 361, 600	
南都銀行	2, 300	1, 811. 00	4, 165, 300	
百五銀行	14, 400	312. 00	4, 492, 800	
京都銀行	5, 700	6, 160. 00	35, 112, 000	
紀陽銀行	5, 700	1, 418. 00	8, 082, 600	
ほくほくフィナンシャルグループ	10, 600	978. 00	10, 366, 800	
山陰合同銀行	10, 200	497. 00	5, 069, 400	
中国銀行	13, 700	859. 00	11, 768, 300	
鳥取銀行	500	1, 127. 00	563, 500	
伊予銀行	21, 100	646. 00	13, 630, 600	
百十四銀行	1, 800	1, 576. 00	2, 836, 800	
四国銀行	2, 300	723. 00	1, 662, 900	
阿波銀行	2, 400	2, 245. 00	5, 388, 000	
大分銀行	900	2, 099. 00	1, 889, 100	
宮崎銀行	1, 000	2, 231. 00	2, 231, 000	
佐賀銀行	900	1, 377. 00	1, 239, 300	

沖縄銀行	1, 400	2, 808. 00	3, 931, 200	
琉球銀行	3, 500	770. 00	2, 695, 000	
セブン銀行	53, 700	245. 00	13, 156, 500	
みずほフィナンシャルグループ	217, 000	1, 530. 00	332, 010, 000	
高知銀行	600	755. 00	453, 000	
山口フィナンシャルグループ	19, 800	637. 00	12, 612, 600	
長野銀行	500	1, 280. 00	640, 000	
名古屋銀行	1, 300	2, 753. 00	3, 578, 900	
北洋銀行	24, 000	232. 00	5, 568, 000	
愛知銀行	500	2, 923. 00	1, 461, 500	
中京銀行	600	1, 832. 00	1, 099, 200	
大光銀行	600	1, 291. 00	774, 600	
愛媛銀行	2, 200	974. 00	2, 142, 800	
トマト銀行	500	1, 051. 00	525, 500	
京葉銀行	6, 700	428. 00	2, 867, 600	
栃木銀行	7, 900	181. 00	1, 429, 900	
北日本銀行	500	1, 899. 00	949, 500	
東和銀行	2, 900	677. 00	1, 963, 300	
福島銀行	2, 200	231. 00	508, 200	
大東銀行	800	646. 00	516, 800	
トモニホールディングス	12, 400	314. 00	3, 893, 600	
フィデアホールディングス	16, 100	117. 00	1, 883, 700	
池田泉州ホールディングス	18, 900	158. 00	2, 986, 200	
F P G	5, 100	603. 00	3, 075, 300	
ジャパンインベストメントアドバイザー	800	1, 249. 00	999, 200	
マーキュリアインベストメント	700	760. 00	532, 000	
S B I ホールディングス	19, 600	3, 130. 00	61, 348, 000	
ジャフコ グループ	2, 400	6, 740. 00	16, 176, 000	
大和証券グループ本社	119, 600	534. 00	63, 866, 400	
野村ホールディングス	243, 900	643. 60	156, 974, 040	
岡三証券グループ	13, 500	403. 00	5, 440, 500	
丸三証券	4, 800	617. 00	2, 961, 600	
東洋証券	5, 400	151. 00	815, 400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17, 100	355. 00	6, 070, 500	
光世証券	400	674. 00	269, 600	
水戸証券	4, 200	280. 00	1, 176, 000	

いちよし証券	3,300	584.00	1,927,200	
松井証券	7,900	906.00	7,157,400	
マネックスグループ	14,400	890.00	12,816,000	
極東証券	2,200	797.00	1,753,400	
岩井コスモホールディングス	1,600	1,533.00	2,452,800	
藍澤証券	2,800	894.00	2,503,200	
マネーパートナーズグループ	2,100	225.00	472,500	
スパークス・グループ	7,500	328.00	2,460,000	
かんぽ生命保険	19,800	2,238.00	44,312,400	
SOMPOホールディングス	28,200	4,413.00	124,446,600	
アニコムホールディングス	4,500	1,183.00	5,323,500	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	38,800	3,227.00	125,207,600	
第一生命ホールディングス	84,500	1,817.00	153,536,500	
東京海上ホールディングス	53,000	5,534.00	293,302,000	
T&Dホールディングス	47,700	1,393.00	66,446,100	
アドバンスクリエイト	300	1,886.00	565,800	
全国保証	4,200	5,000.00	21,000,000	
ジェイリース	600	734.00	440,400	
イントラスト	500	752.00	376,000	
日本モーゲージサービス	900	1,156.00	1,040,400	
C a s a	500	1,016.00	508,000	
アルヒ	2,400	1,641.00	3,938,400	
プレミアムグループ	800	2,300.00	1,840,000	
クレディセゾン	9,300	1,312.00	12,201,600	
芙蓉総合リース	1,600	7,440.00	11,904,000	
みずほリース	2,400	3,465.00	8,316,000	
東京センチュリー	3,700	8,060.00	29,822,000	
日本証券金融	6,700	629.00	4,214,300	
アイフル	27,100	277.00	7,506,700	
リコーリース	1,200	3,285.00	3,942,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,800	1,387.00	13,592,600	
アコム	32,100	461.00	14,798,100	
ジャックス	1,800	2,106.00	3,790,800	
オリエントコーポレーション	43,800	139.00	6,088,200	
日立キャピタル	3,700	2,882.00	10,663,400	

オリックス	99,100	1,757.50	174,168,250	
三菱UFJリース	35,900	572.00	20,534,800	
九州リースサービス	800	645.00	516,000	
日本取引所グループ	43,200	2,406.50	103,960,800	
イー・ギャランティ	1,800	2,351.00	4,231,800	
アサックス	900	748.00	673,200	
NECキャピタルソリューション	600	2,026.00	1,215,600	
いちご	17,900	332.00	5,942,800	
日本駐車場開発	16,400	144.00	2,361,600	
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,177.00	1,059,300	
SREホールディングス	200	5,130.00	1,026,000	
ADワークスグループ	3,900	157.00	612,300	
ヒューリック	33,900	1,201.00	40,713,900	
三栄建築設計	700	1,805.00	1,263,500	
野村不動産ホールディングス	9,700	2,478.00	24,036,600	
三重交通グループホールディングス	3,200	505.00	1,616,000	
サムティ	2,300	1,790.00	4,117,000	
ディア・ライフ	2,300	454.00	1,044,200	
コーセーアールイー	600	608.00	364,800	
日本商業開発	1,100	1,692.00	1,861,200	
プレサンスコーポレーション	2,600	1,517.00	3,944,200	
THEグローバル社	1,300	277.00	360,100	
ハウコム	300	1,323.00	396,900	
日本管理センター	900	1,252.00	1,126,800	
サンセイランディック	500	752.00	376,000	
エストラスト	300	714.00	214,200	
フージャースホールディングス	2,700	704.00	1,900,800	
オープンハウス	5,000	4,460.00	22,300,000	
東急不動産ホールディングス	43,500	693.00	30,145,500	
飯田グループホールディングス	13,300	2,480.00	32,984,000	
イーグランド	300	855.00	256,500	
ムゲンエステート	1,300	488.00	634,400	
ビーロッド	900	668.00	601,200	
ファーストブラザーズ	300	993.00	297,900	
ハウスドゥ	900	1,162.00	1,045,800	
シーアールイー	400	1,271.00	508,400	



プロパティエージェント	300	1,528.00	458,400	
ケイアイスター不動産	500	3,620.00	1,810,000	
アグレ都市デザイン	400	772.00	308,800	
グッドコムアセット	800	1,337.00	1,069,600	
ジェイ・エス・ビー	300	3,515.00	1,054,500	
テンポイノベーション	500	926.00	463,000	
グローバル・リンク・マネジメント	300	759.00	227,700	
パーク 2 4	8,600	2,259.00	19,427,400	
パラカ	400	1,662.00	664,800	
三井不動産	72,900	2,421.50	176,527,350	
三菱地所	105,000	1,850.00	194,250,000	
平和不動産	2,700	3,745.00	10,111,500	
東京建物	15,800	1,572.00	24,837,600	
ダイビル	4,100	1,292.00	5,297,200	
京阪神ビルディング	2,800	1,559.00	4,365,200	
住友不動産	35,900	3,628.00	130,245,200	
テーオーシー	3,100	772.00	2,393,200	
東京楽天地	300	4,375.00	1,312,500	
スターツコーポレーション	1,900	2,973.00	5,648,700	
フジ住宅	1,900	665.00	1,263,500	
空港施設	1,400	522.00	730,800	
明和地所	900	643.00	578,700	
ゴールドクレスト	1,500	1,787.00	2,680,500	
エスリード	600	1,576.00	945,600	
日神グループホールディングス	2,300	438.00	1,007,400	
日本エスコン	2,900	779.00	2,259,100	
タカラレーベン	7,000	341.00	2,387,000	
A V A N T I A	900	909.00	818,100	
イオンモール	8,000	1,885.00	15,080,000	
毎日コムネット	600	691.00	414,600	
ファースト住建	600	1,110.00	666,000	
カチタス	4,000	3,085.00	12,340,000	
トーセイ	2,300	1,066.00	2,451,800	
穴吹興産	300	1,672.00	501,600	
サンフロンティア不動産	1,900	917.00	1,742,300	
エフ・ジェー・ネクスト	1,600	1,153.00	1,844,800	

インテリックス	500	557.00	278,500	
ランドビジネス	600	338.00	202,800	
サンネクスタグループ	600	986.00	591,600	
グランディハウス	1,100	463.00	509,300	
日本空港ビルデング	5,100	5,360.00	27,336,000	
明豊ファシリティワークス	800	643.00	514,400	
日本工営	1,000	2,771.00	2,771,000	
L I F U L L	5,500	454.00	2,497,000	
ミクシィ	3,000	2,578.00	7,734,000	
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	1,909.00	1,909,000	
日本M&Aセンター	12,700	6,290.00	79,883,000	
メンバーズ	500	2,531.00	1,265,500	
中広	300	340.00	102,000	
U T グループ	2,300	3,355.00	7,716,500	
アイティメディア	500	2,148.00	1,074,000	
タケエイ	1,800	1,357.00	2,442,600	
E・Jホールディングス	600	1,005.00	603,000	
ビーネックスグループ	2,000	1,275.00	2,550,000	
コシダカホールディングス	3,800	509.00	1,934,200	
アルトナー	400	901.00	360,400	
パソナグループ	1,700	2,009.00	3,415,300	
C D S	300	1,440.00	432,000	
リンクアンドモチベーション	2,900	646.00	1,873,400	
G C A	2,000	777.00	1,554,000	
エス・エム・エス	5,300	3,885.00	20,590,500	
サニーサイドアップグループ	600	677.00	406,200	
パーソルホールディングス	15,500	2,195.00	34,022,500	
リニカル	1,000	767.00	767,000	
クックパッド	5,100	314.00	1,601,400	
エスクリ	600	365.00	219,000	
アイ・ケイ・ケイ	900	635.00	571,500	
学情	600	1,418.00	850,800	
スタジオアリス	800	2,120.00	1,696,000	
シミックホールディングス	800	1,735.00	1,388,000	
エプコ	400	991.00	396,400	
N J S	400	1,974.00	789,600	

総合警備保障	6,200	5,150.00	31,930,000	
カカクコム	11,400	3,565.00	40,641,000	
アイロムグループ	600	2,004.00	1,202,400	
セントケア・ホールディング	1,200	964.00	1,156,800	
サイネックス	300	723.00	216,900	
ルネサンス	1,100	1,110.00	1,221,000	
ディップ	2,400	3,025.00	7,260,000	
デジタルホールディングス	1,100	2,048.00	2,252,800	
新日本科学	2,000	682.00	1,364,000	
ツクイホールディングス	3,700	925.00	3,422,500	
キャリアデザインセンター	400	915.00	366,000	
ベネフィット・ワン	5,600	3,060.00	17,136,000	
エムスリー	27,300	8,723.00	238,137,900	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	310.00	372,000	
プラス	300	479.00	143,700	
アウトソーシング	8,900	1,526.00	13,581,400	
ウェルネット	1,900	498.00	946,200	
ワールドホールディングス	600	2,297.00	1,378,200	
ディー・エヌ・エー	6,600	2,175.00	14,355,000	
博報堂DYホールディングス	21,500	1,775.00	38,162,500	
ぐるなび	2,800	608.00	1,702,400	
タカミヤ	2,000	534.00	1,068,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	953.00	1,238,900	
ファンコミュニケーションズ	4,300	408.00	1,754,400	
ライク	400	1,988.00	795,200	
ビジネス・ブレークスルー	600	453.00	271,800	
エスプール	4,000	1,031.00	4,124,000	
WDBホールディングス	700	2,835.00	1,984,500	
手間いらず	200	5,210.00	1,042,000	
ティア	900	457.00	411,300	
CDG	100	1,548.00	154,800	
アドウェイズ	1,900	661.00	1,255,900	
バリューコマース	1,000	3,250.00	3,250,000	
インフォマート	15,700	1,009.00	15,841,300	
J Pホールディングス	4,600	299.00	1,375,400	
エコナックホールディングス	3,300	95.00	313,500	

E P S ホールディングス	2, 100	1, 232. 00	2, 587, 200	
レググス	400	1, 841. 00	736, 400	
プレステージ・インターナショナル	5, 800	811. 00	4, 703, 800	
アミューズ	900	2, 699. 00	2, 429, 100	
ドリームインキュベータ	500	1, 200. 00	600, 000	
クイック	1, 000	1, 253. 00	1, 253, 000	
T A C	1, 000	264. 00	264, 000	
ケネディクス	4, 400	747. 00	3, 286, 800	
電通グループ	17, 400	3, 780. 00	65, 772, 000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	666. 00	532, 800	
ぴあ	500	3, 085. 00	1, 542, 500	
イオンファンタジー	600	2, 449. 00	1, 469, 400	
シーティーエス	1, 800	917. 00	1, 650, 600	
ネクシィーズグループ	600	1, 034. 00	620, 400	
H. U. グループホールディングス	4, 400	3, 330. 00	14, 652, 000	
アルプス技研	1, 300	2, 107. 00	2, 739, 100	
日本空調サービス	1, 600	738. 00	1, 180, 800	
オリエンタルランド	16, 400	17, 735. 00	290, 854, 000	
ダスキン	3, 600	2, 915. 00	10, 494, 000	
明光ネットワークジャパン	2, 100	599. 00	1, 257, 900	
ファルコホールディングス	700	1, 643. 00	1, 150, 100	
秀英予備校	200	435. 00	87, 000	
ラウンドワン	5, 300	1, 086. 00	5, 755, 800	
リゾートトラスト	7, 100	1, 763. 00	12, 517, 300	
ビー・エム・エル	2, 000	3, 875. 00	7, 750, 000	
ワタベウェディング	300	309. 00	92, 700	
りらいあコミュニケーションズ	2, 300	1, 388. 00	3, 192, 400	
リソー教育	8, 000	353. 00	2, 824, 000	
早稲田アカデミー	600	999. 00	599, 400	
ユー・エス・エス	17, 300	2, 050. 00	35, 465, 000	
東京個別指導学院	1, 400	690. 00	966, 000	
サイバーエージェント	9, 500	6, 830. 00	64, 885, 000	
楽天	72, 200	1, 187. 00	85, 701, 400	
クリーク・アンド・リバー社	800	1, 237. 00	989, 600	
モーニングスター	1, 700	494. 00	839, 800	
デー・オー・ダブリュー	2, 700	309. 00	834, 300	

山田コンサルティンググループ	900	1, 068. 00	961, 200	
セントラルスポーツ	600	2, 394. 00	1, 436, 400	
フルキャストホールディングス	1, 400	1, 878. 00	2, 629, 200	
エン・ジャパン	2, 700	3, 580. 00	9, 666, 000	
リソルホールディングス	200	4, 075. 00	815, 000	
テクノプロ・ホールディングス	3, 100	8, 140. 00	25, 234, 000	
アトラ	500	344. 00	172, 000	
インターワークス	600	380. 00	228, 000	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	15, 120. 00	9, 072, 000	
K e e P e r 技研	1, 000	1, 880. 00	1, 880, 000	
ファーストロジック	300	798. 00	239, 400	
三機サービス	300	996. 00	298, 800	
G u n o s y	1, 100	808. 00	888, 800	
デザインワン・ジャパン	700	215. 00	150, 500	
イー・ガーディアン	700	3, 460. 00	2, 422, 000	
リブセンス	1, 000	240. 00	240, 000	
ジャパンマテリアル	4, 700	1, 498. 00	7, 040, 600	
ベクトル	2, 000	1, 326. 00	2, 652, 000	
ウチヤマホールディングス	700	357. 00	249, 900	
チャーム・ケア・コーポレーション	1, 200	1, 364. 00	1, 636, 800	
キャリアリンク	500	3, 070. 00	1, 535, 000	
I B J	1, 300	1, 095. 00	1, 423, 500	
アサンテ	600	1, 724. 00	1, 034, 400	
N・フィールド	1, 100	1, 198. 00	1, 317, 800	
バリューHR	600	1, 779. 00	1, 067, 400	
M&Aキャピタルパートナーズ	1, 300	5, 020. 00	6, 526, 000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	2, 085. 00	1, 251, 000	
E R I ホールディングス	400	625. 00	250, 000	
アビスト	200	2, 980. 00	596, 000	
シグマクシス	900	1, 922. 00	1, 729, 800	
ウィルグループ	1, 200	1, 055. 00	1, 266, 000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2, 400	296. 00	710, 400	
メドピア	700	7, 280. 00	5, 096, 000	
レアジョブ	200	2, 444. 00	488, 800	
リクルートホールディングス	110, 800	5, 128. 00	568, 182, 400	
エラン	2, 100	1, 505. 00	3, 160, 500	

土木管理総合試験所	900	346.00	311,400	
ネットマーケティング	800	604.00	483,200	
日本郵政	116,900	899.70	105,174,930	
ベルシステム24ホールディングス	2,600	1,882.00	4,893,200	
鎌倉新書	1,600	932.00	1,491,200	
SMN	300	764.00	229,200	
一蔵	300	400.00	120,000	
LITALICO	600	3,825.00	2,295,000	
グローバルキッズCOMPANY	300	905.00	271,500	
エアトリ	900	1,717.00	1,545,300	
アトラエ	500	3,490.00	1,745,000	
ストライク	600	4,745.00	2,847,000	
ソラスト	3,800	1,616.00	6,140,800	
セラク	500	1,801.00	900,500	
インソース	1,300	2,255.00	2,931,500	
ペイカレント・コンサルティング	1,000	19,670.00	19,670,000	
Orchestra Holdings	400	2,284.00	913,600	
アイモバイル	600	1,222.00	733,200	
キャリアインデックス	600	595.00	357,000	
MS-Japan	700	1,216.00	851,200	
船場	400	877.00	350,800	
グレイステクノロジー	800	6,160.00	4,928,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,400	2,350.00	10,340,000	
フルテック	300	1,402.00	420,600	
グリーンズ	800	511.00	408,800	
ツナググループ・ホールディングス	400	398.00	159,200	
GameWith	500	581.00	290,500	
ソウルドアウト	400	1,673.00	669,200	
MS&Consulting	300	599.00	179,700	
エル・ティー・エス	100	3,980.00	398,000	
ミダック	400	3,395.00	1,358,000	
日総工産	1,300	854.00	1,110,200	
キュービーネットホールディングス	800	1,703.00	1,362,400	
RPAホールディングス	1,800	680.00	1,224,000	
スプリックス	400	798.00	319,200	

マネジメントソリューションズ	800	1, 894. 00	1, 515, 200	
プロレド・パートナーズ	200	3, 560. 00	712, 000	
a n d f a c t o r y	200	763. 00	152, 600	
テノ．ホールディングス	100	1, 283. 00	128, 300	
フロンティア・マネジメント	300	2, 177. 00	653, 100	
ピアラ	100	2, 078. 00	207, 800	
コプロ・ホールディングス	100	3, 135. 00	313, 500	
ギークス	200	1, 569. 00	313, 800	
カーブスホールディングス	4, 300	968. 00	4, 162, 400	
フォーラムエンジニアリング	800	1, 017. 00	813, 600	
ダイレクトマーケティングミックス	700	3, 245. 00	2, 271, 500	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	775. 00	620, 000	
リログループ	8, 500	2, 569. 00	21, 836, 500	
東祥	1, 000	1, 745. 00	1, 745, 000	
エイチ・アイ・エス	2, 300	2, 060. 00	4, 738, 000	
ラックランド	500	2, 405. 00	1, 202, 500	
共立メンテナンス	2, 600	3, 780. 00	9, 828, 000	
イチネンホールディングス	1, 600	1, 350. 00	2, 160, 000	
建設技術研究所	1, 000	2, 467. 00	2, 467, 000	
スペース	1, 100	894. 00	983, 400	
長大	600	1, 552. 00	931, 200	
燦ホールディングス	600	1, 165. 00	699, 000	
スバル興業	100	8, 270. 00	827, 000	
東京テアトル	700	1, 307. 00	914, 900	
タナベ経営	300	1, 401. 00	420, 300	
ナガワ	500	11, 790. 00	5, 895, 000	
よみうりランド	100	6, 030. 00	603, 000	
東京都競馬	1, 000	4, 840. 00	4, 840, 000	
常磐興産	800	1, 390. 00	1, 112, 000	
カナモト	2, 700	2, 364. 00	6, 382, 800	
東京ドーム	6, 300	1, 297. 00	8, 171, 100	
西尾レントオール	1, 400	2, 563. 00	3, 588, 200	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	12, 700	26. 00	330, 200	
トランス・コスモス	1, 500	2, 862. 00	4, 293, 000	
乃村工藝社	6, 600	828. 00	5, 464, 800	
藤田観光	800	1, 627. 00	1, 301, 600	

KNT－CTホールディングス	900	960.00	864,000	
日本管財	1,600	2,101.00	3,361,600	
トーカイ	1,500	2,234.00	3,351,000	
白洋舎	200	2,398.00	479,600	
セコム	15,200	9,845.00	149,644,000	
セントラル警備保障	800	3,485.00	2,788,000	
丹青社	3,000	794.00	2,382,000	
メイテック	1,900	5,540.00	10,526,000	
応用地質	1,800	1,306.00	2,350,800	
船井総研ホールディングス	3,200	2,480.00	7,936,000	
進学会ホールディングス	600	477.00	286,200	
オオバ	1,100	743.00	817,300	
いであ	400	1,801.00	720,400	
学究社	500	1,335.00	667,500	
ベネッセホールディングス	5,700	2,226.00	12,688,200	
イオンディライト	1,900	3,000.00	5,700,000	
ナック	700	994.00	695,800	
ダイセキ	2,600	3,440.00	8,944,000	
ステップ	500	1,539.00	769,500	
合 計	16,826,600		42,868,520,230	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。



## 2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は 2021 年 2 月 26 日現在です。

### 【インデックスファンド T S P】

#### 【純資産額計算書】

I 資産総額	21,749,617,916円
II 負債総額	40,925,977円
III 純資産総額（I－II）	21,708,691,939円
IV 発行済口数	22,417,880,000口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9684円

（参考）

### インデックス マザーファンド T O P I X

#### 純資産額計算書

I 資産総額	41,631,912,790円
II 負債総額	109,961,928円
III 純資産総額（I－II）	41,521,950,862円
IV 発行済口数	17,226,734,172口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4103円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1) 名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行わないものとします。

##### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### (3) 譲渡制限の内容

###### ① 譲渡制限はありません。

###### ② 受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### ③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

##### (4) 受益証券の再発行

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

##### (5) 受益権の再分割

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

##### (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2021年2月末現在	資本金	17,363,045,900 円
	発行可能株式総数	230,000,000 株
	発行済株式総数	197,012,500 株

●過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2021年2月末現在）

###### ・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行います。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

###### ・監査等委員会

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

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2021年2月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理／コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2021年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	840	250,370
株式投資信託	777	214,171
単位型	270	10,692
追加型	507	203,479
公社債投資信託	63	36,199
単位型	50	2,029
追加型	13	34,170

### 3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 61 期事業年度（2019 年 4 月 1 日から 2020 年 3 月 31 日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 62 期中間会計期間（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、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2020年6月8日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の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、日興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) 上記は、当社が、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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年12月4日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の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、日興アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び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及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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) 上記は、当社が、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。

## (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

		第 60 期 (2019 年 3 月 31 日)		第 61 期 (2020 年 3 月 31 日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	20,680		24,591
有価証券		1		19
前払費用		495		603
未収入金		38		14
未収委託者報酬		16,867		16,912
未収収益	※3	618	※3	1,412
関係会社短期貸付金		2,408		2,371
立替金		791		1,437
その他	※2	869	※2	1,316
流動資産合計		42,769		48,679
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	136	※1	182
器具備品	※1	137	※1	135
有形固定資産合計		274		318
無形固定資産				
ソフトウェア		107		120
無形固定資産合計		107		120
投資その他の資産				
投資有価証券		16,755		17,826
関係会社株式		25,769		25,769
長期差入保証金		447		484
繰延税金資産		1,913		2,022
投資その他の資産合計		44,886		46,102
固定資産合計		45,268		46,540
資産合計		88,038		95,220

(単位：百万円)

	第 60 期 (2019 年 3 月 31 日)	第 61 期 (2020 年 3 月 31 日)
負債の部		
流動負債		
預り金	354	554
未払金	6,112	5,881
未払収益分配金	7	8
未払償還金	71	71
未払手数料 ※3	5,299	5,202
その他未払金	734	599
未払費用 ※3	3,897	※3 4,289
未払法人税等	2,382	1,439
未払消費税等 ※4	621	※4 746
賞与引当金	2,680	2,718
役員賞与引当金	210	55
その他 ※3	172	42
流動負債合計	16,431	15,726
固定負債		
退職給付引当金	1,405	1,395
その他	629	695
固定負債合計	2,035	2,091
負債合計	18,466	17,818
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	47,142	55,395
利益剰余金合計	47,142	55,395
自己株式	△833	△905
株主資本合計	68,891	77,073
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	493	△60
繰延ヘッジ損益	185	389
評価・換算差額等合計	679	329
純資産合計	69,571	77,402
負債純資産合計	88,038	95,220

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第 60 期 (自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)	第 61 期 (自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	77,264	74,265
その他営業収益	3,063	2,994
営業収益合計	80,328	77,259
営業費用		
支払手数料	32,834	31,322
広告宣伝費	960	953
公告費	2	2
調査費	18,251	17,275
調査費	890	920
委託調査費	17,333	16,333
図書費	27	21
委託計算費	541	534
営業雑経費	794	1,058
通信費	128	116
印刷費	334	337
協会費	69	52
諸会費	19	10
その他	243	541
営業費用計	53,385	51,148
一般管理費		
給料	9,783	9,857
役員報酬	241	360
役員賞与引当金繰入額	210	55
給料・手当	6,589	6,675
賞与	61	64
賞与引当金繰入額	2,680	2,702
交際費	92	92
寄付金	13	29
旅費交通費	476	420
租税公課	428	440
不動産賃借料	888	901
退職給付費用	378	387
退職金	52	82
固定資産減価償却費	108	118
福利費	1,071	1,014
諸経費	3,106	3,229
一般管理費計	16,401	16,573
営業利益	10,540	9,538

(単位：百万円)

	第 60 期		第 61 期	
	(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)		(自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取利息		37		99
受取配当金	※ 1	1,865	※ 1	4,881
有価証券償還益		1		—
デリバティブ収益	※ 1	142		223
時効成立分配金・償還金		21		1
為替差益		58		5
その他		48		145
営業外収益合計		2,176		5,357
営業外費用				
支払利息	※ 1	286		185
有価証券償還損		—		0
時効成立後支払分配金・償還金		78		1
その他		24		12
営業外費用合計		388		199
経常利益		12,328		14,695
特別利益				
投資有価証券売却益		218		164
特別利益合計		218		164
特別損失				
投資有価証券売却損		176		19
投資有価証券評価損		—		21
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		180		—
特別損失合計		357		41
税引前当期純利益		12,189		14,818
法人税、住民税及び事業税		3,741		3,307
法人税等調整額		△375		45
法人税等合計		3,366		3,353
当期純利益		8,823		11,465

(3) 【株主資本等変動計算書】

第 60 期（自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日）

（単位：百万円）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	△786	61,756
当期変動額							
剰余金の配当				△1,640	△1,640		△1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						△47	△47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	7,182	7,182	△47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	△833	68,891

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				△1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				△47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	△160	△75	△75
当期変動額合計	85	△160	△75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

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

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				△3,212
当期純利益				11,465
自己株式の取得				△71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△553	204	△349	△349
当期変動額合計	△553	204	△349	7,831
当期末残高	△60	389	329	77,402

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第 61 期 (自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>① 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>② その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td><td>3 年～15 年</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>3 年～20 年</td></tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5 年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3 年～15 年	器具備品	3 年～20 年
建物	3 年～15 年				
器具備品	3 年～20 年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10 年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</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 平成 30 年 3 月 30 日)
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第 30 号 平成 30 年 3 月 30 日)

(1) 概要

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

ステップ 1 : 顧客との契約を識別する。

ステップ 2 : 契約における履行義務を識別する。

ステップ 3 : 取引価格を算定する。

ステップ 4 : 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ 5 : 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022 年 3 月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

## (貸借対照表関係)

第 60 期 (2019 年 3 月 31 日)	第 61 期 (2020 年 3 月 31 日)
<p>※ 1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,281 百万円</p> <p>器具備品 655 百万円</p> <p>※ 2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。</p> <p>※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 1,347 百万円</p> <p>未収収益 127 百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 350 百万円</p> <p>未払費用 767 百万円</p> <p>その他 162 百万円</p> <p>※ 4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>※ 5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が ロンドン ウォール リミテッド パートナースィップ に支払うオフィス賃借料等の債務 468 百万円に対し て保証を行っております。</p>	<p>※ 1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,311 百万円</p> <p>器具備品 707 百万円</p> <p>※ 2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。</p> <p>※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 151 百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 623 百万円</p> <p>※ 4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>※ 5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が ロンドン ウォール リミテッド パートナースィップ に支払うオフィス賃借料等の債務 365 百万円に対し て保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第 60 期 (自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)	第 61 期 (自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)
※ 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。	※ 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。
受取配当金 1,831 百万円	受取配当金 4,849 百万円
デリバティブ収益 54 百万円	
支払利息 75 百万円	

## (株主資本等変動計算書関係)

第 60 期 (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	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式 (株)	197,012,500	—	—	197,012,500

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式 (株)	1,301,700	64,000	—	1,365,700

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009 年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	—	323,400	1,171,500	—
2009 年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	—	33,000	75,900	—
2011 年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	—	630,300	2,055,900	—
2016 年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	—	—	3,618,000	—
2016 年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	—	66,000	3,811,000	—
2017 年度 ストックオプション(1)	普通株式	—	4,422,000	66,000	4,356,000	—
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	—

(注) 1 2017 年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

3 2009 年度ストックオプション(1)1,171,500 株、2009 年度ストックオプション(2)75,900 株、2011 年度ストックオプション(1)2,055,900 株及び 2016 年度ストックオプション(1)1,206,000 株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016 年度ストックオプション(1)2,412,000 株、2016 年度ストックオプション(2)及び 2017 年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1 株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018 年 5 月 31 日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018 年 3 月 31 日	2018 年 6 月 23 日

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

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

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

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

第 60 期 (自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)	第 61 期 (自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)
オペレーティング・リース取引	オペレーティング・リース取引
解約不能のものに係る未経過リース料	解約不能のものに係る未経過リース料
1 年内 853 百万円	1 年内 912 百万円
1 年超 6,704 百万円	1 年超 6,148 百万円
合計 7,558 百万円	合計 7,060 百万円

(金融商品関係)

第 60 期(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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

2019 年 3 月 31 日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	20,680	20,680	—
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	—
(3) 未収収益	618	618	—
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,740	16,740	—
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	—
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	—
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(31)	(31)	—
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	—
デリバティブ取引計	(158)	(158)	—

(※1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係) 注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1 年以内	1 年超 5 年以内	5 年超 10 年以内	10 年超
現金・預金	20,680	—	—	—
未収委託者報酬	16,867	—	—	—
未収収益	618	—	—	—
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363



## 1 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### ① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### ② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### ③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

(※1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

## (8) デリバティブ取引

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

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

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

## 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1 年以内	1 年超 5 年以内	5 年超 10 年以内	10 年超
現金・預金	24,591	—	—	—
未収委託者報酬	16,912	—	—	—
未収収益	1,412	—	—	—
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

(有価証券関係)

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	7,400	7,589	△188
	小計	7,400	7,589	△188
合計		16,740	16,029	711

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

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

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第 60 期(2019 年 3 月 31 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,407	—	3	3
	買建	—	—	—	—
合計		2,407	—	3	3

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	1,792	—	△35	△35
合計		1,792	—	△35	△35

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2, 251	—	△42
	豪ドル		63	—	△0
	シンガポール ドル		975	—	△18
	香港ドル		518	—	△8
	人民元		2, 149	—	△58
	ユーロ		81	—	0
合計			6, 040	—	△127

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第 61 期(2020 年 3 月 31 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,913	—	△41	△41
	買建	—	—	—	—
合計		1,913	—	△41	△41

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	1,808	—	15	15
合計		1,808	—	15	15

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第 60 期 (自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)	第 61 期 (自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631

(退職給付関係)

第 60 期(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、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	△59
退職給付債務の期末残高	1,411

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

退職給付債務	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	△6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.1%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230 百万円でありました。



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

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	△31
退職給付の支払額	△164
退職給付債務の期末残高	1,363

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.2%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233 百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009 年度ストックオプション(1)	2009 年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271 名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48 名
株式の種類別のストックオプション の付与数 (注)	普通株式 19,724,100 株	普通株式 1,702,800 株
付与日	2010 年 2 月 8 日	2010 年 8 月 20 日
権利確定条件	2012 年 1 月 22 日 (以下「権利行使可 能初日」といいます。)、当該権利行 使可能初日から 1 年経過した日の翌 日、及び当該権利行使可能初日から 2 年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2 分の 1、4 分の 1、4 分の 1 ずつ 権利確定する。ただし、本新株予約 権の行使時において、当社が株式公 開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2 年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012 年 1 月 22 日から 2020 年 1 月 21 日まで	同左

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ① ストックオプション(新株予約権)の数

	2009 年度ストックオプション(1)	2009 年度ストックオプション(2)
付与日	2010 年 2 月 8 日	2010 年 8 月 20 日
権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	2011 年度ストックオプション(1)	2016 年度ストックオプション(1)
付与日	2011 年 10 月 7 日	2016 年 7 月 15 日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	2016 年度ストックオプション(2)	2017 年度ストックオプション(1)
付与日	2017 年 4 月 27 日	2018 年 4 月 27 日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	—
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

## ② 単価情報

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

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りに  
よっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128 百万円
- 3 株式公開価格が 737 円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分  
割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開  
日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

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

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2009 年度ストックオプション(1)	2009 年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271 名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48 名
株式の種類別のストックオプション の付与数 (注)	普通株式 19,724,100 株	普通株式 1,702,800 株
付与日	2010 年 2 月 8 日	2010 年 8 月 20 日
権利確定条件	2012 年 1 月 22 日 (以下「権利行使可 能初日」といいます。)、当該権利行 使可能初日から 1 年経過した日の翌 日、及び当該権利行使可能初日か ら 2 年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2 分の 1、4 分の 1、4 分の 1 ずつ 権利確定する。ただし、本新株予約 権の行使時において、当社が株式公 開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2 年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012 年 1 月 22 日から 2020 年 1 月 21 日まで	同左

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ① ストックオプション(新株予約権)の数

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

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



	2016 年度ストックオプション(2)	2017 年度ストックオプション(1)
付与日	2017 年 4 月 27 日	2018 年 4 月 27 日
権利確定前(株)		
期首	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

## ② 単価情報

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

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

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

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

## (税効果会計関係)

第 60 期 (2019 年 3 月 31 日)		第 61 期 (2020 年 3 月 31 日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳  (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳  (単位：百万円)
	繰延税金資産		繰延税金資産
	賞与引当金 820		賞与引当金 822
	投資有価証券評価損 96		投資有価証券評価損 102
	関係会社株式評価損 1,430		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 430		退職給付引当金 427
	固定資産減価償却費 103		固定資産減価償却費 96
	その他 761		その他 744
	繰延税金資産小計 3,643		繰延税金資産小計 3,624
	評価性引当金 △1,430		評価性引当金 △1,430
	繰延税金資産合計 2,212		繰延税金資産合計 2,194
	繰延税金負債		繰延税金負債
	その他有価証券評価差額金 217		繰延ヘッジ利益 172
	繰延ヘッジ利益 81		繰延税金負債合計 172
	繰延税金負債合計 299		繰延税金資産の純額 2,022
	繰延税金資産の純額 1,913		
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率 30.6%		法定実効税率 30.6%
	(調整)		(調整)
	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.8%		交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%
	受取配当金等永久に益金に参入されない項目 △4.4%		受取配当金等永久に益金に参入されない項目 △9.6%
	その他 0.6%		その他 1.0%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.6%		税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.6%

## (関連当事者情報)

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業 の内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポ ー ル 国	342,369 (SGD 千)	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	資金の 貸付	資金の貸付の 返済 (シンガ ポールドル 貨建) (注 1)	554 (SGD 6,800 千) (注 2)	—	—
							貸付金利息 (シンガ ポールドル 貨建) (注 1)	8 (SGD 104 千)	—	—
							資金の貸付 (米国ドル 貨建) (注 3)	1,807 (USD 16,500 千) (注 4)	関係会社 短期 貸付金	1,830 (USD 16,500 千)
							貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注 3)	17 (USD 209 千)	未収収益	17 (USD 209 千)
							資金の貸付 (円貨建) (注 3)	—	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注 3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 5)	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	—	配当の受取	1,021 (USD 9,000 千)	—	—
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD 千) (注 5)	アセット マネジメ ント業	間接 100.00	資金の 借入	資金の借入 (米国ドル 貨建) (注 6)	5,364 (USD 50,000 千) (注 7)	—	—
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貨建) (注 6)	5,526 (USD 50,000 千) (注 7)	—	—
							借入金利息 (米国ドル 貨建) (注 6)	65 (USD 593 千)	—	—

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠 SGD11,000 千、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 取引金額 554 百万円 (SGD6,800 千) の内訳は、貸付の返済 554 百万円 (SGD6,800 千) であります。
- 3 融資枠 5,000 百万円 (若しくは 5,000 百万円相当額の外国通貨)、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 取引金額 1,807 百万円 (USD16,500 千) の内訳は、貸付 1,807 百万円 (USD16,500 千) であります。

- 5 Nikko AM Americas Holding Co., Inc. 及び Nikko Asset Management Americas, Inc. の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 6 借入枠 USD50,000 千、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 7 取引金額 5,364 百万円 (USD50,000 千) 及び 5,526 百万円 (USD50,000 千) の内訳は、借入 5,364 百万円 (USD50,000 千) 及び借入の返済 5,526 百万円 (USD50,000 千) であります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）  
三井住友信託銀行株式会社（非上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は 2019 年 12 月 31 日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	26,768 百万円
負債合計	5,586 百万円
純資産合計	21,181 百万円

営業収益	14,075 百万円
税引前当期純利益	3,894 百万円
当期純利益	2,730 百万円

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

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業 の内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポール 国	342,369 (SGD 千)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	—	資金の貸付 (米国ドル 貨建) (注 1)	—	関係会社 短期 貸付金	1,793 (USD 16,500 千)
							貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注 1)	86 (USD 798 千)	未収収益	13 (USD 122 千)
							資金の貸付 (円貨建) (注 1)	—	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注 1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	—	配当の受取	1,526 (USD 14,000 千)	—	—
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	—	配当の受取	2,700	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は 2019 年 12 月 31 日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	28,121 百万円
負債合計	5,242 百万円
純資産合計	22,879 百万円

営業収益	14,853 百万円
税引前当期純利益	4,354 百万円
当期純利益	3,194 百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

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

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

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

関連情報

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の 10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

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

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の 10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第 60 期(自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。



## (1株当たり情報)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	355円59銭	395円50銭
1株当たり当期純利益金額	45円08銭	58円61銭

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

## 2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益 (百万円)	8,823	11,465
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	—	—
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	8,823	11,465
普通株式の期中平均株式数 (千株)	195,677	195,599
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株

## 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
純資産の部の合計額 (百万円)	69,571	77,402
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	—	—
普通株式に係る期末の純資産額 (百万円)	69,571	77,402
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数 (千株)	195,647	195,558

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等  
(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 62 期中間会計期間  
(2020 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		23,938
有価証券		42
未収委託者報酬		14,700
未収収益		838
関係会社短期貸付金		2,323
その他	※ 2	2,990
流動資産合計		44,833
固定資産		
有形固定資産	※ 1	408
無形固定資産		154
投資その他の資産		
投資有価証券		21,271
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		462
繰延税金資産		1,702
投資その他の資産合計		49,206
固定資産合計		49,769
資産合計		94,603

(単位：百万円)

第 62 期中間会計期間  
(2020 年 9 月 30 日)

負債の部		
流動負債		
未払金		7,010
未払費用		3,510
未払法人税等		1,507
未払消費税等	※ 3	562
賞与引当金		1,606
役員賞与引当金		27
その他		1,069
流動負債合計		15,294
固定負債		
退職給付引当金		1,452
その他		315
固定負債合計		1,768
負債合計		17,062
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		55,970
利益剰余金合計		55,970
自己株式		△2,067
株主資本合計		76,486
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		645
繰延ヘッジ損益		408
評価・換算差額等合計		1,054
純資産合計		77,541
負債純資産合計		94,603

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)
営業収益		
委託者報酬		35,275
その他営業収益		1,507
営業収益合計		36,782
営業費用及び一般管理費	※ 1	32,215
営業利益		4,567
営業外収益	※ 2	789
営業外費用	※ 3	418
経常利益		4,938
特別利益	※ 4	43
特別損失	※ 5	91
税引前中間純利益		4,891
法人税等	※ 6	1,452
中間純利益		3,438

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 62 期中間会計期間（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		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	△905	77,073
当中間期変動額							
剰余金の配当				△2,862	△2,862		△2,862
中間純利益				3,438	3,438		3,438
自己株式の取得						△1,161	△1,161
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	－	－	－	575	575	△1,161	△586
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	55,970	55,970	△2,067	76,486

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△60	389	329	77,402
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,862
中間純利益				3,438
自己株式の取得				△1,161
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	706	18	724	724
当中間期変動額合計	706	18	724	138
当中間期末残高	645	408	1,054	77,541

注記事項  
(重要な会計方針)

項目	第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>②その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5 年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10 年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

## (中間貸借対照表関係)

第 62 期中間会計期間 (2020 年 9 月 30 日)	
※ 1	有形固定資産の減価償却累計額 2,060 百万円
※ 2	信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※ 3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※ 4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務 28 百万円に対して保証を行っております。

## (中間損益計算書関係)

第 62 期中間会計期間 (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 43 百万円 無形固定資産 20 百万円
※ 2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 40 百万円 受取配当金 719 百万円
※ 3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 60 百万円 デリバティブ費用 338 百万円
※ 4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 43 百万円
※ 5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 90 百万円
※ 6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式 (株)	1, 454, 500	1, 405, 500	—	2, 860, 000

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間 会計 期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
2011 年度 ストックオプション (1)	普通株式	1, 184, 700	—	270, 600	914, 100	—
2016 年度 ストックオプション (1)	普通株式	1, 346, 000	—	319, 000	1, 027, 000	—
2016 年度 ストックオプション (2)	普通株式	2, 394, 000	—	402, 000	1, 992, 000	—
2017 年度 ストックオプション (1)	普通株式	2, 939, 000	—	—	2, 939, 000	—
合計		7, 863, 700	—	991, 600	6, 872, 100	—

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

2 2011 年度ストックオプション(1)914,100 株、2016 年度ストックオプション(1)1,027,000 株、2016 年度ストックオプション(2)1,198,000 株及び 2017 年度ストックオプション(1)986,000 株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016 年度ストックオプション(2)794,000 株及び 2017 年度ストックオプション(1)1,953,000 株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1 株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020 年 6 月 12 日 取締役会	普通株式	2, 862	14. 64	2020 年 3 月 31 日	2020 年 7 月 1 日

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

(リース取引関係)

第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1 年内	911 百万円
1 年超	5, 692 百万円
合計	6, 604 百万円



(金融商品関係)

第 62 期中間会計期間(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(当中間決算日)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、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	23,938	23,938	—
(2) 未収委託者報酬	14,700	14,700	—
(3) 未収収益	838	838	—
(4) 関係会社短期貸付金	2,323	2,323	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	21,297	21,297	—
(6) 未払金	(7,010)	(7,010)	—
(7) 未払費用	(3,510)	(3,510)	—
(8) デリバティブ取引(※2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(15)	(15)	—
ヘッジ会計が適用されているもの	14	14	—
デリバティブ取引計	(1)	(1)	—

(※1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

- (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
  - (5) 有価証券及び投資有価証券  
投資信託は基準価額によっております。
  - (6) 未払金及び(7) 未払費用  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
  - (8) デリバティブ取引  
(デリバティブ取引関係) 注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち 21 百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、36 百万円は、流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち 65 百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、51 百万円は、流動負債のその他に含まれております。
- 2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額 16 百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
  - 3 子会社株式(中間貸借対照表計上額 22,876 百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 2,892 百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第 62 期中間会計期間(2020 年 9 月 30 日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	9,871	8,550	1,320
	小計	9,871	8,550	1,320
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	11,425	11,815	△389
	小計	11,425	11,815	△389
合計		21,297	20,366	930

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

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

(デリバティブ取引関係)

第 62 期中間会計期間(2020 年 9 月 30 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,250	—	△36	△36
合計		2,250	—	△36	△36

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,766	—	21	21
合計		1,766	—	21	21

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

2 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち 1 年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	4,775	—	53
	豪ドル		3	—	△0
	シンガポールドル		509	—	△1
	ユーロ		47	—	△0
	香港ドル		1,068	—	12
	人民元		2,404	—	△48
	合計		8,808	—	14

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,003 百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,460 百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,335 百万円

(ストックオプション等関係)

第 62 期中間会計期間(自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)  
該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第 62 期中間会計期間(自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)  
当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

[関連情報]

第 62 期中間会計期間(自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の 10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第 62 期中間会計期間(自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)  
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第 62 期中間会計期間(自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)  
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第 62 期中間会計期間(自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)  
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)
1株当たり純資産額	399 円 38 銭
1株当たり中間純利益金額	17 円 64 銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第 62 期中間会計期間 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日)
中間純利益 (百万円)	3,438
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	—
普通株式に係る中間純利益 (百万円)	3,438
普通株式の期中平均株式数 (千株)	194,864
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まなかった潜在株式の概要	2011 年度ストックオプション(1)914,100 株、 2016 年度ストックオプション(1)1,027,000 株、 2016 年度ストックオプション(2)1,992,000 株、 2017 年度ストックオプション(1)2,939,000 株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第 62 期中間会計期間 (2020 年 9 月 30 日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額 (百万円)	77,541
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	—
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額 (百万円)	77,541
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間会計期間末の普通株式の数 (千株)	194,153

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5 【その他】

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

## <約 款>

## <追加型証券投資信託 インデックスファンドTSP>

### 運用の基本方針

約款第18条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものといたします。

#### 基本方針

この投資信託は、わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（インデックス）をモデルとして運用を行ないます。

#### 運用方法

##### (1)投資対象

インデックス マザーファンド TOPIX受益証券ならびに東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

インデックス マザーファンド TOPIX受益証券に投資を行なうとともに、わが国の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、東証株価指数の動きに連動した投資成果を目指します。

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、株式（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）への投資にあたっては、バーラ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行ないます。

①投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないます。

②資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行ないます。

③株式の組入比率は、高位を保ちます。

株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

#### 運用制限

(1)株式への実質投資割合には制限を設けません。

(2)投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(3)有価証券先物取引等は、約款第20条の2の範囲で行ないます。

(4)スワップ取引は、約款第20条の6の範囲で行ないます。

(5)外貨建資産への投資は行ないません。

(6)一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

##### ①分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### ②分配対象額についての分配方針

利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

##### ③留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。



## 追加型証券投資信託 インデックスファンドTSP 約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は証券投資信託であり、日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、この信託に関する信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金131億8,200万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者は、これを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第37条第7項、第38条、第39条第1項、第40条第1項および第42条第2項の規定による解約の日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第3条の2 この信託に係る受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第4条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第5条 委託者は、第2条第1項による受益権については131億8,200万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第6条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第6条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

(追加日時の異なる受益権の内容)

第7条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第8条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社振法の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、

受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

- ③ 委託者は、第5条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、保護預り会社または第34条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および委託者の指定する登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

- 第9条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位および価額）

- 第10条 委託者は、第5条第1項の規定により分割される受益権を、取得申込者に対し、委託者が定める単位をもって、当該受益権の取得の申込に応ずるものとします。なお、この場合においては、第34条第3項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に限り、1口の整数倍をもって当該取得の申込に応ずることができます。また、受益権の取得申込者がその申込をしようとする場合において、委託者に対し、当該取得の申込に係る受益権について、第34条第3項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込をしないことを申し出たときは、委託者が定める単位をもって、当該受益権の取得の申込に応ずるものとします。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、第5条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が定める単位をもって取得の申込に応ずるものとします。ただし、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができます。

- ③ 前2項の取得申込者は、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者（第34条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

- ④ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る受益証券の価額は、1口につき1円に、1円に2%の率を乗じて得た手数料を加算した価額とします。

- ⑤ 前項の手数は、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関がそれぞれ独自に定めるものとします。

- ⑥ 第4項の規定にかかわらず、証券投資信託の受益証券または受益権を信託終了時まで保有した受益者（信託期間を延長した証券投資信託（追加型証券投資信託にあつては、延長前の信託終了日（以下「当初の信託終了日」といいます。）以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行なわないものを

います。以下本項において同じ。)にあっては、当初の信託終了日まで当該信託の受益証券または受益権を保有した受益者をいいます。以下本項において同じ。)が、その償還金(信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金を含みます。以下本項において同じ。)をもって、当該信託終了日(信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取約定日または一部解約請求日を含みます。)の属する月の翌月の初日から起算して3ヵ月以内に、当該償還金の支払いを受けた委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関でこの信託に係る受益権の取得申込をする場合の1口当たりの受益権の価額は、当該償還金額の範囲内(単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額とのいずれか大きい額)で取得する口数について取得申込日の基準価額とすることができます。

なお、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関は、当該受益者に対し、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求めることができます。

- ⑦ 第4項の規定にかかわらず、受益者が第34条第3項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第27条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 追加型証券投資信託の受益証券または受益権を保有する者が、当該信託の信託終了日の1年前の日以降に開始する委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が別に定める期間内に、当該信託の受益証券または受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金をもって、当該売却代金または一部解約金の支払いを受けた委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関でこの信託に係る受益権の取得申込をする場合の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、取得申込を行なう委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑨ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受け付けた取得申込の受付を取消することができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第11条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第12条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(無記名式の受益証券の再交付)

第13条 (削 除)

(記名式の受益証券の再交付)

第14条 (削 除)

(毀損した場合等の再交付)

第15条 (削 除)

(受益証券の再交付の費用)

第16条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第16条の2 この信託において投資の対象とする資産の種類(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条

各号で定める特定資産の種類をいいます。)は、次に掲げるものとします。

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、第20条の2および第20条の6に定めるものに限ります。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

② この信託においては、前項各号に掲げる資産のほか、次に掲げる資産を投資の対象とします。

1. 為替手形

（デリバティブ取引等に係る投資制限）

第16条の3 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

（運用の指図範囲）

第17条 委託者は、信託金を、主として日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託 インデックス マザーファンド TOPIX（その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
2. 短期社債等（社振法第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
3. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質を有するもの
4. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
5. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
7. 貸付債権信託受益権であつて金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といい、第4号および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 前項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。

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

③ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第17条の2 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条

第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条および第20条の8において同じ。）、第20条の8第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条の2ならびに第17条第1項および第2項に定める資産への投資を行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第19条、第20条の2、第20条の5から第20条の7までおよび第23条から第24条の2までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

（投資する株式等の範囲）

第19条 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

（同一銘柄の株式への投資制限）

第20条 （削 除）

（先物取引等の運用指図・目的・範囲）

第20条の2 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- ② 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利に係るこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

（海外金融先物市場における先物取引および先物オプション取引の目的・範囲）

第20条の3 （削 除）

（有価証券の保管）

第20条の4 （削 除）

（信用取引の指図範囲）

第20条の5 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条の3第1

項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権(前号に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第20条の6 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本項において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- ⑥ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第20条の7 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を第2項に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。

- ② 前項の株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ③ 前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 委託者は、株式の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(信託業務の委託等)

第20条の8 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 信託財産の保管等を委託する場合においては、当該財産の分別管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限り、)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
  1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

#### 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

##### (混蔵寄託)

第21条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

##### (信託財産の登記等および記載等の留保等)

第22条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

##### (一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第23条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

##### (再投資の指図)

第24条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

##### (資金の借入れ)

第24条の2 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- ② 前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
  1. 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
  3. 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ③ 一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ④ 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- ⑤ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

##### (損益の帰属)

第25条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

##### (受託者による資金の立替え)

第26条 信託財産に属する有価証券について、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託

者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第27条 この信託の計算期間は、毎年2月13日から翌年2月12日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第28条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務等の諸費用)

第29条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息、信託財産の財務諸表の監査に要する費用ならびに当該費用に係る消費税等相当額（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の額)

第30条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第27条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の52以内の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末、または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

(収益分配)

第31条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配します。ただし、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。ただし、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② (削 除)

- ③ 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越すものとします。

(追加信託金および一部解約金の計算処理)

第32条 (削 除)

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第33条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第34条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第34条第5項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第34条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者（第34条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または



委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第35条に規定する時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関に支払われます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとし、当該取得により増加した受益権は、第8条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第37条第3項により信託の一部解約が行なわれた場合および第36条第1項により委託者の指定する第一種金融商品取引業者が受益権を買取った場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。
- ③ 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込をしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が、当該申し出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）をこの信託の受益権の取得申込金として、各受益者ごとに当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとし、当該取得により増加した受益権は、第8条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第37条第3項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。
- ④ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者（第34条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。））、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。
- ⑤ 一部解約金は、第37条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として4営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑥ 前各項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において行なうものとし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとし、
- ⑦ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関)

第34条の2 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または記録等に関する業務を委任することができます。

(収益分配金および償還金の時効)

第35条 受益者が、収益分配金については第34条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第34条第4項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(受益権の買取り)

第36条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者は、受益者の請求があるときは、1口単位をもってその受益権を買取ります。

- ② 受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額から、当該買取りに関して当該買取りを行なう委託者の指定する第一種金融商品取引業者にかかる源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額とします。

- ③ 受益者は、平成19年1月4日以降の第1項の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に買取りの代金が受益者に支払われることとなる第1項の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ④ 委託者の指定する第一種金融商品取引業者は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者との協議に基づいて第1項による受益権の買取りを中止することおよび既に受け付けた受益権の買取りの約定を取消することができます。
- ⑤ 前項により受益権の買取りが中止された場合には、受益者は買取中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日を買取約定日として、第2項の規定に準じて算定された価額とします。

(一部解約)

第37条 受益者（前条の委託者の指定する第一種金融商品取引業者を含みます。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。
- ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日を一部解約の実行の請求日として、第4項の規定に準じて算定した価額とします。
- ⑦ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、第38条の規定に従ってこの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第37条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第38条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託契約の解約を行いません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約を行わないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付しま

す。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

- ⑥ 前3項の規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合は、適用しないものとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第39条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第43条の規定に従うものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第40条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第43条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第41条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第42条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第43条の規定に従い新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第43条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託約款の変更を行ないません。

- ⑤ 委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行なわないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

(反対者の買取請求権)

第43条の2 第38条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第38条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(信託期間の延長)

第44条 (削 除)

(公告)

第45条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

(運用報告書の交付省略)

第45条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項で定める運用報告書の交付に代えて、

当該運用報告書を次のアドレスに掲載するものとします。

www.nikkoam.com/

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第46条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

## 附 則

第1条 変更後の第10条の規定は、平成18年5月13日以降の取得申込について適用します。

第2条 この約款において「自動けいぞく投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関が締結する「自動けいぞく投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第3条 (削 除)

第4条 (削 除)

第5条 (削 除)

第6条 変更後の第27条の規定は、第10計算期間の翌期初より適用するものとします。

第7条 変更後の第29条の規定は、平成11年7月1日より適用するものとします。

第8条 変更後の第6条第1項の規定は、平成12年4月4日以降行なわれる追加信託について適用するものとします。

- ② 変更後の第6条第2項の規定は、平成12年9月28日以降の純資産総額の計算に適用するものとします。

第9条 変更後の第30条第1項の規定は、平成11年12月1日以降計上される信託報酬より適用します。

- ② 変更後の第30条第3項の規定は、平成9年4月1日以降計上される信託報酬より適用します。

第10条 第34条第7項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。なお、平成12年3月31日以前の取得申込に係る受益権の信託時の受益証券の価額は、委託者が計算する平成12年3月31日の平均信託金（信託金総額を受益権総口数で除して得た額）とみなすものとします。

第11条 変更後の第36条の各規定は、平成12年4月3日以降の買取請求より適用します。

第12条 平成18年12月29日現在の信託約款第8条、第9条および第11条から第16条までの規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 1986年2月13日

東京都港区赤坂九丁目7番1号  
委託者 日興アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目4番1号  
受託者 三井住友信託銀行株式会社

