

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年 9月29日
【計算期間】	第17期（自 平成28年 7月20日 至 平成29年 7月18日）
【ファンド名】	しんきんトピックスオープン
【発行者名】	しんきんアセットマネジメント投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 堀 泰彦
【本店の所在の場所】	東京都中央区京橋三丁目 8 番 1 号
【事務連絡者氏名】	野呂 俊夫
【連絡場所】	東京都中央区京橋三丁目 8 番 1 号
【電話番号】	03 - 5524 - 8161
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

我が国の株式市場全体の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

当ファンドは、以下の「商品分類」および「属性区分」に該当します。

##### 1) 商品分類表

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 債券 不動産投信 その他資産 ( )	インデックス型
追加型投信	海外 内外	( ) 資産複合	特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券	年2回 年4回 年6回 (隔月)	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア	TOPIX
クレジット属性 ( ) 不動産投信 その他資産 ( ) 資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	その他 ( )

(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。

#### < 商品分類の定義 >

「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われ従来の信託財産とともに運用されるファンド

「国内」...目論見書または投資信託約款（以下、「目論見書等」といいます。）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

「株式」...目論見書等において、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

「インデックス型」...目論見書等において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるもの

<属性区分の定義>

「株式 一般」...目論見書等において、主として株式に投資する旨の記載があって、大型株および中小型株の区分に当てはまらないもの

「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの

「日本」...目論見書等において、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

「TOPIX」...目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨の記載があるもの

当ファンドが属さない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ホームページ ( <a href="http://www.toushin.or.jp">http://www.toushin.or.jp</a> ) をご参照ください。
--

## ファンドの特色

### 東証株価指数 (TOPIX) の動きに連動する運用を目指すファンドです。

例えば、TOPIXが5%上昇した場合には、基準価額がおおむね5%上昇し、TOPIXが5%下落した場合には、基準価額がおおむね5%下落するような運用成果を目指します。

※しんきんトピックスオープンはTOPIXに連動するように運用指図が行われますが、必ずしも完全に連動する運用成果を保証するものではありません。

#### <特色1> TOPIXという知名度の高い指標に連動することを目指すため、値動きが分かりやすいファンドです。

TOPIXは、日本の株式市場の値動きを表す代表的な指標として、テレビや新聞など身の回りのさまざまな媒体で情報が提供されています。そのため、ファンドの値動きを比較的容易に理解することができます。

#### <特色2> 少ない資金で国内株式の大部分に投資したのと同じような投資成果が期待できます。

東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄の時価総額は、我が国の上場株式の時価総額の大部分を占めています。

#### <特色3> 購入時の手数料が掛からないファンドです。

#### 東証株価指数 (TOPIX) とは…

- 東京証券取引所第一部上場全銘柄の時価総額を指数化した時価総額加重型の株価指数で、1968年1月4日を100として計算し、東京証券取引所が公表しています。Tokyo Stock Price Index を略してTOPIXと呼ばれます。

$$\left[ \begin{array}{c} \text{東証株価指数 (TOPIX) =} \\ \text{当日の時価総額} \div \text{基準時の時価総額} \times 100 \end{array} \right]$$

- 東京証券取引所第一部上場全銘柄の時価総額は、わが国の株式市場全体の時価総額の大部分を占めており、東証株価指数 (TOPIX) はわが国の株式市場の動向を的確に表しています。
- 各銘柄の時価総額を考慮しますので、一部の小型値がさ株の動きに影響されません。

※東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 ((株) 東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株) 東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株) 東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株) 東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## TOPIXの特徴

### ◎TOPIXと日経平均株価の比較

	TOPIX (東証株価指数)	日経平均株価 (日経225)
銘柄数	約2,000銘柄	225銘柄 <sup>※2</sup>
対象	東証一部上場の全銘柄 <sup>※1</sup>	東証一部上場銘柄のうち流動性と業種別分布を考慮して選定した銘柄
特徴	時価総額を基に算出されるため、時価総額の大きな銘柄の影響が強くなる傾向にあります。 (浮動株調整時価総額加重型)	時価総額を考慮しないことから、株価の高い銘柄の影響が強くなる傾向にあります。 (株価平均型)

出所：(株)東京証券取引所、(株)日本経済新聞社等の資料によりしんきんアセットマネジメント投信(株)作成

※1 新規上場直後や整理ポストに割り当てられた銘柄などは除かれます。

※2 通常は225銘柄が採用されていますが、銘柄入替時などには225銘柄とならない場合があります。

### ◎TOPIXの推移

TOPIXは日本経済の歩みとともに、日本株式市場の動きを的確に反映して推移してきました。



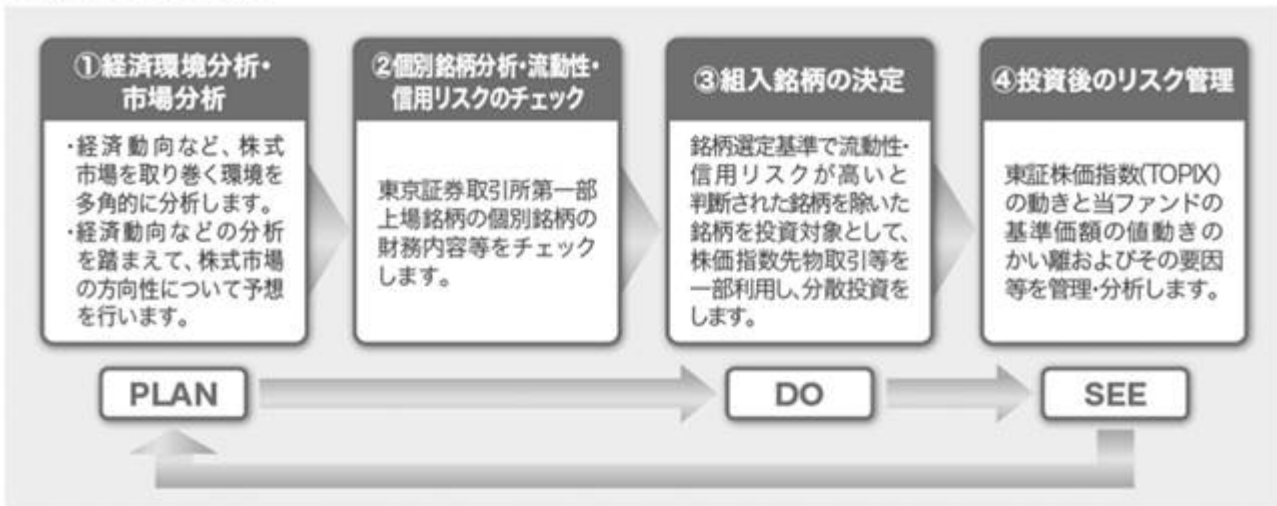
出所：内閣府ホームページ他より、しんきんアセットマネジメント投信(株)作成

※グラフ・データは終値ベースです。

### ●投資戦略

- 東京証券取引所第一部上場の銘柄に投資します。
- 株価指数先物取引等の派生商品の活用により、取引コストや価格変動リスクを低減させるとともに、株式(現物)と株価指数先物取引を合計した実質組入比率を高位に保ち、東証株価指数(TOPIX)との連動性の向上を図ります。

## ●投資プロセス



※市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ●ベンチマークについて

しんきんトピックスオープンは、東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、これに連動する運用を目指します。

(ベンチマークとは、投資銘柄の決定などにあたって目安となる指標のことです。)

## ●収益分配について

年1回の決算時(7月18日(休業日の場合は翌営業日))に収益分配方針に従って分配を行います。



※上記の図はイメージであり、将来の分配金をお約束するものではありません。

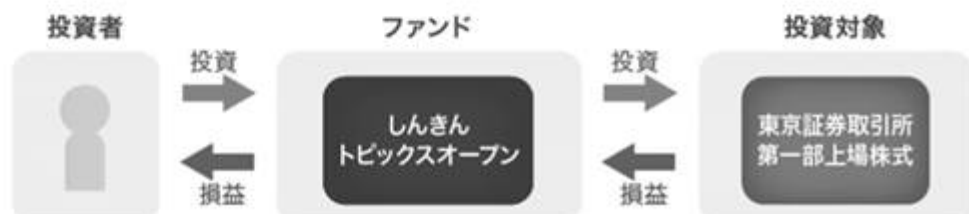
※自動けいぞく投資コースおよび確定拠出年金コースの場合、分配金は自動的に再投資されます。

※分配金のお受け取りについては販売会社にお問い合わせください。

### <収益分配方針>

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)の全額とします。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないこともあります。

### ファンドの仕組み



## 主な投資制限

- 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は行いません。

信託金の限度額

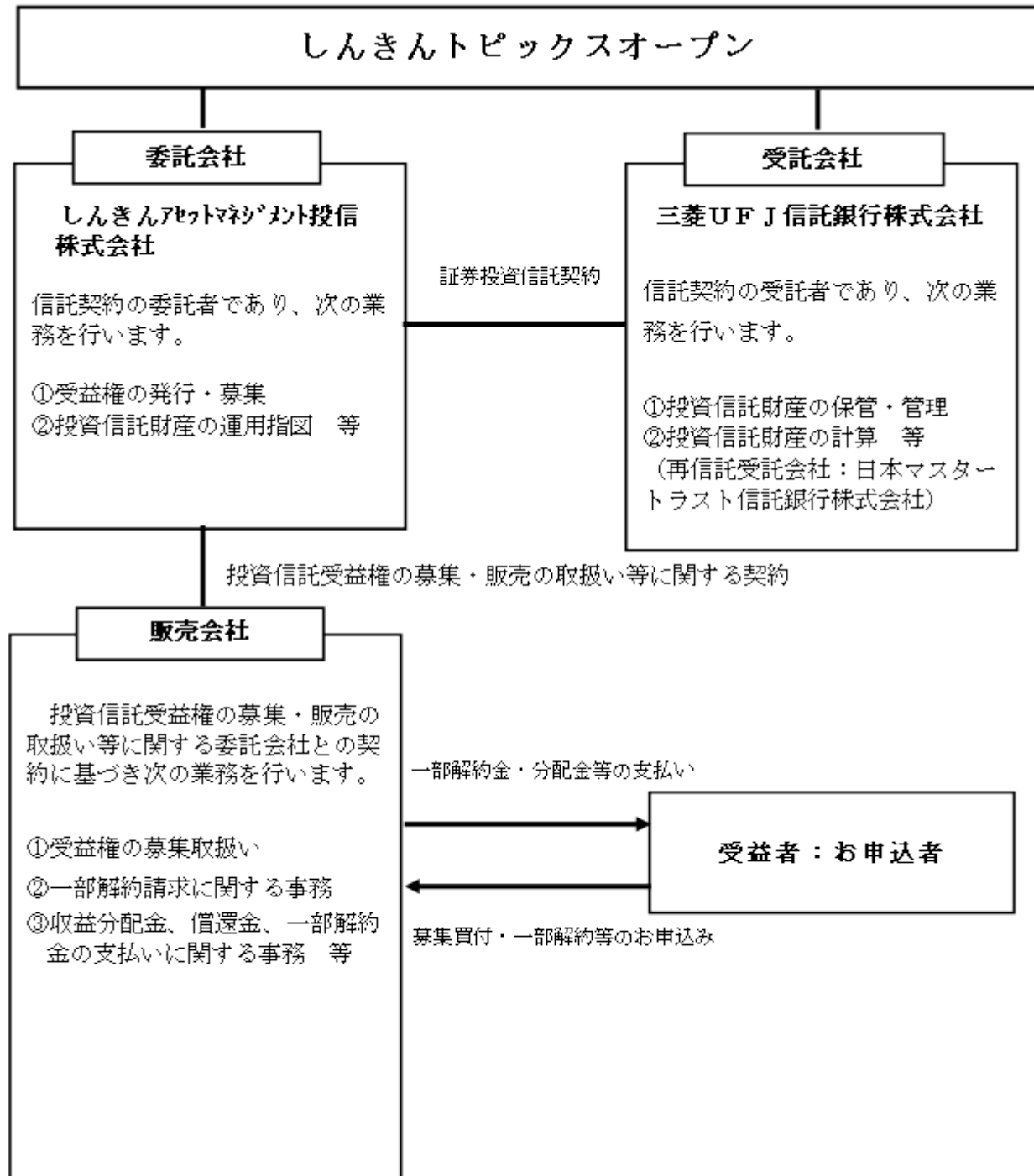
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、3,000億円を限度額として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## (2)【ファンドの沿革】

平成12年7月19日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始。

## (3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組みは、以下のとおりです。



## &lt; 委託会社の概況 &gt; (本書提出日現在)

## 名称

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

## 本店の所在の場所

東京都中央区京橋三丁目 8 番 1 号

## 資本金の額

200百万円

## 会社の沿革

平成 2 年 12 月	全信連投資顧問株式会社として設立
平成 3 年 3 月	投資顧問業の登録
平成 4 年 3 月	投資一任契約に係る業務の認可
平成 10 年 11 月	「しんきんアセットマネジメント投信株式会社」に商号変更
平成 10 年 12 月	証券投資信託委託業の認可
平成 19 年 9 月	金融商品取引業者（投資運用業、投資助言・代理業）の登録
平成 29 年 8 月	金融商品取引法に基づく第二種金融商品取引業の追加登録

## 大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
信金中央金庫	東京都中央区八重洲一丁目 3 番 7 号	4,000株	100.0%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 投資対象

主として我が国の株式を主要投資対象とします。ただし、投資信託財産の規模によっては、主として我が国の公社債等に投資するとともに株価指数先物取引等を利用して運用を行う場合があります。

## 投資態度

- 1) 金融商品取引所第一部上場株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることを目指して運用を行うことを基本とします。
- 2) 株式（株価指数先物取引等を含む）の組入比率は、高位を保ちます。
- 3) 東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させるため、国内において行われる株価指数先物取引等を利用することがあります。このため株式の組入時価総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4) 前記 3) のほかに、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、有価証券店頭オプション取引、有価証券指数等オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。）を行うことができます。
- 6) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。
- 7) 株式以外の資産への投資割合は、原則として、投資信託財産の総額の 50% 以下とします。



- 8) 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。

## (2)【投資対象】

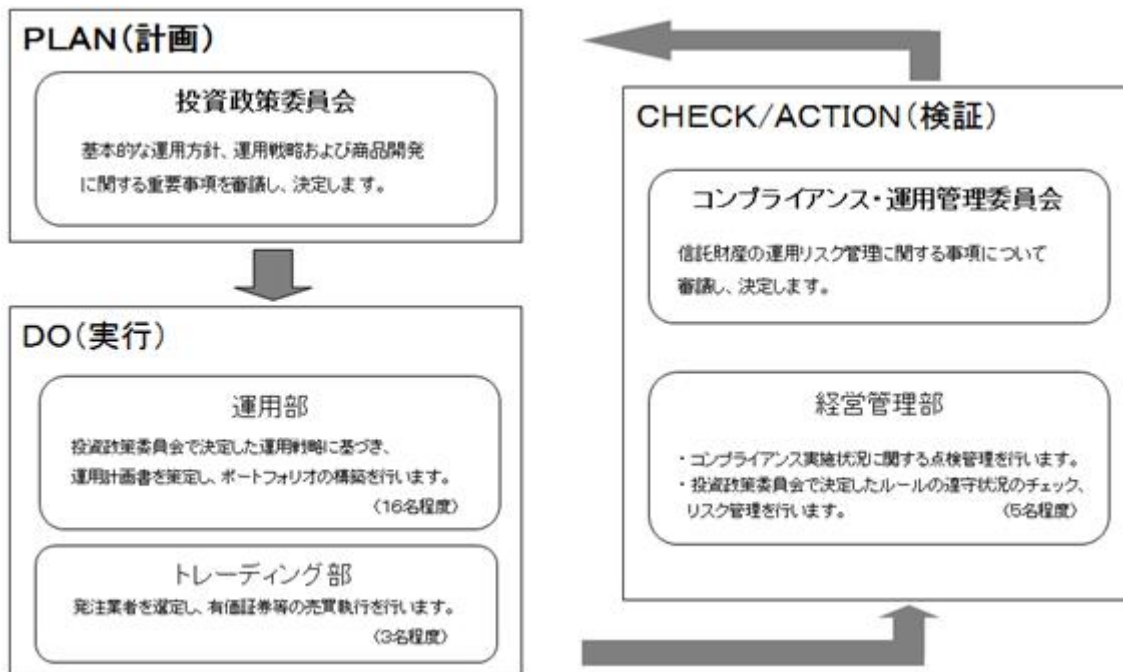
委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券または優先出資引受権を表示する証書(金融商品法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13) 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、外国投資信託を除きます。)
- 14) 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、外国投資証券を除きます。)
- 15) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 16) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるもので、本邦通貨建のものとしします。)
- 17) 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。)
- 18) 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ものをいいます。

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第16号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## (3)【運用体制】

当社のファンドの運用体制は、以下のとおりです。



#### 投資プロセス

信金中央金庫グループおよび内外の調査機関からの情報に基づき、投資環境等について当社独自の綿密な調査・分析を行います。

投資政策委員会においては、ファンダメンタルズ分析、市場分析を踏まえて基本的な投資方針を策定します。また、基本的な投資方針に基づき当面の運用に当たってのガイドラインを決定し、併せて個別銘柄についての分析を行い、投資対象銘柄を選定します。

ファンドの運用体制等は、今後変更となる場合があります。

#### (4)【分配方針】

収益の分配は年1回の決算時（7月18日、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないこともあります。

収益分配に充てず投資信託財産に留保した収益等については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

#### (5)【投資制限】

しんきんトピックスオープン投資信託約款（以下「約款」といいます。）および法令では、ファンドの運用に関して一定の制限および限度を定めています。かかる制限、限度は以下のとおりです。

投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式は、我が国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行する株式とします。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。

#### 株式への投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

#### 新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 同一銘柄の転換社債等への投資制限

同一銘柄の転換社債および新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって、当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ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。)への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資は行いません。

#### 先物取引等の運用指図

- 1) 委託会社は、我が国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引を行うことの指図をすることができます。また、我が国において行われる有価証券店頭オプション取引、有価証券店頭指数等オプション取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ)。
- 2) 委託会社は、我が国の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を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の範囲

- 1) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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、原則として約款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、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社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) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

- 5) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引の範囲

- 1) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として約款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) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 5) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 信用リスク集中回避のための投資制限

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等エクスポージャーの投資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、当該比率以内になるよう調整を行うこととします。

#### デリバティブ取引等に係る投資制限

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいいます。）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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

#### 信用取引の指図範囲

- 1) 委託会社は、投資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付けることの指図をすることができます。なお、当該売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うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 1)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。
  - a. 投資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
  - b. 株式分割により取得する株券
  - c. 有償増資により取得する株券
  - d. 売り出しにより取得する株券
  - e. 投資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の行使により取得可能な株券
  - f. 投資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、または投資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券の新株予約権（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

#### 有価証券の貸付けの指図および範囲

- 1) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を、次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
  - a. 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、投資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。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前各項目に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社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。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 資金の借入れ

- 1) 委託会社は、投資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、投資信託財産において一部解約代金の支払資金に不足額が生じるときは、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。
  - a. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による、受取りの確定している資金の額の範囲内。
  - b. 一部解約金支払日の前営業日において確定した、当該支払日における当該支払資金の不足額の範囲内。
  - c. 借入指図を行う日における、投資信託財産の純資産総額の10%以内。
- 3) 1)の借入期間は、有価証券等の売却等の代金の入金日までに限るものとします。
- 4) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### 法令に基づく投資制限

委託会社は、運用の指図を行う投資信託財産について、以下の行為を行わないものとします。

- 1) 同一法人の発行する株式への投資制限  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- 2) デリバティブ取引に係る投資制限  
委託会社は、投資信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

「しんきんトピックスオープン」は、値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、預貯金とは異なり、投資元本は保証されているものではありません。ファンドの運用による利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

#### (1) 基準価額の変動要因

##### 価格変動リスク

株価は、政治・経済情勢、発行体の業績、市場の需給等を反映して、短期的・長期的に大きく変動します。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 信用リスク

有価証券等の発行体が経営不安、倒産等に陥った場合、またその可能性が高まった場合には当該発行体が発行する有価証券および短期金融商品の価格は下落し、場合によっては投資資金が回収できなくなることもあります。組入有価証券等の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 流動性リスク

流動性リスクとは、有価証券を売買する際に、需給動向により有価証券を希望する時期・価格で売買することができなくなるリスクをいいます。当ファンドが投資する有価証券の流動性が損なわれた場合には、基準価額が下落する要因となります。

上記の変動要因は主なもののみであり、上記に限定されるものではありません。

#### (2) 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。

#### (3) リスクの管理体制

運用部門から独立した管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析および法令遵守の観点から運用状況を監視します。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としています。原則月1回開催するコンプライアンス・運用管理委員会への報告を通じて、運用部門にファンドのリスクとリターンの計測・分析結果等がフィードバックされ、適切なリスクの管理体制を構築しています。

投資リスクに対する管理体制等は、今後変更となる場合があります。

## 参考情報

● 当ファンドの年間騰落率および  
基準価額(分配金再投資後)の推移● 当ファンドと代表的な資産クラスとの  
年間騰落率の比較

※上記の左グラフは、各月末における当ファンドの直近1年間の騰落率および基準価額(分配金再投資後)の推移を表示したものです。

※基準価額(分配金再投資後)は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。しんきんアセットマネジメント投信(株)が公表している基準価額とは異なる場合があります。

※上記の右グラフは、当ファンドおよび代表的な資産クラスについて、2012年8月から2017年7月の5年間の年間騰落率の平均・最大・最小を表示したものです。当該グラフは、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あり、すべ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。

上記のグラフ・データは過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 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

資産クラス	指数名	詳細
【日本株】	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)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、TOPIX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。
【先進国株】	MSCI-KOKUSAI インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI-KOKUSAI インデックス(配当込み、円ベース)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、MSCI Index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。
【新興国株】	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI 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、MSCI Index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。
【日本国債】	NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。
【先進国債】	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
【新興国債】	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ティバーシファイド (円ベース)	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ティバーシファイド(円ベース)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国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ティバーシファイドに関する著作権、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。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジを行わない投資を想定して、円ベースとしています。

※騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しておりますが、同社はその内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害および一切の問題について、何らの責任も負いません。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はありませんが、一部解約時に基準価額の0.30%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

##### (3)【信託報酬等】

運用管理費用 (信託報酬)	純資産総額に対して、年率0.864% (税抜0.80%)	
	1万円あたりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (保有日数 / 365)	
※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。 ※運用管理費用は、計算期間を通じて毎日計算され、毎計算期間の最初の6か月終了日および毎計算期間末、または信託終了のときに投資信託財産から支払われます。		
支払先	配分(税抜)および役務の内容	
委託会社	純資産総額に対して、年率0.25%	ファンドの運用、受託会社への運用指図、法定書類の作成等の対価
販売会社	純資産総額に対して、年率0.45%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理および購入後の情報提供等の対価
受託会社	純資産総額に対して、年率0.10%	運用財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

##### (4)【その他の手数料等】

投資信託財産において、一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的とし資金の借入れの指図を行った場合、当該借入金の利息は投資信託財産から支払われます。

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、投資信託財産から支払われます。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等相当額、先物取引・オプション取引等に要する費用は投資信託財産から支払われます。

投資信託財産に係る監査費用は計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.00864% (税抜0.008%) を乗じて計算し毎計算期の6か月終了日および毎計算期間末または信託終了のときに投資信託財産から支払われます

当ファンドの手数料等の合計額については、投資者がファンドを保有される期間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】

個別元本について

- 1) 受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- 2) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- 3) 同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社ごとに、個別元本が算出されます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は、当該支店等ごとに個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金について



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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。受益者が「元本払戻金（特別分配金）」を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該「元本払戻金（特別分配金）」を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

個別元本および収益分配金の区分については、後記<個別元本および収益分配金の区分の具体例>をご参照ください。

#### 個人、法人別の課税上の取扱いについて

##### 1) 個人の受益者に対する課税

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、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い、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。）を選択することもできます。
換金時および償還時	一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
損益通算について	一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能となります。 一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能となります。 特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等も通算が可能となります。

少額投資非課税制度「愛称: N I S A（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称: ジュニア N I S A（ニーサ）」をご利用になれます。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### 2) 法人の受益者に対する課税

収益分配時ならびに換金時および償還時の差益に対する課税	法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。 収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。
-----------------------------	---

課税上は株式投資信託として取り扱われます。配当控除の適用があります。

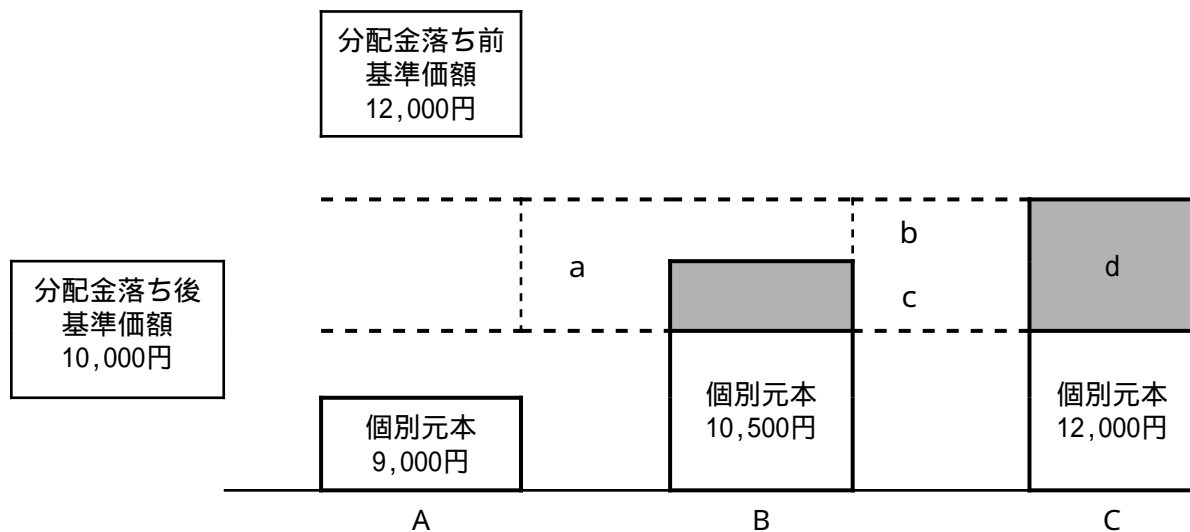
確定拠出年金コースの場合、確定拠出年金制度に係る税制が適用されます。

取得申込者によって取扱いが異なる場合があります。また、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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。

## &lt; 個別元本および収益分配金の区分の具体例 &gt;

分配金支払い前の基準価額が1万口当り12,000円、2,000円の収益分配を行い分配金落ち後の基準価額が10,000円となったケース。



- A) 収益分配金受取前の個別元本が9,000円の場合  
分配金落ち後の基準価額が分配金受取前の個別元本を上回っているため、aの部分(2,000円)は普通分配金となり、収益分配金落ち後の個別元本は9,000円のまま変わりません。
- B) 収益分配金受取前の個別元本が10,500円の場合  
分配金落ち後の基準価額が当初の個別元本を下回っているcの部分(500円)は「元本払戻金(特別分配金)」となり、収益分配金(2,000円)からc「元本払戻金(特別分配金)」(500円)を差引いた残りのbの部分(1,500円)は普通分配金となります。  
収益分配金受取後の個別元本は  
収益分配金受取前個別元本(10,500円) - 「元本払戻金(特別分配金)」(500円) = 10,000円となります。
- C) 収益分配金受取前の個別元本が12,000円の場合  
分配金落ち後の基準価額が当初の個別元本を下回っているため、dの部分(2,000円)は「元本払戻金(特別分配金)」となります。  
収益分配金受取後の個別元本は  
収益分配金受取前個別元本(12,000円) - 「元本払戻金(特別分配金)」(2,000円) = 10,000円となります。

受益者によって取扱いが異なる場合があります。また、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 5【運用状況】

以下は平成29年7月31日現在の運用状況です。

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または評価金額の比率です。

投資比率の内訳と合計は、端数処理の関係で一致しない場合があります。

## (1)【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	3,644,712,430	96.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		113,967,356	3.03
合計(純資産総額)		3,758,679,786	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	113,365,000	3.02

(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】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## (国内株式評価額上位30銘柄)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	19,000	6,180.00	117,420,000	6,234.00	118,446,000	3.15
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	117,000	721.60	84,427,200	700.00	81,900,000	2.18
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	12,400	5,369.00	66,575,600	5,390.00	66,836,000	1.78
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	6,800	9,145.00	62,186,000	8,958.00	60,914,400	1.62
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	12,300	4,268.00	52,496,400	4,195.00	51,598,500	1.37
6	日本	株式	ソニー	電気機器	11,000	4,505.00	49,555,000	4,540.00	49,940,000	1.33
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	14,000	3,096.00	43,344,000	3,108.00	43,512,000	1.16
8	日本	株式	KDDI	情報・通信業	14,700	2,912.00	42,806,400	2,920.00	42,924,000	1.14
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	209,100	199.30	41,673,630	196.40	41,067,240	1.09
10	日本	株式	任天堂	その他製品	1,000	36,500.00	36,500,000	37,480.00	37,480,000	1.00
11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	9,700	3,812.00	36,976,400	3,834.00	37,189,800	0.99
12	日本	株式	ファナック	電気機器	1,600	22,275.00	35,640,000	22,565.00	36,104,000	0.96
13	日本	株式	キーエンス	電気機器	700	50,100.00	35,070,000	51,020.00	35,714,000	0.95
14	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	6,000	5,763.00	34,578,000	5,832.00	34,992,000	0.93
15	日本	株式	キヤノン	電気機器	8,300	3,794.00	31,490,200	3,837.00	31,847,100	0.85
16	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	3,000	10,630.00	31,890,000	10,350.00	31,050,000	0.83
17	日本	株式	信越化学工業	化学	2,900	10,125.00	29,362,500	10,110.00	29,319,000	0.78
18	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	6,400	4,468.00	28,595,200	4,445.00	28,448,000	0.76
19	日本	株式	三菱電機	電気機器	16,600	1,643.00	27,273,800	1,710.50	28,394,300	0.76
20	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	11,000	2,619.50	28,814,500	2,563.00	28,193,000	0.75
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	37,000	729.90	27,006,300	759.60	28,105,200	0.75
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	6,000	4,752.00	28,512,000	4,645.00	27,870,000	0.74
23	日本	株式	三菱商事	卸売業	11,600	2,400.50	27,845,800	2,396.50	27,799,400	0.74
24	日本	株式	花王	化学	4,100	6,798.00	27,871,800	6,714.00	27,527,400	0.73

25	日本	株式	村田製作所	電気機器	1,600	17,155.00	27,448,000	17,180.00	27,488,000	0.73
26	日本	株式	パナソニック	電気機器	17,800	1,518.00	27,020,400	1,521.00	27,073,800	0.72
27	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	5,500	4,878.00	26,829,000	4,657.00	25,613,500	0.68
28	日本	株式	ダイキン工業	機械	2,100	11,805.00	24,790,500	11,700.00	24,570,000	0.65
29	日本	株式	日本電産	電気機器	2,000	11,595.00	23,190,000	12,160.00	24,320,000	0.65
30	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	1,300	17,825.00	23,172,500	17,750.00	23,075,000	0.61

## 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率(%)
株式	96.97
合計	96.97

## 業種別投資比率

業種	投資比率(%)
水産・農林業	0.11
鉱業	0.29
建設業	3.12
食料品	4.45
繊維製品	0.69
パルプ・紙	0.24
化学	6.88
医薬品	4.40
石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.95
ガラス・土石製品	0.97
鉄鋼	1.27
非鉄金属	0.95
金属製品	0.69
機械	5.07
電気機器	13.01
輸送用機器	8.40
精密機器	1.56
その他製品	2.08
電気・ガス業	1.74
陸運業	3.91
海運業	0.22
空運業	0.56
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.70
卸売業	4.31
小売業	4.44
銀行業	7.49
証券、商品先物取引業	1.06

保険業	2.40
その他金融業	1.22
不動産業	2.38
サービス業	3.75
合計(対純資産総額比)	96.97

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

種類	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (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	買建	7	113,396,080	113,365,000	3.02

(注) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

平成29年7月末日、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産総額ならびに基準価額の推移は以下のとおりです。

計算期間	純資産総額(円)		基準価額(円)	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1計算期間末 (平成13年7月18日)	5,021,478,424	5,021,478,424	7,900	7,900
第2計算期間末 (平成14年7月18日)	4,612,684,545	4,612,684,545	6,674	6,674
第3計算期間末 (平成15年7月18日)	4,196,324,276	4,196,324,276	6,173	6,173
第4計算期間末 (平成16年7月18日)	4,802,532,801	4,840,997,421	7,491	7,551
第5計算期間末 (平成17年7月19日)	10,696,378,820	10,737,342,783	7,834	7,864
第6計算期間末 (平成18年7月18日)	5,673,347,934	5,714,164,538	9,730	9,800
第7計算期間末 (平成19年7月18日)	5,602,099,416	5,645,611,582	11,587	11,677
第8計算期間末 (平成20年7月18日)	5,104,910,738	5,104,910,738	8,316	8,316
第9計算期間末 (平成21年7月21日)	6,272,724,016	6,272,724,016	6,022	6,022
第10計算期間末 (平成22年7月20日)	4,789,121,614	4,789,121,614	5,619	5,619
第11計算期間末 (平成23年7月19日)	5,008,191,166	5,077,797,971	5,756	5,836
第12計算期間末 (平成24年7月18日)	4,663,217,848	4,663,217,848	5,063	5,063

第13計算期間末 (平成25年7月18日)	4,138,064,359	4,192,502,870	8,361	8,471
第14計算期間末 (平成26年7月18日)	3,987,504,288	4,043,033,748	8,617	8,737
第15計算期間末 (平成27年7月21日)	4,272,409,598	4,328,690,075	11,387	11,537
第16計算期間末 (平成28年7月19日)	3,758,842,419	3,758,842,419	9,169	9,169
第17計算期間末 (平成29年7月18日)	3,707,152,626	3,773,841,066	11,118	11,318
平成28年7月末日	3,747,340,346		9,110	
平成28年8月末日	3,780,550,741		9,151	
平成28年9月末日	4,482,604,198		9,168	
平成28年10月末日	4,678,423,864		9,647	
平成28年11月末日	4,107,611,941		10,173	
平成28年12月末日	4,229,423,591		10,523	
平成29年1月末日	3,650,967,927		10,544	
平成29年2月末日	3,666,741,288		10,639	
平成29年3月末日	3,630,550,611		10,570	
平成29年4月末日	3,670,210,744		10,698	
平成29年5月末日	3,761,842,853		10,947	
平成29年6月末日	3,759,426,491		11,262	
平成29年7月末日	3,758,679,786		11,101	

(注) 基準価額は受益権1口当たりの純資産額を1万口単位で表示したものです。

#### 【分配の推移】

計算期間		1万口当たりの収益分配金(円)
第1期	平成12年7月19日から平成13年7月18日	0
第2期	平成13年7月19日から平成14年7月18日	0
第3期	平成14年7月19日から平成15年7月18日	0
第4期	平成15年7月19日から平成16年7月20日	60
第5期	平成16年7月21日から平成17年7月19日	30
第6期	平成17年7月20日から平成18年7月18日	70
第7期	平成18年7月19日から平成19年7月18日	90
第8期	平成19年7月19日から平成20年7月18日	0
第9期	平成20年7月19日から平成21年7月21日	0
第10期	平成21年7月22日から平成22年7月20日	0
第11期	平成22年7月21日から平成23年7月19日	80
第12期	平成23年7月20日から平成24年7月18日	0
第13期	平成24年7月19日から平成25年7月18日	110
第14期	平成25年7月19日から平成26年7月18日	120
第15期	平成26年7月19日から平成27年7月21日	150
第16期	平成27年7月22日から平成28年7月19日	0
第17期	平成28年7月20日から平成29年7月18日	200

## 【収益率の推移】

計算期間		収益率（％）
第1期	平成12年7月19日から平成13年7月18日	21.00
第2期	平成13年7月19日から平成14年7月18日	15.51
第3期	平成14年7月19日から平成15年7月18日	7.51
第4期	平成15年7月19日から平成16年7月20日	22.32
第5期	平成16年7月21日から平成17年7月19日	4.98
第6期	平成17年7月20日から平成18年7月18日	25.10
第7期	平成18年7月19日から平成19年7月18日	20.01
第8期	平成19年7月19日から平成20年7月18日	28.23
第9期	平成20年7月19日から平成21年7月21日	27.59
第10期	平成21年7月22日から平成22年7月20日	6.69
第11期	平成22年7月21日から平成23年7月19日	3.86
第12期	平成23年7月20日から平成24年7月18日	12.04
第13期	平成24年7月19日から平成25年7月18日	67.31
第14期	平成25年7月19日から平成26年7月18日	4.50
第15期	平成26年7月19日から平成27年7月21日	33.89
第16期	平成27年7月22日から平成28年7月19日	19.48
第17期	平成28年7月20日から平成29年7月18日	23.44

（注）収益率とは、計算期間末の基準価額（分配付きの額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数です。なお、第1計算期間については、直前の計算期間の基準価額を10,000円として計算しています。

## （4）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定数量(口)	解約数量(口)
第1期	平成12年7月19日から平成13年7月18日	8,993,680,314	2,637,260,285
第2期	平成13年7月19日から平成14年7月18日	1,379,082,268	824,249,417
第3期	平成14年7月19日から平成15年7月18日	3,761,795,209	3,875,197,862
第4期	平成15年7月19日から平成16年7月20日	1,133,564,466	1,520,644,578
第5期	平成16年7月21日から平成17年7月19日	8,719,041,546	1,475,157,122
第6期	平成17年7月20日から平成18年7月18日	4,925,371,569	12,749,082,663
第7期	平成18年7月19日から平成19年7月18日	2,627,585,163	3,623,843,411
第8期	平成19年7月19日から平成20年7月18日	2,821,446,031	1,517,510,938
第9期	平成20年7月19日から平成21年7月21日	5,126,053,339	847,833,033
第10期	平成21年7月22日から平成22年7月20日	1,045,834,900	2,939,240,777
第11期	平成22年7月21日から平成23年7月19日	1,164,598,918	987,182,949
第12期	平成23年7月20日から平成24年7月18日	2,912,758,463	2,402,765,118
第13期	平成24年7月19日から平成25年7月18日	1,431,778,317	5,693,666,777
第14期	平成25年7月19日から平成26年7月18日	1,456,536,543	1,778,037,082
第15期	平成26年7月19日から平成27年7月21日	1,395,267,463	2,270,690,649
第16期	平成27年7月22日から平成28年7月19日	779,358,774	432,010,424
第17期	平成28年7月20日から平成29年7月18日	988,793,248	1,753,751,402

（注）設定数量には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

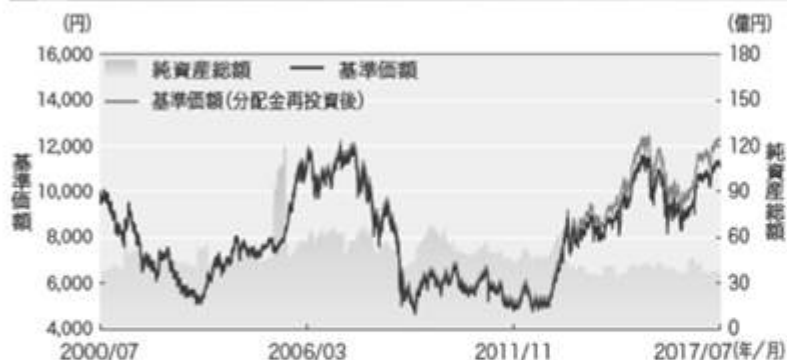
## (参考) 運用実績

データは2017年7月31日現在です。

※下記のグラフ・データは過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※端数処理の都合上、各欄の合計が合計欄と一致しない場合や、比率の合計が100にならない場合があります。

## 基準価額・純資産の推移



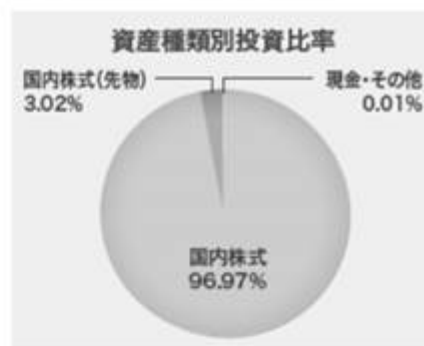
基準価額・純資産総額	
基準価額	11,101円
純資産総額	3,759百万円
分配の推移(税引前)	
決算期	分配金
2017年7月18日	200円
2016年7月19日	0円
2015年7月21日	150円
2014年7月18日	120円
2013年7月18日	110円
設定来累計	910円

※基準価額および分配金は1万口当たりです。

※基準価額(分配金再投資後)は決算日の翌営業日に分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

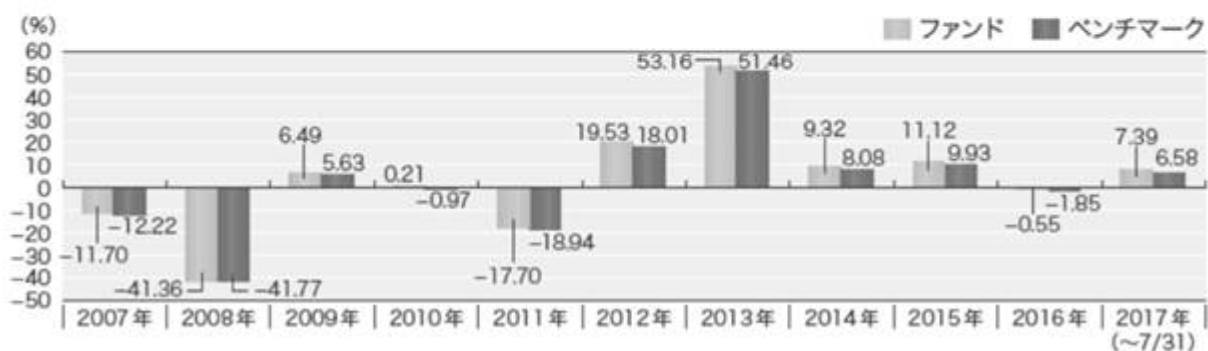
## 主要な資産の状況

組入上位10銘柄			組入上位10業種		
順位	銘柄名	業種	順位	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1	電気機器	13.01%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2	輸送用機器	8.40%
3	日本電信電話	情報・通信業	3	情報・通信業	7.70%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4	銀行業	7.49%
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5	化学	6.88%
6	ソニー	電気機器	6	機械	5.07%
7	本田技研工業	輸送用機器	7	食料品	4.45%
8	KDDI	情報・通信業	8	小売業	4.44%
9	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9	医薬品	4.40%
10	任天堂	その他製品	10	卸売業	4.31%



※投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該銘柄、業種、資産種類の時価の比率です。

## 年間収益率の推移 (期間: 2007年~2017年)



※上記の収益率は決算時の分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

※最新の運用実績はしんきんアセットマネジメント投信(株)のホームページで運用レポートとしてお知らせしています。



## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込みの際、取得申込者は、販売会社との間の権利義務関係を明確にすることを目的とした契約を結びます。
- (2) 当ファンドには、取扱販売会社によって、税引後の収益分配金を無手数料で自動的に再投資する「自動けいぞく投資コース」と、収益分配が行われるごとに収益分配金を受益者に支払う「一般コース」、確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく取得申込者(事業主と資産管理契約を締結した資産管理機関、ないしは国民年金基金連合会)の申込みを対象とした「確定拠出年金コース」があります。
- (3) 取得申込者が「自動けいぞく投資コース」を利用する場合、販売会社は「自動けいぞく投資約款」を取得申込者に交付し、取得申込者は当該約款に基づく自動けいぞく投資の申込みを行います。
- (4) 申込単位は、「自動けいぞく投資コース」の場合は販売会社が定める単位、「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位、「確定拠出年金コース」の場合は1円以上1円単位です。
- (5) 受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額です。  
「自動けいぞく投資コース」および「確定拠出年金コース」の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (6) 各営業日の午後3時までに受け付けた取得の申込みを、当日の申込受付分として取り扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日以降の取扱いとなります。
- (7) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止することができます。取得申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の取得申込みを撤回できます。
- (8) 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行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われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金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うことができます。委託会社は、追加信託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振替法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、振替法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合には、委託会社までお問い合わせください。

<照会先>  
しんきんアセットマネジメント投信株式会社（委託会社）  
<コールセンター> 0120-781812  
携帯電話・PHSからは 03-5524-8181（土日、休日を除く 9:00～17:00）  
<ホームページ> <http://www.skam.co.jp>

### 2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行を請求することにより換金することができます。
- (2) 各営業日の午後3時までに受け付けた換金（解約）の申込みを、当日の申込受付分として取り扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日以降の取扱いとなります。

- (3) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、「自動けいぞく投資コース」および「確定拠出年金コース」の場合、1口単位をもって、「一般コース」の場合、1万口単位をもって換金(解約)の申し込みができます。
- (4) 受益者が換金(解約)の申込みをするときは、取扱販売会社に対し受益権をもって行うものとします。
- (5) 委託会社は、換金(解約)の申込み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。
- (6) 解約の価額は、換金(解約)の申込受付日の基準価額から当該基準価額の0.3%を信託財産留保額として控除した価額とします。
- (7) 課税関係については、前記「ファンド情報 第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」の「(5)課税上の取扱い」の内容をご覧ください。
- (8) 一部解約金に係る収益調整金(注)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ます。
- (9) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金(解約)の申込みの受け付けを中止することができます。換金(解約)の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の換金(解約)の申込みを撤回できます。ただし、受益者がその換金(解約)の申込み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計算日に換金(解約)の申込みを受け付けたものとして、(6)の規定に準じて算定した価額とします。
- (10) 解約代金の支払いは、原則として上記解約請求日から起算して4営業日目以降に販売会社の営業所等で支払われます。
- (11) 受託会社は、一部解約代金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社に交付します。受託会社は、委託会社に一部解約金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
- (12) 換金の請求を行う受益者は、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会社が行うのと引き換えに、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うものとし、振替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われます。
- (注) 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。

ファンドの換金(解約)手続についてご不明な点がある場合には、委託会社までお問い合わせください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の計算方法

- ・基準価額は、委託会社によって毎営業日算出されます。
- ・基準価額とは、投資信託財産に属する資産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投資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価額をいいます。(ただし、便宜上1万口当たり換算した基準価額で表示することがあります。)

- ・基準価額は、委託会社および販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として日本経済新聞朝刊に掲載されます。

#### ファンドの主要な投資対象資産の評価方法

##### 1) 株式

- ・移動平均法に基づき、原則として時価で評価しています。
- ・時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、金融商品取引所が発表する基準値段、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しています。

##### 2) 先物取引

- ・個別法に基づき、原則として時価で評価しています。
- ・時価評価にあたっては、原則として計算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または最終相場によっています。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は無期限です。ただし、後記「(5)その他 ファンドの繰上償還条項」により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

この信託の計算期間は、毎年7月19日から翌年7月18日までを原則とします。

上記にかかわらず、上記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、該当日以降の最初の営業日とし、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、約款に定める信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### ファンドの繰上償還条項

- 1) 委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が10億口を下回るようになった場合、または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、受託会社と合意のうえ、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、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 2) 委託会社は、前項について、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会社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きは、信託契約の解約をしません。

- 5) 委託会社は、この信託契約の解約をし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知られたる受益者に対して交付します。ただし、全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。
- 6) 上記3)から前項までの規定は、投資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、上記3)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うことが困難な場合には適用しません。
- 7) 委託会社は、監督官庁より投資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。
- 8) 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、後記の4)に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- 9) 受託会社がその任務を辞任する場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 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、受託会社と合意のうえ、この約款を変更することができます。約款の変更を行う際には、委託会社は、変更しようとする旨およびその内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) 委託会社は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、変更しようとする旨およびその内容等を公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告は日本経済新聞に掲載します。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) 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きは、約款の変更をしません。
- 5) 委託会社は、約款の変更をし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知られたる受益者に対して交付します。ただし、全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。
- 6) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、上記1)から5)までの規定に従います。

#### 反対者の買取請求権

前記の1)から6)の規定に従い信託契約の解約を行う場合、または前記の規定に従い約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、委託会社を經由して、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資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。

#### 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(投資信託受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約書)は、期間満了の1か月前までに当事者のいずれからも別段の意思表示がない場合は、自動的に1年更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により、随時変更される場合があります。

#### 運用報告書

委託会社は、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に基づき、毎計算期間の末日(原則7月18日)および償還日を基準に交付運用報告書を作成し、投資信託財産に係る知られたる受益者に、販売会社を通じて交付します。

公告

委託会社が受益者に対して行う公告は、日本経済新聞に掲載されます。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

収益分配金は、毎計算期間終了日後1か月以内の委託会社の指定する日から、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い前のため販売会社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ます。)に支払います。

上記にかかわらず、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、受託会社が委託会社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販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、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みに応じるものとします。当該取得申込みにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

販売会社は、受益者が自己に帰属する受益権について、あらかじめ収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みを中止することを申し出た場合には、当該受益権に帰属する収益分配金を当該計算期間終了のつど受益者に支払います。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

##### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、ファンドに係る償還金を持分に依りて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1か月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)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われた受益権に係る受益者を除きます。また、当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い前のため販売会社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ます。)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委託会社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うものとし、振替法の規定に従い、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を行います。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

##### (3) 換金(解約)請求権

受益者は、委託会社に受益権の一部解約の実行を請求することにより換金する権利を有します。権利行使の方法等については、上記「第2 管理及び運営」の「2 換金(解約)手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求を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)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成28年7月20日から平成29年7月18日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

しんきんトピックスオープン

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (平成28年7月19日現在)	当期 (平成29年7月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	164,120,780	124,664,718
株式	3,600,611,440	3,657,759,040
派生商品評価勘定	2,195,920	1,175,680
未収配当金	4,781,776	4,276,519
差入委託証拠金	6,840,000	3,465,000
流動資産合計	3,778,549,916	3,791,340,957
<b>資産合計</b>	<b>3,778,549,916</b>	<b>3,791,340,957</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	135,720	33,240
前受金	1,231,000	1,465,000
未払収益分配金	-	66,688,440
未払解約金	2,164,864	-
未払受託者報酬	2,008,441	1,986,641
未払委託者報酬	14,059,014	13,906,411
未払利息	458	305
その他未払費用	108,000	108,294
流動負債合計	19,707,497	84,188,331
<b>負債合計</b>	<b>19,707,497</b>	<b>84,188,331</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,340,099,380,198	1,333,334,422,044
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2340,537,779	372,730,582
(分配準備積立金)	1,183,108,575	846,444,851
元本等合計	3,758,842,419	3,707,152,626
<b>純資産合計</b>	<b>3,758,842,419</b>	<b>3,707,152,626</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>3,778,549,916</b>	<b>3,791,340,957</b>



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 (自 平成27年 7月22日 至 平成28年 7月19日)	当期 (自 平成28年 7月20日 至 平成29年 7月18日)
<b>営業収益</b>		
受取配当金	78,194,488	86,117,832
受取利息	12,689	-
有価証券売買等損益	875,417,671	786,921,372
派生商品取引等損益	24,371,402	25,197,560
その他収益	80,743	83,474
<b>営業収益合計</b>	<b>821,501,153</b>	<b>898,320,238</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	26,906	82,828
受託者報酬	4,271,179	4,279,745
委託者報酬	29,898,106	29,958,086
その他費用	220,493	846,255
<b>営業費用合計</b>	<b>34,416,684</b>	<b>35,166,914</b>
営業利益又は営業損失( )	855,917,837	863,153,324
経常利益又は経常損失( )	855,917,837	863,153,324
当期純利益又は当期純損失( )	855,917,837	863,153,324
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( )	58,605,216	176,212,475
期首剰余金又は期首欠損金( )	520,377,750	340,537,779
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	145,342,063
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	145,342,063
剰余金減少額又は欠損金増加額	63,602,908	52,326,111
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	51,243,678	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,359,230	52,326,111
分配金	1 -	1 66,688,440
期末剰余金又は期末欠損金( )	340,537,779	372,730,582

## (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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取り扱い 当計算期間は、前期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年7月18日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (平成28年7月19日現在)	当期 (平成29年7月18日現在)
1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額	期首元本額 3,752,031,848円 期中追加設定元本額 779,358,774円 期中一部解約元本額 432,010,424円	期首元本額 4,099,380,198円 期中追加設定元本額 988,793,248円 期中一部解約元本額 1,753,751,402円
2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は340,537,779円であります。	—————
3 計算期間末日における受益権の総数	4,099,380,198口	3,334,422,044口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 (自平成27年7月22日 至平成28年7月19日)		当期 (自平成28年7月20日 至平成29年7月18日)	
1 分配金の計算過程		1 分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	40,779,123円	A 費用控除後の配当等収益額	68,493,072円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	76,372,308円
C 収益調整金額	1,537,121,749円	C 収益調整金額	1,449,556,353円
D 分配準備積立金額	1,142,329,452円	D 分配準備積立金額	768,267,911円
E 当ファンドの分配対象収益額	2,720,230,324円	E 当ファンドの分配対象収益額	2,362,689,644円
F 当ファンドの期末残存口数	4,099,380,198口	F 当ファンドの期末残存口数	3,334,422,044口
G 10,000口当たり収益分配対象額	6,635円	G 10,000口当たり収益分配対象額	7,085円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	200円
I 収益分配金金額	0円	I 収益分配金金額	66,688,440円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 (自 平成27年 7月22日 至 平成28年 7月19日)	当期 (自 平成28年 7月20日 至 平成29年 7月18日)
1. 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、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を、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
2. 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金融商品は「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」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引は、TOPIX（東証株価指数）先物取引が含まれております。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
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析を行い、コンプライアンス部門が、法令遵守の観点から運用状況を監視します。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としております。原則月1回開催するリスク管理委員会への報告を通じて、運用部門にファンドのリスクとリターンの計測・分析結果等がフィードバックされ、適切なリスクの管理体制を構築しております。	運用部門から独立した管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析及び法令遵守の観点から運用状況を監視しております。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としております。原則月1回開催するコンプライアンス・運用管理委員会への報告を通じて、運用部門にファンドのリスクとリターンの計測・分析結果等がフィードバックされ、適切なリスクの管理体制を構築しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 (平成28年 7月19日現在)	当期 (平成29年 7月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(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。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引の大きさを示すものではありません。</p>	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	前期 (平成28年7月19日現在)	当期 (平成29年7月18日現在)
種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	852,588,513円	640,707,907円
合計	852,588,513円	640,707,907円

## (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)

(単位：円)

区分	種類	前期 (平成28年7月19日現在)			
		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	157,649,000		159,720,000	2,071,000

合計	157,649,000	159,720,000	2,071,000
----	-------------	-------------	-----------

(単位：円)

区分	種類	当期 (平成29年7月18日現在)			
		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	112,250,000		113,400,000	1,150,000
合計		112,250,000		113,400,000	1,150,000

- (注) 1. 時価の算定方法  
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。
2. 先物取引の残高表示は、契約額ベースであります。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 (自 平成27年 7月22日 至 平成28年 7月19日)	当期 (自 平成28年 7月20日 至 平成29年 7月18日)
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

前期 (平成28年 7月19日現在)	当期 (平成29年 7月18日現在)
1口当たり純資産額 0.9169円 (1万口当たり純資産額 9,169円)	1口当たり純資産額 1.1118円 (1万口当たり純資産額 11,118円)

(4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	100	3,060.00	306,000	
日本水産	2,400	633.00	1,519,200	
マルハニチロ	300	2,919.00	875,700	
サカタのタネ	300	3,655.00	1,096,500	
ホクト	200	1,965.00	393,000	
三井松島産業	100	1,413.00	141,300	
国際石油開発帝石	8,900	1,086.50	9,669,850	
石油資源開発	300	2,306.00	691,800	
K&Oエナジーグループ	200	1,712.00	342,400	
ショーボンドホールディングス	200	5,710.00	1,142,000	
ミライト・ホールディングス	600	1,280.00	768,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,296.00	129,600	
安藤・間	1,400	715.00	1,001,000	

東急建設	800	885.00	708,000
コムシスホールディングス	700	2,271.00	1,589,700
ミサワホーム	200	1,014.00	202,800
高松コンストラクショングループ	200	2,885.00	577,000
東建コーポレーション	100	13,390.00	1,339,000
大成建設	9,000	1,061.00	9,549,000
大林組	5,300	1,339.00	7,096,700
清水建設	5,000	1,196.00	5,980,000
飛鳥建設	1,800	169.00	304,200
長谷工コーポレーション	2,100	1,361.00	2,858,100
松井建設	300	912.00	273,600
鹿島建設	8,000	964.00	7,712,000
不動テトラ	1,400	185.00	259,000
鉄建建設	1,000	341.00	341,000
西松建設	2,000	630.00	1,260,000
三井住友建設	7,200	121.00	871,200
大豊建設	1,000	535.00	535,000
前田建設工業	1,000	1,362.00	1,362,000
奥村組	1,000	760.00	760,000
東鉄工業	200	3,415.00	683,000
浅沼組	1,000	339.00	339,000
戸田建設	2,000	744.00	1,488,000
熊谷組	3,000	375.00	1,125,000
青木あすなろ建設	100	908.00	90,800
矢作建設工業	300	924.00	277,200
ピーエス三菱	300	486.00	145,800
日本ハウスホールディングス	400	514.00	205,600
大東建託	600	18,025.00	10,815,000
新日本建設	300	940.00	282,000
東亜道路工業	1,000	453.00	453,000
前田道路	1,000	2,298.00	2,298,000
日本道路	1,000	603.00	603,000
東亜建設工業	200	1,807.00	361,400
若築建設	2,000	169.00	338,000
東洋建設	700	453.00	317,100
五洋建設	2,200	657.00	1,445,400
世紀東急工業	300	593.00	177,900
住友林業	1,200	1,769.00	2,122,800
日本基礎技術	200	381.00	76,200
日成ビルド工業	1,000	626.00	626,000
巴コーポレーション	400	364.00	145,600
大和ハウス工業	5,000	3,806.00	19,030,000
ライト工業	400	1,190.00	476,000
積水ハウス	5,300	1,934.50	10,252,850
日特建設	300	598.00	179,400

中電工	200	2,997.00	599,400
関電工	1,000	1,128.00	1,128,000
きんでん	1,200	1,876.00	2,251,200
住友電設	200	1,642.00	328,400
日本電設工業	300	2,240.00	672,000
協和エクシオ	800	1,897.00	1,517,600
新日本空調	200	1,594.00	318,800
九電工	400	4,410.00	1,764,000
三機工業	400	1,241.00	496,400
日揮	1,600	1,817.00	2,907,200
中外炉工業	1,000	224.00	224,000
高砂熱学工業	500	1,841.00	920,500
明星工業	300	686.00	205,800
大気社	200	2,961.00	592,200
日比谷総合設備	200	1,987.00	397,400
東芝プラントシステム	300	1,826.00	547,800
OSJBホールディングス	200	289.00	57,800
東洋エンジニアリング	1,000	277.00	277,000
千代田化工建設	1,000	649.00	649,000
新興プランテック	400	935.00	374,000
日本製粉	500	1,776.00	888,000
日清製粉グループ本社	1,900	1,786.00	3,393,400
昭和産業	1,000	595.00	595,000
鳥越製粉	100	801.00	80,100
中部飼料	200	1,459.00	291,800
フィード・ワン	1,900	226.00	429,400
日本甜菜製糖	100	2,108.00	210,800
三井製糖	100	3,185.00	318,500
日新製糖	100	1,894.00	189,400
森永製菓	400	6,490.00	2,596,000
江崎グリコ	500	6,160.00	3,080,000
名糖産業	100	1,442.00	144,200
不二家	100	2,508.00	250,800
山崎製パン	1,300	2,224.00	2,891,200
亀田製菓	100	5,570.00	557,000
寿スピリッツ	100	4,000.00	400,000
カルビー	800	4,385.00	3,508,000
森永乳業	2,000	821.00	1,642,000
六甲バター	100	2,636.00	263,600
ヤクルト本社	900	7,800.00	7,020,000
明治ホールディングス	1,000	8,830.00	8,830,000
雪印メグミルク	400	3,140.00	1,256,000
プリマハム	1,000	684.00	684,000
日本ハム	1,000	3,280.00	3,280,000
丸大食品	1,000	516.00	516,000

S Foods	100	4,230.00	423,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,000	1,011.00	1,011,000
サッポロホールディングス	600	2,988.00	1,792,800
アサヒグループホールディングス	3,300	4,346.00	14,341,800
キリンホールディングス	7,500	2,349.50	17,621,250
宝ホールディングス	1,400	1,146.00	1,604,400
コカ・コーラボトラーズジャパン	1,100	3,355.00	3,690,500
サントリー食品インターナショナル	1,200	5,300.00	6,360,000
ダイドーグループホールディングス	100	5,600.00	560,000
伊藤園	500	4,170.00	2,085,000
キーコーヒー	100	2,190.00	219,000
日清オイリオグループ	1,000	644.00	644,000
不二製油グループ本社	500	2,572.00	1,286,000
J - オイルミルズ	100	3,870.00	387,000
キッコーマン	1,000	3,475.00	3,475,000
味の素	3,600	2,455.50	8,839,800
キューピー	900	2,807.00	2,526,300
ハウス食品グループ本社	700	2,854.00	1,997,800
カゴメ	600	3,375.00	2,025,000
アリアケジャパン	200	7,750.00	1,550,000
ニチレイ	900	3,225.00	2,902,500
東洋水産	900	4,195.00	3,775,500
日清食品ホールディングス	700	7,110.00	4,977,000
一正蒲鉾	100	1,315.00	131,500
フジッコ	200	2,592.00	518,400
ロック・フィールド	200	1,827.00	365,400
日本たばこ産業	9,700	3,812.00	36,976,400
ケンコーマヨネーズ	100	3,215.00	321,500
わらべや日洋ホールディングス	100	2,950.00	295,000
なとり	100	2,029.00	202,900
ユーグレナ	700	1,174.00	821,800
ミヨシ油脂	100	1,425.00	142,500
理研ビタミン	100	4,345.00	434,500
片倉工業	200	1,273.00	254,600
ゲンゼ	1,000	407.00	407,000
東洋紡	7,000	215.00	1,505,000
富士紡ホールディングス	100	3,375.00	337,500
倉敷紡績	2,000	276.00	552,000
シキボウ	2,000	149.00	298,000
日本毛織	400	945.00	378,000
ダイドーリミテッド	200	441.00	88,200
帝国繊維	200	2,013.00	402,600
帝人	1,300	2,253.00	2,928,900
東レ	11,500	978.20	11,249,300
サカイオーベックス	100	1,811.00	181,100



住江織物	1,000	301.00	301,000
アツギ	2,000	123.00	246,000
ダイニック	1,000	192.00	192,000
セーレン	400	1,804.00	721,600
ソトー	100	1,155.00	115,500
小松精練	200	704.00	140,800
ワコールホールディングス	1,000	1,508.00	1,508,000
ホギメディカル	100	7,820.00	782,000
レナウン	500	175.00	87,500
T S Iホールディングス	700	769.00	538,300
三陽商会	100	1,773.00	177,300
オンワードホールディングス	1,000	805.00	805,000
ゴールドウイン	100	6,830.00	683,000
デサント	400	1,620.00	648,000
特種東海製紙	100	4,015.00	401,500
王子ホールディングス	6,000	586.00	3,516,000
日本製紙	800	2,295.00	1,836,000
三菱製紙	300	768.00	230,400
北越紀州製紙	800	833.00	666,400
大王製紙	800	1,470.00	1,176,000
レンゴー	1,700	640.00	1,088,000
ザ・バック	100	3,575.00	357,500
クラレ	2,700	2,159.00	5,829,300
旭化成	10,000	1,261.00	12,610,000
共和レザー	100	959.00	95,900
昭和電工	1,100	2,893.00	3,182,300
住友化学	12,000	658.00	7,896,000
日産化学工業	900	3,780.00	3,402,000
クレハ	100	5,560.00	556,000
日東エフシー	100	946.00	94,600
日本曹達	1,000	629.00	629,000
東ソー	5,000	1,275.00	6,375,000
トクヤマ	3,000	558.00	1,674,000
セントラル硝子	2,000	487.00	974,000
東亜合成	1,100	1,421.00	1,563,100
大阪ソーダ	1,000	564.00	564,000
デンカ	3,000	613.00	1,839,000
信越化学工業	2,900	10,125.00	29,362,500
日本カーバイド工業	1,000	190.00	190,000
エア・ウォーター	1,300	2,113.00	2,746,900
大陽日酸	1,300	1,266.00	1,645,800
日本化学工業	1,000	240.00	240,000
日本パーカライジング	900	1,621.00	1,458,900
ステラ ケミファ	100	3,110.00	311,000
保土谷化学工業	100	4,845.00	484,500

日本触媒	300	7,260.00	2,178,000
大日精化工業	1,000	980.00	980,000
カネカ	2,000	904.00	1,808,000
三菱瓦斯化学	1,500	2,554.00	3,831,000
三井化学	8,000	625.00	5,000,000
J S R	1,600	1,984.00	3,174,400
東京応化工業	300	3,750.00	1,125,000
三菱ケミカルホールディングス	10,800	995.00	10,746,000
ダイセル	2,200	1,466.00	3,225,200
住友ベークライト	2,000	844.00	1,688,000
積水化学工業	3,500	2,002.00	7,007,000
日本ゼオン	1,000	1,270.00	1,270,000
アイカ工業	500	3,485.00	1,742,500
宇部興産	9,000	303.00	2,727,000
積水樹脂	300	2,029.00	608,700
タキロンシーアイ	1,000	599.00	599,000
旭有機材	1,000	256.00	256,000
日立化成	900	3,315.00	2,983,500
リケンテクノス	400	639.00	255,600
積水化成品工業	300	956.00	286,800
群栄化学工業	100	3,755.00	375,500
タイガースポリマー	100	760.00	76,000
ミライアル	100	1,059.00	105,900
ダイキョーニシカワ	300	1,616.00	484,800
日本化薬	1,000	1,608.00	1,608,000
カーリットホールディングス	300	617.00	185,100
日本精化	100	1,056.00	105,600
扶桑化学工業	100	3,560.00	356,000
A D E K A	800	1,703.00	1,362,400
日油	1,000	1,502.00	1,502,000
ハリマ化成グループ	200	1,063.00	212,600
花王	4,100	6,798.00	27,871,800
第一工業製薬	1,000	541.00	541,000
三洋化成工業	100	5,350.00	535,000
大日本塗料	1,000	309.00	309,000
日本ペイントホールディングス	1,200	4,300.00	5,160,000
関西ペイント	1,700	2,631.00	4,472,700
中国塗料	600	871.00	522,600
日本特殊塗料	100	1,895.00	189,500
藤倉化成	400	644.00	257,600
太陽ホールディングス	100	4,970.00	497,000
D I C	600	4,270.00	2,562,000
サカタインクス	400	1,892.00	756,800
東洋インキ S C ホールディングス	1,000	588.00	588,000
T & K T O K A	100	1,165.00	116,500

富士フィルムホールディングス	3,100	4,126.00	12,790,600
資生堂	3,100	3,913.00	12,130,300
ライオン	2,000	2,329.00	4,658,000
高砂香料工業	100	4,365.00	436,500
マンダム	200	6,190.00	1,238,000
ミルボン	100	6,400.00	640,000
ファンケル	300	2,105.00	631,500
コーセー	300	11,920.00	3,576,000
コタ	100	1,202.00	120,200
シーズ・ホールディングス	200	3,985.00	797,000
ポーラ・オルビスホールディングス	700	2,932.00	2,052,400
ノエビアホールディングス	100	5,640.00	564,000
エステー	100	2,695.00	269,500
アグロ カネショウ	100	1,556.00	155,600
コニシ	300	1,641.00	492,300
長谷川香料	200	2,300.00	460,000
星光PMC	100	1,323.00	132,300
小林製薬	400	6,790.00	2,716,000
荒川化学工業	200	1,952.00	390,400
メック	200	1,377.00	275,400
タカラバイオ	400	1,584.00	633,600
新田ゼラチン	300	763.00	228,900
デクセリアルズ	500	1,119.00	559,500
アース製薬	100	6,210.00	621,000
クミアイ化学工業	800	642.00	513,600
日本農薬	500	678.00	339,000
アキレス	100	1,962.00	196,200
有沢製作所	400	918.00	367,200
日東電工	1,200	9,771.00	11,725,200
レック	100	2,671.00	267,100
きもと	300	264.00	79,200
藤森工業	100	3,335.00	333,500
前澤化成工業	100	1,220.00	122,000
JSP	100	3,310.00	331,000
エフピコ	200	6,000.00	1,200,000
天馬	100	2,090.00	209,000
信越ポリマー	400	904.00	361,600
東リ	400	369.00	147,600
ニフコ	300	6,410.00	1,923,000
日本バルカー工業	100	2,503.00	250,300
ユニ・チャーム	3,300	2,952.00	9,741,600
協和発酵キリン	2,000	1,925.00	3,850,000
武田薬品工業	6,000	5,763.00	34,578,000
アステラス製薬	15,900	1,337.50	21,266,250
大日本住友製薬	1,200	1,506.00	1,807,200

塩野義製薬	2,000	5,944.00	11,888,000
田辺三菱製薬	1,900	2,649.00	5,033,100
わかもと製薬	1,000	285.00	285,000
あすか製薬	200	1,650.00	330,000
日本新薬	400	6,990.00	2,796,000
中外製薬	1,600	4,470.00	7,152,000
科研製薬	300	5,940.00	1,782,000
エーザイ	2,000	6,001.00	12,002,000
ロート製薬	800	2,277.00	1,821,600
小野薬品工業	3,700	2,439.00	9,024,300
久光製薬	500	5,270.00	2,635,000
持田製薬	100	7,750.00	775,000
参天製薬	3,000	1,569.00	4,707,000
扶桑薬品工業	100	2,726.00	272,600
ツムラ	600	4,470.00	2,682,000
日医工	400	1,695.00	678,000
キッセイ薬品工業	300	2,916.00	874,800
生化学工業	300	1,816.00	544,800
栄研化学	100	3,555.00	355,500
日水製薬	100	1,395.00	139,500
鳥居薬品	100	2,702.00	270,200
JCRファーマ	100	2,824.00	282,400
東和薬品	100	5,130.00	513,000
富士製薬工業	100	3,800.00	380,000
沢井製薬	300	6,180.00	1,854,000
ゼリア新薬工業	400	2,040.00	816,000
第一三共	4,800	2,497.00	11,985,600
キョーリン製薬ホールディングス	500	2,450.00	1,225,000
大幸薬品	200	2,304.00	460,800
ダイト	100	2,919.00	291,900
大塚ホールディングス	3,500	4,675.00	16,362,500
大正製薬ホールディングス	300	8,380.00	2,514,000
日本コークス工業	1,100	99.00	108,900
昭和シェル石油	1,500	1,175.00	1,762,500
ニチレキ	100	1,324.00	132,400
ユシロ化学工業	100	1,511.00	151,100
富士石油	500	337.00	168,500
MORESCO	100	2,223.00	222,300
出光興産	800	2,646.00	2,116,800
JXTGホールディングス	24,300	489.70	11,899,710
コスモエネルギーホールディングス	500	1,839.00	919,500
横浜ゴム	1,000	2,298.00	2,298,000
東洋ゴム工業	900	2,382.00	2,143,800
ブリヂストン	5,500	4,878.00	26,829,000
住友ゴム工業	1,500	1,992.00	2,988,000

藤倉ゴム工業	300	719.00	215,700
オカモト	1,000	1,324.00	1,324,000
フコク	100	1,052.00	105,200
ニッタ	200	3,525.00	705,000
住友理工	400	1,167.00	466,800
バンドー化学	300	1,107.00	332,100
日東紡績	1,000	611.00	611,000
旭硝子	1,600	5,020.00	8,032,000
日本板硝子	800	991.00	792,800
日本山村硝子	1,000	186.00	186,000
日本電気硝子	600	4,210.00	2,526,000
オハラ	100	1,332.00	133,200
住友大阪セメント	3,000	539.00	1,617,000
太平洋セメント	10,000	411.00	4,110,000
日本ヒューム	200	699.00	139,800
日本コンクリート工業	500	427.00	213,500
三谷セキサン	100	2,671.00	267,100
アジアパイルホールディングス	200	731.00	146,200
東海カーボン	1,600	688.00	1,100,800
日本カーボン	100	3,500.00	350,000
東洋炭素	100	1,951.00	195,100
ノリタケカンパニーリミテド	100	4,090.00	409,000
TOTO	1,200	4,225.00	5,070,000
日本碍子	2,000	2,243.00	4,486,000
日本特殊陶業	1,400	2,297.00	3,215,800
MARUWA	100	4,595.00	459,500
品川リフラクトリーズ	1,000	273.00	273,000
フジミインコーポレーテッド	200	2,450.00	490,000
ニチアス	1,000	1,413.00	1,413,000
ニチハ	200	4,040.00	808,000
新日鐵住金	7,400	2,654.00	19,639,600
神戸製鋼所	2,800	1,251.00	3,502,800
合同製鐵	100	2,218.00	221,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	4,500	2,065.50	9,294,750
日新製鋼	600	1,278.00	766,800
東京製鐵	900	992.00	892,800
共英製鋼	200	1,902.00	380,400
大和工業	300	3,055.00	916,500
大阪製鐵	100	2,197.00	219,700
淀川製鋼所	300	3,080.00	924,000
東洋鋼鈑	500	422.00	211,000
丸一鋼管	600	3,430.00	2,058,000
大同特殊鋼	3,000	678.00	2,034,000
日本高周波鋼業	1,000	85.00	85,000
日本冶金工業	1,600	243.00	388,800

山陽特殊製鋼	1,000	672.00	672,000
愛知製鋼	100	4,600.00	460,000
日立金属	1,500	1,654.00	2,481,000
日本金属	100	1,740.00	174,000
大平洋金属	1,000	292.00	292,000
新日本電工	800	444.00	355,200
栗本鐵工所	100	2,091.00	209,100
三菱製鋼	1,000	280.00	280,000
日亜鋼業	500	286.00	143,000
シンニッタン	200	706.00	141,200
日本軽金属ホールディングス	3,800	289.00	1,098,200
三井金属鉱業	5,000	481.00	2,405,000
東邦亜鉛	1,000	471.00	471,000
三菱マテリアル	1,000	3,515.00	3,515,000
住友金属鉱山	4,000	1,576.50	6,306,000
DOWAホールディングス	2,000	870.00	1,740,000
古河機械金属	3,000	206.00	618,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	200	1,859.00	371,800
東邦チタニウム	300	805.00	241,500
UACJ	2,000	319.00	638,000
古河電気工業	600	5,150.00	3,090,000
住友電気工業	6,100	1,755.00	10,705,500
フジクラ	2,200	994.00	2,186,800
タツタ電線	400	675.00	270,000
平河ビューテック	100	1,465.00	146,500
リョービ	1,000	496.00	496,000
アーレスティ	200	1,132.00	226,400
アサヒホールディングス	300	1,920.00	576,000
稲葉製作所	100	1,411.00	141,100
宮地エンジニアリンググループ	1,000	256.00	256,000
トーカロ	100	3,870.00	387,000
SUMCO	1,700	1,810.00	3,077,000
東洋製罐グループホールディングス	1,100	1,857.00	2,042,700
コロナ	100	1,161.00	116,100
横河ブリッジホールディングス	300	1,616.00	484,800
駒井ハルテック	100	2,204.00	220,400
三和ホールディングス	1,700	1,187.00	2,017,900
文化シャッター	500	919.00	459,500
三協立山	300	1,597.00	479,100
LIXILグループ	2,300	2,913.00	6,699,900
日本フィルコン	200	593.00	118,600
ノーリツ	400	2,225.00	890,000
長府製作所	200	2,612.00	522,400
リンナイ	300	10,280.00	3,084,000
日東精工	300	496.00	148,800

岡部	300	1,021.00	306,300
ジーテクト	200	2,229.00	445,800
東プレ	300	2,999.00	899,700
高周波熱錬	400	1,032.00	412,800
東京製綱	100	1,649.00	164,900
パイオラックス	300	3,065.00	919,500
日本発條	1,500	1,210.00	1,815,000
三益半導体工業	100	1,780.00	178,000
日本製鋼所	500	1,854.00	927,000
三浦工業	700	2,133.00	1,493,100
タクマ	700	1,124.00	786,800
オークマ	1,000	1,075.00	1,075,000
東芝機械	1,000	517.00	517,000
アマダホールディングス	2,200	1,277.00	2,809,400
アイダエンジニアリング	500	1,095.00	547,500
富士機械製造	500	1,772.00	886,000
牧野フライス製作所	1,000	965.00	965,000
オーエスジー	800	2,465.00	1,972,000
旭ダイヤモンド工業	400	862.00	344,800
D M G 森精機	1,000	1,897.00	1,897,000
ソディック	500	1,357.00	678,500
ディスコ	200	19,210.00	3,842,000
日東工器	100	2,585.00	258,500
豊和工業	100	792.00	79,200
OKK	1,000	139.00	139,000
東洋機械金属	100	796.00	79,600
津田駒工業	1,000	190.00	190,000
島精機製作所	200	5,830.00	1,166,000
NCホールディングス	100	866.00	86,600
日阪製作所	300	988.00	296,400
やまびこ	300	1,336.00	400,800
ペガサスミシン製造	200	728.00	145,600
ナブテスコ	800	3,460.00	2,768,000
三井海洋開発	200	2,614.00	522,800
レオン自動機	100	1,222.00	122,200
S M C	500	35,170.00	17,585,000
新川	200	745.00	149,000
ユニオンツール	100	3,250.00	325,000
オイレス工業	200	2,020.00	404,000
日精エー・エス・ビー機械	100	3,880.00	388,000
サトーホールディングス	200	2,680.00	536,000
日精樹脂工業	200	1,154.00	230,800
ワイエイシイホールディングス	100	1,369.00	136,900
小松製作所	7,400	2,942.50	21,774,500
住友重機械工業	5,000	790.00	3,950,000

日立建機	700	2,898.00	2,028,600
日工	100	2,252.00	225,200
井関農機	200	2,293.00	458,600
TOWA	200	1,808.00	361,600
丸山製作所	100	1,773.00	177,300
北川鉄工所	100	2,418.00	241,800
クボタ	7,800	1,908.50	14,886,300
三菱化工機	1,000	254.00	254,000
月島機械	300	1,262.00	378,600
帝国電機製作所	200	1,132.00	226,400
新東工業	400	1,168.00	467,200
澁谷工業	200	3,445.00	689,000
アイチ コーポレーション	300	785.00	235,500
小森コーポレーション	400	1,410.00	564,000
鶴見製作所	200	1,857.00	371,400
荏原製作所	700	3,325.00	2,327,500
西島製作所	200	1,157.00	231,400
北越工業	300	1,122.00	336,600
ダイキン工業	2,100	11,805.00	24,790,500
トーヨーカネツ	1,000	336.00	336,000
栗田工業	900	3,085.00	2,776,500
椿本チエイン	1,000	1,004.00	1,004,000
大同工業	1,000	319.00	319,000
木村化工機	200	371.00	74,200
アネスト岩田	400	1,028.00	411,200
ダイフク	800	3,525.00	2,820,000
タダノ	800	1,390.00	1,112,000
フジテック	400	1,514.00	605,600
CKD	500	1,975.00	987,500
キトー	200	1,191.00	238,200
平和	500	2,414.00	1,207,000
理想科学工業	200	2,261.00	452,200
SANKYO	400	3,635.00	1,454,000
日本金銭機械	200	1,202.00	240,400
マースエンジニアリング	100	2,374.00	237,400
福島工業	100	4,740.00	474,000
オーイズミ	100	604.00	60,400
ダイコク電機	100	1,689.00	168,900
竹内製作所	300	2,109.00	632,700
アマノ	500	2,468.00	1,234,000
JUKI	300	1,732.00	519,600
サンデンホールディングス	1,000	340.00	340,000
グローリー	500	3,730.00	1,865,000
新晃工業	200	1,741.00	348,200
大和冷機工業	300	1,262.00	378,600



セガサミーホールディングス	1,500	1,459.00	2,188,500
日本ピストンリング	100	2,230.00	223,000
リケン	100	5,330.00	533,000
T P R	200	3,605.00	721,000
ツバキ・ナカシマ	200	2,345.00	469,000
ホシザキ	400	10,450.00	4,180,000
大豊工業	200	1,442.00	288,400
日本精工	3,100	1,473.00	4,566,300
N T N	4,000	535.00	2,140,000
ジェイテクト	1,600	1,674.00	2,678,400
不二越	2,000	636.00	1,272,000
日本トムソン	500	610.00	305,000
T H K	1,100	3,280.00	3,608,000
ユーシン精機	100	2,693.00	269,300
イーグル工業	200	1,929.00	385,800
日本ピラー工業	200	1,726.00	345,200
キッツ	700	1,010.00	707,000
マキタ	2,000	4,385.00	8,770,000
日立造船	1,100	555.00	610,500
三菱重工業	26,000	454.40	11,814,400
I H I	12,000	385.00	4,620,000
スター精密	300	1,928.00	578,400
日清紡ホールディングス	800	1,127.00	901,600
イビデン	1,100	2,004.00	2,204,400
コニカミノルタ	3,700	967.00	3,577,900
ブラザー工業	1,900	2,827.00	5,371,300
ミネベアミツミ	2,800	1,895.00	5,306,000
日立製作所	37,000	729.90	27,006,300
東芝	35,000	275.80	9,653,000
三菱電機	16,600	1,643.00	27,273,800
富士電機	4,000	610.00	2,440,000
東洋電機製造	100	1,866.00	186,600
安川電機	1,800	2,500.00	4,500,000
シンフォニアテクノロジー	1,000	452.00	452,000
明電舎	2,000	394.00	788,000
デンヨー	200	1,959.00	391,800
東芝テック	1,000	619.00	619,000
マブチモーター	400	5,680.00	2,272,000
日本電産	2,000	11,595.00	23,190,000
東光高岳	100	1,711.00	171,100
ダブル・スコープ	200	2,195.00	439,000
ダイヘン	1,000	963.00	963,000
J V C ケンウッド	1,400	328.00	459,200
ミマキエンジニアリング	200	889.00	177,800
第一精工	100	2,437.00	243,700

日新電機	300	1,197.00	359,100
オムロン	1,600	5,100.00	8,160,000
日東工業	200	1,800.00	360,000
I D E C	100	1,458.00	145,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,000	509.00	1,527,000
サクサホールディングス	1,000	228.00	228,000
メルコホールディングス	100	3,380.00	338,000
テクノメディカ	100	1,942.00	194,200
日本電気	21,000	296.00	6,216,000
富士通	15,000	866.00	12,990,000
沖電気工業	700	1,699.00	1,189,300
サンケン電気	1,000	544.00	544,000
アイホン	100	1,989.00	198,900
ルネサスエレクトロニクス	800	1,016.00	812,800
セイコーエプソン	2,300	2,674.00	6,150,200
ワコム	1,300	391.00	508,300
アルバック	300	5,860.00	1,758,000
アクセル	100	788.00	78,800
E I Z O	200	4,325.00	865,000
ジャパンドisplay	3,000	199.00	597,000
日本信号	500	1,096.00	548,000
能美防災	200	1,669.00	333,800
ホーチキ	200	1,860.00	372,000
エレコム	200	2,368.00	473,600
日本無線	100	1,428.00	142,800
パナソニック	17,800	1,518.00	27,020,400
アンリツ	1,200	991.00	1,189,200
富士通ゼネラル	600	2,540.00	1,524,000
日立国際電気	400	2,664.00	1,065,600
ソニー	11,000	4,505.00	49,555,000
T D K	900	7,700.00	6,930,000
タムラ製作所	1,000	545.00	545,000
アルプス電気	1,400	3,215.00	4,501,000
パイオニア	2,700	210.00	567,000
日本電波工業	200	918.00	183,600
日本トリム	100	4,410.00	441,000
ローランド ディー・ジー・	100	2,747.00	274,700
フォスター電機	200	1,997.00	399,400
クラリオン	1,000	419.00	419,000
ヨコオ	100	1,420.00	142,000
ホシデン	500	1,230.00	615,000
ヒロセ電機	200	16,000.00	3,200,000
T O A	200	1,125.00	225,000
日立マクセル	300	2,411.00	723,300
古野電気	300	648.00	194,400

ユニデンホールディングス	1,000	271.00	271,000
アルパイン	400	1,688.00	675,200
スミダコーポレーション	200	2,185.00	437,000
アイコム	100	2,560.00	256,000
リオン	100	1,813.00	181,300
船井電機	200	1,113.00	222,600
横河電機	1,600	1,874.00	2,998,400
新電元工業	1,000	623.00	623,000
アズビル	500	4,380.00	2,190,000
日本光電工業	700	2,720.00	1,904,000
共和電業	300	459.00	137,700
堀場製作所	300	7,060.00	2,118,000
アドバンテスト	1,100	1,989.00	2,187,900
小野測器	100	757.00	75,700
エスベック	200	1,739.00	347,800
キーエンス	700	50,100.00	35,070,000
日置電機	100	2,274.00	227,400
シスメックス	1,200	6,320.00	7,584,000
日本マイクロニクス	300	1,174.00	352,200
メガチップス	200	2,752.00	550,400
OBARA GROUP	100	6,170.00	617,000
コーセル	200	1,393.00	278,600
イリソ電子工業	100	9,280.00	928,000
オプテックスグループ	100	3,655.00	365,500
千代田インテグレ	100	2,225.00	222,500
レーザーテック	400	1,654.00	661,600
スタンレー電気	1,200	3,730.00	4,476,000
岩崎電気	1,000	229.00	229,000
ウシオ電機	900	1,408.00	1,267,200
日本セラミック	200	2,759.00	551,800
遠藤照明	100	1,194.00	119,400
山一電機	200	1,837.00	367,400
図研	100	1,498.00	149,800
日本電子	1,000	636.00	636,000
カシオ計算機	1,300	1,736.00	2,256,800
ファナック	1,600	22,275.00	35,640,000
日本シイエムケイ	400	986.00	394,400
エンプラス	100	3,490.00	349,000
ローム	800	9,150.00	7,320,000
浜松ホトニクス	1,200	3,495.00	4,194,000
三井ハイテック	200	1,779.00	355,800
新光電気工業	600	997.00	598,200
京セラ	2,500	6,365.00	15,912,500
太陽誘電	800	1,860.00	1,488,000
村田製作所	1,600	17,155.00	27,448,000

ユーシン	100	778.00	77,800
双葉電子工業	300	2,032.00	609,600
北陸電気工業	1,000	154.00	154,000
ニチコン	500	1,170.00	585,000
日本ケミコン	1,000	447.00	447,000
K O A	200	2,214.00	442,800
小糸製作所	900	5,990.00	5,391,000
ミツバ	300	2,113.00	633,900
S C R E E Nホールディングス	300	7,600.00	2,280,000
キャノン電子	100	2,277.00	227,700
キャノン	8,300	3,794.00	31,490,200
リコー	4,800	994.00	4,771,200
東京エレクトロン	1,000	16,040.00	16,040,000
トヨタ紡織	600	2,289.00	1,373,400
ユニプレス	300	2,728.00	818,400
豊田自動織機	1,400	6,440.00	9,016,000
モリタホールディングス	300	1,728.00	518,400
三櫻工業	200	809.00	161,800
デンソー	3,500	4,860.00	17,010,000
東海理化電機製作所	400	2,159.00	863,600
三井造船	5,000	159.00	795,000
川崎重工業	12,000	349.00	4,188,000
名村造船所	500	656.00	328,000
日本車輛製造	1,000	287.00	287,000
ニチユ三菱フォークリフト	200	782.00	156,400
日産自動車	17,400	1,142.00	19,870,800
いすゞ自動車	4,500	1,423.00	6,403,500
トヨタ自動車	19,000	6,180.00	117,420,000
日野自動車	2,200	1,238.00	2,723,600
三菱自動車工業	5,800	748.00	4,338,400
エフテック	100	1,429.00	142,900
武蔵精密工業	200	3,210.00	642,000
日産車体	700	1,143.00	800,100
新明和工業	600	955.00	573,000
極東開発工業	400	1,837.00	734,800
日信工業	300	1,854.00	556,200
トピー工業	100	3,390.00	339,000
ティラド	1,000	350.00	350,000
曙ブレーキ工業	800	378.00	302,400
タチエス	300	2,052.00	615,600
N O K	800	2,669.00	2,135,200
フタバ産業	500	1,002.00	501,000
K Y B	2,000	608.00	1,216,000
大同メタル工業	200	1,014.00	202,800
プレス工業	1,000	524.00	524,000

ミクニ	300	493.00	147,900
太平洋工業	400	1,549.00	619,600
ケーヒン	400	1,630.00	652,000
河西工業	300	1,448.00	434,400
アイシン精機	1,400	6,140.00	8,596,000
富士機工	100	738.00	73,800
マツダ	4,700	1,600.00	7,520,000
今仙電機製作所	200	1,279.00	255,800
本田技研工業	14,000	3,096.00	43,344,000
スズキ	3,100	5,351.00	16,588,100
S U B A R U	4,800	4,063.00	19,502,400
ヤマハ発動機	2,200	2,900.00	6,380,000
ショーワ	400	1,148.00	459,200
T B K	100	512.00	51,200
エクセディ	200	3,215.00	643,000
豊田合成	500	2,739.00	1,369,500
愛三工業	300	934.00	280,200
ヨロズ	200	1,831.00	366,200
エフ・シー・シー	300	2,341.00	702,300
シマノ	600	18,040.00	10,824,000
テイ・エス テック	400	3,345.00	1,338,000
ジャムコ	100	2,699.00	269,900
テルモ	2,400	4,300.00	10,320,000
日機装	600	1,180.00	708,000
島津製作所	2,000	2,204.00	4,408,000
長野計器	100	778.00	77,800
東京計器	1,000	291.00	291,000
東京精密	300	3,830.00	1,149,000
マニー	200	2,620.00	524,000
ニコン	2,600	1,854.00	4,820,400
トプコン	700	1,957.00	1,369,900
オリンパス	2,500	4,195.00	10,487,500
理研計器	200	2,083.00	416,600
タムロン	100	2,053.00	205,300
HOYA	3,200	5,838.00	18,681,600
ノーリツ鋼機	200	1,005.00	201,000
エー・アンド・デイ	100	455.00	45,500
シチズン時計	1,500	815.00	1,222,500
リズム時計工業	1,000	231.00	231,000
大研医器	200	789.00	157,800
メニコン	100	3,490.00	349,000
松風	100	1,331.00	133,100
セイコーホールディングス	1,000	476.00	476,000
ニプロ	1,100	1,523.00	1,675,300
パラマウントベッドホールディングス	200	5,010.00	1,002,000

前田工織	200	1,626.00	325,200
アートネイチャー	200	727.00	145,400
ダンロップスポーツ	200	1,171.00	234,200
バンダイナムコホールディングス	1,700	3,900.00	6,630,000
共立印刷	500	345.00	172,500
SHOEI	100	3,110.00	311,000
パイロットコーポレーション	300	4,815.00	1,444,500
萩原工業	100	3,040.00	304,000
トッパン・フォームズ	300	1,197.00	359,100
フジシールインターナショナル	300	3,105.00	931,500
タカラトミー	700	1,343.00	940,100
廣済堂	300	382.00	114,600
プロネクサス	200	1,250.00	250,000
大建工業	100	2,638.00	263,800
凸版印刷	4,000	1,203.00	4,812,000
大日本印刷	4,000	1,285.00	5,140,000
日本写真印刷	300	2,987.00	896,100
宝印刷	100	1,639.00	163,900
アシックス	1,500	2,042.00	3,063,000
ツツミ	100	2,076.00	207,600
ヤマハ	1,000	4,055.00	4,055,000
河合楽器製作所	100	2,239.00	223,900
クリナップ	200	888.00	177,600
ビジョン	900	4,050.00	3,645,000
キングジム	200	1,044.00	208,800
リンテック	400	2,729.00	1,091,600
イトーキ	400	912.00	364,800
任天堂	1,000	36,500.00	36,500,000
三菱鉛筆	200	3,155.00	631,000
タカラスタANDARD	300	1,876.00	562,800
コクヨ	800	1,507.00	1,205,600
グローブライド	100	1,964.00	196,400
岡村製作所	600	1,062.00	637,200
美津濃	1,000	653.00	653,000
東京電力ホールディングス	13,100	461.00	6,039,100
中部電力	5,100	1,459.00	7,440,900
関西電力	6,400	1,469.00	9,401,600
中国電力	2,200	1,214.00	2,670,800
北陸電力	1,600	988.00	1,580,800
東北電力	3,900	1,490.00	5,811,000
四国電力	1,400	1,289.00	1,804,600
九州電力	3,500	1,312.00	4,592,000
北海道電力	1,500	874.00	1,311,000
沖縄電力	200	2,656.00	531,200
電源開発	1,200	2,740.00	3,288,000

イーレックス	300	983.00	294,900
東京瓦斯	16,000	577.70	9,243,200
大阪瓦斯	15,000	437.90	6,568,500
東邦瓦斯	4,000	766.00	3,064,000
広島ガス	400	353.00	141,200
西部瓦斯	2,000	268.00	536,000
静岡ガス	500	750.00	375,000
メタウォーター	100	3,135.00	313,500
SBSホールディングス	200	857.00	171,400
東武鉄道	8,000	598.00	4,784,000
相鉄ホールディングス	3,000	547.00	1,641,000
東京急行電鉄	8,000	832.00	6,656,000
京浜急行電鉄	4,000	1,309.00	5,236,000
小田急電鉄	2,600	2,184.00	5,678,400
京王電鉄	4,000	921.00	3,684,000
京成電鉄	1,200	2,958.00	3,549,600
富士急行	1,000	1,161.00	1,161,000
東日本旅客鉄道	3,000	10,630.00	31,890,000
西日本旅客鉄道	1,500	7,999.00	11,998,500
東海旅客鉄道	1,300	17,825.00	23,172,500
西武ホールディングス	2,100	1,994.00	4,187,400
鴻池運輸	200	1,505.00	301,000
西日本鉄道	2,000	490.00	980,000
ハマキョウレックス	100	2,755.00	275,500
サカイ引越センター	100	4,290.00	429,000
近鉄グループホールディングス	16,000	424.00	6,784,000
阪急阪神ホールディングス	2,000	4,025.00	8,050,000
南海電気鉄道	3,000	564.00	1,692,000
京阪ホールディングス	3,000	704.00	2,112,000
名古屋鉄道	5,000	512.00	2,560,000
山陽電気鉄道	1,000	559.00	559,000
日本通運	5,000	696.00	3,480,000
ヤマトホールディングス	2,800	2,174.50	6,088,600
山九	2,000	742.00	1,484,000
センコーグループホールディングス	600	740.00	444,000
ニッコンホールディングス	500	2,536.00	1,268,000
福山通運	1,000	717.00	717,000
セイノーホールディングス	1,100	1,470.00	1,617,000
日立物流	300	2,485.00	745,500
丸和運輸機関	100	3,940.00	394,000
C&Fロジホールディングス	200	1,306.00	261,200
九州旅客鉄道	1,100	3,670.00	4,037,000
日本郵船	14,000	215.00	3,010,000
商船三井	8,000	347.00	2,776,000
川崎汽船	6,000	282.00	1,692,000

N S ユナイテッド海運	1,000	232.00	232,000
飯野海運	800	491.00	392,800
乾汽船	200	838.00	167,600
日本航空	2,800	3,631.00	10,166,800
A N A ホールディングス	29,000	393.00	11,397,000
トランコム	100	5,490.00	549,000
日新	1,000	531.00	531,000
三菱倉庫	1,000	1,426.00	1,426,000
三井倉庫ホールディングス	1,000	309.00	309,000
住友倉庫	1,000	700.00	700,000
ケイヒン	1,000	163.00	163,000
中央倉庫	100	1,053.00	105,300
安田倉庫	200	765.00	153,000
東洋埠頭	1,000	186.00	186,000
宇徳	200	461.00	92,200
上組	2,000	1,182.00	2,364,000
郵船ロジスティクス	100	1,021.00	102,100
近鉄エクスプレス	300	1,908.00	572,400
エーアイティー	200	1,000.00	200,000
N E C ネットエスアイ	200	2,612.00	522,400
システナ	100	2,176.00	217,600
デジタルアーツ	100	4,060.00	406,000
新日鉄住金ソリューションズ	300	2,622.00	786,600
コア	100	1,551.00	155,100
T I S	500	3,125.00	1,562,500
グリー	1,000	910.00	910,000
コーエーテクモホールディングス	400	2,176.00	870,400
三菱総合研究所	100	3,335.00	333,500
ファインデックス	100	942.00	94,200
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,847.00	184,700
K L a b	300	2,174.00	652,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	1,530.00	153,000
ネクソン	1,700	2,267.00	3,853,900
アイスタイル	300	812.00	243,600
エイチーム	100	2,985.00	298,500
テクノスジャパン	200	1,123.00	224,600
e n i s h	100	2,974.00	297,400
コロプラ	500	1,135.00	567,500
モバイルクリエイト	100	405.00	40,500
ブロードリーフ	500	706.00	353,000
ハーツユナイテッドグループ	100	1,771.00	177,100
メディアドゥ	100	2,327.00	232,700
VOYAGE GROUP	100	2,538.00	253,800
ティーガイア	200	2,082.00	416,400



日本アジアグループ	300	432.00	129,600
豆蔵ホールディングス	200	1,013.00	202,600
テクマトリックス	200	1,789.00	357,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,500	296.00	1,036,000
GMOペイメントゲートウェイ	100	6,310.00	631,000
ザッパラス	100	506.00	50,600
インターネットイニシアティブ	300	2,037.00	611,100
さくらインターネット	200	908.00	181,600
SRAホールディングス	100	3,065.00	306,500
朝日ネット	200	529.00	105,800
gumi	200	1,579.00	315,800
LINE	300	3,840.00	1,152,000
ソルクシーズ	100	795.00	79,500
フェイス	100	1,132.00	113,200
野村総合研究所	1,100	4,435.00	4,878,500
サイバネットシステム	200	717.00	143,400
インテージホールディングス	100	2,342.00	234,200
クレスコ	100	3,350.00	335,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,500	1,558.00	2,337,000
オービック	500	6,960.00	3,480,000
ジャストシステム	300	1,624.00	487,200
ヤフー	11,200	494.00	5,532,800
トレンドマイクロ	800	5,680.00	4,544,000
日本オラクル	200	7,430.00	1,486,000
アルファシステムズ	100	2,106.00	210,600
フューチャー	300	938.00	281,400
CAC Holdings	100	1,065.00	106,500
オービックビジネスコンサルタント	100	6,050.00	605,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,905.00	1,562,000
アイティフォー	200	626.00	125,200
大塚商会	400	7,000.00	2,800,000
サイボウズ	300	507.00	152,100
電通国際情報サービス	100	2,586.00	258,600
デジタルガレージ	300	2,108.00	632,400
EMシステムズ	100	2,651.00	265,100
日本エンタープライズ	200	262.00	52,400
WOWOW	100	3,085.00	308,500
イマジカ・ロボットホールディングス	100	722.00	72,200
ネットワンシステムズ	700	1,101.00	770,700
アルゴグラフィックス	100	2,524.00	252,400
マーベラス	300	1,172.00	351,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	300	1,452.00	435,600
日本ユニシス	500	1,886.00	943,000

兼松エレクトロニクス	100	3,450.00	345,000
東京放送ホールディングス	1,000	1,988.00	1,988,000
日本テレビホールディングス	1,400	1,827.00	2,557,800
朝日放送	200	817.00	163,400
テレビ朝日ホールディングス	400	1,961.00	784,400
スカパーJ S A Tホールディングス	1,000	479.00	479,000
テレビ東京ホールディングス	100	2,242.00	224,200
日本BS放送	100	1,269.00	126,900
ワイヤレスゲート	100	1,456.00	145,600
コネクシオ	100	1,980.00	198,000
日本電信電話	12,400	5,369.00	66,575,600
K D D I	14,700	2,912.00	42,806,400
光通信	200	11,330.00	2,266,000
N T T ドコモ	11,000	2,619.50	28,814,500
エムティーアイ	300	687.00	206,100
G M O インターネット	600	1,420.00	852,000
カドカワ	500	1,412.00	706,000
学研ホールディングス	100	3,255.00	325,500
ゼンリン	200	3,215.00	643,000
昭文社	100	727.00	72,700
アイネット	100	1,348.00	134,800
松竹	1,000	1,409.00	1,409,000
東宝	1,000	3,400.00	3,400,000
東映	1,000	1,066.00	1,066,000
エヌ・ティ・ティ・データ	4,700	1,240.00	5,828,000
D T S	100	3,470.00	347,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	600	3,650.00	2,190,000
シーイーシー	100	2,114.00	211,400
カプコン	400	2,643.00	1,057,200
ジャステック	100	1,259.00	125,900
S C S K	400	5,010.00	2,004,000
日本システムウエア	100	1,776.00	177,600
アイネス	300	1,141.00	342,300
T K C	200	3,225.00	645,000
富士ソフト	300	3,225.00	967,500
N S D	300	2,085.00	625,500
コナミホールディングス	700	6,160.00	4,312,000
福井コンピュータホールディングス	100	3,850.00	385,000
J B C C ホールディングス	100	840.00	84,000
ミロク情報サービス	100	2,294.00	229,400
ソフトバンクグループ	6,800	9,145.00	62,186,000
エレマテック	100	1,831.00	183,100
J A L U X	100	2,677.00	267,700
あらた	100	3,890.00	389,000

フィールズ	100	1,208.00	120,800
双日	9,100	276.00	2,511,600
アルフレッサ ホールディングス	1,800	2,072.00	3,729,600
横浜冷凍	400	1,069.00	427,600
アルコニックス	100	2,088.00	208,800
神戸物産	100	5,200.00	520,000
あい ホールディングス	300	3,045.00	913,500
ダイワボウホールディングス	2,000	408.00	816,000
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,673.00	501,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	300	874.00	262,200
U K Cホールディングス	100	1,897.00	189,700
T O K A Iホールディングス	800	838.00	670,400
三洋貿易	100	2,637.00	263,700
ウイン・パートナーズ	200	1,318.00	263,600
シップヘルスケアホールディングス	300	3,365.00	1,009,500
明治電機工業	100	1,356.00	135,600
富士興産	100	547.00	54,700
小野建	200	1,806.00	361,200
伯東	100	1,470.00	147,000
コンドーテック	100	979.00	97,900
中山福	100	803.00	80,300
ナガイレーベン	300	2,712.00	813,600
三菱食品	200	3,210.00	642,000
松田産業	200	1,471.00	294,200
第一興商	300	5,340.00	1,602,000
メディパルホールディングス	1,500	2,049.00	3,073,500
萩原電気	100	2,256.00	225,600
アズワン	100	5,500.00	550,000
シモジマ	100	1,113.00	111,300
ドウシシャ	200	2,129.00	425,800
高速	100	1,074.00	107,400
黒田電気	200	2,143.00	428,600
丸文	200	834.00	166,800
ハピネット	200	1,994.00	398,800
日本ライフライン	200	4,415.00	883,000
エクセル	100	1,430.00	143,000
マルカキカイ	100	1,875.00	187,500
I D O M	500	667.00	333,500
日本エム・ディ・エム	200	932.00	186,400
進和	100	2,219.00	221,900
シークス	100	4,540.00	454,000
オーハシテクニカ	200	1,414.00	282,800
伊藤忠商事	11,000	1,713.00	18,843,000
丸紅	14,700	735.70	10,814,790
長瀬産業	1,000	1,762.00	1,762,000

蝶理	100	2,023.00	202,300
豊田通商	1,700	3,415.00	5,805,500
三共生興	300	390.00	117,000
兼松	3,000	236.00	708,000
ツカモトコーポレーション	1,000	128.00	128,000
三井物産	13,900	1,606.50	22,330,350
日立ハイテクノロジーズ	500	4,520.00	2,260,000
カメイ	200	1,566.00	313,200
スターゼン	100	4,655.00	465,500
山善	500	1,129.00	564,500
住友商事	9,600	1,493.50	14,337,600
三菱商事	11,600	2,400.50	27,845,800
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,518.00	1,007,200
西華産業	1,000	425.00	425,000
佐藤商事	200	905.00	181,000
菱洋エレクトロ	200	1,858.00	371,600
ユアサ商事	100	3,445.00	344,500
阪和興業	2,000	836.00	1,672,000
カナデン	100	1,195.00	119,500
フルサト工業	100	1,707.00	170,700
岩谷産業	2,000	714.00	1,428,000
すてきナイスグループ	1,000	156.00	156,000
昭光通商	1,000	100.00	100,000
三愛石油	500	1,166.00	583,000
稲畑産業	400	1,490.00	596,000
G S Iクレオス	1,000	139.00	139,000
明和産業	300	439.00	131,700
ワキタ	400	1,274.00	509,600
東邦ホールディングス	500	2,156.00	1,078,000
サンゲツ	400	1,971.00	788,400
ミツウロコグループホールディングス	200	716.00	143,200
伊藤忠エネクス	400	973.00	389,200
サンリオ	500	2,226.00	1,113,000
サンワテクノス	100	1,530.00	153,000
リョーサン	200	4,260.00	852,000
新光商事	200	1,392.00	278,400
トーヨー	100	3,015.00	301,500
三信電気	200	1,445.00	289,000
東陽テクニカ	300	1,076.00	322,800
モスフードサービス	200	3,375.00	675,000
加賀電子	200	2,409.00	481,800
立花エレテック	100	1,541.00	154,100
フォーバル	100	765.00	76,500
PALTA C	300	3,880.00	1,164,000
三谷産業	100	416.00	41,600

ヤマタネ	100	1,624.00	162,400
日鉄住金物産	100	5,710.00	571,000
トラスコ中山	400	2,726.00	1,090,400
オートバックスセブン	600	1,906.00	1,143,600
加藤産業	200	2,916.00	583,200
イノテック	100	669.00	66,900
イエローハット	100	2,925.00	292,500
J Kホールディングス	400	679.00	271,600
杉本商事	100	1,546.00	154,600
因幡電機産業	200	4,310.00	862,000
バイテックホールディングス	100	1,441.00	144,100
ミスミグループ本社	1,800	2,703.00	4,865,400
スズケン	700	3,635.00	2,544,500
ジェコス	100	1,280.00	128,000
ローソン	500	7,380.00	3,690,000
サンエー	100	4,785.00	478,500
カワチ薬品	100	2,764.00	276,400
エービーシー・マート	300	6,280.00	1,884,000
ハードオフコーポレーション	100	1,125.00	112,500
アスクル	200	3,540.00	708,000
ゲオホールディングス	300	1,182.00	354,600
アダストリア	300	2,751.00	825,300
ジーフット	100	804.00	80,400
くらコーポレーション	100	5,460.00	546,000
キャンドゥ	100	1,676.00	167,600
バルグループホールディングス	100	3,370.00	337,000
エディオン	600	1,003.00	601,800
サーラコーポレーション	200	856.00	171,200
ワッツ	100	1,306.00	130,600
ハローズ	100	2,324.00	232,400
ひらまつ	200	647.00	129,400
ハニーズホールディングス	200	1,299.00	259,800
アルペン	100	2,027.00	202,700
クオール	200	1,748.00	349,600
ジンス	100	6,450.00	645,000
ビックカメラ	900	1,194.00	1,074,600
D C Mホールディングス	1,000	961.00	961,000
Monotaro	600	3,625.00	2,175,000
アークランドサービスホールディングス	200	1,916.00	383,200
J . フロント リテイリング	1,900	1,605.00	3,049,500
ドトール・日レスホールディングス	200	2,503.00	500,600
マツモトキヨシホールディングス	300	6,600.00	1,980,000
ブロンコビリー	100	2,524.00	252,400
スタートトゥデイ	1,400	2,718.00	3,805,200
トレジャー・ファクトリー	100	801.00	80,100

物語コーポレーション	100	5,580.00	558,000
ココカラファイン	200	5,740.00	1,148,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,100	1,093.00	3,388,300
ウエルシアホールディングス	400	4,105.00	1,642,000
クリエイトSDホールディングス	300	2,898.00	869,400
チムニー	100	2,804.00	280,400
シュッピン	100	2,142.00	214,200
ジョイフル本田	300	3,055.00	916,500
すかいらく	800	1,647.00	1,317,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	500	1,116.00	558,000
ブックオフコーポレーション	300	798.00	239,400
あさひ	100	1,312.00	131,200
日本調剤	100	3,570.00	357,000
コスモス薬品	100	23,190.00	2,319,000
トーエル	100	901.00	90,100
セブン&アイ・ホールディングス	6,400	4,468.00	28,595,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	600	1,167.00	700,200
ツルハホールディングス	300	11,780.00	3,534,000
サンマルクホールディングス	100	3,360.00	336,000
トリドールホールディングス	200	2,905.00	581,000
クスリのアオキホールディングス	100	5,550.00	555,000
メディカルシステムネットワーク	200	491.00	98,200
総合メディカル	100	4,855.00	485,500
はるやまホールディングス	100	988.00	98,800
カップ・クリエイト	100	1,265.00	126,500
ライトオン	200	991.00	198,200
良品計画	200	27,390.00	5,478,000
三城ホールディングス	200	457.00	91,400
アドヴァン	200	1,121.00	224,200
コナカ	500	592.00	296,000
G-7ホールディングス	100	2,278.00	227,800
イオン北海道	100	611.00	61,100
コジマ	300	336.00	100,800
ヒマラヤ	100	872.00	87,200
コーナン商事	300	2,062.00	618,600
エコス	100	1,134.00	113,400
ワタミ	200	1,336.00	267,200
ドンキホーテホールディングス	1,000	4,065.00	4,065,000
西松屋チェーン	300	1,176.00	352,800
ゼンショーホールディングス	800	2,019.00	1,615,200
幸楽苑ホールディングス	100	1,808.00	180,800
ハークスレイ	100	1,125.00	112,500
サイゼリヤ	200	3,295.00	659,000

V Tホールディングス	600	547.00	328,200
ユナイテッドアローズ	200	3,375.00	675,000
ハイデイ日高	200	2,905.00	581,000
京都きもの友禅	100	930.00	93,000
コロワイド	500	1,891.00	945,500
ピーシーデポコーポレーション	200	593.00	118,600
壱番屋	100	3,825.00	382,500
スギホールディングス	300	5,540.00	1,662,000
スクロール	300	370.00	111,000
ヨンドシーホールディングス	200	2,613.00	522,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	700	6,190.00	4,333,000
木曽路	200	2,705.00	541,000
サトレストランシステムズ	200	917.00	183,400
千趣会	200	790.00	158,000
タカキュー	500	197.00	98,500
日本瓦斯	300	3,595.00	1,078,500
ロイヤルホールディングス	300	2,608.00	782,400
いなげや	200	1,735.00	347,000
島忠	400	2,716.00	1,086,400
チヨダ	200	3,010.00	602,000
ライフコーポレーション	100	2,940.00	294,000
リンガーハット	200	2,530.00	506,000
Mr M a x	200	526.00	105,200
A O K Iホールディングス	300	1,421.00	426,300
コメリ	300	2,860.00	858,000
青山商事	400	3,990.00	1,596,000
しまむら	200	13,430.00	2,686,000
高島屋	2,000	1,008.00	2,016,000
松屋	400	945.00	378,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	800	1,911.00	1,528,800
パルコ	200	1,325.00	265,000
丸井グループ	1,700	1,532.00	2,604,400
アクシアル リテイリング	100	4,150.00	415,000
イオン	6,100	1,701.00	10,376,100
イズミ	300	5,700.00	1,710,000
平和堂	300	2,313.00	693,900
フジ	200	2,682.00	536,400
ヤオコー	200	4,725.00	945,000
ゼビオホールディングス	200	2,064.00	412,800
ケーズホールディングス	700	2,172.00	1,520,400
O l y m p i cグループ	100	587.00	58,700
日産東京販売ホールディングス	300	420.00	126,000
アインホールディングス	200	8,350.00	1,670,000
元気寿司	100	2,295.00	229,500

ヤマダ電機	5,300	564.00	2,989,200
アークランドサカモト	300	1,503.00	450,900
ニトリホールディングス	700	14,690.00	10,283,000
吉野家ホールディングス	600	1,982.00	1,189,200
松屋フーズ	100	4,140.00	414,000
サガミチェーン	200	1,397.00	279,400
関西スーパーマーケット	200	1,535.00	307,000
王将フードサービス	100	4,320.00	432,000
ブレナス	200	2,583.00	516,600
ミニストップ	100	2,429.00	242,900
アークス	300	2,337.00	701,100
パローホールディングス	300	2,491.00	747,300
ベルク	100	4,920.00	492,000
大庄	100	1,768.00	176,800
ファーストリテイリング	200	33,880.00	6,776,000
サンドラッグ	600	4,070.00	2,442,000
サックスパー ホールディングス	200	1,238.00	247,600
じもとホールディングス	1,500	197.00	295,500
めぶきフィナンシャルグループ	7,300	424.00	3,095,200
東京ＴＹフィナンシャルグループ	200	3,015.00	603,000
九州フィナンシャルグループ	2,400	720.00	1,728,000
ゆうちょ銀行	4,400	1,438.00	6,327,200
富山第一銀行	600	508.00	304,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	10,000	552.00	5,520,000
西日本フィナンシャルホールディングス	1,000	1,226.00	1,226,000
新生銀行	13,000	184.00	2,392,000
あおぞら銀行	10,000	430.00	4,300,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	117,000	721.60	84,427,200
りそなホールディングス	17,600	584.50	10,287,200
三井住友トラスト・ホールディングス	3,000	3,937.00	11,811,000
三井住友フィナンシャルグループ	12,300	4,268.00	52,496,400
第四銀行	2,000	511.00	1,022,000
北越銀行	200	2,647.00	529,400
千葉銀行	6,000	796.00	4,776,000
群馬銀行	3,500	651.00	2,278,500
武蔵野銀行	200	3,355.00	671,000
千葉興業銀行	500	580.00	290,000
筑波銀行	700	332.00	232,400
七十七銀行	2,000	548.00	1,096,000
青森銀行	1,000	387.00	387,000
秋田銀行	1,000	314.00	314,000
山形銀行	1,000	491.00	491,000
岩手銀行	100	4,430.00	443,000
東邦銀行	1,000	386.00	386,000
みちのく銀行	1,000	184.00	184,000



ふくおかフィナンシャルグループ	6,000	521.00	3,126,000	
静岡銀行	4,000	994.00	3,976,000	
十六銀行	2,000	357.00	714,000	
スルガ銀行	1,600	2,714.00	4,342,400	
八十二銀行	3,000	722.00	2,166,000	
山梨中央銀行	1,000	453.00	453,000	
大垣共立銀行	2,000	315.00	630,000	
福井銀行	1,000	268.00	268,000	
北國銀行	2,000	424.00	848,000	
清水銀行	100	3,530.00	353,000	
滋賀銀行	1,000	577.00	577,000	
南都銀行	200	3,185.00	637,000	
百五銀行	1,000	449.00	449,000	
京都銀行	3,000	1,036.00	3,108,000	
紀陽銀行	600	1,919.00	1,151,400	
三重銀行	100	2,440.00	244,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,000	1,779.00	1,779,000	
広島銀行	4,000	465.00	1,860,000	
山陰合同銀行	900	895.00	805,500	
中国銀行	1,100	1,634.00	1,797,400	
伊予銀行	1,800	916.00	1,648,800	
百十四銀行	2,000	358.00	716,000	
四国銀行	1,000	295.00	295,000	
阿波銀行	1,000	728.00	728,000	
大分銀行	1,000	417.00	417,000	
宮崎銀行	1,000	362.00	362,000	
佐賀銀行	1,000	262.00	262,000	
十八銀行	1,000	298.00	298,000	
沖縄銀行	200	4,445.00	889,000	
琉球銀行	500	1,587.00	793,500	
セブン銀行	6,100	413.00	2,519,300	
みずほフィナンシャルグループ	209,100	199.30	41,673,630	
高知銀行	1,000	124.00	124,000	
山口フィナンシャルグループ	1,000	1,347.00	1,347,000	
名古屋銀行	100	4,095.00	409,500	
北洋銀行	2,500	380.00	950,000	
愛知銀行	100	6,140.00	614,000	
第三銀行	100	1,720.00	172,000	
中京銀行	100	2,309.00	230,900	
大光銀行	1,000	237.00	237,000	
愛媛銀行	200	1,382.00	276,400	
みなと銀行	200	2,112.00	422,400	
京葉銀行	1,000	470.00	470,000	
関西アーバン銀行	200	1,324.00	264,800	
栃木銀行	1,000	464.00	464,000	

北日本銀行	100	3,175.00	317,500
大東銀行	1,000	166.00	166,000
トモニホールディングス	1,400	526.00	736,400
フィデアホールディングス	1,700	181.00	307,700
池田泉州ホールディングス	1,400	456.00	638,400
F P G	600	1,210.00	726,000
S B Iホールディングス	1,800	1,518.00	2,732,400
ジャフコ	200	4,600.00	920,000
大和証券グループ本社	14,000	661.20	9,256,800
野村ホールディングス	30,600	667.10	20,413,260
岡三証券グループ	1,000	732.00	732,000
丸三証券	500	912.00	456,000
東洋証券	1,000	252.00	252,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,800	641.00	1,153,800
光世証券	1,000	160.00	160,000
水戸証券	600	312.00	187,200
いちよし証券	400	937.00	374,800
松井証券	900	909.00	818,100
だいこう証券ビジネス	100	611.00	61,100
マネックスグループ	1,700	304.00	516,800
カブドットコム証券	1,100	377.00	414,700
極東証券	200	1,544.00	308,800
岩井コスモホールディングス	200	1,243.00	248,600
藍澤證券	300	676.00	202,800
マネーパートナーズグループ	300	499.00	149,700
かんぽ生命保険	300	2,504.00	751,200
S O M P Oホールディングス	3,200	4,472.00	14,310,400
アニコムホールディングス	100	2,664.00	266,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	4,600	3,916.00	18,013,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,500	1,984.00	2,976,000
第一生命ホールディングス	9,300	1,993.50	18,539,550
東京海上ホールディングス	6,000	4,752.00	28,512,000
T & Dホールディングス	5,600	1,674.50	9,377,200
全国保証	400	4,770.00	1,908,000
クレディセゾン	1,200	2,164.00	2,596,800
アクリーティブ	200	390.00	78,000
芙蓉総合リース	100	6,490.00	649,000
興銀リース	300	2,614.00	784,200
東京センチュリー	300	4,730.00	1,419,000
日本証券金融	700	554.00	387,800
アイフル	2,800	386.00	1,080,800
ポケットカード	200	715.00	143,000
リコーリース	100	3,890.00	389,000

イオンフィナンシャルサービス	1,000	2,335.00	2,335,000
アコム	2,800	485.00	1,358,000
ジャックス	1,000	520.00	520,000
日立キャピタル	400	2,678.00	1,071,200
オリックス	10,900	1,771.00	19,303,900
三菱UFJリース	3,900	596.00	2,324,400
日本取引所グループ	4,800	1,980.00	9,504,000
イー・ギャランティ	100	2,646.00	264,600
いちご	1,800	320.00	576,000
日本駐車場開発	2,200	165.00	363,000
ヒューリック	3,300	1,112.00	3,669,600
三栄建築設計	100	1,964.00	196,400
野村不動産ホールディングス	1,000	2,194.00	2,194,000
三重交通グループホールディングス	400	390.00	156,000
サムティ	200	1,552.00	310,400
日本商業開発	100	1,659.00	165,900
プレサンスコーポレーション	300	1,501.00	450,300
ユニゾホールディングス	100	2,525.00	252,500
日本管理センター	200	1,362.00	272,400
フージャースホールディングス	300	999.00	299,700
オープンハウス	200	3,505.00	701,000
東急不動産ホールディングス	3,700	647.00	2,393,900
飯田グループホールディングス	1,300	1,812.00	2,355,600
ムゲンエステート	100	972.00	97,200
パーク24	800	2,889.00	2,311,200
バラカ	100	2,191.00	219,100
三井不動産	8,000	2,542.50	20,340,000
三菱地所	11,400	2,000.50	22,805,700
平和不動産	400	1,742.00	696,800
東京建物	1,900	1,447.00	2,749,300
ダイビル	500	1,180.00	590,000
京阪神ビルディング	300	692.00	207,600
住友不動産	4,000	3,375.00	13,500,000
大京	3,000	233.00	699,000
テーオーシー	700	1,023.00	716,100
レオパレス21	1,900	758.00	1,440,200
スターツコーポレーション	200	2,778.00	555,600
フジ住宅	200	744.00	148,800
空港施設	200	619.00	123,800
明和地所	100	813.00	81,300
ゴールドクレスト	200	2,416.00	483,200
日神不動産	300	606.00	181,800
日本エスコン	400	502.00	200,800
タカラレーベン	800	485.00	388,000
サンヨーハウジング名古屋	100	1,113.00	111,300

イオンモール	1,000	2,095.00	2,095,000
トーセイ	300	781.00	234,300
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,000	1,089.00	1,089,000
サンフロンティア不動産	200	1,123.00	224,600
エフ・ジェー・ネクスト	200	865.00	173,000
インテリックス	100	869.00	86,900
グランディハウス	100	428.00	42,800
日本空港ビルデング	500	4,255.00	2,127,500
日本工営	100	3,210.00	321,000
L I F U L L	500	921.00	460,500
ジェイエイシーリクルートメント	200	1,821.00	364,200
日本M&Aセンター	500	4,235.00	2,117,500
タケエイ	200	1,116.00	223,200
トラスト・テック	100	2,336.00	233,600
パソナグループ	100	1,257.00	125,700
リンクアンドモチベーション	500	711.00	355,500
G C A	200	1,061.00	212,200
エス・エム・エス	300	3,345.00	1,003,500
パーソルホールディングス	1,300	2,100.00	2,730,000
リニカル	100	1,859.00	185,900
クックパッド	400	914.00	365,600
エスクリ	100	732.00	73,200
アイ・ケイ・ケイ	100	803.00	80,300
学情	100	1,264.00	126,400
スタジオアリス	100	2,493.00	249,300
シミックホールディングス	100	1,474.00	147,400
総合警備保障	600	5,050.00	3,030,000
カカクコム	1,200	1,641.00	1,969,200
ルネサンス	100	1,983.00	198,300
ディップ	300	2,423.00	726,900
オプトホールディング	100	1,400.00	140,000
新日本科学	200	619.00	123,800
ツクイ	500	662.00	331,000
エムスリー	1,500	3,030.00	4,545,000
ツカダ・グローバルホールディング	100	606.00	60,600
アウトソーシング	100	5,540.00	554,000
ウェルネット	200	1,352.00	270,400
ディー・エヌ・エー	700	2,657.00	1,859,900
博報堂D Yホールディングス	2,300	1,563.00	3,594,900
ぐるなび	200	1,820.00	364,000
エスアールジータカミヤ	200	538.00	107,600
ジャパンベストレスキューシステム	400	309.00	123,600
ファンコミュニケーションズ	500	1,001.00	500,500
WDBホールディングス	100	2,204.00	220,400
バリューコマース	300	708.00	212,400

インフォマート	800	834.00	667,200
J Pホールディングス	600	285.00	171,000
E P Sホールディングス	300	1,824.00	547,200
プレステージ・インターナショナル	300	1,206.00	361,800
アミューズ	100	2,994.00	299,400
ドリームインキュベータ	100	2,203.00	220,300
クイック	100	1,480.00	148,000
ケネディクス	2,400	526.00	1,262,400
電通	1,800	5,130.00	9,234,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	786.00	78,600
ぴあ	100	3,735.00	373,500
イオンファンタジー	100	3,370.00	337,000
ネクシーズグループ	100	1,888.00	188,800
みらかホールディングス	400	4,920.00	1,968,000
アルプス技研	100	3,725.00	372,500
ダイオーズ	100	1,234.00	123,400
日本空調サービス	100	713.00	71,300
オリエンタルランド	1,700	7,627.00	12,965,900
ダスキン	400	2,817.00	1,126,800
明光ネットワークジャパン	200	1,545.00	309,000
ファルコホールディングス	100	1,536.00	153,600
ラウンドワン	600	1,170.00	702,000
リゾートトラスト	600	2,062.00	1,237,200
ビー・エム・エル	300	2,146.00	643,800
ワタベウェディング	100	552.00	55,200
りらいあコミュニケーションズ	300	1,208.00	362,400
ユー・エス・エス	2,000	2,200.00	4,400,000
東京個別指導学院	100	1,480.00	148,000
サイバーエージェント	900	3,620.00	3,258,000
楽天	8,200	1,314.00	10,774,800
テー・オー・ダブリュー	200	878.00	175,600
フルキャストホールディングス	200	1,354.00	270,800
テクノプロ・ホールディングス	300	4,685.00	1,405,500
リブセンス	200	627.00	125,400
ジャパンマテリアル	100	1,986.00	198,600
ベクトル	200	1,650.00	330,000
I B J	200	759.00	151,800
アサンテ	100	2,057.00	205,700
ライドオン・エクスプレス	100	1,030.00	103,000
リクルートホールディングス	10,600	1,926.00	20,415,600
日本郵政	3,700	1,412.00	5,224,400
ベルシステム24ホールディングス	300	1,171.00	351,300
ソラスト	100	1,473.00	147,300
リログループ	900	2,174.00	1,956,600
エイチ・アイ・エス	300	3,325.00	997,500

共立メンテナンス	200	3,260.00	652,000	
イチネンホールディングス	200	1,204.00	240,800	
建設技術研究所	100	1,147.00	114,700	
スペース	100	1,424.00	142,400	
東京テアトル	1,000	144.00	144,000	
東京都競馬	100	3,175.00	317,500	
カナモト	200	3,760.00	752,000	
東京ドーム	700	1,010.00	707,000	
西尾レントオール	100	3,680.00	368,000	
トランス・コスモス	200	2,714.00	542,800	
乃村工藝社	400	2,276.00	910,400	
藤田観光	100	4,160.00	416,000	
日本管財	200	1,961.00	392,200	
トーカイ	100	4,625.00	462,500	
セコム	1,700	8,463.00	14,387,100	
セントラル警備保障	100	2,069.00	206,900	
丹青社	300	1,096.00	328,800	
メイテック	200	4,730.00	946,000	
アサツー ディ・ケイ	300	2,923.00	876,900	
応用地質	200	1,574.00	314,800	
船井総研ホールディングス	200	2,851.00	570,200	
進学会	100	576.00	57,600	
ベネッセホールディングス	500	4,375.00	2,187,500	
イオンディライト	200	3,865.00	773,000	
ナック	100	997.00	99,700	
ニチイ学館	300	1,115.00	334,500	
ダイセキ	300	2,676.00	802,800	
合計	2,315,000		3,657,759,040	

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
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】

## 【純資産額計算書】

	平成29年7月31日現在
資産総額	3,759,900,188 円
負債総額	1,220,402 円
純資産総額( )	3,758,679,786 円
発行済数量	3,386,022,642 口
1口当たり純資産額( / )	1.1101 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 受益証券の名義書換え等  
該当事項はありません。
- (2) 受益者名簿の閉鎖の時期  
該当事項はありません。
- (3) 受益者に対する特典  
該当事項はありません。
- (4) 受益権の譲渡制限の内容

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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、上記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。）に振替法の規定に従い、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われるよう通知するものとします。

上記の振替について、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等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

- (5) 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。

- (6) 受益権の再分割

委託会社は、受託者と協議のうえ、振替法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。

- (7) 償還金

償還金は、償還日において振替機関の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還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販売会社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て）に支払います。

- (8) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。



## 第二部【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）資本の額

200百万円(本書提出日現在)

発行可能株式総数 16,000株

発行済株式総数 4,000株

最近5年間における主な資本の額の増減はありません。

##### （2）当社の機構

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後1年以内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選任し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決めます。

###### 投資運用の意思決定機構

###### 商品企画体制

###### ・投資政策委員会

当委員会において、事務局である運用本部運用企画部が情報を収集し、投資環境、運用環境、販売環境に適合した商品企画案を提出します。また当委員会は、新規設定する商品に関する基本的な重要事項について協議し、委員長がこれを決定します。

###### 運用体制

###### ・投資政策委員会

当委員会において、経済環境、資産別市場見通しならびに投資環境等を検討し、基本的な運用方針、運用戦略について協議し、委員長がこれを決定します。また、基本的な投資方針等に基づいて、ファンド運用についての具体的なガイドライン、方策を審議、決定するとともに、個別銘柄についての分析を行い、投資対象銘柄を選定します。経営管理部は、各ファンドの運用成績、ポートフォリオの運用内容等について考査し、当委員会に報告を行います。

###### ・コンプライアンス・運用管理委員会

当委員会において、事務局である経営管理部は、前1か月間の運用状況のモニタリングを行い、リスクとリターンの計測・分析結果および法令・諸規則や運用に関する諸決定事項の遵守状況等の報告を行います。また、トレーディング部は、取引先リスク等の報告を行います。

###### コンプライアンス管理体制

取締役会の下で法令等遵守に関する問題を一元管理するため、以下のとおりコンプライアンス管理体制を敷いています。

- ・コンプライアンス・運用管理委員会を設置し、コンプライアンスに関する事項全般について審議します。
- ・コンプライアンスに関する事項を統括する部門として、コンプライアンス担当部門を設置するとともに、コンプライアンス関連部門を設置します。
- ・コンプライアンス統括責任者を社長、コンプライアンス管理責任者を経営管理部長とし、コンプライアンス責任者を各部門長とします。また、各部門におけるコンプライアンスの推進および徹底を実践するため、各部門にコンプライアンス担当者を配置します。
- ・全部門から独立した内部監査部門を設置し、コンプライアンス管理の適切性・有効性を検証・評価します。

上記の内容は、今後変更となる場合があります。

## 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当社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行います。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部および投資助言業務を行います。

当社の運用する証券投資信託は、2017年7月31日現在、以下のとおりです。

（親投資信託を除きます。）

（単位：百万円）

種類	本数	純資産総額
追加型株式投資信託	58	780,704
単位型公社債投資信託	3	17,067
単位型株式投資信託	29	98,679
合計	90	896,450

(注)純資産総額は百万円未満を切り捨てしています。

### 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)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 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、当事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## 1 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

科 目	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
		金 額		金 額	
(資産の部)		千円	千円	千円	千円
流動資産					
現金・預金	*2		2,749,956		3,532,999
前払費用			12,646		18,138
未収委託者報酬			412,264		433,530
未収運用受託報酬	*2		19,480		16,941
未収収益			82		38
繰延税金資産			36,340		33,208
その他の流動資産			519		466
流動資産計			3,231,291		4,035,324
固定資産					
有形固定資産	*1		88,010		82,688
建物		64,057		58,375	
器具備品		23,953		24,313	
無形固定資産			91,905		70,236
ソフトウェア		90,619		68,785	
電話加入権		959		959	
その他		325		491	
投資その他の資産			1,003		2,968
長期前払費用		1,003		2,968	
固定資産計			180,919		155,893
資産合計			3,412,210		4,191,217

科 目	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
		金 額	金 額	金 額	金 額
(負債の部)		千円	千円	千円	千円
流動負債					
未払金			296,395		331,493
未払手数料	*2	242,684		261,115	
その他未払金		53,710		70,378	
未払法人税等			183,587		196,373
未払消費税等			38,411		43,152
未払事業所税			1,865		1,878
前受収益			6,432		-
賞与引当金			67,423		68,577
その他の流動負債			2,876		2,750
流動負債計			596,993		644,226
固定負債					
退職給付引当金			90,618		100,631
役員退職慰労引当金			25,170		15,848
固定負債計			115,788		116,480
負債合計			712,781		760,707
(純資産の部)		千円	千円	千円	千円
株主資本			2,699,429		3,430,510
資本金			200,000		200,000
利益剰余金			2,499,429		3,230,510
利益準備金		2,000		2,000	
その他利益剰余金		2,497,429		3,228,510	
別途積立金		1,800,000		2,350,000	
繰越利益剰余金		697,429		878,510	
純資産合計			2,699,429		3,430,510
負債・純資産合計			3,412,210		4,191,217

## ( 2 ) 【損益計算書】

科 目	注記 番号	前事業年度		当事業年度	
		自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日
		金 額		金 額	
		千円	千円	千円	千円
営業収益					
委託者報酬			4,016,300		4,604,878
運用受託報酬	*1		221,945		212,214
営業収益計			4,238,246		4,817,093
営業費用					
支払手数料	*1		2,015,995		2,289,896
広告宣伝費			17,795		24,734
調査費			374,952		442,132
調査研究費		295,600		327,321	
委託調査費		79,352		114,810	
営業雑経費			57,761		60,001
印刷費		51,186		53,360	
郵便料		203		150	
電信電話料		2,260		2,244	
協会費		4,110		4,245	
営業費用計			2,466,505		2,816,764
一般管理費					
給料			536,903		534,172
役員報酬		41,999		41,999	
給料・手当		345,983		346,443	
賞与		66,649		63,219	
法定福利費		67,918		68,520	
福利厚生費		4,911		3,996	
その他給料		9,440		9,992	
賞与引当金繰入			67,423		68,374
退職給付費用			62,698		56,254
役員退職慰労引当金繰入			12,022		8,678
交際費			4,029		4,321
旅費交通費			9,634		8,823
租税公課			13,281		22,779
不動産賃借料			62,740		62,760
固定資産減価償却費			45,195		48,587
諸経費			125,507		126,388
一般管理費計			939,437		941,140
営業利益			832,303		1,059,187
営業外収益					
受取利息	*1		507		162
その他営業外収益			281		219
営業外収益計			788		381
営業外費用					
雑損失			358		157
営業外費用計			358		157

経常利益			832,733		1,059,411
------	--	--	---------	--	-----------

科 目	注記 番号	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日		当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	
		金 額		金 額	
特別損失		千円	千円	千円	千円
固定資産除却損			3,556		-
特別損失計			3,556		-
税引前当期純利益			829,176		1,059,411
法人税、住民税および事業税			287,074		325,199
法人税等調整額			1,568		3,131
当期純利益			543,670		731,081



## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計		
			別途 積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	200,000	2,000	1,410,000	543,758	1,955,758	2,155,758	2,155,758
当期変動額							
新株の発行							
剰余金の配当							
別途積立金の積立			390,000	390,000			
別途積立金の取崩							
当期純利益				543,670	543,670	543,670	543,670
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計			390,000	153,670	543,670	543,670	543,670
当期末残高	200,000	2,000	1,800,000	697,429	2,499,429	2,699,429	2,699,429

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計		
			別途 積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	200,000	2,000	1,800,000	697,429	2,499,429	2,699,429	2,699,429
当期変動額							
新株の発行							
剰余金の配当							
別途積立金の積立			550,000	550,000			
別途積立金の取崩							
当期純利益				731,081	731,081	731,081	731,081
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計			550,000	181,081	731,081	731,081	731,081
当期末残高	200,000	2,000	2,350,000	878,510	3,230,510	3,430,510	3,430,510

## 重要な会計方針

	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
1. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産 定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下のとおりです。 建 物 3年 ~ 50年 器具備品 3年 ~ 20年</p> <p>(2)無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1)賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。</p> <p>(2)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を計上しております。 なお、退職給付引当金の対象従業員が300名未満であるため、簡便法によっており、退職給付債務の金額は当事業年度末における自己都合要支給額としております。</p> <p>(3)役員退職慰労引当金 当社常勤役員の退職慰労金の支給に充てるため、「常勤役員退職慰労金規程」に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。</p>
3. 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 消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。 なお、仮払消費税等およ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>

## （追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## \* 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
建 物	51,907千円	57,590千円
器具備品	26,302千円	31,583千円

## \* 2 関係会社項目

関係会社に対する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
普通預金	1,523,880千円	2,397,290千円
定期預金	1,000,000千円	1,000,000千円
未収運用受託報酬	2,558千円	- 千円
未払手数料	126,284千円	133,205千円

## (損益計算書関係)

## \* 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
運用受託報酬	141,022千円	146,598千円
受取利息	477千円	160千円
支払手数料	1,678,370千円	1,873,505千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式および総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(千株)	4			4
計	4			4

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1. 発行済株式および総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(千株)	4			4
計	4			4

## (リース取引関係)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．金融商品の状況に関する事項

当社は、資産運用については短期的な預金等に限定しております。また、投機的な取引は行なわない方針であります。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次の通りであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,749,956	2,749,956	
(2)未収委託者報酬	412,264	412,264	
(3)未収運用受託報酬	19,480	19,480	
資産計	3,181,701	3,181,701	
(4)未払手数料	242,684	242,684	
(5)その他未払金	53,710	53,710	
(6)未払法人税等	183,587	183,587	
(7)未払消費税等	38,411	38,411	
(8)未払事業所税	1,865	1,865	
負債計	520,259	520,259	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(4)未払手数料、(5)その他未払金、(6)未払法人税等、(7)未払消費税等、(8)未払事業所税

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。

## (注2) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	1年以内	1年超
(1)預金	2,749,836	2,749,836	
(2)未収委託者報酬	412,264	412,264	
(3)未収運用受託報酬	19,480	19,480	
合計	3,181,582	3,181,582	

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、資産運用については短期的な預金等に限定しております。また、投機的な取引は行なわない方針であります。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

### 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年3月31日における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次の通りであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	3,532,999	3,532,999	
(2)未収委託者報酬	433,530	433,530	
(3)未収運用受託報酬	16,941	16,941	
資産計	3,983,471	3,983,471	
(4)未払手数料	261,115	261,115	
(5)その他未払金	70,378	70,378	
(6)未払法人税等	196,373	196,373	
(7)未払消費税等	43,152	43,152	
(8)未払事業所税	1,878	1,878	
負債計	572,898	572,898	

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(4)未払手数料、(5)その他未払金、(6)未払法人税等、(7)未払消費税等、(8)未払事業所税

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。

(注2) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	1年以内	1年超
(1)預金	3,532,907	3,532,907	
(2)未収委託者報酬	433,530	433,530	
(3)未収運用受託報酬	16,941	16,941	
合計	3,983,380	3,983,380	

## （有価証券関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度と厚生年金基金制度を併用しております。当社が有する退職一時金制度については、簡便法により退職給付引当金および退職給付費用を計算しております。

また、当社が加入する厚生年金基金制度は、複数事業主制度の厚生年金基金制度であり、当社の拠出に対応する年金資産の額を合理的に計算することができないため、当該年金制度への拠出額を退職給付費用として計上しております。

## 2. 確定給付制度

## （1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
	千円	千円
退職給付引当金の期首残高	87,723	90,618
退職給付費用	11,871	12,169
退職給付の支払額	8,976	2,156
制度への拠出額		
退職給付引当金の期末残高	90,618	100,631

## （2）退職給付債務および年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金および前払年金費用の調整表

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
	千円	千円
非積立金型制度の退職給付債務	90,618	100,631
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,618	100,631
退職給付引当金	90,618	100,631

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,618	100,631
---------------------	--------	---------

## (3) 退職給付費用

	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
簡便法で計算した退職給付費用	千円 11,871	千円 12,169

## 3. 複数事業主制度

確定拠出制度と同様に会計処理する、複数事業主制度の厚生年金基金制度への要拠出額は、前事業年度 35,789千円、当事業年度 35,424千円であります。

	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
(1) 直近の積立状況に関する事項	(平成27年3月31日現在)	(平成28年3月31日現在)
	千円	千円
年金資産の額	1,659,830,986	1,605,568,222
年金財政計算上の数理債務の額と最低責任準備金の額との合計額(注)	1,824,563,577	1,782,403,243
差引額	<u>164,732,591</u>	<u>176,835,020</u>
(2) 掛金に占める当社の拠出割合	(平成27年3月分) 0.0607%	(平成28年3月分) 0.0560%
(3) 補足説明	上記(1)の差引額の主な要因は、年金財政計算上の過去の勤務債務残高247,567,203千円および年金財政計算上の別途積立金82,834,612千円であります。 本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年0か月の元利均等定率償却であります。	上記(1)の差引額の主な要因は、年金財政計算上の過去の勤務債務残高229,190,073千円および年金財政計算上の別途積立金52,355,052千円であります。 本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年0か月の元利均等定率償却であります。



## ( 税効果会計関係 )

## 1. 繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
	千円	千円
繰延税金資産		
賞与引当金繰入限度超過額	20,807	21,162
役員退職慰労引当金	7,767	4,890
退職給付引当金繰入限度超過額	27,964	31,054
未払事業税	11,333	8,425
未払事業所税	575	579
その他	3,624	3,040
繰延税金資産 小計	72,072	69,154
評価性引当額	35,732	35,945
繰延税金資産 合計	36,340	33,208
繰延税金資産の純額	36,340	33,208
繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。		
流動資産 繰延税金資産	36,340	33,208

## 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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## （セグメント情報等）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## （1）製品・サービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
信金中央金庫	141,022

なお、営業収益の金額は、運用受託報酬について表示しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## （1）製品・サービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
信金中央金庫	146,598

なお、営業収益の金額は、運用受託報酬について表示しております。

## ( 関連当事者情報 )

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社および法人主要株主等

種類	会社等の名称	住所	資本金 または 出資金	事業の 内容	議決権等の所 有(被所有)割 合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼務等	事業上の 関係				
親会社	信金中央 金庫	東京都 中央区	690,998 百万円	信用金庫 連合会事 業	直接 (被所有) 100%	兼任1 人	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	運用受託 報酬  投資信託 の代行手 数料  事務所 賃借料  出向者 人件費	141,022 千円  1,678,370 千円  49,958 千円  144,099 千円	未収 運用受託 報酬  未払 手数料	2,558 千円  126,284 千円

## (2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	住所	資本金 または 出資金	事業の 内容	議決権等の所 有(被所有)割 合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼務等	事業上の 関係				
親会社 の子会 社	しんきん 証券株式 会社	東京都 中央区	20,000 百万円	証券業		なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	投資信託 の代行手 数料	308,409 千円	未払 手数料	73,117 千円

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

## 2. 取引条件および取引条件の決定方針等

信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち、委託者報酬分の配分を両者協議のうえ合理的に決定しております。

また、上記の他預金取引がありますが、取引条件が一般の取引と同等であることが明白な取引であるため記載しておりません。

## 2. 親会社に関する注記

親会社情報

信金中央金庫(東京証券取引所に上場)

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

### (1) 親会社および法人主要株主等

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼務等	事業上の関係				
親会社	信金中央金庫	東京都中央区	690,998 百万円	信用金庫 連合会事業	直接 (被所有) 100%	兼任1 人	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	運用受託 報酬 投資信託 の代行手 数料 事務所 賃借料 出向者 人件費	146,598 千円 1,873,505 千円 49,958 千円 150,768 千円	未払 手数料	133,205 千円

### (2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼務等	事業上の関係				
親会社の子会社	しんきん証券株式会社	東京都中央区	20,000 百万円	証券業		なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	投資信託 の代行手 数料	389,128 千円	未払 手数料	73,862 千円

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

#### 2. 取引条件および取引条件の決定方針等

信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち、委託者報酬分の配分を両者協議のうえ合理的に決定しております。

また、上記の他預金取引がありますが、取引条件が一般の取引と同等であることが明白な取引であるため記載しておりません。

## 2. 親会社に関する注記

### 親会社情報

信金中央金庫（東京証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
1株当たり純資産額	674,857円36銭	857,627円65銭
1株当たり当期純利益金額	135,917円66銭	182,770円28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、潜在株式が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。

	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
当期純利益金額	543,670千円	731,081千円
普通株主に帰属しない金額	千円	千円
普通株式に係る当期純利益金額	543,670千円	731,081千円
期中平均株式数	4,000 株	4,000 株

## （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うことを内容とした運用を行うこと（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うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (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うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(1)から(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

定款の変更に関しては、株主総会において株主の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### 1 - (1) 名称

信金中央金庫(指定登録金融機関)(販売会社)

(2) 資本の額(出資の総額) 690,998百万円(平成29年3月末現在)

(3) 事業の内容

全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

#### 2 - (1) 名称

しんきん証券株式会社(金融商品取引業者)(販売会社)

(2) 資本の額 20,000百万円(平成29年3月末現在)

(3) 事業の内容

金融商品取引法に基づき第一種金融商品取引業を営んでいます。

#### 3 - (1) 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社(受託会社)

(2) 資本の額 324,279百万円(平成29年3月末現在)

(3) 事業の内容

銀行業および信託業務を営んでいます。

#### <再信託受託会社の概要>

##### ・名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

・資本の額 10,000百万円(平成29年3月末現在)

・事業の内容

銀行業および信託業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 信金中央金庫(販売会社)

委託会社の指定する登録金融機関として、当該受益権の募集の取扱い、償還金等の支払を行います。

#### (2) しんきん証券株式会社(販売会社)

委託会社の指定する金融商品取引業者として、当該受益権の募集の取扱い、償還金等の支払を行います。

#### (3) 三菱UFJ信託銀行株式会社(受託会社)

投資信託財産の保管・管理業務を行い、分配金、解約金および償還金の委託会社への交付等を行います。

### 3【資本関係】

信金中央金庫は、委託会社の発行済株式総数4,000株を全て保有します。



### 第3【参考情報】

当計算期間において、提出されたファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

- |                   |                         |
|-------------------|-------------------------|
| (1) 有価証券届出書       | 平成28年9月30日<br>関東財務局長に提出 |
| (2) 有価証券報告書       | 平成28年9月30日<br>関東財務局長に提出 |
| (3) 半期報告書         | 平成29年4月7日<br>関東財務局長に提出  |
| (4) 有価証券届出書の訂正届出書 | 平成29年4月7日<br>関東財務局長に提出  |

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月9日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 南波 秀哉 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩崎 裕男 印

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」に掲げられているしんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第27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。

#### 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。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 監査意見

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、しんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成29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。

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年8月16日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御 中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂 印  
業務執行社員

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」に掲げられているしんきんトピックスオープンの平成28年7月20日から平成29年7月18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。

#### 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。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 監査意見

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、しんきんトピックスオープンの平成29年7月18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。

#### 利害関係

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

以上

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