

**【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】	2020年10月9日
【計算期間】	第20期（自 2019年7月19日 至 2020年7月20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】	米山 亮
【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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt; 商品分類の定義 &gt;

「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

## &lt; 属性区分の定義 &gt;

「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="https://www.toushin.or.jp">https://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。

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

- 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。

※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。

## ■ 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 2,200 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)

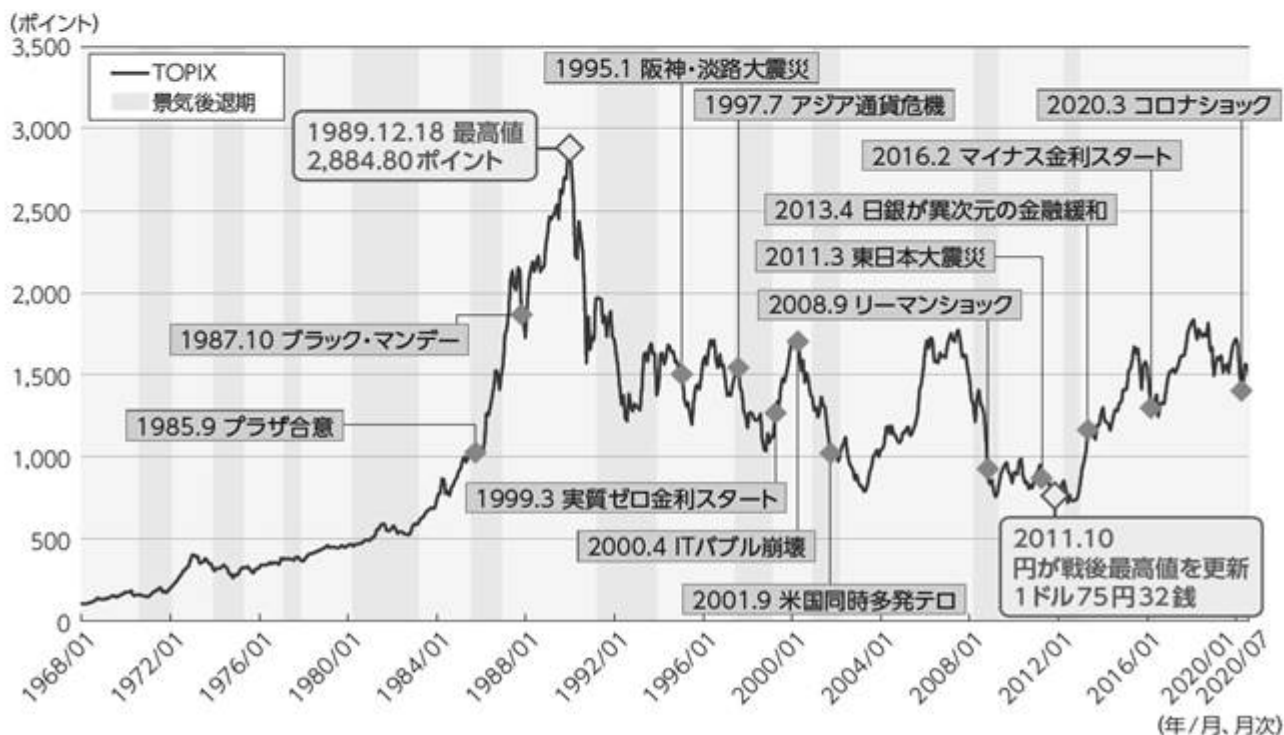
出所：(株)東京証券取引所、(株)日本経済新聞社等の資料によりしんきんアセットマネジメント投信(株)作成

※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。



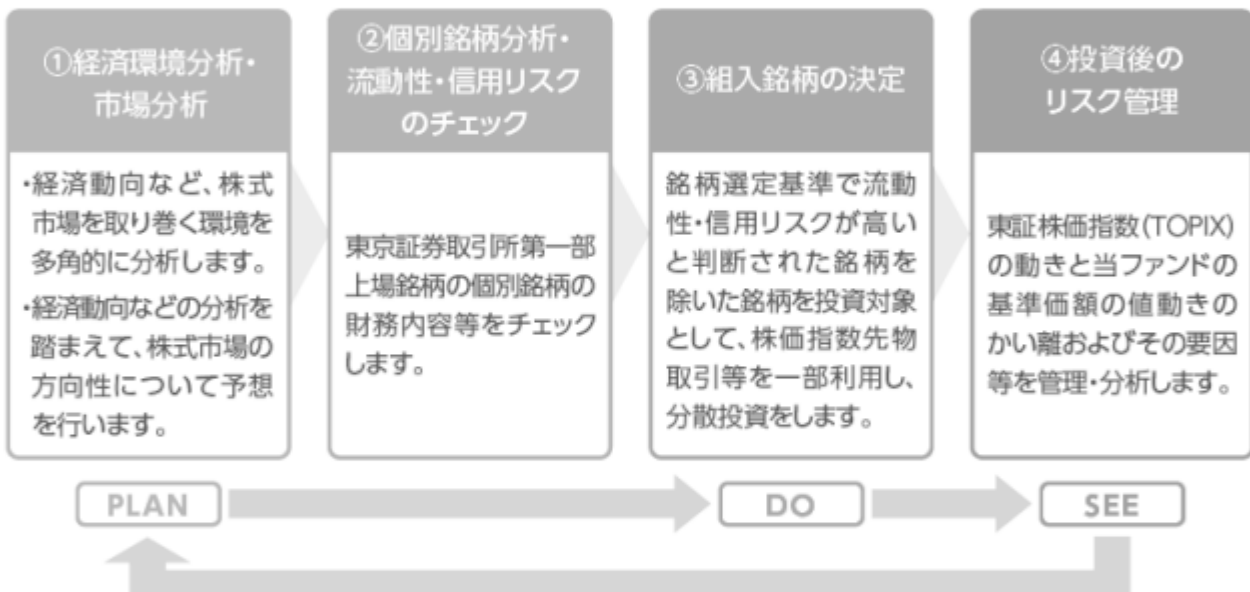
出所：内閣府ホームページ他より、しんきんアセットマネジメント投信(株)作成

※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。

下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。

### 収益分配金のお支払いのイメージ



※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。

## ■ 収益分配金に関する留意事項

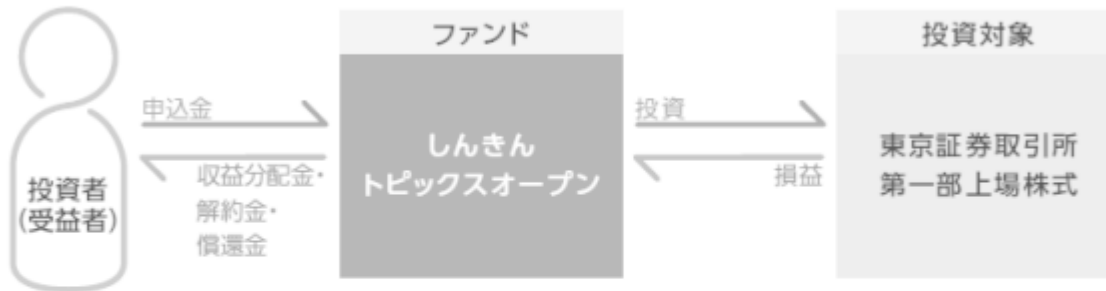
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

## ■ ファンドの仕組み



※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。

## ■ 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

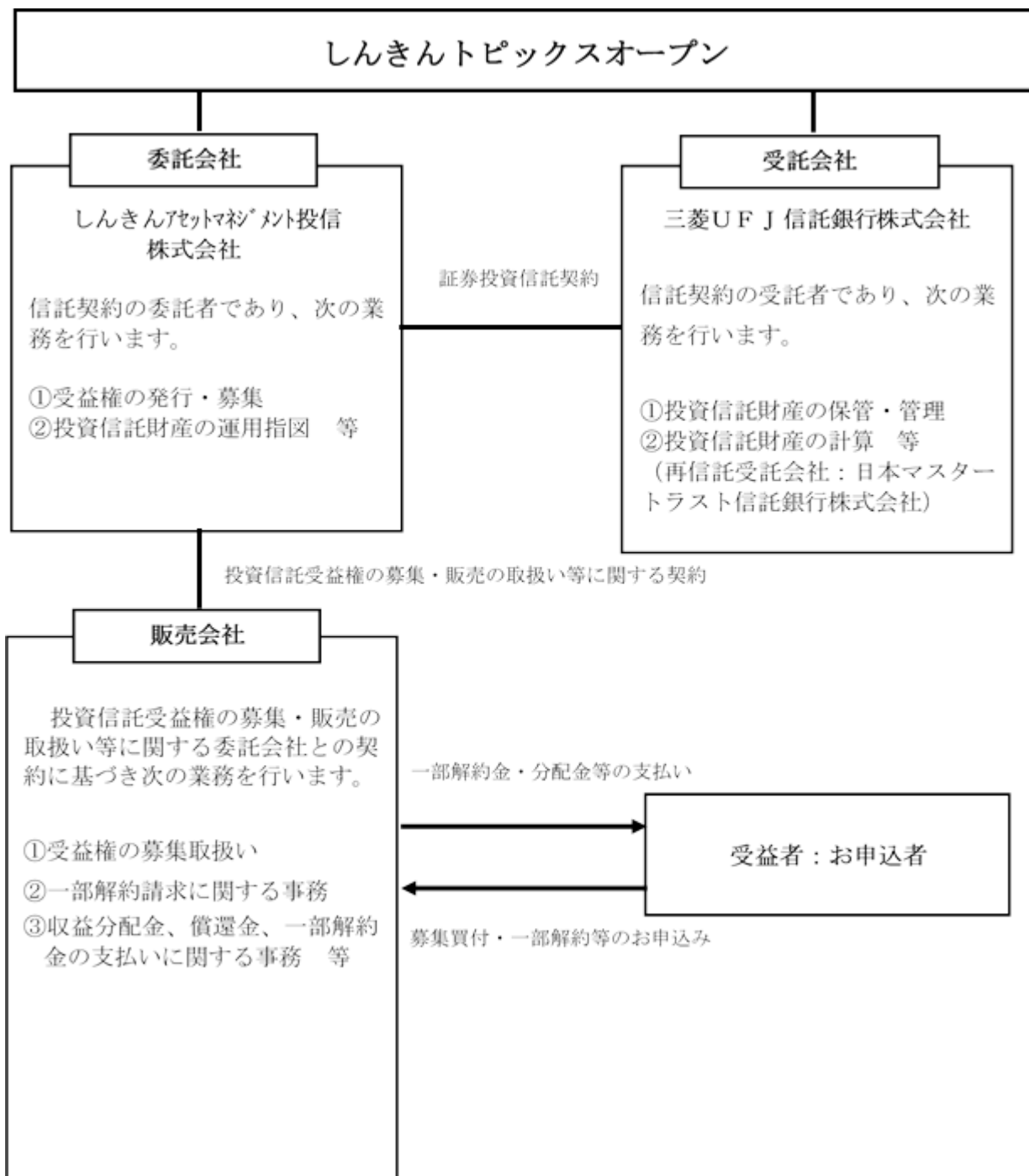
- ・3,000億円を限度額として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

### (2)【ファンドの沿革】

2000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

1990年12月	全信連投資顧問株式会社として設立
1991年 3月	投資顧問業の登録
1992年 3月	投資一任契約に係る業務の認可
1998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
1998年12月	証券投資信託委託業の認可
2007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
2017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

主としてわ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、主としてわ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、1)の証券または証書、12)ならびに16)の証券または証書のうち1)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、2)から6)までの証券ならびに12)および16)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

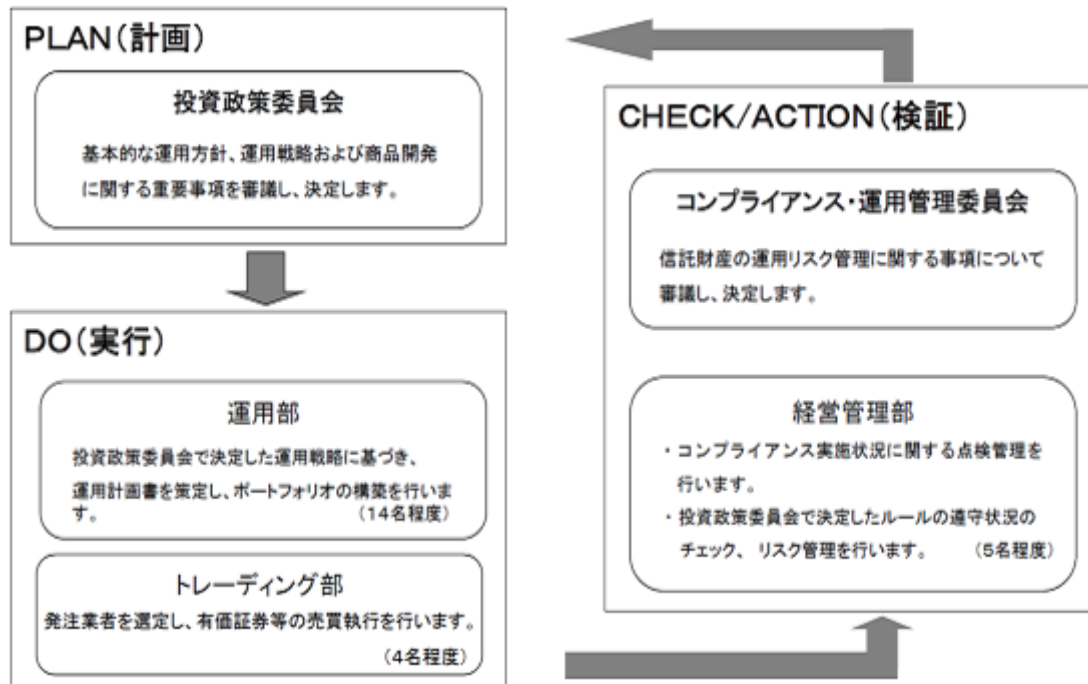
委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変化等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を上記の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (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。



#### 投資決定プロセス

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の投資信託約款（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書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(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。

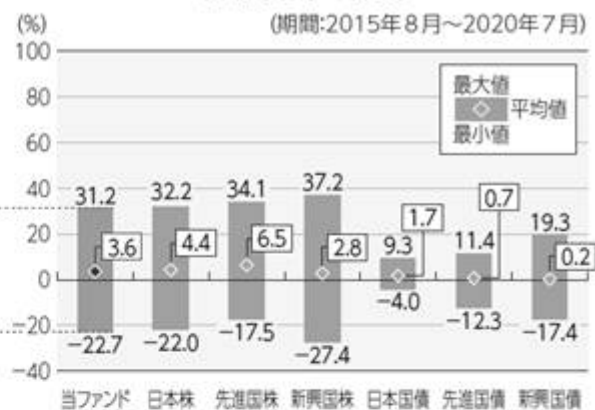
投資リスクに対する管理体制等は、今後変更となる場合があります。

## 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、2015年8月から2020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	権利の帰属先
日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	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。	東京証券取引所
先進国株	MSCI-KOKUSAI インデックス (配当込み、円ベース)	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。	MSCI Inc.
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 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。	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村証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。	野村証券株式会社
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット・ グローバル・ディバースファイド (円ベース)	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。	J.P. Morgan Securities LLC

(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。

※権利の帰属先は、当該指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利を有します。

※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0.3%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】

純資産総額に対して、年率0.88%（税抜0.80%）

1万口あたりの信託報酬：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。

運用管理費用  
(信託報酬)

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

(注)「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。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。

## (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会社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0.0088%（税抜0.008%）を乗じて計算し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。

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】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

## 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ついては販売会社ごとに、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）」（受益者ごと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。益金不算入制度の適用はありません。
-----------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

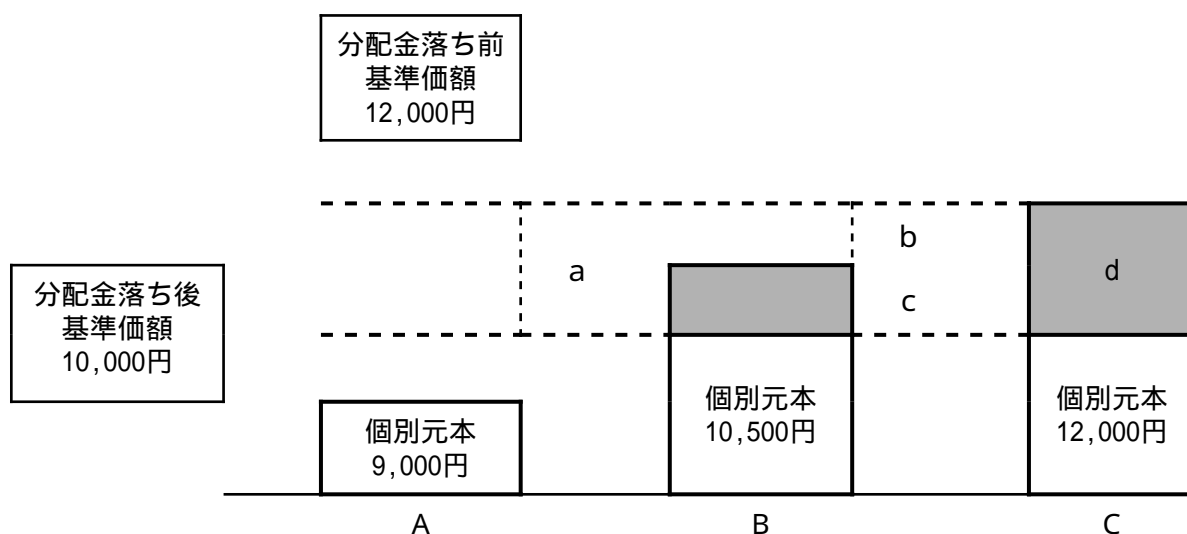
確定拠出年金コースの場合、確定拠出年金制度に係る税制が適用されます。

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2020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	2,611,551,280	94.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		158,061,464	5.71
合計(純資産総額)		2,769,612,744	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	149,650,000	5.40

(注)先物取引は、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。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 評価額上位銘柄(国内株式)

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	13,900	6,790.52	94,388,300	6,217.00	86,416,300	3.12
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	9,700	6,272.00	60,838,400	6,595.00	63,971,500	2.31
3	日本	株式	ソニー	電気機器	7,800	8,247.15	64,327,800	8,076.00	62,992,800	2.27
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,100	44,610.00	49,071,000	44,220.00	48,642,000	1.76
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	16,300	2,567.89	41,856,700	2,443.50	39,829,050	1.44
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	10,300	3,788.00	39,016,400	3,756.00	38,686,800	1.40
7	日本	株式	任天堂	その他製品	800	47,020.00	37,616,000	46,440.00	37,152,000	1.34
8	日本	株式	第一三共	医薬品	3,600	8,354.00	30,074,400	9,258.00	33,328,800	1.20
9	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	83,300	423.50	35,277,550	393.20	32,753,560	1.18
10	日本	株式	ダイキン工業	機械	1,600	19,660.00	31,456,000	18,450.00	29,520,000	1.07
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	8,800	3,347.00	29,453,600	3,259.00	28,679,200	1.04
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	8,500	3,539.00	30,081,500	3,268.00	27,778,000	1.00
13	日本	株式	HOYA	精密機器	2,500	10,700.00	26,750,000	10,420.00	26,050,000	0.94
14	日本	株式	信越化学工業	化学	2,100	12,925.00	27,142,500	12,275.00	25,777,500	0.93
15	日本	株式	日本電産	電気機器	3,000	7,640.00	22,920,000	8,375.00	25,125,000	0.91
16	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	8,600	2,993.50	25,744,100	2,907.50	25,004,500	0.90
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,800	2,792.40	27,365,600	2,524.00	24,735,200	0.89
18	日本	株式	村田製作所	電気機器	3,700	6,581.78	24,352,600	6,609.00	24,453,300	0.88
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	8,400	3,066.00	25,754,400	2,800.00	23,520,000	0.85
20	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	800	29,120.00	23,296,000	28,800.00	23,040,000	0.83
21	日本	株式	花王	化学	3,000	8,545.00	25,635,000	7,636.00	22,908,000	0.83
22	日本	株式	S M C	機械	400	56,900.00	22,760,000	55,070.00	22,028,000	0.80

23	日本	株式	ファナック	電気機器	1,200	20,705.00	24,846,000	17,705.00	21,246,000	0.77
24	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	164,900	137.30	22,640,770	127.60	21,041,240	0.76
25	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,400	4,723.00	20,781,200	4,436.00	19,518,400	0.70
26	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	8,400	2,444.50	20,533,800	2,300.00	19,320,000	0.70
27	日本	株式	中外製薬	医薬品	3,900	5,180.00	20,202,000	4,736.00	18,470,400	0.67
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	5,900	3,500.00	20,650,000	3,128.00	18,455,200	0.67
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	10,800	1,728.50	18,667,800	1,650.00	17,820,000	0.64
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	12,500	1,402.00	17,525,000	1,370.50	17,131,250	0.62

## 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	94.29
合計	94.29

## 業種別投資比率

業種	投資比率(%)
水産・農林業	0.10
鉱業	0.17
建設業	2.30
食料品	3.65
繊維製品	0.47
パルプ・紙	0.19
化学	6.79
医薬品	6.53
石油・石炭製品	0.38
ゴム製品	0.54
ガラス・土石製品	0.73
鉄鋼	0.51
非鉄金属	0.67
金属製品	0.50
機械	5.11
電気機器	14.95
輸送用機器	6.63
精密機器	2.52
その他製品	2.47
電気・ガス業	1.37
陸運業	3.32
海運業	0.13
空運業	0.29
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	10.03
卸売業	4.15
小売業	4.88



銀行業	4.50
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	1.77
その他金融業	0.99
不動産業	1.82
サービス業	4.90
合計(対純資産総額比)	94.29

## 【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	10	157,250,000	149,650,000	5.40

(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】

2020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11計算期間末 (2011年 7月19日)	5,008,191,166	5,077,797,971	5,756	5,836
第12計算期間末 (2012年 7月18日)	4,663,217,848	4,663,217,848	5,063	5,063
第13計算期間末 (2013年 7月18日)	4,138,064,359	4,192,502,870	8,361	8,471
第14計算期間末 (2014年 7月18日)	3,987,504,288	4,043,033,748	8,617	8,737
第15計算期間末 (2015年 7月21日)	4,272,409,598	4,328,690,075	11,387	11,537
第16計算期間末 (2016年 7月19日)	3,758,842,419	3,758,842,419	9,169	9,169
第17計算期間末 (2017年 7月18日)	3,707,152,626	3,773,841,066	11,118	11,318
第18計算期間末 (2018年 7月18日)	3,636,481,239	3,697,257,187	11,967	12,167
第19計算期間末 (2019年 7月18日)	3,076,494,975	3,076,494,975	10,658	10,658
第20計算期間末 (2020年 7月20日)	2,867,772,096	2,922,802,293	10,944	11,154
2019年 7月末日	3,136,322,328		10,868	
8月末日	2,905,768,670		10,497	
9月末日	3,076,917,827		11,122	
10月末日	3,177,012,587		11,672	
11月末日	3,206,762,953		11,889	
12月末日	3,215,959,432		12,058	
2020年 1月末日	3,150,021,983		11,793	
2月末日	2,815,839,343		10,577	

3月末日	2,648,849,416		9,946	
4月末日	2,768,976,015		10,365	
5月末日	2,893,879,450		11,060	
6月末日	2,886,028,672		11,029	
7月末日	2,769,612,744		10,385	

（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11期	2010年 7月21日～2011年 7月19日	80
第12期	2011年 7月20日～2012年 7月18日	0
第13期	2012年 7月19日～2013年 7月18日	110
第14期	2013年 7月19日～2014年 7月18日	120
第15期	2014年 7月19日～2015年 7月21日	150
第16期	2015年 7月22日～2016年 7月19日	0
第17期	2016年 7月20日～2017年 7月18日	200
第18期	2017年 7月19日～2018年 7月18日	200
第19期	2018年 7月19日～2019年 7月18日	0
第20期	2019年 7月19日～2020年 7月20日	210

#### 【収益率の推移】

計算期間		収益率（％）
第11期	2010年 7月21日～2011年 7月19日	3.86
第12期	2011年 7月20日～2012年 7月18日	12.04
第13期	2012年 7月19日～2013年 7月18日	67.31
第14期	2013年 7月19日～2014年 7月18日	4.50
第15期	2014年 7月19日～2015年 7月21日	33.89
第16期	2015年 7月22日～2016年 7月19日	19.48
第17期	2016年 7月20日～2017年 7月18日	23.44
第18期	2017年 7月19日～2018年 7月18日	9.44
第19期	2018年 7月19日～2019年 7月18日	10.94
第20期	2019年 7月19日～2020年 7月20日	4.65

（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。

## (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11期	2010年 7月21日 ~ 2011年 7月19日	1,164,598,918	987,182,949
第12期	2011年 7月20日 ~ 2012年 7月18日	2,912,758,463	2,402,765,118
第13期	2012年 7月19日 ~ 2013年 7月18日	1,431,778,317	5,693,666,777
第14期	2013年 7月19日 ~ 2014年 7月18日	1,456,536,543	1,778,037,082
第15期	2014年 7月19日 ~ 2015年 7月21日	1,395,267,463	2,270,690,649
第16期	2015年 7月22日 ~ 2016年 7月19日	779,358,774	432,010,424
第17期	2016年 7月20日 ~ 2017年 7月18日	988,793,248	1,753,751,402
第18期	2017年 7月19日 ~ 2018年 7月18日	476,631,391	772,256,010
第19期	2018年 7月19日 ~ 2019年 7月18日	773,375,801	925,480,066
第20期	2019年 7月19日 ~ 2020年 7月20日	303,035,483	569,243,039

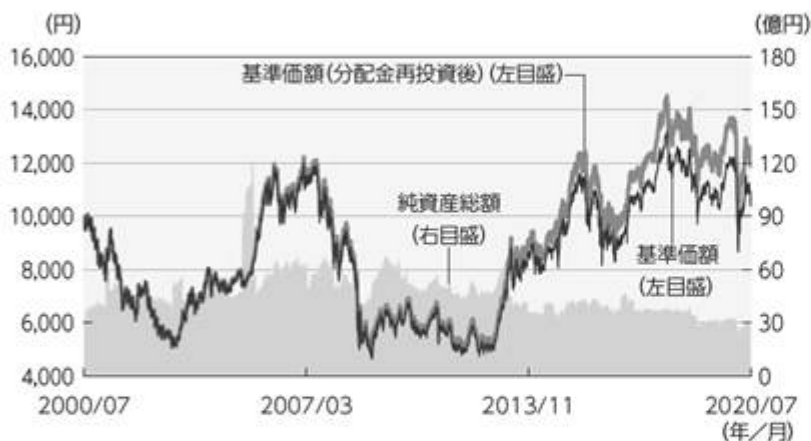
## (参考情報) 運用実績

データは2020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	10,385円
純資産総額	2,770百万円

#### ■ 分配の推移 (税引前)

決算期	分配金
2020年 7月	210円
2019年 7月	0円
2018年 7月	200円
2017年 7月	200円
2016年 7月	0円
設定来累計	1,320円

※基準価額および分配金は1万口当たりです。

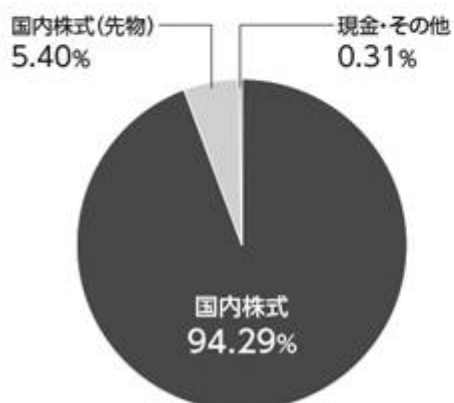
※基準価額 (分配金再投資後) は決算日の翌営業日に分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

### 主要な資産の状況

組入上位10銘柄			
	銘柄名	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.12%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.31%
3	ソニー	電気機器	2.27%
4	キーエンス	電気機器	1.76%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.44%
6	武田薬品工業	医薬品	1.40%
7	任天堂	その他製品	1.34%
8	第一三共	医薬品	1.20%
9	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.18%
10	ダイキン工業	機械	1.07%

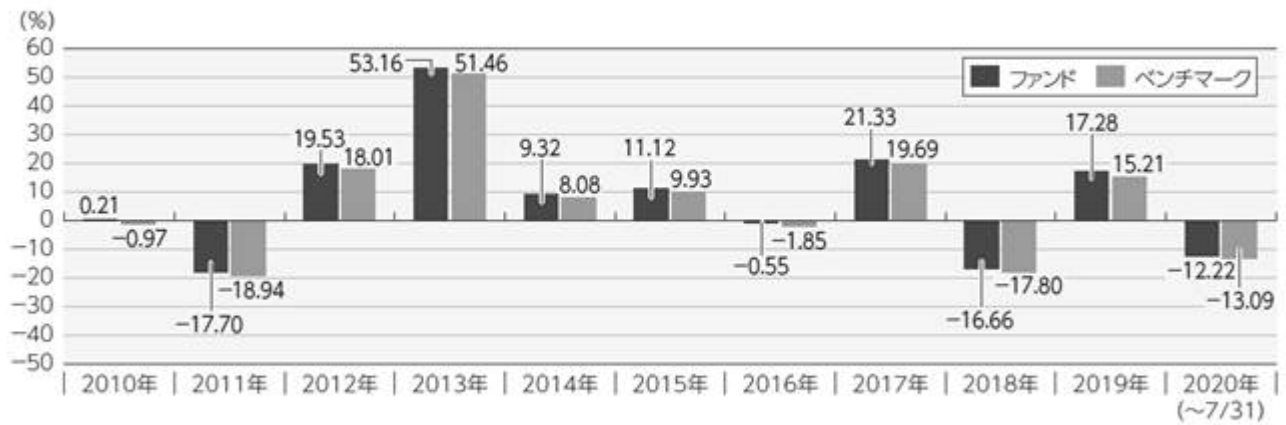
組入株式上位10業種		
	業種	投資比率
1	電気機器	14.95%
2	情報・通信業	10.03%
3	化学	6.79%
4	輸送用機器	6.63%
5	医薬品	6.53%
6	機械	5.11%
7	サービス業	4.90%
8	小売業	4.88%
9	銀行業	4.50%
10	卸売業	4.15%

#### ■ 資産種類別投資比率



※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:2010年～2020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ます。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（受付時間：営業日の9:00～17:00）  
< ホームページ > <https://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」の「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、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、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い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、基準日に保有している投資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(2019年7月19日から2020年7月20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 (2019年7月18日現在)	当期 (2020年7月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	13,803,184
コール・ローン	110,285,238	157,810,543
株式	2,974,886,060	2,754,585,290
未収配当金	4,571,394	4,350,023
前払金	-	2,970,000
差入委託証拠金	2,700,000	5,550,000
流動資産合計	3,092,442,692	2,939,069,040
資産合計	3,092,442,692	2,939,069,040
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,220,000	3,076,600
前受金	610,000	-
未払収益分配金	-	55,030,197
未払解約金	962,884	486,159
未払受託者報酬	1,630,416	1,574,197
未払委託者報酬	11,412,857	11,019,347
未払利息	274	373
その他未払費用	111,286	110,071
流動負債合計	15,947,717	71,296,944
負債合計	15,947,717	71,296,944
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1, 2 2,886,693,160	1, 2 2,620,485,604
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	189,801,815	247,286,492
(分配準備積立金)	681,288,482	554,787,628
元本等合計	3,076,494,975	2,867,772,096
純資産合計	3,076,494,975	2,867,772,096
負債純資産合計	3,092,442,692	2,939,069,040

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	前期 ( 自 2018年 7月19日 至 2019年 7月18日 )	当期 ( 自 2019年 7月19日 至 2020年 7月20日 )
<b>営業収益</b>		
受取配当金	76,189,108	71,601,943
有価証券売買等損益	460,770,470	74,717,717
派生商品取引等損益	23,919,600	20,339,880
その他収益	56,829	28,998
営業収益合計	408,444,133	166,688,538
<b>営業費用</b>		
支払利息	82,239	76,603
受託者報酬	3,512,513	3,282,826
委託者報酬	24,587,436	22,979,675
その他費用	251,001	239,634
営業費用合計	28,433,189	26,578,738
営業利益又は営業損失 ( )	436,877,322	140,109,800
経常利益又は経常損失 ( )	436,877,322	140,109,800
当期純利益又は当期純損失 ( )	436,877,322	140,109,800
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 ( )	109,866,090	12,240,790
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	597,683,814	189,801,815
剰余金増加額又は欠損金減少額	94,714,566	20,847,072
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	94,714,566	20,847,072
剰余金減少額又は欠損金増加額	175,585,333	36,201,208
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	175,585,333	36,201,208
分配金	1 -	1 55,030,197
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	189,801,815	247,286,492

## (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	計算期間の取扱い 当計算期間は、当期末が休日のため、2019年7月19日から2020年7月20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 (2019年7月18日現在)	当期 (2020年7月20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 3,038,797,425円 期中追加設定元本額 773,375,801円 期中一部解約元本額 925,480,066円	期首元本額 2,886,693,160円 期中追加設定元本額 303,035,483円 期中一部解約元本額 569,243,039円
2 計算期間末日における受益権の総数	2,886,693,160口	2,620,485,604口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 (自2018年7月19日 至2019年7月18日)		当期 (自2019年7月19日 至2020年7月20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	41,451,464円	A 費用控除後の配当等収益額	55,852,055円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	1,566,806,349円	C 収益調整金額	1,490,898,622円
D 分配準備積立金額	639,837,018円	D 分配準備積立金額	553,965,770円
E 当ファンドの分配対象収益額	2,248,094,831円	E 当ファンドの分配対象収益額	2,100,716,447円
F 当ファンドの期末残存口数	2,886,693,160口	F 当ファンドの期末残存口数	2,620,485,604口
G 10,000口当たり収益分配対象額	7,787円	G 10,000口当たり収益分配対象額	8,016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	210円
I 収益分配金金額	0円	I 収益分配金金額	55,030,197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 2018年 7月19日 至 2019年 7月18日)	当期 (自 2019年 7月19日 至 2020年 7月20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。デリバティブ取引には、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。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 (2019年 7月18日現在)	当期 (2020年 7月20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ん。	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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	前期 （2019年7月18日現在）	当期 （2020年7月20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	389,938,440円	70,361,158円
合計	389,938,440円	70,361,158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 (2019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	93,170,000		91,950,000	1,220,000
合計		93,170,000		91,950,000	1,220,000

(単位:円)

区分	種類	当期 (2020年7月20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	160,320,000		157,250,000	3,070,000
合計		160,320,000		157,250,000	3,070,000

(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 2018年7月19日 至 2019年7月18日)	当期 (自 2019年7月19日 至 2020年7月20日)
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

前期 (2019年7月18日現在)	当期 (2020年7月20日現在)
1口当たり純資産額 1.0658円 (1万口当たり純資産額 10,658円)	1口当たり純資産額 1.0944円 (1万口当たり純資産額 10,944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	2,766.00	276,600	
日本水産	1,700	474.00	805,800	
マルハニチロ	300	2,159.00	647,700	
サカタのタネ	200	3,230.00	646,000	
ホクト	200	2,086.00	417,200	
三井松島ホールディングス	100	789.00	78,900	
国際石油開発帝石	6,800	650.00	4,420,000	
石油資源開発	300	1,833.00	549,900	
K & Oエナジーグループ	100	1,484.00	148,400	
ショーボンドホールディングス	200	4,775.00	955,000	
ミライト・ホールディングス	500	1,600.00	800,000	
タマホーム	100	1,188.00	118,800	
TATERU	200	169.00	33,800	
スペースバリューホールディングス	300	364.00	109,200	
ダイセキ環境ソリューション	100	735.00	73,500	
安藤・間	1,000	614.00	614,000	
東急建設	500	546.00	273,000	
コムシスホールディングス	600	3,225.00	1,935,000	
高松コンストラクショングループ	100	2,338.00	233,800	
東建コーポレーション	100	7,150.00	715,000	
大成建設	1,300	3,875.00	5,037,500	
大林組	3,800	1,007.00	3,826,600	
清水建設	3,700	850.00	3,145,000	
飛島建設	100	1,092.00	109,200	
長谷工コーポレーション	1,500	1,343.00	2,014,500	
松井建設	200	671.00	134,200	
鹿島建設	2,900	1,272.00	3,688,800	
不動テトラ	100	1,451.00	145,100	
鉄建建設	100	2,016.00	201,600	
西松建設	300	2,134.00	640,200	
三井住友建設	900	468.00	421,200	
大豊建設	100	2,458.00	245,800	
前田建設工業	1,000	798.00	798,000	
奥村組	200	2,571.00	514,200	
東鉄工業	100	2,750.00	275,000	
浅沼組	100	4,235.00	423,500	
戸田建設	1,600	729.00	1,166,400	
熊谷組	200	2,599.00	519,800	

矢作建設工業	300	820.00	246,000	
ピーエス三菱	300	516.00	154,800	
日本ハウスホールディングス	400	270.00	108,000	
大東建託	400	10,190.00	4,076,000	
新日本建設	200	856.00	171,200	
N I P P O	400	2,821.00	1,128,400	
前田道路	400	2,028.00	811,200	
東亜建設工業	200	1,572.00	314,400	
若築建設	100	1,260.00	126,000	
東洋建設	700	395.00	276,500	
五洋建設	1,700	590.00	1,003,000	
世紀東急工業	300	758.00	227,400	
福田組	100	4,940.00	494,000	
住友林業	1,000	1,350.00	1,350,000	
巴コーポレーション	400	335.00	134,000	
大和ハウス工業	3,900	2,603.50	10,153,650	
ライト工業	300	1,523.00	456,900	
積水ハウス	4,200	2,107.50	8,851,500	
日特建設	300	772.00	231,600	
ユアテック	200	660.00	132,000	
中電工	100	2,263.00	226,300	
関電工	600	913.00	547,800	
きんでん	700	1,759.00	1,231,300	
東京エネシス	100	767.00	76,700	
住友電設	100	2,455.00	245,500	
日本電設工業	300	2,361.00	708,300	
協和エクシオ	600	2,657.00	1,594,200	
新日本空調	100	2,469.00	246,900	
九電工	300	3,215.00	964,500	
三機工業	300	1,248.00	374,400	
日揮ホールディングス	1,200	1,155.00	1,386,000	
太平電業	100	2,229.00	222,900	
高砂熱学工業	300	1,546.00	463,800	
明星工業	300	836.00	250,800	
大気社	200	3,185.00	637,000	
ダイダン	100	2,807.00	280,700	
日比谷総合設備	100	1,878.00	187,800	
OSJBホールディングス	500	233.00	116,500	
東洋エンジニアリング	200	346.00	69,200	
レイズネクスト	300	1,239.00	371,700	
日清製粉グループ本社	1,400	1,593.00	2,230,200	
昭和産業	100	3,330.00	333,000	
鳥越製粉	100	911.00	91,100	

中部飼料	200	1,618.00	323,600
フィード・ワン	1,000	198.00	198,000
日本甜菜製糖	100	1,794.00	179,400
三井製糖	100	1,974.00	197,400
日新製糖	100	1,823.00	182,300
森永製菓	300	4,005.00	1,201,500
江崎グリコ	400	5,110.00	2,044,000
名糖産業	100	1,380.00	138,000
不二家	100	2,254.00	225,400
山崎製パン	1,000	1,810.00	1,810,000
亀田製菓	100	5,380.00	538,000
寿スピリッツ	100	4,100.00	410,000
カルビー	600	3,065.00	1,839,000
森永乳業	300	4,870.00	1,461,000
六甲バター	100	1,522.00	152,200
ヤクルト本社	900	6,370.00	5,733,000
明治ホールディングス	800	8,520.00	6,816,000
雪印メグミルク	300	2,518.00	755,400
プリマハム	200	2,807.00	561,400
日本ハム	500	4,350.00	2,175,000
丸大食品	200	1,915.00	383,000
S Foods	100	2,573.00	257,300
伊藤ハム米久ホールディングス	700	647.00	452,900
サッポロホールディングス	400	1,958.00	783,200
アサヒグループホールディングス	2,600	3,680.00	9,568,000
キリンホールディングス	5,200	2,140.00	11,128,000
宝ホールディングス	1,000	955.00	955,000
オエノンホールディングス	600	417.00	250,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	900	1,871.00	1,683,900
サントリー食品インターナショナル	800	4,345.00	3,476,000
ダイトーグループホールディングス	100	4,825.00	482,500
伊藤園	400	6,230.00	2,492,000
キーコーヒー	100	2,158.00	215,800
日清オイリオグループ	200	3,385.00	677,000
不二製油グループ本社	300	2,912.00	873,600
J - オイルミルズ	100	4,050.00	405,000
キッコーマン	800	4,890.00	3,912,000
味の素	2,800	1,731.00	4,846,800
キュービー	700	1,918.00	1,342,600
ハウス食品グループ本社	500	3,370.00	1,685,000
カゴメ	500	3,165.00	1,582,500
アリアケジャパン	100	6,590.00	659,000
ニチレイ	600	2,975.00	1,785,000

東洋水産	700	6,330.00	4,431,000	
日清食品ホールディングス	500	9,520.00	4,760,000	
一正蒲鉾	100	984.00	98,400	
フジッコ	200	2,056.00	411,200	
ロック・フィールド	200	1,284.00	256,800	
日本たばこ産業	7,300	1,933.50	14,114,550	
ケンコーマヨネーズ	100	1,891.00	189,100	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,566.00	156,600	
なとり	100	1,797.00	179,700	
北の達人コーポレーション	400	545.00	218,000	
ユーグレナ	600	750.00	450,000	
理研ビタミン	200	2,302.00	460,400	
片倉工業	200	1,090.00	218,000	
ゲンゼ	100	4,120.00	412,000	
東洋紡	500	1,529.00	764,500	
富士紡ホールディングス	100	3,110.00	311,000	
倉敷紡績	100	2,151.00	215,100	
シキボウ	200	1,043.00	208,600	
日本毛織	400	967.00	386,800	
帝国繊維	200	2,473.00	494,600	
帝人	1,000	1,712.00	1,712,000	
東レ	8,700	506.90	4,410,030	
サカイオーベックス	100	2,216.00	221,600	
住江織物	100	2,073.00	207,300	
アツギ	200	597.00	119,400	
セーレン	300	1,360.00	408,000	
ソトー	100	959.00	95,900	
小松マテーレ	200	731.00	146,200	
ワコールホールディングス	300	1,977.00	593,100	
ホギメディカル	200	3,240.00	648,000	
T S Iホールディングス	300	346.00	103,800	
ワールド	200	1,433.00	286,600	
三陽商会	100	611.00	61,100	
オンワードホールディングス	700	311.00	217,700	
ゴールドウイン	200	6,620.00	1,324,000	
デサント	300	1,827.00	548,100	
特種東海製紙	100	4,705.00	470,500	
王子ホールディングス	4,900	487.00	2,386,300	
日本製紙	300	1,472.00	441,600	
北越コーポレーション	800	380.00	304,000	
大王製紙	400	1,448.00	579,200	
レンゴー	1,200	834.00	1,000,800	
トーモク	100	1,821.00	182,100	

ザ・パックス	100	2,890.00	289,000	
クラレ	1,900	1,129.00	2,145,100	
旭化成	8,000	847.00	6,776,000	
昭和電工	800	2,414.00	1,931,200	
住友化学	8,700	339.00	2,949,300	
住友精化	100	3,515.00	351,500	
日産化学	700	5,540.00	3,878,000	
クレハ	100	4,620.00	462,000	
テイカ	100	1,402.00	140,200	
石原産業	200	718.00	143,600	
日本曹達	200	2,850.00	570,000	
東ソー	1,900	1,480.00	2,812,000	
トクヤマ	400	2,582.00	1,032,800	
セントラル硝子	300	2,041.00	612,300	
東亜合成	800	1,085.00	868,000	
大阪ソーダ	100	2,405.00	240,500	
関東電化工業	300	852.00	255,600	
デンカ	500	2,709.00	1,354,500	
信越化学工業	2,100	12,925.00	27,142,500	
日本カーバイド工業	100	1,189.00	118,900	
堺化学工業	100	2,121.00	212,100	
第一稀元素化学工業	100	752.00	75,200	
エア・ウォーター	1,000	1,477.00	1,477,000	
大陽日酸	1,000	1,843.00	1,843,000	
日本化学工業	100	2,216.00	221,600	
日本パーカライジング	600	1,132.00	679,200	
高圧ガス工業	100	799.00	79,900	
四国化成工業	200	1,124.00	224,800	
ステラ ケミファ	100	2,587.00	258,700	
日本触媒	200	5,600.00	1,120,000	
大日精化工業	100	2,416.00	241,600	
カネカ	300	2,708.00	812,400	
三菱瓦斯化学	1,200	1,643.00	1,971,600	
三井化学	1,100	2,260.00	2,486,000	
J S R	1,200	2,188.00	2,625,600	
東京応化工業	200	5,760.00	1,152,000	
大阪有機化学工業	100	2,881.00	288,100	
三菱ケミカルホールディングス	8,100	640.00	5,184,000	
K H ネオケム	200	2,155.00	431,000	
ダイセル	1,500	804.00	1,206,000	
住友ベークライト	200	2,964.00	592,800	
積水化学工業	2,500	1,561.00	3,902,500	
日本ゼオン	1,100	1,011.00	1,112,100	

アイカ工業	400	3,630.00	1,452,000
宇部興産	600	1,829.00	1,097,400
積水樹脂	200	2,276.00	455,200
タキロンシーアイ	300	713.00	213,900
旭有機材	100	1,427.00	142,700
リケンテクノス	400	416.00	166,400
積水化成成品工業	200	570.00	114,000
ミライアル	100	1,117.00	111,700
ダイキョーニシカワ	300	501.00	150,300
日本化薬	800	1,087.00	869,600
カーリットホールディングス	200	504.00	100,800
日本精化	100	1,416.00	141,600
扶桑化学工業	100	4,145.00	414,500
A D E K A	500	1,485.00	742,500
日油	400	3,900.00	1,560,000
ハリマ化成グループ	200	1,022.00	204,400
花王	3,000	8,545.00	25,635,000
三洋化成工業	100	4,750.00	475,000
大日本塗料	200	947.00	189,400
日本ペイントホールディングス	1,000	7,410.00	7,410,000
関西ペイント	1,400	2,151.00	3,011,400
中国塗料	400	868.00	347,200
日本特殊塗料	100	1,033.00	103,300
藤倉化成	400	539.00	215,600
太陽ホールディングス	100	5,120.00	512,000
D I C	500	2,732.00	1,366,000
サカイクス	300	1,068.00	320,400
東洋インキS Cホールディングス	200	2,094.00	418,800
T & K T O K A	100	820.00	82,000
富士フイルムホールディングス	2,300	4,768.00	10,966,400
資生堂	2,500	6,665.00	16,662,500
ライオン	1,700	2,782.00	4,729,400
高砂香料工業	100	2,157.00	215,700
マンダム	300	1,875.00	562,500
ミルボン	200	4,995.00	999,000
ファンケル	600	3,160.00	1,896,000
コーセー	200	12,230.00	2,446,000
コタ	100	1,202.00	120,200
ポーラ・オルビスホールディングス	500	1,775.00	887,500
ノエビアホールディングス	100	4,570.00	457,000
エステー	100	1,779.00	177,900
アグロ カネショウ	100	1,384.00	138,400
コニシ	300	1,493.00	447,900



長谷川香料	200	2,299.00	459,800
星光PMC	100	719.00	71,900
小林製薬	400	9,130.00	3,652,000
荒川化学工業	200	1,250.00	250,000
メック	100	2,064.00	206,400
タカラバイオ	400	2,980.00	1,192,000
JCU	200	3,255.00	651,000
デクセリアルズ	400	844.00	337,600
アース製薬	100	7,260.00	726,000
クミアイ化学工業	600	1,026.00	615,600
日本農薬	500	526.00	263,000
アキレス	100	1,926.00	192,600
有沢製作所	300	814.00	244,200
日東電工	900	6,230.00	5,607,000
レック	200	1,529.00	305,800
きもと	300	174.00	52,200
藤森工業	100	3,625.00	362,500
前澤化成工業	100	1,002.00	100,200
JSP	100	1,513.00	151,300
エフピコ	100	8,540.00	854,000
天馬	100	1,672.00	167,200
信越ポリマー	300	1,003.00	300,900
東リ	400	260.00	104,000
ニフコ	500	2,292.00	1,146,000
バルカー	100	1,915.00	191,500
ユニ・チャーム	2,400	4,734.00	11,361,600
協和キリン	1,300	2,676.00	3,478,800
武田薬品工業	10,300	3,788.00	39,016,400
アステラス製薬	10,800	1,728.50	18,667,800
大日本住友製薬	900	1,412.00	1,270,800
塩野義製薬	1,600	6,260.00	10,016,000
わかもと製薬	500	269.00	134,500
あすか製薬	200	1,224.00	244,800
日本新薬	300	8,290.00	2,487,000
中外製薬	3,900	5,180.00	20,202,000
科研製薬	200	5,040.00	1,008,000
エーザイ	1,500	8,550.00	12,825,000
ロート製薬	700	3,430.00	2,401,000
小野薬品工業	2,900	2,947.50	8,547,750
久光製薬	400	4,920.00	1,968,000
持田製薬	200	3,915.00	783,000
参天製薬	2,300	1,892.00	4,351,600
ツムラ	400	2,765.00	1,106,000

日医工	400	1,234.00	493,600
キッセイ薬品工業	200	2,324.00	464,800
生化学工業	300	1,060.00	318,000
栄研化学	200	1,640.00	328,000
鳥居薬品	100	3,430.00	343,000
JCRファーマ	100	10,510.00	1,051,000
東和薬品	200	2,000.00	400,000
富士製薬工業	100	1,125.00	112,500
沢井製薬	300	5,240.00	1,572,000
ゼリア新薬工業	300	1,914.00	574,200
第一三共	3,600	8,354.00	30,074,400
キョーリン製薬ホールディングス	300	2,016.00	604,800
大幸薬品	300	2,150.00	645,000
ダイト	100	3,090.00	309,000
大塚ホールディングス	2,400	4,583.00	10,999,200
大正製薬ホールディングス	300	6,420.00	1,926,000
ペプチドリーム	600	4,735.00	2,841,000
日本コークス工業	1,100	66.00	72,600
ニチレキ	100	1,612.00	161,200
ユシロ化学工業	100	1,301.00	130,100
富士石油	500	161.00	80,500
MORESCO	100	1,030.00	103,000
出光興産	1,400	2,330.00	3,262,000
ENEOSホールディングス	17,400	393.00	6,838,200
コスモエネルギーホールディングス	400	1,635.00	654,000
横浜ゴム	700	1,554.00	1,087,800
TOYO TIRE	700	1,507.00	1,054,900
ブリヂストン	3,400	3,458.00	11,757,200
住友ゴム工業	1,100	981.00	1,079,100
藤倉コンポジット	300	371.00	111,300
オカモト	100	4,185.00	418,500
フコク	100	658.00	65,800
ニッタ	100	2,448.00	244,800
住友理工	200	608.00	121,600
三ツ星ベルト	200	1,844.00	368,800
バンドー化学	300	650.00	195,000
日東紡績	200	5,080.00	1,016,000
AGC	1,200	3,225.00	3,870,000
日本板硝子	600	397.00	238,200
日本電気硝子	500	1,729.00	864,500
オハラ	100	1,062.00	106,200
住友大阪セメント	300	3,855.00	1,156,500
太平洋セメント	800	2,516.00	2,012,800

日本ヒューム	200	800.00	160,000
日本コンクリート工業	500	276.00	138,000
三谷セキサン	100	5,560.00	556,000
アジアパイルホールディングス	200	488.00	97,600
東海カーボン	1,200	993.00	1,191,600
日本カーボン	100	3,455.00	345,500
東洋炭素	100	1,752.00	175,200
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,390.00	339,000
TOTO	900	4,170.00	3,753,000
日本碍子	1,500	1,478.00	2,217,000
日本特殊陶業	1,000	1,552.00	1,552,000
フジミインコーポレーテッド	200	3,590.00	718,000
ニチアス	300	2,406.00	721,800
ニチハ	200	2,402.00	480,400
日本製鉄	5,400	1,037.00	5,599,800
神戸製鋼所	2,300	394.00	906,200
合同製鉄	100	1,859.00	185,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,300	815.00	2,689,500
東京製鉄	700	642.00	449,400
共英製鋼	200	1,325.00	265,000
大和工業	300	2,208.00	662,400
大阪製鉄	100	1,237.00	123,700
淀川製鋼所	200	1,900.00	380,000
丸一鋼管	500	2,736.00	1,368,000
大同特殊鋼	200	3,565.00	713,000
日本高周波鋼業	100	336.00	33,600
日本冶金工業	100	1,589.00	158,900
山陽特殊製鋼	100	869.00	86,900
日立金属	1,300	1,360.00	1,768,000
日本金属	100	601.00	60,100
大平洋金属	100	1,541.00	154,100
新日本電工	800	153.00	122,400
栗本鐵工所	100	1,626.00	162,600
三菱製鋼	100	618.00	61,800
日亜鋼業	500	306.00	153,000
シンニッタン	400	220.00	88,000
大紀アルミニウム工業所	100	538.00	53,800
日本軽金属ホールディングス	3,300	188.00	620,400
三井金属鉱業	400	2,348.00	939,200
東邦亜鉛	100	1,630.00	163,000
三菱マテリアル	800	2,303.00	1,842,400
住友金属鉱山	1,600	3,285.00	5,256,000
DOWAホールディングス	300	3,260.00	978,000

古河機械金属	200	1,096.00	219,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	200	938.00	187,600
東邦チタニウム	300	672.00	201,600
UACJ	200	1,928.00	385,600
古河電気工業	400	2,693.00	1,077,200
住友電気工業	4,500	1,283.50	5,775,750
フジクラ	1,500	328.00	492,000
タツタ電線	300	554.00	166,200
平河ヒューテック	100	968.00	96,800
リョービ	200	1,199.00	239,800
アーレスティ	200	353.00	70,600
アサヒホールディングス	300	2,840.00	852,000
稲葉製作所	100	1,437.00	143,700
宮地エンジニアリンググループ	100	1,680.00	168,000
トーカロ	400	1,171.00	468,400
SUMCO	1,600	1,626.00	2,601,600
東洋製罐グループホールディングス	800	1,213.00	970,400
コロナ	100	1,013.00	101,300
横河ブリッジホールディングス	300	2,090.00	627,000
三和ホールディングス	1,200	931.00	1,117,200
文化シャッター	400	737.00	294,800
三協立山	200	913.00	182,600
アルインコ	100	960.00	96,000
LIXILグループ	1,700	1,512.00	2,570,400
日本フィルコン	200	467.00	93,400
ノーリツ	300	1,342.00	402,600
長府製作所	200	2,219.00	443,800
リンナイ	200	8,890.00	1,778,000
日東精工	300	453.00	135,900
岡部	300	823.00	246,900
ジーテクト	200	980.00	196,000
東プレ	300	1,170.00	351,000
高周波熱錬	300	518.00	155,400
東京製綱	100	578.00	57,800
パイオラックス	200	1,669.00	333,800
エイチワン	100	559.00	55,900
日本発條	1,200	686.00	823,200
三益半導体工業	100	2,425.00	242,500
日本製鋼所	400	1,619.00	647,600
三浦工業	500	4,260.00	2,130,000
タクマ	500	1,508.00	754,000
ツガミ	300	949.00	284,700
オークマ	100	4,735.00	473,500

芝浦機械	100	2,129.00	212,900
アマダ	1,400	788.00	1,103,200
アイダエンジニアリング	400	730.00	292,000
F U J I	500	1,981.00	990,500
牧野フライス製作所	100	3,540.00	354,000
オーエスジー	600	1,637.00	982,200
旭ダイヤモンド工業	400	483.00	193,200
D M G 森精機	800	1,317.00	1,053,600
ソディック	400	877.00	350,800
ディスコ	200	27,130.00	5,426,000
豊和工業	100	780.00	78,000
O K K	100	372.00	37,200
東洋機械金属	100	404.00	40,400
津田駒工業	100	852.00	85,200
島精機製作所	200	1,405.00	281,000
オプトラン	100	2,521.00	252,100
N C ホールディングス	100	555.00	55,500
ヤマシンフィルタ	200	1,018.00	203,600
日阪製作所	200	769.00	153,800
やまびこ	200	955.00	191,000
平田機工	100	6,080.00	608,000
ペガサスミシン製造	200	312.00	62,400
ナブテスコ	700	3,570.00	2,499,000
三井海洋開発	200	1,545.00	309,000
レオン自動機	100	1,284.00	128,400
S M C	400	56,900.00	22,760,000
ホソカワミクロン	100	5,780.00	578,000
ユニオンツール	100	2,683.00	268,300
オイレス工業	200	1,444.00	288,800
サトーホールディングス	200	2,420.00	484,000
技研製作所	100	4,185.00	418,500
日精樹脂工業	100	817.00	81,700
ワイエイシイホールディングス	100	720.00	72,000
小松製作所	5,600	2,348.00	13,148,800
住友重機械工業	700	2,379.00	1,665,300
日立建機	500	3,290.00	1,645,000
日工	400	626.00	250,400
井関農機	100	1,195.00	119,500
T O W A	200	1,405.00	281,000
北川鉄工所	100	1,560.00	156,000
クボタ	6,700	1,604.50	10,750,150
三菱化工機	100	1,856.00	185,600
月島機械	300	1,192.00	357,600

帝国電機製作所	100	1,244.00	124,400
新東工業	300	765.00	229,500
澁谷工業	100	2,918.00	291,800
アイチ コーポレーション	300	790.00	237,000
小森コーポレーション	300	727.00	218,100
鶴見製作所	100	1,870.00	187,000
荏原製作所	500	2,725.00	1,362,500
西島製作所	200	871.00	174,200
北越工業	200	1,172.00	234,400
ダイキン工業	1,600	19,660.00	31,456,000
トーヨーカネツ	100	2,116.00	211,600
栗田工業	700	2,990.00	2,093,000
椿本チエイン	200	2,698.00	539,600
大同工業	100	627.00	62,700
木村化工機	200	430.00	86,000
アネスト岩田	300	844.00	253,200
ダイフク	700	9,950.00	6,965,000
加藤製作所	100	1,258.00	125,800
タダノ	600	927.00	556,200
フジテック	500	1,931.00	965,500
C K D	400	2,160.00	864,000
キトー	100	1,237.00	123,700
平和	400	1,812.00	724,800
理想科学工業	100	1,357.00	135,700
S A N K Y O	300	2,690.00	807,000
日本金銭機械	200	572.00	114,400
マースグループホールディングス	100	1,687.00	168,700
フクシマガリレイ	100	3,275.00	327,500
オーイズミ	100	376.00	37,600
ダイコク電機	100	1,268.00	126,800
竹内製作所	200	1,954.00	390,800
アマノ	300	2,259.00	677,700
J U K I	200	519.00	103,800
マックス	200	1,575.00	315,000
グローリー	300	2,503.00	750,900
新晃工業	200	1,439.00	287,800
大和冷機工業	200	1,010.00	202,000
セガサミーホールディングス	1,300	1,290.00	1,677,000
日本ピストンリング	100	1,228.00	122,800
リケン	100	2,878.00	287,800
T P R	200	1,467.00	293,400
ツバキ・ナカシマ	200	843.00	168,600
ホシザキ	400	8,770.00	3,508,000

大豊工業	100	553.00	55,300	
日本精工	2,400	807.00	1,936,800	
NTN	2,700	223.00	602,100	
ジェイテクト	1,200	835.00	1,002,000	
不二越	100	3,395.00	339,500	
日本トムソン	500	342.00	171,000	
THK	800	2,764.00	2,211,200	
ユーシン精機	200	716.00	143,200	
イーグル工業	200	718.00	143,600	
日本ピラー工業	200	1,510.00	302,000	
キッツ	500	710.00	355,000	
マキタ	1,600	4,160.00	6,656,000	
日立造船	900	384.00	345,600	
三菱重工業	2,100	2,703.50	5,677,350	
IHI	900	1,613.00	1,451,700	
スター精密	200	1,293.00	258,600	
日清紡ホールディングス	700	780.00	546,000	
イビデン	800	3,005.00	2,404,000	
コニカミノルタ	2,800	381.00	1,066,800	
ブラザー工業	1,500	1,910.00	2,865,000	
ミネベアミツミ	2,300	1,866.00	4,291,800	
日立製作所	5,900	3,500.00	20,650,000	
三菱電機	12,500	1,402.00	17,525,000	
富士電機	800	2,959.00	2,367,200	
東洋電機製造	100	1,179.00	117,900	
安川電機	1,400	3,920.00	5,488,000	
シンフォニアテクノロジー	200	1,073.00	214,600	
明電舎	300	1,736.00	520,800	
山洋電気	100	4,855.00	485,500	
デンヨー	200	2,044.00	408,800	
東芝テック	200	4,400.00	880,000	
マブチモーター	300	3,395.00	1,018,500	
日本電産	3,000	7,640.00	22,920,000	
東光高岳	100	1,011.00	101,100	
ダイヘン	200	4,060.00	812,000	
ヤーマン	200	954.00	190,800	
JVCケンウッド	1,100	160.00	176,000	
ミマキエンジニアリング	200	385.00	77,000	
第一精工	100	2,012.00	201,200	
日新電機	300	1,039.00	311,700	
大崎電気工業	200	530.00	106,000	
オムロン	1,100	7,300.00	8,030,000	
日東工業	200	1,907.00	381,400	

I D E C	200	1,711.00	342,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	400	1,869.00	747,600
サクサホールディングス	100	1,501.00	150,100
メルコホールディングス	100	3,235.00	323,500
日本電気	1,600	5,790.00	9,264,000
富士通	1,200	13,920.00	16,704,000
沖電気工業	600	1,082.00	649,200
電気興業	100	2,495.00	249,500
サンケン電気	200	2,148.00	429,600
アイホン	100	1,519.00	151,900
ルネサスエレクトロニクス	6,000	597.00	3,582,000
セイコーエプソン	1,600	1,253.00	2,004,800
ワコム	1,000	578.00	578,000
アルバック	300	3,370.00	1,011,000
E I Z O	100	4,240.00	424,000
日本信号	400	1,092.00	436,800
京三製作所	300	579.00	173,700
能美防災	200	2,169.00	433,800
ホーチキ	100	1,244.00	124,400
エレコム	100	5,390.00	539,000
パナソニック	14,100	1,014.00	14,297,400
シャープ	1,300	1,197.00	1,556,100
アンリツ	900	2,465.00	2,218,500
富士通ゼネラル	500	2,522.00	1,261,000
ソニー	7,700	8,249.00	63,517,300
T D K	600	10,720.00	6,432,000
タムラ製作所	500	469.00	234,500
アルプスアルパイン	1,200	1,425.00	1,710,000
日本電波工業	200	315.00	63,000
ローランド ディー・ジー	100	1,213.00	121,300
フォスター電機	200	1,141.00	228,200
ヨコオ	100	2,798.00	279,800
ホシデン	400	929.00	371,600
ヒロセ電機	200	11,980.00	2,396,000
日本航空電子工業	300	1,492.00	447,600
T O A	200	758.00	151,600
マクセルホールディングス	300	937.00	281,100
古野電気	200	1,006.00	201,200
ユニデンホールディングス	100	1,761.00	176,100
スミダコーポレーション	200	723.00	144,600
アイコム	100	2,993.00	299,300
リオン	100	2,086.00	208,600
船井電機	200	521.00	104,200



横河電機	1,200	1,700.00	2,040,000	
新電元工業	100	2,111.00	211,100	
アズビル	800	3,465.00	2,772,000	
日本光電工業	500	3,695.00	1,847,500	
共和電業	300	420.00	126,000	
堀場製作所	300	5,820.00	1,746,000	
アドバンテスト	900	6,700.00	6,030,000	
エスベック	200	1,940.00	388,000	
キーエンス	1,100	44,610.00	49,071,000	
日置電機	100	3,340.00	334,000	
シスメックス	900	8,040.00	7,236,000	
日本マイクロニクス	300	1,108.00	332,400	
メガチップス	100	2,127.00	212,700	
O B A R A G R O U P	100	3,560.00	356,000	
コーセル	200	886.00	177,200	
イリソ電子工業	100	3,435.00	343,500	
オプテックスグループ	200	1,243.00	248,600	
千代田インテグレ	100	1,635.00	163,500	
レーザーテック	600	9,970.00	5,982,000	
スタンレー電気	900	2,652.00	2,386,800	
岩崎電気	100	1,865.00	186,500	
ウシオ電機	800	1,381.00	1,104,800	
日本セラミック	100	2,201.00	220,100	
遠藤照明	100	620.00	62,000	
山一電機	100	1,370.00	137,000	
図研	100	3,090.00	309,000	
日本電子	300	3,080.00	924,000	
カシオ計算機	1,100	1,872.00	2,059,200	
ファナック	1,200	20,705.00	24,846,000	
日本シイエムケイ	400	417.00	166,800	
エンプラス	100	2,364.00	236,400	
ローム	600	7,100.00	4,260,000	
浜松ホトニクス	900	4,790.00	4,311,000	
三井ハイテック	200	1,668.00	333,600	
新光電気工業	500	1,701.00	850,500	
京セラ	1,700	5,901.00	10,031,700	
太陽誘電	600	3,350.00	2,010,000	
村田製作所	3,600	6,580.00	23,688,000	
双葉電子工業	200	969.00	193,800	
北陸電気工業	100	850.00	85,000	
ニチコン	400	742.00	296,800	
日本ケミコン	100	1,919.00	191,900	
K O A	200	1,035.00	207,000	

市光工業	200	506.00	101,200	
小糸製作所	700	4,540.00	3,178,000	
ミツバ	300	392.00	117,600	
S C R E E Nホールディングス	200	5,330.00	1,066,000	
キヤノン電子	100	1,628.00	162,800	
キヤノン	6,700	2,163.50	14,495,450	
リコー	3,200	810.00	2,592,000	
象印マホービン	400	1,339.00	535,600	
東京エレクトロン	800	29,120.00	23,296,000	
トヨタ紡織	300	1,444.00	433,200	
ユニプレス	100	935.00	93,500	
豊田自動織機	1,000	5,770.00	5,770,000	
モリタホールディングス	200	1,851.00	370,200	
三櫻工業	200	670.00	134,000	
デンソー	2,700	4,124.00	11,134,800	
東海理化電機製作所	300	1,544.00	463,200	
三井E & Sホールディングス	500	450.00	225,000	
川崎重工業	1,000	1,659.00	1,659,000	
名村造船所	500	155.00	77,500	
三菱ロジスネクスト	200	1,054.00	210,800	
日産自動車	14,700	426.30	6,266,610	
いすゞ自動車	3,500	963.70	3,372,950	
トヨタ自動車	13,800	6,794.00	93,757,200	
日野自動車	1,600	744.00	1,190,400	
三菱自動車工業	4,500	278.00	1,251,000	
エフテック	100	494.00	49,400	
武蔵精密工業	300	919.00	275,700	
日産車体	200	921.00	184,200	
新明和工業	400	1,027.00	410,800	
極東開発工業	300	1,382.00	414,600	
日信工業	300	2,204.00	661,200	
トピー工業	100	1,219.00	121,900	
ティラド	100	1,310.00	131,000	
タチエス	200	929.00	185,800	
N O K	700	1,292.00	904,400	
フタバ産業	400	471.00	188,400	
K Y B	100	1,967.00	196,700	
大同メタル工業	200	548.00	109,600	
プレス工業	700	310.00	217,000	
ミクニ	300	269.00	80,700	
太平洋工業	300	942.00	282,600	
ケーヒン	300	2,539.00	761,700	
河西工業	200	450.00	90,000	

アイシン精機	1,000	3,190.00	3,190,000	
マツダ	3,500	706.00	2,471,000	
今仙電機製作所	200	738.00	147,600	
本田技研工業	9,600	2,797.00	26,851,200	
スズキ	2,400	3,760.00	9,024,000	
SUBARU	3,900	2,267.00	8,841,300	
安永	100	1,014.00	101,400	
ヤマハ発動機	1,600	1,687.00	2,699,200	
ショーワ	300	2,245.00	673,500	
T B K	100	444.00	44,400	
エクセディ	200	1,559.00	311,800	
豊田合成	400	2,134.00	853,600	
愛三工業	200	526.00	105,200	
ヨロズ	100	1,109.00	110,900	
エフ・シー・シー	200	1,874.00	374,800	
シマノ	500	21,430.00	10,715,000	
テイ・エス テック	300	2,977.00	893,100	
ジャムコ	100	727.00	72,700	
テルモ	3,500	4,111.00	14,388,500	
日機装	500	981.00	490,500	
日本エム・ディ・エム	100	1,606.00	160,600	
島津製作所	1,500	2,910.00	4,365,000	
長野計器	100	1,028.00	102,800	
東京計器	200	943.00	188,600	
東京精密	200	3,420.00	684,000	
マニー	600	2,831.00	1,698,600	
ニコン	2,000	907.00	1,814,000	
トプコン	700	838.00	586,600	
オリンパス	6,900	1,956.00	13,496,400	
理研計器	100	2,469.00	246,900	
タムロン	100	1,808.00	180,800	
HOYA	2,500	10,700.00	26,750,000	
ノーリツ鋼機	100	1,493.00	149,300	
エー・アンド・デイ	100	678.00	67,800	
朝日インテック	1,100	2,942.00	3,236,200	
シチズン時計	1,500	337.00	505,500	
リズム時計工業	100	611.00	61,100	
大研医器	200	565.00	113,000	
メニコン	200	5,220.00	1,044,000	
松風	100	1,402.00	140,200	
セイコーホールディングス	200	1,630.00	326,000	
ニプロ	900	1,180.00	1,062,000	
パラマウントベッドホールディングス	200	4,510.00	902,000	

ニホンフラッシュ	200	1,484.00	296,800
前田工織	200	2,533.00	506,600
アートネイチャー	200	623.00	124,600
バンダイナムコホールディングス	1,300	5,970.00	7,761,000
SHOEI	200	2,718.00	543,600
フランスベッドホールディングス	200	843.00	168,600
パイロットコーポレーション	200	3,405.00	681,000
萩原工業	200	1,411.00	282,200
トッパン・フォームズ	300	1,083.00	324,900
フジシールインターナショナル	300	1,958.00	587,400
タカラトミー	600	852.00	511,200
プロネクサス	200	1,188.00	237,600
大建工業	100	1,861.00	186,100
凸版印刷	1,700	1,748.00	2,971,600
大日本印刷	1,600	2,499.00	3,998,400
NISSHA	300	986.00	295,800
TAKARA & COMPANY	100	2,397.00	239,700
アシックス	1,100	1,236.00	1,359,600
ツツミ	100	1,929.00	192,900
ヤマハ	800	4,950.00	3,960,000
クリナップ	200	573.00	114,600
ビジョン	800	4,405.00	3,524,000
キングジム	200	848.00	169,600
リンテック	300	2,549.00	764,700
イトーキ	300	335.00	100,500
任天堂	800	47,020.00	37,616,000
三菱鉛筆	200	1,304.00	260,800
タカラスタンダード	200	1,564.00	312,800
コクヨ	600	1,277.00	766,200
グローブライド	100	2,110.00	211,000
オカムラ	500	781.00	390,500
美津濃	100	2,026.00	202,600
東京電力ホールディングス	10,100	327.00	3,302,700
中部電力	3,800	1,364.50	5,185,100
関西電力	4,500	1,085.00	4,882,500
中国電力	1,700	1,360.00	2,312,000
北陸電力	1,100	685.00	753,500
東北電力	3,000	1,034.00	3,102,000
四国電力	1,200	788.00	945,600
九州電力	2,600	937.00	2,436,200
北海道電力	1,200	427.00	512,400
沖縄電力	300	1,749.00	524,700
電源開発	1,000	1,766.00	1,766,000

イーレックス	300	1,583.00	474,900	
東京瓦斯	2,300	2,559.50	5,886,850	
大阪瓦斯	2,400	2,103.00	5,047,200	
東邦瓦斯	600	5,110.00	3,066,000	
広島ガス	400	365.00	146,000	
西部瓦斯	200	2,554.00	510,800	
静岡ガス	400	889.00	355,600	
メタウォーター	100	4,480.00	448,000	
SBSホールディングス	200	2,375.00	475,000	
東武鉄道	1,300	3,405.00	4,426,500	
相鉄ホールディングス	400	2,832.00	1,132,800	
東急	3,000	1,348.00	4,044,000	
京浜急行電鉄	1,600	1,592.00	2,547,200	
小田急電鉄	1,800	2,566.00	4,618,800	
京王電鉄	600	5,940.00	3,564,000	
京成電鉄	900	3,025.00	2,722,500	
富士急行	200	3,325.00	665,000	
東日本旅客鉄道	2,100	7,155.00	15,025,500	
西日本旅客鉄道	1,100	5,373.00	5,910,300	
東海旅客鉄道	1,000	15,215.00	15,215,000	
西武ホールディングス	1,500	1,090.00	1,635,000	
鴻池運輸	200	1,073.00	214,600	
西日本鉄道	400	2,869.00	1,147,600	
ハマキョウレックス	100	3,235.00	323,500	
サカイ引越センター	100	5,100.00	510,000	
近鉄グループホールディングス	1,200	4,615.00	5,538,000	
阪急阪神ホールディングス	1,500	3,440.00	5,160,000	
南海電気鉄道	600	2,413.00	1,447,800	
京阪ホールディングス	500	4,620.00	2,310,000	
名古屋鉄道	1,000	2,931.00	2,931,000	
山陽電気鉄道	100	2,204.00	220,400	
日本通運	400	5,650.00	2,260,000	
ヤマトホールディングス	2,100	2,757.00	5,789,700	
山九	300	4,035.00	1,210,500	
丸全昭和運輸	100	3,280.00	328,000	
センコーグループホールディングス	700	821.00	574,700	
ニッコンホールディングス	500	2,118.00	1,059,000	
福山通運	200	3,920.00	784,000	
セイノーホールディングス	900	1,402.00	1,261,800	
日立物流	300	3,010.00	903,000	
丸和運輸機関	200	3,240.00	648,000	
C&Fロジホールディングス	200	1,607.00	321,400	
九州旅客鉄道	1,000	2,492.00	2,492,000	

S Gホールディングス	1,100	3,830.00	4,213,000	
日本郵船	1,000	1,474.00	1,474,000	
商船三井	700	1,928.00	1,349,600	
川崎汽船	400	1,057.00	422,800	
N Sユニテッド海運	100	1,514.00	151,400	
飯野海運	800	339.00	271,200	
乾汽船	200	801.00	160,200	
日本航空	2,100	1,916.00	4,023,600	
A N Aホールディングス	2,100	2,398.00	5,035,800	
日新	100	1,548.00	154,800	
三菱倉庫	400	2,771.00	1,108,400	
三井倉庫ホールディングス	200	1,556.00	311,200	
住友倉庫	400	1,275.00	510,000	
日本トランスシティ	100	499.00	49,900	
中央倉庫	100	983.00	98,300	
安田倉庫	200	891.00	178,200	
宇徳	200	475.00	95,000	
上組	600	2,079.00	1,247,400	
近鉄エクスプレス	200	1,896.00	379,200	
エーアイティー	200	888.00	177,600	
N E C ネットエスアイ	300	2,178.00	653,400	
システナ	500	1,439.00	719,500	
デジタルアーツ	100	9,390.00	939,000	
日鉄ソリューションズ	200	2,984.00	596,800	
コア	100	1,215.00	121,500	
T I S	1,200	2,251.00	2,701,200	
グリー	800	456.00	364,800	
コーエーテクモホールディングス	300	3,385.00	1,015,500	
ファインデックス	100	911.00	91,100	
K L a b	300	720.00	216,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	200	845.00	169,000	
ネクソン	3,500	2,421.00	8,473,500	
アイスタイル	300	287.00	86,100	
エイチーム	100	876.00	87,600	
テクノスジャパン	200	806.00	161,200	
コロプラ	400	1,004.00	401,600	
ブロードリーフ	800	550.00	440,000	
デジタルハーツホールディングス	100	846.00	84,600	
メディアドゥ	100	5,230.00	523,000	
フィクスターズ	200	1,205.00	241,000	
C A R T A H O L D I N G S	100	1,253.00	125,300	
ティーガイア	100	1,987.00	198,700	
日本アジアグループ	300	299.00	89,700	

テクマトリックス	200	1,751.00	350,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	300	1,940.00	582,000	
GMOペイメントゲートウェイ	200	11,030.00	2,206,000	
インターネットイニシアティブ	200	3,545.00	709,000	
さくらインターネット	200	603.00	120,600	
S R Aホールディングス	100	2,332.00	233,200	
朝日ネット	200	1,105.00	221,000	
コムチュア	200	2,615.00	523,000	
g u m i	200	936.00	187,200	
L I N E	300	5,510.00	1,653,000	
A O I T Y O H o l d i n g s	100	394.00	39,400	
マクロミル	200	748.00	149,600	
ソルクシーズ	100	702.00	70,200	
フェイス	100	697.00	69,700	
野村総合研究所	1,800	2,824.00	5,083,200	
サイバネットシステム	200	648.00	129,600	
インテージホールディングス	200	898.00	179,600	
ソースネクスト	400	272.00	108,800	
インフォコム	200	3,165.00	633,000	
F I G	100	252.00	25,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,059.00	105,900	
フジ・メディア・ホールディングス	1,200	1,011.00	1,213,200	
オービック	400	19,350.00	7,740,000	
ジャストシステム	200	7,710.00	1,542,000	
Zホールディングス	16,900	501.00	8,466,900	
トレンドマイクロ	600	6,310.00	3,786,000	
日本オラクル	300	12,790.00	3,837,000	
アルファシステムズ	100	4,090.00	409,000	
フューチャー	200	1,760.00	352,000	
C A C H o l d i n g s	100	1,202.00	120,200	
オービックビジネスコンサルタント	100	5,970.00	597,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	600	4,175.00	2,505,000	
アイティフォー	200	747.00	149,400	
大塚商会	700	5,560.00	3,892,000	
サイボウズ	200	3,205.00	641,000	
電通国際情報サービス	100	5,630.00	563,000	
デジタルガレージ	300	3,690.00	1,107,000	
E Mシステムズ	400	932.00	372,800	
日本エンタープライズ	200	334.00	66,800	
WOWOW	100	2,472.00	247,200	
スカラ	100	632.00	63,200	
I M A G I C A G R O U P	100	378.00	37,800	
ネットワンシステムズ	500	3,645.00	1,822,500	

アルゴグラフィックス	200	3,290.00	658,000	
マーベラス	300	683.00	204,900	
エイベックス	200	910.00	182,000	
日本ユニシス	400	3,355.00	1,342,000	
兼松エレクトロニクス	100	4,270.00	427,000	
東京放送ホールディングス	800	1,681.00	1,344,800	
日本テレビホールディングス	1,100	1,206.00	1,326,600	
テレビ朝日ホールディングス	400	1,573.00	629,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,000	422.00	422,000	
テレビ東京ホールディングス	100	2,356.00	235,600	
ワイヤレスゲート	100	796.00	79,600	
コネクシオ	100	1,443.00	144,300	
日本電信電話	16,100	2,569.00	41,360,900	
K D D I	8,800	3,347.00	29,453,600	
ソフトバンク	10,600	1,431.00	15,168,600	
光通信	100	23,140.00	2,314,000	
N T T ドコモ	8,600	2,993.50	25,744,100	
エムティーアイ	300	781.00	234,300	
G M O インターネット	500	2,874.00	1,437,000	
K A D O K A W A	400	2,280.00	912,000	
ゼンリン	300	1,202.00	360,600	
アイネット	100	1,530.00	153,000	
松竹	100	13,010.00	1,301,000	
東宝	800	3,340.00	2,672,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	3,300	1,292.00	4,263,600	
D T S	200	2,341.00	468,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	500	5,760.00	2,880,000	
シーイーシー	200	1,585.00	317,000	
カプコン	600	4,015.00	2,409,000	
ジャステック	100	1,234.00	123,400	
S C S K	300	5,390.00	1,617,000	
日本システムウエア	100	1,952.00	195,200	
アイネス	300	1,527.00	458,100	
T K C	100	5,940.00	594,000	
富士ソフト	200	4,715.00	943,000	
N S D	500	1,968.00	984,000	
コナミホールディングス	500	3,445.00	1,722,500	
福井コンピュータホールディングス	100	2,610.00	261,000	
J B C C ホールディングス	100	1,432.00	143,200	
ミロク情報サービス	100	2,207.00	220,700	
ソフトバンクグループ	9,700	6,272.00	60,838,400	
エレマテック	100	874.00	87,400	
J A L U X	100	1,737.00	173,700	



あらた	100	5,030.00	503,000	
フィールズ	100	351.00	35,100	
双日	6,700	240.00	1,608,000	
アルフレッサ ホールディングス	1,400	2,269.00	3,176,600	
横浜冷凍	400	890.00	356,000	
アルコニックス	200	1,275.00	255,000	
神戸物産	400	6,540.00	2,616,000	
あい ホールディングス	200	1,532.00	306,400	
ダイワボウホールディングス	100	7,330.00	733,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,638.00	491,400	
ラクト・ジャパン	100	3,600.00	360,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,023.00	204,600	
レスターホールディングス	200	1,968.00	393,600	
TOKAIホールディングス	600	999.00	599,400	
三洋貿易	200	984.00	196,800	
ウイン・パートナーズ	100	968.00	96,800	
シップヘルスケアホールディングス	200	4,600.00	920,000	
コメダホールディングス	300	1,798.00	539,400	
富士興産	100	432.00	43,200	
小野建	100	1,227.00	122,700	
伯東	100	954.00	95,400	
コンドーテック	100	1,135.00	113,500	
ナガイレーベン	200	2,790.00	558,000	
三菱食品	100	2,762.00	276,200	
松田産業	100	1,445.00	144,500	
第一興商	200	3,185.00	637,000	
メディパルホールディングス	1,300	2,047.00	2,661,100	
萩原電気ホールディングス	100	2,041.00	204,100	
アズワン	100	11,310.00	1,131,000	
ドウシシャ	100	1,627.00	162,700	
高速	100	1,394.00	139,400	
丸文	200	508.00	101,600	
ハピネット	200	1,160.00	232,000	
日本ライフライン	400	1,369.00	547,600	
マルカ	100	1,803.00	180,300	
IDOM	500	498.00	249,000	
進和	100	1,970.00	197,000	
シークス	200	968.00	193,600	
オーハシテクニカ	100	1,620.00	162,000	
伊藤忠商事	8,400	2,444.50	20,533,800	
丸紅	12,800	520.10	6,657,280	
長瀬産業	700	1,324.00	926,800	
蝶理	100	1,700.00	170,000	

豊田通商	1,300	2,868.00	3,728,400	
三共生興	300	431.00	129,300	
兼松	500	1,297.00	648,500	
三井物産	10,400	1,657.00	17,232,800	
日本紙パルプ商事	100	3,830.00	383,000	
カメイ	100	1,045.00	104,500	
スターゼン	100	4,125.00	412,500	
山善	500	1,032.00	516,000	
住友商事	7,500	1,293.00	9,697,500	
内田洋行	100	6,860.00	686,000	
三菱商事	7,900	2,309.50	18,245,050	
キヤノンマーケティングジャパン	300	2,208.00	662,400	
西華産業	100	1,243.00	124,300	
佐藤商事	100	924.00	92,400	
菱洋エレクトロ	200	3,120.00	624,000	
ユアサ商事	100	3,050.00	305,000	
阪和興業	200	2,097.00	419,400	
正栄食品工業	100	3,795.00	379,500	
カナデン	100	1,306.00	130,600	
菱電商事	100	1,483.00	148,300	
フルサト工業	100	1,396.00	139,600	
岩谷産業	300	3,785.00	1,135,500	
昭光通商	100	594.00	59,400	
三愛石油	300	918.00	275,400	
稲畑産業	200	1,281.00	256,200	
G S Iクレオス	100	1,165.00	116,500	
明和産業	200	457.00	91,400	
ワキタ	300	964.00	289,200	
東邦ホールディングス	300	1,997.00	599,100	
サンゲツ	300	1,550.00	465,000	
ミツウロコグループホールディングス	100	1,123.00	112,300	
シナネンホールディングス	100	2,876.00	287,600	
伊藤忠エネクス	200	867.00	173,400	
サンリオ	400	1,715.00	686,000	
サンワテクノス	100	860.00	86,000	
リョーサン	100	2,142.00	214,200	
新光商事	200	872.00	174,400	
三信電気	100	1,800.00	180,000	
東陽テクニカ	200	969.00	193,800	
モスフードサービス	200	2,864.00	572,800	
加賀電子	100	2,139.00	213,900	
ソーダニッカ	200	528.00	105,600	
立花エレテック	100	1,774.00	177,400	

フォーバル	100	1,016.00	101,600
PALTAC	200	5,260.00	1,052,000
ヤマタネ	100	1,239.00	123,900
日鉄物産	100	3,510.00	351,000
トラスコ中山	300	2,638.00	791,400
オートバックスセブン	500	1,350.00	675,000
モリト	100	617.00	61,700
加藤産業	200	3,480.00	696,000
イノテック	100	1,005.00	100,500
イエローハット	200	1,504.00	300,800
J Kホールディングス	200	800.00	160,000
日伝	100	2,324.00	232,400
杉本商事	100	1,920.00	192,000
因幡電機産業	300	2,509.00	752,700
ミスミグループ本社	1,600	2,789.00	4,462,400
スズケン	500	3,910.00	1,955,000
ジェコス	100	930.00	93,000
ローソン	300	5,740.00	1,722,000
サンエー	100	4,220.00	422,000
カワチ薬品	100	3,060.00	306,000
エービーシー・マート	200	5,970.00	1,194,000
アスクル	100	3,190.00	319,000
ゲオホールディングス	200	1,492.00	298,400
アダストリア	200	1,507.00	301,400
くら寿司	100	4,915.00	491,500
キャンドウ	100	2,440.00	244,000
パルグループホールディングス	200	1,146.00	229,200
エディオン	500	1,063.00	531,500
サーラコーポレーション	200	570.00	114,000
ワッツ	100	1,005.00	100,500
ハローズ	100	3,560.00	356,000
ひらまつ	200	173.00	34,600
ハニーズホールディングス	200	1,163.00	232,600
アルペン	100	1,646.00	164,600
クオールホールディングス	200	1,136.00	227,200
ジンスホールディングス	100	7,360.00	736,000
ビックカメラ	800	1,141.00	912,800
DCMホールディングス	700	1,321.00	924,700
MonotaRO	900	4,315.00	3,883,500
アークランドサービスホールディングス	200	1,937.00	387,400
J.フロント リテイリング	1,600	680.00	1,088,000
ドトール・日レスホールディングス	200	1,574.00	314,800
マツモトキヨシホールディングス	500	3,825.00	1,912,500

ブロンコビリー	100	2,129.00	212,900	
Z O Z O	1,000	2,583.00	2,583,000	
トレジャー・ファクトリー	100	696.00	69,600	
ココカラファイン	100	5,970.00	597,000	
三越伊勢丹ホールディングス	2,300	588.00	1,352,400	
ウエルシアホールディングス	400	9,280.00	3,712,000	
クリエイトSDホールディングス	200	3,690.00	738,000	
チムニー	100	1,305.00	130,500	
シュッピン	200	713.00	142,600	
ネクステージ	100	1,007.00	100,700	
ジョイフル本田	400	1,466.00	586,400	
すかいらーくホールディングス	1,500	1,635.00	2,452,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,249.00	374,700	
あさひ	100	1,600.00	160,000	
コスモス薬品	100	18,770.00	1,877,000	
トーエル	100	692.00	69,200	
セブン&アイ・ホールディングス	4,700	3,511.00	16,501,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	600	523.00	313,800	
ツルハホールディングス	300	14,600.00	4,380,000	
サンマルクホールディングス	100	1,582.00	158,200	
トリドールホールディングス	400	1,215.00	486,000	
クスリのアオキホールディングス	100	9,840.00	984,000	
スシローグローバルホールディングス	400	2,454.00	981,600	
メディカルシステムネットワーク	200	500.00	100,000	
ノジマ	200	2,764.00	552,800	
カッパ・クリエイト	200	1,390.00	278,000	
ライトオン	100	585.00	58,500	
良品計画	1,700	1,397.00	2,374,900	
アドヴァン	200	1,361.00	272,200	
コナカ	300	297.00	89,100	
G - 7ホールディングス	200	2,398.00	479,600	
イオン北海道	100	772.00	77,200	
コジマ	300	543.00	162,900	
コーナン商事	200	3,795.00	759,000	
エコス	100	2,332.00	233,200	
ワタミ	200	895.00	179,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	2,800	2,363.00	6,616,400	
西松屋チェーン	300	1,092.00	327,600	
ゼンショーホールディングス	600	2,151.00	1,290,600	
サイゼリヤ	200	1,855.00	371,000	
V Tホールディングス	500	347.00	173,500	

ユナイテッドアローズ	200	1,607.00	321,400	
ハイデイ日高	200	1,590.00	318,000	
コロワイド	400	1,400.00	560,000	
ピーシーデポコーポレーション	200	673.00	134,600	
壱番屋	100	4,990.00	499,000	
スギホールディングス	300	7,610.00	2,283,000	
スクロール	300	515.00	154,500	
ヨンドシーホールディングス	200	1,894.00	378,800	
ファミリーマート	1,000	2,409.00	2,409,000	
木曽路	200	2,342.00	468,400	
S R Sホールディングス	200	868.00	173,600	
千趣会	200	341.00	68,200	
タカキュー	500	129.00	64,500	
ケーヨー	200	839.00	167,800	
上新電機	200	2,169.00	433,800	
日本瓦斯	200	4,715.00	943,000	
ロイヤルホールディングス	200	1,752.00	350,400	
いなげや	100	1,772.00	177,200	
島忠	300	2,890.00	867,000	
チヨダ	100	1,056.00	105,600	
ライフコーポレーション	100	4,665.00	466,500	
リンガーハット	200	2,233.00	446,600	
MrMaxHD	200	809.00	161,800	
AOKIホールディングス	300	602.00	180,600	
オークワ	200	1,572.00	314,400	
コメリ	200	2,830.00	566,000	
青山商事	200	646.00	129,200	
しまむら	100	7,400.00	740,000	
高島屋	1,000	815.00	815,000	
松屋	300	651.00	195,300	
エイチ・ツー・オー リテイリング	600	712.00	427,200	
丸井グループ	1,100	1,723.00	1,895,300	
アクシアル リテイリング	100	4,520.00	452,000	
イオン	4,700	2,494.50	11,724,150	
イズミ	300	4,190.00	1,257,000	
平和堂	300	1,967.00	590,100	
フジ	200	1,871.00	374,200	
ヤオコー	100	8,320.00	832,000	
ゼビオホールディングス	200	782.00	156,400	
ケーズホールディングス	1,400	1,382.00	1,934,800	
Olympicグループ	100	965.00	96,500	
日産東京販売ホールディングス	300	257.00	77,100	
アインホールディングス	200	6,800.00	1,360,000	

ヤマダ電機	3,800	484.00	1,839,200	
アークランドサカモト	200	1,883.00	376,600	
ニトリホールディングス	500	22,450.00	11,225,000	
吉野家ホールディングス	400	2,072.00	828,800	
松屋フーズホールディングス	100	3,575.00	357,500	
サガミホールディングス	300	1,194.00	358,200	
関西スーパーマーケット	100	1,216.00	121,600	
王将フードサービス	100	5,770.00	577,000	
プレナス	200	1,741.00	348,200	
ミニストップ	100	1,544.00	154,400	
アークス	300	2,576.00	772,800	
パローホールディングス	300	2,265.00	679,500	
ベルク	100	7,490.00	749,000	
大庄	100	1,135.00	113,500	
ファーストリテイリング	200	58,600.00	11,720,000	
サンドラッグ	500	3,580.00	1,790,000	
サックスパー ホールディングス	200	548.00	109,600	
ベルーナ	300	743.00	222,900	
じもとホールディングス	1,000	95.00	95,000	
めぶきフィナンシャルグループ	6,300	255.00	1,606,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	200	1,184.00	236,800	
九州フィナンシャルグループ	2,000	452.00	904,000	
ゆうちょ銀行	3,400	826.00	2,808,400	
富山第一銀行	300	263.00	78,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	6,900	347.00	2,394,300	
西日本フィナンシャルホールディングス	800	742.00	593,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	500	418.00	209,000	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,336.00	133,600	
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,117.00	423,400	
新生銀行	1,100	1,298.00	1,427,800	
あおぞら銀行	800	1,940.00	1,552,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	83,300	423.50	35,277,550	
りそなホールディングス	13,700	380.10	5,207,370	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,300	2,984.00	6,863,200	
三井住友フィナンシャルグループ	8,400	3,066.00	25,754,400	
千葉銀行	4,100	525.00	2,152,500	
群馬銀行	2,300	352.00	809,600	
武蔵野銀行	200	1,546.00	309,200	
千葉興業銀行	400	234.00	93,600	
筑波銀行	600	168.00	100,800	
七十七銀行	400	1,565.00	626,000	
青森銀行	100	2,248.00	224,800	
秋田銀行	100	1,480.00	148,000	

山形銀行	100	1,334.00	133,400	
岩手銀行	100	2,573.00	257,300	
東邦銀行	1,000	234.00	234,000	
みちのく銀行	100	1,002.00	100,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,000	1,706.00	1,706,000	
静岡銀行	2,700	711.00	1,919,700	
十六銀行	200	1,948.00	389,600	
スルガ銀行	1,400	381.00	533,400	
八十二銀行	3,100	416.00	1,289,600	
山梨中央銀行	200	856.00	171,200	
大垣共立銀行	200	2,235.00	447,000	
福井銀行	100	1,658.00	165,800	
北國銀行	100	2,940.00	294,000	
清水銀行	100	1,629.00	162,900	
滋賀銀行	200	2,468.00	493,600	
南都銀行	200	2,062.00	412,400	
百五銀行	1,200	328.00	393,600	
京都銀行	400	3,970.00	1,588,000	
紀陽銀行	500	1,628.00	814,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	800	957.00	765,600	
広島銀行	1,800	515.00	927,000	
山陰合同銀行	700	520.00	364,000	
中国銀行	1,000	953.00	953,000	
伊予銀行	1,700	646.00	1,098,200	
四国銀行	200	784.00	156,800	
阿波銀行	200	2,381.00	476,200	
大分銀行	100	2,440.00	244,000	
宮崎銀行	100	2,380.00	238,000	
佐賀銀行	100	1,236.00	123,600	
沖縄銀行	100	3,115.00	311,500	
琉球銀行	300	934.00	280,200	
セブン銀行	4,300	279.00	1,199,700	
みずほフィナンシャルグループ	164,900	137.30	22,640,770	
山口フィナンシャルグループ	1,600	659.00	1,054,400	
名古屋銀行	100	2,382.00	238,200	
北洋銀行	1,600	215.00	344,000	
中京銀行	100	2,038.00	203,800	
大光銀行	100	1,444.00	144,400	
愛媛銀行	200	1,183.00	236,600	
京葉銀行	500	516.00	258,000	
栃木銀行	700	167.00	116,900	
北日本銀行	100	1,764.00	176,400	
東和銀行	200	690.00	138,000	

大東銀行	100	640.00	64,000	
トモニホールディングス	900	348.00	313,200	
フィデアホールディングス	1,700	101.00	171,700	
池田泉州ホールディングス	1,400	166.00	232,400	
F P G	500	547.00	273,500	
S B Iホールディングス	1,500	2,218.00	3,327,000	
ジャフコ	200	3,885.00	777,000	
大和証券グループ本社	9,800	482.50	4,728,500	
野村ホールディングス	21,500	499.10	10,730,650	
岡三証券グループ	1,000	343.00	343,000	
丸三証券	500	424.00	212,000	
東洋証券	900	115.00	103,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,800	244.00	439,200	
水戸証券	600	213.00	127,800	
いちよし証券	300	418.00	125,400	
松井証券	700	875.00	612,500	
マネックスグループ	1,300	230.00	299,000	
極東証券	200	570.00	114,000	
岩井コスモホールディングス	200	1,271.00	254,200	
藍澤證券	300	698.00	209,400	
マネーパートナーズグループ	300	209.00	62,700	
かんぽ生命保険	400	1,509.00	603,600	
S O M P Oホールディングス	2,400	3,711.00	8,906,400	
アニコムホールディングス	100	4,445.00	444,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	3,200	2,874.50	9,198,400	
第一生命ホールディングス	7,000	1,326.50	9,285,500	
東京海上ホールディングス	4,400	4,723.00	20,781,200	
T & Dホールディングス	3,800	943.00	3,583,400	
全国保証	400	3,960.00	1,584,000	
アルヒ	100	1,589.00	158,900	
クレディセゾン	900	1,111.00	999,900	
芙蓉総合リース	100	6,000.00	600,000	
みずほリース	200	2,391.00	478,200	
東京センチュリー	200	5,850.00	1,170,000	
日本証券金融	600	500.00	300,000	
アイフル	2,600	221.00	574,600	
リコーリース	100	2,977.00	297,700	
イオンフィナンシャルサービス	800	917.00	733,600	
アコム	2,700	391.00	1,055,700	
ジャックス	200	1,689.00	337,800	
オリエントコーポレーション	3,400	110.00	374,000	
日立キャピタル	300	2,439.00	731,700	
オリックス	7,600	1,252.00	9,515,200	



三菱UFJリース	2,700	496.00	1,339,200	
日本取引所グループ	3,400	2,832.00	9,628,800	
イー・ギャランティ	100	2,605.00	260,500	
いちご	1,800	264.00	475,200	
日本駐車場開発	2,200	141.00	310,200	
ヒューリック	2,600	991.00	2,576,600	
三栄建築設計	100	1,352.00	135,200	
野村不動産ホールディングス	800	1,921.00	1,536,800	
三重交通グループホールディングス	300	466.00	139,800	
サムティ	200	1,248.00	249,600	
日本商業開発	100	1,514.00	151,400	
プレサンスコーポレーション	200	1,304.00	260,800	
日本管理センター	100	1,158.00	115,800	
フージャースホールディングス	200	547.00	109,400	
オープンハウス	400	3,200.00	1,280,000	
東急不動産ホールディングス	3,200	454.00	1,452,800	
飯田グループホールディングス	1,000	1,788.00	1,788,000	
ムゲンエステート	100	495.00	49,500	
パーク24	700	1,794.00	1,255,800	
バラカ	100	1,637.00	163,700	
三井不動産	6,100	1,860.00	11,346,000	
三菱地所	8,700	1,597.00	13,893,900	
平和不動産	300	2,891.00	867,300	
東京建物	1,400	1,207.00	1,689,800	
ダイビル	400	1,015.00	406,000	
京阪神ビルディング	200	1,306.00	261,200	
住友不動産	2,800	2,850.50	7,981,400	
テオーシー	300	662.00	198,600	
レオパレス21	1,700	182.00	309,400	
スターツコーポレーション	200	2,212.00	442,400	
フジ住宅	200	538.00	107,600	
明和地所	100	400.00	40,000	
ゴールドクレスト	100	1,491.00	149,100	
日神グループホールディングス	200	364.00	72,800	
日本エスコン	400	829.00	331,600	
タカラレーベン	800	353.00	282,400	
A V A N T I A	100	878.00	87,800	
イオンモール	700	1,342.00	939,400	
カチタス	400	2,508.00	1,003,200	
トーセイ	200	845.00	169,000	
サンフロンティア不動産	200	866.00	173,200	
エフ・ジェー・ネクスト	200	852.00	170,400	
インテリックス	100	469.00	46,900	

日本空港ビルデング	400	4,130.00	1,652,000
日本工営	100	3,010.00	301,000
L I F U L L	400	422.00	168,800
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,126.00	112,600
日本M&Aセンター	900	4,850.00	4,365,000
タケエイ	200	1,070.00	214,000
ビーネックスグループ	200	1,078.00	215,600
コシダカホールディングス	300	417.00	125,100
パソナグループ	200	1,303.00	260,600
リンクアンドモチベーション	300	356.00	106,800
G C A	200	619.00	123,800
エス・エム・エス	500	2,436.00	1,218,000
パーソルホールディングス	1,200	1,484.00	1,780,800
リニカル	100	859.00	85,900
クックパッド	400	322.00	128,800
エスクリ	100	351.00	35,100
アイ・ケイ・ケイ	100	540.00	54,000
学情	100	1,042.00	104,200
スタジオアリス	100	1,475.00	147,500
シミックホールディングス	100	1,376.00	137,600
総合警備保障	500	4,925.00	2,462,500
カカコム	1,000	2,700.00	2,700,000
ルネサンス	100	906.00	90,600
ディップ	200	2,215.00	443,000
デジタルホールディングス	100	1,431.00	143,100
新日本科学	200	644.00	128,800
ツクイ	400	480.00	192,000
ベネフィット・ワン	400	2,159.00	863,600
エムスリー	2,600	4,840.00	12,584,000
ツカダ・グローバルホールディング	100	271.00	27,100
アウトソーシング	800	636.00	508,800
ウェルネット	200	613.00	122,600
ディー・エヌ・エー	700	1,306.00	914,200
博報堂D Yホールディングス	1,600	1,226.00	1,961,600
ぐるなび	200	659.00	131,800
タカミヤ	200	547.00	109,400
ジャパンベストレスキューシステム	100	787.00	78,700
ファンコミュニケーションズ	500	445.00	222,500
W D Bホールディングス	100	2,792.00	279,200
パリュコマース	100	3,105.00	310,500
インフォマート	1,400	687.00	961,800
J Pホールディングス	600	271.00	162,600
E P Sホールディングス	200	1,017.00	203,400

プレステージ・インターナショナル	600	888.00	532,800	
アミューズ	100	2,153.00	215,300	
ドリームインキュベータ	100	1,285.00	128,500	
クイック	100	1,149.00	114,900	
ケネディクス	1,200	462.00	554,400	
電通グループ	1,200	2,563.00	3,075,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	559.00	55,900	
シーティーエス	100	839.00	83,900	
ネクシィーズグループ	100	900.00	90,000	
H.U.グループホールディングス	400	2,463.00	985,200	
アルプス技研	100	1,885.00	188,500	
日本空調サービス	100	756.00	75,600	
オリエンタルランド	1,300	13,920.00	18,096,000	
ダスキン	300	2,715.00	814,500	
明光ネットワークジャパン	200	756.00	151,200	
ファルコホールディングス	100	1,572.00	157,200	
ラウンドワン	400	750.00	300,000	
リゾートトラスト	500	1,323.00	661,500	
ビー・エム・エル	200	2,679.00	535,800	
ワタベウェディング	100	285.00	28,500	
りらいあコミュニケーションズ	300	1,123.00	336,900	
リソー教育	700	324.00	226,800	
ユー・エス・エス	1,400	1,720.00	2,408,000	
東京個別指導学院	100	484.00	48,400	
サイバーエージェント	700	5,990.00	4,193,000	
楽天	5,700	992.00	5,654,400	
テー・オー・ダブリュー	400	301.00	120,400	
フルキャストホールディングス	200	1,342.00	268,400	
エン・ジャパン	200	2,672.00	534,400	
テクノプロ・ホールディングス	200	5,840.00	1,168,000	
イー・ガーディアン	100	3,055.00	305,500	
リブセンス	200	291.00	58,200	
ジャパンマテリアル	300	1,669.00	500,700	
ベクトル	200	832.00	166,400	
I B J	200	652.00	130,400	
アサンテ	100	1,464.00	146,400	
N・フィールド	100	467.00	46,700	
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	2,215.00	221,500	
リクルートホールディングス	8,500	3,539.00	30,081,500	
日本郵政	9,700	780.40	7,569,880	
ベルシステム24ホールディングス	300	1,661.00	498,300	
ソラスト	300	1,039.00	311,700	
ベイカレント・コンサルティング	100	12,300.00	1,230,000	

キュービーネットホールディングス	100	1,871.00	187,100	
カーブスホールディングス	300	543.00	162,900	
リログループ	700	1,975.00	1,382,500	
東祥	100	1,226.00	122,600	
エイチ・アイ・エス	200	1,550.00	310,000	
共立メンテナンス	200	3,465.00	693,000	
イチネンホールディングス	200	1,166.00	233,200	
建設技術研究所	100	1,711.00	171,100	
スペース	100	956.00	95,600	
東京都競馬	100	4,110.00	411,000	
カナモト	200	2,336.00	467,200	
東京ドーム	600	731.00	438,600	
西尾レントオール	100	2,230.00	223,000	
トランス・コスモス	200	2,610.00	522,000	
乃村工藝社	600	830.00	498,000	
藤田観光	100	1,523.00	152,300	
日本管財	100	1,974.00	197,400	
トーカイ	100	2,350.00	235,000	
セコム	1,300	9,410.00	12,233,000	
セントラル警備保障	100	3,625.00	362,500	
丹青社	300	706.00	211,800	
メイテック	200	5,330.00	1,066,000	
応用地質	200	1,450.00	290,000	
船井総研ホールディングス	300	2,375.00	712,500	
進学会ホールディングス	100	432.00	43,200	
ベネッセホールディングス	400	2,870.00	1,148,000	
イオンディライト	200	3,260.00	652,000	
ナック	100	907.00	90,700	
ニチイ学館	200	1,588.00	317,600	
ダイセキ	200	2,450.00	490,000	
合計	1,456,100		2,754,585,290	

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】(2020年7月31日現在)

資産総額	2,792,867,706 円
負債総額	23,254,962 円
純資産総額( )	2,769,612,744 円
発行済数量	2,666,880,472 口
1口当たり純資産額( / )	1.0385 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、受託会社と協議のうえ、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、補充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、2020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	81	807,941
単位型公社債投資信託	13	59,731
単位型株式投資信託	43	91,952
合計	137	959,625

（注）純資産総額は百万円未満を切り捨てています。



### 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、事業年度(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY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 ( 2019年3月31日現在 )		当事業年度 ( 2020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		5,096,449		6,105,781
前払費用			22,449		18,738
未収委託者報酬			534,748		472,704
未収運用受託報酬	*2		13,102		7,811
未収収益			49		50
その他の流動資産			1,313		2,890
流動資産計			5,668,112		6,607,976
固定資産					
有形固定資産	*1		90,589		82,167
建物		71,717		64,512	
器具備品		18,871		17,654	
無形固定資産			26,964		27,614
ソフトウェア		25,565		26,308	
電話加入権		959		959	
その他		439		346	
投資その他の資産			46,552		44,757
投資有価証券		2,018		2,479	
長期前払費用		4,870		4,648	
繰延税金資産		39,662		37,628	
固定資産計			164,106		154,539
資産合計			5,832,218		6,762,516

科 目	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020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			382,042		348,153
未払手数料	*2	319,565		298,154	
その他未払金		62,477		49,999	
未払法人税等			206,238		236,742
未払消費税等			38,518		60,459
未払事業所税			2,007		2,020
賞与引当金			71,011		71,102
その他の流動負債			3,620		4,016
流動負債計			703,438		722,494
固定負債					
退職給付引当金			102,601		109,538
役員退職慰労引当金			18,487		17,951
固定負債計			121,089		127,489
負債合計			824,528		849,984
(純資産の部)		千円	千円	千円	千円
株主資本			5,007,677		5,912,551
資本金			200,000		200,000
利益剰余金			4,807,677		5,712,551
利益準備金		2,000		2,000	
その他利益剰余金		4,805,677		5,710,551	
別途積立金		3,830,000		4,650,000	
繰越利益剰余金		975,677		1,060,551	
評価・換算差額等			13		20
その他有価証券評価差額金		13		20	
純資産合計			5,007,690		5,912,531
負債・純資産合計			5,832,218		6,762,516

## ( 2 ) 【損益計算書】

科 目	注記 番号	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日		当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	
		金 額		金 額	
		千円	千円	千円	千円
営業収益					
委託者報酬			5,202,260		5,673,201
運用受託報酬	*1		192,056		132,189
営業収益計			5,394,317		5,805,390
営業費用					
支払手数料	*1		2,566,470		2,798,780
広告宣伝費			32,074		37,672
調査費			555,537		590,453
調査研究費		375,631		389,905	
委託調査費		179,906		200,547	
営業雑経費			68,770		67,426
印刷費		61,381		59,367	
郵便料		99		169	
電信電話料		2,404		2,424	
協会費		4,885		5,464	
営業費用計			3,222,852		3,494,332
一般管理費					
給料			578,701		587,623
役員報酬		41,693		53,299	
給料・手当		385,731		386,160	
賞与		67,757		62,682	
法定福利費		75,923		77,704	
福利厚生費		4,080		4,833	
その他給料		3,513		2,943	
賞与引当金繰入			71,011		71,102
退職給付費用			64,269		62,160
役員退職慰労引当金繰入			6,718		10,803
交際費			3,260		3,715
旅費交通費			9,400		10,463
租税公課			25,155		26,856
不動産賃借料			62,753		62,753
固定資産減価償却費			33,479		30,023
諸経費			135,925		131,389
一般管理費計			990,674		996,891
営業利益			1,180,790		1,314,166
営業外収益					
受取利息	*1		136		145
受取配当金			-		17
その他営業外収益			280		263
営業外収益計			416		426

営業外費用					
雑損失			904		938
営業外費用計			904		938
経常利益			1,180,302		1,313,653

科 目	注記 番号	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日		当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	
		金 額		金 額	
		千円	千円	千円	千円
税引前当期純利益			1,180,302		1,313,653
法人税、住民税および事業税			365,355		406,739
法人税等調整額			4,600		2,040
当期純利益			819,547		904,874

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
			その他利益剰余金			
			別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	200,000	2,000	3,080,000	906,129	3,988,129	4,188,129
当期変動額						
新株の発行						
剰余金の配当						
別途積立金の積立			750,000	750,000		
別途積立金の取崩						
当期純利益				819,547	819,547	819,547
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計			750,000	69,547	819,547	819,547
当期末残高	200,000	2,000	3,830,000	975,677	4,807,677	5,007,677

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高			4,188,129
当期変動額			
新株の発行			
剰余金の配当			
別途積立金の積立			
別途積立金の取崩			
当期純利益			819,547
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）	13	13	13
当期変動額合計	13	13	819,560
当期末残高	13	13	5,007,690

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	利益剰余金			利益 剰余金 合計	
		利益 準備金	その他利益剰余金			
			別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	200,000	2,000	3,830,000	975,677	4,807,677	5,007,677
当期変動額						
新株の発行						
剰余金の配当						
別途積立金の積立			820,000	820,000		
別途積立金の取崩						
当期純利益				904,874	904,874	904,874
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計			820,000	84,874	904,874	904,874
当期末残高	200,000	2,000	4,650,000	1,060,551	5,712,551	5,912,551

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	13	13	5,007,690
当期変動額			
新株の発行			
剰余金の配当			
別途積立金の積立			
別途積立金の取崩			
当期純利益			904,874
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）	33	33	33
当期変動額合計	33	33	904,840
当期末残高	20	20	5,912,531



## 重要な会計方針

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの：投資信託は、期末前1か月の市場価格の平均に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)</p>
2. 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>
3. 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います。</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>
4. 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>

## 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 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
建 物	63,831千円	70,422千円
器具備品	40,573千円	48,310千円

## \* 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 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
普通預金	3,907,610千円	4,911,204千円
定期預金	1,000,000千円	1,000,000千円
未収運用受託報酬	5,548千円	2,655千円
未払手数料	166,032千円	135,102千円

## （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 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
運用受託報酬	171,273千円	123,017千円
受取利息	134千円	143千円
支払手数料	2,086,194千円	2,333,403千円

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式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 2019年4月1日 至 2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

## （金融商品関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

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

当社は投資運用業を営んでおり、投資家のニーズに対応した投資信託を適時適切に設定することを目的として、当社が運用を行う投資信託を直接保有しております。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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。

投資有価証券は、投資信託であり、市場価格の変動リスクに晒されております。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

投資信託については、時価の動向を定期的に把握して経営に報告しております。

また、投資信託に係るリスクに関しては、取締役会において1銘柄当たりの取得金額および取得金額の合計額に係る上限金額を設定しており、リスクは極めて限定的であると認識しております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日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	5,096,449	5,096,449	
(2)未収委託者報酬	534,748	534,748	
(3)未収運用受託報酬	13,102	13,102	
(4)投資有価証券	2,018	2,018	
資産計	5,646,318	5,646,318	
(5)未払手数料	319,565	319,565	
(6)その他未払金	62,477	62,477	
(7)未払法人税等	206,238	206,238	
(8)未払消費税等	38,518	38,518	
(9)未払事業所税	2,007	2,007	
負債計	628,807	628,807	

## (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、(5)未払手数料、(6)その他未払金、(7)未払法人税等、(8)未払消費税等、(9)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。

## (4)投資有価証券

投資信託は、基準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	5,096,091	5,096,091	
(2)未収委託者報酬	534,748	534,748	
(3)未収運用受託報酬	13,102	13,102	
合計	5,643,942	5,643,942	

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

当社は投資運用業を営んでおり、投資家のニーズに対応した投資信託を適時適切に設定することを目的として、当社が運用を行う投資信託を直接保有しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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。

投資有価証券は、投資信託であり、市場価格の変動リスクに晒されております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

投資信託については、時価の動向を定期的に把握して経営に報告しております。

また、投資信託に係るリスクに関しては、取締役会において1銘柄当たりの取得金額および取得金額の合計額に係る上限金額を設定しており、リスクは極めて限定的であると認識しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日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	6,105,781	6,105,781	
(2)未収委託者報酬	472,704	472,704	
(3)未収運用受託報酬	7,811	7,811	
(4)投資有価証券	2,479	2,479	
資産計	6,588,776	6,588,776	
(5)未払手数料	298,154	298,154	
(6)その他未払金	49,999	49,999	
(7)未払法人税等	236,742	236,742	
(8)未払消費税等	60,459	60,459	
(9)未払事業所税	2,020	2,020	
負債計	647,375	647,375	

### (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、(5)未払手数料、(6)その他未払金、(7)未払法人税等、(8)未払消費税等、(9)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。

### (4)投資有価証券

投資信託は、基準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	6,105,476	6,105,476	

(2)未収委託者報酬	472,704	472,704	
(3)未収運用受託報酬	7,811	7,811	
合計	6,585,991	6,585,991	

## （有価証券関係）

## 1. その他有価証券

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	1,032	1,000	32
小計	1,032	1,000	32
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	986	1,000	13
小計	986	1,000	13
合計	2,018	2,000	18

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	1,071	1,000	71
小計	1,071	1,000	71
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1,408	1,500	91
小計	1,408	1,500	91
合計	2,479	2,500	20

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
	千円	千円
退職給付引当金の期首残高	103,292	102,601
退職給付費用	14,918	15,713
退職給付の支払額	15,609	8,777
制度への拠出額		
退職給付引当金の期末残高	102,601	109,538

### (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 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
	千円	千円
非積立型制度の退職給付債務	102,601	109,538
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	102,601	109,538
退職給付引当金	102,601	109,538
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	102,601	109,538

### (3) 退職給付費用

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
	千円	千円
簡便法で計算した退職給付費用	14,918	15,713

## 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 39,525千円、当事業年度 40,250千円であります。

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
(1) 直近の積立状況に関する事項	(2018年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
	千円	千円

年金資産の額	1,669,710,596	1,650,650,110
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)	1,806,457,984	1,782,453,404
差引額	136,747,387	131,803,293
(2) 掛金に占める当社の拠出割合	(2018年3月分) 0.0676%	(2019年3月分) 0.0746%
(3) 補足説明	<p>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197,854,570千円および年金財政計算上の別途積立金61,107,182千円であります。</p> <p>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。</p>	<p>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180,752,834千円および年金財政計算上の別途積立金48,949,540千円であります。</p> <p>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。</p>

## （税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
繰延税金資産	千円	千円
賞与引当金繰入限度超過額	21,743	21,771
役員退職慰労引当金	5,660	5,496
退職給付引当金繰入限度超過額	31,416	33,540
未払事業税	10,663	12,019
未払事業所税	614	618
その他有価証券評価差額金		6
その他	3,174	3,219
繰延税金資産 小計	73,273	76,671
評価性引当額	33,605	39,043
繰延税金資産 合計	39,668	37,628
繰延税金負債	千円	千円
その他有価証券評価差額金	5	
繰延税金負債 合計	5	
繰延税金資産の純額	39,662	37,628

## 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## （1）製品・サービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
信金中央金庫	171,273

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## （1）製品・サービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
信金中央金庫	123,017

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 2018年4月1日 至 2019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	投資信託 の代行手 数料  運用受託 報酬  出向者 人件費  事務所 賃借料	2,086,194 千円  171,273 千円  111,204 千円  49,958 千円	未払 手数料	166,032 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	445,847 千円	未払 手数料	90,195 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 2019年4月1日 至 2020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	投資信託 の代行手 数料  運用受託 報酬  出向者 人件費  事務所 賃借料	2,333,403 千円  123,017 千円  73,481 千円  49,958 千円	未払 手数料	135,102 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	424,462 千円	未払 手数料	85,994 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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
1株当たり純資産額	1,251,922円67銭	1,478,132円90銭
1株当たり当期純利益金額	204,886円98銭	226,218円53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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
当期純利益金額	819,547千円	904,874千円
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	819,547千円	904,874千円
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(2020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(2020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(2020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(2020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とおりです。

- |             |                                        |
|-------------|----------------------------------------|
| (1) 有価証券届出書 | 2019年10月11日<br>2020年4月10日<br>関東財務局長に提出 |
| (2) 有価証券報告書 | 2019年10月11日<br>関東財務局長に提出               |
| (3) 半期報告書   | 2020年4月10日<br>関東財務局長に提出                |

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月12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

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員 公認会計士 小松崎 謙 印

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているしんきんアセットマネジメント投信株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、しんきんアセットマネジメント投信株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 監査意見の根拠

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

#### 財務諸表に対する経営者並びに監査役の責任

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2020年8月26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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているしんきんトピックスオープンの2019年7月19日から2020年7月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、しんきんトピックスオープンの2020年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。