

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成25年5月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファン ニッセイTOPIXオープンドの名称】	
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限5,000億円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ニッセイTOPIXオープン

（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

手数料は変更となる場合があります。

申込手数料につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成25年5月21日（火）～平成26年5月20日（火）

なお、継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されま

す。

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ

(9) 【払込期日】

取得申込者は、各販売会社が定める期日（詳しくは販売会社にお問合せください）までに、申込代金を各販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を經由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

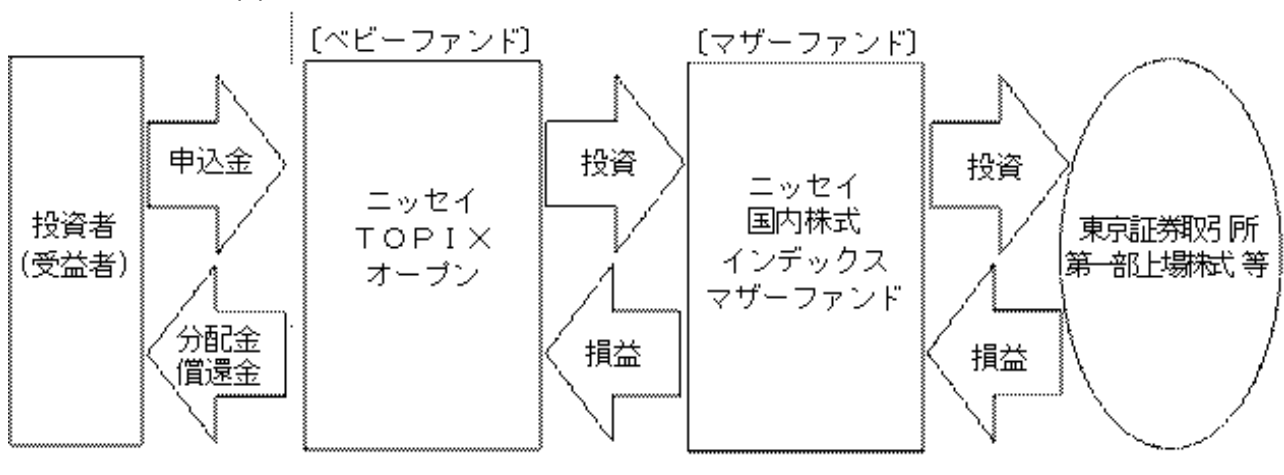
ファンドは、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

<イメージ図>



ファンドの特色

TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果をめざします。

- ・主に「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」に投資することでTOPIXに連動する投資成果をめざします。
- ・マザーファンドの運用は、ニッセイ基礎研究所 が独自に開発したモデルを利用します。なお、モデルについては継続的に評価、分析を行い、必要と判断した場合には、見直しを行うことがあります。

ニッセイ基礎研究所は、日本生命の創業100周年記念事業として1988年7月に設立されたニッセイグループのシンクタンクです。生命保険分野にとどまらず、国内外の経済・金融、資産運用、年金・福祉・雇用に至るまで幅広い分野で、中立公正な立場から基礎的かつ問題解決型の調査・研究を実施しております。

< TOPIXの特徴 >

日本の代表的な株価指数です。

TOPIXは、テレビや新聞などでも日々の動きが報じられており、日本を代表する株価指数の

ひとつです。TOPIXは、東証一部に上場されている銘柄すべての時価総額の増減を表す指数です。

国内株式市場の動きを表します。

東証一部上場銘柄のすべてを対象としているため、TOPIXの動きは国内株式市場全体の動きを表しているといえます。TOPIXは1968年1月4日を基準日としています。この基準日の時価総額を100として、時価総額を指数で表しており、基準日の時価総額に対してどのくらい増えたか減ったかを表します。

TOPIXは、以下の数式で算出されます。

$$\text{TOPIX} = \frac{\text{当日の時価総額}}{\text{基準日の時価総額}} \times 100$$

なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。

TOPIXの著作権等について

TOPIX（東証株価指数）は、株式会社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、株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

5,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

ファンドの商品分類表・属性区分表は以下の通りです（該当区分を網掛け表示しています）。

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象 インデックス

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

商品分類表

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をいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、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をいう。

属性区分表

その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
TOPIX	目論見書または約款において、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

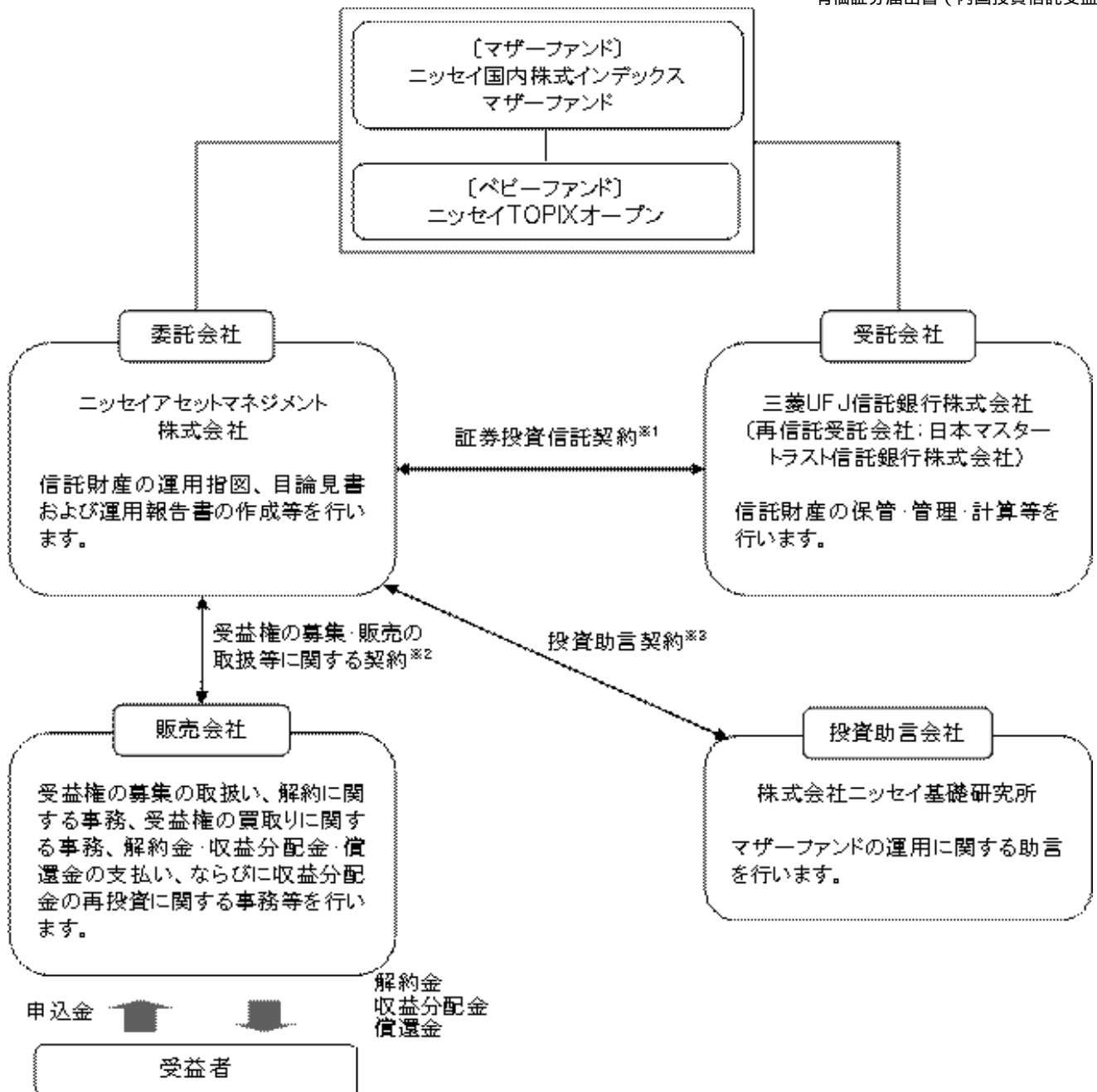
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(2) 【ファンドの沿革】

平成13年4月27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】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（平成25年3月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 宇治原 潔
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 平成7年4月4日

7. 沿革

昭和60年7月1日	ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
平成7年4月4日	ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
平成10年7月1日	ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
平成12年5月8日	定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	97,604株	90.00%
パトナム・ユーエス・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア	10,844株	10.00%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主としてニッセイ国内株式インデックスマザーファンドに投資を行い、TOPIXの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

主として上記マザーファンドに投資を行いますが、追加設定・一部解約にともなう資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。

株式の実質投資割合と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

株式以外の資産の実質組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況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。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

マザーファンドは、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

（２）運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所上場株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIXの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況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。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

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割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

（２）【投資対象】

a 主な投資対象

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドを主要投資対象とします。また、追加設定・一部解約等にともなう資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。

なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限 b 約款に定めるその他の投資制限 先物取引等、スワップ取引および金利先渡取引」に定めるものに限りません）

ハ．金銭債権（イ．およびニ．に掲げるものに該当するものを除きます）

ニ．約束手形（イ．に掲げるものを除きます）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券

主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結されたニッセイ国内株式インデックスマザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます）ならびに次の1．から22．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます）に投資しま

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と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. 特定目的会社にかかる特定社債券（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かかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8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日本の通貨建表示の証券または証書で、1. から11. の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるもので日本の通貨建表示のものとしします）
14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるもので日本の通貨建表示のものとしします）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
16. 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、有価証券にかかるものに限りします）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
18. 外国法人が発行する日本の通貨建表示の譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

なお、1. の証券または証書、12. および17. 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17. 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。

金融商品

信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

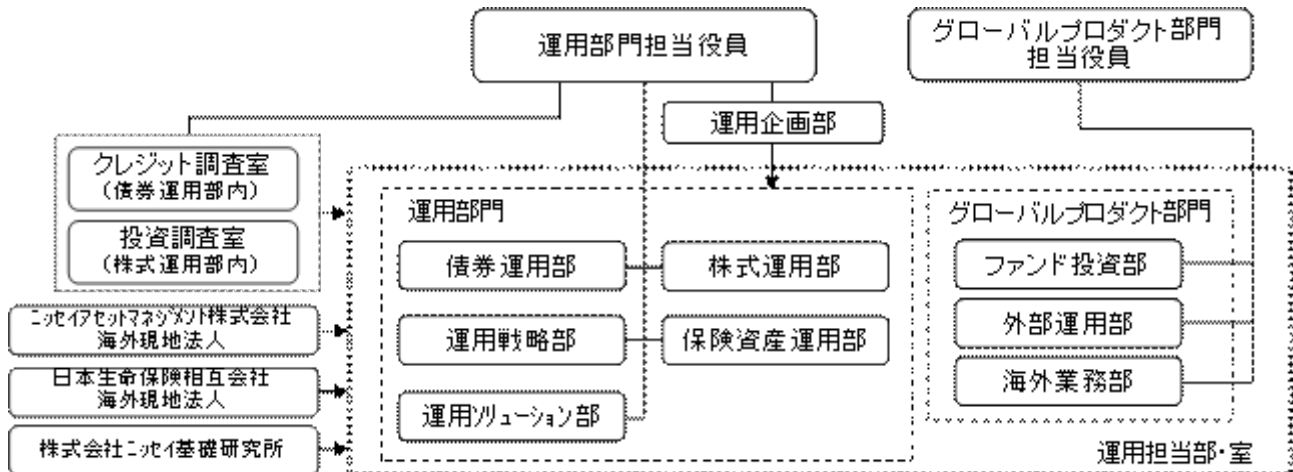
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5．の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記の1．から4．までに掲げる金融商品により運用することができます。

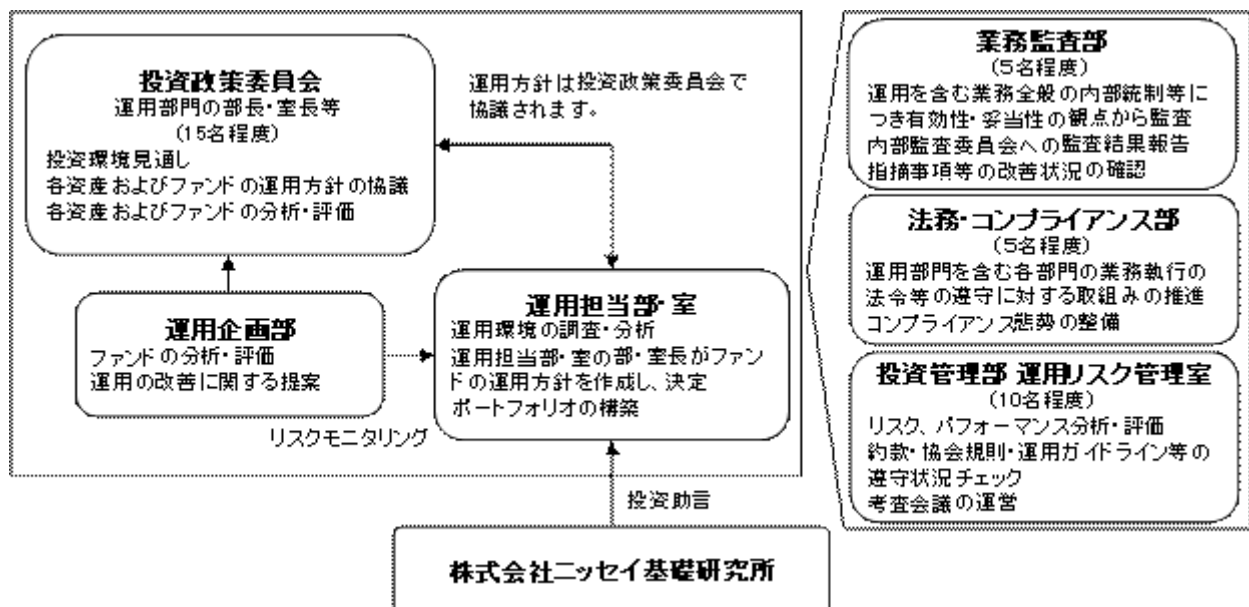
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー・サービス規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、SAS70、SSAE16またはISAE3402（受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準）に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査報告書を、定期的に受託会社より受取っています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

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

2. 分配対象額についての分配方針

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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

3. 留保益の運用方針

特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配時期

毎決算日とし、決算日は2月20日(年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日)です。

支払方法

<分配金受取コースの場合>

税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。

<分配金再投資コースの場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

1. 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、国内の証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。

2. 前記1.にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場することが確認できるものについては、投資することができるものとします。

信用取引の範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当

該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

2. 前記1.の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超える場合には、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済します。
- 先物取引等
1. 国内の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ)ならびに外国の取引所における国内の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ)。
 2. 国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における国内の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

スワップ取引

1. 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、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)を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約します。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価します。
6. 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を行うものとします。

金利先渡取引

1. 信託財産に属する資産を効率的に運用するため、金利先渡取引を行うことができます。
2. 金利先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として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. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価します。
4. 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を行うものとします。

有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。

・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2．前記1．に定める限度額を超えた場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約します。

3．有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行います。

公社債の空売り

1．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属さない公社債を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます）の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

2．前記1．の売付けは、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えた場合には、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済します。

公社債の借入れ

1．信託財産を効率的に運用するため、公社債の借入れをすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行います。

2．前記1．は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3．信託財産の一部解約等により、前記2．の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えた場合には、速やかにその超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還します。

4．上記1．の借入れに関する品借料は信託財産中から支払われます。

資金の借入れ

1．信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行いません。

2．一部解約にともなう支払資金の手当てに関する借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

3．収益分配金の再投資に関する借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c 法令に定める投資制限

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）

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かか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信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、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かかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続す

ることを内容とした運用を行わないものとします。

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、TOPIXの動きに連動することを目標に運用しますので、TOPIXの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。

・流動性リスク

市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはTOPIXに連動する投資成果をめざしますが、主に以下の理由から基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。

- ・ファンドは、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、または、ファンドの構成銘柄のウエイトが当該指数の構成銘柄のウエイトと異なる場合があること
- ・株価指数先物と当該指数の動きの不一致
- ・ファンドは、流動性確保のために現金・預金等を保有すること
- ・ファンドは、信託報酬等の管理費用負担および売買委託手数料等の取引コストを負担すること
- ・ファンドにおける株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する価格の不一致
- ・当該指数の算出に使用する価格と基準価額の算出に使用する価格の不一致
- ・流動性が低下したとき、ファンドにおける株式および株価指数先物の売買の執行が思惑どおりにいかないこと
- ・当該指数の構成銘柄の入替えあるいは当該指数の算出方法の変更による影響

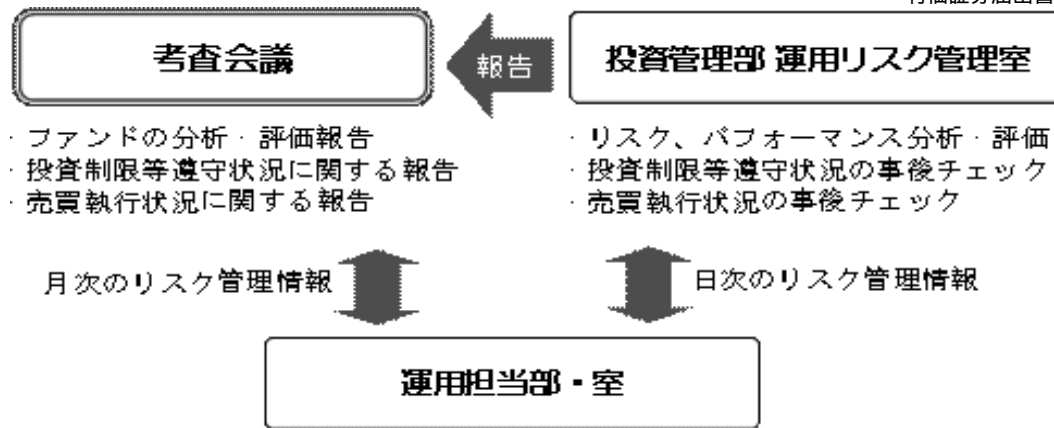
・短期金融資産の運用に関する留意点

コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。

・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

（2）投資リスク管理体制



1. 投資管理部 運用リスク管理室が、以下の通り管理を行います。
 - ・ 運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
 - ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

○ 手数料は変更となる場合があります。

前記についての詳細は、販売会社にお問合せください。なお、販売会社につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.525%（税抜0.5%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分		
委託会社	年0.22575%	(税抜0.215%)
販売会社	年0.22575%	(税抜0.215%)
受託会社	年0.07350%	(税抜0.070%)

前記 の信託報酬については、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払います。

(4) 【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。この他に、先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産中から支払います。

監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に下記の監査報酬率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00210% (税抜0.002%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00315% (税抜0.003%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00525% (税抜0.005%)
10億円以下 の部分	年 0.03150% (税抜0.030%)

信託事務の諸費用

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替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

借入金の利息

信託財産において一部解約金の支払資金の手当て、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入を行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど信託財産中から支払います。

信託財産留保額

換金請求受付日の基準価額に0.3%をかけた額とします。

上記の、およびの費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「4 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

課税対象

- 分配時 : 分配時の「普通分配金」に対して課税されます。
「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。
- 解約請求・償還時 : 個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額の差益に対して課税されます。
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。
- 買取請求時 : 買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。
申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

- 分配時 : 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります）または申告分離課税を選択することもできます。
- 解約請求・償還・買取請求時 : 解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。
解約請求、償還および買取請求時の損益については、確定申告を行い、上場株式等の譲渡損益と通算することができます。

税率（個人）

平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%・復興特別所得税0.147%・地方税3%）
平成26年1月1日から 平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%・地方税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%・地方税5%）

税率は原則として20%（所得税15%・地方税5%）ですが、平成25年12月31日までは軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

確定申告を行い、上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）から上場株式等の譲渡損失を控除することができます。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して以下の税率により源泉徴収されます。

益金不算入制度の適用があります。

税率（法人）

平成25年12月31日まで	7.147%（所得税7%・復興特別所得税0.147%）
平成26年1月1日から 平成49年12月31日まで	15.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%）
平成50年1月1日以降	15%（所得税15%）

税率は原則として15%（所得税のみ）ですが、平成25年12月31日までは軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

個別元本

- 追加型株式投資信託について、受益者毎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かかる消費税等相当額は含まれません）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- 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。
- 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を差引いた額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

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毎に、個別元本の算出が行われます。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毎に、分配金受取コースと分配金再投資コースの両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

収益分配金は分配前の受益者の個別元本と基準価額の関係により、課税扱いの普通分配金と、個別元本の一部払戻しに相当する非課税扱いの元本払戻金（特別分配金）に区分されます。



収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額以上の場合、収益分配金の全額が普通分配金となります。	収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を差引いた額が普通分配金となります。
---	--

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成25年3月29日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	12,382,011,552	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		162,015	0.00
純資産総額		12,381,849,537	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」

(平成25年3月29日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	36,092,732,150	98.48
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		558,395,806	1.52
純資産総額		36,651,127,956	100.00

(注1)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

(注2)その他資産として、下記のとおり株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

資産の名称	取引所	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
東証株価指数先物(買建) (2013年6月限)	東京証券取引所	567,086,975	571,175,000	1.56

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成25年3月29日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	12,774,178,843	9,061	11,574,047,843	9,693	12,382,011,552	100.00
投資比率：合計									100.00

(注1)投資有価証券は1銘柄のみで、簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額であります。

(注2)投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	100.00
合計		100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」

(平成25年3月29日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額(円)		投資比率(%)
						単価	金額	
						下段：評価額(円)		

1	日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	323,800	4,820 4,860	1,560,716,000 1,573,668,000	4.29
2	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	1,883,600	533 558	1,003,958,800 1,051,048,800	2.87
3	日本	ホンダ	株式	輸送用機器	212,600	3,500 3,555	744,100,000 755,793,000	2.06
4	日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	188,100	3,825 3,775	719,482,500 710,077,500	1.94
5	日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	3,208,200	205 199	657,681,000 638,431,800	1.74
6	日本	キヤノン	株式	電気機器	156,600	3,345 3,400	523,827,000 532,440,000	1.45
7	日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	119,000	3,395 4,340	404,005,000 516,460,000	1.41
8	日本	武田薬品工業	株式	医薬品	98,900	4,790 5,030	473,731,000 497,467,000	1.36
9	日本	J T	株式	食料品	156,900	2,941 3,000	461,508,300 470,700,000	1.28
10	日本	三菱地所	株式	不動産業	174,000	2,136 2,596	371,664,000 451,704,000	1.23
11	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	104,700	4,295 4,105	449,686,500 429,793,500	1.17
12	日本	ファナック	株式	電気機器	26,200	14,580 14,490	381,996,000 379,638,000	1.04
13	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	46,500	6,840 7,720	318,060,000 358,980,000	0.98
14	日本	三菱商事	株式	卸売業	194,100	1,924 1,743	373,448,400 338,316,300	0.92
15	日本	日立製作所	株式	電気機器	605,000	524 543	316,930,900 328,515,000	0.90
16	日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	104,100	2,815 3,115	293,041,500 324,271,500	0.88
17	日本	三井不動産	株式	不動産業	117,000	2,130 2,639	249,210,000 308,763,000	0.84
18	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	58,600	5,020 5,060	294,172,000 296,516,000	0.81
19	日本	信越化学工業	株式	化学	47,300	5,740 6,250	271,502,000 295,625,000	0.81
20	日本	野村ホールディングス	株式	証券・商品先物取引業	508,500	544 577	276,624,000 293,404,500	0.80
21	日本	N T T ドコモ	株式	情報・通信業	2,050	141,100 142,100	289,255,000 291,305,000	0.79
22	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	318,400	938 905	298,659,200 288,152,000	0.79
23	日本	三井物産	株式	卸売業	214,700	1,413 1,313	303,371,100 281,901,100	0.77
24	日本	コマツ	株式	機械	123,100	2,410 2,249	296,671,000 276,851,900	0.76
25	日本	K D D I	株式	情報・通信業	70,200	3,465 3,870	243,243,000 271,674,000	0.74
26	日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	82,800	2,809 3,170	232,585,200 262,476,000	0.72

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額(円) 下段：評価額(円)		投資比率(%)
						単価	金額	
27	日本	新日鐵住金	株式	鉄鋼	1,116,000	256 235	285,696,000 262,260,000	0.72
28	日本	ソニー	株式	電気機器	158,400	1,355 1,642	214,632,000 260,092,800	0.71
29	日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	96,400	2,885 2,650	278,114,000 255,460,000	0.70

30	日本	デンソー	株式	輸送用機器	62,300	3,670 3,985	228,641,000 248,265,500	0.68
							投資比率：合計	36.16

(注1) 投資有価証券の評価金額の上位30銘柄について記載しております。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.28
	輸送用機器	10.97
	銀行業	10.61
	情報・通信業	6.03
	化学	5.55
	医薬品	5.07
	機械	5.01
	卸売業	4.82
	小売業	4.35
	陸運業	4.35
	食料品	4.11
	不動産業	3.54
	建設業	2.31
	電気・ガス業	2.24
	保険業	2.23
	サービス業	2.12
	証券、商品先物取引業	1.62
	鉄鋼	1.54
	その他製品	1.35
	精密機器	1.24
	その他金融業	1.14
	非鉄金属	1.00
	ゴム製品	0.97
	ガラス・土石製品	0.87
	繊維製品	0.80
	石油・石炭製品	0.69
	金属製品	0.64
	鉱業	0.55
	空運業	0.52
	海運業	0.33
倉庫・運輸関連業	0.28	
パルプ・紙	0.27	
水産・農林業	0.08	
	合計	98.48

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」

種類	取引所	資産の名称	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	東京証券 取引所	東証株価指数先物 （2013年6月限）	買建	55	567,086,975	571,175,000	1.56

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率であります。

（注2）時価の算定方法

- 1．先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 2．先物取引の評価においては、取引所の発表する清算値段によっております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

平成25年3月29日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

		純資産総額（円）		1万口当たり純資産総額（円）	
第1期末	（平成14年2月20日）	分配付：	4,935,549,001	分配付：	7,067
		分配落：	4,935,549,001	分配落：	7,067
第2期末	（平成15年2月20日）	分配付：	5,030,113,949	分配付：	6,307
		分配落：	5,030,113,949	分配落：	6,307
第3期末	（平成16年2月20日）	分配付：	6,346,644,276	分配付：	7,921
		分配落：	6,346,644,276	分配落：	7,921
第4期末	（平成17年2月21日）	分配付：	5,428,088,572	分配付：	8,798
		分配落：	5,428,088,572	分配落：	8,798
第5期末	（平成18年2月20日）	分配付：	5,549,908,971	分配付：	12,007
		分配落：	5,549,908,971	分配落：	12,007
第6期末	（平成19年2月20日）	分配付：	6,684,138,878	分配付：	13,778
		分配落：	6,684,138,878	分配落：	13,778
第7期末	（平成20年2月20日）	分配付：	6,891,905,695	分配付：	10,163
		分配落：	6,891,905,695	分配落：	10,163
第8期末	（平成21年2月20日）	分配付：	6,512,677,936	分配付：	5,855
		分配落：	6,512,677,936	分配落：	5,855
第9期末	（平成22年2月22日）	分配付：	8,429,590,894	分配付：	7,308
		分配落：	8,429,590,894	分配落：	7,308
第10期末	（平成23年2月21日）	分配付：	8,714,276,623	分配付：	7,946
		分配落：	8,714,276,623	分配落：	7,946
第11期末	（平成24年2月20日）	分配付：	7,946,380,753	分配付：	6,804
		分配落：	7,946,380,753	分配落：	6,804
第12期末	（平成25年2月20日）	分配付：	11,366,392,129	分配付：	8,242
		分配落：	11,366,392,129	分配落：	8,242

		純資産総額（円）		1万口当たり純資産総額（円）	
	平成24年3月末日		8,287,940,656		7,171
	4月末日		8,242,522,554		6,748
	5月末日		7,479,914,246		6,037
	6月末日		8,249,772,711		6,463
	7月末日		8,250,825,690		6,177
	8月末日		8,171,752,418		6,138
	9月末日		8,637,121,807		6,248
	10月末日		8,874,972,152		6,287
	11月末日		9,745,706,472		6,615

	12月末日	10,389,521,348	7,284
	平成25年1月末日	11,192,971,661	7,960
	2月末日	11,335,630,882	8,260
	平成25年3月29日	12,381,849,537	8,835

【分配の推移】

		1万口当たり分配金
第1期	(平成14年2月20日)	0円
第2期	(平成15年2月20日)	0円
第3期	(平成16年2月20日)	0円
第4期	(平成17年2月21日)	0円
第5期	(平成18年2月20日)	0円
第6期	(平成19年2月20日)	0円
第7期	(平成20年2月20日)	0円
第8期	(平成21年2月20日)	0円
第9期	(平成22年2月22日)	0円
第10期	(平成23年2月21日)	0円
第11期	(平成24年2月20日)	0円
第12期	(平成25年2月20日)	0円

【収益率の推移】

		収益率
第1期	自平成13年4月27日 至平成14年2月20日	29.33%
第2期	自平成14年2月21日 至平成15年2月20日	10.75%
第3期	自平成15年2月21日 至平成16年2月20日	25.59%
第4期	自平成16年2月21日 至平成17年2月21日	11.07%

		収益率
第5期	自平成17年2月22日 至平成18年2月20日	36.47%
第6期	自平成18年2月21日 至平成19年2月20日	14.75%
第7期	自平成19年2月21日 至平成20年2月20日	26.24%
第8期	自平成20年2月21日 至平成21年2月20日	42.39%
第9期	自平成21年2月21日 至平成22年2月22日	24.82%
第10期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	8.73%
第11期	自平成23年2月22日 至平成24年2月20日	14.37%
第12期	自平成24年2月21日 至平成25年2月20日	21.13%

(注) 収益率は、以下の計算式により算出しております。ただし、第1期については、前期末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額（10,000円）を用いております。

$$\text{収益率} = (\text{当期末分配付基準価額} - \text{前期末分配落基準価額}) \div \text{前期末分配落基準価額} \times 100$$

(4) 【設定及び解約の実績】

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	自平成13年4月27日 至平成14年2月20日	7,872,922,617	889,092,910	6,983,829,707
第2期	自平成14年2月21日 至平成15年2月20日	2,923,521,467	1,931,287,044	7,976,064,130
第3期	自平成15年2月21日 至平成16年2月20日	2,981,345,792	2,945,224,053	8,012,185,869
第4期	自平成16年2月21日 至平成17年2月21日	962,058,995	2,804,479,623	6,169,765,241
第5期	自平成17年2月22日 至平成18年2月20日	2,145,907,073	3,693,354,013	4,622,318,301
第6期	自平成18年2月21日 至平成19年2月20日	2,760,532,092	2,531,673,089	4,851,177,304
第7期	自平成19年2月21日 至平成20年2月20日	3,231,847,280	1,301,600,051	6,781,424,533
第8期	自平成20年2月21日 至平成21年2月20日	5,902,239,263	1,560,771,658	11,122,892,138
第9期	自平成21年2月21日 至平成22年2月22日	2,915,884,920	2,503,286,588	11,535,490,470
第10期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	1,730,969,712	2,298,999,559	10,967,460,623
第11期	自平成23年2月22日 至平成24年2月20日	1,861,523,446	1,149,596,498	11,679,387,571

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第12期	自平成24年2月21日 至平成25年2月20日	5,323,800,228	3,213,083,842	13,790,103,957

(注) 本邦外における販売又は解約の実績はありません。

〈参考情報〉

2013年3月末現在

● 基準価額・純資産の推移



- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	8,835円
純資産総額	129億円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

第8期	2009年2月20日	0円
第9期	2010年2月22日	0円
第10期	2011年2月21日	0円
第11期	2012年2月20日	0円
第12期	2013年2月20日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

● 組入上位業種(マザーファンド)

	業種	比率
1	電気機器	11.5%
2	輸送用機器	11.1%
3	銀行業	10.8%
4	情報・通信業	6.1%
5	化学	5.6%
6	医薬品	5.2%
7	機械	5.1%
8	卸売業	4.9%
9	小売業	4.4%
10	陸運業	4.4%

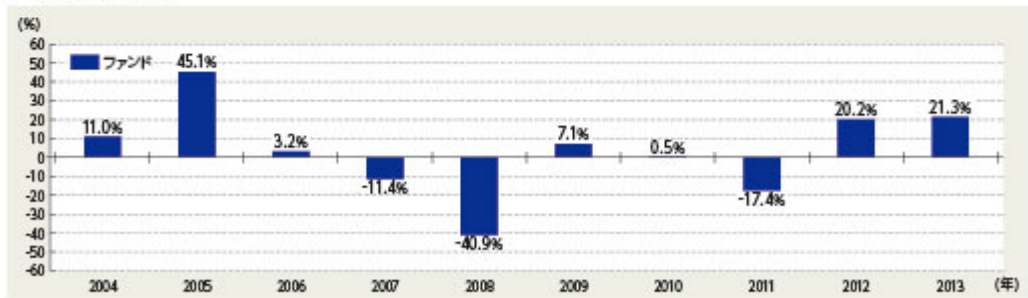
- ・比率は対組入株式評価額比です。

● 組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.4%
2	三菱UFJフィナンシャルG	2.9%
3	本田技研	2.1%
4	三井住友フィナンシャルG	2.0%
5	みずほフィナンシャルG	1.8%
6	キャノン	1.5%
7	ソフトバンク	1.4%
8	武田薬品	1.4%
9	日本たばこ産業	1.3%
10	三菱地所	1.3%

- ・比率は対組入株式評価額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2013年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

- 1) ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。
- 2) 最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受け付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受け付けを中止することおよび既に受け付けた申込みの受け付けを取消することがあります。

取扱コース

分配金の受取方法により、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の2つのコースがあります（販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります）。

分配金再投資コースを選択した場合、販売会社と「自動けいぞく（累積）投資契約」（同様の権利義務を規定する名称の異なる契約または規定も含まれます）を締結します。なお、販売会社によっては、定期引出契約を締結できる場合があります。

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

販売価額

申込価額に申込手数料および申込手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

○ 手数料は変更となる場合があります。

その他

1. ファンドの取得申込者は、販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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かか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、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかか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、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、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。
2. 定期引出契約とは、分配金再投資コースにおいて、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することがあります。

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

1口単位あるいは1万口単位です。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の基準価額から信託財産留保額を差引いた額とします。

<買取請求の場合>

買取価額：買取請求受付日の基準価額から信託財産留保額相当額を差引いた額とします（税法上の一定の要件を満たしている場合）。それ以外の場合は、買取請求受付日の基準価額から、信託財産留保額相当額および当該買取りに関して当該買取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する金額を差引いた額とします。

換金方法および受益者によって課税上の取扱いが異なります。詳細は「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご確認ください。

換金手数料はありません。

信託財産留保額

換金請求受付日の基準価額に0.3%をかけた額とします。

支払開始日

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

その他

1. 受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約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かかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。
2. 換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記の規定に準じて算出した価額とします。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限です。

（４）【計算期間】

毎年2月21日から翌年2月20日までとします。

上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの償還日とします。

（５）【その他】

繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、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。

・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

・やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドの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. 前記2. の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3. の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1. の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ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドの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。
6. 前記3. から5. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記3. の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
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、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更 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の間において存続します。
9. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「 約款の変更 」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。

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、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドの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. 前記2. の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3. の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1. の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該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ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドの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。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1. から5. の規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前記「 繰上償還 」に規定する信託契約の解約または前記「 約款の変更 」に規定する約款の変更を行う場合において、「 繰上償還 3. 」または「 約款の変更 3. 」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買

取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定します。

公告

電子公告により行い、委託会社のホームページ(<http://www.nam.co.jp/>)に掲載します。

電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。

信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドにかかる信託事務の処理の一部について、日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

関係法人との契約の更改等に関する手続き

委託会社と販売会社との間で締結された「受益権の募集・販売の取扱等に関する契約」は、契約期間満了の3ヶ月前までに委託会社、販売会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

委託会社と投資助言会社との間で締結された「投資助言契約」は、契約期間満了の1ヶ月前までに委託会社、投資助言会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者には、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利があります。

分配金受取コースの場合、税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日目までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

分配金再投資コースの場合、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。再投資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。

(2) 償還金に対する請求権

受益者には、持分に応じて償還金を請求する権利があります。原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

(3) 解約請求権

受益者には、持分に応じて解約請求する権利があります。権利行使の方法等については、前記「2 換金(解約)手続等」の項をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」の項をご参照ください。

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、第12期計算期間（平成24年2月21日から平成25年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

ニッセイTOPIXオープン

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成24年2月20日現在)	第12期 (平成25年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,449,275	24,657,671
親投資信託受益証券	7,946,713,383	11,366,537,265
未収入金	15,030,336	22,608,010
流動資産合計	7,980,192,994	11,413,802,946
資産合計		
	7,980,192,994	11,413,802,946
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,691,789	21,803,736
未払受託者報酬	2,635,372	3,538,085
未払委託者報酬	16,188,981	21,734,142
その他未払費用	296,099	334,854
流動負債合計	33,812,241	47,410,817
負債合計		
	33,812,241	47,410,817
純資産の部		
元本等		
元本	11,679,387,571	13,790,103,957
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,733,006,818	2,423,711,828
純資産合計	7,946,380,753	11,366,392,129
負債純資産合計	7,980,192,994	11,413,802,946

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月20日）	第12期 （自平成24年2月21日 至平成25年2月20日）
営業収益		
受取利息	4,954	6,519
有価証券売買等損益	1,193,850,898	2,243,395,239
営業収益合計	1,193,845,944	2,243,401,758
営業費用		
受託者報酬	5,482,223	6,478,776
委託者報酬	33,676,986	39,798,619
その他費用	601,260	643,544
営業費用合計	39,760,469	46,920,939
営業利益又は営業損失（ ）	1,233,606,413	2,196,480,819
経常利益又は経常損失（ ）	1,233,606,413	2,196,480,819
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,233,606,413	2,196,480,819
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（ ）	146,476,579	72,434,432
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,253,184,000	3,733,006,818
剰余金増加額又は欠損金減少額	250,057,596	1,062,438,165
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	250,057,596	1,062,438,165
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	642,750,580	1,877,189,562
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	642,750,580	1,877,189,562
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,733,006,818	2,423,711,828

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、計算期間末日の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(追加情報)

第12期 (自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)
第12期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 (平成24年2月20日現在)	第12期 (平成25年2月20日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	11,679,387,571口	13,790,103,957口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	3,733,006,818円	2,423,711,828円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6804円 (6,804円)	0.8242円 (8,242円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月20日)	第12期 (自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)
分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(4,651,226,648円)、及び分配準備積立金(607,961,243円)より、分配対象収益は5,259,187,891円(1口当たり0.450297円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,474円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(93,451,141円)、収益調整金(5,729,452,614円)、及び分配準備積立金(484,579,903円)より、分配対象収益は6,307,490,132円(1口当たり0.457393円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第11期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月20日)	第12期 (自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)

<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは親投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは親投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>
---	---

<p>第11期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月20日)</p>	<p>第12期 (自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)</p>
<p>4. 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ることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>4. 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ることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成24年2月20日現在)	第12期 (平成25年2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>1. 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第11期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月20日)	第12期 (自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第11期 (平成24年2月20日現在)	第12期 (平成25年2月20日現在)
期首元本額	10,967,460,623円	11,679,387,571円
期中追加設定元本額	1,861,523,446円	5,323,800,228円
期中一部解約元本額	1,149,596,498円	3,213,083,842円

2 有価証券関係

第11期（平成24年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,042,867,687
合計	1,042,867,687

第12期（平成25年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,162,851,945
合計	2,162,851,945

3 デリバティブ取引関係

第11期（平成24年2月20日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成25年2月20日現在）

該当事項はありません。

(4) 【 附属明細表 】

第 1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	ニッセイ国内株式インデッ クスマザーファンド	12,574,994,209	11,366,537,265	
合計		12,574,994,209	11,366,537,265	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

< 参考 >

開示対象ファンド（ニッセイTOPIXオープン）は、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの計算期間末日（以下、「計算日」という。）における同マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成24年2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	228,695,144	355,030,995
株式	28,502,185,220	34,441,711,410
派生商品評価勘定	10,246,530	3,960,035
未収入金	335,046,440	226,853,598
未収配当金	30,808,593	39,226,802
差入委託証拠金	12,285,000	11,100,000
流動資産合計	29,119,266,927	35,077,882,840
資産合計	29,119,266,927	35,077,882,840
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	21,890
前受金	22,205,000	480,000
未払金	14,612,910	22,841,342
未払解約金	47,283,538	47,471,237
流動負債合計	84,101,448	70,814,469
負債合計	84,101,448	70,814,469
純資産の部		

元本等		
元本	39,093,719,161	38,727,108,836
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,058,553,682	3,720,040,465
純資産合計	29,035,165,479	35,007,068,371
負債純資産合計	29,119,266,927	35,077,882,840

(2) 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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、証券取引所における計算日の最終相場によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。 本マザーファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。 (2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	39,093,719,161口	38,727,108,836口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	10,058,553,682円	3,720,040,465円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7427円 (7,427円)	0.9039円 (9,039円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

(自平成23年2月22日 至平成24年2月20日)	(自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)
1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

<p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 本マザーファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは株価変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されておりま。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	<p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 本マザーファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは株価変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されておりま。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>
---	---

<p>(自平成23年2月22日 至平成24年2月20日)</p> <p>4. 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ることもあります。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、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>(自平成24年2月21日 至平成25年2月20日)</p> <p>4. 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ることもあります。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、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
--	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>1. 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>2. デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>3. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>2. デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>3. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成23年2月22日 至平成24年2月20日）	（自平成24年2月21日 至平成25年2月20日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（その他の注記）

1 開示対象ファンドの計算期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成24年2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
同計算期間の期首元本額	38,794,942,704円	39,093,719,161円
同計算期間中の追加設定元本額	5,670,759,718円	7,478,922,775円
同計算期間中の一部解約元本額	5,371,983,261円	7,845,533,100円
同計算期間末日の元本額	39,093,719,161円	38,727,108,836円
上記元本額の内訳		
ニッセイTOPIXオープン	10,699,762,197円	12,574,994,209円
ニッセイ国内株式インデックスSA（適格機関投資家限定）	23,653,684,972円	22,357,621,080円
ニッセイ日本バランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	188,809,005円	136,305,850円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	309,578,192円	237,305,200円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	364,167,872円	293,988,947円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	2,332,842,758円	1,638,573,542円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	1,544,874,165円	1,488,320,008円
合計	39,093,719,161円	38,727,108,836円

2 有価証券関係

（平成24年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	4,977,075,182
合計	4,977,075,182

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、本マザーファンドの期首（平成23年2月22日）から計算日までの期間に対応するものであります。

（平成25年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,711,894,485
合計	5,711,894,485

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、本マザーファンドの期首（平成24年2月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

（平成24年2月20日現在）

株式関連

区分	種類	契約額等（円）	契約額等のうち 1年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	366,033,470	-	376,280,000	10,246,530
合計		366,033,470	-	376,280,000	10,246,530

（注1）時価の算定方法

- 1．先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 2．先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。

（注2）評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首（平成23年2月22日）から計算日までの期間に対応するものであります。

（注3）上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（平成25年2月20日現在）

株式関連

区分	種類	契約額等（円）	契約額等のうち 1年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	375,336,855	-	379,275,000	3,938,145
合計		375,336,855	-	379,275,000	3,938,145

（注1）時価の算定方法

- 1．先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 2．先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。

（注2）評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首（平成24年2月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

（注3）上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（3）附属明細表（平成25年2月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	12,000	209	2,508,000	
日本水産	30,900	179	5,531,100	
マルハニチロホールディングス	56,000	155	8,680,000	
サカタのタネ	4,200	1,163	4,884,600	
ホクト	2,900	1,737	5,037,300	
ショーボンドホールディングス	2,600	3,270	8,502,000	
ミライト・ホールディングス	8,200	883	7,240,600	
住石ホールディングス	7,500	90	675,000	
日鉄鉱業	7,000	471	3,297,000	
三井松島産業	19,000	189	3,591,000	
国際石油開発帝石	350	512,000	179,200,000	
日本海洋掘削	700	3,355	2,348,500	
関東天然瓦斯開発	3,000	497	1,491,000	
石油資源開発	4,100	3,625	14,862,500	
ダイセキ環境ソリューション	9	131,700	1,185,300	

ハザマ	10,000	236	2,360,000
東急建設	10,200	217	2,213,400
コムシスホールディングス	14,000	1,178	16,492,000
ミサワホーム	3,400	1,193	4,056,200
高松コンストラクショングループ	2,200	1,355	2,981,000
東建コーポレーション	1,070	5,080	5,435,600
ヤマウラ	4,000	273	1,092,000
大成建設	145,000	263	38,135,000
大林組	86,000	467	40,162,000
清水建設	88,000	288	25,344,000
飛島建設	17,800	106	1,886,800
長谷工コーポレーション	180,000	80	14,400,000
鹿島	126,000	266	33,516,000
不動テトラ	20,300	174	3,532,200
鉄建	17,000	118	2,006,000
安藤建設	10,000	124	1,240,000
太平工業	5,000	366	1,830,000
西松建設	35,000	167	5,845,000
三井住友建設	40,100	75	3,007,500
大豊建設	10,000	119	1,190,000
前田建設工業	18,000	354	6,372,000
佐田建設	14,000	83	1,162,000
ナカノフドー建設	4,500	283	1,273,500
奥村組	25,000	390	9,750,000
大和小田急建設	6,000	200	1,200,000
東鉄工業	3,700	1,336	4,943,200
イチケン	7,000	175	1,225,000
戸田建設	33,000	208	6,864,000
熊谷組	20,000	102	2,040,000
北野建設	7,000	223	1,561,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
植木組	6,000	190	1,140,000	
三井ホーム	4,000	496	1,984,000	
矢作建設工業	3,600	419	1,508,400	
ピーエス三菱	2,300	520	1,196,000	
大東建託	10,900	8,350	91,015,000	
N I P P O	7,000	1,224	8,568,000	
東亜道路工業	5,000	322	1,610,000	
前田道路	8,000	1,351	10,808,000	
日本道路	9,000	396	3,564,000	
東亜建設工業	25,000	139	3,475,000	
若築建設	15,000	109	1,635,000	
東洋建設	8,900	293	2,607,700	
五洋建設	34,000	224	7,616,000	
大林道路	3,000	372	1,116,000	
福田組	4,000	363	1,452,000	
住友林業	19,800	895	17,721,000	
日本基礎技術	3,700	319	1,180,300	
日成ビルド工業	9,000	187	1,683,000	
エス・バイ・エル	15,000	159	2,385,000	
巴コーポレーション	3,900	327	1,275,300	
パナホーム	11,000	579	6,369,000	
大和ハウス工業	72,000	1,671	120,312,000	
ライト工業	6,400	446	2,854,400	
積水ハウス	86,000	1,049	90,214,000	
ユアテック	5,000	293	1,465,000	
西部電気工業	3,000	400	1,200,000	
四電工	2,000	311	622,000	

中電工	4,200	932	3,914,400
関電工	13,000	440	5,720,000
きんでん	19,000	620	11,780,000
東京エネシス	3,000	458	1,374,000
トーエネック	4,000	469	1,876,000
住友電設	2,000	1,178	2,356,000
日本電設工業	5,000	928	4,640,000
協和エクシオ	10,300	997	10,269,100
新日本空調	2,300	499	1,147,700
日本工営	9,000	327	2,943,000
N D S	4,000	282	1,128,000
九電工	5,000	458	2,290,000
三機工業	7,000	497	3,479,000
日揮	29,000	2,427	70,383,000
中外炉工業	9,000	242	2,178,000
太平電業	4,000	531	2,124,000
高砂熱学工業	8,200	682	5,592,400
三晃金属工業	5,000	239	1,195,000
N E C ネットズエスアイ	2,400	1,671	4,010,400
朝日工業社	4,000	301	1,204,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アタカ大機	3,000	333	999,000	
大気社	4,100	1,928	7,904,800	
ダイダン	4,000	507	2,028,000	
日比谷総合設備	3,500	1,017	3,559,500	
東芝プラントシステム	5,000	1,197	5,985,000	
日本製粉	18,000	399	7,182,000	
日清製粉グループ本社	26,000	1,137	29,562,000	
日東富士製粉	4,000	312	1,248,000	
昭和産業	12,000	297	3,564,000	
鳥越製粉	2,300	625	1,437,500	
協同飼料	11,000	107	1,177,000	
中部飼料	2,500	549	1,372,500	
日本配合飼料	10,000	119	1,190,000	
日本甜菜製糖	15,000	173	2,595,000	
三井製糖	11,000	318	3,498,000	
ネクスト	1,200	1,051	1,261,200	
日本M & Aセンター	1,400	3,210	4,494,000	
ノバレーゼ	20	57,600	1,152,000	
アコーディア・ゴルフ	118	82,000	9,676,000	
パソナグループ	27	45,000	1,215,000	
G C A サヴィアングループ	1,300	874	1,136,200	
エス・エム・エス	7	207,600	1,453,200	
テンプホールディングス	3,700	1,388	5,135,600	
クックパッド	800	3,110	2,488,000	
森永製菓	28,000	197	5,516,000	
中村屋	7,000	414	2,898,000	
江崎グリコ	10,000	894	8,940,000	
名糖産業	1,300	978	1,271,400	
不二家	16,000	196	3,136,000	
山崎製パン	21,000	1,087	22,827,000	
モロゾフ	4,000	296	1,184,000	
亀田製菓	1,600	2,179	3,486,400	
カルビー	2,600	8,100	21,060,000	
森永乳業	24,000	284	6,816,000	
ヤクルト本社	16,800	3,365	56,532,000	
明治ホールディングス	8,500	3,910	33,235,000	
雪印メグミルク	5,600	1,443	8,080,800	

プリマハム	16,000	176	2,816,000
日本ハム	22,000	1,396	30,712,000
伊藤ハム	16,000	438	7,008,000
丸大食品	14,000	305	4,270,000
米久	2,500	946	2,365,000
S FOODS	2,000	899	1,798,000
スタジオアリス	1,200	1,262	1,514,400
シミックホールディングス	1,000	1,442	1,442,000
システナ	27	82,200	2,219,400
NECフィールドディング	2,200	1,073	2,360,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
新日鉄住金ソリューションズ	1,700	1,759	2,990,300	
総合警備保障	9,800	1,231	12,063,800	
日本駐車場開発	275	5,780	1,589,500	
コア	1,600	739	1,182,400	
カカクコム	3,600	3,540	12,744,000	
新日本科学	2,600	462	1,201,200	
ツクイ	1,200	1,638	1,965,600	
エムスリー	63	162,000	10,206,000	
ディー・エヌ・エー	13,200	2,574	33,976,800	
博報堂DYホールディングス	3,720	6,820	25,370,400	
ぐるなび	1,900	962	1,827,800	
一休	17	84,700	1,439,900	
ジェイコムホールディングス	1,600	720	1,152,000	
PGMホールディングス	38	69,700	2,648,600	
サッポロホールディングス	47,000	316	14,852,000	
アサヒグループホールディングス	57,800	2,286	132,130,800	
麒麟ホールディングス	123,000	1,291	158,793,000	
宝ホールディングス	23,000	806	18,538,000	
オエノンホールディングス	7,000	245	1,715,000	
養命酒製造	2,000	784	1,568,000	
三国コカ・コーラボトリング	3,000	975	2,925,000	
コカ・コーラウエスト	9,700	1,529	14,831,300	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,600	1,260	4,536,000	
ダイドードリンコ	1,500	3,890	5,835,000	
伊藤園	7,800	1,862	14,523,600	
キーコーヒー	2,500	1,578	3,945,000	
ユニカフェ	2,200	530	1,166,000	
ジャパンフーズ	1,200	983	1,179,600	
日清オイリオグループ	12,000	328	3,936,000	
不二製油	7,000	1,343	9,401,000	
J-オイルミルズ	12,000	282	3,384,000	
ローソン	9,600	7,180	68,928,000	
サンエー	1,000	3,860	3,860,000	
ダイユーエイト	1,800	645	1,161,000	
カワチ薬品	1,800	1,887	3,396,600	
エービーシー・マート	3,000	3,355	10,065,000	
高千穂交易	1,300	909	1,181,700	
アスクル	2,200	1,249	2,747,800	
ゲオホールディングス	43	91,300	3,925,900	
ポイント	2,330	3,240	7,549,200	
伊藤忠食品	600	3,220	1,932,000	
くらコーポレーション	1,500	1,288	1,932,000	
キャンドウ	13	120,400	1,565,200	
エレマテック	1,200	1,275	1,530,000	
バル	750	4,265	3,198,750	
JALUX	1,300	901	1,171,300	
エディオン	10,900	401	4,370,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
あらた	6,000	336	2,016,000	
サーラコーポレーション	2,400	488	1,171,200	
ひらまつ	9	182,800	1,645,200	
双日	159,600	140	22,344,000	
ゲンキー	600	2,038	1,222,800	
アルフレッサ ホールディングス	6,600	4,515	29,799,000	
大黒天物産	500	2,281	1,140,500	
ハニーズ	2,000	1,149	2,298,000	
キッコーマン	23,000	1,383	31,809,000	
味の素	76,000	1,203	91,428,000	
キューピー	14,600	1,241	18,118,600	
ハウス食品	10,100	1,466	14,806,600	
カゴメ	10,300	1,723	17,746,900	
焼津水産化学工業	1,400	805	1,127,000	
アリアケジャパン	2,600	1,772	4,607,200	
ニチレイ	32,000	481	15,392,000	
ヨコレイ	6,300	679	4,277,700	
東洋水産	13,000	2,795	36,335,000	
日清食品ホールディングス	11,200	3,670	41,104,000	
永谷園	3,000	881	2,643,000	
フジッコ	3,000	1,055	3,165,000	
ロック・フィールド	1,500	1,553	2,329,500	
J T	127,500	2,895	369,112,500	
ケンコーマヨネーズ	1,300	873	1,134,900	
わらべや日洋	1,700	1,483	2,521,100	
なとり	1,300	916	1,190,800	
片倉工業	3,400	876	2,978,400	
グンゼ	20,000	236	4,720,000	
ヒューリック	32,800	640	20,992,000	
山下医科器械	700	1,369	958,300	
ラサ商事	2,400	480	1,152,000	
アルペン	1,900	1,678	3,188,200	
アルコニックス	700	1,642	1,149,400	
ビックカメラ	96	46,350	4,449,600	
D C Mホールディングス	13,200	629	8,302,800	
MonotaRO	1,700	3,555	6,043,500	
あい ホールディングス	4,500	713	3,208,500	
J . フロント リテイリング	60,000	550	33,000,000	
ドトール・日レスホールディングス	4,400	1,289	5,671,600	
マツモトキヨシホールディングス	4,300	2,447	10,522,100	
スタートトゥデイ	5,300	968	5,130,400	
ココカラファイン	2,600	2,962	7,701,200	
三越伊勢丹ホールディングス	50,300	969	48,740,700	
東洋紡	114,000	167	19,038,000	
ユニチカ	73,000	52	3,796,000	
富士紡ホールディングス	13,000	277	3,601,000	
日清紡ホールディングス	17,000	662	11,254,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
クラブウ	28,000	158	4,424,000	
ダイワボウホールディングス	23,000	184	4,232,000	
シキボウ	16,000	115	1,840,000	
日東紡績	20,000	354	7,080,000	
トヨタ紡織	9,000	1,290	11,610,000	
ウエルシアホールディングス	900	4,030	3,627,000	

クリエイティブSDホールディングス	1,100	2,958	3,253,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,800	852	4,089,600
八洲電機	3,000	386	1,158,000
UKCホールディングス	1,500	1,932	2,898,000
TOKAIホールディングス	9,900	295	2,920,500
日本毛織	8,000	621	4,968,000
ダイドーリミテッド	3,000	663	1,989,000
東京建物不動産販売	3,400	351	1,193,400
野村不動産ホールディングス	12,200	1,577	19,239,400
常和ホールディングス	700	1,761	1,232,700
帝国繊維	3,000	761	2,283,000
ブックオフコーポレーション	1,700	687	1,167,900
日本コークス工業	21,500	123	2,644,500
ミタチ産業	2,600	450	1,170,000
あさひ	1,500	1,243	1,864,500
日本調剤	510	2,300	1,173,000
コスモス薬品	1,300	10,900	14,170,000
シップヘルスケアホールディングス	3,600	2,513	9,046,800
ソフトクリエイティブホールディングス	800	1,455	1,164,000
セブン&アイ・ホールディングス	106,000	2,815	298,390,000
ツルハホールディングス	2,500	8,080	20,200,000
サンマルクホールディングス	800	3,655	2,924,000
フェリシモ	1,000	1,100	1,100,000
トリドール	2,200	937	2,061,400
クスリのアオキ	400	6,060	2,424,000
帝人	102,000	218	22,236,000
東レ	208,000	565	117,520,000
クラレ	45,800	1,233	56,471,400
旭化成	168,000	564	94,752,000
稲葉製作所	1,100	1,091	1,200,100
宮地エンジニアリンググループ	9,000	159	1,431,000
トーカロ	1,500	1,403	2,104,500
アルファ	800	1,081	864,800
SUMCO	16,400	926	15,186,400
川田テクノロジーズ	600	1,816	1,089,600
住江織物	7,000	214	1,498,000
イチカワ	7,000	164	1,148,000
日本バイリーン	3,000	429	1,287,000
芦森工業	9,000	133	1,197,000
アツギ	22,000	110	2,420,000
ダイニック	7,000	178	1,246,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
共和レザー	4,000	294	1,176,000	
セーレン	7,200	563	4,053,600	
東海染工	11,000	106	1,166,000	
小松精練	4,000	393	1,572,000	
ワコールホールディングス	16,000	951	15,216,000	
ホギメディカル	1,700	4,690	7,973,000	
レナウン	8,000	144	1,152,000	
クラウディア	1,000	1,220	1,220,000	
TSIホールディングス	13,800	487	6,720,600	
デジタルハーツ	1,700	687	1,167,900	
ITホールディングス	8,400	1,124	9,441,600	
グリー	13,100	1,142	14,960,200	
コーエーテクモホールディングス	5,000	797	3,985,000	
三菱総合研究所	1,000	1,884	1,884,000	
ネクソン	20,800	883	18,366,400	
エイチーム	400	2,705	1,082,000	

特種東海製紙	16,000	214	3,424,000
ドワンゴ	13	233,400	3,034,200
マクロミル	2,000	1,007	2,014,000
ティーガイア	3,100	962	2,982,200
GMOペイメントゲートウェイ	800	1,671	1,336,800
ザッパラス	14	98,300	1,376,200
インターネットイニシアティブ	3,000	2,531	7,593,000
SRAホールディングス	1,200	997	1,196,400
王子ホールディングス	119,000	339	40,341,000
三菱製紙	38,000	93	3,534,000
北越紀州製紙	16,500	475	7,837,500
中越パルプ工業	10,000	146	1,460,000
大王製紙	12,000	638	7,656,000
日本製紙グループ本社	13,000	1,461	18,993,000
レンゴー	22,000	460	10,120,000
トーモク	8,000	266	2,128,000
ザ・バック	1,900	1,611	3,060,900
コープケミカル	10,000	112	1,120,000
昭和電工	167,000	132	22,044,000
住友化学	185,000	279	51,615,000
日本化成	9,000	143	1,287,000
住友精化	5,000	326	1,630,000
日産化学工業	19,100	1,168	22,308,800
ラサ工業	10,000	119	1,190,000
クレハ	19,000	349	6,631,000
テイカ	5,000	269	1,345,000
石原産業	48,000	83	3,984,000
片倉チッカリン	5,000	223	1,115,000
日本曹達	16,000	412	6,592,000
東ソー	72,000	241	17,352,000
トクヤマ	39,000	222	8,658,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
セントラル硝子	24,000	285	6,840,000	
東亜合成	32,000	389	12,448,000	
ダイソー	11,000	267	2,937,000	
関東電化工業	7,000	176	1,232,000	
電気化学工業	54,000	340	18,360,000	
イビデン	15,600	1,376	21,465,600	
信越化学工業	48,200	5,740	276,668,000	
日本カ-バイド工業	8,000	394	3,152,000	
堺化学工業	10,000	259	2,590,000	
エア・ウォーター	22,000	1,252	27,544,000	
大陽日酸	35,000	652	22,820,000	
日本化学工業	10,000	120	1,200,000	
日本パーカライジング	6,000	1,516	9,096,000	
高圧ガス工業	4,000	507	2,028,000	
四国化成工業	4,000	632	2,528,000	
戸田工業	4,000	328	1,312,000	
ステラ ケミファ	1,200	1,771	2,125,200	
保土谷化学工業	7,000	172	1,204,000	
日本触媒	20,000	884	17,680,000	
大日精化工業	10,000	427	4,270,000	
カネカ	33,000	499	16,467,000	
協和発酵キリン	32,000	907	29,024,000	
三菱ガス化学	42,000	644	27,048,000	
三井化学	114,000	208	23,712,000	
JSR	26,500	1,976	52,364,000	
東京応化工業	5,200	1,947	10,124,400	

大阪有機化学工業	3,100	379	1,174,900
三菱ケミカルホールディングス	168,000	416	69,888,000
日本合成化学工業	5,000	696	3,480,000
ダイセル	32,000	718	22,976,000
住友ベークライト	21,000	387	8,127,000
積水化学工業	55,000	889	48,895,000
日本ゼオン	23,000	896	20,608,000
アイカ工業	7,500	1,546	11,595,000
宇部興産	129,000	190	24,510,000
積水樹脂	4,000	1,146	4,584,000
タキロン	6,000	347	2,082,000
旭有機材工業	9,000	211	1,899,000
日立化成工業	11,600	1,333	15,462,800
リケンテクノス	4,000	264	1,056,000
大倉工業	6,000	422	2,532,000
積水化成成品工業	7,000	218	1,526,000
群栄化学工業	7,000	221	1,547,000
タイガースポリマー	3,500	335	1,172,500
ミライアル	700	1,764	1,234,800
日本カーリット	2,600	459	1,193,400
日本化薬	19,000	1,059	20,121,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
イーピーエス	16	227,500	3,640,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	600	1,996	1,197,600	
アミューズ	800	1,817	1,453,600	
野村総合研究所	14,300	2,049	29,300,700	
サイバネットシステム	47	25,440	1,195,680	
T A C	6,100	195	1,189,500	
ケネディクス	256	20,170	5,163,520	
電通	24,400	2,815	68,686,000	
インテージ	700	2,091	1,463,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	120	9,540	1,144,800	
シンプレクス・ホールディングス	47	29,810	1,401,070	
イオンファンタジー	900	1,339	1,205,100	
日本精化	2,200	582	1,280,400	
A D E K A	11,600	824	9,558,400	
日油	21,000	422	8,862,000	
ミヨシ油脂	9,000	179	1,611,000	
ハリマ化成グループ	2,500	457	1,142,500	
花王	71,300	2,961	211,119,300	
第一工業製薬	5,000	233	1,165,000	
三洋化成工業	8,000	501	4,008,000	
武田薬品工業	100,700	4,790	482,353,000	
アステラス製薬	59,700	5,020	299,694,000	
大日本住友製薬	19,000	1,273	24,187,000	
塩野義製薬	39,200	1,803	70,677,600	
田辺三菱製薬	22,400	1,332	29,836,800	
あすか製薬	3,000	599	1,797,000	
日本新薬	6,000	1,192	7,152,000	
中外製薬	31,200	2,000	62,400,000	
科研製薬	11,000	1,545	16,995,000	
エーザイ	33,100	3,905	129,255,500	
ロート製薬	11,000	1,172	12,892,000	
小野薬品工業	13,100	4,930	64,583,000	
久光製薬	8,300	5,210	43,243,000	
有機合成薬品工業	5,000	251	1,255,000	
持田製薬	10,000	1,151	11,510,000	

参天製薬	9,200	4,270	39,284,000
扶桑薬品工業	9,000	364	3,276,000
日本ケミファ	4,000	585	2,340,000
ツムラ	7,300	3,200	23,360,000
日医工	3,900	1,908	7,441,200
テルモ	19,700	4,095	80,671,500
みらかホールディングス	7,000	4,405	30,835,000
キッセイ薬品工業	5,000	1,812	9,060,000
生化学工業	5,100	994	5,069,400
栄研化学	1,900	1,238	2,352,200
日水製薬	1,200	972	1,166,400
鳥居薬品	1,600	2,170	3,472,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東和薬品	1,400	5,060	7,084,000	
沢井製薬	1,800	9,980	17,964,000	
ゼリア新薬工業	4,000	1,420	5,680,000	
第一三共	84,800	1,632	138,393,600	
キョーリン製薬ホールディングス	7,200	2,055	14,796,000	
大幸薬品	1,300	872	1,133,600	
ダイト	600	1,326	795,600	
大塚ホールディングス	53,300	2,963	157,927,900	
大正製薬ホールディングス	6,500	6,350	41,275,000	
大日本塗料	15,000	164	2,460,000	
日本ペイント	23,000	859	19,757,000	
関西ペイント	30,000	995	29,850,000	
中国塗料	8,000	497	3,976,000	
藤倉化成	3,100	376	1,165,600	
太陽ホールディングス	2,200	2,730	6,006,000	
D I C	95,000	184	17,480,000	
サカタインクス	5,000	505	2,525,000	
東洋インキS Cホールディングス	24,000	412	9,888,000	
アルプス技研	1,500	800	1,200,000	
サニックス	3,900	429	1,673,100	
日本空調サービス	1,500	798	1,197,000	
オリエンタルランド	8,000	12,970	103,760,000	
ダスキン	7,400	1,828	13,527,200	
パーク24	13,200	1,563	20,631,600	
明光ネットワークジャパン	2,400	1,053	2,527,200	
ファルコS Dホールディングス	1,400	1,047	1,465,800	
クレスコ	1,800	639	1,150,200	
フジ・メディア・ホールディングス	245	151,800	37,191,000	
秀英予備校	3,200	362	1,158,400	
田谷	1,600	725	1,160,000	
ラウンドワン	8,400	641	5,384,400	
リゾートトラスト	4,500	1,986	8,937,000	
オービック	870	19,430	16,904,100	
ヤフー	1,855	39,500	73,272,500	
ビー・エム・エル	1,600	2,362	3,779,200	
トレンドマイクロ	10,100	2,664	26,906,400	
もしもしホットライン	4,400	1,281	5,636,400	
東急コミュニティー	700	3,505	2,453,500	
リソー教育	272	8,030	2,184,160	
日本オラクル	5,100	3,955	20,170,500	
アルファシステムズ	1,000	1,130	1,130,000	
フューチャーアーキテクト	32	37,950	1,214,400	
ウェアハウス	1,700	299	508,300	
シーエーシー	1,500	764	1,146,000	
トーセ	2,000	582	1,164,000	

ユー・エス・エス	3,000	9,910	29,730,000	
オービックビジネスコンサルタント	800	5,070	4,056,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
伊藤忠テクノソリューションズ	3,000	3,820	11,460,000	
アイティフォー	3,400	344	1,169,600	
東京個別指導学院	4,900	236	1,156,400	
東計電算	900	1,249	1,124,100	
エクスネット	9	127,400	1,146,600	
テー・オー・ダブリュー	2,200	542	1,192,400	
大塚商会	2,300	8,410	19,343,000	
総合メディカル	600	3,030	1,818,000	
サイボウズ	47	25,470	1,197,090	
アグレックス	1,400	849	1,188,600	
セントラルスポーツ	800	1,462	1,169,600	
I S I D	1,600	955	1,528,000	
ウェザーニューズ	700	2,296	1,607,200	
C I J	3,400	342	1,162,800	
WOWOW	8	203,600	1,628,800	
富士フイルムホールディングス	57,400	1,796	103,090,400	
コニカミノルタホールディングス	68,000	701	47,668,000	
資生堂	47,800	1,260	60,228,000	
ライオン	31,000	475	14,725,000	
高砂香料工業	9,000	496	4,464,000	
マンダム	2,900	2,854	8,276,600	
ミルボン	1,300	3,035	3,945,500	
ファンケル	6,800	1,035	7,038,000	
コーセー	4,800	2,008	9,638,400	
ドクターシーラボ	18	268,100	4,825,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	3,200	2,839	9,084,800	
ノエビアホールディングス	1,600	1,399	2,238,400	
エステー	1,600	992	1,587,200	
コニシ	1,900	1,717	3,262,300	
長谷川香料	3,400	1,250	4,250,000	
小林製薬	4,100	4,440	18,204,000	
荒川化学工業	2,100	724	1,520,400	
日本高純度化学	7	226,900	1,588,300	
J C U	400	3,690	1,476,000	
新田ゼラチン	1,200	848	1,017,600	
アース製薬	1,900	2,973	5,648,700	
イハラケミカル工業	5,000	491	2,455,000	
北興化学工業	4,000	267	1,068,000	
大成ラミック	800	2,445	1,956,000	
クミアイ化学工業	6,000	528	3,168,000	
日本農薬	6,000	611	3,666,000	
昭和シェル石油	24,000	620	14,880,000	
コスモ石油	74,000	208	15,392,000	
ニチレキ	3,000	595	1,785,000	
東燃ゼネラル石油	41,000	872	35,752,000	
ユシロ化学工業	1,500	885	1,327,500	
A O Cホールディングス	6,200	349	2,163,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
MORESCO	700	832	582,400	
出光興産	3,200	8,310	26,592,000	
J Xホールディングス	298,300	552	164,661,600	
横浜ゴム	30,000	834	25,020,000	

東洋ゴム工業	22,000	378	8,316,000
ブリヂストン	84,200	2,809	236,517,800
住友ゴム工業	21,000	1,400	29,400,000
オカモト	10,000	309	3,090,000
アキレス	22,000	131	2,882,000
フコク	1,500	795	1,192,500
ニッタ	2,700	1,694	4,573,800
クリエートメディック	1,400	820	1,148,000
東海ゴム工業	5,000	1,042	5,210,000
三ツ星ベルト	7,000	502	3,514,000
バンドー化学	9,000	294	2,646,000
鬼怒川ゴム工業	5,000	451	2,255,000
旭硝子	132,000	647	85,404,000
日本板硝子	122,000	118	14,396,000
石塚硝子	8,000	149	1,192,000
有沢製作所	4,200	335	1,407,000
日本山村硝子	11,000	184	2,024,000
日本電気硝子	48,000	465	22,320,000
住友大阪セメント	48,000	274	13,152,000
太平洋セメント	148,000	224	33,152,000
デイ・シイ	3,900	308	1,201,200
リゾートソリューション	6,000	188	1,128,000
日本ヒューム	3,000	531	1,593,000
日本コンクリート工業	5,000	306	1,530,000
東海カーボン	23,000	348	8,004,000
日本カーボン	14,000	190	2,660,000
東洋炭素	1,500	2,248	3,372,000
ノリタケカンパニーリミテド	14,000	229	3,206,000
TOTO	41,000	841	34,481,000
日本ガイシ	35,000	965	33,775,000
日本特殊陶業	23,000	1,278	29,394,000
MARUWA	600	2,294	1,376,400
品川リフラクトリーズ	7,000	206	1,442,000
黒崎播磨	6,000	223	1,338,000
TYK	2,000	168	336,000
ニッカトー	2,800	420	1,176,000
フジインコーポレーテッド	2,400	1,375	3,300,000
エーアンドエーマテリアル	14,000	82	1,148,000
ニチアス	12,000	517	6,204,000
新日鐵住金	1,136,000	256	290,816,000
神戸製鋼所	373,000	125	46,625,000
合同製鐵	15,000	184	2,760,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	68,600	2,036	139,669,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日新製鋼ホールディングス	11,400	755	8,607,000	
東京製鐵	14,800	491	7,266,800	
共英製鋼	2,500	1,663	4,157,500	
大和工業	5,600	2,670	14,952,000	
東京鐵鋼	5,000	396	1,980,000	
大阪製鐵	1,300	1,584	2,059,200	
淀川製鋼所	19,000	360	6,840,000	
東洋鋼鈑	6,000	316	1,896,000	
住友鋼管	1,800	759	1,366,200	
丸一鋼管	9,000	2,245	20,205,000	
大同特殊鋼	42,000	461	19,362,000	
日本高周波鋼業	12,000	94	1,128,000	
日本冶金工業	20,000	124	2,480,000	
山陽特殊製鋼	13,000	346	4,498,000	

愛知製鋼	14,000	391	5,474,000
日立金属	19,000	905	17,195,000
日本金属	9,000	125	1,125,000
大平洋金属	17,000	506	8,602,000
日本電工	11,000	308	3,388,000
栗本鐵工所	12,000	321	3,852,000
日本製鋼所	41,000	496	20,336,000
三菱製鋼	16,000	182	2,912,000
日亜鋼業	5,000	248	1,240,000
日本精線	4,000	330	1,320,000
大紀アルミニウム工業所	6,000	214	1,284,000
日本軽金属ホールディングス	56,500	108	6,102,000
三井金属	68,000	232	15,776,000
東邦亜鉛	15,000	378	5,670,000
三菱マテリアル	157,000	283	44,431,000
住友金属鉱山	70,000	1,511	105,770,000
DOWAホールディングス	30,000	666	19,980,000
古河機械金属	45,000	103	4,635,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,600	1,836	4,773,600
東邦チタニウム	4,500	798	3,591,000
住友軽金属工業	64,000	88	5,632,000
古河スカイ	9,000	251	2,259,000
古河電気工業	84,000	200	16,800,000
住友電気工業	94,900	1,065	101,068,500
フジクラ	43,000	269	11,567,000
昭和電線ホールディングス	34,000	80	2,720,000
タツタ電線	5,000	654	3,270,000
日立電線	21,000	153	3,213,000
カナレ電気	900	1,316	1,184,400
リョービ	15,000	240	3,600,000
アサヒホールディングス	4,000	1,776	7,104,000
東洋製罐	19,100	1,346	25,708,600
ホッカンホールディングス	6,000	279	1,674,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
コロナ	1,200	1,123	1,347,600	
横河ブリッジホールディングス	5,000	794	3,970,000	
駒井ハルテック	6,000	239	1,434,000	
高田機工	6,000	202	1,212,000	
三和ホールディングス	25,000	447	11,175,000	
文化シャッター	7,000	433	3,031,000	
三協立山	3,500	1,780	6,230,000	
東洋シャッタ-	2,400	498	1,195,200	
LIXILグループ	37,400	2,010	75,174,000	
日本フィルコン	3,200	370	1,184,000	
ノーリツ	5,300	1,702	9,020,600	
長府製作所	2,600	1,885	4,901,000	
リンナイ	4,300	6,640	28,552,000	
ユニプレス	4,500	1,834	8,253,000	
ダイニチ工業	1,400	833	1,166,200	
三洋工業	6,000	179	1,074,000	
岡部	5,300	695	3,683,500	
東プレ	5,200	883	4,591,600	
高周波熱錬	3,600	701	2,523,600	
東京製鋼	18,000	119	2,142,000	
バイオラックス	1,100	2,423	2,665,300	
ニッパツ	19,400	816	15,830,400	
中央発條	4,000	305	1,220,000	
三浦工業	4,000	2,266	9,064,000	

タクマ	9,000	624	5,616,000
ツガミ	7,000	520	3,640,000
オークマ	17,000	690	11,730,000
東芝機械	13,000	466	6,058,000
アマダ	41,000	566	23,206,000
アイダエンジニアリング	6,300	707	4,454,100
牧野フライス製作所	12,000	619	7,428,000
オーエスジー	11,000	1,263	13,893,000
ダイジェット工業	8,000	155	1,240,000
旭ダイヤモンド工業	6,600	877	5,788,200
森精機製作所	14,200	980	13,916,000
ディスコ	3,000	5,350	16,050,000
日東工器	1,600	1,860	2,976,000
豊田自動織機	23,400	3,250	76,050,000
豊和工業	15,000	104	1,560,000
OKK	10,000	135	1,350,000
東洋機械金属	5,300	220	1,166,000
津田駒工業	7,000	177	1,239,000
島精機製作所	3,500	1,875	6,562,500
日阪製作所	3,000	849	2,547,000
やまびこ	1,100	1,760	1,936,000
ペガサスミシン製造	5,900	202	1,191,800
ナブテスコ	13,300	1,784	23,727,200

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三井海洋開発	2,200	2,179	4,793,800	
レオン自動機	6,000	202	1,212,000	
S M C	8,000	15,870	126,960,000	
新川	2,500	458	1,145,000	
ホソカワミクロン	4,000	754	3,016,000	
ユニオンツール	1,500	1,793	2,689,500	
オイレス工業	2,800	1,802	5,045,600	
サトーホールディングス	2,800	1,530	4,284,000	
日本エアテック	2,700	429	1,158,300	
ワイエイシイ	2,400	483	1,159,200	
コマツ	125,400	2,410	302,214,000	
住友重機械工業	73,000	404	29,492,000	
日立建機	13,700	2,190	30,003,000	
日工	4,000	366	1,464,000	
巴工業	1,000	1,990	1,990,000	
井関農機	26,000	293	7,618,000	
T O W A	2,400	534	1,281,600	
丸山製作所	6,000	188	1,128,000	
北川鉄工所	12,000	153	1,836,000	
シンニッタン	3,100	386	1,196,600	
クボタ	143,000	1,083	154,869,000	
荏原実業	900	1,300	1,170,000	
東洋エンジニアリング	15,000	441	6,615,000	
三菱化工機	8,000	152	1,216,000	
月島機械	4,000	877	3,508,000	
帝国電機製作所	800	1,673	1,338,400	
新東工業	5,400	841	4,541,400	
澁谷工業	1,700	862	1,465,400	
アイチコーポレーション	4,400	457	2,010,800	
小森コーポレーション	6,500	913	5,934,500	
鶴見製作所	2,000	810	1,620,000	
住友精密工業	4,000	400	1,600,000	
酒井重工業	5,000	280	1,400,000	
荏原製作所	51,000	375	19,125,000	

石井鐵工所	6,000	207	1,242,000
西島製作所	3,100	754	2,337,400
千代田化工建設	21,000	1,121	23,541,000
ダイキン工業	35,000	3,490	122,150,000
オルガノ	5,000	502	2,510,000
トーヨーカネツ	14,000	259	3,626,000
栗田工業	14,800	1,868	27,646,400
椿本チエイン	14,000	508	7,112,000
大同工業	8,000	151	1,208,000
日機装	9,000	1,038	9,342,000
木村化工機	3,300	365	1,204,500
新興プランテック	5,900	724	4,271,600
アネスト岩田	4,000	375	1,500,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ダイフク	12,000	632	7,584,000	
加藤製作所	6,000	294	1,764,000	
油研工業	7,000	161	1,127,000	
タダノ	12,000	926	11,112,000	
フジテック	7,000	688	4,816,000	
CKD	7,200	639	4,600,800	
キトー	16	80,400	1,286,400	
平和	5,600	1,737	9,727,200	
理想科学工業	1,800	1,976	3,556,800	
SANKYO	7,800	3,905	30,459,000	
日本金銭機械	2,400	779	1,869,600	
マースエンジニアリング	1,400	1,867	2,613,800	
福島工業	700	2,292	1,604,400	
オーイズミ	2,700	426	1,150,200	
ダイコク電機	1,100	2,426	2,668,600	
アマノ	7,800	883	6,887,400	
JUKI	16,000	147	2,352,000	
サンデン	15,000	398	5,970,000	
蛇の目マシン工業	25,000	80	2,000,000	
ブラザー工業	33,200	964	32,004,800	
マックス	4,000	1,112	4,448,000	
モリタホールディングス	4,000	777	3,108,000	
グローリー	7,700	2,099	16,162,300	
大和冷機工業	4,000	545	2,180,000	
セガサミーホールディングス	27,600	1,588	43,828,800	
日本ピストンリング	9,000	185	1,665,000	
リケン	9,000	366	3,294,000	
TPR	2,800	1,249	3,497,200	
ホシザキ電機	5,600	2,755	15,428,000	
大豊工業	1,800	1,220	2,196,000	
日本精工	57,000	688	39,216,000	
NTN	55,000	265	14,575,000	
ジェイテクト	27,300	920	25,116,000	
不二越	24,000	372	8,928,000	
ミネベア	35,000	299	10,465,000	
日本トムソン	9,000	400	3,600,000	
THK	17,100	1,688	28,864,800	
ユーシン精機	1,300	1,608	2,090,400	
前澤給装工業	1,000	1,289	1,289,000	
イーグル工業	3,000	827	2,481,000	
日本ビラー工業	3,000	739	2,217,000	
キッツ	10,600	438	4,642,800	
日立製作所	605,000	524	317,020,000	
東芝	507,000	420	212,940,000	

三菱電機	257,000	786	202,002,000
富士電機	77,000	256	19,712,000
東洋電機製造	5,000	245	1,225,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
安川電機	28,000	849	23,772,000	
シンフォニアテクノロジー	15,000	165	2,475,000	
明電舎	25,000	285	7,125,000	
オリジン電気	4,000	414	1,656,000	
デンヨー	2,500	1,170	2,925,000	
日立工機	6,900	778	5,368,200	
三桜工業	3,300	645	2,128,500	
マキタ	15,600	4,130	64,428,000	
東芝テック	16,000	521	8,336,000	
芝浦メカトロニクス	6,000	205	1,230,000	
マブチモーター	3,800	4,670	17,746,000	
日本電産	13,900	5,270	73,253,000	
東光高岳ホールディングス	1,300	1,499	1,948,700	
ダイヘン	14,000	282	3,948,000	
JVCケンウッド	15,500	256	3,968,000	
第一精工	800	1,510	1,208,000	
日新電機	5,000	478	2,390,000	
大崎電気工業	3,000	453	1,359,000	
オムロン	28,600	2,178	62,290,800	
日東工業	3,800	1,436	5,456,800	
I D E C	3,400	820	2,788,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	49,000	326	15,974,000	
サクサホールディングス	7,000	176	1,232,000	
メルコホールディングス	1,600	1,654	2,646,400	
N E C	332,000	240	79,680,000	
富士通	247,000	398	98,306,000	
沖電気工業	93,000	103	9,579,000	
岩崎通信機	16,000	77	1,232,000	
電気興業	7,000	375	2,625,000	
サンケン電気	13,000	376	4,888,000	
ナカヨ通信機	4,000	262	1,048,000	
アイホン	1,500	1,511	2,266,500	
ルネサスエレクトロニクス	6,600	263	1,735,800	
セイコーエプソン	17,500	944	16,520,000	
ワコム	47	311,500	14,640,500	
アルバック	4,300	911	3,917,300	
アクセル	1,300	2,155	2,801,500	
ナナオ	2,200	1,558	3,427,600	
日本信号	6,500	680	4,420,000	
京三製作所	6,000	296	1,776,000	
能美防災	3,000	668	2,004,000	
日本無線	5,000	294	1,470,000	
パナソニック	293,200	685	200,842,000	
シャープ	133,000	331	44,023,000	
アンリツ	14,000	1,350	18,900,000	
富士通ゼネラル	6,000	774	4,644,000	
日立国際電気	6,000	811	4,866,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ソニー	161,300	1,355	218,561,500	
T D K	14,500	3,305	47,922,500	
ミツミ電機	9,800	560	5,488,000	

タムラ製作所	10,000	189	1,890,000
アルプス電気	18,800	627	11,787,600
池上通信機	17,000	69	1,173,000
パイオニア	31,200	201	6,271,200
日本電波工業	2,200	1,005	2,211,000
日本トリム	400	2,870	1,148,000
ローランド ディー . ジー .	1,100	1,216	1,337,600
フォスター電機	2,600	1,322	3,437,200
クラリオン	14,000	124	1,736,000
SMK	8,000	280	2,240,000
ヨコオ	2,600	450	1,170,000
東光	13,000	271	3,523,000
ティアック	21,000	54	1,134,000
ホシデン	7,000	562	3,934,000
ヒロセ電機	4,500	11,180	50,310,000
日本航空電子工業	6,000	748	4,488,000
TOA	3,000	652	1,956,000
ユニデン	8,000	218	1,744,000
アルパイン	5,000	864	4,320,000
スミダコーポレーション	2,200	528	1,161,600
アイコム	1,400	1,996	2,794,400
船井電機	2,600	1,213	3,153,800
横河電機	25,700	924	23,746,800
新電元工業	8,000	337	2,696,000
アズビル	7,200	1,938	13,953,600
日本光電	5,100	3,235	16,498,500
チノー	6,000	210	1,260,000
共和電業	4,000	283	1,132,000
堀場製作所	5,100	3,005	15,325,500
アドバンテスト	17,500	1,284	22,470,000
小野測器	3,000	417	1,251,000
エスペック	2,700	779	2,103,300
パナソニック デバイスSUNX	2,900	401	1,162,900
キーエンス	6,300	26,350	166,005,000
HIOKI	1,300	1,399	1,818,700
シスメックス	9,000	4,760	42,840,000
メガチップス	2,100	1,371	2,879,100
OBARA GROUP	1,800	1,278	2,300,400
日本電産コバル電子	2,700	429	1,158,300
東京電波	1,700	600	1,020,000
デンソー	63,400	3,670	232,678,000
コーセル	3,700	1,029	3,807,300
日立メディコ	2,000	1,319	2,638,000
新日本無線	6,000	209	1,254,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
オブテックス	1,600	1,167	1,867,200	
千代田インテグレ	1,200	1,046	1,255,200	
スタンレー電気	20,000	1,585	31,700,000	
岩崎電気	9,000	199	1,791,000	
ウシオ電機	15,600	1,043	16,270,800	
岡谷電機産業	3,400	345	1,173,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	6,000	194	1,164,000	
日本セラミック	1,700	1,538	2,614,600	
日本デジタル研究所	2,200	1,077	2,369,400	
双信電機	3,600	324	1,166,400	
図研	2,000	580	1,160,000	
日本電子	9,000	338	3,042,000	
カシオ計算機	24,500	715	17,517,500	

ファナック	26,700	14,580	389,286,000
日本CMK	5,500	352	1,936,000
エンプラス	1,100	3,910	4,301,000
ローム	13,600	3,295	44,812,000
浜松ホトニクス	10,000	3,680	36,800,000
三井ハイテック	3,700	624	2,308,800
新光電気工業	8,600	736	6,329,600
京セラ	21,300	8,260	175,938,000
太陽誘電	12,500	1,035	12,937,500
村田製作所	26,900	6,080	163,552,000
ユーシン	3,600	710	2,556,000
双葉電子工業	4,800	981	4,708,800
日東電工	22,200	5,330	118,326,000
北陸電気工業	11,000	111	1,221,000
東海理化	6,000	1,548	9,288,000
ニチコン	8,100	885	7,168,500
日本ケミコン	15,000	252	3,780,000
KOA	3,200	897	2,870,400
三井造船	99,000	172	17,028,000
日立造船	101,500	134	13,601,000
佐世保重工業	17,000	112	1,904,000
三菱重工業	430,000	512	220,160,000
川崎重工業	200,000	281	56,200,000
IHI	175,000	247	43,225,000
日本車輛製造	9,000	343	3,087,000
日本輸送機	3,000	404	1,212,000
近畿車輛	4,000	295	1,180,000
じもとホールディングス	18,200	215	3,913,000
全国保証	2,000	2,729	5,458,000
日産自動車	324,200	938	304,099,600
いすゞ自動車	149,000	581	86,569,000
トヨタ自動車	329,700	4,820	1,589,154,000
日野自動車	32,000	968	30,976,000
三菱自動車工業	622,000	102	63,444,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
エフテック	1,000	1,183	1,183,000	
武蔵精密工業	2,700	1,947	5,256,900	
日産車体	9,000	1,174	10,566,000	
新明和工業	10,000	622	6,220,000	
極東開発工業	4,800	970	4,656,000	
日信工業	5,200	1,480	7,696,000	
トピー工業	19,000	228	4,332,000	
ティラド	9,000	248	2,232,000	
曙ブレーキ工業	11,900	415	4,938,500	
タチエス	3,400	1,524	5,181,600	
NOK	12,400	1,295	16,058,000	
フタバ産業	7,800	381	2,971,800	
カヤバ工業	20,000	381	7,620,000	
シロキ工業	6,000	228	1,368,000	
市光工業	8,000	143	1,144,000	
大同メタル工業	4,000	786	3,144,000	
プレス工業	11,000	466	5,126,000	
カルソニックカンセイ	17,000	386	6,562,000	
太平洋工業	5,300	532	2,819,600	
ケーヒン	5,300	1,400	7,420,000	
河西工業	3,000	447	1,341,000	
アイシン精機	23,500	3,290	77,315,000	
マツダ	406,000	276	112,056,000	

ダイハツ工業	27,000	1,868	50,436,000
今仙電機製作所	1,900	1,145	2,175,500
ホンダ	216,500	3,500	757,750,000
スズキ	53,700	2,307	123,885,900
富士重工業	82,000	1,329	108,978,000
ヤマハ発動機	39,000	1,065	41,535,000
ショーワ	6,100	1,012	6,173,200
小糸製作所	13,000	1,487	19,331,000
T B K	3,000	514	1,542,000
エクセディ	3,500	1,968	6,888,000
ミツバ	5,000	765	3,825,000
豊田合成	7,300	2,229	16,271,700
愛三工業	2,700	830	2,241,000
ヨロズ	1,900	1,472	2,796,800
エフ・シー・シー	4,200	2,090	8,778,000
新家工業	10,000	124	1,240,000
シマノ	10,300	6,540	67,362,000
タカタ	4,600	1,695	7,797,000
テイ・エス テック	5,400	2,230	12,042,000
小野建	2,200	866	1,905,200
はるやま商事	2,200	522	1,148,400
佐鳥電機	2,500	470	1,175,000
カップ・クリエイトホールディングス	1,850	2,040	3,774,000
エコートレーディング	1,400	845	1,183,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
伯東	1,500	885	1,327,500	
コンドーテック	2,200	521	1,146,200	
中山福	1,700	703	1,195,100	
ライトオン	1,900	669	1,271,100	
ナガイレーベン	3,400	1,177	4,001,800	
ジーンズメイト	3,700	378	1,398,600	
三菱食品	2,800	2,680	7,504,000	
良品計画	2,700	5,440	14,688,000	
三城ホールディングス	3,100	473	1,466,300	
松田産業	1,800	1,279	2,302,200	
メディカルホールディングス	25,300	1,158	29,297,400	
アドヴァン	1,300	902	1,172,600	
アズワン	1,600	1,909	3,054,400	
尾家産業	1,400	843	1,180,200	
シモジマ	1,500	1,007	1,510,500	
ドウシシャ	1,300	2,369	3,079,700	
コナカ	3,000	787	2,361,000	
高速	1,500	815	1,222,500	
G-7ホールディングス	2,200	530	1,166,000	
イオン北海道	2,400	489	1,173,600	
コーナン商事	3,300	1,106	3,649,800	
黒田電気	3,400	1,119	3,804,600	
ネットワンシステムズ	9,200	863	7,939,600	
エコス	2,000	580	1,160,000	
ワタミ	3,000	1,703	5,109,000	
マルシェ	1,400	806	1,128,400	
ドン・キホーテ	7,400	3,755	27,787,000	
丸文	2,700	431	1,163,700	
メガネトップ	4,400	1,097	4,826,800	
西松屋チェーン	5,000	736	3,680,000	
ゼンショーホールディングス	9,700	1,195	11,591,500	
ハピネット	1,500	767	1,150,500	
幸楽苑	1,600	1,283	2,052,800	

トーメンエレクトロニクス	1,300	1,185	1,540,500
ハークスレイ	1,600	719	1,150,400
サイゼリヤ	3,700	1,195	4,421,500
アルゴグラフィックス	900	1,333	1,199,700
ガリバーインターナショナル	850	3,645	3,098,250
日本エム・ディ・エム	4,700	251	1,179,700
ユナイテッドアローズ	2,700	2,346	6,334,200
進和	1,500	1,074	1,611,000
エスケイジャパン	3,900	298	1,162,200
ダイトエレクトロン	3,300	366	1,207,800
ハイデイ日高	1,300	2,068	2,688,400
シークス	1,600	1,149	1,838,400
京都きもの友禅	1,700	1,206	2,050,200
コロナイド	8,500	982	8,347,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
田中商事	2,400	486	1,166,400	
壱番屋	1,000	3,005	3,005,000	
マクニカ	1,300	1,689	2,195,700	
白銅	1,400	828	1,159,200	
トップカルチャー	3,000	390	1,170,000	
スギホールディングス	4,000	3,280	13,120,000	
島津製作所	31,000	582	18,042,000	
JMS	4,000	370	1,480,000	
モリテックス	4,400	274	1,205,600	
長野計器	1,800	663	1,193,400	
ブイ・テクノロジー	5	252,200	1,261,000	
スター精密	4,500	962	4,329,000	
東京計器	8,000	180	1,440,000	
日本電産トーソク	1,800	625	1,125,000	
東京精密	4,600	1,756	8,077,600	
マニー	800	3,185	2,548,000	
ニコン	47,900	2,140	102,506,000	
トプコン	5,200	950	4,940,000	
オリンパス	30,300	2,060	62,418,000	
理研計器	2,100	554	1,163,400	
大日本スクリーン製造	26,000	460	11,960,000	
キャノン電子	2,400	1,832	4,396,800	
タムロン	2,000	2,117	4,234,000	
HOYA	62,400	1,850	115,440,000	
ノーリツ鋼機	600	495	297,000	
エー・アンド・デイ	3,200	367	1,174,400	
キャノン	159,400	3,345	533,193,000	
リコー	77,000	993	76,461,000	
日本電産コバル	2,000	648	1,296,000	
シチズンホールディングス	29,000	490	14,210,000	
リズム時計工業	12,000	171	2,052,000	
パラマウントベッドホールディングス	2,200	2,860	6,292,000	
SHOBI	3,000	393	1,179,000	
永大産業	3,000	379	1,137,000	
ダンロップスポーツ	1,400	1,014	1,419,600	
バンダイナムコホールディングス	26,500	1,488	39,432,000	
フランスベッドホールディングス	16,000	204	3,264,000	
マーベラスAQL	29	45,550	1,320,950	
パイロットコーポレーション	22	259,900	5,717,800	
エイベックス・グループ・ホールディングス	4,800	2,421	11,620,800	
トッパン・フォームズ	4,600	817	3,758,200	
フジシールインターナショナル	3,100	2,148	6,658,800	
タカラトミー	8,400	517	4,342,800	

アーク	8,700	166	1,444,200
レック	1,000	1,225	1,225,000
タカノ	2,700	433	1,169,100
プロネクサス	3,000	530	1,590,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ホクシン	6,300	185	1,165,500	
ウッドワン	4,000	281	1,124,000	
大建工業	10,000	251	2,510,000	
きもと	2,400	840	2,016,000	
凸版印刷	72,000	609	43,848,000	
大日本印刷	78,000	797	62,166,000	
図書印刷	6,000	136	816,000	
共同印刷	8,000	246	1,968,000	
日本写真印刷	3,900	1,739	6,782,100	
光村印刷	4,000	265	1,060,000	
藤森工業	2,300	2,115	4,864,500	
宝印刷	1,800	633	1,139,400	
前澤化成工業	1,900	907	1,723,300	
アシックス	23,900	1,451	34,678,900	
ツツミ	1,300	2,375	3,087,500	
J S P	1,800	1,355	2,439,000	
ニチハ	3,000	1,267	3,801,000	
ローランド	2,400	807	1,936,800	
エフピコ	1,300	5,810	7,553,000	
小松ウオール工業	1,000	1,657	1,657,000	
ヤマハ	18,900	891	16,839,900	
河合楽器製作所	9,000	171	1,539,000	
クリナップ	2,600	623	1,619,800	
ビジョン	1,900	5,190	9,861,000	
天馬	2,100	984	2,066,400	
キングジム	2,100	655	1,375,500	
リンテック	5,500	1,678	9,229,000	
信越ポリマー	5,300	370	1,961,000	
東リ	7,000	217	1,519,000	
イトーキ	5,400	505	2,727,000	
任天堂	14,700	8,740	128,478,000	
三菱鉛筆	2,100	1,733	3,639,300	
松風	1,400	861	1,205,400	
タカラスタンダード	12,000	665	7,980,000	
コクヨ	13,300	624	8,299,200	
ナカバヤシ	6,000	190	1,140,000	
ニフコ	6,000	1,958	11,748,000	
グロープライド	12,000	108	1,296,000	
岡村製作所	10,000	602	6,020,000	
日本バルカー工業	11,000	235	2,585,000	
伊藤忠商事	202,100	1,090	220,289,000	
丸紅	208,000	690	143,520,000	
スクロール	4,300	267	1,148,100	
高島	5,000	278	1,390,000	
F & A アクアホールディングス	1,900	1,053	2,000,700	
三陽商会	14,000	261	3,654,000	
長瀬産業	14,300	1,032	14,757,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
蝶理	1,600	992	1,587,200	
豊田通商	28,200	2,336	65,875,200	

オンワ - ドホールディングス	18,000	755	13,590,000
三共生興	4,300	334	1,436,200
兼松	54,000	137	7,398,000
ミズノ	13,000	406	5,278,000
ファミリーマート	7,800	3,965	30,927,000
ルック	5,000	342	1,710,000
三井物産	218,700	1,413	309,023,100
日本紙パルプ商事	13,000	308	4,004,000
東京エレクトロン	21,600	4,185	90,396,000
日立ハイテクノロジーズ	7,700	1,987	15,299,900
カメイ	3,000	903	2,709,000
東都水産	9,000	137	1,233,000
スターゼン	8,000	262	2,096,000
セイコーホールディングス	16,000	273	4,368,000
山善	9,700	651	6,314,700
住友商事	149,500	1,174	175,513,000
日本ユニシス	7,000	711	4,977,000
内田洋行	5,000	257	1,285,000
三菱商事	197,700	1,924	380,374,800
第一実業	6,000	457	2,742,000
キャノンマーケティングジャパン	8,400	1,279	10,743,600
西華産業	9,000	258	2,322,000
佐藤商事	2,300	581	1,336,300
菱洋エレクトロ	3,000	821	2,463,000
東京産業	4,000	287	1,148,000
ユアサ商事	26,000	176	4,576,000
神鋼商事	6,000	187	1,122,000
阪和興業	25,000	394	9,850,000
カナデン	3,000	571	1,713,000
菱電商事	4,000	586	2,344,000
ニプロ	13,700	711	9,740,700
フルサト工業	1,400	910	1,274,000
岩谷産業	28,000	362	10,136,000
すてきなイスグループ	10,000	230	2,300,000
昭光通商	9,000	136	1,224,000
イワキ	6,000	189	1,134,000
兼松エレクトロニクス	1,600	1,067	1,707,200
三愛石油	6,000	411	2,466,000
稲畑産業	6,200	638	3,955,600
ゴールドウイン	6,000	554	3,324,000
ユニ・チャーム	14,800	5,490	81,252,000
デサント	7,000	593	4,151,000
ヤマトインターナショナル	2,900	398	1,154,200
東邦ホールディングス	8,100	1,903	15,414,300
サンゲツ	4,500	2,319	10,435,500

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ミツウロコグループホールディングス	4,100	529	2,168,900	
シナネン	5,000	394	1,970,000	
伊藤忠エネクス	5,600	493	2,760,800	
サンリオ	6,400	3,740	23,936,000	
サンワテクノス	1,700	683	1,161,100	
リョーサン	4,100	2,024	8,298,400	
新光商事	2,800	939	2,629,200	
トーヨー	5,000	323	1,615,000	
三信電気	3,600	652	2,347,200	
東陽テクニカ	3,700	1,121	4,147,700	
モスフードサービス	3,300	1,753	5,784,900	
加賀電子	2,500	778	1,945,000	

三益半導体工業	2,300	727	1,672,100
ソーダニッカ	3,000	398	1,194,000
立花エレテック	1,500	859	1,288,500
木曽路	3,100	1,785	5,533,500
千趣会	4,600	669	3,077,400
ケーヨー	4,300	498	2,141,400
アデランス	3,200	1,343	4,297,600
上新電機	6,000	901	5,406,000
日本瓦斯	3,500	1,144	4,004,000
ベスト電器	8,000	167	1,336,000
マルエツ	5,000	305	1,525,000
ロイヤルホールディングス	4,200	1,085	4,557,000
東天紅	6,000	200	1,200,000
いなげや	2,800	1,016	2,844,800
島忠	5,700	1,976	11,263,200
チヨダ	3,000	2,127	6,381,000
ライフコーポレーション	1,600	1,271	2,033,600
カスミ	5,200	586	3,047,200
リンガーハット	2,300	1,235	2,840,500
テナライド	3,800	307	1,166,600
AOKIホールディングス	2,200	2,214	4,870,800
オークワ	4,000	1,057	4,228,000
コメリ	3,900	2,553	9,956,700
青山商事	7,000	2,026	14,182,000
しまむら	2,900	9,300	26,970,000
高島屋	34,000	730	24,820,000
松屋	5,100	818	4,171,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	16,000	819	13,104,000
ニッセンホールディングス	4,600	324	1,490,400
パルコ	4,900	914	4,478,600
丸井グループ	33,000	766	25,278,000
クレディセゾン	22,200	1,905	42,291,000
原信ナルスホールディングス	1,400	1,645	2,303,000
井筒屋	14,000	97	1,358,000
ダイエー	14,650	199	2,915,350

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
イズミヤ	10,000	497	4,970,000	
イオン	89,300	1,065	95,104,500	
ユニー	24,300	662	16,086,600	
イズミ	6,300	1,974	12,436,200	
平和堂	5,100	1,298	6,619,800	
フジ	2,800	1,848	5,174,400	
ヤオコー	1,300	3,595	4,673,500	
ゼビオ	3,400	1,781	6,055,400	
ケーズホールディングス	6,300	2,280	14,364,000	
Paltac	3,000	1,127	3,381,000	
オリンピック	1,700	723	1,229,100	
新生銀行	219,000	205	44,895,000	
あおぞら銀行	92,000	272	25,024,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,918,100	533	1,022,347,300	
りそなホールディングス	260,500	428	111,494,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	530,000	357	189,210,000	
三井住友フィナンシャルグループ	191,600	3,825	732,870,000	
第四銀行	33,000	330	10,890,000	
北越銀行	26,000	210	5,460,000	
西日本シティ銀行	89,000	253	22,517,000	
千葉銀行	98,000	609	59,682,000	
横浜銀行	161,000	481	77,441,000	

常陽銀行	96,000	459	44,064,000
群馬銀行	57,000	483	27,531,000
武蔵野銀行	4,100	3,245	13,304,500
千葉興業銀行	4,900	742	3,635,800
筑波銀行	10,500	370	3,885,000
東京都民銀行	4,800	923	4,430,400
七十七銀行	40,000	438	17,520,000
青森銀行	19,000	281	5,339,000
秋田銀行	17,000	253	4,301,000
山形銀行	15,000	408	6,120,000
岩手銀行	1,800	3,815	6,867,000
東邦銀行	21,000	290	6,090,000
東北銀行	13,000	154	2,002,000
みちのく銀行	13,000	207	2,691,000
ふくおかフィナンシャルグループ	103,000	415	42,745,000
静岡銀行	74,000	920	68,080,000
十六銀行	32,000	336	10,752,000
スルガ銀行	25,000	1,359	33,975,000
八十二銀行	47,000	471	22,137,000
山梨中央銀行	15,000	393	5,895,000
大垣共立銀行	34,000	307	10,438,000
福井銀行	22,000	181	3,982,000
北國銀行	29,000	368	10,672,000
清水銀行	900	2,715	2,443,500
滋賀銀行	24,000	536	12,864,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
南都銀行	25,000	424	10,600,000	
百五銀行	23,000	403	9,269,000	
京都銀行	45,000	799	35,955,000	
三重銀行	10,000	216	2,160,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	177,000	157	27,789,000	
広島銀行	75,000	388	29,100,000	
山陰合同銀行	15,000	750	11,250,000	
中国銀行	20,000	1,325	26,500,000	
鳥取銀行	5,000	190	950,000	
伊予銀行	27,000	781	21,087,000	
百十四銀行	28,000	370	10,360,000	
四国銀行	18,000	249	4,482,000	
阿波銀行	21,000	555	11,655,000	
鹿児島銀行	18,000	616	11,088,000	
大分銀行	15,000	337	5,055,000	
宮崎銀行	17,000	251	4,267,000	
肥後銀行	21,000	547	11,487,000	
佐賀銀行	15,000	220	3,300,000	
十八銀行	16,000	250	4,000,000	
沖縄銀行	1,900	3,720	7,068,000	
琉球銀行	5,300	1,200	6,360,000	
八千代銀行	1,300	2,353	3,058,900	
セブン銀行	85,400	241	20,581,400	
みずほフィナンシャルグループ	3,265,100	205	669,345,500	
紀陽ホールディングス	101,000	137	13,837,000	
山口フィナンシャルグループ	25,000	891	22,275,000	
芙蓉総合リース	2,400	3,260	7,824,000	
興銀リース	3,800	2,423	9,207,400	
東京センチュリーリース	5,900	2,133	12,584,700	
SBIホールディングス	32,200	726	23,377,200	
日本証券金融	9,700	631	6,120,700	
大阪証券金融	4,500	242	1,089,000	

アイフル	21,100	574	12,111,400
日本アジア投資	18,000	80	1,440,000
ポケットカード	2,600	474	1,232,400
長野銀行	9,000	178	1,602,000
名古屋銀行	23,000	341	7,843,000
北洋銀行	38,100	314	11,963,400
愛知銀行	900	5,000	4,500,000
第三銀行	14,000	179	2,506,000
中京銀行	10,000	200	2,000,000
東日本銀行	11,000	244	2,684,000
大光銀行	9,000	241	2,169,000
愛媛銀行	15,000	235	3,525,000
トマト銀行	10,000	178	1,780,000
みなと銀行	23,000	164	3,772,000
京葉銀行	21,000	472	9,912,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
関西アーバン銀行	35,000	117	4,095,000	
栃木銀行	13,000	368	4,784,000	
北日本銀行	700	2,528	1,769,600	
東和銀行	27,000	103	2,781,000	
福島銀行	31,000	85	2,635,000	
大東銀行	16,000	99	1,584,000	
リコーリース	1,700	2,353	4,000,100	
イオンクレジットサービス	9,200	2,041	18,777,200	
アコム	5,090	2,211	11,253,990	
ジャックス	14,000	426	5,964,000	
オリエン트コーポレーション	49,000	283	13,867,000	
日立キャピタル	5,000	1,728	8,640,000	
オリックス	13,180	10,580	139,444,400	
三菱UFJリース	6,430	4,090	26,298,700	
ジャフコ	3,500	2,951	10,328,500	
トモニホールディングス	19,400	405	7,857,000	
大和証券グループ本社	251,000	551	138,301,000	
野村ホールディングス	517,900	544	281,737,600	
岡三証券グループ	22,000	713	15,686,000	
丸三証券	7,700	702	5,405,400	
東洋証券	10,000	303	3,030,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	29,000	507	14,703,000	
光世証券	6,000	229	1,374,000	
水戸証券	7,000	393	2,751,000	
いちよし証券	5,700	813	4,634,100	
松井証券	15,000	863	12,945,000	
NK S Jホールディングス	56,300	2,096	118,004,800	
だいこう証券ビジネス	1,800	657	1,182,600	
マネックスグループ	287	31,350	8,997,450	
カブドットコム証券	10,300	460	4,738,000	
極東証券	3,400	1,202	4,086,800	
岩井コスモホールディングス	2,400	673	1,615,200	
フィデアホールディングス	14,600	220	3,212,000	
池田泉州ホールディングス	20,900	501	10,470,900	
M S & A Dホールディングス	75,700	2,053	155,412,100	
ソニーフィナンシャルホールディングス	24,200	1,523	36,856,600	
第一生命保険	1,355	134,200	181,841,000	
東京海上ホールディングス	98,100	2,885	283,018,500	
アサックス	8	149,900	1,199,200	
N E Cキャピタルソリューション	1,000	1,617	1,617,000	
T & Dホ - ルディングス	86,900	1,169	101,586,100	
三井不動産	119,000	2,130	253,470,000	

三菱地所	177,000	2,136	378,072,000
平和不動産	4,800	1,295	6,216,000
東京建物	48,000	442	21,216,000
ダイビル	6,500	894	5,811,000
東急不動産	56,000	618	34,608,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
京阪神ビルディング	3,300	504	1,663,200	
住友不動産	61,000	2,754	167,994,000	
大京	39,000	218	8,502,000	
テーオーシー	8,700	600	5,220,000	
東京楽天地	4,000	356	1,424,000	
レオパレス21	21,100	322	6,794,200	
フジ住宅	3,200	495	1,584,000	
空港施設	3,100	454	1,407,400	
明和地所	2,200	517	1,137,400	
住友不動産販売	910	4,155	3,781,050	
ゴールドクレスト	2,000	1,653	3,306,000	
東栄住宅	1,700	1,227	2,085,900	
リロ・ホールディング	900	3,460	3,114,000	
日本エスリード	1,200	958	1,149,600	
東急リパブル	2,700	1,368	3,693,600	
飯田産業	2,900	1,230	3,567,000	
日神不動産	2,000	582	1,164,000	
アーネストワン	4,200	1,558	6,543,600	
タカラレーベン	2,700	1,065	2,875,500	
サンヨーハウジング名古屋	13	110,800	1,440,400	
イオンモール	11,500	2,210	25,415,000	
フージャースコーポレーション	34	75,500	2,567,000	
タクトホーム	13	134,300	1,745,900	
トーセイ	33	69,800	2,303,400	
NTT都市開発	157	88,500	13,894,500	
サンフロンティア不動産	21	79,200	1,663,200	
ランドビジネス	24	47,700	1,144,800	
グランディハウス	1,300	877	1,140,100	
東武鉄道	146,000	504	73,584,000	
相鉄ホールディングス	41,000	306	12,546,000	
東京急行電鉄	151,000	542	81,842,000	
京浜急行電鉄	66,000	820	54,120,000	
小田急電鉄	82,000	966	79,212,000	
京王電鉄	72,000	729	52,488,000	
京成電鉄	38,000	850	32,300,000	
富士急行	7,000	558	3,906,000	
新京成電鉄	3,000	365	1,095,000	
東日本旅客鉄道	47,300	6,840	323,532,000	
西日本旅客鉄道	22,100	4,050	89,505,000	
東海旅客鉄道	21,300	8,980	191,274,000	
西日本鉄道	33,000	373	12,309,000	
ハマキョウレックス	700	3,205	2,243,500	
サカイ引越センター	300	2,052	615,600	
近畿日本鉄道	232,000	397	92,104,000	
阪急阪神ホールディングス	162,000	507	82,134,000	
南海電気鉄道	53,000	405	21,465,000	
京阪電気鉄道	58,000	414	24,012,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
名糖運輸	1,800	635	1,143,000	

名古屋鉄道	90,000	272	24,480,000
トランコム	700	2,407	1,684,900
日本通運	102,000	405	41,310,000
ヤマトホールディングス	48,500	1,559	75,611,500
山九	31,000	400	12,400,000
日新	10,000	244	2,440,000
丸全昭和運輸	9,000	315	2,835,000
センコー	10,000	464	4,640,000
トナミホールディングス	6,000	186	1,116,000
日本梱包運輸倉庫	8,300	1,331	11,047,300
日本石油輸送	6,000	205	1,230,000
福山通運	16,000	486	7,776,000
セイノーホールディングス	20,000	723	14,460,000
神奈川中央交通	3,000	489	1,467,000
日立物流	4,500	1,299	5,845,500
日本郵船	204,000	223	45,492,000
商船三井	125,000	307	38,375,000
川崎汽船	113,000	182	20,566,000
N S ユナイテッド海運	12,000	128	1,536,000
乾汽船	3,900	300	1,170,000
飯野海運	10,700	436	4,665,200
第一中央汽船	19,000	81	1,539,000
日本航空	21,700	4,350	94,395,000
全日本空輸	504,000	190	95,760,000
バスコ	2,000	285	570,000
三菱倉庫	18,000	1,416	25,488,000
三井倉庫	12,000	393	4,716,000
住友倉庫	17,000	469	7,973,000
澁澤倉庫	7,000	313	2,191,000
ヤマタネ	12,000	143	1,716,000
日本トランスシティ	6,000	327	1,962,000
安田倉庫	2,000	671	1,342,000
東洋埠頭	8,000	156	1,248,000
宇徳	4,000	294	1,176,000
上組	28,000	785	21,980,000
サンリツ	2,100	575	1,207,500
キューソー流通システム	1,200	935	1,122,000
郵船ロジスティクス	2,000	911	1,822,000
近鉄エクスプレス	2,300	3,080	7,084,000
東海運	4,700	251	1,179,700
T B S ホールディングス	13,700	1,123	15,385,100
日本テレビホールディングス	23,100	1,372	31,693,200
テレビ朝日	6,400	1,614	10,329,600
スカパーJ S A Tホールディングス	220	46,350	10,197,000
テレビ東京ホールディングス	1,800	994	1,789,200
アイ・ティー・シーネットワーク	2,200	701	1,542,200

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
NECモバイリング	900	4,080	3,672,000	
日本電信電話	106,600	4,295	457,847,000	
KDDI	35,700	6,930	247,401,000	
光通信	2,600	4,420	11,492,000	
NTTドコモ	2,087	141,100	294,475,700	
GMOインターネット	8,400	736	6,182,400	
学研ホールディングス	8,000	258	2,064,000	
ゼンリン	3,300	1,107	3,653,100	
角川グループホールディングス	2,200	2,382	5,240,400	
インプレスホールディングス	9,100	128	1,164,800	
東京電力	217,800	215	46,827,000	

中部電力	78,500	1,164	91,374,000
関西電力	104,700	819	85,749,300
中国電力	35,500	1,199	42,564,500
北陸電力	25,100	1,029	25,827,900
東北電力	64,100	725	46,472,500
四国電力	23,100	1,130	26,103,000
九州電力	56,700	908	51,483,600
北海道電力	24,000	808	19,392,000
沖縄電力	1,500	2,797	4,195,500
J POWER	15,900	2,306	36,665,400
東京ガス	309,000	457	141,213,000
大阪ガス	249,000	363	90,387,000
東邦ガス	65,000	502	32,630,000
北海道ガス	5,000	246	1,230,000
西部ガス	29,000	213	6,177,000
静岡ガス	6,500	631	4,101,500
松竹	17,000	1,000	17,000,000
東宝	18,100	1,744	31,566,400
エイチ・アイ・エス	2,200	3,270	7,194,000
東映	11,000	543	5,973,000
NTTデータ	156	273,700	42,697,200
共立メンテナンス	1,300	2,424	3,151,200
イチネンホールディングス	2,800	580	1,624,000
建設技術研究所	1,900	607	1,153,300
スペース	1,700	690	1,173,000
アインファーマシーズ	1,600	5,010	8,016,000
燦ホールディングス	900	1,299	1,169,100
東京テアトル	10,000	129	1,290,000
よみうりランド	5,000	454	2,270,000
東京都競馬	21,000	211	4,431,000
常磐興産	8,000	153	1,224,000
カナモト	3,000	1,400	4,200,000
東京ドーム	20,000	328	6,560,000
DTS	2,400	1,317	3,160,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,200	1,069	9,834,800
シーイーシー	2,100	551	1,157,100

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
カプコン	4,900	1,465	7,178,500	
日本空港ビルデング	8,800	1,050	9,240,000	
トランス・コスモス	3,500	1,183	4,140,500	
乃村工藝社	6,000	434	2,604,000	
ジャステック	2,100	554	1,163,400	
SCSK	6,000	1,557	9,342,000	
藤田観光	7,000	297	2,079,000	
日本管財	1,000	1,626	1,626,000	
トーカイ	1,200	2,590	3,108,000	
白洋舎	5,000	209	1,045,000	
セコム	27,900	4,695	130,990,500	
CSP	1,300	872	1,133,600	
アイネス	3,400	635	2,159,000	
丹青社	3,000	349	1,047,000	
メイテック	4,100	2,330	9,553,000	
TKC	2,300	1,653	3,801,900	
アサツー ディ・ケイ	4,400	2,402	10,568,800	
富士ソフト	3,600	2,071	7,455,600	
応用地質	2,800	1,075	3,010,000	
船井総合研究所	2,700	600	1,620,000	
NSD	5,000	972	4,860,000	

進学会	3,700	319	1,180,300
丸紅建材リース	7,000	176	1,232,000
コナミ	11,400	1,781	20,303,400
ベネッセホールディングス	8,200	3,710	30,422,000
イオンディライト	2,600	1,717	4,464,200
ナック	600	2,583	1,549,800
福井コンピュータホールディングス	1,600	639	1,022,400
ニチイ学館	5,200	896	4,659,200
ダイセキ	4,000	1,377	5,508,000
ステップ	1,600	741	1,185,600
日鐵商事	6,000	277	1,662,000
元気寿司	1,000	1,133	1,133,000
トラスコ中山	2,900	1,776	5,150,400
ヤマダ電機	11,550	3,565	41,175,750
オートバックスセブン	3,100	3,910	12,121,000
アークランドサカモト	1,600	1,366	2,185,600
ニトリホールディングス	5,000	6,890	34,450,000
グルメ杵屋	2,000	650	1,300,000
愛眼	3,800	312	1,185,600
吉野家ホールディングス	69	107,300	7,403,700
加藤産業	3,600	1,707	6,145,200
イノテック	3,000	392	1,176,000
イエローハット	2,400	1,412	3,388,800
富士エレクトロニクス	1,300	1,281	1,665,300
松屋フーズ	1,200	1,647	1,976,400
J B C Cホールディングス	2,100	697	1,463,700

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
J Kホールディングス	2,600	463	1,203,800	
サガミチェーン	3,000	741	2,223,000	
日伝	1,100	2,149	2,363,900	
北沢産業	7,000	172	1,204,000	
杉本商事	1,500	800	1,200,000	
因幡電機産業	3,000	2,850	8,550,000	
住金物産	13,000	303	3,939,000	
プレナス	2,800	1,522	4,261,600	
ミニストップ	1,900	1,534	2,914,600	
アークス	4,300	1,789	7,692,700	
パロー	5,500	1,574	8,657,000	
ミスミグループ本社	9,400	2,336	21,958,400	
ベルク	1,200	1,376	1,651,200	
大庄	1,200	1,222	1,466,400	
タキヒヨー	4,000	470	1,880,000	
ファーストリテイリング	5,100	25,450	129,795,000	
ソフトバンク	121,100	3,395	411,134,500	
スズケン	9,700	3,125	30,312,500	
サンドラッグ	4,800	3,740	17,952,000	
東京デリカ	1,200	946	1,135,200	
ジェコス	1,800	666	1,198,800	
やまや	800	1,573	1,258,400	
ペルーナ	3,150	679	2,138,850	
合計	39,681,424	-	34,441,711,410	

株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
デリバティブ取引関係注記に記載したとおりであります。

第4 不動産等明細表
該当事項はありません。

第5 商品明細表
該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

第8 借入金明細表
該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

（平成25年3月29日現在）

資産総額	12,421,068,215 円
負債総額	39,218,678 円
純資産総額（ - ）	12,381,849,537 円
発行済数量	14,014,200,585 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	8,835 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等

該当事項はありません。

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

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

（2）受益者に対する特典

ありません。

（3）譲渡制限

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

（4）受益権の譲渡

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

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前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）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、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かか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）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

平成25年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。

最近5年間における資本金の増減はありません。

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後2年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

取締役会は、取締役の中から代表取締役を選任するとともに、取締役社長1名を選任します。また、取締役会は、取締役会長1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を選任することができます。

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、その議長を務めます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって決議します。

投資運用の意思決定機構

ファンドの個々の取引の運用指図は、運用基本方針、運用内規および月次運用方針に基づき、委託会社のファンドマネジャーが行います。

ファンド毎の運用基本方針、具体的な運用ルールである運用内規および月次運用方針については、運用部門中心に構成される協議機関において市場動向・ファンダメンタルズ等の投資環境分析を踏まえ協議され、運用担当部（室）の部（室）長が決定します。

ファンドマネジャーは、運用基本方針、運用内規および月次運用方針に基づき、具体的な銘柄選択を行い、組入有価証券等の売買の指図を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成25年3月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	186	21,494
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	13	1,724
単位型公社債投資信託	0	0
合計	199	23,218

純資産総額合計額の金額については、億円未満の端数を切り捨てて記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

- (1) 委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第17期事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第18期事業年度に係る中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		6,270,894		1,324,746
有価証券		11,023,094		8,309,605
前払費用	1	195,613	1	200,463
未収委託者報酬		1,751,247		1,465,803
未収運用受託報酬	1	656,202	1	778,921
未収投資助言報酬	1	171,421	1	154,740
繰延税金資産		295,260		273,967
その他		64,039		44,410
流動資産合計		20,427,773		12,552,657
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	133,329	2	115,964
車両	2	5,095	2	2,970
器具備品	2	179,790	2	148,251
有形固定資産合計		318,215		267,186
無形固定資産				
ソフトウェア		1,372,451		1,228,624
ソフトウェア仮勘定		51,575		55,978
その他		8,203		8,171
無形固定資産合計		1,432,230		1,292,774
投資その他の資産				
投資有価証券		16,986,491		25,328,584
差入保証金	1	284,824	1	283,591
繰延税金資産		500,589		437,364
その他		17		38
投資その他の資産合計		17,771,923		26,049,578
固定資産合計		19,522,370		27,609,540
資産合計		39,950,144		40,162,198
負債の部				
流動負債				
預り金		28,412		30,600
未払収益分配金		4,324		-
未払償還金		151,440		148,104
未払手数料	1	683,709	1	560,208
未払運用委託報酬		391,985		396,073
未払投資助言報酬		106,084		126,813
その他未払金	1	187,916	1	205,721
未払費用	1	119,099	1	122,185
未払法人税等		145,709		149,239
賞与引当金		552,829		538,159
その他		42,559		22,815
流動負債合計		2,414,070		2,299,923

固定負債		
退職給付引当金	644,223	767,977
役員退職慰労引当金	11,275	13,630
その他	1 66,068	1 4,973
固定負債合計	721,566	786,580
負債合計	3,135,637	3,086,503
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	17,625,364	17,833,930
利益剰余金合計	18,305,171	18,513,737
株主資本合計	36,587,011	36,795,577
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	227,494	280,116
評価・換算差額等合計	227,494	280,116
純資産合計	36,814,506	37,075,694
負債・純資産合計	39,950,144	40,162,198

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,004,207	9,952,331
運用受託報酬	3,873,347	3,987,169
投資助言報酬	751,384	705,920
業務受託料	47,100	47,100
営業収益計	15,676,039	14,692,522
営業費用		
支払手数料	4,548,772	4,131,652
広告宣伝費	110,792	27,241
公告費	466	323
調査費	2,708,450	2,700,559
支払運用委託報酬	1,442,927	1,294,778
支払投資助言報酬	448,879	479,438
委託調査費	20,521	42,633
調査費	796,121	883,708
委託計算費	104,902	101,748
営業雑経費	543,623	390,063
通信費	57,003	55,182

印刷費		175,972		133,820
協会費		17,084		17,984
その他営業雑経費		293,563		183,076
営業費用計		8,017,006		7,351,588
一般管理費				
役員報酬	1	62,167	1	59,718
給料・手当		2,985,814		3,012,857
賞与引当金繰入額		547,443		537,887
賞与		256,821		260,246
福利厚生費		550,141		566,829
退職給付費用		163,211		156,575
役員退職慰労引当金繰入額		5,550		5,455
役員退職慰労金		637		650
其他人件費		135,147		115,587
不動産賃借料		635,759		632,434
その他不動産経費		38,835		27,417
交際費		14,220		14,037
旅費交通費		87,941		90,473
固定資産減価償却費		627,055		654,122
租税公課		77,387		79,628
業務委託費		183,393		179,945
器具備品費		178,045		151,259
保守料		92,961		87,228
保険料		63,246		60,291
寄付金		820		5,000
諸経費		39,883		56,644
一般管理費計		6,746,486		6,754,291
営業利益		912,546		586,642
営業外収益				
受取利息		3,284		1,966
有価証券利息		107,994		93,236
受取配当金		102,558		45,856
その他営業外収益		22,945		17,359
営業外収益計		236,783		158,419
営業外費用				
為替差損		9,852		6,419
賃貸借契約解約損		-		4,124
その他営業外費用		15,292		1,248
営業外費用計		25,144		11,792
経常利益		1,124,185		733,269
特別利益				
投資有価証券売却益		35,991		25,290
投資有価証券償還益		351		-
事故受取保険金	3	5,462	3	14,136
清算配当金		-	5	59,327
特別利益計		41,804		98,754
特別損失				
投資有価証券売却損		17,676		1,778
投資有価証券償還損		355,993		87,378
投資有価証券評価損		5,706		-
固定資産除却損	4	16,762	4	19,104
事故損失賠償金	2	22,343	2	39,244
特別損失計		418,482		147,506
税引前当期純利益		747,507		684,516

法人税、住民税及び事業税	272,647	263,157
法人税等調整額	37,686	77,232
法人税等合計	310,333	340,390
当期純利益	437,174	344,126

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	10,000,000	10,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計		
当期首残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	139,807	139,807
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
当期首残高	120,000	120,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	120,000	120,000
研究開発積立金		
当期首残高	70,000	70,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	70,000	70,000
別途積立金		
当期首残高	350,000	350,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	350,000	350,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	17,323,750	17,625,364
当期変動額		

剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	17,625,364	17,833,930
利益剰余金合計		
当期首残高	18,003,557	18,305,171
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	18,305,171	18,513,737
株主資本合計		
当期首残高	36,285,397	36,587,011
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	36,587,011	36,795,577
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	93,537	227,494
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	133,956	52,622
当期末残高	227,494	280,116
評価・換算差額等合計		
当期首残高	93,537	227,494
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	133,956	52,622
当期末残高	227,494	280,116
純資産合計		
当期首残高	36,378,935	36,814,506
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	435,570	261,188
当期末残高	36,814,506	37,075,694

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

満期保有目的の債券

償却原価法（定額法）によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

…決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

時価のないもの

…移動平均法に基づく原価法によっております。なお、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の財務諸表を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法によっております。

主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。

無形固定資産

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準

賞与引当金

従業員への賞与の支給に充てるため、当事業年度末在籍者に対する支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

退職給付引当金

従業員へ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に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額（簡便法により自己都合退職による期末要支給額の100%）を計上しております。

なお受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。

役員退職慰労引当金

役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

5. リース取引の処理方法

平成19年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。

6. 消費税及び地方消費税の会計処理

税抜方式によっております。

(追加情報)

当会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(注記事項)

(貸借対照表関係)

1. 関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
前払費用	60,402千円	52,725千円
未収運用受託報酬	296,706	383,091
未収投資助言報酬	152,956	135,967
差入保証金	280,262	280,262
未払手数料	88,132	90,057
その他未払金	14,956	19,525
未払費用	60,986	59,677
その他固定負債	66,068	4,973

2.有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
建物	187,418千円	206,955千円
車両	1,919	4,043
器具備品	592,884	573,767
計	782,221	784,767

(損益計算書関係)

1.役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	30,000千円	
2.事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。		
3.事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。		
4.固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
建物	8,300千円	-千円
器具備品	8,461	11,393
その他	-	7,711
計	16,762	19,104
5.清算配当金は、会社型投資信託の清算配当であります。		

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	108,448	-	-	108,448
合計	108,448	-	-	108,448

2.配当に関する事項

配当金支払額

平成22年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年6月25日

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

平成23年6月27日開催の定時株主総会決議において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月27日

当事業年度（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	108,448	-	-	108,448
合計	108,448	-	-	108,448

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成23年 6月27日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成23年 3月31日
効力発生日	平成23年 6月27日

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

平成24年 6月25日開催の定時株主総会決議において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成24年 3月31日
効力発生日	平成24年 6月25日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額（単位：千円）

	前事業年度（平成23年 3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	3,237	2,461	776

(単位：千円)

	当事業年度（平成24年 3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	417	445

未経過リース料期末残高相当額等

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年 3月31日)	当事業年度 (平成24年 3月31日)
1年内	342	174
1年超	462	287
合計	804	462

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

支払リース料	1,383	361
減価償却費相当額	1,258	330
支払利息相当額	53	19

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、自己勘定の資金運用にあたっては、資金運用規則に沿って、慎重な資金管理、資本金の保全、投機の回避に十分に留意しております。また、資金の管理にあたっては、投資信託委託会社としての業務により当社が受け入れる投資信託財産に属する金銭等との混同を来たさないよう、分離して行っております。

投資有価証券は主として利付国債と自社設定投資信託であります。これらは金利の変動リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。自己資金運用に係るリスク管理等については、資金運用規則のほか自己資金運用に係るリスク管理規程に従い、適切なリスク管理を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2参照)

前事業年度（平成23年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	6,270,894	6,270,894	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,028,251	4,044,880	16,628
その他有価証券	6,994,842	6,994,842	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,512,627	10,567,760	55,132
その他有価証券	6,341,364	6,341,364	-

当事業年度（平成24年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,324,746	1,324,746	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,010,705	4,019,880	9,174
その他有価証券	4,298,900	4,298,900	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	18,362,076	18,430,810	68,733
その他有価証券	6,899,008	6,899,008	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

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

有価証券

これらの時価について、譲渡性預金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、譲渡性預金以外のものは決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)は、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっており、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資以外のものは、決算日の市場価格等によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
非上場株式	132,500	67,500

非上場株式については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成23年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	6,270,894	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,000,000	10,400,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(注)	8,732,095	2,405,100	1,236,025	-
合計	19,002,989	12,805,100	1,236,025	-

(注) 譲渡性預金、投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

当事業年度(平成24年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,324,746	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,000,000	18,200,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(注)	6,301,000	2,409,250	1,459,100	-
合計	11,625,746	20,609,250	1,459,100	-

(注) 投資信託受益証券、国庫短期証券等であります

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成23年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)

時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	12,507,839	12,583,440	75,600
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,507,839	12,583,440	75,600
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	2,033,039	2,029,200	3,839
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,033,039	2,029,200	3,839
	合計	14,540,878	14,612,640	71,761

当事業年度（平成24年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	21,338,974	21,416,990	78,015
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	21,338,974	21,416,990	78,015
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	1,033,806	1,033,700	106
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,033,806	1,033,700	106
	合計	22,372,781	22,450,690	77,908

2. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,495,142	5,493,181	1,961
	国債・地方債等	5,495,142	5,493,181	1,961
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,659,502	2,608,636	1,050,865
	小計	9,154,645	8,101,818	1,052,826
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	999,700	999,761	61
	国債・地方債等	999,700	999,761	61
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,181,862	3,835,995	654,133
	小計	4,181,562	4,835,756	654,194
	合計	13,336,207	12,937,574	398,632

当事業年度（平成24年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
--	----	------------------	--------------	------------

貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	4,298,900	4,297,606	1,293
	国債・地方債等	4,298,900	4,297,606	1,293
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	4,307,034	3,281,746	1,025,288
	小計	8,605,934	7,579,352	1,026,581
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	2,591,974	3,160,015	568,040
	小計	2,591,974	3,160,015	568,040
合計		11,197,908	10,739,367	458,540

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上記の「その他有価証券」には含めておりません。

区分	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
非上場株式	132,500千円	67,500千円

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	561,210	35,991	17,676
合計	561,210	35,991	17,676

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	90,200	25,200	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	31,237	90	1,778
合計	121,437	25,290	1,778

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について5,706千円（その他有価証券の投資信託受益証券5,706千円）減損処理を行っております。

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

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、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、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を支払っております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
(1)退職給付債務	644,223千円	767,977千円
(2)退職給付引当金	644,223千円	767,977千円

(注) 当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
(1)勤務費用	130,059千円	132,222千円
(2)退職給付負担金	33,151千円	24,353千円

(注) 福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金	43,211千円	45,640千円

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

(税効果会計関係)

	前事業年度	当事業年度
	(平成23年3月31日)	(平成24年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	221,131千円	204,554千円
未払事業税	18,935	19,923
その他	<u>55,977</u>	<u>49,981</u>
繰延税金資産合計	296,044	274,458
繰延税金負債		
有価証券評価差額	<u>784</u>	<u>491</u>
繰延税金負債合計	<u>784</u>	<u>491</u>
繰延税金資産の純額	<u>295,260</u>	<u>273,967</u>
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	257,689	276,081
役員退職慰労引当金	4,510	4,857
税務上の繰延資産償却超過額	5,310	2,519
投資有価証券評価損	539,831	472,994
投資有価証券評価差額	261,653	212,965
その他	<u>30,323</u>	<u>6,911</u>
小計	<u>1,099,317</u>	<u>976,328</u>
評価性引当額	<u>120,282</u>	<u>106,755</u>
繰延税金資産合計	<u>979,034</u>	<u>869,573</u>
繰延税金負債		
特別分配金否認	58,098	50,467
投資有価証券評価差額	<u>420,346</u>	<u>381,742</u>
繰延税金負債合計	<u>478,445</u>	<u>432,209</u>
繰延税金資産の純額	<u>500,589</u>	<u>437,364</u>
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		
	前事業年度	当事業年度
	(平成23年3月31日)	(平成24年3月31日)
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の		法定実効税率 40.00%
負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5		(調整)
以下であるため注記を省略しております。		交際費等永久に損金に算入されない項目 0.93
	住民税均等割	0.85
	税率変更に伴う影響	9.27
	その他	<u>1.32</u>
	税効果会計適用後の法人税等の負担率	49.73
3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正		
「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）および「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が、平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率が変更されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される実効税率は、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。		
平成24年3月31日まで 40.00%		
平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.01%		
平成27年4月1日以降 35.64%		
この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債を控除した金額）は48,216千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,484千円、その他有価証券評価差額金が15,268千円、それぞれ増加しています。		

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産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。

[関連情報]

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する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、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、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、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	営業収益
日本生命保険相互会社	2,096,879

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する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、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、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、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,205,257

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	1,352,450	未収運用受託報酬	296,706
								投資助言報酬の受取	697,329	未収投資助言報酬	152,956
								業務受託料の受取	47,100	-	-

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	1,525,483	未収運用受託報酬	383,091
								投資助言報酬の受取	632,674	未収投資助言報酬	135,967
								業務受託料の受取	47,100	-	-

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、一般的取引条件と同様に決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	339,466円90銭	341,875円31銭
1株当たり当期純利益金額	4,031円18銭	3,173円18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、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
当期純利益	437,174千円	344,126千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	437,174千円	344,126千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第18期中間会計期間末
(平成24年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金・預金		861,189
有価証券		7,213,238
前払費用		580,968
未収委託者報酬		1,413,920
未収運用受託報酬		974,209
未収投資助言報酬		153,445
繰延税金資産		193,172
その他		41,624
流動資産合計		<u>11,431,768</u>

固定資産

有形固定資産	1	262,947
無形固定資産		1,227,694
投資その他の資産		
投資有価証券		26,318,839
繰延税金資産		545,994
その他		283,609
投資その他の資産合計		<u>27,148,443</u>

固定資産合計 28,639,084資産合計 40,070,853

負債の部

流動負債

未払手数料		548,329
未払運用委託報酬		430,444
未払投資助言報酬		140,037
その他未払金		179,488
未払費用		99,347
未払法人税等		129,746
前受投資助言報酬		70,261
賞与引当金		372,279
その他		219,373
流動負債合計		<u>2,189,308</u>

固定負債

退職給付引当金		821,839
役員退職慰労引当金		9,100
固定負債合計		<u>830,939</u>

負債合計 3,020,247

純資産の部	
株主資本	
資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	18,001,445
利益剰余金合計	18,681,252
株主資本合計	36,963,092
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	87,512
評価・換算差額等合計	87,512
純資産合計	37,050,605
負債・純資産合計	40,070,853

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第18期中間会計期間

(自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		4,485,618
運用受託報酬		2,469,602
投資助言報酬		338,891
業務受託料		23,614
営業収益計		7,317,725
営業費用		3,610,733
一般管理費	1	3,250,777
営業利益		456,214
営業外収益	2	88,157
営業外費用	3	15,890
経常利益		528,480
特別利益	4	107,408
特別損失	5	120,776
税引前中間純利益		515,112
法人税、住民税及び事業税		120,655
法人税等調整額		91,382
法人税等合計		212,037
中間純利益		303,074

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第18期中間会計期間

(自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

株主資本	
資本金	
当期首残高	10,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
資本剰余金合計	
当期首残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	139,807
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
当期首残高	120,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	120,000
研究開発積立金	
当期首残高	70,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	70,000
別途積立金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	17,833,930
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	18,001,445
利益剰余金合計	
当期首残高	18,513,737
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560

中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	18,681,252
株主資本合計	
当期首残高	36,795,577
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	36,963,092
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	280,116
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192,603
当中間期変動額合計	192,603
当中間期末残高	87,512
評価・換算差額等合計	
当期首残高	280,116
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192,603
当中間期変動額合計	192,603
当中間期末残高	87,512
純資産合計	
当期首残高	37,075,694
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192,603
当中間期変動額合計	25,088
当中間期末残高	37,050,605

（重要な会計方針）

項目	第18期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定額法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員へ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に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額（簡便法により自己都合退職による中間会計期間末要支給額の100%）を計上しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．リース取引の処理方法	<p>平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>
6．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。</p>

（会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の減価償却費が911千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ911千円増加しております。

（注記事項）

[中間貸借対照表関係]

第18期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	822,082千円

[中間損益計算書関係]

第18期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	37,633千円
無形固定資産	240,255千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	44,672千円
受取配当金	31,458千円
補助金収入	9,500千円
受取利息	115千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	15,252千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	105,652千円
投資有価証券償還益	1,755千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	119,106千円
投資有価証券償還損	152千円
事故損失賠償金	1千円
固定資産除却損	
建物	1,481千円
器具備品	35千円
計	1,516千円

[中間株主資本等変動計算書関係]

第18期中間会計期間
(自 平成24年4月1日
至 平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	前事業年度末 株式数(千株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成24年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成24年3月31日	平成24年6月25日

[リース取引関係]

第18期中間会計期間
 (自平成24年4月1日
 至平成24年9月30日)

1. リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引
 所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。その内容は以下のとおりであります。

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間会計期間末残高相当額

	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	中間 会計期間末残高 相当額
有形固定資産 (器具備品)	千円	千円	千円
	862	503	359

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	177千円
1年超	198千円
合計	375千円

当中間会計期間の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	93千円
減価償却費相当額	86千円
支払利息相当額	6千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引
 該当取引はありません。

〔金融商品関係〕

第18期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2を参照ください）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	861,189	861,189	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,013,898	4,022,770	8,871
その他有価証券	3,199,340	3,199,340	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	20,430,130	20,531,710	101,579
その他有価証券	5,821,209	5,821,209	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

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

有価証券

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

（注2）非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

〔有価証券関係〕

第18期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	23,639,299	23,749,760	110,460
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	23,639,299	23,749,760	110,460
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	804,729	804,720	9
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	804,729	804,720	9
合計		24,444,029	24,554,480	110,450

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,899,052	2,899,430	377
	国債・地方債 等	2,899,052	2,899,430	377
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,675,650	3,428,202	752,552
	小計	5,574,702	6,327,632	752,930
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	299,928	299,910	18
	国債・地方債 等	299,928	299,910	18
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,999,200	2,393,007	606,192
	小計	3,299,128	2,692,917	606,211
合計		8,873,830	9,020,549	146,718

(注1) 非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

[デリバティブ取引関係]

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

当社は、資産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。

[関連情報]

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、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	営業収益
日本生命保険相互会社	1,254,877

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

該当事項はありません。

[1株当たり情報]

	第18期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
1株当たり純資産額	341,643円97銭
1株当たり中間純利益	2,794円65銭

（注）1．潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2．1株当たり中間純利益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益	303,074千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	<u>303,074千円</u>
期中平均株式数	108千株

〔重要な後発事象〕

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

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。

自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又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）。

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、若しくは取引の公正を害し、又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）。

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ）又は子法人等（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又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又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、運用財産の額若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。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成24年9月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成24年9月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

(平成24年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
岡三証券株式会社	5,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	8,000百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
浜銀TT証券株式会社	3,307百万円	
フィデリティ証券株式会社	5,207百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	47,937百万円	
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ジャパネット銀行	37,250百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,250,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

(3) 投資助言会社（参考情報）

a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

b. 資本金の額

平成24年9月末現在、450百万円

c. 事業の内容

「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(2) 販売会社

証券投資信託の募集の取扱いおよび販売を行い、一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を代行します。

(3) 投資助言会社（参考情報）

委託会社に対し、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

3【資本関係】

(1) 日本生命保険相互会社（販売会社）は、委託会社の株式を97,604株（持株比率90.00%）保有しています。

(2) 委託会社は、株式会社ニッセイ基礎研究所（投資助言会社）の株式を1,350株（持株比率15.0%）保有しています（参考情報）。

委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
 - ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せや、資料のご請求などを委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
コールセンター 0120-762-506
（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ <http://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。

投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成24年6月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小暮和敏 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 大竹 新 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第17期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 小暮和敏 印
--------------------	--------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 大竹新 印
--------------------	-------------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第18期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成25年4月4日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 岩本 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイTOPIXオープンの平成24年2月21日から平成25年2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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイTOPIXオープンの平成25年2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。

利害関係

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

以上

1. 上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)