

【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】	2020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 大関 洋
【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 係るファンドの名称】	ニッセイTOPIXオープン
【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1兆円
【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】
1兆円を上限とします。
- (4)【発行(売出)価格】
取得申込受付日の基準価額です。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：2020年5月21日(木)～2020年11月20日(金)
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 <https://www.nam.co.jp/>
- (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。

(1 0) 【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 <https://www.nam.co.jp/>

(1 1) 【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

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

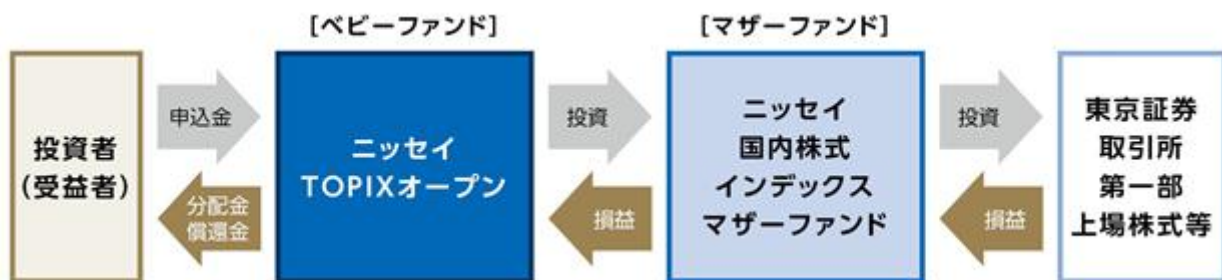
ファンドは、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

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月に設立された日本生命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・研究を実施しています。

< 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せん。

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せん）。

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	国 内	株 式 債 券	インデックス型
追 加 型	海 外 内 外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	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	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	日々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)		その他 ()
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマー ジング		

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。

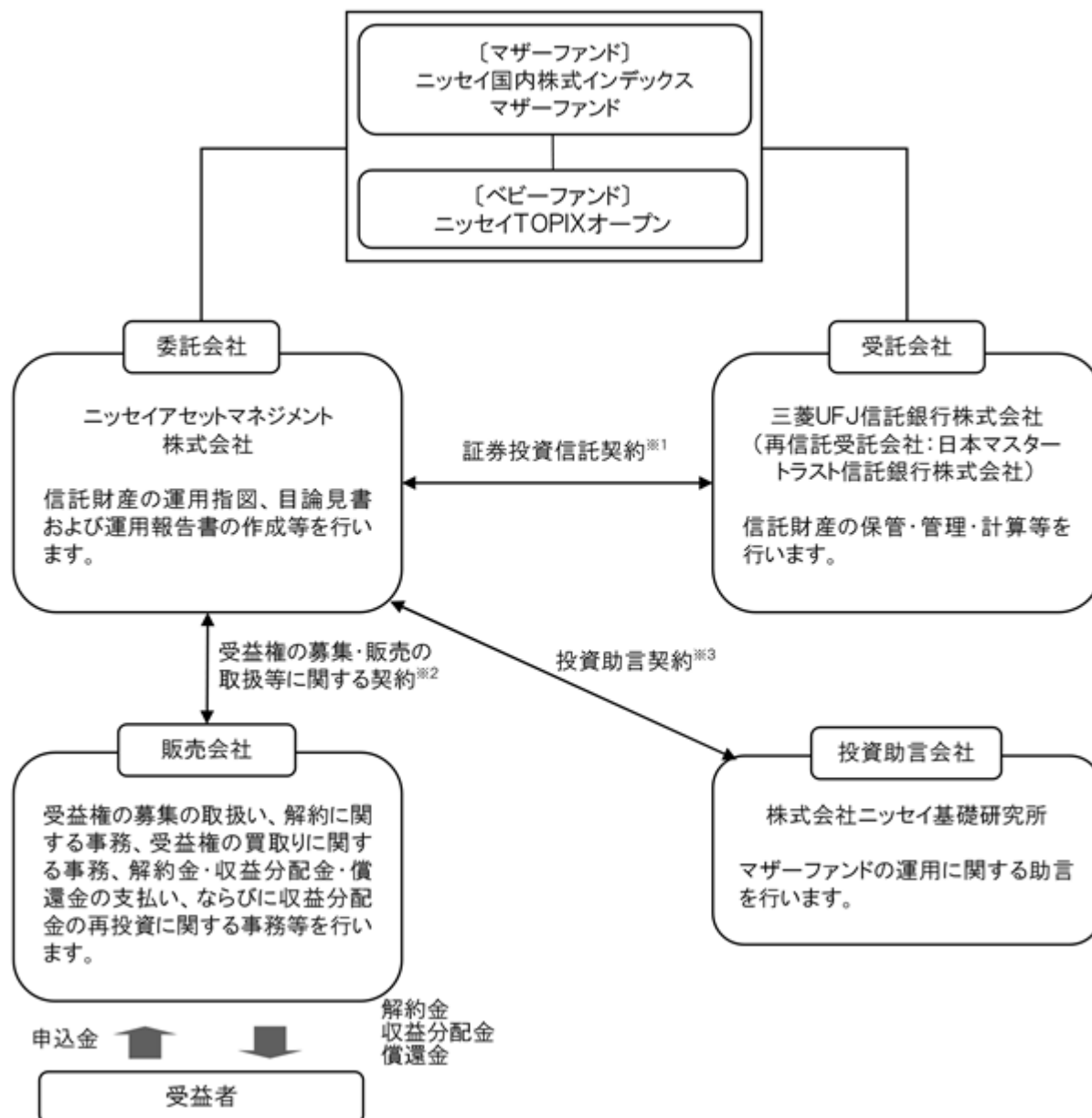
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

(2) 【ファンドの沿革】

2001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（2020年3月25日現在）

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 大関 洋
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 : 1995年4月4日

7. 沿革

1985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。
1995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。
1998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。
2000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	108,448株	100%

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(東証株価指数)(配当込み)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。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます)は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

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

(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)ます)
 - 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)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)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)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)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

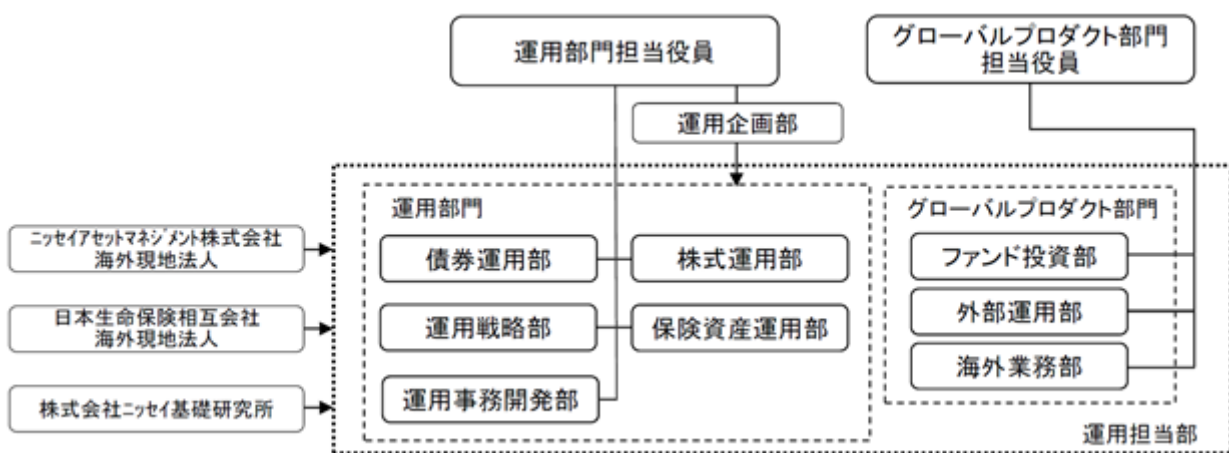
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

- 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。

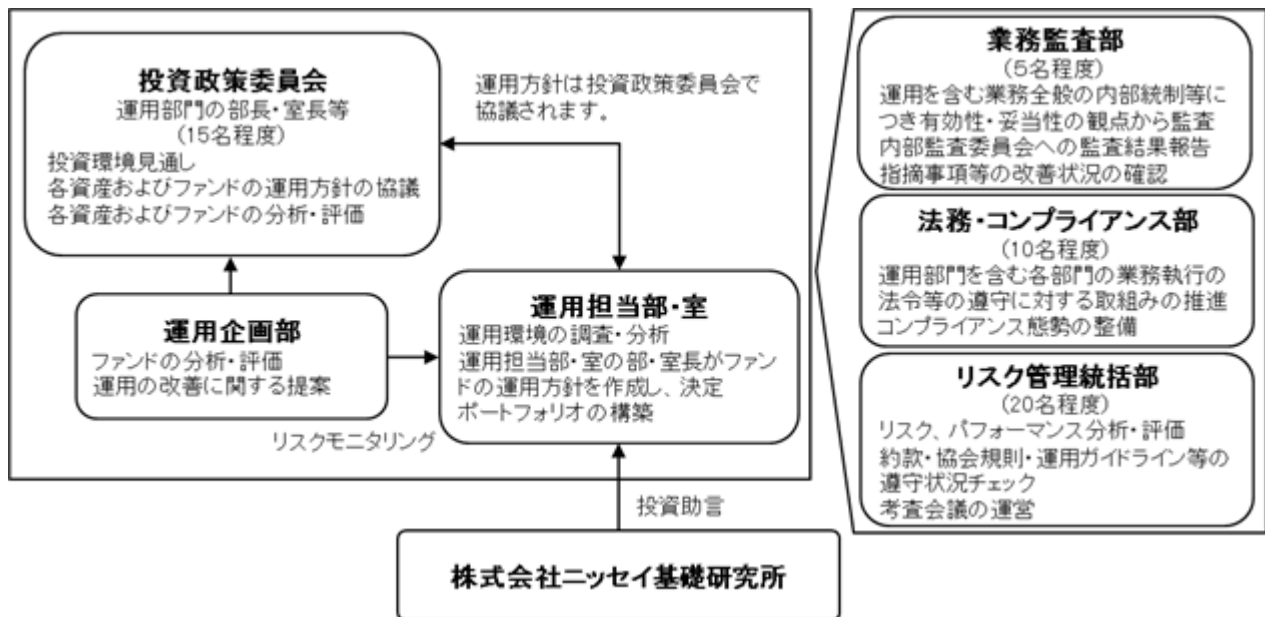
（3）【運用体制】

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/アナリスト服務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、受託業務の内部統制の有効性について、監査人による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、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
経費控除後の利息・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。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます)は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

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

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. 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. 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、新投資口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。

信用リスク集中回避（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法に反することとなる取引を行う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。

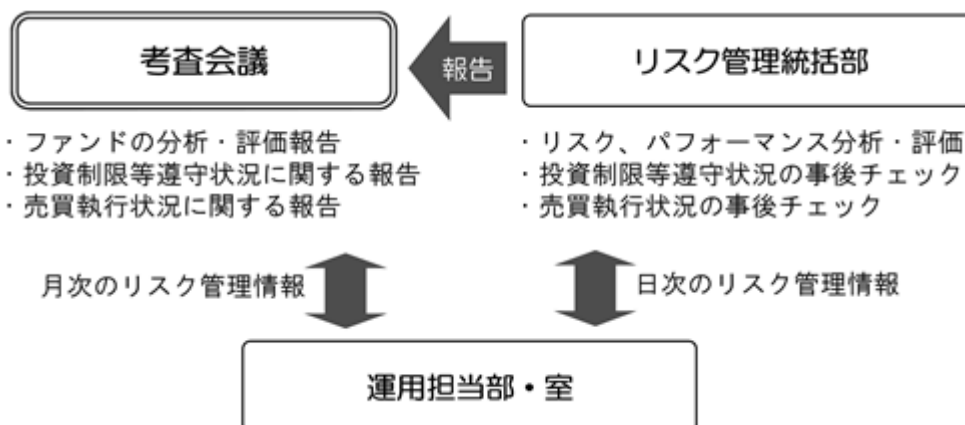
・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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
- ・収益分配金に関する留意点
- 収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。
- ・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. リスク管理統括部が、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、月次の考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、月次の考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。

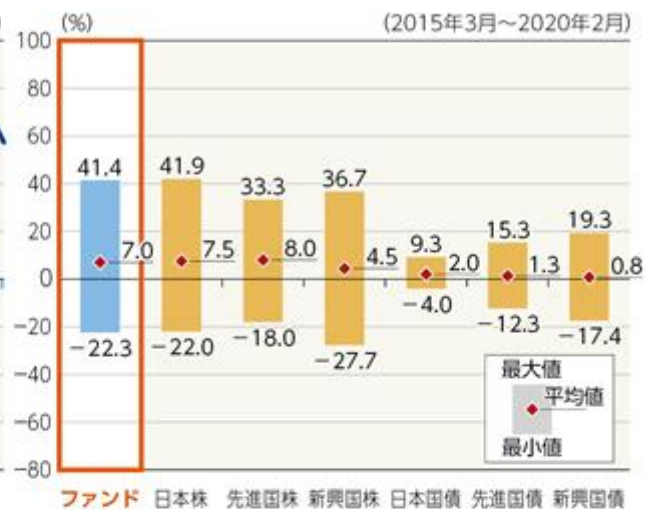
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



- ・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
- ・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間ににおけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)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・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標準に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

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 <https://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0.55%（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（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.215%	0.215%	0.070%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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 0.0022% (税抜0.002%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.0033% (税抜0.003%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.0055% (税抜0.005%)
10億円以下 の部分	年 0.0110% (税抜0.010%)

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。

<ご参考>

「4 手数料等及び税金」の「(1) 申込手数料」から「(4) その他の手数料等」までに記載の主な手数料において、当該手数料を対価とする役務の内容・收受先等は次の通りです。

申込手数料	投資者のファンドの取得時に、販売会社からの商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売会社における当該取得にかかる事務手続き等の対価として販売会社が収受
信託報酬のうち「委託会社」の報酬	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価として委託会社が収受
信託報酬のうち「販売会社」の報酬	投資者(受益者)へのファンド購入後の情報提供・運用報告書等各種書類の送付、また口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価として販売会社が収受
信託報酬のうち「受託会社」の報酬	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価として受託会社が収受
証券取引の手数料	有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
監査費用	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
借入金の利息	受託会社等から一時的に資金を借入れた場合に発生する利息

（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。
外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

- 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。

税率（個人）

2037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%）
2038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、2037年12月31日までは、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。

確定申告等により、解約請求、償還および買取請求時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます）の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）等との損益通算が可能です。また、解約請求、償還および買取請求時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）等については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

<少額投資非課税制度について>

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問合せください。

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はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

税率（法人）

2037年12月31日まで	15.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%）
2038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、2037年12月31日までは、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。

普通分配金	元本払戻金（特別分配金）
<p>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。</p>	<p>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。</p>

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】

「ニッセイTOPIXオープン」

(2020年2月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	10,249,326,310	100.00
内 日本	10,249,326,310	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	119,792	0.00
純資産総額	10,249,206,518	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」

(2020年2月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	60,493,709,480	97.94
内 日本	60,493,709,480	97.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,269,994,482	2.06
純資産総額	61,763,703,962	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。

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,124,625,000	1.82
内 日本	1,124,625,000	1.82

(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。

その他資産として、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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

「ニッセイTOPIXオープン」

(2020年2月28日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円)	評価単価(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
				簿価金額(円)	評価金額(円)		
1	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	6,306,889,613	1.8002	1.6251	-	100.00%
				11,354,050,463	10,249,326,310	-	

(注) 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	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	100.00
	小計		100.00
合計(対純資産総額比)			100.00

(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。

(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」

(2020年2月28日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	317,100	7,752.00 2,458,159,200	7,127.00 2,259,971,700	- -	3.66%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	179,700	7,522.00 1,351,703,400	6,611.00 1,187,996,700	- -	1.92%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	221,200	5,531.00 1,223,457,200	5,013.00 1,108,875,600	- -	1.80%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,929,200	562.80 1,085,753,760	531.90 1,026,141,480	- -	1.66%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	372,700	2,776.00 1,034,615,200	2,529.50 942,744,650	- -	1.53%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	236,400	4,163.00 984,133,200	3,763.00 889,573,200	- -	1.44%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	25,700	38,350.00 985,595,000	34,410.00 884,337,000	- -	1.43%
8	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	194,500	4,552.00 885,364,000	3,758.00 730,931,000	- -	1.18%
9	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	193,900	3,751.00 727,318,900	3,484.00 675,547,600	- -	1.09%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	207,800	3,409.00 708,390,200	3,058.00 635,452,400	- -	1.03%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	17,400	40,100.00 697,740,000	36,270.00 631,098,000	- -	1.02%
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	223,700	3,041.00 680,271,700	2,799.50 626,248,150	- -	1.01%
13	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	206,000	3,131.00 644,986,000	2,927.50 603,065,000	- -	0.98%
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	100,200	6,126.00 613,825,200	5,801.00 581,260,200	- -	0.94%
15	信越化学工業 日本	株式 化学	47,800	13,745.00 657,011,000	12,145.00 580,531,000	- -	0.94%
16	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,808,300	158.70 604,377,210	147.60 562,105,080	- -	0.91%
17	HOYA 日本	株式 精密機器	56,700	10,195.00 578,056,500	9,609.00 544,830,300	- -	0.88%
18	第一三共 日本	株式 医薬品	81,300	7,715.00 627,229,500	6,590.00 535,767,000	- -	0.87%
19	花王 日本	株式 化学	68,000	8,525.00 579,700,000	7,868.00 535,024,000	- -	0.87%
20	ダイキン工業 日本	株式 機械	36,200	15,445.00 559,109,000	14,725.00 533,045,000	- -	0.86%
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	196,400	2,852.00 560,132,800	2,690.00 528,316,000	- -	0.86%
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	136,500	4,189.00 571,798,500	3,637.00 496,450,500	- -	0.80%
23	ファナック 日本	株式 電気機器	27,000	20,470.00 552,690,000	17,970.00 485,190,000	- -	0.79%
24	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	195,700	2,604.50 509,700,650	2,461.50 481,715,550	- -	0.78%

25	村田製作所 日本	株式 電気機器	83,500	6,289.00 525,131,500	5,721.00 477,703,500	- -	0.77%
26	三井物産 日本	株式 卸売業	246,000	1,929.50 474,657,000	1,783.50 438,741,000	- -	0.71%
27	日本電産 日本	株式 電気機器	34,200	14,075.00 481,365,000	12,780.00 437,076,000	- -	0.71%
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	249,900	1,913.00 478,058,700	1,699.00 424,580,100	- -	0.69%
29	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	18,900	25,165.00 475,618,500	22,325.00 421,942,500	- -	0.68%
30	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	23,600	20,725.00 489,110,000	17,780.00 419,608,000	- -	0.68%

(注) 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	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	14.15
		情報・通信業	9.13
		輸送用機器	7.69
		化学	7.03
		医薬品	5.99
		銀行業	5.63
		卸売業	5.02
		機械	4.94
		サービス業	4.92
		小売業	4.38
		陸運業	4.01
		食料品	3.73
		建設業	2.72
		精密機器	2.44
		不動産業	2.37
		保険業	2.34
		その他製品	2.16
		電気・ガス業	1.50
		その他金融業	1.21
		証券、商品先物取引業	0.79
		ガラス・土石製品	0.79
		非鉄金属	0.69
		ゴム製品	0.69
		鉄鋼	0.67
		金属製品	0.56
		繊維製品	0.55
		石油・石炭製品	0.48
空運業	0.44		
鉱業	0.27		
パルプ・紙	0.23		
倉庫・運輸関連業	0.18		
海運業	0.15		
水産・農林業	0.09		
小計		97.94	
合計(対純資産総額比)		97.94	

(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】

「ニッセイTOPIXオープン」

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」

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

「ニッセイTOPIXオープン」

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」

(2020年2月28日現在)

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数 先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0203月	買建	75	1,251,979,950	1,124,625,000	1.82%

(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) 先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

「ニッセイTOPIXオープン」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10計算期間末 (2011年2月21日)	8,714,276,623	8,714,276,623	0.7946	0.7946
第11計算期間末 (2012年2月20日)	7,946,380,753	7,946,380,753	0.6804	0.6804
第12計算期間末 (2013年2月20日)	11,366,392,129	11,366,392,129	0.8242	0.8242
第13計算期間末 (2014年2月20日)	11,901,115,847	11,901,115,847	1.0261	1.0261
第14計算期間末 (2015年2月20日)	11,751,116,675	11,751,116,675	1.3102	1.3102
第15計算期間末 (2016年2月22日)	10,630,356,936	10,630,356,936	1.1519	1.1519
第16計算期間末 (2017年2月20日)	12,150,036,683	12,150,036,683	1.3943	1.3943
第17計算期間末 (2018年2月20日)	12,951,911,472	12,951,911,472	1.6140	1.6140
第18計算期間末 (2019年2月20日)	11,844,303,217	11,844,303,217	1.5030	1.5030
第19計算期間末 (2020年2月20日)	11,389,329,599	11,389,329,599	1.5918	1.5918
2019年2月末日	11,773,186,711	-	1.4980	-
3月末日	11,645,141,255	-	1.4985	-
4月末日	11,598,105,993	-	1.5228	-
5月末日	10,846,647,564	-	1.4232	-
6月末日	11,111,302,028	-	1.4616	-
7月末日	11,167,823,713	-	1.4740	-
8月末日	10,816,853,728	-	1.4237	-
9月末日	11,341,157,674	-	1.5093	-
10月末日	11,757,590,152	-	1.5842	-
11月末日	11,784,024,751	-	1.6144	-
12月末日	11,844,740,715	-	1.6370	-
2020年1月末日	11,530,357,742	-	1.6014	-
2月末日	10,249,206,518	-	1.4367	-

【分配の推移】

「ニッセイTOPIXオープン」

	1口当たりの分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

【収益率の推移】

「ニッセイTOPIXオープン」

	収益率(%)
第10計算期間	8.7
第11計算期間	14.4
第12計算期間	21.1
第13計算期間	24.5
第14計算期間	27.7
第15計算期間	12.1
第16計算期間	21.0
第17計算期間	15.8
第18計算期間	6.9
第19計算期間	5.9

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しております（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

(4) 【設定及び解約の実績】

「ニッセイTOPIXオープン」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第10計算期間	1,730,969,712	2,298,999,559	10,967,460,623
第11計算期間	1,861,523,446	1,149,596,498	11,679,387,571
第12計算期間	5,323,800,228	3,213,083,842	13,790,103,957
第13計算期間	5,135,350,758	7,327,078,364	11,598,376,351
第14計算期間	3,236,440,790	5,866,043,618	8,968,773,523
第15計算期間	2,938,706,523	2,678,626,407	9,228,853,639
第16計算期間	1,837,034,876	2,351,785,223	8,714,103,292
第17計算期間	1,667,238,065	2,356,613,048	8,024,728,309
第18計算期間	1,253,166,962	1,397,504,758	7,880,390,513
第19計算期間	723,029,020	1,448,636,647	7,154,782,886

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

3. 運用実績

2020年2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	14,367円
純資産総額	102億円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2016年2月	0円
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	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	14.4%
2	情報・通信業	9.3%
3	輸送用機器	7.9%
4	化学	7.2%
5	医薬品	6.1%
6	銀行業	5.8%
7	卸売業	5.1%
8	機械	5.0%
9	サービス業	5.0%
10	小売業	4.5%

・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	3.7%
2	ソニー	2.0%
3	ソフトバンクグループ	1.8%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.7%
5	日本電信電話	1.6%
6	武田薬品工業	1.5%
7	キーエンス	1.5%
8	リクルートホールディングス	1.2%
9	三井住友フィナンシャルグループ	1.1%
10	KDDI	1.1%

・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。

・2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

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みます）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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、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 <https://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. 換金請求の受け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 <https://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 <https://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。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託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(<https://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ます。

- ・ 交付運用報告書は、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。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)に掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、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ヵ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ヵ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19期計算期間（2019年2月21日から2020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18期 (2019年2月20日現在)	第19期 (2020年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	78,375	1,007,743
コール・ローン	32,009,613	30,279,094
親投資信託受益証券	11,844,437,558	11,389,461,056
未収入金	13,560,570	66,415,862
流動資産合計	11,890,086,116	11,487,163,755
資産合計	11,890,086,116	11,487,163,755
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,692,640	65,537,999
未払受託者報酬	4,595,190	4,484,168
未払委託者報酬	28,227,743	27,545,852
その他未払費用	267,326	266,137
流動負債合計	45,782,899	97,834,156
負債合計	45,782,899	97,834,156
純資産の部		
元本等		
元本	7,880,390,513	7,154,782,886
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,963,912,704	4,234,546,713
純資産合計	11,844,303,217	11,389,329,599
負債純資産合計	11,890,086,116	11,487,163,755

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期 (自2018年2月21日 至2019年2月20日)	第19期 (自2019年2月21日 至2020年2月20日)
営業収益		
受取利息	132	296
有価証券売買等損益	796,427,311	730,963,387
営業収益合計	796,427,179	730,963,683
営業費用		
支払利息	12,361	10,068
受託者報酬	9,427,485	8,730,440
委託者報酬	57,912,066	53,630,313
その他費用	542,817	521,860
営業費用合計	67,894,729	62,892,681
営業利益又は営業損失()	864,321,908	668,071,002
経常利益又は経常損失()	864,321,908	668,071,002
当期純利益又は当期純損失()	864,321,908	668,071,002
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()	48,392,727	61,484,340
期首剰余金又は期首欠損金()	4,927,183,163	3,963,912,704
剰余金増加額又は欠損金減少額	702,461,780	387,084,180
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	702,461,780	387,084,180
剰余金減少額又は欠損金増加額	849,803,058	723,036,833
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	849,803,058	723,036,833
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	3,963,912,704	4,234,546,713

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
---------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第18期 2019年2月20日現在	第19期 2020年2月20日現在
1 . 受益権総口数	7,880,390,513口	7,154,782,886口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5030円 (15,030円)	1.5918円 (15,918円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期 自2018年2月21日 至2019年2月20日	第19期 自2019年2月21日 至2020年2月20日
1 . 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(5,971,661,605円)及び分配準備積立金(3,008,590,366円)より分配対象収益は8,980,251,971円(1口当たり1.139569円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(5,674,260,520円)及び分配準備積立金(2,484,677,095円)より分配対象収益は8,158,937,615円(1口当たり1.140347円)のため、基準価額の水準、市場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

項目	第18期 自2018年2月21日 至2019年2月20日	第19期 自2019年2月21日 至2020年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
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。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2019年2月20日現在	第19期 2020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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第18期 2019年2月20日現在	第19期 2020年2月20日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終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	752,479,107	661,778,206
合計	752,479,107	661,778,206

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第18期 2019年2月20日現在	第19期 2020年2月20日現在
期首元本額	8,024,728,309円	7,880,390,513円
期中追加設定元本額	1,253,166,962円	723,029,020円
期中一部解約元本額	1,397,504,758円	1,448,636,647円

(4)【附属明細表】(2020年2月20日現在)

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	券面総額又は口数	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	6,326,072,571	11,389,461,056	
親投資信託受益証券	合計	6,326,072,571	11,389,461,056	
合計		6,326,072,571	11,389,461,056	

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」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開示対象期間末日（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

貸借対照表

（単位：円）

	2019年2月20日現在	2020年2月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,340,456	42,827,796
コール・ローン	955,881,002	1,286,823,310
株式	57,384,775,610	67,041,297,600
派生商品評価勘定	41,476,380	-
未収入金	-	6,565,600
未収配当金	91,185,526	108,315,429
前払金	-	22,135,000
差入委託証拠金	24,645,000	31,680,000
流動資産合計	58,500,303,974	68,539,644,735
資産合計	58,500,303,974	68,539,644,735
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	17,881,300
前受金	37,265,000	-
未払解約金	146,631,400	296,452,837
その他未払費用	661	3,233
流動負債合計	183,897,061	314,337,370
負債合計	183,897,061	314,337,370
純資産の部		
元本等		
元本	34,475,094,643	37,895,533,054
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,841,312,270	30,329,774,311
純資産合計	58,316,406,913	68,225,307,365
負債純資産合計	58,500,303,974	68,539,644,735

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、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。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年2月20日現在	2020年2月20日現在
1. 受益権総口数	34,475,094,643口	37,895,533,054口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6916円 (16,916円)	1.8004円 (18,004円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月21日 至 2019年2月20日	自 2019年2月21日 至 2020年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
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、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、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年2月20日現在	2020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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年2月20日現在	2020年2月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,450,732,412	2,553,090,093
合計	4,450,732,412	2,553,090,093

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	2019年2月20日 現在			2020年2月20日 現在			時価 (円)	評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)		
市場取引								
先物取引								
買 建	814,445,000	-	855,950,000	41,505,000	1,125,325,000	-	1,107,480,000	17,845,000
合計	814,445,000	-	855,950,000	41,505,000	1,125,325,000	-	1,107,480,000	17,845,000

(注) 1. 時価の算定方法

株指指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株指指数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。

3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年2月20日現在	2020年2月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	28,140,482,546円	34,475,094,643円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	15,227,365,012円	14,196,038,295円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	8,892,752,915円	10,775,599,884円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,001,913,903円	6,326,072,571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)	5,024,057,407円	4,354,685,255円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,238,812円	-円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,210,844円	4,063,446円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,206,570,755円	1,533,145,263円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,301,785,562円	5,401,509,272円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,932,098,974円	3,653,662,525円
ニッセイ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)	12,600,088円	8,430,005円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,132,565円	35,457,287円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,055,008円	33,985,449円
DCニッセイ国内株式インデックス	158,434,319円	308,410,353円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	13,107,204,121円	14,991,687,269円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	473,776,130円	708,282,393円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	26,130,458円	95,609,361円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,740,453円	86,255,178円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	16,118,045円	69,742,388円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25,983,647円	126,906,078円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,039,005円	31,936,187円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	21,997,831円	49,469,361円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,360,716円	5,859,103円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,998,804円	4,160,513円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	705,242円	1,135,532円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	1,334,030円	3,585,333円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	11,608,114円	19,339,643円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	286,261円	9,914,628円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	274,456円	7,978,547円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	258,945円	12,198,373円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	180,148円	12,051,741円
計	34,475,094,643円	37,895,533,054円

附属明細表(2020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(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,400	2,800.00	3,920,000	
日本水産	38,600	610.00	23,546,000	
マルハニチロ	5,600	2,565.00	14,364,000	
カネコ種苗	1,400	1,325.00	1,855,000	
サカタのタネ	4,600	3,335.00	15,341,000	
ホクト	2,900	1,974.00	5,724,600	
ヒノキヤグループ	1,000	2,038.00	2,038,000	
ショーボンドホールディングス	6,000	4,235.00	25,410,000	
ミライト・ホールディングス	11,500	1,510.00	17,365,000	
タマホーム	2,100	1,415.00	2,971,500	
ファーストコーポレーション	3,100	595.00	1,844,500	
ベステラ	1,300	1,110.00	1,443,000	
スペースバリューホールディングス	4,700	533.00	2,505,100	
住石ホールディングス	12,600	143.00	1,801,800	
日鉄鉱業	900	4,230.00	3,807,000	
三井松島ホールディングス	900	1,120.00	1,008,000	
国際石油開発帝石	154,800	1,072.00	165,945,600	
石油資源開発	5,000	2,798.00	13,990,000	
K&Oエナジーグループ	1,900	1,646.00	3,127,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	991.00	1,684,700	
安藤・間	23,000	856.00	19,688,000	
東急建設	11,300	749.00	8,463,700	
コムシスホールディングス	13,700	2,919.00	39,990,300	
ビーアールホールディングス	4,200	492.00	2,066,400	
高松コンストラクショングループ	2,400	2,594.00	6,225,600	
東建コーポレーション	1,200	8,200.00	9,840,000	
ヤマウラ	1,900	939.00	1,784,100	
大成建設	29,700	4,070.00	120,879,000	
大林組	89,100	1,229.00	109,503,900	
清水建設	90,400	1,082.00	97,812,800	
飛鳥建設	2,600	1,353.00	3,517,800	
長谷工コーポレーション	34,500	1,416.00	48,852,000	
松井建設	3,500	714.00	2,499,000	
銭高組	400	3,960.00	1,584,000	
鹿島建設	70,000	1,278.00	89,460,000	
不動テトラ	2,300	1,641.00	3,774,300	
大末建設	1,900	952.00	1,808,800	
鉄建建設	1,900	2,655.00	5,044,500	
西松建設	6,900	2,425.00	16,732,500	
三井住友建設	21,500	610.00	13,115,000	
大豊建設	2,000	2,627.00	5,254,000	
前田建設工業	22,300	1,067.00	23,794,100	
佐田建設	4,500	392.00	1,764,000	
ナカノフドー建設	3,800	452.00	1,717,600	
奥村組	4,800	2,829.00	13,579,200	
東鉄工業	3,800	3,070.00	11,666,000	
浅沼組	1,000	5,150.00	5,150,000	
戸田建設	37,000	712.00	26,344,000	
熊谷組	4,100	3,190.00	13,079,000	
北野建設	700	2,510.00	1,757,000	
植木組	700	2,494.00	1,745,800	
矢作建設工業	3,900	835.00	3,256,500	
ピーエス三菱	2,900	656.00	1,902,400	
日本ハウスホールディングス	6,100	442.00	2,696,200	

大東建託	10,700	12,420.00	132,894,000
新日本建設	3,800	860.00	3,268,000
N I P P O	7,400	2,680.00	19,832,000
東亜道路工業	600	3,360.00	2,016,000
前田道路	9,400	3,400.00	31,960,000
日本道路	900	7,160.00	6,444,000
東亜建設工業	2,800	1,765.00	4,942,000
日本国土開発	6,500	591.00	3,841,500
若築建設	1,600	1,599.00	2,558,400
東洋建設	10,000	502.00	5,020,000
五洋建設	35,300	658.00	23,227,400
世紀東急工業	4,300	883.00	3,796,900
福田組	1,000	4,415.00	4,415,000
住友林業	22,600	1,720.00	38,872,000
日本基礎技術	4,500	363.00	1,633,500
巴コーポレーション	4,600	373.00	1,715,800
大和ハウス工業	88,200	3,300.00	291,060,000
ライト工業	5,100	1,465.00	7,471,500
積水ハウス	97,500	2,317.50	225,956,250
日特建設	2,300	844.00	1,941,200
ユアテック	5,100	637.00	3,248,700
四電工	700	2,580.00	1,806,000
中電工	3,600	2,441.00	8,787,600
関電工	12,700	1,003.00	12,738,100
きんでん	21,200	1,793.00	38,011,600
東京エネシス	3,000	836.00	2,508,000
トーエネック	900	3,630.00	3,267,000
住友電設	2,500	2,461.00	6,152,500
日本電設工業	4,900	2,224.00	10,897,600
協和エクシオ	13,500	2,629.00	35,491,500
新日本空調	2,400	1,979.00	4,749,600
日本工営	1,800	3,320.00	5,976,000
九電工	6,300	3,130.00	19,719,000
三機工業	6,400	1,369.00	8,761,600
日揮ホールディングス	27,400	1,551.00	42,497,400
中外炉工業	1,000	1,700.00	1,700,000
ヤマト	2,900	726.00	2,105,400
太平電業	2,200	2,533.00	5,572,600
高砂熱学工業	7,700	1,860.00	14,322,000
三晃金属工業	700	2,607.00	1,824,900
N E C ネットエスアイ	2,600	4,220.00	10,972,000
朝日工業社	600	3,135.00	1,881,000
明星工業	5,800	787.00	4,564,600
大気社	4,300	3,440.00	14,792,000
ダイダン	2,100	2,735.00	5,743,500
日比谷総合設備	2,900	1,914.00	5,550,600
日本製粉	8,300	1,649.00	13,686,700
日清製粉グループ本社	32,200	1,956.00	62,983,200
昭和産業	2,600	3,035.00	7,891,000
鳥越製粉	2,500	826.00	2,065,000
中部飼料	3,500	1,629.00	5,701,500
フィード・ワン	19,200	175.00	3,360,000
東洋精糖	1,500	1,188.00	1,782,000
日本甜菜製糖	1,500	1,847.00	2,770,500
三井製糖	2,500	2,082.00	5,205,000
塩水港精糖	7,800	226.00	1,762,800
日新製糖	1,400	2,008.00	2,811,200
L I F U L L	9,500	507.00	4,816,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	1,615.00	2,907,000
日本M&Aセンター	20,500	3,680.00	75,440,000

メンバーズ	1,100	1,595.00	1,754,500
UTグループ	3,200	2,689.00	8,604,800
タケエイ	2,600	1,014.00	2,636,400
ビーネックスグループ	3,400	981.00	3,335,400
コシダカホールディングス	6,500	1,493.00	9,704,500
パソナグループ	2,900	1,320.00	3,828,000
CDS	1,300	1,383.00	1,797,900
リンクアンドモチベーション	6,000	507.00	3,042,000
GCA	3,300	801.00	2,643,300
エス・エム・エス	8,400	2,349.00	19,731,600
サニーサイドアップグループ	1,700	910.00	1,547,000
パーソルホールディングス	27,100	1,743.00	47,235,300
リニカル	1,700	993.00	1,688,100
クックパッド	9,500	311.00	2,954,500
アイ・ケイ・ケイ	2,500	741.00	1,852,500
森永製菓	6,700	4,690.00	31,423,000
中村屋	700	4,015.00	2,810,500
江崎グリコ	8,500	4,710.00	40,035,000
名糖産業	1,400	1,390.00	1,946,000
井村屋グループ	1,200	1,900.00	2,280,000
不二家	1,600	2,316.00	3,705,600
山崎製パン	21,400	2,007.00	42,949,800
モロゾフ	500	4,920.00	2,460,000
亀田製菓	1,600	4,775.00	7,640,000
寿スピリッツ	2,700	6,290.00	16,983,000
カルビー	13,000	3,050.00	39,650,000
森永乳業	5,300	4,070.00	21,571,000
六甲バター	1,900	1,545.00	2,935,500
ヤクルト本社	19,600	5,390.00	105,644,000
明治ホールディングス	18,900	7,070.00	133,623,000
雪印メグミルク	6,900	2,470.00	17,043,000
プリマハム	4,500	2,487.00	11,191,500
日本ハム	10,900	4,660.00	50,794,000
丸大食品	3,000	2,001.00	6,003,000
S Foods	2,300	2,635.00	6,060,500
柿安本店	1,000	3,105.00	3,105,000
伊藤ハム米久ホールディングス	18,400	662.00	12,180,800
学情	1,000	2,017.00	2,017,000
スタジオアリス	1,400	1,831.00	2,563,400
クロスキャット	1,500	1,191.00	1,786,500
シミックホールディングス	1,500	1,600.00	2,400,000
システナ	9,900	1,654.00	16,374,600
NJS	1,000	1,793.00	1,793,000
デジタルアーツ	1,400	5,470.00	7,658,000
日鉄ソリューションズ	4,200	3,335.00	14,007,000
総合警備保障	10,800	5,530.00	59,724,000
いちご	35,700	396.00	14,137,200
日本駐車場開発	30,700	146.00	4,482,200
コア	1,300	1,338.00	1,739,400
カカクコム	20,300	2,858.00	58,017,400
セントケア・ホールディング	3,800	459.00	1,744,200
ルネサンス	1,500	1,693.00	2,539,500
ディップ	3,800	3,240.00	12,312,000
SBSホールディングス	2,500	1,816.00	4,540,000
オプトホールディング	1,500	1,939.00	2,908,500
新日本科学	2,900	675.00	1,957,500
ツクイ	6,400	647.00	4,140,800
ベネフィット・ワン	7,400	1,961.00	14,511,400
エムスリー	59,900	3,065.00	183,593,500
ツカダ・グローバルホールディング	3,200	538.00	1,721,600

アウトソーシング	15,500	951.00	14,740,500
ウェルネット	2,700	666.00	1,798,200
ワールドホールディングス	1,000	1,953.00	1,953,000
ディー・エヌ・エー	13,300	1,573.00	20,920,900
博報堂DYホールディングス	37,800	1,443.00	54,545,400
ぐるなび	4,700	845.00	3,971,500
タカミヤ	2,900	596.00	1,728,400
ジャパンベストレスキューシステム	2,100	860.00	1,806,000
ファンコミュニケーションズ	7,500	436.00	3,270,000
ライク	900	1,906.00	1,715,400
ビジネス・ブレークスルー	4,600	407.00	1,872,200
エスプール	5,200	807.00	4,196,400
WDBホールディングス	1,200	2,638.00	3,165,600
バリューコマース	1,500	2,432.00	3,648,000
インフォマート	29,800	746.00	22,230,800
サッポロホールディングス	9,700	2,473.00	23,988,100
アサヒグループホールディングス	59,700	4,824.00	287,992,800
麒麟ホールディングス	120,900	2,266.50	274,019,850
宝ホールディングス	21,400	952.00	20,372,800
オエノンホールディングス	7,500	388.00	2,910,000
養命酒製造	900	1,931.00	1,737,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	20,000	2,937.00	58,740,000
サントリー食品インターナショナル	19,100	4,655.00	88,910,500
ダイドーグループホールディングス	1,500	3,935.00	5,902,500
伊藤園	8,700	5,470.00	47,589,000
キーコーヒー	2,800	2,250.00	6,300,000
日清オイリオグループ	3,700	3,710.00	13,727,000
不二製油グループ本社	7,000	2,748.00	19,236,000
かどや製油	500	3,800.00	1,900,000
J・オイルミルズ	1,500	4,250.00	6,375,000
ローソン	7,100	6,220.00	44,162,000
サンエー	2,300	4,560.00	10,488,000
カワチ薬品	2,200	2,090.00	4,598,000
エービーシー・マート	4,400	6,770.00	29,788,000
ハードオフコーポレーション	2,200	800.00	1,760,000
高千穂交易	1,600	1,121.00	1,793,600
アスクル	2,900	3,365.00	9,758,500
ゲオホールディングス	5,000	1,225.00	6,125,000
アダストリア	3,900	2,106.00	8,213,400
ジーフット	2,900	613.00	1,777,700
伊藤忠食品	700	4,870.00	3,409,000
くら寿司	1,500	5,400.00	8,100,000
キャンドゥ	1,300	1,631.00	2,120,300
エレマテック	2,600	983.00	2,555,800
パルグループホールディングス	1,400	3,430.00	4,802,000
JALUX	800	2,266.00	1,812,800
エディオン	12,800	1,012.00	12,953,600
あらた	2,200	4,545.00	9,999,000
サーラコーポレーション	5,700	605.00	3,448,500
トーマンデバイス	500	3,970.00	1,985,000
ハローズ	1,100	2,734.00	3,007,400
J Pホールディングス	8,500	309.00	2,626,500
フジオフードシステム	2,400	1,663.00	3,991,200
あみやき亭	600	3,415.00	2,049,000
東京エレクトロン デバイス	1,000	2,780.00	2,780,000
ひらまつ	6,700	243.00	1,628,100
フィールズ	3,300	476.00	1,570,800
双日	154,600	342.00	52,873,200
アルフレッサ ホールディングス	31,100	2,180.00	67,798,000

大黒天物産	700	3,335.00	2,334,500
ハニーズホールディングス	2,500	1,342.00	3,355,000
キッコーマン	20,500	5,880.00	120,540,000
味の素	63,000	1,987.00	125,181,000
キュービー	15,900	2,152.00	34,216,800
ハウス食品グループ本社	10,700	3,440.00	36,808,000
カゴメ	10,800	2,664.00	28,771,200
アリアケジャパン	2,600	7,500.00	19,500,000
ピエトロ	1,100	1,641.00	1,805,100
エバラ食品工業	800	2,180.00	1,744,000
ニチレイ	13,600	2,795.00	38,012,000
横浜冷凍	7,800	937.00	7,308,600
東洋水産	14,700	4,555.00	66,958,500
イトアンド	1,000	1,839.00	1,839,000
大冷	900	1,952.00	1,756,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,600	1,143.00	1,828,800
日清食品ホールディングス	12,100	8,900.00	107,690,000
永谷園ホールディングス	1,400	2,121.00	2,969,400
一正蒲鉾	1,900	951.00	1,806,900
フジッコ	3,100	1,884.00	5,840,400
ロック・フィールド	3,000	1,417.00	4,251,000
日本たばこ産業	164,700	2,267.00	373,374,900
ケンコーマヨネーズ	1,600	2,212.00	3,539,200
わらべや日洋ホールディングス	1,900	1,835.00	3,486,500
なとり	1,600	1,694.00	2,710,400
北の達人コーポレーション	10,000	628.00	6,280,000
ユーグレナ	12,200	824.00	10,052,800
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,613.00	2,258,200
片倉工業	4,000	1,332.00	5,328,000
グンゼ	2,000	4,135.00	8,270,000
ヒューリック	59,800	1,319.00	78,876,200
ラサ商事	2,000	903.00	1,806,000
アルペン	2,100	1,900.00	3,990,000
クオールホールディングス	4,100	1,388.00	5,690,800
アルコニックス	3,000	1,237.00	3,711,000
神戸物産	9,700	4,460.00	43,262,000
ジーンズホールディングス	1,500	7,410.00	11,115,000
ビックカメラ	16,600	1,080.00	17,928,000
D C Mホールディングス	15,100	1,044.00	15,764,400
ベッパーフードサービス	2,200	869.00	1,911,800
Monotaro	19,900	2,635.00	52,436,500
東京一番フーズ	3,000	608.00	1,824,000
DDホールディングス	1,100	1,684.00	1,852,400
あいホールディングス	4,000	1,731.00	6,924,000
ディービーエックス	1,900	918.00	1,744,200
きちりホールディングス	2,500	713.00	1,782,500
アークランドサービスホールディングス	2,000	2,010.00	4,020,000
J.フロントリテイリング	33,400	1,285.00	42,919,000
ドトール・日レスホールディングス	4,500	2,085.00	9,382,500
マツモトキヨシホールディングス	11,600	3,875.00	44,950,000
ブロンコビリー	1,500	2,530.00	3,795,000
ZOZO	19,200	1,723.00	33,081,600
物語コーポレーション	700	8,410.00	5,887,000
ココカラファイン	2,900	5,100.00	14,790,000
三越伊勢丹ホールディングス	48,900	801.00	39,168,900
東洋紡	11,000	1,500.00	16,500,000
ユニチカ	8,200	349.00	2,861,800
富士紡ホールディングス	1,300	3,420.00	4,446,000
日清紡ホールディングス	18,900	1,038.00	19,618,200
倉敷紡績	2,800	2,302.00	6,445,600

ダイワボウホールディングス	2,400	6,270.00	15,048,000
シキボウ	1,200	1,260.00	1,512,000
日東紡績	4,200	5,050.00	21,210,000
トヨタ紡織	8,300	1,624.00	13,479,200
マクニカ・富士エレホールディングス	6,700	1,715.00	11,490,500
Hamee	600	1,594.00	956,400
ラクト・ジャパン	1,000	3,940.00	3,940,000
ウエルシアホールディングス	8,300	6,250.00	51,875,000
クリエイトSDホールディングス	4,700	2,717.00	12,769,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,300	1,047.00	5,549,100
八洲電機	2,200	883.00	1,942,600
レスターホールディングス	2,900	1,844.00	5,347,600
ジュテックホールディングス	1,600	1,157.00	1,851,200
丸善CHIホールディングス	5,000	367.00	1,835,000
OCHIホールディングス	1,200	1,465.00	1,758,000
TOKAIホールディングス	14,800	986.00	14,592,800
黒谷	3,600	480.00	1,728,000
ミサワ	2,600	774.00	2,012,400
ティーライフ	2,000	849.00	1,698,000
Cominix	2,200	814.00	1,790,800
三洋貿易	2,800	1,205.00	3,374,000
チムニー	900	2,225.00	2,002,500
シュッピン	1,900	979.00	1,860,100
ビューティガレージ	900	2,032.00	1,828,800
ウイン・パートナーズ	2,000	1,061.00	2,122,000
ネクステージ	4,000	1,003.00	4,012,000
ジョイフル本田	8,200	1,246.00	10,217,200
鳥貴族	900	2,645.00	2,380,500
キリン堂ホールディングス	1,100	1,688.00	1,856,800
ホットランド	1,900	1,292.00	2,454,800
すかいらくホールディングス	31,400	1,853.00	58,184,200
SFPホールディングス	1,200	2,133.00	2,559,600
綿半ホールディングス	1,000	1,830.00	1,830,000
日本毛織	9,200	1,012.00	9,310,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8,100	959.00	7,767,900
三栄建築設計	1,200	1,490.00	1,788,000
野村不動産ホールディングス	17,000	2,751.00	46,767,000
三重交通グループホールディングス	5,700	581.00	3,311,700
サムティ	4,000	1,861.00	7,444,000
ディア・ライフ	3,600	569.00	2,048,400
コーセーアールイー	2,900	605.00	1,754,500
日本商業開発	1,800	1,771.00	3,187,800
プレサンスコーポレーション	4,600	1,277.00	5,874,200
ユニゾホールディングス	4,200	5,840.00	24,528,000
THEグローバル社	3,900	439.00	1,712,100
日本管理センター	1,800	1,408.00	2,534,400
サンセイランディック	2,000	820.00	1,640,000
エストラスト	2,100	825.00	1,732,500
フージャースホールディングス	5,600	697.00	3,903,200
オープンハウス	8,100	3,100.00	25,110,000
東急不動産ホールディングス	76,200	782.00	59,588,400
飯田グループホールディングス	23,400	1,626.00	38,048,400
イーランド	2,100	808.00	1,696,800
ムゲンエステート	2,600	594.00	1,544,400
帝国繊維	3,100	2,182.00	6,764,200
日本コークス工業	24,000	76.00	1,824,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,600	694.00	1,804,400
BEE NOS	1,600	1,111.00	1,777,600

あさひ	2,100	1,265.00	2,656,500
日本調剤	800	3,850.00	3,080,000
コスモス薬品	1,200	23,490.00	28,188,000
シップヘルスケアホールディングス	4,500	4,630.00	20,835,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,200	1,766.00	2,119,200
オンリー	2,300	778.00	1,789,400
セブン&アイ・ホールディングス	109,500	3,920.00	429,240,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,500	2,253.00	16,897,500
明治電機工業	1,200	1,440.00	1,728,000
ツルハホールディングス	6,100	12,670.00	77,287,000
サンマルクホールディングス	2,200	2,169.00	4,771,800
フェリシモ	1,800	942.00	1,695,600
トリドールホールディングス	3,500	2,735.00	9,572,500
帝人	22,700	2,011.00	45,649,700
東レ	201,500	700.00	141,050,000
クラレ	43,800	1,262.00	55,275,600
旭化成	184,500	1,024.00	188,928,000
サカイオーベックス	1,000	1,903.00	1,903,000
T O K Y O B A S E	3,600	457.00	1,645,200
稲葉製作所	1,600	1,334.00	2,134,400
宮地エンジニアリンググループ	900	2,043.00	1,838,700
トーカロ	7,800	1,125.00	8,775,000
アルファ	1,400	1,175.00	1,645,000
S U M C O	33,600	1,869.00	62,798,400
川田テクノロジーズ	600	6,190.00	3,714,000
R S T e c h n o l o g i e s	800	2,787.00	2,229,600
ハウスドゥ	1,500	1,190.00	1,785,000
アグレ都市デザイン	3,500	517.00	1,809,500
ジェイ・エス・ビー	300	5,170.00	1,551,000
テンポイノベーション	1,900	953.00	1,810,700
住江織物	800	2,332.00	1,865,600
日本フェルト	3,700	485.00	1,794,500
イチカワ	1,300	1,431.00	1,860,300
芦森工業	1,300	1,271.00	1,652,300
アツギ	2,400	787.00	1,888,800
J Mホールディングス	1,400	2,266.00	3,172,400
コメダホールディングス	6,100	2,141.00	13,060,100
サツドラホールディングス	1,000	1,815.00	1,815,000
パロックジャパンリミテッド	1,900	982.00	1,865,800
クスリのアオキホールディングス	2,500	6,560.00	16,400,000
スシローグローバルホールディングス	3,100	8,800.00	27,280,000
L I X I L ビバ	2,800	2,345.00	6,566,000
セーレン	6,800	1,585.00	10,778,000
ソトー	1,900	969.00	1,841,100
東海染工	1,600	1,123.00	1,796,800
小松マテーレ	4,600	790.00	3,634,000
ワコールホールディングス	7,300	2,800.00	20,440,000
ホギメディカル	3,200	3,305.00	10,576,000
クラウドシアホールディングス	3,800	459.00	1,744,200
T S I ホールディングス	9,300	495.00	4,603,500
マツオカコーポレーション	900	2,049.00	1,844,100
ワールド	3,900	2,324.00	9,063,600
T I S	9,300	7,120.00	66,216,000
電算システム	1,100	2,602.00	2,862,200
グリー	17,100	457.00	7,814,700
コーエーテクモホールディングス	5,700	3,080.00	17,556,000
三菱総合研究所	1,200	4,120.00	4,944,000
ボルテージ	3,500	507.00	1,774,500
電算	800	2,251.00	1,800,800

A G S	2,200	792.00	1,742,400
ファインデックス	2,300	885.00	2,035,500
ブレインパッド	700	5,090.00	3,563,000
K L a b	5,400	759.00	4,098,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,400	978.00	3,325,200
ネクソン	79,400	1,823.00	144,746,200
アイスタイル	7,800	350.00	2,730,000
エムアップ	800	2,730.00	2,184,000
エイチーム	1,900	888.00	1,687,200
エニゲモ	2,000	829.00	1,658,000
テクノスジャパン	3,500	496.00	1,736,000
コロプラ	9,100	947.00	8,617,700
オルトプラス	2,100	916.00	1,923,600
ブロードリーフ	13,800	523.00	7,217,400
クロス・マーケティンググループ	5,000	430.00	2,150,000
デジタルハーツホールディングス	1,800	965.00	1,737,000
システム情報	2,000	836.00	1,672,000
メディアドゥホールディングス	900	3,080.00	2,772,000
じげん	6,900	438.00	3,022,200
フィックスターズ	3,000	1,349.00	4,047,000
C A R T A H O L D I N G S	1,600	1,099.00	1,758,400
オブティム	700	4,650.00	3,255,000
セレス	1,400	1,280.00	1,792,000
S H I F T	700	7,220.00	5,054,000
特種東海製紙	1,800	3,995.00	7,191,000
ティーガイア	2,500	2,314.00	5,785,000
セック	500	3,670.00	1,835,000
豆蔵ホールディングス	1,900	1,881.00	3,573,900
テクマトリックス	2,000	2,830.00	5,660,000
プロシップ	1,300	1,388.00	1,804,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,700	1,839.00	12,321,300
G M O ペイメントゲートウェイ	4,600	7,550.00	34,730,000
ザッパラス	4,700	355.00	1,668,500
インターネットイニシアティブ	4,100	3,340.00	13,694,000
さくらインターネット	3,000	615.00	1,845,000
G M O クラウド	700	2,479.00	1,735,300
S R A ホールディングス	1,500	2,579.00	3,868,500
朝日ネット	2,600	713.00	1,853,800
e B A S E	1,700	1,705.00	2,898,500
アバント	2,000	961.00	1,922,000
アドソル日進	1,000	2,442.00	2,442,000
フリービット	2,100	803.00	1,686,300
コムチュア	3,100	2,258.00	6,999,800
サイバーコム	900	1,900.00	1,710,000
アステリア	3,100	529.00	1,639,900
アイル	1,000	1,826.00	1,826,000
王子ホールディングス	116,300	597.00	69,431,100
日本製紙	12,300	1,721.00	21,168,300
三菱製紙	4,000	440.00	1,760,000
北越コーポレーション	18,500	491.00	9,083,500
中越パルプ工業	1,200	1,478.00	1,773,600
大王製紙	12,200	1,441.00	17,580,200
阿波製紙	1,100	518.00	569,800
マークライズ	1,400	1,998.00	2,797,200
メディカル・データ・ビジョン	2,100	925.00	1,942,500
g u m i	3,600	726.00	2,613,600
モバイルファクトリー	1,000	1,850.00	1,850,000
テラスカイ	1,000	3,245.00	3,245,000

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,655.00	1,820,500
PCIホールディングス	800	2,250.00	1,800,000
PR TIMES	500	2,581.00	1,290,500
ランドコンピュータ	1,500	1,197.00	1,795,500
ダブルスタンダード	400	4,020.00	1,608,000
オーブンドア	1,400	1,210.00	1,694,000
アカツキ	1,000	4,730.00	4,730,000
Ubicomホールディングス	1,200	1,319.00	1,582,800
LINE	6,400	5,370.00	34,368,000
レンゴー	26,300	819.00	21,539,700
トーモク	1,700	1,706.00	2,900,200
ザ・パック	2,100	4,165.00	8,746,500
チェンジ	600	4,260.00	2,556,000
シンクロ・フード	3,300	429.00	1,415,700
オークネット	1,700	1,191.00	2,024,700
AOI TYO HOLDINGS	2,800	741.00	2,074,800
マクロミル	5,700	1,038.00	5,916,600
ビーグリー	1,400	1,506.00	2,108,400
オロ	700	3,335.00	2,334,500
昭和電工	19,800	2,655.00	52,569,000
住友化学	204,500	442.00	90,389,000
住友精化	1,200	3,165.00	3,798,000
日産化学	15,600	5,050.00	78,780,000
クレハ	2,400	5,950.00	14,280,000
多木化学	800	4,425.00	3,540,000
テイカ	2,000	1,631.00	3,262,000
石原産業	5,000	823.00	4,115,000
片倉コープアグリ	1,500	1,231.00	1,846,500
日本曹達	4,100	3,175.00	13,017,500
東ソー	43,000	1,641.00	70,563,000
トクヤマ	8,000	2,715.00	21,720,000
セントラル硝子	5,700	2,275.00	12,967,500
東亜合成	17,500	1,225.00	21,437,500
大阪ソーダ	2,800	2,730.00	7,644,000
関東電化工業	6,600	1,000.00	6,600,000
デンカ	10,200	2,943.00	30,018,600
イビデン	17,400	2,736.00	47,606,400
信越化学工業	47,800	13,745.00	657,011,000
日本カーバイド工業	1,400	1,271.00	1,779,400
堺化学工業	1,800	2,186.00	3,934,800
第一稀元素化学工業	3,000	851.00	2,553,000
エア・ウォーター	25,900	1,529.00	39,601,100
大陽日酸	26,700	2,194.00	58,579,800
日本化学工業	900	2,656.00	2,390,400
日本パーカライジング	14,000	1,102.00	15,428,000
高圧ガス工業	4,400	752.00	3,308,800
四国化成工業	4,300	1,212.00	5,211,600
ステラ ケミファ	1,500	3,230.00	4,845,000
保土谷化学工業	1,000	4,345.00	4,345,000
日本触媒	4,300	6,050.00	26,015,000
大日精化工業	2,500	2,629.00	6,572,500
カネカ	7,200	3,310.00	23,832,000
協和キリン	28,600	2,710.00	77,506,000
三菱瓦斯化学	26,300	1,821.00	47,892,300
三井化学	25,300	2,541.00	64,287,300
JSR	25,900	2,122.00	54,959,800
東京応化工業	4,800	4,420.00	21,216,000
大阪有機化学工業	2,600	1,715.00	4,459,000
三菱ケミカルホールディングス	186,000	787.30	146,437,800

KHネオケム	4,900	2,434.00	11,926,600
ダイセル	38,100	1,003.00	38,214,300
住友ベークライト	4,400	3,595.00	15,818,000
積水化学工業	59,800	1,807.00	108,058,600
日本ゼオン	25,100	1,209.00	30,345,900
アイカ工業	8,300	3,475.00	28,842,500
宇部興産	14,100	2,166.00	30,540,600
積水樹脂	5,000	2,373.00	11,865,000
タキロンシーアイ	6,000	625.00	3,750,000
旭有機材	1,600	1,604.00	2,566,400
日立化成	12,900	4,605.00	59,404,500
ニチバン	1,500	1,680.00	2,520,000
リケンテクノス	7,000	464.00	3,248,000
大倉工業	1,300	1,630.00	2,119,000
積水化成品工業	3,700	677.00	2,504,900
群栄化学工業	700	2,449.00	1,714,300
タイガースポリマー	3,200	554.00	1,772,800
ダイキョーニシカワ	5,900	725.00	4,277,500
竹本容器	2,100	855.00	1,795,500
森六ホールディングス	1,500	2,149.00	3,223,500
日本化薬	17,200	1,286.00	22,119,200
カーリットホールディングス	3,100	555.00	1,720,500
E P Sホールディングス	4,100	1,260.00	5,166,000
プレステージ・インターナショナル	10,200	987.00	10,067,400
プロトコーポレーション	2,500	1,339.00	3,347,500
アミューズ	1,500	2,637.00	3,955,500
野村総合研究所	39,500	2,640.00	104,280,000
クイック	1,700	1,444.00	2,454,800
T A C	8,900	198.00	1,762,200
C Eホールディングス	3,600	476.00	1,713,600
ケネディクス	25,300	672.00	17,001,600
電通グループ	28,000	3,380.00	94,640,000
インテージホールディングス	3,500	836.00	2,926,000
東邦システムサイエンス	2,000	907.00	1,814,000
ぴあ	800	3,885.00	3,108,000
イオンファンタジー	1,000	2,222.00	2,222,000
ソースネクスト	13,200	402.00	5,306,400
シーティーエス	3,100	726.00	2,250,600
ネクシィーズグループ	1,100	1,564.00	1,720,400
インフォコム	3,000	2,801.00	8,403,000
メディカルシステムネットワーク	3,700	484.00	1,790,800
日本精化	2,200	1,362.00	2,996,400
扶桑化学工業	2,800	3,420.00	9,576,000
トリケミカル研究所	600	9,550.00	5,730,000
ラクスル	1,500	3,445.00	5,167,500
F I G	6,300	288.00	1,814,400
A D E K A	12,800	1,547.00	19,801,600
日油	10,500	3,710.00	38,955,000
ミヨシ油脂	1,500	1,072.00	1,608,000
新日本理化	8,600	198.00	1,702,800
ハリマ化成グループ	2,300	1,051.00	2,417,300
イーソル	1,000	1,878.00	1,878,000
アルテリア・ネットワークス	3,100	1,899.00	5,886,900
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,100	1,552.00	1,707,200
花王	68,000	8,525.00	579,700,000
第一工業製薬	1,000	4,290.00	4,290,000
日華化学	2,100	777.00	1,631,700
ニイタカ	800	2,605.00	2,084,000
三洋化成工業	1,700	4,835.00	8,219,500

武田薬品工業	236,400	4,163.00	984,133,200
アステラス製薬	249,900	1,913.00	478,058,700
大日本住友製薬	21,100	1,722.00	36,334,200
塩野義製薬	36,300	6,459.00	234,461,700
わかもと製薬	7,000	279.00	1,953,000
あすか製薬	3,200	1,111.00	3,555,200
日本新薬	7,400	9,220.00	68,228,000
ビオフェルミン製薬	800	2,374.00	1,899,200
中外製薬	29,600	12,085.00	357,716,000
科研製薬	4,900	5,820.00	28,518,000
エーザイ	34,000	8,968.00	304,912,000
理研ビタミン	1,300	3,965.00	5,154,500
ロート製薬	14,600	3,270.00	47,742,000
小野薬品工業	65,300	2,541.00	165,927,300
久光製薬	7,600	5,530.00	42,028,000
有機合成薬品工業	6,900	418.00	2,884,200
持田製薬	3,900	4,260.00	16,614,000
参天製薬	52,900	1,954.00	103,366,600
扶桑薬品工業	1,000	1,955.00	1,955,000
ツムラ	8,800	2,803.00	24,666,400
日医工	8,000	1,316.00	10,528,000
テルモ	80,400	3,844.00	309,057,600
みらかホールディングス	7,600	2,806.00	21,325,600
キッセイ薬品工業	5,000	2,858.00	14,290,000
生化学工業	5,500	1,219.00	6,704,500
栄研化学	5,000	2,171.00	10,855,000
日水製薬	1,400	1,319.00	1,846,600
鳥居薬品	1,800	3,605.00	6,489,000
JCRファーマ	2,000	11,030.00	22,060,000
東和薬品	3,600	2,388.00	8,596,800
富士製薬工業	1,900	1,239.00	2,354,100
沢井製薬	5,800	7,040.00	40,832,000
ゼリア新薬工業	5,200	1,950.00	10,140,000
第一三共	81,300	7,715.00	627,229,500
キョーリン製薬ホールディングス	6,300	2,129.00	13,412,700
大幸薬品	1,100	5,230.00	5,753,000
ダイト	1,700	3,400.00	5,780,000
大塚ホールディングス	54,100	4,491.00	242,963,100
大正製薬ホールディングス	6,000	7,240.00	43,440,000
ペプチドリーム	14,400	5,190.00	74,736,000
大日本塗料	3,100	1,071.00	3,320,100
日本ペイントホールディングス	23,000	5,010.00	115,230,000
関西ペイント	31,300	2,531.00	79,220,300
中国塗料	7,900	933.00	7,370,700
日本特殊塗料	2,100	1,189.00	2,496,900
藤倉化成	3,800	530.00	2,014,000
太陽ホールディングス	2,000	4,750.00	9,500,000
D I C	11,800	2,927.00	34,538,600
サカタインクス	6,100	1,156.00	7,051,600
東洋インキS Cホールディングス	5,900	2,392.00	14,112,800
T & K T O K A	2,200	920.00	2,024,000
アルプス技研	2,400	1,962.00	4,708,800
日本空調サービス	2,800	753.00	2,108,400
オリエンタルランド	28,900	13,795.00	398,675,500
フォーカスシステムズ	1,900	892.00	1,694,800
ダスキン	7,000	2,999.00	20,993,000
パーク24	15,000	2,629.00	39,435,000
明光ネットワークジャパン	3,200	916.00	2,931,200
ファルコホールディングス	1,500	1,931.00	2,896,500
クレスコ	1,700	1,943.00	3,303,100

フジ・メディア・ホールディングス	26,900	1,421.00	38,224,900
秀英予備校	4,000	443.00	1,772,000
ラウンドワン	7,600	933.00	7,090,800
リゾートトラスト	12,400	1,613.00	20,001,200
オービック	9,700	14,630.00	141,911,000
ジャストシステム	4,500	5,130.00	23,085,000
TDCソフト	2,400	929.00	2,229,600
Zホールディングス	382,900	423.00	161,966,700
ビー・エム・エル	3,500	3,305.00	11,567,500
トレンドマイクロ	12,400	5,890.00	73,036,000
りらいあコミュニケーションズ	4,900	1,445.00	7,080,500
IDホールディングス	1,100	1,629.00	1,791,900
リソー教育	12,400	382.00	4,736,800
日本オラクル	5,700	9,560.00	54,492,000
アルファシステムズ	900	2,829.00	2,546,100
フューチャー	3,400	1,768.00	6,011,200
CAC Holdings	1,800	1,275.00	2,295,000
SBテクノロジー	1,000	2,363.00	2,363,000
トーセ	1,900	888.00	1,687,200
ユー・エス・エス	30,400	1,884.00	57,273,600
オービックビジネスコンサルタント	2,800	4,165.00	11,662,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,700	3,325.00	42,227,500
アイティフォー	3,400	749.00	2,546,600
東京個別指導学院	1,700	687.00	1,167,900
東計電算	400	4,530.00	1,812,000
サイバーエージェント	15,600	4,410.00	68,796,000
楽天	126,600	948.00	120,016,800
エクスネット	1,900	971.00	1,844,900
クリーク・アンド・リバー社	1,700	1,005.00	1,708,500
テー・オー・ダブリュー	2,200	859.00	1,889,800
大塚商会	15,100	4,850.00	73,235,000
サイボウズ	3,300	2,249.00	7,421,700
山田コンサルティンググループ	1,300	1,550.00	2,015,000
セントラルスポーツ	1,000	2,976.00	2,976,000
電通国際情報サービス	1,700	4,955.00	8,423,500
デジタルガレージ	5,000	4,075.00	20,375,000
イーエムシステムズ	3,900	899.00	3,506,100
ウェザーニューズ	900	3,845.00	3,460,500
C I J	2,200	823.00	1,810,600
ビジネスエンジニアリング	500	3,180.00	1,590,000
日本エンタープライズ	6,900	256.00	1,766,400
WOWOW	1,300	2,663.00	3,461,900
スカラ	2,400	709.00	1,701,600
フルキャストホールディングス	2,700	2,463.00	6,650,100
エン・ジャパン	4,800	3,485.00	16,728,000
富士フイルムホールディングス	54,500	5,364.00	292,338,000
コニカミノルタ	62,100	654.00	40,613,400
資生堂	56,500	6,985.00	394,652,500
ライオン	36,900	1,999.00	73,763,100
高砂香料工業	1,800	2,309.00	4,156,200
マンダム	6,400	2,551.00	16,326,400
ミルボン	3,800	5,880.00	22,344,000
ファンケル	11,500	3,070.00	35,305,000
コーセー	5,300	14,280.00	75,684,000
コタ	1,500	1,479.00	2,218,500
シーボン	700	2,455.00	1,718,500
ポーラ・オルビスホールディングス	12,100	2,263.00	27,382,300
ノエビアホールディングス	2,700	5,090.00	13,743,000
アジュバンコスメジャパン	1,800	987.00	1,776,600
エステー	1,800	1,601.00	2,881,800

アグロ カネショウ	1,200	1,409.00	1,690,800
コニシ	4,700	1,529.00	7,186,300
長谷川香料	3,800	2,177.00	8,272,600
星光PMC	2,000	884.00	1,768,000
小林製薬	8,000	8,570.00	68,560,000
荒川化学工業	2,600	1,491.00	3,876,600
メック	2,000	1,542.00	3,084,000
日本高純度化学	800	2,661.00	2,128,800
タカラバイオ	7,400	2,249.00	16,642,600
JCU	3,400	2,962.00	10,070,800
新田ゼラチン	2,700	640.00	1,728,000
デクセリアルズ	7,300	915.00	6,679,500
アース製薬	2,100	6,060.00	12,726,000
北興化学工業	2,900	625.00	1,812,500
大成ラミック	900	2,804.00	2,523,600
クミアイ化学工業	11,700	833.00	9,746,100
日本農薬	5,100	552.00	2,815,200
富士興産	2,700	677.00	1,827,900
ニチレキ	3,400	1,393.00	4,736,200
ユシロ化学工業	1,600	1,335.00	2,136,000
ピーピー・カストロール	1,300	1,372.00	1,783,600
富士石油	3,600	232.00	835,200
MORESCO	1,300	1,336.00	1,736,800
出光興産	32,000	2,903.00	92,896,000
JXTGホールディングス	427,500	468.30	200,198,250
コスモエネルギーホールディングス	8,200	2,000.00	16,400,000
横浜ゴム	16,500	2,017.00	33,280,500
TOYO TIRE	16,300	1,620.00	26,406,000
ブリヂストン	87,300	3,983.00	347,715,900
住友ゴム工業	25,600	1,246.00	31,897,600
オカモト	1,800	3,660.00	6,588,000
アキレス	2,000	1,949.00	3,898,000
フコク	2,600	688.00	1,788,800
ニッタ	3,200	2,881.00	9,219,200
クリエートメディック	1,600	1,104.00	1,766,400
住友理工	5,500	832.00	4,576,000
三ツ星ベルト	3,700	1,727.00	6,389,900
パンドー化学	5,000	817.00	4,085,000
AGC	28,100	3,480.00	97,788,000
日本板硝子	13,600	567.00	7,711,200
有沢製作所	4,500	910.00	4,095,000
日本山村硝子	1,500	1,190.00	1,785,000
日本電気硝子	11,400	2,059.00	23,472,600
オハラ	1,400	1,274.00	1,783,600
住友大阪セメント	5,400	4,170.00	22,518,000
太平洋セメント	17,900	2,946.00	52,733,400
リソルホールディングス	400	4,145.00	1,658,000
日本ヒューム	2,800	762.00	2,133,600
日本コンクリート工業	6,500	288.00	1,872,000
三谷セキサン	1,300	3,790.00	4,927,000
アジアパイルホールディングス	4,100	528.00	2,164,800
東海カーボン	29,800	1,016.00	30,276,800
日本カーボン	1,500	4,000.00	6,000,000
東洋炭素	1,700	2,013.00	3,422,100
ノリタケカンパニーリミテド	1,600	4,170.00	6,672,000
TOTO	20,300	4,600.00	93,380,000
日本碍子	34,700	1,882.00	65,305,400
日本特殊陶業	22,100	1,933.00	42,719,300
MARUWA	1,100	7,760.00	8,536,000
品川リフラクトリーズ	700	2,926.00	2,048,200

黒崎播磨	600	6,320.00	3,792,000
ヨータイ	2,700	673.00	1,817,100
イソライト工業	3,100	556.00	1,723,600
ニッカトー	2,700	673.00	1,817,100
フジインコーポレーテッド	2,500	3,055.00	7,637,500
クニミネ工業	1,200	1,205.00	1,446,000
ニチアス	7,800	2,546.00	19,858,800
日本製鉄	125,800	1,358.00	170,836,400
神戸製鋼所	51,400	455.00	23,387,000
中山製鋼所	3,900	452.00	1,762,800
合同製鐵	1,500	2,754.00	4,131,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	75,900	1,108.00	84,097,200
東京製鐵	13,700	799.00	10,946,300
共英製鋼	3,200	1,879.00	6,012,800
大和工業	6,000	2,499.00	14,994,000
東京鐵鋼	1,200	1,391.00	1,669,200
大阪製鐵	1,500	1,587.00	2,380,500
淀川製鋼所	3,800	1,977.00	7,512,600
丸一鋼管	9,100	2,859.00	26,016,900
モリ工業	800	2,621.00	2,096,800
大同特殊鋼	4,600	4,255.00	19,573,000
日本高周波鋼業	4,300	405.00	1,741,500
日本冶金工業	2,300	2,015.00	4,634,500
山陽特殊製鋼	1,900	1,449.00	2,753,100
愛知製鋼	1,600	3,350.00	5,360,000
日立金属	30,300	1,695.00	51,358,500
日本金属	2,200	805.00	1,771,000
大平洋金属	1,900	2,386.00	4,533,400
新日本電工	18,100	171.00	3,095,100
栗本鐵工所	1,400	2,111.00	2,955,400
日本製鋼所	8,500	1,820.00	15,470,000
三菱製鋼	2,100	980.00	2,058,000
日亜鋼業	5,700	309.00	1,761,300
日本精線	300	3,590.00	1,077,000
大紀アルミニウム工業所	4,600	661.00	3,040,600
日本軽金属ホールディングス	71,100	215.00	15,286,500
三井金属鉱業	7,600	2,921.00	22,199,600
東邦亜鉛	1,400	1,839.00	2,574,600
三菱マテリアル	18,600	2,763.00	51,391,800
住友金属鉱山	35,900	3,063.00	109,961,700
DOWAホールディングス	7,100	3,940.00	27,974,000
古河機械金属	5,000	1,336.00	6,680,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	1,293.00	3,749,700
東邦チタニウム	5,000	845.00	4,225,000
UACJ	4,300	2,115.00	9,094,500
CKサンエツ	600	3,355.00	2,013,000
古河電気工業	8,700	2,572.00	22,376,400
住友電気工業	105,100	1,458.50	153,288,350
フジクラ	33,900	385.00	13,051,500
昭和電線ホールディングス	3,300	1,302.00	4,296,600
東京特殊電線	100	2,574.00	257,400
タツタ電線	5,600	579.00	3,242,400
カナレ電気	1,000	1,785.00	1,785,000
平河ヒューテック	1,300	1,317.00	1,712,100
リョービ	3,500	1,665.00	5,827,500
アーレスティ	3,700	500.00	1,850,000
アサヒホールディングス	4,900	2,703.00	13,244,700
東洋製罐グループホールディングス	17,900	1,987.00	35,567,300
ホッカンホールディングス	1,500	1,814.00	2,721,000
コロナ	1,800	991.00	1,783,800

横河ブリッジホールディングス	5,200	2,218.00	11,533,600
OSJBホールディングス	14,100	264.00	3,722,400
三和ホールディングス	27,000	1,106.00	29,862,000
文化シャッター	8,300	836.00	6,938,800
三協立山	3,600	1,308.00	4,708,800
アルインコ	2,000	1,091.00	2,182,000
LIXILグループ	41,500	1,907.00	79,140,500
日本ファイルコン	3,500	510.00	1,785,000
ノーリツ	5,800	1,306.00	7,574,800
長府製作所	2,900	2,241.00	6,498,900
リンナイ	5,500	8,170.00	44,935,000
ユニプレス	5,500	1,296.00	7,128,000
ダイニチ工業	2,600	664.00	1,726,400
日東精工	3,900	526.00	2,051,400
三洋工業	900	1,977.00	1,779,300
岡部	5,700	852.00	4,856,400
ジーテクト	3,500	1,460.00	5,110,000
東プレ	5,200	1,605.00	8,346,000
高周波熱錬	5,400	814.00	4,395,600
東京製網	2,000	946.00	1,892,000
サンコール	1,400	548.00	767,200
モリテックスチール	5,100	333.00	1,698,300
パイオラックス	4,200	1,807.00	7,589,400
エイチワン	2,800	667.00	1,867,600
日本発条	30,100	910.00	27,391,000
三浦工業	12,200	3,840.00	46,848,000
タクマ	9,500	1,240.00	11,780,000
テクノプロ・ホールディングス	5,400	7,730.00	41,742,000
インターワークス	3,300	538.00	1,775,400
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	7,370.00	8,107,000
Keeper 技研	1,500	1,120.00	1,680,000
三機サービス	1,800	995.00	1,791,000
Gunosy	1,700	1,159.00	1,970,300
イー・ガーディアン	1,400	1,914.00	2,679,600
リブセンス	6,400	281.00	1,798,400
ジャパンマテリアル	8,300	1,517.00	12,591,100
ベクトル	3,400	1,199.00	4,076,600
ウチヤマホールディングス	3,800	447.00	1,698,600
チャーム・ケア・コーポレーション	2,300	938.00	2,157,400
キャリアリンク	3,200	584.00	1,868,800
IBJ	1,900	1,221.00	2,319,900
アサンテ	1,100	1,875.00	2,062,500
N・フィールド	3,000	562.00	1,686,000
バリューHR	600	3,445.00	2,067,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	3,750.00	7,125,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,000	1,665.00	1,665,000
ERIホールディングス	2,300	766.00	1,761,800
アビスト	700	2,533.00	1,773,100
シグマクシス	1,900	1,665.00	3,163,500
ウィルグループ	1,800	995.00	1,791,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	212.00	1,823,200
リクルートホールディングス	194,500	4,552.00	885,364,000
エラン	1,600	1,644.00	2,630,400
ツガミ	5,800	978.00	5,672,400
オークマ	3,300	5,000.00	16,500,000
東芝機械	3,200	3,180.00	10,176,000
アマダホールディングス	35,700	1,086.00	38,770,200
アイダエンジニアリング	7,400	878.00	6,497,200
滝澤鉄工所	1,400	1,285.00	1,799,000

F U J I	12,100	1,909.00	23,098,900
牧野フライス製作所	3,300	4,065.00	13,414,500
オーエスジー	13,000	1,779.00	23,127,000
ダイジェット工業	1,300	1,379.00	1,792,700
旭ダイヤモンド工業	7,400	571.00	4,225,400
D M G 森精機	17,800	1,528.00	27,198,400
ソディック	6,600	817.00	5,392,200
ディスコ	3,800	24,740.00	94,012,000
日東工器	1,500	2,440.00	3,660,000
日進工具	800	2,818.00	2,254,400
パンチ工業	4,100	409.00	1,676,900
日本郵政	222,500	1,005.00	223,612,500
ベルシステム 2 4 ホールディングス	4,500	1,508.00	6,786,000
鎌倉新書	2,000	1,648.00	3,296,000
一蔵	2,700	623.00	1,682,100
L I T A L I C O	900	2,476.00	2,228,400
エアトリ	1,200	1,328.00	1,593,600
アトラエ	700	2,805.00	1,963,500
ストライク	1,000	4,730.00	4,730,000
ソラスト	7,500	1,060.00	7,950,000
セラク	1,500	1,226.00	1,839,000
インソース	1,300	2,893.00	3,760,900
豊田自動織機	23,000	6,340.00	145,820,000
豊和工業	2,300	769.00	1,768,700
O K K	2,900	600.00	1,740,000
東洋機械金属	3,500	501.00	1,753,500
エンシュウ	1,000	1,112.00	1,112,000
島精機製作所	4,500	1,928.00	8,676,000
オプトラ	3,100	3,265.00	10,121,500
N C ホールディングス	2,600	648.00	1,684,800
イワキ	1,500	1,069.00	1,603,500
フリュー	2,700	1,158.00	3,126,600
ヤマシンフィルタ	6,100	692.00	4,221,200
日阪製作所	3,500	936.00	3,276,000
やまびこ	5,400	1,004.00	5,421,600
平田機工	1,300	5,830.00	7,579,000
ペガサスミシン製造	3,900	456.00	1,778,400
ナブテスコ	16,600	3,245.00	53,867,000
三井海洋開発	3,000	1,990.00	5,970,000
レオン自動機	2,800	1,340.00	3,752,000
S M C	8,900	49,230.00	438,147,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	2,900	748.00	2,169,200
ホソカワミクロン	1,000	5,380.00	5,380,000
ユニオンツール	1,000	2,986.00	2,986,000
オイレス工業	3,600	1,544.00	5,558,400
日精エー・エス・ピー機械	900	4,110.00	3,699,000
サトーホールディングス	4,000	2,744.00	10,976,000
技研製作所	2,500	4,415.00	11,037,500
日本エアーテック	1,900	1,031.00	1,958,900
カワタ	1,800	1,004.00	1,807,200
日精樹脂工業	2,400	929.00	2,229,600
オカダアイヨン	1,500	1,080.00	1,620,000
小松製作所	128,700	2,300.00	296,010,000
住友重機械工業	16,300	2,666.00	43,455,800
日立建機	11,400	2,952.00	33,652,800
日工	3,900	776.00	3,026,400
巴工業	1,200	2,125.00	2,550,000
井関農機	2,800	1,359.00	3,805,200
T O W A	2,900	1,111.00	3,221,900

丸山製作所	1,100	1,614.00	1,775,400
北川鉄工所	1,300	1,981.00	2,575,300
シンニッタン	4,400	392.00	1,724,800
ローツェ	1,200	3,965.00	4,758,000
タカキタ	3,400	528.00	1,795,200
クボタ	150,800	1,607.00	242,335,600
荏原実業	900	2,002.00	1,801,800
東洋エンジニアリング	3,700	575.00	2,127,500
三菱化工機	1,000	1,913.00	1,913,000
月島機械	5,200	1,347.00	7,004,400
帝国電機製作所	2,300	1,462.00	3,362,600
新東工業	6,700	900.00	6,030,000
澁谷工業	2,500	2,735.00	6,837,500
アイチコーポレーション	4,900	695.00	3,405,500
小森コーポレーション	7,200	923.00	6,645,600
鶴見製作所	2,200	1,879.00	4,133,800
荏原製作所	11,700	2,830.00	33,111,000
西島製作所	2,900	841.00	2,438,900
北越工業	2,900	1,297.00	3,761,300
ダイキン工業	36,200	15,445.00	559,109,000
オルガノ	1,000	6,890.00	6,890,000
トーヨーカネツ	1,200	2,454.00	2,944,800
栗田工業	15,400	3,235.00	49,819,000
橋本チエイン	4,100	3,220.00	13,202,000
日機装	8,500	1,109.00	9,426,500
木村化工機	3,200	557.00	1,782,400
レイズネクスト	4,800	1,286.00	6,172,800
アネスト岩田	4,400	1,024.00	4,505,600
ダイフク	14,500	6,970.00	101,065,000
サムコ	900	1,920.00	1,728,000
加藤製作所	1,600	1,455.00	2,328,000
油研工業	1,100	1,676.00	1,843,600
タダノ	13,700	1,014.00	13,891,800
フジテック	10,300	1,700.00	17,510,000
C K D	7,900	1,966.00	15,531,400
キトー	2,100	1,682.00	3,532,200
平和	7,900	2,250.00	17,775,000
理想科学工業	2,500	1,928.00	4,820,000
SANKYO	6,300	3,895.00	24,538,500
日本金銭機械	3,100	780.00	2,418,000
マースグループホールディングス	1,800	1,992.00	3,585,600
フクシマガリレイ	1,800	4,025.00	7,245,000
ダイコク電機	1,300	1,383.00	1,797,900
竹内製作所	4,800	1,911.00	9,172,800
アマノ	7,400	2,881.00	21,319,400
JUKI	4,000	802.00	3,208,000
サンデンホールディングス	3,700	624.00	2,308,800
蛇の目ミシン工業	4,600	390.00	1,794,000
ブラザー工業	34,700	2,142.00	74,327,400
マックス	4,300	2,007.00	8,630,100
モリタホールディングス	5,000	1,766.00	8,830,000
グローリー	7,300	3,160.00	23,068,000
新晃工業	2,600	1,664.00	4,326,400
大和冷機工業	4,100	1,071.00	4,391,100
セガサミーホールディングス	28,200	1,660.00	46,812,000
日本ピストンリング	1,300	1,432.00	1,861,600
リケン	1,300	3,405.00	4,426,500
T P R	3,800	1,649.00	6,266,200
ツバキ・ナカシマ	5,800	1,198.00	6,948,400
ホシザキ	8,300	10,480.00	86,984,000

大豊工業	2,600	678.00	1,762,800
日本精工	53,500	908.00	48,578,000
NTN	65,800	294.00	19,345,200
ジェイテクト	27,300	1,159.00	31,640,700
不二越	2,600	4,020.00	10,452,000
ミネベアミツミ	52,700	2,172.00	114,464,400
日本トムソン	8,400	429.00	3,603,600
THK	16,500	2,762.00	45,573,000
ユースン精機	2,200	899.00	1,977,800
前澤給装工業	1,000	2,198.00	2,198,000
イーグル工業	3,500	934.00	3,269,000
日本ピラー工業	2,900	1,509.00	4,376,100
キッツ	11,500	712.00	8,188,000
日立製作所	136,500	4,189.00	571,798,500
三菱電機	284,100	1,566.50	445,042,650
富士電機	17,100	3,385.00	57,883,500
東洋電機製造	1,200	1,393.00	1,671,600
安川電機	30,600	3,735.00	114,291,000
シンフォニアテクノロジー	3,700	1,185.00	4,384,500
明電舎	5,200	1,981.00	10,301,200
オリジン	1,200	1,486.00	1,783,200
山洋電気	1,400	5,140.00	7,196,000
デンヨー	2,400	2,041.00	4,898,400
ベイカレント・コンサルティング	1,600	7,880.00	12,608,000
MS-Japan	1,300	1,263.00	1,641,900
グレイステクノロジー	1,200	3,205.00	3,846,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,900	2,216.00	6,426,400
フルテック	1,600	1,130.00	1,808,000
日総工業	2,000	818.00	1,636,000
キュービーネットホールディングス	1,100	2,280.00	2,508,000
RPAホールディングス	1,700	1,091.00	1,854,700
三櫻工業	3,600	1,014.00	3,650,400
マキタ	37,100	4,130.00	153,223,000
東芝テック	3,600	4,160.00	14,976,000
芝浦メカトロニクス	500	3,390.00	1,695,000
マブチモーター	7,900	4,160.00	32,864,000
日本電産	34,200	14,075.00	481,365,000
トレックス・セミコンダクター	1,600	1,487.00	2,379,200
東光高岳	1,600	1,142.00	1,827,200
ダブル・スコープ	4,500	745.00	3,352,500
ダイヘン	3,100	3,305.00	10,245,500
ヤーマン	4,600	627.00	2,884,200
JVCケンウッド	23,100	252.00	5,821,200
ミマキエンジニアリング	3,600	499.00	1,796,400
第一精工	1,200	2,435.00	2,922,000
日新電機	6,700	1,121.00	7,510,700
大崎電気工業	5,700	602.00	3,431,400
オムロン	25,500	6,720.00	171,360,000
日東工業	4,200	2,146.00	9,013,200
IDEC	4,100	1,853.00	7,597,300
不二電機工業	1,500	1,205.00	1,807,500
ジーエス・ユアサコーポレーション	9,500	2,137.00	20,301,500
サクサホールディングス	1,000	1,839.00	1,839,000
メルコホールディングス	1,000	2,537.00	2,537,000
日本電気	34,500	4,795.00	165,427,500
富士通	27,400	12,630.00	346,062,000
沖電気工業	11,500	1,330.00	15,295,000
電気興業	1,400	3,295.00	4,613,000
サンケン電気	3,100	2,903.00	8,999,300

アイホン	1,600	1,676.00	2,681,600
ルネサスエレクトロニクス	135,800	779.00	105,788,200
セイコーエプソン	35,300	1,691.00	59,692,300
ワコム	19,100	388.00	7,410,800
アルバック	5,200	3,615.00	18,798,000
E I Z O	2,200	3,730.00	8,206,000
ジャパンディスプレイ	82,100	71.00	5,829,100
日本信号	7,200	1,358.00	9,777,600
京三製作所	6,700	555.00	3,718,500
能美防災	3,800	2,334.00	8,869,200
ホーチキ	2,100	1,375.00	2,887,500
エレコム	3,100	3,950.00	12,245,000
パナソニック	324,600	1,189.00	385,949,400
シャープ	32,900	1,491.00	49,053,900
アンリツ	18,300	2,023.00	37,020,900
富士通ゼネラル	7,700	2,434.00	18,741,800
ソニー	179,700	7,522.00	1,351,703,400
T D K	13,700	11,450.00	156,865,000
帝国通信工業	1,500	1,230.00	1,845,000
タムラ製作所	9,500	574.00	5,453,000
アルプスアルパイン	25,100	1,836.00	46,083,600
池上通信機	1,700	1,015.00	1,725,500
日本電波工業	3,700	480.00	1,776,000
鈴木	2,100	873.00	1,833,300
日本トリム	400	3,865.00	1,546,000
ローランド ディー・ジー	1,600	1,835.00	2,936,000
フォスター電機	3,000	1,545.00	4,635,000
S M K	700	2,832.00	1,982,400
ヨコオ	1,800	2,954.00	5,317,200
ホシデン	7,800	1,094.00	8,533,200
ヒロセ電機	4,400	12,890.00	56,716,000
日本航空電子工業	6,500	1,921.00	12,486,500
T O A	3,000	1,025.00	3,075,000
マクセルホールディングス	6,100	1,413.00	8,619,300
古野電気	3,700	1,059.00	3,918,300
ユニデンホールディングス	900	2,050.00	1,845,000
スミダコーポレーション	2,200	1,114.00	2,450,800
アイコム	1,600	2,579.00	4,126,400
リオン	1,200	2,821.00	3,385,200
船井電機	2,900	707.00	2,050,300
横河電機	26,100	1,939.00	50,607,900
新電元工業	1,000	3,420.00	3,420,000
アズビル	17,900	2,937.00	52,572,300
東亜ディーケーケー	1,800	977.00	1,758,600
日本光電工業	11,700	3,510.00	41,067,000
共和電業	4,000	433.00	1,732,000
日本電子材料	1,600	999.00	1,598,400
堀場製作所	5,600	6,840.00	38,304,000
アドバンテスト	21,100	5,610.00	118,371,000
小野測器	3,000	583.00	1,749,000
エスベック	2,500	2,184.00	5,460,000
キーエンス	25,700	38,350.00	985,595,000
日置電機	1,500	3,695.00	5,542,500
シスメックス	20,300	7,444.00	151,113,200
日本マイクロニクス	4,900	1,087.00	5,326,300
メガチップス	2,600	1,800.00	4,680,000
O B A R A G R O U P	1,500	3,090.00	4,635,000
I M A G I C A G R O U P	3,800	461.00	1,751,800
澤藤電機	900	1,951.00	1,755,900
デンソー	62,600	4,467.00	279,634,200

原田工業	1,900	957.00	1,818,300
コーセル	3,800	1,143.00	4,343,400
イリソ電子工業	2,400	4,060.00	9,744,000
オブテックスグループ	4,700	1,513.00	7,111,100
千代田インテグレ	1,300	2,118.00	2,753,400
アイ・オー・データ機器	1,900	909.00	1,727,100
レーザーテック	12,500	5,630.00	70,375,000
スタンレー電気	20,000	2,920.00	58,400,000
岩崎電気	1,100	1,634.00	1,797,400
ウシオ電機	16,500	1,475.00	24,337,500
岡谷電機産業	4,900	363.00	1,778,700
ヘリオス テクノ ホールディング	4,300	395.00	1,698,500
エノモト	1,400	1,209.00	1,692,600
日本セラミック	2,900	2,463.00	7,142,700
遠藤照明	2,600	686.00	1,783,600
古河電池	2,400	700.00	1,680,000
山一電機	2,100	1,877.00	3,941,700
図研	1,800	2,426.00	4,366,800
日本電子	5,600	3,365.00	18,844,000
カシオ計算機	25,100	2,100.00	52,710,000
ファナック	27,000	20,470.00	552,690,000
日本シイエムケイ	6,700	560.00	3,752,000
エンブラス	1,400	2,993.00	4,190,200
ローム	12,600	8,230.00	103,698,000
浜松ホトニクス	20,400	4,615.00	94,146,000
三井ハイテック	3,100	1,611.00	4,994,100
新光電気工業	9,500	1,361.00	12,929,500
京セラ	40,000	7,472.00	298,880,000
協栄産業	1,300	1,379.00	1,792,700
太陽誘電	12,600	3,485.00	43,911,000
村田製作所	83,500	6,289.00	525,131,500
双葉電子工業	4,500	1,185.00	5,332,500
日東電工	19,600	6,000.00	117,600,000
北陸電気工業	1,600	1,041.00	1,665,600
東海理化電機製作所	7,500	1,818.00	13,635,000
ニチコン	9,600	877.00	8,419,200
日本ケミコン	2,200	1,786.00	3,929,200
K O A	4,300	1,185.00	5,095,500
三井E & Sホールディングス	10,300	878.00	9,043,400
日立造船	22,500	424.00	9,540,000
三菱重工業	47,600	3,762.00	179,071,200
川崎重工業	22,100	2,219.00	49,039,900
I H I	20,500	2,737.00	56,108,500
名村造船所	9,200	243.00	2,235,600
スプリックス	1,700	980.00	1,666,000
日本車輛製造	1,000	2,870.00	2,870,000
三菱ロジスネクスト	3,800	1,679.00	6,380,200
近畿車輛	1,300	1,357.00	1,764,100
F P G	8,600	970.00	8,342,000
島根銀行	2,800	609.00	1,705,200
じもとホールディングス	18,900	103.00	1,946,700
全国保証	7,900	4,550.00	35,945,000
めぶきフィナンシャルグループ	145,600	234.00	34,070,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,800	1,205.00	4,579,000
九州フィナンシャルグループ	46,000	410.00	18,860,000
かんぽ生命保険	9,900	1,821.00	18,027,900
ゆうちょ銀行	79,400	1,008.00	80,035,200
富山第一銀行	6,700	308.00	2,063,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	164,800	420.00	69,216,000

西日本フィナンシャルホールディングス	19,100	682.00	13,026,200
日本モーゲージサービス	800	2,225.00	1,780,000
アルヒ	4,500	1,808.00	8,136,000
プレミアグループ	1,500	2,059.00	3,088,500
日産自動車	335,100	504.40	169,024,440
いすゞ自動車	82,300	1,137.00	93,575,100
トヨタ自動車	317,100	7,752.00	2,458,159,200
日野自動車	35,500	1,010.00	35,855,000
三菱自動車工業	105,200	405.00	42,606,000
エフテック	900	738.00	664,200
武蔵精密工業	6,300	1,343.00	8,460,900
日産車体	5,500	1,073.00	5,901,500
新明和工業	7,700	1,286.00	9,902,200
極東開発工業	5,300	1,385.00	7,340,500
日信工業	5,800	2,240.00	12,992,000
トビー工業	2,300	1,720.00	3,956,000
ティラド	1,000	1,770.00	1,770,000
曙ブレーキ工業	15,600	238.00	3,712,800
タチエス	4,700	1,252.00	5,884,400
NOK	15,300	1,564.00	23,929,200
フタバ産業	7,900	620.00	4,898,000
KYB	3,200	2,725.00	8,720,000
市光工業	4,200	716.00	3,007,200
大同メタル工業	5,400	668.00	3,607,200
プレス工業	14,100	352.00	4,963,200
ミクニ	5,500	320.00	1,760,000
太平洋工業	5,900	1,293.00	7,628,700
ケーヒン	6,500	2,587.00	16,815,500
河西工業	3,800	740.00	2,812,000
アイシン精機	23,400	3,905.00	91,377,000
マツダ	83,600	898.00	75,072,800
今仙電機製作所	2,600	854.00	2,220,400
本田技研工業	223,700	3,041.00	680,271,700
スズキ	56,300	4,850.00	273,055,000
SUBARU	88,200	2,922.50	257,764,500
安永	1,500	1,142.00	1,713,000
ヤマハ発動機	37,100	1,946.00	72,196,600
ショーワ	6,700	2,286.00	15,316,200
小糸製作所	17,000	4,655.00	79,135,000
TBK	4,000	427.00	1,708,000
エクセディ	3,900	2,227.00	8,685,300
ミツバ	5,200	726.00	3,775,200
豊田合成	9,200	2,501.00	23,009,200
愛三工業	4,400	693.00	3,049,200
日本プラスト	2,700	656.00	1,771,200
ヨロズ	2,700	1,446.00	3,904,200
エフ・シー・シー	4,600	2,134.00	9,816,400
シマノ	10,600	15,550.00	164,830,000
テイ・エス テック	6,600	3,090.00	20,394,000
関西みらいフィナンシャルグループ	16,400	566.00	9,282,400
三十三フィナンシャルグループ	2,600	1,526.00	3,967,600
第四北越フィナンシャルグループ	4,900	2,546.00	12,475,400
ジャムコ	1,400	1,297.00	1,815,800
小野建	2,500	1,273.00	3,182,500
ノジマ	5,000	2,137.00	10,685,000
佐島電機	2,100	861.00	1,808,100
カッパ・クリエイト	3,900	1,448.00	5,647,200
伯東	1,700	1,194.00	2,029,800
コンドーテック	2,200	1,166.00	2,565,200
ライトオン	3,100	570.00	1,767,000

ナガイレーベン	4,000	2,343.00	9,372,000
三菱食品	3,100	2,932.00	9,089,200
良品計画	37,200	1,741.00	64,765,200
松田産業	2,000	1,499.00	2,998,000
第一興商	4,200	4,795.00	20,139,000
メディバルホールディングス	30,200	2,205.00	66,591,000
アドヴァン	4,300	1,246.00	5,357,800
S P K	700	2,623.00	1,836,100
萩原電気ホールディングス	1,000	2,525.00	2,525,000
アルビス	1,100	2,152.00	2,367,200
アズワン	1,900	9,070.00	17,233,000
スズデン	1,300	1,415.00	1,839,500
シモジマ	1,700	1,104.00	1,876,800
ドウシシャ	2,600	1,568.00	4,076,800
小津産業	1,000	1,689.00	1,689,000
コナカ	4,500	400.00	1,800,000
高速	1,700	1,202.00	2,043,400
G - 7ホールディングス	1,600	2,512.00	4,019,200
イオン北海道	2,800	831.00	2,326,800
コジマ	4,800	490.00	2,352,000
ヒマラヤ	2,200	833.00	1,832,600
コーナン商事	4,000	2,410.00	9,640,000
ネットワンシステムズ	10,600	2,467.00	26,150,200
エコス	1,100	1,671.00	1,838,100
ワタミ	3,300	1,178.00	3,887,400
マルシェ	2,400	766.00	1,838,400
システムソフト	18,600	94.00	1,748,400
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	61,500	1,962.00	120,663,000
丸文	2,900	596.00	1,728,400
西松屋チェーン	6,100	906.00	5,526,600
ゼンショーホールディングス	13,400	2,462.00	32,990,800
ハビネット	2,300	1,274.00	2,930,200
幸楽苑ホールディングス	1,800	1,849.00	3,328,200
日本ライフライン	8,300	1,403.00	11,644,900
サイゼリヤ	4,600	2,282.00	10,497,200
V Tホールディングス	11,600	414.00	4,802,400
マルカ	1,000	2,069.00	2,069,000
アルゴグラフィックス	2,400	3,675.00	8,820,000
I D O M	7,500	630.00	4,725,000
日本エム・ディ・エム	1,600	1,918.00	3,068,800
ユナイテッドアローズ	2,900	2,755.00	7,989,500
進和	1,700	2,181.00	3,707,700
ダイトロン	1,200	1,930.00	2,316,000
ハイデイ日高	4,000	1,907.00	7,628,000
シークス	3,600	1,358.00	4,888,800
京都きもの友禅	5,500	325.00	1,787,500
コロワイド	9,300	2,204.00	20,497,200
ピーシーデポコーポレーション	3,700	583.00	2,157,100
田中商事	2,500	708.00	1,770,000
オーハシテクニカ	1,600	1,482.00	2,371,200
壱番屋	2,000	5,430.00	10,860,000
白銅	1,200	1,408.00	1,689,600
P L A N T	3,200	551.00	1,763,200
スギホールディングス	5,600	5,430.00	30,408,000
薬王堂ホールディングス	1,200	2,180.00	2,616,000
島津製作所	34,000	2,877.00	97,818,000
J M S	2,400	840.00	2,016,000
長野計器	2,100	976.00	2,049,600
ブイ・テクノロジー	1,300	4,460.00	5,798,000

スター精密	4,400	1,328.00	5,843,200
東京計器	1,900	898.00	1,706,200
インターアクション	1,500	2,761.00	4,141,500
オーバル	7,500	231.00	1,732,500
東京精密	5,100	3,875.00	19,762,500
マニー	11,300	2,548.00	28,792,400
ニコン	46,000	1,195.00	54,970,000
トプコン	14,300	1,227.00	17,546,100
オリンパス	157,200	2,110.00	331,692,000
理研計器	2,500	2,230.00	5,575,000
S C R E E Nホールディングス	4,900	6,210.00	30,429,000
キヤノン電子	3,000	2,027.00	6,081,000
タムロン	2,300	2,698.00	6,205,400
H O Y A	56,700	10,195.00	578,056,500
シード	1,800	961.00	1,729,800
ノーリツ鋼機	1,900	1,510.00	2,869,000
エー・アンド・デイ	2,600	1,008.00	2,620,800
朝日インテック	24,100	2,830.00	68,203,000
キヤノン	153,000	2,787.50	426,487,500
リコー	72,300	1,111.00	80,325,300
シチズン時計	33,300	487.00	16,217,100
リズム時計工業	2,000	880.00	1,760,000
大研医器	1,000	678.00	678,000
メニコン	3,900	5,030.00	19,617,000
スノーピーク	1,700	851.00	1,446,700
パラマウントベッドホールディングス	3,000	4,570.00	13,710,000
トランザクション	1,800	1,073.00	1,931,400
粧美堂	4,600	391.00	1,798,600
ニホンフラッシュ	1,300	2,549.00	3,313,700
前田工織	3,100	2,131.00	6,606,100
永大産業	5,500	326.00	1,793,000
アートネイチャー	3,000	733.00	2,199,000
バンダイナムコホールディングス	29,400	5,910.00	173,754,000
共立印刷	11,000	167.00	1,837,000
S H O E I	1,400	5,370.00	7,518,000
フランスベッドホールディングス	4,000	917.00	3,668,000
マーベラス	4,300	672.00	2,889,600
パイロットコーポレーション	4,700	4,195.00	19,716,500
萩原工業	1,600	1,642.00	2,627,200
エイベックス	4,800	1,241.00	5,956,800
トッパン・フォームズ	6,100	1,155.00	7,045,500
フジシールインターナショナル	6,400	2,108.00	13,491,200
タカラトミー	12,700	1,059.00	13,449,300
廣済堂	2,000	869.00	1,738,000
アーク	19,800	90.00	1,782,000
レック	3,000	1,165.00	3,495,000
三光合成	5,200	335.00	1,742,000
プロネクス	2,400	1,132.00	2,716,800
ホクシン	11,900	145.00	1,725,500
大建工業	1,900	1,895.00	3,600,500
凸版印刷	40,100	2,038.00	81,723,800
大日本印刷	37,200	2,936.00	109,219,200
共同印刷	900	2,859.00	2,573,100
N I S S H A	5,800	988.00	5,730,400
光村印刷	1,100	1,656.00	1,821,600
藤森工業	2,500	3,285.00	8,212,500
ヴィア・ホールディングス	3,400	656.00	2,230,400
T A K A R A & C O M P A N Y	1,400	1,655.00	2,317,000
前澤化成工業	1,800	1,122.00	2,019,600
未来工業	1,500	2,029.00	3,043,500

アシックス	23,500	1,336.00	31,396,000
ツツミ	900	1,973.00	1,775,700
JSP	1,700	1,784.00	3,032,800
ニチハ	4,000	2,529.00	10,116,000
エフピコ	3,200	6,890.00	22,048,000
小松ウオール工業	900	2,073.00	1,865,700
ヤマハ	16,900	5,880.00	99,372,000
河合楽器製作所	900	3,015.00	2,713,500
ビジョン	17,200	3,930.00	67,596,000
天馬	1,900	1,915.00	3,638,500
オリバー	700	3,725.00	2,607,500
キングジム	2,400	840.00	2,016,000
象印マホービン	8,300	1,916.00	15,902,800
リンテック	6,800	2,544.00	17,299,200
信越ポリマー	5,100	950.00	4,845,000
東リ	7,100	292.00	2,073,200
イトーキ	6,100	422.00	2,574,200
任天堂	17,400	40,100.00	697,740,000
三菱鉛筆	4,700	1,590.00	7,473,000
松風	1,300	1,959.00	2,546,700
タカラスタANDARD	5,900	1,716.00	10,124,400
コクヨ	13,600	1,589.00	21,610,400
ニフコ	10,400	2,852.00	29,660,800
立川ブラインド工業	1,400	1,213.00	1,698,200
グローブライド	1,300	2,208.00	2,870,400
オカムラ	9,900	1,006.00	9,959,400
バルカー	2,300	2,318.00	5,331,400
MUTOHホールディングス	1,000	1,688.00	1,688,000
伊藤忠商事	195,700	2,604.50	509,700,650
丸紅	291,300	789.50	229,981,350
スクロール	5,200	344.00	1,788,800
高島	900	1,894.00	1,704,600
ヨンドシーホールディングス	2,800	2,297.00	6,431,600
三陽商会	1,400	1,523.00	2,132,200
長瀬産業	15,700	1,437.00	22,560,900
蝶理	1,800	2,100.00	3,780,000
豊田通商	31,200	3,690.00	115,128,000
オンワードホールディングス	16,700	612.00	10,220,400
三共生興	4,200	549.00	2,305,800
兼松	10,400	1,286.00	13,374,400
美津濃	2,600	2,505.00	6,513,000
ファミリーマート	22,400	2,508.00	56,179,200
三井物産	246,000	1,929.50	474,657,000
日本紙パルプ商事	1,600	3,860.00	6,176,000
東京エレクトロン	18,900	25,165.00	475,618,500
日立ハイテク	9,700	8,020.00	77,794,000
カメイ	3,600	1,097.00	3,949,200
東都水産	600	2,856.00	1,713,600
OUGホールディングス	700	2,601.00	1,820,700
スターゼン	1,000	4,405.00	4,405,000
セイコーホールディングス	4,000	2,287.00	9,148,000
山善	10,900	1,006.00	10,965,400
椿本興業	500	3,990.00	1,995,000
住友商事	176,600	1,649.50	291,301,700
日本ユニシス	8,700	3,750.00	32,625,000
内田洋行	1,200	6,020.00	7,224,000
三菱商事	196,400	2,852.00	560,132,800
第一実業	1,400	3,530.00	4,942,000
キヤノンマーケティングジャパン	8,000	2,731.00	21,848,000
西華産業	1,600	1,300.00	2,080,000

佐藤商事	2,300	919.00	2,113,700
菱洋エレクトロ	2,800	1,923.00	5,384,400
東京産業	3,000	585.00	1,755,000
ユアサ商事	2,700	3,320.00	8,964,000
神鋼商事	700	2,391.00	1,673,700
阪和興業	5,200	2,496.00	12,979,200
正栄食品工業	1,800	3,730.00	6,714,000
カナデン	2,300	1,307.00	3,006,100
菱電商事	2,000	1,644.00	3,288,000
ニプロ	19,700	1,240.00	24,428,000
フルサト工業	1,500	1,623.00	2,434,500
岩谷産業	6,200	3,650.00	22,630,000
昭光通商	2,500	680.00	1,700,000
イワキ	3,700	503.00	1,861,100
兼松エレクトロニクス	1,500	3,390.00	5,085,000
三愛石油	6,900	1,064.00	7,341,600
稲畑産業	6,200	1,439.00	8,921,800
ゴールドウイン	5,000	7,170.00	35,850,000
ユニ・チャーム	54,800	3,945.00	216,186,000
デサント	5,400	1,633.00	8,818,200
ワキタ	6,000	1,020.00	6,120,000
ヤマトインターナショナル	4,400	405.00	1,782,000
東邦ホールディングス	9,000	2,242.00	20,178,000
サンゲツ	7,700	1,795.00	13,821,500
ミツウロコグループホールディングス	4,100	1,143.00	4,686,300
シナネンホールディングス	1,200	2,154.00	2,584,800
伊藤忠エネクス	6,200	920.00	5,704,000
サンリオ	7,900	1,967.00	15,539,300
サンワテクノス	2,000	891.00	1,782,000
リョーサン	3,100	2,413.00	7,480,300
新光商事	4,400	792.00	3,484,800
トーヨー	1,300	1,748.00	2,272,400
三信電気	1,500	1,616.00	2,424,000
東陽テクニカ	3,200	1,038.00	3,321,600
モスフードサービス	3,700	2,988.00	11,055,600
加賀電子	2,800	2,285.00	6,398,000
三益半導体工業	2,200	2,226.00	4,897,200
ソーダニッカ	2,900	582.00	1,687,800
立花エレテック	2,100	1,721.00	3,614,100
木曽路	3,700	2,847.00	10,533,900
S R Sホールディングス	3,300	1,038.00	3,425,400
千趣会	5,100	518.00	2,641,800
ケーヨー	5,700	546.00	3,112,200
上新電機	3,300	2,017.00	6,656,100
日本瓦斯	4,400	3,730.00	16,412,000
ロイヤルホールディングス	4,900	2,128.00	10,427,200
東天紅	1,400	1,251.00	1,751,400
いなげや	3,500	1,357.00	4,749,500
島忠	5,300	3,005.00	15,926,500
チヨダ	2,900	1,459.00	4,231,100
ライフコーポレーション	2,100	2,589.00	5,436,900
リンガーハット	3,400	2,407.00	8,183,800
MrMaxHD	3,800	473.00	1,797,400
テンアライド	4,100	435.00	1,783,500
AOKIホールディングス	5,600	1,019.00	5,706,400
オークワ	4,400	1,464.00	6,441,600
コメリ	4,300	2,209.00	9,498,700
青山商事	5,800	1,286.00	7,458,800
しまむら	3,300	7,720.00	25,476,000
はせがわ	4,600	395.00	1,817,000

高島屋	20,400	1,116.00	22,766,400
松屋	5,600	776.00	4,345,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	13,300	936.00	12,448,800
近鉄百貨店	1,100	3,420.00	3,762,000
丸井グループ	25,700	2,371.00	60,934,700
クレディセゾン	19,600	1,834.00	35,946,400
アクシアル リテイリング	2,300	3,695.00	8,498,500
イオン	107,700	2,300.00	247,710,000
イズミ	5,700	3,325.00	18,952,500
平和堂	5,700	1,859.00	10,596,300
フジ	3,400	1,824.00	6,201,600
ヤオコー	3,200	5,800.00	18,560,000
ゼビオホールディングス	3,400	1,100.00	3,740,000
ケーズホールディングス	27,000	1,316.00	35,532,000
PALTA C	4,500	5,020.00	22,590,000
三谷産業	5,100	353.00	1,800,300
新生銀行	20,600	1,690.00	34,814,000
あおぞら銀行	16,700	3,030.00	50,601,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,929,200	562.80	1,085,753,760
りそなホールディングス	307,600	439.30	135,128,680
三井住友トラスト・ホールディングス	53,000	4,001.00	212,053,000
三井住友フィナンシャルグループ	193,900	3,751.00	727,318,900
千葉銀行	96,400	605.00	58,322,000
群馬銀行	55,100	357.00	19,670,700
武蔵野銀行	4,200	1,657.00	6,959,400
千葉興業銀行	7,700	332.00	2,556,400
筑波銀行	11,700	196.00	2,293,200
七十七銀行	9,500	1,566.00	14,877,000
青森銀行	2,200	2,573.00	5,660,600
秋田銀行	1,800	1,888.00	3,398,400
山形銀行	3,100	1,367.00	4,237,700
岩手銀行	1,800	2,543.00	4,577,400
東邦銀行	25,100	243.00	6,099,300
みちのく銀行	1,800	1,333.00	2,399,400
ふくおかフィナンシャルグループ	23,600	1,846.00	43,565,600
静岡銀行	69,400	751.00	52,119,400
十六銀行	3,500	2,071.00	7,248,500
スルガ銀行	28,700	436.00	12,513,200
八十二銀行	67,600	403.00	27,242,800
山梨中央銀行	3,300	917.00	3,026,100
大垣共立銀行	5,500	2,232.00	12,276,000
福井銀行	2,400	1,550.00	3,720,000
北國銀行	2,900	3,130.00	9,077,000
清水銀行	1,200	1,947.00	2,336,400
富山銀行	800	1,968.00	1,574,400
滋賀銀行	5,600	2,624.00	14,694,400
南都銀行	4,700	2,475.00	11,632,500
百五銀行	25,200	316.00	7,963,200
京都銀行	10,100	4,200.00	42,420,000
紀陽銀行	9,900	1,589.00	15,731,100
ほくほくフィナンシャルグループ	18,700	1,008.00	18,849,600
広島銀行	41,400	520.00	21,528,000
山陰合同銀行	16,600	609.00	10,109,400
中国銀行	24,100	947.00	22,822,700
鳥取銀行	1,400	1,311.00	1,835,400
伊予銀行	40,000	535.00	21,400,000
百十四銀行	3,000	2,002.00	6,006,000
四国銀行	4,300	917.00	3,943,100
阿波銀行	4,600	2,372.00	10,911,200
大分銀行	1,600	2,273.00	3,636,800

宮崎銀行	1,900	2,351.00	4,466,900
佐賀銀行	1,700	1,501.00	2,551,700
沖縄銀行	2,600	3,320.00	8,632,000
琉球銀行	6,500	1,051.00	6,831,500
セブン銀行	93,600	319.00	29,858,400
みずほフィナンシャルグループ	3,808,300	158.70	604,377,210
山口フィナンシャルグループ	35,000	647.00	22,645,000
芙蓉総合リース	2,900	6,920.00	20,068,000
みずほリース	4,400	3,220.00	14,168,000
東京センチュリー	5,600	5,130.00	28,728,000
SBIホールディングス	31,300	2,462.00	77,060,600
日本証券金融	12,400	498.00	6,175,200
アイフル	42,800	302.00	12,925,600
長野銀行	1,200	1,466.00	1,759,200
名古屋銀行	2,300	3,380.00	7,774,000
北洋銀行	42,200	227.00	9,579,400
愛知銀行	1,000	3,395.00	3,395,000
中京銀行	1,200	2,202.00	2,642,400
大光銀行	1,100	1,598.00	1,757,800
愛媛銀行	4,000	1,076.00	4,304,000
京葉銀行	11,900	570.00	6,783,000
栃木銀行	13,500	194.00	2,619,000
北日本銀行	900	2,065.00	1,858,500
東和銀行	4,900	774.00	3,792,600
リコーリース	2,200	4,215.00	9,273,000
イオンフィナンシャルサービス	17,200	1,819.00	31,286,800
アコム	56,300	522.00	29,388,600
ジャックス	3,100	2,470.00	7,657,000
オリエン트コーポレーション	75,900	160.00	12,144,000
日立キャピタル	6,600	3,085.00	20,361,000
アプラスフィナンシャル	21,300	82.00	1,746,600
オリックス	175,300	1,925.00	337,452,500
三菱UFJリース	71,100	699.00	49,698,900
ジャフコ	4,300	4,680.00	20,124,000
九州リースサービス	3,000	604.00	1,812,000
トモニホールディングス	21,700	340.00	7,378,000
大和証券グループ本社	224,900	537.20	120,816,280
野村ホールディングス	493,200	564.40	278,362,080
岡三証券グループ	23,900	393.00	9,392,700
丸三証券	8,300	505.00	4,191,500
東洋証券	12,000	149.00	1,788,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	32,200	322.00	10,368,400
光世証券	3,100	591.00	1,832,100
水戸証券	8,100	222.00	1,798,200
いちよし証券	5,200	615.00	3,198,000
松井証券	16,000	897.00	14,352,000
SOMPOホールディングス	52,700	4,367.00	230,140,900
だいこう証券ビジネス	2,700	669.00	1,806,300
日本取引所グループ	80,400	1,980.00	159,192,000
マネックスグループ	21,100	251.00	5,296,100
極東証券	3,800	755.00	2,869,000
岩井コスモホールディングス	2,600	1,267.00	3,294,200
藍澤証券	5,000	693.00	3,465,000
フィデアホールディングス	27,200	121.00	3,291,200
池田泉州ホールディングス	32,200	188.00	6,053,600
アニコムホールディングス	2,300	3,910.00	8,993,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	73,300	3,738.00	273,995,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	23,000	2,387.00	54,901,000

スパークス・グループ	9,700	262.00	2,541,400
第一生命ホールディングス	158,600	1,629.50	258,438,700
東京海上ホールディングス	100,200	6,126.00	613,825,200
イー・ギャランティ	3,000	1,295.00	3,885,000
アサックス	2,500	710.00	1,775,000
NECキャピタルソリューション	1,100	2,435.00	2,678,500
T&Dホールディングス	83,800	1,215.00	101,817,000
アドバンスクリエイト	700	1,816.00	1,271,200
三井不動産	138,200	2,943.00	406,722,600
三菱地所	196,400	2,140.00	420,296,000
平和不動産	5,100	3,430.00	17,493,000
東京建物	30,600	1,724.00	52,754,400
ダイビル	7,200	1,382.00	9,950,400
京阪神ビルディング	4,500	1,475.00	6,637,500
住友不動産	63,000	3,990.00	251,370,000
テーオーシー	5,500	844.00	4,642,000
東京楽天地	500	5,590.00	2,795,000
レオパレス21	36,700	404.00	14,826,800
スターツコーポレーション	3,800	2,587.00	9,830,600
フジ住宅	3,300	658.00	2,171,400
空港施設	3,400	523.00	1,778,200
明和地所	2,800	625.00	1,750,000
ゴールドクレスト	2,200	1,896.00	4,171,200
リログループ	14,800	2,587.00	38,287,600
エスリード	1,100	1,880.00	2,068,000
日神グループホールディングス	4,100	533.00	2,185,300
日本エスコン	5,100	896.00	4,569,600
タカラレーベン	12,800	490.00	6,272,000
A V A N T I A	1,800	950.00	1,710,000
イオンモール	14,000	1,826.00	25,564,000
毎日コムネット	1,900	906.00	1,721,400
ファースト住建	1,500	1,248.00	1,872,000
カチタス	3,500	3,975.00	13,912,500
東祥	1,700	1,978.00	3,362,600
トーセイ	3,900	1,358.00	5,296,200
穴吹興産	1,000	1,637.00	1,637,000
サンフロンティア不動産	3,900	1,264.00	4,929,600
エフ・ジェー・ネクスト	2,400	1,109.00	2,661,600
グランディハウス	3,900	441.00	1,719,900
東武鉄道	30,000	3,590.00	107,700,000
相鉄ホールディングス	9,100	2,707.00	24,633,700
東急	71,700	1,856.00	133,075,200
京浜急行電鉄	36,500	1,814.00	66,211,000
小田急電鉄	42,300	2,304.00	97,459,200
京王電鉄	14,700	5,840.00	85,848,000
京成電鉄	19,800	3,915.00	77,517,000
富士急行	3,900	3,380.00	13,182,000
新京成電鉄	700	2,391.00	1,673,700
東日本旅客鉄道	50,000	9,014.00	450,700,000
西日本旅客鉄道	25,300	8,732.00	220,919,600
東海旅客鉄道	23,600	20,725.00	489,110,000
西武ホールディングス	38,100	1,675.00	63,817,500
鴻池運輸	4,500	1,471.00	6,619,500
西日本鉄道	7,900	2,600.00	20,540,000
ハマキョウレックス	2,200	3,170.00	6,974,000
サカイ引越センター	1,500	6,060.00	9,090,000
近鉄グループホールディングス	26,900	5,170.00	139,073,000
阪急阪神ホールディングス	35,900	4,005.00	143,779,500
南海電気鉄道	12,800	2,655.00	33,984,000
京阪ホールディングス	12,000	4,755.00	57,060,000

神戸電鉄	600	3,955.00	2,373,000
名古屋鉄道	22,100	3,065.00	67,736,500
山陽電気鉄道	1,900	2,108.00	4,005,200
トランコム	800	7,780.00	6,224,000
日本通運	9,500	5,890.00	55,955,000
ヤマトホールディングス	47,200	1,927.00	90,954,400
山九	7,500	5,100.00	38,250,000
日新	2,300	1,688.00	3,882,400
丸全昭和運輸	2,200	2,763.00	6,078,600
センコーグループホールディングス	14,800	867.00	12,831,600
トナミホールディングス	600	4,855.00	2,913,000
ニッコンホールディングス	9,600	2,404.00	23,078,400
日本石油輸送	500	3,095.00	1,547,500
福山通運	3,400	3,595.00	12,223,000
セイノーホールディングス	20,200	1,341.00	27,088,200
エスライン	1,700	985.00	1,674,500
神奈川中央交通	700	3,925.00	2,747,500
日立物流	4,900	3,110.00	15,239,000
丸和運輸機関	2,800	1,992.00	5,577,600
C & F ロジホールディングス	2,700	1,265.00	3,415,500
日本郵船	22,600	1,746.00	39,459,600
商船三井	17,100	2,565.00	43,861,500
川崎汽船	8,300	1,486.00	12,333,800
N S ユナイテッド海運	1,500	1,844.00	2,766,000
飯野海運	12,800	357.00	4,569,600
九州旅客鉄道	24,000	3,620.00	86,880,000
S G ホールディングス	28,200	2,229.00	62,857,800
日本航空	48,400	2,998.50	145,127,400
A N A ホールディングス	49,200	3,272.00	160,982,400
パスコ	600	1,932.00	1,159,200
西本W i s m e t t a c ホールディングス	500	3,145.00	1,572,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	2,097.00	1,677,600
Genky Drug Stores	1,200	1,947.00	2,336,400
国際紙パルプ商事	6,600	288.00	1,900,800
総合メディカルホールディングス	2,400	2,547.00	6,112,800
ブックオフグループホールディングス	1,800	926.00	1,666,800
三菱倉庫	8,500	2,908.00	24,718,000
三井倉庫ホールディングス	3,100	1,738.00	5,387,800
住友倉庫	9,900	1,440.00	14,256,000
澁澤倉庫	1,500	2,071.00	3,106,500
ヤマタネ	1,400	1,476.00	2,066,400
東陽倉庫	5,800	310.00	1,798,000
乾汽船	1,600	1,191.00	1,905,600
日本トランスシティ	5,900	477.00	2,814,300
ケイヒン	1,400	1,348.00	1,887,200
中央倉庫	1,600	1,131.00	1,809,600
安田倉庫	2,200	1,003.00	2,206,600
東洋埠頭	1,300	1,373.00	1,784,900
宇徳	3,500	510.00	1,785,000
上組	15,400	2,266.00	34,896,400
キューソー流通システム	900	1,883.00	1,694,700
近鉄エクスプレス	5,700	1,897.00	10,812,900
東海運	5,900	282.00	1,663,800
エーアイティー	1,900	960.00	1,824,000
東京放送ホールディングス	17,000	1,898.00	32,266,000
日本テレビホールディングス	23,300	1,458.00	33,971,400
朝日放送グループホールディングス	2,800	720.00	2,016,000
テレビ朝日ホールディングス	7,700	2,027.00	15,607,900
スカパーJ S A T ホールディングス	18,300	469.00	8,582,700

テレビ東京ホールディングス	2,300	2,365.00	5,439,500
日本BS放送	1,400	1,234.00	1,727,600
ビジョン	2,600	1,115.00	2,899,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,100	1,684.00	1,852,400
コネクシオ	1,600	1,531.00	2,449,600
日本通信	21,700	215.00	4,665,500
日本電信電話	372,700	2,776.00	1,034,615,200
KDDI	207,800	3,409.00	708,390,200
ソフトバンク	253,400	1,484.50	376,172,300
光通信	2,900	23,170.00	67,193,000
NTTドコモ	206,000	3,131.00	644,986,000
エムティーアイ	2,700	648.00	1,749,600
GMOインターネット	11,000	2,076.00	22,836,000
KADOKAWA	7,500	1,645.00	12,337,500
学研ホールディングス	900	7,160.00	6,444,000
ゼンリン	5,600	1,460.00	8,176,000
インプレスホールディングス	10,500	166.00	1,743,000
東京電力ホールディングス	226,800	436.00	98,884,800
中部電力	86,900	1,521.00	132,174,900
関西電力	107,700	1,268.00	136,563,600
中国電力	39,300	1,470.00	57,771,000
北陸電力	26,000	831.00	21,606,000
東北電力	71,000	1,021.00	72,491,000
四国電力	25,600	876.00	22,425,600
九州電力	58,600	853.00	49,985,800
北海道電力	26,600	519.00	13,805,400
沖縄電力	5,300	2,009.00	10,647,700
電源開発	22,600	2,526.00	57,087,600
エフオン	1,400	657.00	919,800
イーレックス	4,000	1,480.00	5,920,000
レノバ	4,700	1,132.00	5,320,400
東京瓦斯	54,600	2,379.00	129,893,400
大阪瓦斯	55,100	1,875.00	103,312,500
東邦瓦斯	14,000	4,090.00	57,260,000
北海道瓦斯	1,500	1,600.00	2,400,000
広島ガス	5,800	339.00	1,966,200
西部瓦斯	3,200	2,360.00	7,552,000
静岡ガス	8,100	954.00	7,727,400
メタウォーター	1,400	4,100.00	5,740,000
アイネット	1,400	1,468.00	2,055,200
松竹	1,800	13,870.00	24,966,000
東宝	16,700	3,870.00	64,629,000
エイチ・アイ・エス	4,200	2,485.00	10,437,000
東映	1,000	13,960.00	13,960,000
ラックランド	800	2,129.00	1,703,200
エヌ・ティ・ティ・データ	74,200	1,455.00	107,961,000
共立メンテナンス	4,500	4,040.00	18,180,000
イチネンホールディングス	3,000	1,375.00	4,125,000
建設技術研究所	1,900	2,220.00	4,218,000
スペース	1,800	1,154.00	2,077,200
アインホールディングス	3,400	6,780.00	23,052,000
燦ホールディングス	1,200	1,564.00	1,876,800
東京テアトル	1,300	1,316.00	1,710,800
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,804.00	1,682,400
ナガワ	900	6,620.00	5,958,000
よみうりランド	600	4,095.00	2,457,000
東京都競馬	1,800	3,675.00	6,615,000
常磐興産	1,100	1,621.00	1,783,100
カナモト	4,400	2,654.00	11,677,600
東京ドーム	11,000	967.00	10,637,000

D T S	6,200	2,190.00	13,578,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,900	4,960.00	59,024,000
シーイーシー	3,000	1,938.00	5,814,000
カブコン	13,100	3,455.00	45,260,500
西尾レントオール	2,800	2,926.00	8,192,800
アイ・エス・ビー	900	2,322.00	2,089,800
日本空港ビルディング	8,900	5,170.00	46,013,000
トランス・コスモス	2,600	2,652.00	6,895,200
乃村工藝社	11,600	1,181.00	13,699,600
ジャステック	1,800	1,044.00	1,879,200
S C S K	6,400	6,240.00	39,936,000
藤田観光	1,200	2,467.00	2,960,400
K N T - C Tホールディングス	1,700	1,146.00	1,948,200
日本管財	2,900	1,901.00	5,512,900
トーカイ	2,600	2,462.00	6,401,200
白洋舎	700	2,766.00	1,936,200
セコム	28,800	9,641.00	277,660,800
日本システムウエア	900	2,289.00	2,060,100
セントラル警備保障	1,300	5,460.00	7,098,000
アイネス	2,700	1,680.00	4,536,000
丹青社	5,100	1,149.00	5,859,900
メイテック	3,400	5,640.00	19,176,000
T K C	2,400	5,300.00	12,720,000
富士ソフト	3,600	4,115.00	14,814,000
応用地質	2,900	1,418.00	4,112,200
船井総研ホールディングス	5,600	2,981.00	16,693,600
N S D	9,000	1,894.00	17,046,000
進学会ホールディングス	3,600	510.00	1,836,000
丸紅建材リース	1,000	1,829.00	1,829,000
コナミホールディングス	10,100	4,375.00	44,187,500
学究社	1,300	1,350.00	1,755,000
ベネッセホールディングス	9,000	2,952.00	26,568,000
イオンディライト	3,300	3,760.00	12,408,000
ナック	1,700	995.00	1,691,500
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,130.00	3,443,000
ニチイ学館	3,900	1,334.00	5,202,600
ダイセキ	4,600	2,923.00	13,445,800
ステップ	1,100	1,648.00	1,812,800
日鉄物産	2,000	4,575.00	9,150,000
泉州電業	900	2,976.00	2,678,400
元気寿司	700	2,906.00	2,034,200
トラスコ中山	5,800	2,357.00	13,670,600
ヤマダ電機	85,300	594.00	50,668,200
オートバックスセブン	10,400	1,539.00	16,005,600
モリト	2,300	792.00	1,821,600
アークランドサカモト	4,400	1,181.00	5,196,400
ニトリホールディングス	12,100	16,560.00	200,376,000
グルメ杵屋	2,000	1,161.00	2,322,000
愛眼	7,300	242.00	1,766,600
吉野家ホールディングス	9,200	2,529.00	23,266,800
加藤産業	4,400	3,465.00	15,246,000
イノテック	1,700	1,086.00	1,846,200
イエローハット	5,300	1,645.00	8,718,500
松屋フーズホールディングス	1,300	4,460.00	5,798,000
J B C Cホールディングス	1,900	1,927.00	3,661,300
J Kホールディングス	2,500	743.00	1,857,500
サガミホールディングス	3,700	1,323.00	4,895,100
日伝	2,500	1,942.00	4,855,000
関西スーパーマーケット	2,300	1,001.00	2,302,300

ミロク情報サービス	2,500	2,650.00	6,625,000	
北沢産業	6,600	255.00	1,683,000	
杉本商事	1,500	1,892.00	2,838,000	
因幡電機産業	8,000	2,615.00	20,920,000	
王将フードサービス	2,100	6,430.00	13,503,000	
ブレナス	3,100	1,930.00	5,983,000	
ミニストップ	2,100	1,522.00	3,196,200	
アークス	5,700	1,915.00	10,915,500	
バローホールディングス	6,200	1,801.00	11,166,200	
東テク	900	2,453.00	2,207,700	
ミスミグループ本社	35,100	2,661.00	93,401,100	
ベルク	1,400	5,590.00	7,826,000	
大 庄	1,500	1,626.00	2,439,000	
タキヒヨー	1,000	1,825.00	1,825,000	
ファーストリテイリング	3,700	59,640.00	220,668,000	
ソフトバンクグループ	221,200	5,531.00	1,223,457,200	
蔵王産業	1,200	1,450.00	1,740,000	
スズケン	11,900	4,005.00	47,659,500	
サンドラッグ	10,500	3,295.00	34,597,500	
サックスパー ホールディングス	2,400	802.00	1,924,800	
ジェコス	1,900	1,034.00	1,964,600	
やまや	800	2,206.00	1,764,800	
ペルーナ	6,000	614.00	3,684,000	
合計	33,485,100		67,041,297,600	

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
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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】

「ニッセイTOPIXオープン」

(2020年2月28日現在)

資産総額	10,301,927,647円
負債総額	52,721,129円
純資産総額(-)	10,249,206,518円
発行済数量	7,133,852,878口
1口当たり純資産額(/)	1.4367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って、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、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、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

2020年2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年間に於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。

2020年2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	403	62,651
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	125	27,251
単位型公社債投資信託	2	86
合計	530	89,989

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。

中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(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24期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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25期事業年度に係る中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		19,824,114		18,401,863
有価証券		7,102,076		8,008,550
前払費用		421,985		608,442
未収委託者報酬		4,433,940		4,705,229
未収運用受託報酬		1,806,719		1,911,554
未収投資助言報酬		101,471		168,445
その他		323,490		31,744
流動資産合計		34,013,799		33,835,830
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	82,291	1	72,641
車両	1	4,900	1	3,268
器具備品	1	94,283	1	95,277
有形固定資産合計		181,475		171,187
無形固定資産				
ソフトウェア		889,998		968,052
ソフトウェア仮勘定		44,035		24,478
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		942,047		1,000,545
投資その他の資産				
投資有価証券		34,455,496		36,902,679
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		14,723		167,886
差入保証金		299,871		293,513
繰延税金資産		778,580		1,066,925
その他		14,474		87,940
投資その他の資産合計		35,629,369		38,585,168
固定資産合計		36,752,892		39,756,901
資産合計		70,766,691		73,592,732

負債の部

流動負債

預り金	70,706	65,641
未払収益分配金	3,465	6,368
未払手数料	1,700,145	1,736,084
未払運用委託報酬	703,881	702,648
未払投資助言報酬	771,152	723,039
その他未払金	437,257	461,392
未払費用	109,199	113,233
未払法人税等	2,548,634	1,996,248
賞与引当金	864,699	853,083
その他	377,984	289,152
流動負債合計	7,587,128	6,946,893

固定負債

退職給付引当金	1,682,532	1,801,748
役員退職慰労引当金	18,200	22,500
固定負債合計	1,700,732	1,824,248
負債合計	9,287,861	8,771,142

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	41,733,107	45,192,421
利益剰余金合計	42,412,914	45,872,228
株主資本合計	60,694,754	64,154,068

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	779,438	711,399
繰延ヘッジ損益	4,637	43,878
評価・換算差額等合計	784,076	667,521

純資産合計	61,478,830	64,821,590
-------	------------	------------

負債・純資産合計	70,766,691	73,592,732
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,937,202	26,471,631
運用受託報酬	11,497,098	11,784,292
投資助言報酬	493,070	610,372
その他営業収益	-	16,907
営業収益計	38,927,371	38,883,204
営業費用		
支払手数料	12,354,679	11,518,158
広告宣伝費	31,453	23,965
公告費	260	130
調査費	5,782,852	5,954,296
支払運用委託報酬	1,754,925	1,695,119
支払投資助言報酬	2,906,672	3,019,717
委託調査費	82,637	106,467
調査費	1,038,617	1,132,991
委託計算費	216,637	229,936
営業雑経費	794,505	812,655
通信費	45,726	49,932
印刷費	179,345	190,576
協会費	32,226	34,445
その他営業雑経費	537,207	537,701
営業費用計	19,180,389	18,539,142
一般管理費		
役員報酬	83,616	137,828
給料・手当	3,439,572	3,685,286
賞与引当金繰入額	864,584	851,086
賞与	248,146	279,376
福利厚生費	662,791	710,135
退職給付費用	330,209	311,969
役員退職慰労引当金繰入額	2,450	8,350
役員退職慰労金	-	150
その他人件費	148,712	151,765
不動産賃借料	630,692	673,220
その他不動産経費	26,725	30,378
交際費	26,650	29,832
旅費交通費	152,875	209,373
固定資産減価償却費	396,898	405,606
租税公課	332,001	325,740
業務委託費	223,322	261,111
器具備品費	282,137	332,440
保険料	54,193	52,393
寄付金	162	-
諸経費	175,371	189,822
一般管理費計	8,081,115	8,645,865
営業利益	11,665,865	11,698,196
営業外収益		
受取利息	165	573
有価証券利息	33,950	24,008

受取配当金	176,877		124,674
金融派生商品収益	-		35,286
為替差益	-		22,977
時効成立償還金	27,718		-
その他営業外収益	13,552		14,395
営業外収益計	252,264		221,915
営業外費用			
為替差損	15,293		-
金融派生商品費用	-		20,127
控除対象外消費税	13,239		17,501
雑損失	27,789		-
その他営業外費用	657		1,080
営業外費用計	56,980		38,709
経常利益	11,861,150		11,881,403
特別利益			
投資有価証券売却益	201,537		655,395
投資有価証券償還益	31,108		46,876
固定資産売却益	1	169	1
特別利益計	232,815		702,272
特別損失			
投資有価証券売却損	107		81,265
投資有価証券償還損	15,469		68,047
固定資産除却損	2	5,271	2
事故損失賠償金	-		3
特別損失計	20,848		150,913
税引前当期純利益	12,073,117		12,432,761
法人税、住民税及び事業税	3,912,569		3,862,523
法人税等調整額	157,154		43,320
法人税等合計	3,755,414		3,905,844
当期純利益	8,317,703		8,526,917

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,278,000	5,278,000	5,278,000
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,317,703	8,317,703	8,317,703
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,039,703	3,039,703	3,039,703
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	812,844	-	812,844	58,467,896
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,278,000
当期純利益	-	-	-	8,317,703
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	33,405	4,637	28,768	28,768
当期変動額合計	33,405	4,637	28,768	3,010,934
当期末残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	その他利益剰余金				
						研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,067,603	5,067,603	5,067,603
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,526,917	8,526,917	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,459,314	3,459,314	3,459,314
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,067,603
当期純利益	-	-	-	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	68,039	48,515	116,554	116,554
当期変動額合計	68,039	48,515	116,554	3,342,759
当期末残高	711,399	43,878	667,521	64,821,590

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31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 ...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> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備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>
4．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、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期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の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5．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、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。

6．ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8．連結納税制度の適用を前提とした会計処理	<p>日本生命保険相互会社及び当社を含む一部の子会社は、2018年12月に連結納税制度の承認申請を行い、翌事業年度より連結納税制度が適用されることとなったため、当事業年度より「連結納税制度を適用する場合の税効果会計に関する当面の取扱い（その1）」（2015年1月16日 企業会計基準委員会 実務対応報告第5号）及び「連結納税制度を適用する場合の税効果会計に関する当面の取扱い（その2）」（2015年1月16日 企業会計基準委員会 実務対応報告第7号）に基づき、連結納税制度の適用を前提とした会計処理を行っております。</p>

（表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」に表示していた「繰延税金資産」437,736千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」778,580千円に含めて表示しております。

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

本会計基準により、顧客と約束する財又はサービスを提供する履行義務の実質的な実施主体についての評価を行ったうえで、約束した財又はサービスが顧客に移転された時点で、当該財又はサービスと交換に権利を得ると見込む対価を反映した金額で、収益を認識することが求められます。

（2）適用予定日

2021年4月1日以後開始する会計年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

(貸借対照表関係)

1. 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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物附属設備	313,759千円	325,809千円
車両	1,828	3,460
器具備品	469,355	474,339
計	784,943	803,609

(損益計算書関係)

1. 固定資産売却益の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
車両	169千円	-

2. 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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
器具備品	5,271千円	623千円
ソフトウェア	-	465
計	5,271	1,089

3. 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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2017年4月1日 至2018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 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

2017年6月23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	5,278,000千円
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年6月22日開催の定時株主総会において、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	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

2018年6月22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	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

2019年3月19日開催の臨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
配当財産の種類	投資有価証券
配当財産の帳簿価額	67,500千円
譲渡株数	1,350株
1株当たり配当額	-
基準日	2019年3月19日
効力発生日	2019年3月22日

(注) 配当財産のすべてを普通株式(108千株)の唯一の株主である日本生命保険相互会社に対して割り当てることとしており、1株当たり配当額は定めておりません。

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2019年6月28日開催の定時株主総会において、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	未定 千円
配当の原資	未定
1株当たり配当額	未定 円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

(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資金運用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。

上記の自社設定投資信託の一部につきましてはデリバティブを用いてヘッジを行っております。デリバティブを用いたヘッジ取引につきましては、外貨建て資産の為替変動リスクを回避する目的で為替予約、外国株式の価格変動リスクを回避する目的で株価指数先物を使ってヘッジ会計を適用しております。ヘッジ会計の適用にあたっては、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前の有効性の確認、事後の有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運用しております。ヘッジの有効性判定については資金運用リスク管理規程に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

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)を参照下さい)。

前事業年度(2018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	19,824,114	19,824,114	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,102,076	7,115,800	13,723
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,652,704	14,687,680	34,975
その他有価証券	19,735,292	19,735,292	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	103,394	103,394	-

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

当事業年度(2019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	18,401,863	18,401,863	-
有価証券			
満期保有目的の債券	2,199,830	2,205,940	6,109
その他有価証券	5,808,720	5,808,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,649,504	17,681,300	31,795
その他有価証券	19,253,174	19,253,174	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	47,244	47,244	-

() デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

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

現金・預金

預金はすべて短期であるため、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

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非上場株式	67,500	-
関係会社株式	66,222	66,222

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。

また、関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積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、記載しておりません。

(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(2018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	19,824,114	-	-	-
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	7,100,000	14,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	2,896,071	14,413,880	2,089,902	299,797
合計	29,820,185	29,063,880	2,089,902	299,797

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2019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	18,401,863	-	-	-
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	2,200,000	17,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	7,033,352	15,714,537	2,156,988	138,951
合計	27,635,215	33,364,537	2,156,988	138,951

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（2018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	15,606,746	15,660,060	53,313
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	15,606,746	15,660,060	53,313
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	6,148,033	6,143,420	4,613
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,148,033	6,143,420	4,613
合計		21,754,780	21,803,480	48,699

当事業年度（2019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	18,749,335	18,787,460	38,124
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	18,749,335	18,787,460	38,124
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	1,100,000	1,099,780	220
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,100,000	1,099,780	220
合計		19,849,335	19,887,240	37,904

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,824,610	5,803,679	20,930
	国債・地方債等	5,824,610	5,803,679	20,930
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,066,429	5,762,409	1,304,019
	小計	12,891,039	11,566,089	1,324,949
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 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）	6,844,252	7,045,700	201,447
	小計	6,844,252	7,045,700	201,447
合計		19,735,292	18,611,789	1,123,502

当事業年度（2019年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,808,720	5,801,046	7,673
	国債・地方債等	5,808,720	5,801,046	7,673
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	13,421,370	12,553,359	868,010
	小計	19,230,090	18,354,406	875,684
貸借対照表計上額が取得原価または償却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）	5,831,804	5,981,670	149,865
	小計	5,831,804	5,981,670	149,865
	合計	25,061,894	24,336,076	725,818

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、当事業年度の貸借対照表計上額は-千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円）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、記載しておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自2017年4月1日 至2018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	344,430	201,537	107
合計	344,430	201,537	107

当事業年度（自2018年4月1日 至2019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	2,232,532	655,395	81,265
合計	2,232,532	655,395	81,265

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 株価指数先物関連

前事業年度(2018年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	新興国株価指数先物売建	投資有価証券	1,022,464	-	31,858
合計			1,022,464	-	31,858

(注1) 時価の算定方法 取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

(2) 通貨関連

前事業年度(2018年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引米ドル売建	投資有価証券	1,988,812	-	71,536
合計			1,988,812	-	71,536

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2019年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引米ドル売建	投資有価証券	1,909,028	-	47,244
合計			1,909,028	-	47,244

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(注2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

（退職給付関係）

前事業年度（自2017年4月1日 至2018年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度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。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,519,642 千円
退職給付費用	248,707
退職給付の支払額	85,817
退職給付引当金の期末残高	1,682,532

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 248,707 千円

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、54,955千円であります。

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度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。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,682,532 千円
退職給付費用	229,805
退職給付の支払額	110,589
退職給付引当金の期末残高	1,801,748

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 229,805 千円

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、58,788千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	264,770 千円	261,214 千円
未払事業税	138,553	119,420
退職給付引当金	515,191	551,695
税務上の繰延資産償却超過額	3,662	6,126
役員退職慰労引当金	5,572	6,889
投資有価証券評価差額	61,683	88,160
その他	48,864	62,896
小計	1,038,300	1,096,402
評価性引当額	47	9
繰延税金資産合計	1,038,253	1,096,393
繰延税金負債		
繰延ヘッジ損益	2,021	-
特別分配金否認	9,827	5,022
投資有価証券評価差額	247,824	24,444
繰延税金負債合計	259,672	29,467
繰延税金資産(は負債)の純額	778,580	1,066,925

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

（セグメント情報等）

[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2017年4月1日 至2018年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（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

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（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

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

[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2017年4月1日 至2018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	150,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,608,592	未収運用受託報酬	833,260
								投資助言報酬の受取	132,212	未収投資助言報酬	11,876

当事業年度（自2018年4月1日 至2019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	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,299,726	未収運用受託報酬	762,239
								投資助言報酬の受取	130,542	未収投資助言報酬	11,530

（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、協議の上決定しております。

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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	566,896円85銭	597,720円47銭
1株当たり当期純利益金額	76,697円61銭	78,626円78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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第25期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,614,564
有価証券		8,201,592
前払費用		721,934
未収委託者報酬		5,066,032
未収運用受託報酬		2,474,584
未収投資助言報酬		145,968
その他		7,397
流動資産合計		35,232,073
固定資産		
有形固定資産	1	234,319
無形固定資産		1,098,869
投資その他の資産		
投資有価証券		34,018,838
関係会社株式		66,222
長期前払費用		32,135
差入保証金		290,409
繰延税金資産		877,601
その他		89,656
投資その他の資産合計		35,374,865
固定資産合計		36,708,053
資産合計		71,940,127

負債の部

流動負債

預り金	45,684
未払収益分配金	6,932
未払手数料	1,908,680
未払運用委託報酬	618,237
未払投資助言報酬	739,605
その他未払金	1,591,362
未払費用	140,489
未払法人税等	551,114
前受投資助言報酬	47,034
賞与引当金	492,807
その他	2 248,490
流動負債合計	<u>6,390,440</u>

固定負債

退職給付引当金	1,912,442
役員退職慰労引当金	26,750
固定負債合計	<u>1,939,192</u>

負債合計

負債合計	<u>8,329,632</u>
------	------------------

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	<u>8,281,840</u>
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	43,751,608
利益剰余金合計	<u>44,431,415</u>
株主資本合計	<u>62,713,255</u>

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	929,830
繰延ヘッジ損益	32,591
評価・換算差額等合計	<u>897,239</u>

純資産合計

純資産合計	<u>63,610,494</u>
-------	-------------------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	<u>71,940,127</u>
----------	-------------------

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第25期中間会計期間	
(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	13,306,014
運用受託報酬	5,749,281
投資助言報酬	320,718
営業収益計	19,376,015
営業費用	9,094,752
一般管理費	1 4,511,749
営業利益	5,769,513
営業外収益	2 174,997
営業外費用	3 35,183
経常利益	5,909,326
特別利益	4 2,997
特別損失	5 65,567
税引前中間純利益	5,846,756
法人税、住民税及び事業税	1,682,493
法人税等調整額	105,028
法人税等合計	1,787,521
中間純利益	4,059,235

(3)中間株主資本等変動計算書

第25期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備 金	資本剰余金 合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,500,048	5,500,048	5,500,048
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	4,059,235	4,059,235	4,059,235
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,440,813	1,440,813	1,440,813
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	43,751,608	44,431,415	62,713,255

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッ ジ損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	711,399	43,878	667,521	64,821,590
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
中間純利益	-	-	-	4,059,235
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	218,430	11,287	229,718	229,718
当中間期変動額合計	218,430	11,287	229,718	1,211,095
当中間期末残高	929,830	32,591	897,239	63,610,494

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第25期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019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 ...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）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> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備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>
4．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、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
5．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、中間会計期間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。

6．ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8．連結納税制度	当中間会計期間より日本生命保険相互会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

第25期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)	
1．有形固定資産の減価償却累計額	817,746千円
2．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第25期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1．減価償却の実施額 有形固定資産 無形固定資産	30,130千円 172,854千円
2．営業外収益のうち主要なもの 受取配当金 有価証券利息 金融派生商品収益	157,472千円 7,537千円 6,483千円
3．営業外費用のうち主要なもの 為替差損 金融派生商品損失 控除対象外消費税	28,274千円 3,497千円 3,313千円
4．特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益	2,997千円
5．特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損	57,232千円

投資有価証券償還損	4,115千円
事故損失賠償金	3,771千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第25期中間会計期間
 (自 2019年4月1日
 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 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
2019年6月28日 定時株主総会	普通株式	5,500,048	50,716	2019年3月31日	2019年6月28日

(金融商品関係)

第25期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

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	18,614,564	18,614,564	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,300,452	6,317,860	17,407
その他有価証券	1,901,140	1,901,140	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	13,748,496	13,767,690	19,193
その他有価証券	20,270,342	20,270,342	-
デリバティブ取引 ()			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	23,326	23,326	-

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 示しております。

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

現金・預金

短期で決済されるため、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。

有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

(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

関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)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、記載しておりません。

(有価証券関係)

第25期中間会計期間末（2019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	18,948,948	18,985,550	36,601
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	18,948,948	18,985,550	36,601
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	1,100,000	1,100,000	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,100,000	1,100,000	-
合計		20,048,948	20,085,550	36,601

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (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 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,900,074	1,901,140	1,065
	国債・地方債等	1,900,074	1,901,140	1,065
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	13,559,359	14,776,750	1,217,390
小計		15,459,434	16,677,890	1,218,456
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 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)	5,690,320	5,493,591	196,728
小計		5,690,320	5,493,591	196,728
合計		21,149,754	22,171,482	1,021,728

(注) 投資信託受益証券等であります。

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第25期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

第25期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	1,795,896	-	23,326
合計			1,795,896	-	23,326

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（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

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

[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25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

（ 1 株当たり情報）

	第25期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
1株当たり純資産額	586,552円95銭
1株当たり中間純利益金額	37,430円24銭

（注）1．潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、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金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	4,059,235千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>4,059,235千円</u>
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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)。

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

2019年3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

2019年3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

(資本金の額：2019年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	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。
エース証券株式会社	8,831	
株式会社SBI証券	48,323	
岡三証券株式会社	5,000	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
株式会社しん証券さかもと	300	
楽天証券株式会社	7,495	
東海東京証券株式会社	6,000	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
野村證券株式会社	10,000	
フィデリティ証券株式会社	9,257	
松井証券株式会社	11,945	
岡三にいがた証券株式会社	852	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
株式会社百五銀行	20,000	
株式会社北洋銀行	121,101	
日本生命保険相互会社	1,350,000	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

2019年3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108,448株(持株比率100%)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は、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 <https://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

2019年5月31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 樋口 誠之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第24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2019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

1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2020年3月26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

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイTOPIXオープンの2019年2月21日から2020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2020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（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月29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 樋口 誠之 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子 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、「委託会社等の経理の状況」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2019年4月1日から2020年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019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に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2019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(2019年4月1日から2019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

1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。