【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28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　　赤林　富二
【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】	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド
【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】

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド
（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】

① 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。

② 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。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。
申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。
なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成28年5月21日（土）～ 平成29年5月19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　http://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経由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（午前９時～午後５時　土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ　http://www.nam.co.jp/

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

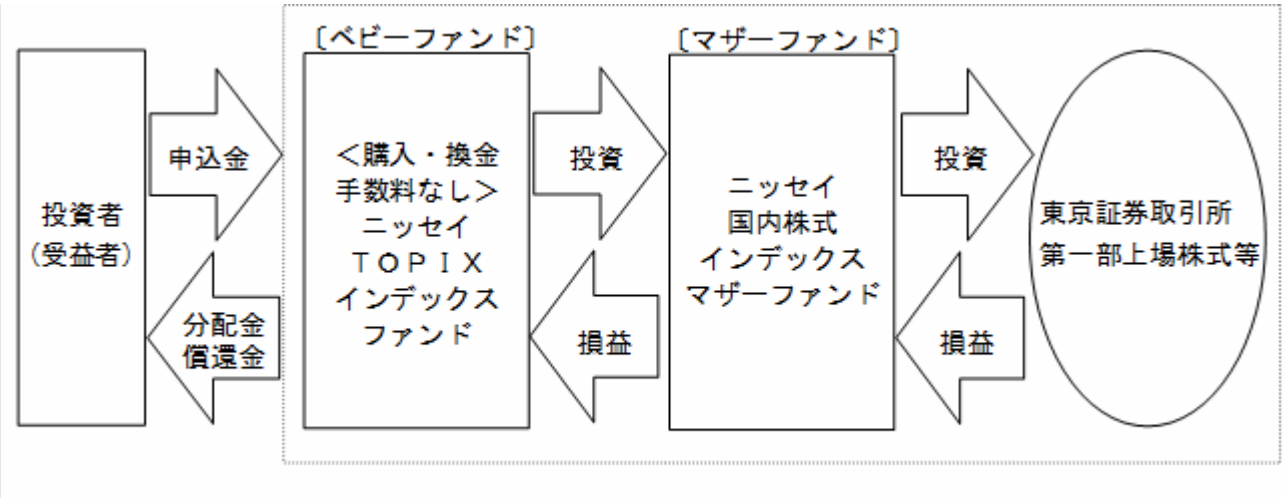
ファンドは、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 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＞



③ ファンドの特色

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

・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」に投資することにより、ＴＯＰＩＸ（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざします。

・マザーファンドの運用は、ニッセイ基礎研究所※が独自に開発したモデルを利用します。なお、モデルについては継続的に評価、分析を行い、必要と判断した場合には、見直しを行うことがあります。

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

○ 「ＴＯＰＩＸ」について

「ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

同指数は、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。

◆購入時および換金時の手数料は無料です。

・購入時の購入時手数料および換金時の換金時手数料、信託財産留保額はありません。

○　保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

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。

④　信託金の上限

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／国内／株式／インデックス型に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	対象 インデックス

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

商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

属性区分表

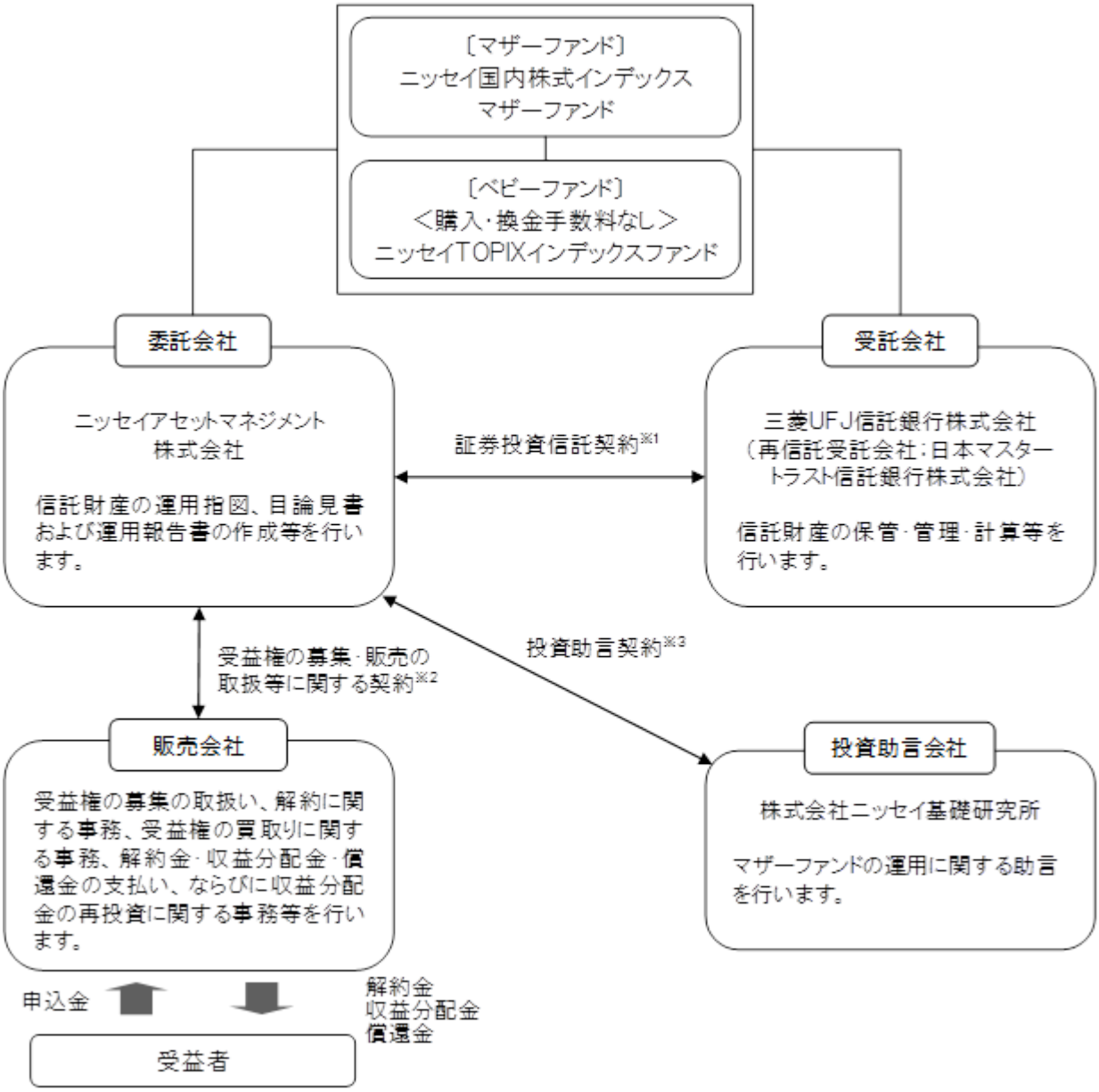
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投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

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、
一般社団法人 投資信託協会ホームページ（http://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成27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、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。

※２　委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

※３　委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（平成28年4月1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　　赤林　富二
５．金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
６．設立年月日　　：平成7年4月4日

７．沿革

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

８．大株主の状況

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

①　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（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。

②　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。

③　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。

④　株式以外の資産（上記マザーファンドを通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、このファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

⑤　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。

※　金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場を「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。

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所上場株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（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。
②　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。
③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。
④　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

①　株式への投資割合には、制限を設けません。
②　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。
③　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。
④　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。
⑤　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。
⑥　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。
⑦　外貨建資産への投資は行いません。
⑧　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。
⑨　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・一部解約等にともなう資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。

なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

ｂ　約款に定める投資対象

①　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（国内の通貨建表示のものに限ります）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　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引」に定めるものに限ります）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権
２．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

②　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）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、国内の通貨建表示のものに限ります）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．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（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証券または証書で、１．から11．までの証券または証書の性質を有するもの
13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます）
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号で定めるものをいいます）
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。

③　金融商品

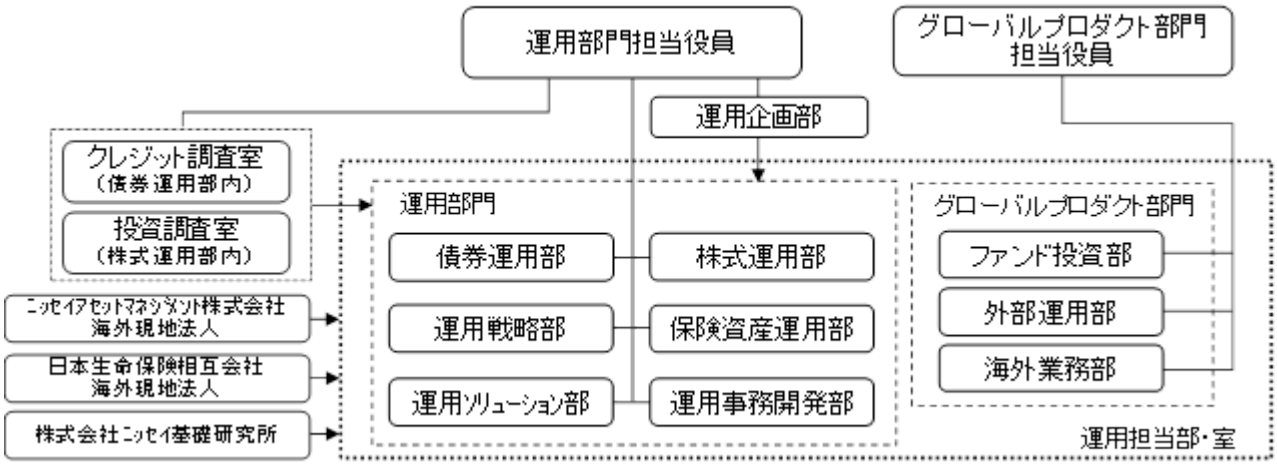
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

④　前記②にかかわらず、このファンドの設定、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③に掲げる金融商品により運用することができます。

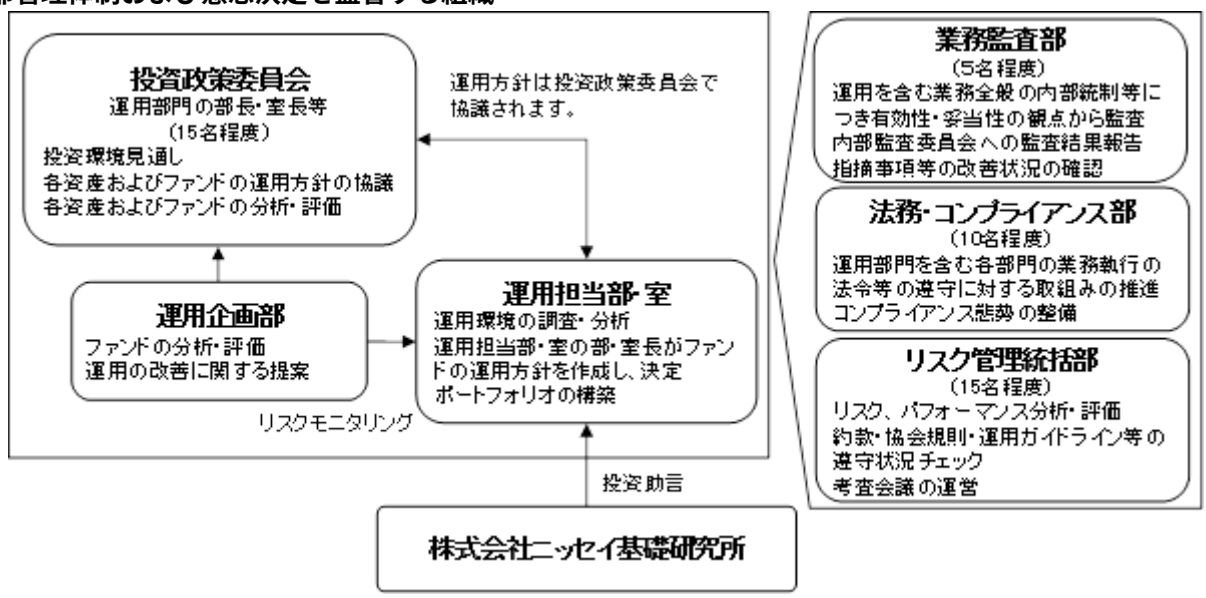
（３）【運用体制】

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。

○　上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①　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

経費控除後の配当等収益（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます）および売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます）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

留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、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。

②　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。

③　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

①　株式への実質投資割合には、制限を設けません。

②　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％以下とします。

③　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％以下とします。

④　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％以下とします。

⑤　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％以下とします。

⑥　投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

⑧　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。

⑨　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

①　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、国内の金融商品取引所※に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。

２．前記１．にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、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または登録され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ます。

②　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売付けの一部を決済するものとします。

③　先物取引等

１．国内の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28 条第８項第３号イに掲げるものをいいます）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28 条第８項第３号ロに掲げるものをいいます）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます）ならびに外国の金融商品取引所における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．国内の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における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。

④　スワップ取引

１．信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
２．スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
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するものとします。
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たときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑤　金利先渡取引

１．信託財産に属する資産を効率的に運用するため、金利先渡取引を行うことができます。
２．金利先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
３．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
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たときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑥　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。
　ｉ．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。
　ii．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契約の一部を解約するものとします。

３．有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　有価証券の空売り

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証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、売付けた有価証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．の売付けは、当該売付けにかかる有価証券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．の売付けにかかる有価証券の時価総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売付けの一部を決済するものとします。

⑧　有価証券の借入れ

１．信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供を行うものとします。

２．前記１．は、当該借入れにかかる有価証券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．の借入れにかかる有価証券の時価総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借入れた有価証券の一部を返還するものとします。

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　資金の借入れ

１．信託財産の効率的な運用、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、または再投資にかか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わないものとします。

２．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、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かか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

①　デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号）

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第２条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、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。

②　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な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。

③　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（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、ＴＯＰＩＸ（配当込み）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。

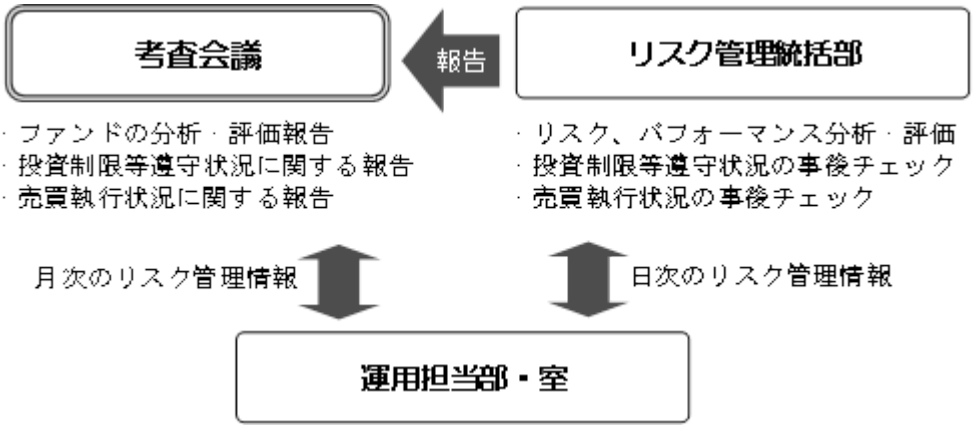
・基準価額と指数の連動性に関する留意点
ファンドはＴＯＰＩＸ（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざしますが、主に以下の理由から基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。
・ファンドは、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、または、ファンドの構成銘柄のウエイトが当該指数の構成銘柄のウエイトと異なる場合があること
・株価指数先物と当該指数の動きの不一致
・ファンドは、流動性確保のために現金・預金等を保有すること
・ファンドは、運用管理費用（信託報酬）等の管理費用負担および売買委託手数料等の取引コストを負担すること
・ファンドにおける株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使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が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。

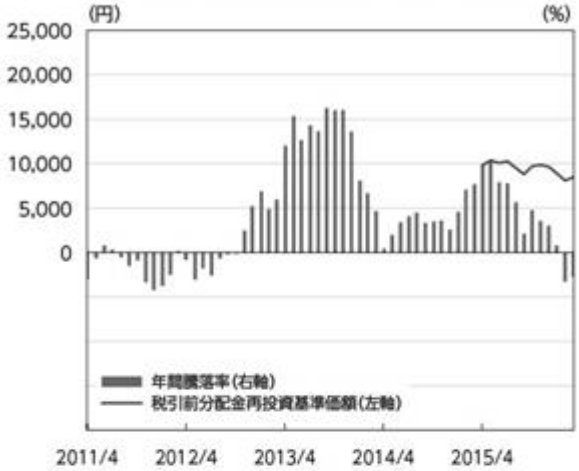
２．運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

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

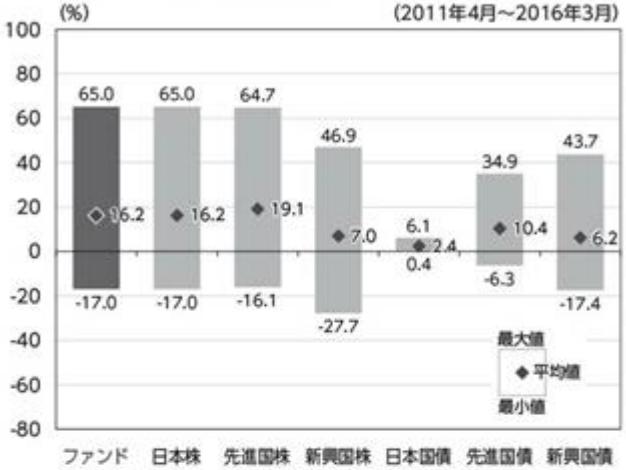
（参考情報）

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



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の月末データが1年に満たないためファンドの騰落率を記載できません。**参考としてファンドの騰落率に代えファンドのベンチマーク（TOPIX（配当込み））の騰落率を記載しています。**

・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・・・シティ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・ディバーシファイド（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。
・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。
・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、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。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

① 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0.3132%（税抜0.29%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。

なお、平成28年5月20日現在の信託報酬率は年0.3132%（税抜0.29%）であり、その配分は次の通りとします。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.13%	0.13%	0.03%

② 前記①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】

① 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。

② 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 0.00216% （税抜0.002%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00324% （税抜0.003%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00540% （税抜0.005%）
10億円以下 の部分	年 0.01080% （税抜0.010%）

③ 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。

④ 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。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

○ 上記の①、③および④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・収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。

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）

平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%・地方税5%）
平成50年 1 月 1 日以降	20%　（所得税15%・地方税5%）

税率は原則として20%（所得税15%・地方税5%）ですが、平成49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。

税率（法人）

平成49年12月31日まで	15.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%）
平成50年 1 月 1 日以降	15%　　（所得税15%）

税率は原則として15%（所得税のみ）ですが、平成49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。

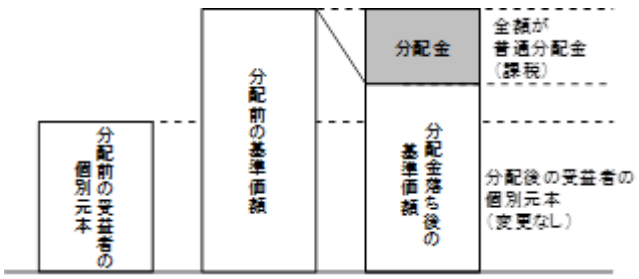
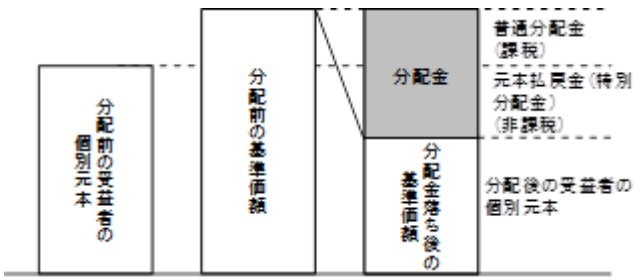
個別元本

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

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には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】

「＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド」

（平成28年3月31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		3,308,278,454	100.00
	内　日本	3,308,278,454	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△28,868	△0.00
純資産総額		3,308,249,586	100.00

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

（参考情報）

「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」

（平成28年3月31日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		33,636,656,750	93.85
	内　日本	33,636,656,750	93.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,206,064,021	6.15
純資産総額		35,842,720,771	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）		902,825,000	2.52
	内　日本	902,825,000	2.52

（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、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

（2）【投資資産】

「＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド」

①【投資有価証券の主要銘柄】

（平成28年3月31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） 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	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	2,473,849,140	1.2849 3,178,787,067	1.3373 3,308,278,454	－ －	100.00%

（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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

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」

①投資有価証券の主要銘柄

（平成28年3月31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	210,100	5,980.00 1,256,398,000	5,952.00 1,250,515,200	－ －	3.49%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,337,500	477.30 638,388,750	521.50 697,506,250	－ －	1.95%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	128,800	4,812.00 619,785,600	4,848.00 624,422,400	－ －	1.74%
4	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	111,900	4,542.00 508,249,800	4,690.00 524,811,000	－ －	1.46%
5	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	169,300	3,013.00 510,100,900	3,006.00 508,915,800	－ －	1.42%
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	94,400	5,095.00 480,968,000	5,366.00 506,550,400	－ －	1.41%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	152,000	2,925.00 444,600,000	3,086.00 469,072,000	－ －	1.31%

8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	133,500	3,026.00 403,971,000	3,412.00 455,502,000	— —	1.27%
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,354,200	166.30 391,503,460	168.10 395,741,020	— —	1.10%
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	70,500	5,417.00 381,898,500	5,136.00 362,088,000	— —	1.01%
11	ソニー 日本	株式 電気機器	119,200	2,488.00 296,569,600	2,893.00 344,845,600	— —	0.96%
12	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	69,700	4,556.00 317,553,200	4,792.00 334,002,400	— —	0.93%
13	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	128,600	2,642.00 339,761,200	2,552.50 328,251,500	— —	0.92%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	90,900	3,311.00 300,969,900	3,355.00 304,969,500	— —	0.85%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	17,300	17,040.00 294,792,000	17,485.00 302,490,500	— —	0.84%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	15,100	20,755.00 313,400,500	19,905.00 300,565,500	— —	0.84%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	30,900	9,953.00 307,547,700	9,713.00 300,131,700	— —	0.84%
18	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	198,100	1,577.00 312,403,700	1,496.50 296,456,650	— —	0.83%
19	花王 日本	株式 化学	47,600	5,848.00 278,364,800	6,003.00 285,742,800	— —	0.80%
20	三菱地所 日本	株式 不動産業	124,000	2,144.50 265,918,000	2,090.50 259,222,000	— —	0.72%
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	67,500	3,791.00 255,892,500	3,800.00 256,500,000	— —	0.72%
22	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	59,700	3,991.00 238,262,700	4,205.00 251,038,500	— —	0.70%
23	三井不動産 日本	株式 不動産業	88,000	2,652.00 233,376,000	2,808.00 247,104,000	— —	0.69%
24	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	237,100	979.20 232,168,320	1,041.50 246,939,650	— —	0.69%
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	17,700	13,435.00 237,799,500	13,570.00 240,189,000	— —	0.67%
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	125,100	1,872.00 234,187,200	1,906.00 238,440,600	— —	0.67%

27	キーエンス 日本	株式 電気機器	3,800	58,580.00 222,604,000	61,390.00 233,282,000	— —	0.65%
28	日立製作所 日本	株式 電気機器	431,000	476.60 205,414,600	526.60 226,964,600	— —	0.63%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	180,000	1,134.00 204,120,000	1,179.50 212,310,000	— —	0.59%
30	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	53,400	3,693.00 197,206,200	3,975.00 212,265,000	— —	0.59%

（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	10.90
		輸送用機器	9.22
		情報・通信業	7.66
		銀行業	6.95
		化学	5.75
		医薬品	5.30
		小売業	4.77
		食料品	4.75
		機械	4.35
		陸運業	4.34
		卸売業	3.96
		サービス業	3.60
		建設業	2.98
		不動産業	2.69
		保険業	2.18
		電気・ガス業	2.01
		精密機器	1.52
		その他製品	1.48
		その他金融業	1.31
		鉄鋼	1.12
		証券、商品先物取引業	1.03
		ゴム製品	0.94
		ガラス・土石製品	0.82
		非鉄金属	0.77
		繊維製品	0.71
		空運業	0.65
		金属製品	0.61
		石油・石炭製品	0.47
		鉱業	0.28

		パルプ・紙	0.24
		海運業	0.21
		倉庫・運輸関連業	0.20
		水産・農林業	0.10
	小計		93.85
合　計（対純資産総額比）			93.85

（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。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

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２８０６月	買建	67	906,181,180	902,825,000	2.52%

（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】

「＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド」

①【純資産の推移】

平成28年3月31日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額（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1計算期間末（平成28年2月22日）	2,843,409,790	2,843,409,790	0.8098	0.8098
平成27年4月末日	220,477,197	－	0.9840	－
5月末日	444,846,201	－	1.0343	－
6月末日	646,726,514	－	1.0081	－
7月末日	1,030,478,519	－	1.0260	－
8月末日	1,372,787,065	－	0.9502	－
9月末日	1,650,687,404	－	0.8789	－
10月末日	1,926,884,807	－	0.9705	－
11月末日	2,231,463,513	－	0.9840	－
12月末日	2,509,933,005	－	0.9642	－
平成28年1月末日	2,798,735,149	－	0.8926	－
2月末日	2,892,056,712	－	0.8085	－
3月末日	3,308,249,586	－	0.8469	－

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△19.0

(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】

「＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1計算期間	5,215,234,630	1,703,917,701	3,511,316,929

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉 2016年3月末現在

●基準価額・純資産の推移

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

●基準価額および純資産総額

基準価額	8,469円
純資産総額	33億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

第1期	2016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	11.6%
2	輸送用機器	9.8%
3	情報・通信業	8.2%
4	銀行業	7.4%
5	化学	6.1%
6	医薬品	5.6%
7	小売業	5.1%
8	食料品	5.1%
9	機械	4.6%
10	陸運業	4.6%

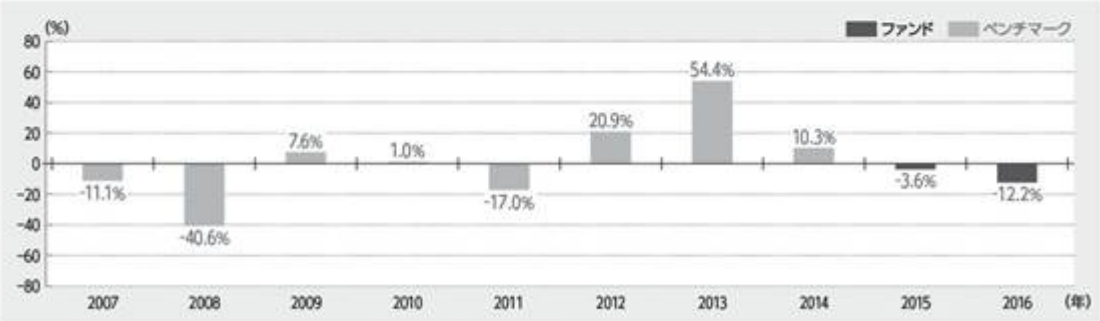
・比率は対組入株式評価額比です。

●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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.1%
3	日本電信電話	1.9%
4	日本たばこ産業	1.6%
5	KDDI	1.5%
6	ソフトバンクグループ	1.5%
7	本田技研工業	1.4%
8	三井住友フィナンシャルグループ	1.4%
9	みずほフィナンシャルグループ	1.2%
10	武田薬品工業	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して計算しております。
・2015年はファンド設定時から年末まで、2016年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
・2014年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

❗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】

①　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。

金融商品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。

②　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。

③　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。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

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。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　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　http://www.nam.co.jp/

２【換金（解約）手続等】

①　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。

金融商品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および既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

②　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。

③　換金単位

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。

④　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、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。

⑤　信託財産留保額
ありません。

⑥　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。

⑦　その他
１．受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
２．換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記④の規定に準じて算出した価額とします。
３．詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（午前９時～午後５時　土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ　　http://www.nam.co.jp/

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①　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。

②　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	金融商品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	金融商品取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。
なお、委託会社へは以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（午前９時～午後５時　土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ　　http://www.nam.co.jp/

（２）【保管】
該当事項はありません。

（３）【信託期間】
無期限です。

（４）【計算期間】
毎年2月21日から翌年2月20日までとします。
上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの償還日とします。

（５）【その他】
①　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。
ｉ．受益権の口数が30億口を下回っている場合
ii．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
iii．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、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
３．前記２．の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
４．前記２．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。
５．前記２．から４．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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２．から４．までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
６．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。
７．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「②　約款の変更等　２．」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
８．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違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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「②　約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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。

９．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。

② 約款の変更等

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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。なお、約款は当該「② 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

２．委託会社は、前記１．の事項（前記１．の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

３．前記２．の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。

４．前記２．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

６．前記２．から５．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

７．前記１．から６．までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

８．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７．までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求の不適用

ファンドは、受益者からの換金請求に対して、この信託契約の一部を解約することにより公正な価格をもって支払いに応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、前記「① 繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「② 約款の変更等」に規定する重大な約款の変更等を行う場合の書面決議において反対した受益者からの買取請求を受付けません。

④ 公告

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

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

⑤ 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れてい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（http://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。

⑥ 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。

⑦ 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）書面決議における議決権

委託会社が、書面決議において信託契約の解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます）または重大な約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行使することができます。

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

① 他の受益者の氏名または名称および住所

② 他の受益者が有する受益権の内容

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）当ファンドの第1期計算期間については、設定日である平成27年4月27日を期首としております。

３）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1期計算期間（平成27年4月27日から平成28年2月22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】
【＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成28年2月22日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,169,406
コール・ローン	181,310
親投資信託受益証券	2,843,483,731
未収入金	10,424,040
流動資産合計	2,856,258,487
資産合計	2,856,258,487
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,350,168
未払受託者報酬	252,279
未払委託者報酬	2,186,651
その他未払費用	59,599
流動負債合計	12,848,697
負債合計	12,848,697
純資産の部	
元本等	
元本	3,511,316,929
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△667,907,139
純資産合計	2,843,409,790
負債純資産合計	2,856,258,487

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 （自平成27年4月27日 至平成28年2月22日）
営業収益	
受取利息	210
有価証券売買等損益	△443,440,321
営業収益合計	△443,440,111
営業費用	
受託者報酬	411,126
委託者報酬	3,563,628
その他費用	106,822
営業費用合計	4,081,576
営業利益又は営業損失（△）	△447,521,687
経常利益又は経常損失（△）	△447,521,687
当期純利益又は当期純損失（△）	△447,521,687
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（△）	△47,644,635
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	50,335,249
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	50,335,249
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	318,365,336
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	318,365,336
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△667,907,139

（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。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月20日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、平成27年4月27日から平成28年2月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 （平成28年2月22日現在）
１．　受益権総口数	3,511,316,929口
２．　投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は667,907,139円であります。
３．　1口当たり純資産額	0.8098円
（1万口当たり純資産額）	(8,098円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 （自平成27年4月27日 至平成28年2月22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（13,322,459円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（4,563,981円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は17,886,440円（1口当たり0.005094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）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 （自平成27年4月27日 至平成28年2月22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。

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。
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。
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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 （平成28年2月22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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 （平成28年2月22日現在）
	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	△397,627,474
合計	△397,627,474

（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1期 （平成28年2月22日現在）
期首元本額	182,848,809円
期中追加設定元本額	5,032,385,821円
期中一部解約元本額	1,703,917,701円

（４）【附属明細表】（平成28年2月22日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

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	2,224,600,009	2,843,483,731	
親投資信託受益証券　合計		2,224,600,009	2,843,483,731	
合計		2,224,600,009	2,843,483,731	

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（＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド）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が、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）

	（平成28年2月22日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,552,328,027
コール・ローン	129,737,550
株式	33,569,060,310
派生商品評価勘定	2,176,240
未収入金	38,804,780
未収配当金	53,632,336
前払金	26,650,000
差入委託証拠金	122,130,000
流動資産合計	35,494,519,243
資産合計	35,494,519,243
負債の部	
流動負債	
未払金	1,295,076,600
未払解約金	61,994,903
流動負債合計	1,357,071,503
負債合計	1,357,071,503
純資産の部	

元本等	
元本	26,708,202,183
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,429,245,557
純資産合計	34,137,447,740
負債純資産合計	35,494,519,243

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所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。
2．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年2月22日現在）
1．　受益権総口数	26,708,202,183口
2．　1口当たり純資産額	1.2782円
（1万口当たり純資産額）	(12,782円)

（金融商品に関する注記）

I　金融商品の状況に関する事項

項目	（自　平成27年4月27日 至　平成28年2月22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。

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。
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。
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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年2月22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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年2月22日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△5,047,967,953
合計	△5,047,967,953

（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	（平成28年2月22日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
先物取引				
買　建	568,920,000	－	571,120,000	2,200,000
合計	568,920,000	－	571,120,000	2,200,000

（注）　１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算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．株価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	（平成28年2月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	27,249,359,761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	10,294,049,760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	10,835,207,338円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	8,316,998,974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）	7,359,394,307円
ニッセイ日本バランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	28,333,451円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	8,035,580円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	639,417,761円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,086,722,705円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,271,160,116円
ニッセイ／パナゴラ・インデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	106,618,067円
ニッセイ／パナゴラ・インデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	634,211,990円
ニッセイ／パナゴラ・インデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	524,533,318円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）ＤＢ（適格機関投資家限定）	1,336,991,960円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	6,973,595円
ニッセイターゲットデートファンドＩ（適格機関投資家限定）	312,638円
ニッセイターゲットデートファンドＩＩ（適格機関投資家限定）	298,736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	2,224,600,009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）	163,598,976円
計	26,708,202,183円

附属明細表（平成28年2月22日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
極洋	8,000	262.00	2,096,000	
日本水産	22,500	546.00	12,285,000	
マルハニチロ	4,000	2,236.00	8,944,000	
サカタのタネ	2,900	2,755.00	7,989,500	
ホクト	2,000	2,023.00	4,046,000	
ショーボンドホールディングス	2,100	3,840.00	8,064,000	
ミライト・ホールディングス	6,000	795.00	4,770,000	

住石ホールディングス	6,800	93.00	632,400	
日鉄鉱業	5,000	410.00	2,050,000	
三井松島産業	13,000	118.00	1,534,000	
国際石油開発帝石	103,100	824.90	85,047,190	
日本海洋掘削	600	2,029.00	1,217,400	
石油資源開発	3,100	2,544.00	7,886,400	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,300	1,225.00	1,592,500	
安藤・間	13,100	518.00	6,785,800	
東急建設	6,400	823.00	5,267,200	
コムシスホールディングス	8,400	1,698.00	14,263,200	
ミサワホーム	2,300	660.00	1,518,000	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,147.00	3,220,500	
東建コーポレーション	800	8,570.00	6,856,000	
大成建設	102,000	692.00	70,584,000	
大林組	58,700	989.00	58,054,300	
清水建設	60,000	865.00	51,900,000	
飛島建設	14,800	154.00	2,279,200	
長谷工コーポレーション	22,800	946.00	21,568,800	
松井建設	2,200	667.00	1,467,400	
錢高組	3,000	442.00	1,326,000	
鹿島建設	92,000	644.00	59,248,000	
不動テトラ	13,800	114.00	1,573,200	
鉄建建設	12,000	257.00	3,084,000	
西松建設	23,000	429.00	9,867,000	
三井住友建設	75,000	92.00	6,900,000	
大豊建設	8,000	426.00	3,408,000	
前田建設工業	12,000	751.00	9,012,000	
佐田建設	2,400	403.00	967,200	
ナカノフドー建設	1,800	526.00	946,800	
奥村組	19,000	556.00	10,564,000	
東鉄工業	2,300	3,030.00	6,969,000	
イチケン	3,000	298.00	894,000	
淺沼組	6,000	227.00	1,362,000	
戸田建設	23,000	455.00	10,465,000	
熊谷組	29,000	296.00	8,584,000	
青木あすなろ建設	1,500	664.00	996,000	
北野建設	4,000	267.00	1,068,000	
植木組	4,000	214.00	856,000	
三井ホーム	3,000	506.00	1,518,000	
矢作建設工業	2,700	731.00	1,973,700	
ピーエス三菱	2,300	419.00	963,700	

日本ハウスホールディングス	4,000	399.00	1,596,000	
大東建託	7,300	15,190.00	110,887,000	
新日本建設	2,300	520.00	1,196,000	
ＮＩＰＰＯ	5,000	1,689.00	8,445,000	
東亜道路工業	4,000	350.00	1,400,000	
前田道路	6,000	1,717.00	10,302,000	
日本道路	6,000	556.00	3,336,000	
東亜建設工業	17,000	243.00	4,131,000	
若築建設	11,000	115.00	1,265,000	
東洋建設	6,100	417.00	2,543,700	
五洋建設	21,700	468.00	10,155,600	
大林道路	2,300	731.00	1,681,300	
世紀東急工業	3,100	467.00	1,447,700	
福田組	3,000	912.00	2,736,000	
日本ドライケミカル	500	2,080.00	1,040,000	
住友林業	13,500	1,274.00	17,199,000	
日本基礎技術	2,200	447.00	983,400	
日成ビルド工業	5,000	369.00	1,845,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	15,000	68.00	1,020,000	
パナホーム	7,000	823.00	5,761,000	
大和ハウス工業	57,800	3,064.00	177,099,200	
ライト工業	3,800	1,096.00	4,164,800	
積水ハウス	65,400	1,803.50	117,948,900	
日特建設	2,400	398.00	955,200	
北陸電気工事	1,300	765.00	994,500	
ユアテック	3,000	787.00	2,361,000	
中電工	2,800	2,341.00	6,554,800	
関電工	8,000	839.00	6,712,000	
きんでん	11,800	1,449.00	17,098,200	
東京エネシス	2,000	873.00	1,746,000	
トーエネック	3,000	679.00	2,037,000	
住友電設	1,500	1,333.00	1,999,500	
日本電設工業	3,200	2,136.00	6,835,200	
協和エクシオ	7,700	1,261.00	9,709,700	
新日本空調	1,600	961.00	1,537,600	
日本工営	6,000	360.00	2,160,000	
ＮＤＳ	3,000	282.00	846,000	
九電工	4,000	2,244.00	8,976,000	
三機工業	4,300	937.00	4,029,100	
日揮	20,000	1,710.00	34,200,000	
中外炉工業	6,000	176.00	1,056,000	

太平電業	3,000	890.00	2,670,000	
高砂熱学工業	5,800	1,528.00	8,862,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	2,200	1,736.00	3,819,200	
朝日工業社	2,000	447.00	894,000	
明星工業	3,500	412.00	1,442,000	
大氣社	2,400	2,538.00	6,091,200	
ダイダン	3,000	754.00	2,262,000	
日比谷総合設備	2,400	1,631.00	3,914,400	
東芝プラントシステム	3,200	1,261.00	4,035,200	
日本製粉	13,000	805.00	10,465,000	
日清製粉グループ本社	21,400	1,871.00	40,039,400	
昭和産業	8,000	452.00	3,616,000	
鳥越製粉	1,600	639.00	1,022,400	
中部飼料	1,800	793.00	1,427,400	
フィード・ワン	11,800	117.00	1,380,600	
東洋精糖	10,000	101.00	1,010,000	
日本甜菜製糖	10,000	187.00	1,870,000	
三井製糖	8,000	480.00	3,840,000	
塩水港精糖	4,300	230.00	989,000	
日新製糖	300	4,325.00	1,297,500	
ネクスト	5,200	1,030.00	5,356,000	
日本Ｍ＆Ａセンター	2,800	5,110.00	14,308,000	
ノバレーゼ	1,200	826.00	991,200	
アコーディア・ゴルフ	7,200	1,098.00	7,905,600	
タケエイ	1,600	727.00	1,163,200	
トラスト・テック	400	2,388.00	955,200	
パソナグループ	1,600	632.00	1,011,200	
リンクアンドモチベーション	8,800	117.00	1,029,600	
ＧＣＡサヴィアン	1,600	877.00	1,403,200	
エス・エム・エス	2,300	1,802.00	4,144,600	
テンプホールディングス	12,800	1,458.00	18,662,400	
リニカル	1,100	1,552.00	1,707,200	
クックパッド	4,100	2,016.00	8,265,600	
アイ・ケイ・ケイ	1,500	639.00	958,500	
森永製菓	18,000	642.00	11,556,000	
中村屋	5,000	463.00	2,315,000	
江崎グリコ	4,500	6,060.00	27,270,000	
名糖産業	900	1,300.00	1,170,000	
不二家	11,000	190.00	2,090,000	
山崎製パン	14,000	2,155.00	30,170,000	
モロゾフ	3,000	421.00	1,263,000	

亀田製菓	1,100	4,300.00	4,730,000	
寿スピリッツ	500	5,470.00	2,735,000	
カルビー	7,200	4,645.00	33,444,000	
森永乳業	18,000	536.00	9,648,000	
六甲バター	900	1,791.00	1,611,900	
ヤクルト本社	10,500	5,560.00	58,380,000	
明治ホールディングス	11,600	9,330.00	108,228,000	
雪印メグミルク	4,600	2,719.00	12,507,400	
プリマハム	12,000	278.00	3,336,000	
日本ハム	14,000	2,538.00	35,532,000	
伊藤ハム	9,000	706.00	6,354,000	
林兼産業	11,000	93.00	1,023,000	
丸大食品	10,000	422.00	4,220,000	
米久	600	2,566.00	1,539,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,200	2,149.00	2,578,800	
学情	1,000	1,019.00	1,019,000	
スタジオアリス	800	2,232.00	1,785,600	
シミックホールディングス	800	1,558.00	1,246,400	
システナ	1,700	1,515.00	2,575,500	
ＮＪＳ	800	1,154.00	923,200	
デジタルアーツ	800	1,936.00	1,548,800	
新日鉄住金ソリューションズ	2,900	1,969.00	5,710,100	
綜合警備保障	6,100	5,790.00	35,319,000	
いちごグループホールディングス	14,300	361.00	5,162,300	
日本駐車場開発	18,800	119.00	2,237,200	
コア	800	1,316.00	1,052,800	
カカクコム	13,200	1,978.00	26,109,600	
ルネサンス	900	1,205.00	1,084,500	
ディップ	2,000	2,179.00	4,358,000	
ＳＢＳホールディングス	1,700	646.00	1,098,200	
オプトホールディング	1,700	587.00	997,900	
新日本科学	2,700	365.00	985,500	
ツクイ	2,200	1,337.00	2,941,400	
キャリアデザインセンター	1,200	829.00	994,800	
エムスリー	15,800	2,699.00	42,644,200	
ツカダ・グローバルホールディング	1,500	673.00	1,009,500	
アウトソーシング	800	2,905.00	2,324,000	
ウェルネット	700	3,145.00	2,201,500	
ディー・エヌ・エー	8,200	1,745.00	14,309,000	
博報堂ＤＹホールディングス	25,300	1,261.00	31,903,300	

ぐるなび	2,100	2,515.00	5,281,500	
エスアールジータカミヤ	3,000	318.00	954,000	
ジャパンベストレスキューシステム	4,100	238.00	975,800	
ファンコミュニケーションズ	4,200	652.00	2,738,400	
ＷＤＢホールディングス	1,100	872.00	959,200	
ティア	1,600	625.00	1,000,000	
バリューコマース	2,900	342.00	991,800	
インフォマート	2,600	958.00	2,490,800	
サッポロホールディングス	30,000	549.00	16,470,000	
アサヒグループホールディングス	36,700	3,497.00	128,339,900	
キリンホールディングス	79,300	1,499.00	118,870,700	
宝ホールディングス	14,200	821.00	11,658,200	
オエノンホールディングス	5,000	205.00	1,025,000	
養命酒製造	600	1,915.00	1,149,000	
コカ・コーラウエスト	6,600	2,598.00	17,146,800	
コカ・コーライーストジャパン	6,900	2,052.00	14,158,800	
サントリー食品インターナショナル	13,400	4,990.00	66,866,000	
ダイドードリンコ	1,000	5,120.00	5,120,000	
伊藤園	5,800	3,245.00	18,821,000	
キーコーヒー	1,700	1,801.00	3,061,700	
ユニカフェ	600	922.00	553,200	
日清オイリオグループ	10,000	454.00	4,540,000	
不二製油グループ本社	5,200	1,949.00	10,134,800	
Ｊ－オイルミルズ	8,000	340.00	2,720,000	
ローソン	6,500	9,170.00	59,605,000	
サンエー	1,200	4,805.00	5,766,000	
カワチ薬品	1,300	1,936.00	2,516,800	
エービーシー・マート	2,200	6,760.00	14,872,000	
ハードオフコーポレーション	800	1,631.00	1,304,800	
高千穂交易	1,100	871.00	958,100	
アスクル	2,100	3,415.00	7,171,500	
ゲオホールディングス	3,300	1,683.00	5,553,900	
アダストリア	1,600	5,920.00	9,472,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	12,000	83.00	996,000	
伊藤忠食品	500	4,185.00	2,092,500	
くらコーポレーション	1,000	5,200.00	5,200,000	
キャンドゥ	900	1,460.00	1,314,000	
エレマテック	800	2,149.00	1,719,200	
パル	1,000	2,551.00	2,551,000	

ＪＡＬＵＸ	600	2,047.00	1,228,200	
エディオン	7,300	856.00	6,248,800	
あらた	800	2,170.00	1,736,000	
ワッツ	1,200	781.00	937,200	
トーメンデバイス	600	1,723.00	1,033,800	
ハローズ	500	2,657.00	1,328,500	
ＪＰホールディングス	4,500	258.00	1,161,000	
あみやき亭	300	4,325.00	1,297,500	
東京エレクトロン　デバイス	600	1,503.00	901,800	
ひらまつ	2,400	653.00	1,567,200	
フィールズ	1,100	1,733.00	1,906,300	
双日	108,600	225.00	24,435,000	
ゲンキー	400	2,802.00	1,120,800	
アルフレッサ　ホールディングス	21,700	1,995.00	43,291,500	
大黒天物産	400	4,710.00	1,884,000	
ハニーズ	1,500	1,212.00	1,818,000	
ファーマライズホールディングス	2,000	493.00	986,000	
キッコーマン	15,000	3,810.00	57,150,000	
味の素	42,000	2,880.50	120,981,000	
キユーピー	10,000	2,554.00	25,540,000	
ハウス食品グループ本社	6,700	2,205.00	14,773,500	
カゴメ	7,000	2,139.00	14,973,000	
焼津水産化学工業	1,000	1,005.00	1,005,000	
アリアケジャパン	1,600	6,380.00	10,208,000	
エバラ食品工業	500	1,947.00	973,500	
ニチレイ	21,000	887.00	18,627,000	
横浜冷凍	4,300	1,021.00	4,390,300	
東洋水産	9,600	4,165.00	39,984,000	
日清食品ホールディングス	8,300	5,410.00	44,903,000	
永谷園ホールディングス	2,000	1,038.00	2,076,000	
一正蒲鉾	1,100	863.00	949,300	
フジッコ	1,900	2,199.00	4,178,100	
ロック・フィールド	1,000	2,996.00	2,996,000	
日本たばこ産業	115,700	4,542.00	525,509,400	
ケンコーマヨネーズ	600	2,318.00	1,390,800	
わらべや日洋	1,100	2,354.00	2,589,400	
なとり	1,000	1,592.00	1,592,000	
ユーグレナ	6,600	1,521.00	10,038,600	
片倉工業	2,300	1,181.00	2,716,300	
グンゼ	15,000	286.00	4,290,000	
ヒューリック	35,900	989.00	35,505,100	

山下医科器械	600	1,593.00	955,800	
ラサ商事	1,600	600.00	960,000	
アルペン	1,500	1,777.00	2,665,500	
クオール	1,700	1,423.00	2,419,100	
アルコニックス	1,000	1,432.00	1,432,000	
神戸物産	1,100	2,374.00	2,611,400	
ジェイアイエヌ	1,200	4,745.00	5,694,000	
ビックカメラ	8,900	889.00	7,912,100	
ＤＣＭホールディングス	8,500	840.00	7,140,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6,100	2,412.00	14,713,200	
あい　ホールディングス	3,100	2,793.00	8,658,300	
きちり	100	650.00	65,000	
アークランドサービス	500	2,857.00	1,428,500	
Ｊ．フロント　リテイリング	21,800	1,337.00	29,146,600	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	1,798.00	5,394,000	
マツモトキヨシホールディングス	3,600	5,180.00	18,648,000	
ブロンコビリー	700	2,661.00	1,862,700	
スタートトゥデイ	5,200	3,390.00	17,628,000	
物語コーポレーション	500	5,220.00	2,610,000	
ココカラファイン	1,800	4,385.00	7,893,000	
三越伊勢丹ホールディングス	34,300	1,315.00	45,104,500	
東洋紡	72,000	157.00	11,304,000	
ユニチカ	53,000	51.00	2,703,000	
富士紡ホールディングス	9,000	204.00	1,836,000	
日清紡ホールディングス	9,700	1,110.00	10,767,000	
倉敷紡績	19,000	175.00	3,325,000	
ダイワボウホールディングス	16,000	200.00	3,200,000	
シキボウ	11,000	107.00	1,177,000	
日東紡績	12,000	363.00	4,356,000	
トヨタ紡織	6,100	1,763.00	10,754,300	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,100	1,326.00	4,110,600	
ウエルシアホールディングス	1,500	5,610.00	8,415,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,500	2,418.00	6,045,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,000	957.00	2,871,000	
ＵＫＣホールディングス	1,100	2,065.00	2,271,500	
ＯＣＨＩホールディングス	1,000	1,007.00	1,007,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,600	567.00	4,309,200	
三洋貿易	900	1,290.00	1,161,000	
チムニー	400	2,715.00	1,086,000	

ジョイフル本田	2,800	2,210.00	6,188,000	
キリン堂ホールディングス	1,000	1,007.00	1,007,000	
すかいらーく	5,300	1,500.00	7,950,000	
日本毛織	6,000	741.00	4,446,000	
ダイドーリミテッド	2,100	467.00	980,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,700	946.00	5,392,200	
野村不動産ホールディングス	11,500	1,979.00	22,758,500	
三重交通グループホールディングス	3,100	441.00	1,367,100	
日本商業開発	600	1,747.00	1,048,200	
プレサンスコーポレーション	600	3,545.00	2,127,000	
ユニゾホールディングス	1,100	3,920.00	4,312,000	
日本管理センター	1,200	1,739.00	2,086,800	
サンセイランディック	1,200	848.00	1,017,600	
フージャースホールディングス	2,400	427.00	1,024,800	
オープンハウス	2,500	2,106.00	5,265,000	
東急不動産ホールディングス	41,700	707.00	29,481,900	
飯田グループホールディングス	16,000	2,052.00	32,832,000	
帝国繊維	1,900	1,474.00	2,800,600	
ブックオフコーポレーション	1,100	905.00	995,500	
日本コークス工業	14,800	76.00	1,124,800	
あさひ	1,300	1,301.00	1,691,300	
日本調剤	400	3,605.00	1,442,000	
コスモス薬品	900	16,660.00	14,994,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,500	2,791.00	9,768,500	
一六堂	2,900	332.00	962,800	
セブン＆アイ・ホールディングス	72,100	4,556.00	328,487,600	
薬王堂	400	2,582.00	1,032,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,500	2,945.00	4,417,500	
ツルハホールディングス	4,000	9,520.00	38,080,000	
サンマルクホールディングス	1,400	2,896.00	4,054,400	
トリドール	2,100	2,252.00	4,729,200	
クスリのアオキ	1,500	4,890.00	7,335,000	
帝人	75,000	379.00	28,425,000	
東レ	133,000	913.80	121,535,400	
クラレ	28,900	1,239.00	35,807,100	
旭化成	114,000	656.10	74,795,400	
稲葉製作所	1,000	1,158.00	1,158,000	
トーカロ	1,300	1,884.00	2,449,200	

ＳＵＭＣＯ	14,300	763.00	10,910,900	
川田テクノロジーズ	300	3,150.00	945,000	
住江織物	5,000	286.00	1,430,000	
日本フエルト	2,100	454.00	953,400	
芦森工業	7,000	149.00	1,043,000	
アツギ	14,000	109.00	1,526,000	
共和レザー	1,200	826.00	991,200	
セーレン	4,600	1,064.00	4,894,400	
東海染工	3,000	117.00	351,000	
小松精練	2,800	578.00	1,618,400	
ワコールホールディングス	11,000	1,311.00	14,421,000	
ホギメディカル	1,200	5,540.00	6,648,000	
レナウン	9,500	102.00	969,000	
ＴＳＩホールディングス	8,200	729.00	5,977,800	
ＩＴホールディングス	5,700	2,511.00	14,312,700	
電算システム	700	1,528.00	1,069,600	
グリー	10,500	541.00	5,680,500	
コーエーテクモホールディングス	4,100	1,679.00	6,883,900	
三菱総合研究所	700	3,480.00	2,436,000	
電算	400	2,395.00	958,000	
ＡＧＳ	1,200	815.00	978,000	
ファインデックス	1,100	1,014.00	1,115,400	
ヒト・コミュニケーションズ	600	1,732.00	1,039,200	
ＫＬａｂ	2,700	494.00	1,333,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,100	970.00	1,067,000	
ネクソン	16,500	1,661.00	27,406,500	
アイスタイル	2,600	778.00	2,022,800	
エムアップ	2,100	476.00	999,600	
エイチーム	700	1,431.00	1,001,700	
コロプラ	4,800	1,979.00	9,499,200	
ブロードリーフ	1,800	1,280.00	2,304,000	
ハーツユナイテッドグループ	500	1,915.00	957,500	
ブイキューブ	800	1,287.00	1,029,600	
特種東海製紙	11,000	368.00	4,048,000	
ティーガイア	1,700	1,204.00	2,046,800	
テクマトリックス	700	1,486.00	1,040,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,100	284.00	8,548,400	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	1,500	6,110.00	9,165,000	
ザッパラス	2,500	392.00	980,000	

インターネットイニシアティブ	2,800	2,168.00	6,070,400	
さくらインターネット	800	1,784.00	1,427,200	
ＳＲＡホールディングス	1,000	2,256.00	2,256,000	
王子ホールディングス	75,000	430.00	32,250,000	
日本製紙	9,500	1,825.00	17,337,500	
三菱製紙	28,000	80.00	2,240,000	
北越紀州製紙	11,400	617.00	7,033,800	
中越パルプ工業	8,000	159.00	1,272,000	
大王製紙	8,100	872.00	7,063,200	
ｇｕｍｉ	1,800	640.00	1,152,000	
パイプドＨＤ	900	1,076.00	968,400	
レンゴー	16,000	539.00	8,624,000	
トーモク	6,000	250.00	1,500,000	
ザ・パック	1,300	2,642.00	3,434,600	
昭和電工	122,000	113.00	13,786,000	
住友化学	135,000	502.00	67,770,000	
日本化成	9,000	114.00	1,026,000	
住友精化	4,000	587.00	2,348,000	
日産化学工業	11,000	2,563.00	28,193,000	
ラサ工業	10,000	101.00	1,010,000	
クレハ	14,000	361.00	5,054,000	
テイカ	3,000	526.00	1,578,000	
石原産業	33,000	73.00	2,409,000	
日本曹達	12,000	505.00	6,060,000	
東ソー	49,000	428.00	20,972,000	
トクヤマ	30,000	140.00	4,200,000	
セントラル硝子	20,000	543.00	10,860,000	
東亜合成	11,400	880.00	10,032,000	
大阪ソーダ	8,000	414.00	3,312,000	
関東電化工業	4,000	877.00	3,508,000	
デンカ	38,000	401.00	15,238,000	
イビデン	10,700	1,353.00	14,477,100	
信越化学工業	32,800	5,675.00	186,140,000	
日本カーバイド工業	8,000	119.00	952,000	
堺化学工業	7,000	297.00	2,079,000	
エア・ウォーター	15,000	1,583.00	23,745,000	
大陽日酸	14,100	1,006.00	14,184,600	
日本化学工業	7,000	193.00	1,351,000	
日本パーカライジング	9,300	972.00	9,039,600	
高圧ガス工業	3,000	586.00	1,758,000	
四国化成工業	3,000	869.00	2,607,000	

戸田工業	4,000	317.00	1,268,000	
ステラ　ケミファ	900	2,301.00	2,070,900	
保土谷化学工業	6,000	174.00	1,044,000	
日本触媒	2,700	6,790.00	18,333,000	
大日精化工業	7,000	442.00	3,094,000	
カネカ	25,000	864.00	21,600,000	
協和発酵キリン	21,900	1,616.00	35,390,400	
三菱瓦斯化学	31,000	571.00	17,701,000	
三井化学	78,000	396.00	30,888,000	
ＪＳＲ	17,200	1,577.00	27,124,400	
東京応化工業	3,700	2,964.00	10,966,800	
三菱ケミカルホールディングス	122,500	610.00	74,725,000	
日本合成化学工業	4,000	662.00	2,648,000	
ダイセル	25,700	1,515.00	38,935,500	
住友ベークライト	17,000	483.00	8,211,000	
積水化学工業	41,500	1,279.00	53,078,500	
日本ゼオン	16,000	696.00	11,136,000	
アイカ工業	5,500	2,186.00	12,023,000	
宇部興産	98,000	192.00	18,816,000	
積水樹脂	2,800	1,344.00	3,763,200	
タキロン	4,000	543.00	2,172,000	
旭有機材工業	6,000	202.00	1,212,000	
日立化成	9,000	1,869.00	16,821,000	
ニチバン	2,000	624.00	1,248,000	
リケンテクノス	3,000	359.00	1,077,000	
大倉工業	4,000	272.00	1,088,000	
積水化成品工業	5,000	347.00	1,735,000	
群栄化学工業	5,000	267.00	1,335,000	
ミライアル	1,200	859.00	1,030,800	
ダイキョーニシカワ	2,400	1,534.00	3,681,600	
日本化薬	12,000	1,141.00	13,692,000	
カーリットホールディングス	2,000	488.00	976,000	
ＥＰＳホールディングス	2,000	1,357.00	2,714,000	
プレステージ・インターナショナル	1,500	1,207.00	1,810,500	
フェイス	800	1,193.00	954,400	
アミューズ	500	4,110.00	2,055,000	
野村総合研究所	12,100	3,845.00	46,524,500	
ドリームインキュベータ	600	2,166.00	1,299,600	
サイバネットシステム	1,400	912.00	1,276,800	
ＴＡＣ	5,400	179.00	966,600	

ケネディクス	24,500	464.00	11,368,000	
電通	20,300	5,540.00	112,462,000	
インテージホールディングス	900	1,426.00	1,283,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,100	461.00	968,100	
東邦システムサイエンス	1,700	580.00	986,000	
ぴあ	500	2,163.00	1,081,500	
イオンファンタジー	600	2,126.00	1,275,600	
メディカルシステムネットワーク	2,300	425.00	977,500	
日本精化	1,500	721.00	1,081,500	
扶桑化学工業	1,200	1,359.00	1,630,800	
ＡＤＥＫＡ	9,000	1,495.00	13,455,000	
日油	14,000	792.00	11,088,000	
ミヨシ油脂	8,000	121.00	968,000	
新日本理化	6,800	144.00	979,200	
ハリマ化成グループ	1,900	506.00	961,400	
花王	49,200	5,848.00	287,721,600	
第一工業製薬	4,000	312.00	1,248,000	
三洋化成工業	6,000	766.00	4,596,000	
武田薬品工業	72,800	5,417.00	394,357,600	
アステラス製薬	204,800	1,577.00	322,969,600	
大日本住友製薬	12,900	1,236.00	15,944,400	
塩野義製薬	26,700	4,764.00	127,198,800	
田辺三菱製薬	21,300	2,031.00	43,260,300	
わかもと製薬	4,000	268.00	1,072,000	
あすか製薬	2,300	1,176.00	2,704,800	
日本新薬	4,200	3,880.00	16,296,000	
ビオフェルミン製薬	300	3,510.00	1,053,000	
中外製薬	18,200	3,370.00	61,334,000	
科研製薬	3,200	7,200.00	23,040,000	
エーザイ	22,500	7,000.00	157,500,000	
理研ビタミン	600	3,740.00	2,244,000	
ロート製薬	9,000	2,061.00	18,549,000	
小野薬品工業	8,300	19,715.00	163,634,500	
久光製薬	5,700	5,020.00	28,614,000	
持田製薬	1,300	8,540.00	11,102,000	
参天製薬	33,700	1,742.00	58,705,400	
扶桑薬品工業	6,000	252.00	1,512,000	
日本ケミファ	3,000	480.00	1,440,000	
ツムラ	5,800	2,793.00	16,199,400	
日医工	4,300	2,731.00	11,743,300	
テルモ	26,800	3,885.00	104,118,000	

みらかホールディングス	4,700	4,760.00	22,372,000	
キッセイ薬品工業	3,200	2,647.00	8,470,400	
生化学工業	3,500	1,336.00	4,676,000	
栄研化学	1,500	2,138.00	3,207,000	
鳥居薬品	1,200	2,341.00	2,809,200	
ＪＣＲファーマ	1,400	2,008.00	2,811,200	
東和薬品	800	5,220.00	4,176,000	
富士製薬工業	500	2,024.00	1,012,000	
沢井製薬	3,100	7,620.00	23,622,000	
ゼリア新薬工業	3,700	1,389.00	5,139,300	
第一三共	61,500	2,259.00	138,928,500	
キョーリン製薬ホールディングス	4,900	2,127.00	10,422,300	
大幸薬品	900	1,345.00	1,210,500	
ダイト	800	2,705.00	2,164,000	
大塚ホールディングス	39,300	4,152.00	163,173,600	
大正製薬ホールディングス	4,400	8,910.00	39,204,000	
ペプチドリーム	2,200	4,255.00	9,361,000	
大日本塗料	10,000	198.00	1,980,000	
日本ペイントホールディングス	14,100	2,372.00	33,445,200	
関西ペイント	20,700	1,689.00	34,962,300	
中国塗料	5,000	713.00	3,565,000	
日本特殊塗料	1,300	991.00	1,288,300	
藤倉化成	2,500	516.00	1,290,000	
太陽ホールディングス	1,300	3,685.00	4,790,500	
ＤＩＣ	73,000	242.00	17,666,000	
サカタインクス	3,700	1,137.00	4,206,900	
東洋インキＳＣホールディングス	18,000	447.00	8,046,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,300	909.00	1,181,700	
アルプス技研	700	2,191.00	1,533,700	
ダイオーズ	1,000	1,005.00	1,005,000	
日本空調サービス	900	1,111.00	999,900	
オリエンタルランド	19,700	8,010.00	157,797,000	
ダスキン	5,200	2,160.00	11,232,000	
パーク２４	8,700	2,943.00	25,604,100	
明光ネットワークジャパン	2,100	1,132.00	2,377,200	
ファルコホールディングス	800	1,267.00	1,013,600	
クレスコ	600	1,757.00	1,054,200	
フジ・メディア・ホールディングス	17,900	1,314.00	23,520,600	
秀英予備校	1,800	524.00	943,200	
ラウンドワン	5,700	691.00	3,938,700	

リゾートトラスト	7,600	2,513.00	19,098,800	
オービック	5,900	5,570.00	32,863,000	
ジャストシステム	3,100	851.00	2,638,100	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	900	1,043.00	938,700	
ヤフー	123,500	433.00	53,475,500	
ビー・エム・エル	1,100	4,095.00	4,504,500	
トレンドマイクロ	8,400	3,860.00	32,424,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	982.00	2,946,000	
インフォメーション・ディベロプメント	1,100	880.00	968,000	
リソー教育	3,400	308.00	1,047,200	
日本オラクル	2,800	5,380.00	15,064,000	
アルファシステムズ	600	1,733.00	1,039,800	
フューチャーアーキテクト	2,100	802.00	1,684,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,400	723.00	1,012,200	
ソフトバンク・テクノロジー	800	1,300.00	1,040,000	
トーセ	1,400	696.00	974,400	
ユー・エス・エス	22,100	1,719.00	37,989,900	
オービックビジネスコンサルタント	900	4,510.00	4,059,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	3,900	2,276.00	8,876,400	
アイティフォー	2,200	455.00	1,001,000	
東計電算	500	1,924.00	962,000	
サイバーエージェント	4,500	5,130.00	23,085,000	
楽天	85,300	999.60	85,265,880	
大塚商会	4,600	5,470.00	25,162,000	
総合メディカル	800	3,445.00	2,756,000	
サイボウズ	3,300	303.00	999,900	
セントラルスポーツ	600	2,272.00	1,363,200	
パラカ	800	1,331.00	1,064,800	
電通国際情報サービス	1,100	2,103.00	2,313,300	
イーエムシステムズ	400	2,568.00	1,027,200	
ウェザーニューズ	600	3,545.00	2,127,000	
ＣＩＪ	2,300	437.00	1,005,100	
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,313.00	919,100	
日本エンタープライズ	3,900	229.00	893,100	
WOWOW	800	2,564.00	2,051,200	
フルキャストホールディングス	1,700	667.00	1,133,900	
富士フイルムホールディングス	41,800	4,269.00	178,444,200	
コニカミノルタ	43,600	922.00	40,199,200	
資生堂	34,700	2,426.00	84,182,200	

ライオン	21,000	1,224.00	25,704,000	
高砂香料工業	1,200	2,271.00	2,725,200	
マンダム	1,700	4,640.00	7,888,000	
ミルボン	1,100	4,390.00	4,829,000	
ファンケル	4,200	1,391.00	5,842,200	
コーセー	3,000	9,560.00	28,680,000	
シーズ・ホールディングス	2,300	1,841.00	4,234,300	
シーボン	400	2,400.00	960,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	8,600.00	16,340,000	
ノエビアホールディングス	1,200	3,020.00	3,624,000	
アジュバンコスメジャパン	1,000	998.00	998,000	
エステー	1,200	1,095.00	1,314,000	
アグロ　カネショウ	900	882.00	793,800	
コニシ	1,400	2,617.00	3,663,800	
長谷川香料	2,300	1,449.00	3,332,700	
星光ＰＭＣ	1,100	914.00	1,005,400	
小林製薬	2,800	9,690.00	27,132,000	
荒川化学工業	1,600	927.00	1,483,200	
メック	1,400	841.00	1,177,400	
日本高純度化学	500	2,024.00	1,012,000	
ＪＣＵ	500	3,290.00	1,645,000	
デクセリアルズ	4,100	1,027.00	4,210,700	
アース製薬	1,300	4,050.00	5,265,000	
イハラケミカル工業	2,800	1,236.00	3,460,800	
北興化学工業	3,000	292.00	876,000	
大成ラミック	500	3,015.00	1,507,500	
クミアイ化学工業	3,800	1,148.00	4,362,400	
日本農薬	4,200	589.00	2,473,800	
昭和シェル石油	18,400	936.00	17,222,400	
ニチレキ	2,200	745.00	1,639,000	
東燃ゼネラル石油	28,000	900.00	25,200,000	
ユシロ化学工業	1,000	1,232.00	1,232,000	
ビーピー・カストロール	800	1,227.00	981,600	
富士石油	4,200	276.00	1,159,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	300	1,472.00	441,600	
出光興産	9,500	1,796.00	17,062,000	
ＪＸホールディングス	216,500	445.20	96,385,800	
コスモエネルギーホールディングス	5,500	1,188.00	6,534,000	
横浜ゴム	11,000	1,903.00	20,933,000	

東洋ゴム工業	8,300	1,711.00	14,201,300	
ブリヂストン	61,700	3,991.00	246,244,700	
住友ゴム工業	17,100	1,657.00	28,334,700	
藤倉ゴム工業	2,200	453.00	996,600	
オカモト	6,000	938.00	5,628,000	
アキレス	15,000	146.00	2,190,000	
フコク	300	851.00	255,300	
ニッタ	2,000	2,912.00	5,824,000	
クリエートメディック	1,200	804.00	964,800	
住友理工	3,900	994.00	3,876,600	
三ツ星ベルト	4,000	873.00	3,492,000	
バンドー化学	7,000	431.00	3,017,000	
鬼怒川ゴム工業	4,000	524.00	2,096,000	
旭硝子	97,000	545.00	52,865,000	
日本板硝子	89,000	72.00	6,408,000	
有沢製作所	2,700	560.00	1,512,000	
日本山村硝子	7,000	164.00	1,148,000	
日本電気硝子	38,000	532.00	20,216,000	
住友大阪セメント	36,000	412.00	14,832,000	
太平洋セメント	114,000	228.00	25,992,000	
日本ヒューム	1,800	547.00	984,600	
日本コンクリート工業	4,000	250.00	1,000,000	
三谷セキサン	900	1,372.00	1,234,800	
アジアパイルホールディングス	2,700	358.00	966,600	
東海カーボン	16,000	273.00	4,368,000	
日本カーボン	9,000	214.00	1,926,000	
東洋炭素	1,000	1,453.00	1,453,000	
ノリタケカンパニーリミテド	10,000	243.00	2,430,000	
ＴＯＴＯ	13,400	3,235.00	43,349,000	
日本碍子	23,000	2,055.00	47,265,000	
日本特殊陶業	15,800	2,165.00	34,207,000	
ＭＡＲＵＷＡ	700	2,489.00	1,742,300	
品川リフラクトリーズ	5,000	203.00	1,015,000	
黒崎播磨	4,000	234.00	936,000	
東京窯業	6,000	167.00	1,002,000	
ニッカトー	2,600	373.00	969,800	
フジミインコーポレーテッド	1,600	1,165.00	1,864,000	
エーアンドエーマテリアル	14,000	71.00	994,000	
ニチアス	9,000	628.00	5,652,000	
新日鐵住金	82,400	1,874.00	154,417,600	
神戸製鋼所	336,000	86.00	28,896,000	

中山製鋼所	21,000	65.00	1,365,000	
合同製鐵	10,000	192.00	1,920,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	50,000	1,292.50	64,625,000	
日新製鋼	8,300	1,166.00	9,677,800	
東京製鐵	10,100	724.00	7,312,400	
共英製鋼	1,900	1,701.00	3,231,900	
大和工業	4,000	2,307.00	9,228,000	
東京鐵鋼	4,000	389.00	1,556,000	
大阪製鐵	1,100	1,727.00	1,899,700	
淀川製鋼所	2,700	2,451.00	6,617,700	
東洋鋼鈑	4,400	301.00	1,324,400	
丸一鋼管	6,100	3,125.00	19,062,500	
大同特殊鋼	31,000	409.00	12,679,000	
日本冶金工業	13,400	113.00	1,514,200	
山陽特殊製鋼	11,000	479.00	5,269,000	
愛知製鋼	11,000	423.00	4,653,000	
日立金属	20,900	1,192.00	24,912,800	
日本金属	10,000	107.00	1,070,000	
大平洋金属	13,000	312.00	4,056,000	
新日本電工	10,300	165.00	1,699,500	
栗本鐵工所	9,000	156.00	1,404,000	
日本鋳鉄管	7,000	134.00	938,000	
日本製鋼所	30,000	380.00	11,400,000	
三菱製鋼	13,000	175.00	2,275,000	
日亜鋼業	3,700	262.00	969,400	
日本精線	2,000	477.00	954,000	
大紀アルミニウム工業所	4,000	257.00	1,028,000	
日本軽金属ホールディングス	41,400	168.00	6,955,200	
三井金属鉱業	47,000	160.00	7,520,000	
東邦亜鉛	10,000	281.00	2,810,000	
三菱マテリアル	114,000	311.00	35,454,000	
住友金属鉱山	50,000	1,160.50	58,025,000	
ＤＯＷＡホールディングス	24,000	602.00	14,448,000	
古河機械金属	29,000	160.00	4,640,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	1,632.00	2,937,600	
東邦チタニウム	3,100	865.00	2,681,500	
ＵＡＣＪ	26,000	214.00	5,564,000	
古河電気工業	57,000	231.00	13,167,000	
住友電気工業	73,200	1,340.50	98,124,600	
フジクラ	25,000	466.00	11,650,000	

昭和電線ホールディングス	22,000	55.00	1,210,000	
東京特殊電線	1,200	857.00	1,028,400	
タツタ電線	3,800	329.00	1,250,200	
カナレ電気	600	1,693.00	1,015,800	
リョービ	11,000	407.00	4,477,000	
アーレスティ	2,100	655.00	1,375,500	
アサヒホールディングス	2,800	1,440.00	4,032,000	
東洋製罐グループホールディングス	13,000	1,971.00	25,623,000	
ホッカンホールディングス	5,000	289.00	1,445,000	
コロナ	1,000	1,000.00	1,000,000	
横河ブリッジホールディングス	3,500	1,058.00	3,703,000	
ＯＳＪＢホールディングス	3,600	219.00	788,400	
駒井ハルテック	4,000	224.00	896,000	
高田機工	5,000	186.00	930,000	
三和ホールディングス	18,500	719.00	13,301,500	
文化シヤッター	5,100	905.00	4,615,500	
三協立山	2,400	1,299.00	3,117,600	
アルインコ	1,000	987.00	987,000	
ＬＩＸＩＬグループ	25,500	2,393.00	61,021,500	
日本フイルコン	2,300	416.00	956,800	
ノーリツ	3,600	1,894.00	6,818,400	
長府製作所	2,000	2,490.00	4,980,000	
リンナイ	3,400	9,740.00	33,116,000	
ユニプレス	3,600	1,783.00	6,418,800	
ダイニチ工業	900	609.00	548,100	
日東精工	3,000	302.00	906,000	
岡部	3,800	678.00	2,576,400	
ジーテクト	1,900	1,172.00	2,226,800	
東プレ	3,500	2,055.00	7,192,500	
高周波熱錬	3,400	817.00	2,777,800	
東京製綱	12,000	139.00	1,668,000	
サンコール	2,100	473.00	993,300	
モリテックスチール	4,000	248.00	992,000	
パイオラックス	900	5,230.00	4,707,000	
日本発条	17,200	1,020.00	17,544,000	
中央発條	4,000	263.00	1,052,000	
三浦工業	8,200	1,810.00	14,842,000	
タクマ	7,000	870.00	6,090,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,000	3,070.00	9,210,000	
リブセンス	700	389.00	272,300	

ジャパンマテリアル	800	2,216.00	1,772,800	
ベクトル	600	2,588.00	1,552,800	
アサンテ	700	1,496.00	1,047,200	
アビスト	500	1,981.00	990,500	
ウィルグループ	1,100	896.00	985,600	
リクルートホールディングス	36,800	3,380.00	124,384,000	
ツガミ	5,000	399.00	1,995,000	
オークマ	12,000	862.00	10,344,000	
東芝機械	10,000	370.00	3,700,000	
アマダホールディングス	26,600	1,089.00	28,967,400	
アイダエンジニアリング	4,800	864.00	4,147,200	
滝澤鉄工所	8,000	124.00	992,000	
富士機械製造	6,000	1,077.00	6,462,000	
牧野フライス製作所	9,000	722.00	6,498,000	
オーエスジー	8,300	1,912.00	15,869,600	
ダイジェット工業	8,000	130.00	1,040,000	
旭ダイヤモンド工業	5,000	976.00	4,880,000	
ＤＭＧ森精機	10,100	973.00	9,827,300	
ソディック	3,500	738.00	2,583,000	
ディスコ	2,300	10,780.00	24,794,000	
日東工器	1,100	2,071.00	2,278,100	
日本郵政	40,200	1,391.00	55,918,200	
ベルシステム２４ホールディングス	2,700	958.00	2,586,600	
豊田自動織機	15,900	4,780.00	76,002,000	
豊和工業	1,800	540.00	972,000	
ＯＫＫ	9,000	112.00	1,008,000	
石川製作所	14,000	68.00	952,000	
津田駒工業	10,000	98.00	980,000	
島精機製作所	2,600	1,716.00	4,461,600	
日阪製作所	2,300	805.00	1,851,500	
やまびこ	3,300	750.00	2,475,000	
ペガサスミシン製造	2,000	490.00	980,000	
ナブテスコ	9,500	2,219.00	21,080,500	
三井海洋開発	2,100	1,475.00	3,097,500	
レオン自動機	1,600	605.00	968,000	
ＳＭＣ	5,500	27,365.00	150,507,500	
新川	2,400	398.00	955,200	
ホソカワミクロン	3,000	528.00	1,584,000	
ユニオンツール	800	2,430.00	1,944,000	
オイレス工業	2,400	1,777.00	4,264,800	

日精エー・エス・ビー機械	700	1,806.00	1,264,200	
サトーホールディングス	2,500	2,492.00	6,230,000	
日本エアーテック	1,400	691.00	967,400	
日精樹脂工業	1,500	680.00	1,020,000	
小松製作所	89,600	1,741.50	156,038,400	
住友重機械工業	53,000	464.00	24,592,000	
日立建機	8,200	1,637.00	13,423,400	
日工	3,000	325.00	975,000	
巴工業	700	1,423.00	996,100	
井関農機	19,000	180.00	3,420,000	
ＴＯＷＡ	1,800	692.00	1,245,600	
丸山製作所	6,000	165.00	990,000	
北川鉄工所	8,000	206.00	1,648,000	
シンニッタン	600	588.00	352,800	
クボタ	87,700	1,449.00	127,077,300	
荏原実業	800	1,210.00	968,000	
東洋エンジニアリング	10,000	263.00	2,630,000	
三菱化工機	6,000	223.00	1,338,000	
月島機械	3,500	1,007.00	3,524,500	
帝国電機製作所	1,400	662.00	926,800	
新東工業	4,100	909.00	3,726,900	
澁谷工業	1,500	1,332.00	1,998,000	
アイチコーポレーション	2,600	772.00	2,007,200	
小森コーポレーション	4,400	1,202.00	5,288,800	
鶴見製作所	1,400	1,758.00	2,461,200	
住友精密工業	3,000	344.00	1,032,000	
荏原製作所	40,000	426.00	17,040,000	
石井鐵工所	7,000	146.00	1,022,000	
西島製作所	1,900	969.00	1,841,100	
北越工業	2,000	642.00	1,284,000	
千代田化工建設	14,000	847.00	11,858,000	
ダイキン工業	25,400	7,809.00	198,348,600	
オルガノ	3,000	413.00	1,239,000	
トーヨーカネツ	10,000	240.00	2,400,000	
栗田工業	11,000	2,546.00	28,006,000	
椿本チエイン	10,000	627.00	6,270,000	
日機装	6,500	834.00	5,421,000	
新興プランテック	4,000	880.00	3,520,000	
アネスト岩田	2,900	863.00	2,502,700	
ダイフク	9,400	1,754.00	16,487,600	
加藤製作所	4,000	374.00	1,496,000	

タダノ	8,000	974.00	7,792,000	
フジテック	5,100	1,173.00	5,982,300	
ＣＫＤ	4,900	781.00	3,826,900	
キトー	2,200	743.00	1,634,600	
平和	5,500	2,360.00	12,980,000	
理想科学工業	1,900	1,786.00	3,393,400	
ＳＡＮＫＹＯ	4,900	4,250.00	20,825,000	
日本金銭機械	1,600	989.00	1,582,400	
マースエンジニアリング	1,000	1,947.00	1,947,000	
福島工業	1,100	2,264.00	2,490,400	
オーイズミ	2,100	475.00	997,500	
ダイコク電機	800	1,218.00	974,400	
竹内製作所	2,600	1,437.00	3,736,200	
アマノ	5,400	1,583.00	8,548,200	
ＪＵＫＩ	2,600	862.00	2,241,200	
サンデンホールディングス	11,000	291.00	3,201,000	
蛇の目ミシン工業	1,800	537.00	966,600	
ブラザー工業	22,600	1,198.00	27,074,800	
マックス	3,000	1,190.00	3,570,000	
モリタホールディングス	3,100	1,244.00	3,856,400	
グローリー	6,000	3,790.00	22,740,000	
新晃工業	1,200	1,696.00	2,035,200	
大和冷機工業	2,800	920.00	2,576,000	
セガサミーホールディングス	18,800	1,196.00	22,484,800	
日本ピストンリング	700	1,503.00	1,052,100	
リケン	8,000	355.00	2,840,000	
ＴＰＲ	2,100	2,652.00	5,569,200	
ツバキ・ナカシマ	1,600	1,563.00	2,500,800	
ホシザキ電機	3,800	8,590.00	32,642,000	
大豊工業	1,400	1,087.00	1,521,800	
日本精工	35,900	1,048.00	37,623,200	
ＮＴＮ	43,000	362.00	15,566,000	
ジェイテクト	18,600	1,550.00	28,830,000	
不二越	16,000	378.00	6,048,000	
ミネベア	28,000	792.00	22,176,000	
日本トムソン	6,000	379.00	2,274,000	
ＴＨＫ	11,600	1,969.00	22,840,400	
ユーシン精機	700	1,724.00	1,206,800	
前澤給装工業	700	1,369.00	958,300	
イーグル工業	2,200	1,402.00	3,084,400	
日本ピラー工業	1,800	912.00	1,641,600	

キッツ	8,500	470.00	3,995,000	
日立製作所	445,000	476.60	212,087,000	
東芝	368,000	183.50	67,528,000	
三菱電機	186,000	1,134.00	210,924,000	
富士電機	53,000	382.00	20,246,000	
東洋電機製造	3,000	319.00	957,000	
安川電機	21,700	1,281.00	27,797,700	
シンフォニア　テクノロジー	11,000	144.00	1,584,000	
明電舎	16,000	464.00	7,424,000	
オリジン電気	4,000	255.00	1,020,000	
山洋電気	5,000	500.00	2,500,000	
デンヨー	1,600	1,171.00	1,873,600	
日立工機	4,700	740.00	3,478,000	
三櫻工業	2,200	564.00	1,240,800	
マキタ	11,400	6,760.00	77,064,000	
東芝テック	12,000	352.00	4,224,000	
芝浦メカトロニクス	5,000	191.00	955,000	
マブチモーター	5,000	4,620.00	23,100,000	
日本電産	21,000	7,372.00	154,812,000	
東光高岳	1,000	1,337.00	1,337,000	
ダブル・スコープ	500	4,025.00	2,012,500	
ダイヘン	10,000	454.00	4,540,000	
田淵電機	2,200	437.00	961,400	
ＪＶＣケンウッド	12,800	294.00	3,763,200	
ミマキエンジニアリング	1,000	429.00	429,000	
第一精工	700	1,285.00	899,500	
日新電機	4,100	917.00	3,759,700	
大崎電気工業	3,000	717.00	2,151,000	
オムロン	20,000	3,070.00	61,400,000	
日東工業	2,800	1,799.00	5,037,200	
ＩＤＥＣ	2,300	1,023.00	2,352,900	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	34,000	448.00	15,232,000	
サクサホールディングス	5,000	191.00	955,000	
メルコホールディングス	1,000	2,237.00	2,237,000	
テクノメディカ	400	2,235.00	894,000	
日本電気	240,000	273.00	65,520,000	
富士通	168,000	414.20	69,585,600	
沖電気工業	76,000	152.00	11,552,000	
岩崎通信機	14,000	72.00	1,008,000	
電気興業	5,000	551.00	2,755,000	

サンケン電気	10,000	303.00	3,030,000	
アイホン	1,000	1,933.00	1,933,000	
ルネサスエレクトロニクス	9,000	659.00	5,931,000	
セイコーエプソン	26,000	1,799.00	46,774,000	
ワコム	13,700	484.00	6,630,800	
アルバック	3,200	3,280.00	10,496,000	
アクセル	1,200	860.00	1,032,000	
ＥＩＺＯ	1,700	2,990.00	5,083,000	
ジャパンディスプレイ	32,600	211.00	6,878,600	
日本信号	4,800	799.00	3,835,200	
京三製作所	4,000	321.00	1,284,000	
能美防災	2,000	1,353.00	2,706,000	
ホーチキ	1,300	1,134.00	1,474,200	
エレコム	1,500	1,618.00	2,427,000	
日本無線	4,000	267.00	1,068,000	
パナソニック	199,500	845.10	168,597,450	
シャープ	148,000	173.00	25,604,000	
アンリツ	10,500	638.00	6,699,000	
富士通ゼネラル	5,000	1,488.00	7,440,000	
日立国際電気	4,000	1,266.00	5,064,000	
ソニー	123,200	2,488.00	306,521,600	
ＴＤＫ	10,500	5,740.00	60,270,000	
ミツミ電機	6,600	487.00	3,214,200	
タムラ製作所	7,000	271.00	1,897,000	
アルプス電気	14,800	1,804.00	26,699,200	
パイオニア	28,300	244.00	6,905,200	
日本電波工業	1,600	675.00	1,080,000	
日本トリム	500	4,335.00	2,167,500	
ローランド　ディー．ジー．	900	2,334.00	2,100,600	
フォスター電機	2,200	2,138.00	4,703,600	
クラリオン	9,000	351.00	3,159,000	
ＳＭＫ	5,000	529.00	2,645,000	
東光	4,000	358.00	1,432,000	
ティアック	23,000	42.00	966,000	
ホシデン	5,300	661.00	3,503,300	
ヒロセ電機	2,800	12,610.00	35,308,000	
日本航空電子工業	5,000	1,151.00	5,755,000	
ＴＯＡ	2,100	1,012.00	2,125,200	
日立マクセル	2,900	1,627.00	4,718,300	
古野電気	2,100	698.00	1,465,800	
ユニデンホールディングス	9,000	113.00	1,017,000	

アルパイン	4,200	1,270.00	5,334,000	
スミダコーポレーション	1,400	708.00	991,200	
アイコム	1,000	2,196.00	2,196,000	
リオン	700	1,560.00	1,092,000	
船井電機	1,800	963.00	1,733,400	
横河電機	17,500	1,124.00	19,670,000	
新電元工業	6,000	361.00	2,166,000	
アズビル	5,700	2,777.00	15,828,900	
日本光電工業	7,300	2,826.00	20,629,800	
チノー	1,000	1,005.00	1,005,000	
日本電子材料	2,500	384.00	960,000	
堀場製作所	3,200	3,655.00	11,696,000	
アドバンテスト	11,900	1,025.00	12,197,500	
エスペック	1,800	1,343.00	2,417,400	
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	1,800	544.00	979,200	
キーエンス	4,000	58,580.00	234,320,000	
日置電機	900	2,239.00	2,015,100	
シスメックス	13,500	6,660.00	89,910,000	
日本マイクロニクス	2,300	959.00	2,205,700	
メガチップス	1,800	1,063.00	1,913,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,100	4,150.00	4,565,000	
イマジカ・ロボット　ホールディングス	2,600	389.00	1,011,400	
澤藤電機	5,000	179.00	895,000	
デンソー	43,100	4,200.00	181,020,000	
コーセル	2,400	998.00	2,395,200	
オプテックス	1,300	2,770.00	3,601,000	
千代田インテグレ	900	2,538.00	2,284,200	
レーザーテック	2,000	1,419.00	2,838,000	
スタンレー電気	12,500	2,534.00	31,675,000	
岩崎電気	6,000	174.00	1,044,000	
ウシオ電機	10,600	1,578.00	16,726,800	
岡谷電機産業	2,600	370.00	962,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	2,600	382.00	993,200	
日本セラミック	1,000	1,820.00	1,820,000	
日本デジタル研究所	1,500	1,569.00	2,353,500	
双信電機	3,800	259.00	984,200	
山一電機	1,700	572.00	972,400	
図研	1,300	1,163.00	1,511,900	
日本電子	7,000	524.00	3,668,000	

カシオ計算機	17,500	2,102.00	36,785,000	
ファナック	17,900	17,040.00	305,016,000	
日本シイエムケイ	3,800	390.00	1,482,000	
エンプラス	900	3,815.00	3,433,500	
ローム	8,600	4,685.00	40,291,000	
浜松ホトニクス	13,600	2,805.00	38,148,000	
三井ハイテック	2,500	528.00	1,320,000	
新光電気工業	6,600	648.00	4,276,800	
京セラ	28,700	4,927.00	141,404,900	
協栄産業	8,000	125.00	1,000,000	
太陽誘電	8,500	1,111.00	9,443,500	
村田製作所	18,300	13,435.00	245,860,500	
ユーシン	2,300	659.00	1,515,700	
双葉電子工業	3,000	1,504.00	4,512,000	
日東電工	14,100	5,982.00	84,346,200	
北陸電気工業	8,000	124.00	992,000	
東海理化電機製作所	5,100	2,357.00	12,020,700	
ニチコン	5,500	733.00	4,031,500	
日本ケミコン	14,000	142.00	1,988,000	
ＫＯＡ	2,400	864.00	2,073,600	
三井造船	68,000	147.00	9,996,000	
日立造船	13,800	514.00	7,093,200	
三菱重工業	311,000	409.90	127,478,900	
川崎重工業	136,000	303.00	41,208,000	
ＩＨＩ	134,000	190.00	25,460,000	
名村造船所	5,200	675.00	3,510,000	
サノヤスホールディングス	4,800	204.00	979,200	
日本車輌製造	7,000	243.00	1,701,000	
ニチユ三菱フォークリフト	2,200	431.00	948,200	
近畿車輌	3,000	298.00	894,000	
ＦＰＧ	5,100	957.00	4,880,700	
島根銀行	800	1,156.00	924,800	
じもとホールディングス	12,400	145.00	1,798,000	
全国保証	4,500	3,310.00	14,895,000	
足利ホールディングス	12,600	316.00	3,981,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2,400	2,597.00	6,232,800	
九州フィナンシャルグループ	26,400	659.00	17,397,600	
かんぽ生命保険	5,300	2,377.00	12,598,100	
ゆうちょ銀行	33,100	1,191.00	39,422,100	
日産自動車	245,100	979.20	240,001,920	
いすゞ自動車	50,600	1,137.50	57,557,500	

トヨタ自動車	217,200	5,980.00	1,298,856,000	
日野自動車	24,900	1,182.00	29,431,800	
三菱自動車工業	69,300	809.00	56,063,700	
レシップホールディングス	1,300	762.00	990,600	
ＧＭＢ	1,200	826.00	991,200	
ファルテック	700	1,324.00	926,800	
武蔵精密工業	1,900	2,105.00	3,999,500	
日産車体	8,500	1,133.00	9,630,500	
新明和工業	8,000	767.00	6,136,000	
極東開発工業	3,500	1,032.00	3,612,000	
日信工業	3,900	1,442.00	5,623,800	
トピー工業	14,000	214.00	2,996,000	
ティラド	7,000	168.00	1,176,000	
曙ブレーキ工業	8,800	240.00	2,112,000	
タチエス	2,800	1,495.00	4,186,000	
ＮＯＫ	8,400	1,850.00	15,540,000	
フタバ産業	5,300	463.00	2,453,900	
ＫＹＢ	20,000	294.00	5,880,000	
シロキ工業	4,000	331.00	1,324,000	
市光工業	5,000	184.00	920,000	
大同メタル工業	2,400	779.00	1,869,600	
プレス工業	9,300	391.00	3,636,300	
カルソニックカンセイ	13,000	814.00	10,582,000	
太平洋工業	3,900	1,001.00	3,903,900	
ケーヒン	4,100	1,585.00	6,498,500	
河西工業	2,100	1,235.00	2,593,500	
アイシン精機	17,600	4,480.00	78,848,000	
マツダ	55,300	1,614.50	89,281,850	
ダイハツ工業	20,800	1,586.00	32,988,800	
今仙電機製作所	1,600	1,016.00	1,625,600	
本田技研工業	157,100	2,925.00	459,517,500	
スズキ	36,500	2,809.50	102,546,750	
富士重工業	55,200	3,693.00	203,853,600	
ヤマハ発動機	24,700	1,783.00	44,040,100	
ショーワ	4,500	926.00	4,167,000	
小糸製作所	10,500	4,930.00	51,765,000	
ＴＢＫ	2,700	369.00	996,300	
エクセディ	2,400	2,272.00	5,452,800	
ミツバ	3,000	1,497.00	4,491,000	
豊田合成	6,300	2,235.00	14,080,500	
愛三工業	3,100	887.00	2,749,700	

ヨロズ	1,600	2,172.00	3,475,200	
エフ・シー・シー	2,900	1,860.00	5,394,000	
新家工業	7,000	132.00	924,000	
シマノ	7,000	18,470.00	129,290,000	
タカタ	3,200	507.00	1,622,400	
テイ・エス　テック	4,100	2,553.00	10,467,300	
ジャムコ	800	2,489.00	1,991,200	
小野建	1,500	961.00	1,441,500	
はるやま商事	1,300	754.00	980,200	
佐鳥電機	1,400	689.00	964,600	
カッパ・クリエイト	2,400	1,126.00	2,702,400	
エコートレーディング	1,600	605.00	968,000	
伯東	1,300	931.00	1,210,300	
コンドーテック	1,400	765.00	1,071,000	
ライトオン	1,300	1,458.00	1,895,400	
ナガイレーベン	2,500	1,993.00	4,982,500	
三菱食品	1,900	2,968.00	5,639,200	
良品計画	2,000	23,850.00	47,700,000	
三城ホールディングス	2,200	445.00	979,000	
松田産業	1,300	1,220.00	1,586,000	
第一興商	3,000	4,650.00	13,950,000	
メディパルホールディングス	17,200	1,739.00	29,910,800	
アドヴァン	1,800	1,048.00	1,886,400	
アズワン	1,300	3,925.00	5,102,500	
尾家産業	1,200	846.00	1,015,200	
シモジマ	1,200	1,081.00	1,297,200	
ドウシシャ	2,000	2,142.00	4,284,000	
小津産業	500	2,158.00	1,079,000	
コナカ	2,000	533.00	1,066,000	
高速	1,100	856.00	941,600	
ハウス　オブ　ローゼ	700	1,460.00	1,022,000	
イオン北海道	1,900	518.00	984,200	
コジマ	4,300	228.00	980,400	
ヒマラヤ	1,000	1,006.00	1,006,000	
コーナン商事	2,400	1,547.00	3,712,800	
黒田電気	3,200	1,623.00	5,193,600	
ネットワンシステムズ	7,500	588.00	4,410,000	
エコス	800	1,180.00	944,000	
ワタミ	2,000	1,076.00	2,152,000	
マルシェ	1,200	836.00	1,003,200	
ドンキホーテホールディングス	11,100	3,705.00	41,125,500	

丸文	1,500	705.00	1,057,500	
西松屋チェーン	3,400	972.00	3,304,800	
ゼンショーホールディングス	8,900	1,393.00	12,397,700	
ハピネット	1,600	931.00	1,489,600	
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,563.00	1,719,300	
橋本総業	600	1,515.00	909,000	
サイゼリヤ	2,800	2,299.00	6,437,200	
エクセル	800	1,294.00	1,035,200	
ＶＴホールディングス	5,800	569.00	3,300,200	
マルカキカイ	700	1,386.00	970,200	
アルゴグラフィックス	800	1,686.00	1,348,800	
ガリバーインターナショナル	4,600	1,116.00	5,133,600	
ユナイテッドアローズ	2,500	5,080.00	12,700,000	
進和	1,000	1,408.00	1,408,000	
エスケイジャパン	2,200	451.00	992,200	
ハイデイ日高	1,300	3,495.00	4,543,500	
シークス	1,100	2,833.00	3,116,300	
京都きもの友禅	1,200	842.00	1,010,400	
コロワイド	5,700	1,730.00	9,861,000	
ピーシーデポコーポレーション	1,400	1,028.00	1,439,200	
田中商事	1,600	620.00	992,000	
オーハシテクニカ	1,000	1,258.00	1,258,000	
壱番屋	800	5,920.00	4,736,000	
白銅	1,000	1,012.00	1,012,000	
トップカルチャー	2,100	457.00	959,700	
ＰＬＡＮＴ	800	1,163.00	930,400	
スギホールディングス	3,100	5,430.00	16,833,000	
島津製作所	22,000	1,787.00	39,314,000	
モリテックス	3,300	289.00	953,700	
長野計器	1,600	598.00	956,800	
ブイ・テクノロジー	400	3,675.00	1,470,000	
スター精密	3,300	1,273.00	4,200,900	
東京計器	6,000	154.00	924,000	
オーバル	4,600	215.00	989,000	
東京精密	3,400	2,141.00	7,279,400	
マニー	1,600	1,662.00	2,659,200	
ニコン	32,600	1,692.00	55,159,200	
トプコン	5,900	1,185.00	6,991,500	
オリンパス	26,000	4,100.00	106,600,000	
理研計器	1,400	1,044.00	1,461,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18,000	812.00	14,616,000	

キヤノン電子	1,600	1,643.00	2,628,800	
タムロン	1,400	1,718.00	2,405,200	
ＨＯＹＡ	40,600	4,150.00	168,490,000	
ノーリツ鋼機	1,200	418.00	501,600	
エー・アンド・デイ	2,500	378.00	945,000	
キヤノン	94,000	3,311.00	311,234,000	
リコー	56,500	1,134.00	64,071,000	
シチズンホールディングス	21,500	626.00	13,459,000	
リズム時計工業	8,000	142.00	1,136,000	
大研医器	1,400	900.00	1,260,000	
メニコン	900	3,060.00	2,754,000	
スノーピーク	300	3,455.00	1,036,500	
パラマウントベッドホールディングス	1,800	3,745.00	6,741,000	
ＳＨＯ‐ＢＩ	2,600	395.00	1,027,000	
ニホンフラッシュ	1,000	980.00	980,000	
前田工繊	1,900	982.00	1,865,800	
アートネイチャー	1,400	960.00	1,344,000	
ダンロップスポーツ	1,100	934.00	1,027,400	
バンダイナムコホールディングス	18,100	2,345.00	42,444,500	
共立印刷	3,400	282.00	958,800	
ＳＨＯＥＩ	800	1,820.00	1,456,000	
フランスベッドホールディングス	2,400	964.00	2,313,600	
マーベラス	2,900	821.00	2,380,900	
パイロットコーポレーション	3,000	3,965.00	11,895,000	
萩原工業	500	1,976.00	988,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,200	1,302.00	4,166,400	
トッパン・フォームズ	3,100	1,325.00	4,107,500	
フジシールインターナショナル	2,100	3,650.00	7,665,000	
タカラトミー	5,700	843.00	4,805,100	
廣済堂	3,100	308.00	954,800	
レック	800	1,258.00	1,006,400	
プロネクサス	1,600	1,112.00	1,779,200	
ホクシン	9,000	108.00	972,000	
ウッドワン	4,000	242.00	968,000	
大建工業	7,000	239.00	1,673,000	
きもと	5,800	167.00	968,600	
凸版印刷	49,000	972.00	47,628,000	
大日本印刷	52,000	990.00	51,480,000	
図書印刷	3,000	461.00	1,383,000	

共同印刷	6,000	338.00	2,028,000	
日本写真印刷	2,900	1,736.00	5,034,400	
光村印刷	5,000	205.00	1,025,000	
藤森工業	1,600	2,443.00	3,908,800	
宝印刷	800	1,259.00	1,007,200	
前澤化成工業	1,300	975.00	1,267,500	
アシックス	16,300	2,032.00	33,121,600	
ツツミ	900	2,449.00	2,204,100	
ＪＳＰ	1,200	2,239.00	2,686,800	
ニチハ	2,400	1,529.00	3,669,600	
エフピコ	1,600	4,400.00	7,040,000	
小松ウオール工業	600	1,667.00	1,000,200	
ヤマハ	12,800	3,180.00	40,704,000	
河合楽器製作所	600	1,897.00	1,138,200	
クリナップ	2,000	723.00	1,446,000	
ピジョン	9,900	2,637.00	26,106,300	
天馬	1,400	1,907.00	2,669,800	
キングジム	1,500	736.00	1,104,000	
リンテック	4,200	2,125.00	8,925,000	
信越ポリマー	3,600	581.00	2,091,600	
東リ	5,000	291.00	1,455,000	
イトーキ	3,700	697.00	2,578,900	
任天堂	10,800	16,495.00	178,146,000	
三菱鉛筆	1,300	4,360.00	5,668,000	
松風	900	1,310.00	1,179,000	
タカラスタンダード	7,000	968.00	6,776,000	
コクヨ	9,100	1,107.00	10,073,700	
ニフコ	3,500	5,060.00	17,710,000	
グローブライド	800	1,423.00	1,138,400	
岡村製作所	6,100	993.00	6,057,300	
日本バルカー工業	7,000	276.00	1,932,000	
伊藤忠商事	135,200	1,378.50	186,373,200	
丸紅	169,600	584.40	99,114,240	
スクロール	2,600	404.00	1,050,400	
ヨンドシーホールディングス	1,300	2,437.00	3,168,100	
三陽商会	10,000	257.00	2,570,000	
長瀬産業	10,400	1,170.00	12,168,000	
蝶理	1,100	1,428.00	1,570,800	
豊田通商	19,200	2,330.00	44,736,000	
オンワードホールディングス	12,000	705.00	8,460,000	
三共生興	2,600	389.00	1,011,400	

兼松	37,000	151.00	5,587,000	
美津濃	9,000	503.00	4,527,000	
ツカモトコーポレーション	9,000	105.00	945,000	
ファミリーマート	5,300	5,560.00	29,468,000	
三井物産	155,800	1,313.00	204,565,400	
日本紙パルプ商事	9,000	316.00	2,844,000	
東京エレクトロン	15,700	7,053.00	110,732,100	
日立ハイテクノロジーズ	6,000	3,030.00	18,180,000	
カメイ	2,200	983.00	2,162,600	
東都水産	6,000	173.00	1,038,000	
スターゼン	600	3,145.00	1,887,000	
セイコーホールディングス	11,000	398.00	4,378,000	
山善	6,600	907.00	5,986,200	
椿本興業	3,000	286.00	858,000	
住友商事	108,500	1,136.50	123,310,250	
日本ユニシス	4,800	1,395.00	6,696,000	
内田洋行	4,000	390.00	1,560,000	
三菱商事	129,300	1,872.00	242,049,600	
第一実業	4,000	456.00	1,824,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,900	1,946.00	9,535,400	
西華産業	6,000	217.00	1,302,000	
佐藤商事	1,500	622.00	933,000	
菱洋エレクトロ	2,000	1,095.00	2,190,000	
東京産業	2,500	393.00	982,500	
ユアサ商事	1,600	2,442.00	3,907,200	
神鋼商事	5,000	198.00	990,000	
小林産業	5,000	193.00	965,000	
阪和興業	17,000	435.00	7,395,000	
カナデン	1,600	811.00	1,297,600	
菱電商事	3,000	624.00	1,872,000	
ニプロ	13,000	1,075.00	13,975,000	
フルサト工業	900	1,563.00	1,406,700	
岩谷産業	20,000	609.00	12,180,000	
すてきナイスグループ	7,000	132.00	924,000	
昭光通商	13,000	75.00	975,000	
イワキ	5,000	185.00	925,000	
兼松エレクトロニクス	1,100	1,834.00	2,017,400	
三愛石油	4,000	869.00	3,476,000	
稲畑産業	4,100	1,194.00	4,895,400	
ゴールドウイン	800	4,570.00	3,656,000	
ユニ・チャーム	37,000	2,415.00	89,355,000	

デサント	4,200	1,713.00	7,194,600	
キング	2,400	383.00	919,200	
ワキタ	3,700	825.00	3,052,500	
ヤマトインターナショナル	2,600	380.00	988,000	
東邦ホールディングス	5,500	2,327.00	12,798,500	
サンゲツ	6,200	1,950.00	12,090,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,800	557.00	1,559,600	
シナネンホールディングス	4,000	440.00	1,760,000	
伊藤忠エネクス	4,400	817.00	3,594,800	
サンリオ	5,300	2,100.00	11,130,000	
サンワ　テクノス	1,500	676.00	1,014,000	
リョーサン	2,700	2,821.00	7,616,700	
新光商事	2,000	1,030.00	2,060,000	
トーホー	800	2,212.00	1,769,600	
三信電気	2,400	837.00	2,008,800	
東陽テクニカ	2,500	1,086.00	2,715,000	
モスフードサービス	2,300	3,105.00	7,141,500	
加賀電子	1,600	1,291.00	2,065,600	
三益半導体工業	1,300	1,026.00	1,333,800	
ソーダニッカ	2,200	450.00	990,000	
立花エレテック	1,300	1,091.00	1,418,300	
木曽路	2,100	2,229.00	4,680,900	
サトレストランシステムズ	2,000	780.00	1,560,000	
千趣会	3,400	705.00	2,397,000	
ケーヨー	2,900	503.00	1,458,700	
アデランス	3,000	565.00	1,695,000	
上新電機	4,000	853.00	3,412,000	
日本瓦斯	2,000	2,080.00	4,160,000	
ベスト電器	8,300	120.00	996,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,017.00	5,849,300	
東天紅	7,000	130.00	910,000	
いなげや	1,900	1,230.00	2,337,000	
島忠	4,500	2,469.00	11,110,500	
チヨダ	2,000	2,816.00	5,632,000	
ライフコーポレーション	1,100	2,336.00	2,569,600	
リンガーハット	1,600	2,411.00	3,857,600	
ＭＲ　ＭＡＸ	3,500	285.00	997,500	
テンアライド	2,700	363.00	980,100	
ＡＯＫＩホールディングス	3,900	1,238.00	4,828,200	
オークワ	3,000	1,005.00	3,015,000	

コメリ	2,700	2,173.00	5,867,100	
青山商事	3,300	4,175.00	13,777,500	
しまむら	2,000	12,060.00	24,120,000	
高島屋	25,000	920.00	23,000,000	
松屋	3,500	850.00	2,975,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8,800	1,850.00	16,280,000	
近鉄百貨店	7,000	306.00	2,142,000	
ニッセンホールディングス	6,600	146.00	963,600	
パルコ	1,700	866.00	1,472,200	
丸井グループ	21,100	1,500.00	31,650,000	
クレディセゾン	13,100	1,854.00	24,287,400	
アクシアル　リテイリング	1,300	3,370.00	4,381,000	
イオン	70,900	1,425.50	101,067,950	
ユニーグループ・ホールディングス	16,500	749.00	12,358,500	
イズミ	3,400	4,325.00	14,705,000	
平和堂	3,500	2,095.00	7,332,500	
フジ	1,900	2,056.00	3,906,400	
ヤオコー	2,000	4,125.00	8,250,000	
ゼビオホールディングス	2,300	1,754.00	4,034,200	
ケーズホールディングス	3,600	3,480.00	12,528,000	
ＰＡＬＴＡＣ	2,800	1,739.00	4,869,200	
三谷産業	3,200	310.00	992,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,700	567.00	963,900	
新生銀行	149,000	141.00	21,009,000	
あおぞら銀行	109,000	357.00	38,913,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,382,600	477.30	659,914,980	
りそなホールディングス	201,600	389.60	78,543,360	
三井住友トラスト・ホールディングス	360,000	324.50	116,820,000	
三井住友フィナンシャルグループ	138,000	3,026.00	417,588,000	
第四銀行	22,000	368.00	8,096,000	
北越銀行	19,000	182.00	3,458,000	
西日本シティ銀行	56,000	200.00	11,200,000	
千葉銀行	66,000	538.00	35,508,000	
横浜銀行	116,000	504.20	58,487,200	
常陽銀行	62,000	385.00	23,870,000	
群馬銀行	38,000	487.00	18,506,000	
武蔵野銀行	2,700	2,894.00	7,813,800	
千葉興業銀行	4,700	447.00	2,100,900	

筑波銀行	7,200	279.00	2,008,800	
七十七銀行	27,000	402.00	10,854,000	
青森銀行	13,000	295.00	3,835,000	
秋田銀行	11,000	268.00	2,948,000	
山形銀行	10,000	377.00	3,770,000	
岩手銀行	1,200	3,705.00	4,446,000	
東邦銀行	15,000	323.00	4,845,000	
東北銀行	9,000	140.00	1,260,000	
みちのく銀行	9,000	166.00	1,494,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	75,000	352.00	26,400,000	
静岡銀行	51,000	822.00	41,922,000	
十六銀行	22,000	361.00	7,942,000	
スルガ銀行	16,400	1,820.00	29,848,000	
八十二銀行	31,000	504.00	15,624,000	
山梨中央銀行	11,000	392.00	4,312,000	
大垣共立銀行	23,000	343.00	7,889,000	
福井銀行	15,000	186.00	2,790,000	
北國銀行	19,000	277.00	5,263,000	
清水銀行	600	2,108.00	1,264,800	
富山銀行	300	2,703.00	810,900	
滋賀銀行	16,000	448.00	7,168,000	
南都銀行	17,000	301.00	5,117,000	
百五銀行	15,000	393.00	5,895,000	
京都銀行	33,000	727.00	23,991,000	
紀陽銀行	6,800	1,184.00	8,051,200	
三重銀行	8,000	191.00	1,528,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	117,000	167.00	19,539,000	
広島銀行	51,000	410.00	20,910,000	
山陰合同銀行	10,400	652.00	6,780,800	
中国銀行	12,200	1,176.00	14,347,200	
鳥取銀行	6,000	159.00	954,000	
伊予銀行	18,400	772.00	14,204,800	
百十四銀行	19,000	316.00	6,004,000	
四国銀行	13,000	207.00	2,691,000	
阿波銀行	14,000	502.00	7,028,000	
大分銀行	10,000	339.00	3,390,000	
宮崎銀行	11,000	260.00	2,860,000	
佐賀銀行	10,000	200.00	2,000,000	
十八銀行	11,000	230.00	2,530,000	
沖縄銀行	1,400	3,455.00	4,837,000	
琉球銀行	3,500	1,133.00	3,965,500	

セブン銀行	64,600	483.00	31,201,800	
みずほフィナンシャルグループ	2,427,600	166.30	403,709,880	
山口フィナンシャルグループ	16,000	1,050.00	16,800,000	
芙蓉総合リース	2,000	4,605.00	9,210,000	
興銀リース	3,200	1,885.00	6,032,000	
東京センチュリーリース	4,000	3,740.00	14,960,000	
ＳＢＩホールディングス	20,700	1,016.00	21,031,200	
日本証券金融	7,600	479.00	3,640,400	
アイフル	28,800	294.00	8,467,200	
ポケットカード	2,200	440.00	968,000	
長野銀行	6,000	176.00	1,056,000	
名古屋銀行	14,000	356.00	4,984,000	
北洋銀行	26,000	276.00	7,176,000	
愛知銀行	600	4,375.00	2,625,000	
第三銀行	10,000	140.00	1,400,000	
中京銀行	7,000	192.00	1,344,000	
東日本銀行	8,000	271.00	2,168,000	
大光銀行	6,000	190.00	1,140,000	
愛媛銀行	10,000	208.00	2,080,000	
トマト銀行	7,000	146.00	1,022,000	
みなと銀行	16,000	152.00	2,432,000	
京葉銀行	14,000	420.00	5,880,000	
関西アーバン銀行	2,400	1,045.00	2,508,000	
栃木銀行	9,000	418.00	3,762,000	
北日本銀行	500	2,609.00	1,304,500	
東和銀行	24,000	81.00	1,944,000	
福島銀行	21,000	71.00	1,491,000	
大東銀行	10,000	177.00	1,770,000	
リコーリース	1,400	3,170.00	4,438,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,300	2,500.00	28,250,000	
アコム	34,600	468.00	16,192,800	
ジャックス	10,000	375.00	3,750,000	
オリエントコーポレーション	74,500	191.00	14,229,500	
日立キャピタル	4,100	2,371.00	9,721,100	
アプラスフィナンシャル	11,000	87.00	957,000	
オリックス	122,000	1,429.50	174,399,000	
三菱ＵＦＪリース	43,700	481.00	21,019,700	
ジャフコ	2,900	3,175.00	9,207,500	
トモニホールディングス	13,200	331.00	4,369,200	
大和証券グループ本社	161,000	671.80	108,159,800	
野村ホールディングス	331,600	494.10	163,843,560	

岡三証券グループ	15,000	532.00	7,980,000	
丸三証券	5,100	1,199.00	6,114,900	
東洋証券	7,000	289.00	2,023,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,800	523.00	10,355,400	
光世証券	4,000	138.00	552,000	
水戸証券	5,300	323.00	1,711,900	
いちよし証券	3,900	1,078.00	4,204,200	
松井証券	8,800	963.00	8,474,400	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	38,300	3,075.00	117,772,500	
日本取引所グループ	50,600	1,729.00	87,487,400	
マネックスグループ	20,300	283.00	5,744,900	
カブドットコム証券	15,300	330.00	5,049,000	
極東証券	2,300	1,327.00	3,052,100	
岩井コスモホールディングス	1,600	1,055.00	1,688,000	
藍澤證券	2,400	564.00	1,353,600	
フィデアホールディングス	10,600	172.00	1,823,200	
池田泉州ホールディングス	18,300	387.00	7,082,100	
アニコム　ホールディングス	1,100	2,493.00	2,742,300	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	51,500	2,972.00	153,058,000	
マネースクウェアＨＤ	1,000	995.00	995,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	16,500	1,552.00	25,608,000	
マネーパートナーズグループ	3,200	308.00	985,600	
第一生命保険	110,400	1,306.00	144,182,400	
東京海上ホールディングス	69,800	3,791.00	264,611,800	
イー・ギャランティ	600	2,161.00	1,296,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	700	1,547.00	1,082,900	
Ｔ＆Ｄホールディングス	62,800	1,116.50	70,116,200	
三井不動産	91,000	2,652.00	241,332,000	
三菱地所	128,000	2,144.50	274,496,000	
平和不動産	3,300	1,184.00	3,907,200	
東京建物	18,900	1,327.00	25,080,300	
ダイビル	4,400	931.00	4,096,400	
京阪神ビルディング	2,900	571.00	1,655,900	
住友不動産	41,000	3,085.00	126,485,000	
大京	33,000	182.00	6,006,000	
テーオーシー	6,700	901.00	6,036,700	
東京楽天地	3,000	473.00	1,419,000	
レオパレス２１	20,300	668.00	13,560,400	

スターツコーポレーション	2,000	2,307.00	4,614,000	
フジ住宅	2,200	678.00	1,491,600	
空港施設	2,100	499.00	1,047,900	
明和地所	1,500	644.00	966,000	
住友不動産販売	1,300	2,135.00	2,775,500	
ゴールドクレスト	1,400	1,616.00	2,262,400	
リロ・ホールディング	700	12,850.00	8,995,000	
日本エスリード	900	1,037.00	933,300	
日神不動産	2,700	359.00	969,300	
タカラレーベン	7,600	595.00	4,522,000	
サンヨーハウジング名古屋	1,000	1,015.00	1,015,000	
イオンモール	11,200	1,589.00	17,796,800	
ファースト住建	800	1,285.00	1,028,000	
東祥	500	3,945.00	1,972,500	
トーセイ	2,600	650.00	1,690,000	
穴吹興産	4,000	246.00	984,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,800	1,096.00	11,836,800	
サンフロンティア不動産	2,100	1,005.00	2,110,500	
エフ・ジェー・ネクスト	2,000	497.00	994,000	
ランドビジネス	3,500	286.00	1,001,000	
グランディハウス	2,600	364.00	946,400	
東武鉄道	93,000	600.00	55,800,000	
相鉄ホールディングス	30,000	701.00	21,030,000	
東京急行電鉄	102,000	954.00	97,308,000	
京浜急行電鉄	48,000	1,015.00	48,720,000	
小田急電鉄	56,000	1,369.00	76,664,000	
京王電鉄	49,000	1,077.00	52,773,000	
京成電鉄	26,000	1,653.00	42,978,000	
富士急行	5,000	1,233.00	6,165,000	
新京成電鉄	2,000	419.00	838,000	
東日本旅客鉄道	31,900	9,953.00	317,500,700	
西日本旅客鉄道	16,800	6,814.00	114,475,200	
東海旅客鉄道	15,600	20,755.00	323,778,000	
西武ホールディングス	13,900	2,355.00	32,734,500	
鴻池運輸	2,500	1,274.00	3,185,000	
西日本鉄道	23,000	838.00	19,274,000	
ハマキョウレックス	1,300	1,828.00	2,376,400	
サカイ引越センター	700	2,673.00	1,871,100	
近鉄グループホールディングス	176,000	490.00	86,240,000	
阪急阪神ホールディングス	117,000	722.00	84,474,000	
南海電気鉄道	39,000	672.00	26,208,000	

京阪電気鉄道	39,000	789.00	30,771,000	
神戸電鉄	4,000	355.00	1,420,000	
名古屋鉄道	64,000	554.00	35,456,000	
山陽電気鉄道	6,000	455.00	2,730,000	
トランコム	500	6,340.00	3,170,000	
日本通運	68,000	516.00	35,088,000	
ヤマトホールディングス	32,300	2,366.50	76,437,950	
山九	23,000	528.00	12,144,000	
日新	7,000	275.00	1,925,000	
丸全昭和運輸	6,000	399.00	2,394,000	
センコー	8,000	711.00	5,688,000	
トナミホールディングス	4,000	258.00	1,032,000	
ニッコンホールディングス	5,700	1,959.00	11,166,300	
日本石油輸送	4,000	240.00	960,000	
福山通運	11,000	534.00	5,874,000	
セイノーホールディングス	12,400	1,198.00	14,855,200	
神奈川中央交通	2,000	685.00	1,370,000	
日立物流	3,600	1,731.00	6,231,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,700	848.00	1,441,600	
日本郵船	157,000	213.00	33,441,000	
商船三井	86,000	209.00	17,974,000	
川崎汽船	77,000	189.00	14,553,000	
ＮＳユナイテッド海運	8,000	152.00	1,216,000	
飯野海運	9,100	430.00	3,913,000	
日本航空	33,400	4,192.00	140,012,800	
ＡＮＡホールディングス	324,000	325.90	105,591,600	
パスコ	2,000	411.00	822,000	
三菱倉庫	12,000	1,493.00	17,916,000	
三井倉庫ホールディングス	10,000	273.00	2,730,000	
住友倉庫	13,000	550.00	7,150,000	
澁澤倉庫	5,000	276.00	1,380,000	
ヤマタネ	8,000	160.00	1,280,000	
乾汽船	1,400	768.00	1,075,200	
日本トランスシティ	4,000	353.00	1,412,000	
ケイヒン	7,000	145.00	1,015,000	
中央倉庫	1,100	912.00	1,003,200	
安田倉庫	1,400	697.00	975,800	
東洋埠頭	7,000	144.00	1,008,000	
宇徳	3,000	313.00	939,000	
上組	21,000	1,050.00	22,050,000	
キユーソー流通システム	500	2,074.00	1,037,000	

郵船ロジスティクス	1,600	1,204.00	1,926,400	
近鉄エクスプレス	3,100	1,494.00	4,631,400	
エーアイテイー	1,000	1,014.00	1,014,000	
内外トランスライン	700	897.00	627,900	
東京放送ホールディングス	10,300	1,762.00	18,148,600	
日本テレビホールディングス	15,700	1,976.00	31,023,200	
朝日放送	1,700	684.00	1,162,800	
テレビ朝日ホールディングス	4,700	2,024.00	9,512,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	13,100	683.00	8,947,300	
テレビ東京ホールディングス	1,600	1,847.00	2,955,200	
コネクシオ	1,500	1,077.00	1,615,500	
日本通信	9,100	171.00	1,556,100	
日本電信電話	133,200	4,812.00	640,958,400	
ＫＤＤＩ	175,100	3,013.00	527,576,300	
光通信	2,100	7,780.00	16,338,000	
ＮＴＴドコモ	132,900	2,642.00	351,121,800	
エムティーアイ	2,200	735.00	1,617,000	
ＧＭＯインターネット	6,400	1,218.00	7,795,200	
カドカワ	5,400	1,812.00	9,784,800	
学研ホールディングス	6,000	237.00	1,422,000	
ゼンリン	2,300	1,852.00	4,259,600	
昭文社	1,600	626.00	1,001,600	
インプレスホールディングス	7,800	125.00	975,000	
東京電力	148,100	560.00	82,936,000	
中部電力	53,400	1,428.50	76,281,900	
関西電力	71,200	1,236.00	88,003,200	
中国電力	24,100	1,518.00	36,583,800	
北陸電力	17,100	1,640.00	28,044,000	
東北電力	43,600	1,458.00	63,568,800	
四国電力	15,700	1,625.00	25,512,500	
九州電力	38,600	1,086.00	41,919,600	
北海道電力	16,300	967.00	15,762,100	
沖縄電力	1,900	2,781.00	5,283,900	
電源開発	14,900	3,450.00	51,405,000	
イーレックス	300	1,664.00	499,200	
東京瓦斯	195,000	540.90	105,475,500	
大阪瓦斯	181,000	441.60	79,929,600	
東邦瓦斯	44,000	795.00	34,980,000	
北海道瓦斯	4,000	274.00	1,096,000	
広島ガス	3,000	405.00	1,215,000	

西部瓦斯	20,000	254.00	5,080,000	
静岡ガス	5,000	724.00	3,620,000	
メタウォーター	1,100	2,384.00	2,622,400	
アイネット	1,000	1,090.00	1,090,000	
松竹	11,000	1,020.00	11,220,000	
東宝	12,300	2,816.00	34,636,800	
エイチ・アイ・エス	3,000	3,260.00	9,780,000	
東映	6,000	879.00	5,274,000	
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	1,000	1,004.00	1,004,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	10,600	5,620.00	59,572,000	
共立メンテナンス	1,400	8,500.00	11,900,000	
イチネンホールディングス	1,900	905.00	1,719,500	
建設技術研究所	1,100	914.00	1,005,400	
スペース	1,000	1,239.00	1,239,000	
アインホールディングス	2,100	4,945.00	10,384,500	
東京テアトル	8,000	117.00	936,000	
ナガワ	300	2,730.00	819,000	
よみうりランド	4,000	419.00	1,676,000	
東京都競馬	12,000	212.00	2,544,000	
常磐興産	7,000	149.00	1,043,000	
カナモト	2,500	2,479.00	6,197,500	
東京ドーム	15,000	521.00	7,815,000	
ＤＴＳ	1,900	2,089.00	3,969,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	2,920.00	21,316,000	
シーイーシー	1,100	1,093.00	1,202,300	
カプコン	4,400	2,404.00	10,577,600	
西尾レントオール	1,500	2,598.00	3,897,000	
日本空港ビルデング	5,500	4,010.00	22,055,000	
トランス・コスモス	2,100	2,419.00	5,079,900	
乃村工藝社	3,900	1,433.00	5,588,700	
ジャステック	1,100	914.00	1,005,400	
ＳＣＳＫ	4,100	4,380.00	17,958,000	
藤田観光	7,000	552.00	3,864,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,000	170.00	1,530,000	
日本管財	1,600	1,756.00	2,809,600	
トーカイ	800	3,070.00	2,456,000	
セコム	19,000	8,120.00	154,280,000	
セントラル警備保障	800	2,114.00	1,691,200	
アイネス	2,400	1,089.00	2,613,600	
丹青社	3,400	670.00	2,278,000	

メイテック	2,300	3,980.00	9,154,000	
ＴＫＣ	1,600	3,145.00	5,032,000	
アサツー　ディ・ケイ	3,200	2,859.00	9,148,800	
富士ソフト	2,600	2,335.00	6,071,000	
応用地質	1,900	1,224.00	2,325,600	
船井総研ホールディングス	2,500	1,399.00	3,497,500	
ＮＳＤ	3,700	1,658.00	6,134,600	
進学会	1,600	622.00	995,200	
コナミホールディングス	7,800	2,844.00	22,183,200	
ベネッセホールディングス	6,100	3,535.00	21,563,500	
イオンディライト	1,800	3,635.00	6,543,000	
ナック	1,200	834.00	1,000,800	
福井コンピュータホールディングス	1,000	1,008.00	1,008,000	
ニチイ学館	3,200	789.00	2,524,800	
ダイセキ	3,400	1,757.00	5,973,800	
日鉄住金物産	11,000	336.00	3,696,000	
元気寿司	500	2,143.00	1,071,500	
トラスコ中山	2,000	3,910.00	7,820,000	
ヤマダ電機	52,400	518.00	27,143,200	
オートバックスセブン	6,600	1,945.00	12,837,000	
アークランドサカモト	2,900	1,035.00	3,001,500	
ニトリホールディングス	7,400	8,420.00	62,308,000	
グルメ杵屋	1,000	996.00	996,000	
愛眼	4,700	209.00	982,300	
吉野家ホールディングス	6,400	1,429.00	9,145,600	
加藤産業	2,700	2,722.00	7,349,400	
イノテック	2,200	440.00	968,000	
イエローハット	1,600	1,900.00	3,040,000	
松屋フーズ	800	2,812.00	2,249,600	
ＪＢＣＣホールディングス	1,500	636.00	954,000	
ＪＫホールディングス	2,100	456.00	957,600	
サガミチェーン	2,300	1,216.00	2,796,800	
日伝	700	2,817.00	1,971,900	
関西スーパーマーケット	1,400	773.00	1,082,200	
ミロク情報サービス	1,300	917.00	1,192,100	
北沢産業	6,100	162.00	988,200	
杉本商事	1,000	1,260.00	1,260,000	
因幡電機産業	2,400	3,445.00	8,268,000	
王将フードサービス	1,300	3,910.00	5,083,000	
プレナス	1,900	1,953.00	3,710,700	

ミニストップ	1,300	2,039.00	2,650,700	
アークス	3,200	2,299.00	7,356,800	
バローホールディングス	3,700	2,417.00	8,942,900	
バイテックホールディングス	1,000	950.00	950,000	
ミスミグループ本社	19,300	1,545.00	29,818,500	
藤久	600	1,713.00	1,027,800	
ベルク	800	3,815.00	3,052,000	
大　庄	800	1,432.00	1,145,600	
タキヒヨー	3,000	460.00	1,380,000	
ファーストリテイリング	3,500	31,760.00	111,160,000	
ソフトバンクグループ	97,600	5,095.00	497,272,000	
スズケン	7,800	3,715.00	28,977,000	
サンドラッグ	3,600	7,560.00	27,216,000	
サックスバー　ホールディングス	1,600	1,498.00	2,396,800	
ジェコス	1,200	895.00	1,074,000	
やまや	100	1,870.00	187,000	
ルネサスイーストン	2,400	410.00	984,000	
ベルーナ	4,300	504.00	2,167,200	
合計	28,896,700		33,569,060,310	

② 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（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】

「＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド」　（平成28年3月31日現在）

Ⅰ　資産総額	3,321,822,963円
Ⅱ　負債総額	13,573,377円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,308,249,586円
Ⅳ　発行済数量	3,906,089,042口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8469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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行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

①　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。

②　前記①の申請のある場合には、前記①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①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。

③　前記①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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

平成28年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　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。

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年3月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	291	46,807
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	45	8,477
単位型公社債投資信託	4	196
合計	340	55,481

○　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して記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

３【委託会社等の経理状況】

１．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

(2)　当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

２．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第20期事業年度（自平成26年4月1日　至平成27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21期事業年度に係る中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 （平成26年3月31日）		当事業年度 （平成27年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,509,845		3,488,730
有価証券		7,325,806		5,209,385
前払費用		207,351		499,710
未収委託者報酬		1,897,225		2,778,650
未収運用受託報酬		1,419,102		1,519,030
未収投資助言報酬		190,027		216,814
繰延税金資産		406,503		417,418
その他		26,376		52,788
流動資産合計		12,982,239		14,182,529
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	102,335	※1	88,529
車両	※1	1,009	※1	588
器具備品	※1	105,718	※1	90,111

有形固定資産合計	209,063	179,229
無形固定資産		
ソフトウェア	949,954	854,449
ソフトウェア仮勘定	28,053	17,421
その他	8,107	8,075
無形固定資産合計	986,115	879,946
投資その他の資産		
投資有価証券	31,159,584	35,677,217
関係会社株式	66,222	66,222
長期前払費用	-	175,262
差入保証金	284,888	284,888
繰延税金資産	160,839	-
その他	17	17
投資その他の資産合計	31,671,552	36,203,608
固定資産合計	32,866,731	37,262,784
資産合計	45,848,971	51,445,314
負債の部		
流動負債		
預り金	29,930	33,209
未払償還金	137,842	137,094
未払手数料	711,826	995,185
未払運用委託報酬	508,934	655,766
未払投資助言報酬	310,490	410,223
その他未払金	248,117	324,326
未払費用	79,355	97,490
未払法人税等	1,283,286	1,556,244
賞与引当金	769,569	787,638
その他	168,940	498,615
流動負債合計	4,248,293	5,495,794
固定負債		
退職給付引当金	1,106,561	1,253,790
役員退職慰労引当金	19,950	25,400

繰延税金負債	-	13,483
固定負債合計	1,126,511	1,292,673
負債合計	5,374,805	6,788,467
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	20,276,469	23,998,814
利益剰余金合計	20,956,276	24,678,621
株主資本合計	39,238,116	42,960,461
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,236,049	1,696,385
評価・換算差額等合計	1,236,049	1,696,385
純資産合計	40,474,166	44,656,846
負債・純資産合計	45,848,971	51,445,314

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 （自　平成25年4月１日 至　平成26年3月31日）	当事業年度 （自　平成26年4月1日 至　平成27年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	12,436,743	15,670,934
運用受託報酬	6,674,387	7,825,480
投資助言報酬	791,350	872,448
業務受託料	47,100	47,100

営業収益計		19,949,580		24,415,963
営業費用				
支払手数料		5,367,041		6,834,391
広告宣伝費		13,397		28,551
公告費		161		-
調査費		3,767,832		4,581,959
支払運用委託報酬		1,587,647		1,811,448
支払投資助言報酬		1,228,668		1,722,179
委託調査費		66,025		80,518
調査費		885,490		967,812
委託計算費		128,890		148,832
営業雑経費		538,997		581,870
通信費		55,199		53,825
印刷費		147,275		170,610
協会費		20,172		21,379
その他営業雑経費		316,349		336,053
営業費用計		9,816,320		12,175,604
一般管理費				
役員報酬	※1	63,866	※1	62,272
給料・手当		2,906,149		2,905,979
賞与引当金繰入額		766,843		782,365
賞与		248,914		237,611
福利厚生費		569,577		532,618
退職給付費用		241,558		283,064
役員退職慰労引当金繰入額		7,300		7,250
その他人件費		97,103		101,498
不動産賃借料		574,467		544,587
その他不動産経費		26,330		25,737
交際費		14,005		20,059
旅費交通費		79,754		100,791
固定資産減価償却費		511,498		440,227
租税公課		93,822		104,874
業務委託費		208,262		194,856
器具備品費		143,717		156,991
保守料		83,044		-
保険料		59,043		56,700
諸経費		48,305		135,187
一般管理費計		6,743,562		6,692,676

営業利益		3,389,697		5,547,682
営業外収益				
受取利息		166		274
有価証券利息		76,250		70,792
受取配当金	※4	81,042	※4	177,354
為替差益		20,176		31,164
その他営業外収益		13,559		6,906
営業外収益計		191,194		286,492
営業外費用				
控除対象外消費税		4,451		19,444
その他営業外費用		1,182		6,244
営業外費用計		5,634		25,689
経常利益		3,575,257		5,808,485
特別利益				
投資有価証券売却益		1,377		366,068
投資有価証券償還益		102,298		15,343
特別利益計		103,675		381,411
特別損失				
投資有価証券償還損		6,903		-
固定資産除却損	※3	8,924	※3	8,042
事故損失賠償金	※2	2,387	※2	25,550
寄付金		142,550		-
特別損失計		160,764		33,593
税引前当期純利益		3,518,168		6,156,304
法人税、住民税及び事業税		1,474,066		2,284,237
法人税等調整額		△95,320		14,162
法人税等合計		1,378,745		2,298,400
当期純利益		2,139,422		3,857,904

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自　平成25年4月１日　至　平成26年3月31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	18,272,607	18,952,414	37,234,254
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△135,560	△135,560	△135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	2,139,422	2,139,422	2,139,422
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,003,862	2,003,862	2,003,862
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	846,135	846,135	38,080,390
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△135,560
当期純利益	-	-	2,139,422
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	389,913	389,913	389,913
当期変動額合計	389,913	389,913	2,393,775
当期末残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166

当事業年度(自 平成26年4月１日　至 平成27年3月31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	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△135,560	△135,560	△135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△135,560
当期純利益	-	-	3,857,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	460,336	460,336	460,336
当期変動額合計	460,336	460,336	4,182,680
当期末残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846

注記事項
（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自　平成26年4月1日 至　平成27年3月31日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①　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。 ②　その他有価証券 時価のあるもの …決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

	時価のないもの …移動平均法に基づく原価法によっております。 ③　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。
２．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
３．引当金の計上基準	①　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。 ②　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。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。 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。 ③　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。
４．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
５．リース取引の処理方法	平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
６．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。

（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 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
建物	254,648千円	272,378千円
車両	6,004	6,425
器具備品	520,399	481,704
計	781,053	760,508

（損益計算書関係）

※１．役員報酬の限度額は以下のとおりであります。

取締役	180,000千円
監査役	40,000千円

※２．事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。

※３．固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成25年4月 1日 至　平成26年3月31日）	当事業年度 (自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日)
器具備品	8,924千円	4,128千円
その他	―	3,914
計	8,924	8,042

※４．関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 （自　平成25年4月 1日 至　平成26年3月31日）	当事業年度 (自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日)
関係会社からの受取配当金	―	41,126千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26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

①配当金支払額

平成25年6月24日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

平成26年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	1,250円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

当事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27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

①配当金支払額

平成26年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
１株当たり配当額	1,250円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

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

平成27年6月25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	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	1,250円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月25日

（リース取引関係）

１．ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

① リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額　（単位：千円）

	前事業年度（平成26年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	762	100

（単位：千円）

	当事業年度（平成27年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	―	―	―

② 未経過リース料期末残高相当額等　（単位：千円）

	前事業年度 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
１年内	107	―
１年超	―	―

合計	107	―

③ 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額　(単位：千円)

	前事業年度 （自　平成25年4月１日 至　平成26年3月31日）	当事業年度 （自　平成26年4月１日 至　平成27年3月31日）
支払リース料	186	108
減価償却費相当額	172	100
支払利息相当額	6	1

④ 減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

⑤ 利息相当額の算定方法

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

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）　(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
①　現金・預金	1,509,845	1,509,845	―
②　有価証券			
満期保有目的の債券	4,626,076	4,632,360	6,283
その他有価証券	2,699,730	2,699,730	―
③　投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,227,190	23,299,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	―

当事業年度（平成27年3月31日）　(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
①　現金・預金	3,488,730	3,488,730	―

②　有価証券			
満期保有目的の債券	5,209,385	5,215,010	5,624
③　投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,414,879	22,498,520	83,640
その他有価証券	13,194,837	13,194,837	―

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

①現金・預金

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

②有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
非上場株式	67,500	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、「③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(平成26年3月31日)

	１年以内 (千円)	１年超 ５年以内 (千円)	５年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,509,845	―	―	―
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,600,000	23,200,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	4,888,361	3,035,620	1,624,417	3,044
合計	10,998,206	26,235,620	1,624,417	3,044

（注）投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

当事業年度(平成27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	3,488,730	―	―	―

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	5,200,000	22,400,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

（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（平成26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	26,554,298	26,634,680	80,381
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	26,554,298	26,634,680	80,381
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	1,298,967	1,297,400	△1,567
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	1,298,967	1,297,400	△1,567
合計		27,853,266	27,932,080	78,813

当事業年度（平成27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	26,620,113	26,710,130	90,016
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	26,620,113	26,710,130	90,016
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	1,004,151	1,003,400	△751
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	1,004,151	1,003,400	△751
合計		27,624,265	27,713,530	89,264

２．その他有価証券

前事業年度（平成26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	1,799,820	1,799,764	55
	①国債・地方債等	1,799,820	1,799,764	55
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	7,295,640	5,502,350	1,793,290
	小計	9,095,460	7,302,114	1,793,345
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	899,910	899,912	△2
	①国債・地方債等	899,910	899,912	△2
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	569,254	583,000	△13,745
	小計	1,469,164	1,482,912	△13,748
合計		10,564,624	8,785,027	1,779,597

当事業年度（平成27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	3,113,940	3,105,255	8,684
	①国債・地方債等	3,113,940	3,105,255	8,684
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	7,809,441	5,421,939	2,387,501
	小計	10,923,381	8,527,195	2,396,186
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	1,900,070	1,902,293	△2,223
	①国債・地方債等	1,900,070	1,902,293	△2,223
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	371,386	376,170	△4,783
	小計	2,271,456	2,278,463	△7,006
合計		13,194,837	10,805,658	2,389,179

（注１）投資信託受益証券等であります。

（注２）非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円）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（当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、前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（自平成25年4月1日　至平成26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	256,377	1,377	－
合計	256,377	1,377	－

当事業年度（自平成26年4月1日　至平成27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	1,249,329	366,068	－
合計	1,249,329	366,068	－

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26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す。

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	929,869 千円
退職給付費用	212,344
退職給付の支払額	△35,652
退職給付引当金の期末残高	1,106,561

（２）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	212,344 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、44,191千円であります。

当事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27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す。

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	1,106,561 千円
退職給付費用	215,268
退職給付の支払額	△68,039
退職給付引当金の期末残高	1,253,790

（２）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	215,268 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、44,254千円であります。

（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 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	274,274 千円	260,708 千円
未払事業税	98,319	120,645
その他	33,928	36,064
繰延税金資産合計	406,523	417,418
繰延税金負債		
有価証券評価差額	19	―
繰延税金負債合計	19	―
繰延税金資産の純額	406,503	417,418
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	394,378	405,952

税務上の繰延資産償却超過額	7,110	4,573
役員退職慰労引当金	3,835	8,214
投資有価証券評価損	486,598	406,043
投資有価証券評価差額	4,898	2,266
その他	2,461	1,703
小計	899,283	828,753
評価性引当額	△97,929	△90,623
繰延税金資産合計	801,354	738,130
繰延税金負債		
特別分配金否認	92,089	56,555
投資有価証券評価差額	548,424	695,058
繰延税金負債合計	640,514	751,613
繰延税金資産(△は負債)の純額	160,839	△13,483

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度 （平成26年3月31日）		当事業年度 （平成27年3月31日）	
法定実効税率	38.01 %	法定実効税率	35.64 %
（調整）		（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.15	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09
住民税均等割	0.17	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.26
税率変更に伴う影響	0.98	住民税均等割	0.09
特定外国子会社留保金課税	0.67	税率変更に伴う影響	1.63
所得拡大促進税制による特別控除額	△0.60	特定外国子会社留保金課税	0.44
その他	△0.20	所得拡大促進税制による特別控除額	△0.37
税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.19	その他	0.06
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第2号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%に、それぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が32,758千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が100,766千円、その他有価証券評価差額金が68,007千円、それぞれ増加しております。

（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（自平成25年4月1日　至平成26年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	3,851,374

当事業年度（自平成26年4月1日　至平成27年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益

日本生命保険相互会社	4,553,051

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]
該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]
該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]
該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1　関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成25年4月１日　至平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,139,318	未収運用受託報酬	738,331
								投資助言報酬の受取	664,956	未収投資助言報酬	151,082
								業務受託料の受取	47,100	-	-

当事業年度（自平成26年4月１日　至平成27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	200,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,829,599	未収運用受託報酬	767,087
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,782
								業務受託料の受取	47,100	-	-

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、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　平成25年4月１日　至　平成26年3月31日）	当事業年度（自　平成26年4月１日　至　平成27年3月31日）
１株当たり純資産額	373,212円65銭	411,781円19銭
１株当たり当期純利益金額	19,727円63銭	35,573円77銭

（注）　１．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成25年4月１日 至　平成26年3月31日）	当事業年度 （自　平成26年4月１日 至　平成27年3月31日）
当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
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21期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,317,001
有価証券		6,604,052
前払費用		575,114
未収委託者報酬		3,182,655
未収運用受託報酬		1,977,949
未収投資助言報酬		213,262
繰延税金資産		285,665
その他		70,176
流動資産合計		17,225,876
固定資産		
有形固定資産	※1	180,828
無形固定資産		847,760
投資その他の資産		
投資有価証券		35,274,476
関係会社株式		66,222
長期前払費用		25,037
差入保証金		285,623
繰延税金資産		225,874

その他		1,283
投資その他の資産合計		35,878,518
固定資産合計		36,907,107
資産合計		54,132,984
負債の部		
流動負債		
預り金		31,701
未払収益分配金		241
未払償還金		134,963
未払手数料		1,143,638
未払運用委託報酬		776,102
未払投資助言報酬		492,881
その他未払金		208,263
未払費用		154,443
未払法人税等		1,562,061
前受投資助言報酬		47,034
賞与引当金		443,027
その他	※2	290,439
流動負債合計		5,284,799
固定負債		
退職給付引当金		1,340,851
役員退職慰労引当金		24,275
固定負債合計		1,365,126
負債合計		6,649,926
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		

利益準備金	139,807
その他利益剰余金	27,810,746
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	27,270,746
利益剰余金合計	27,950,553
株主資本合計	46,232,393
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,250,664
評価・換算差額等合計	1,250,664
純資産合計	47,483,058
負債・純資産合計	54,132,984

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第21期中間会計期間 （自平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		11,359,993
運用受託報酬		4,591,997
投資助言報酬		445,992
営業収益計		16,397,983
営業費用		8,169,317
一般管理費	※1	3,442,615
営業利益		4,786,050
営業外収益	※2	181,075
営業外費用	※3	15,447
経常利益		4,951,678
特別利益	※4	79,133
特別損失	※5	6,385
税引前中間純利益		5,024,426
法人税、住民税及び事業税		1,506,995
法人税等調整額		109,937
法人税等合計		1,616,933

中間純利益	3,407,492

(3)中間株主資本等変動計算書

第21期中間会計期間(自 平成27年4月１日　至 平成27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	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△135,560	△135,560	△135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,407,492	3,407,492	3,407,492
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	-	-	-	-	-	-	-	3,271,932	3,271,932	3,271,932
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	27,270,746	27,950,553	46,232,393

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△135,560
中間純利益	-	-	3,407,492
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△445,720	△445,720	△445,720
当中間期変動額合計	△445,720	△445,720	2,826,211
当中間期末残高	1,250,664	1,250,664	47,483,058

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第21期中間会計期間 （自　平成27年4月1日 至　平成27年9月30日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①　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。 ②　その他有価証券 時価のあるもの …中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 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。 ③　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。
２．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
３．引当金の計上基準	①　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。 ②　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。 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。 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。 ③　役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
４．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。
５．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。

（中間貸借対照表関係）

第21期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）	
※１．有形固定資産の減価償却累計額	726,224千円
※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21期中間会計期間 （自　平成27年4月1日 至　平成27年9月30日）	
※１．減価償却の実施額	
有形固定資産	21,451千円
無形固定資産	169,933千円
※２．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	139,966千円
有価証券利息	33,571千円
受取利息	267千円
※３．営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,471千円
控除対象外消費税	6,477千円
※４．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	66,441千円
投資有価証券償還益	7,081千円
事故受取保険金	5,609千円
※５．特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	6,192千円
投資有価証券売却損	193千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第21期中間会計期間 （自　平成27年4月1日 至　平成27年9月30日）
１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月25日定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成27年3月31日	平成27年6月25日

（金融商品関係）
第21期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）
金融商品の時価等に関する事項
平成27年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（注2参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
①現金・預金	4,317,001	4,317,001	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	6,604,052	6,618,590	14,537
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,416,134	22,498,420	82,285
その他有価証券	12,790,842	12,790,842	―

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項
①現金・預金
短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
②有価証券
中間決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券
中間決算日の市場価格等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品
非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「③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（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21期中間会計期間末（平成27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	29,020,186	29,117,010	96,823
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	29,020,186	29,117,010	96,823
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	―	―	―
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	―	―	―
合計		29,020,186	29,117,010	96,823

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	5,810,267	5,829,720	19,452
	①国債・地方債等	5,810,267	5,829,720	19,452
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注1）	4,312,989	6,138,058	1,825,069
	小計	10,123,256	11,967,778	1,844,522
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	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注1）	941,670	823,064	△118,606
	小計	941,670	823,064	△118,606

合計	11,064,926	12,790,842	1,725,916

（注1）投資信託受益証券等であります。
（注2）非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、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（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。

（デリバティブ取引関係）
第21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27年9月30日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）
[セグメント情報]
第21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27年9月30日）
１．サービスごとの情報
当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

（２）有形固定資産
当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,076,382

[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21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第21期中間会計期間 （自平成27年4月１日 至平成27年9月30日）
1株当たり純資産額	437,841円71銭
1株当たり中間純利益金額	31,420円52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	3,407,492千円
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	3,407,492千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）
第21期中間会計期間（自平成27年4月1日　至平成27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。

① 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)。

② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、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)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤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。

④ 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。

⑤ 上記③④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】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

平成27年9月末現在、324,279百万円

ｃ．事業の内容

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

（参考）再信託受託会社の概況

ａ．名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

平成27年9月末現在、10,000百万円

ｃ．事業の内容

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

（２）販売会社

(平成27年9月末現在)

ａ．名称	ｂ．資本金の額	ｃ．事業の内容
フィデリティ証券株式会社	7,007百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	47,937百万円	

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

平成27年9月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

３【資本関係】

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に際しては、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。

・　商品内容・販売会社に関するお問合せや、資料のご請求などを委託会社のコールセンターで承っております。

・　基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。

なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。

コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（午前９時～午後５時　土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ　　http://www.nam.co.jp/

（４）目論見書に以下の内容を記載することがあります。

投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。

（５）目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 ２ 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

（６）目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。

（７）目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成２７年６月５日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　小暮和敏　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　大竹　新　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成２６年４月１日から平成２７年３月３１日までの第２０期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成２７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．ＸＢＲＬ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

平成２８年４月７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　　松崎雅則　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンドの平成２７年４月２７日から平成２８年２月２２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、＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンドの平成２８年２月２２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．ＸＢＲＬ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

平成２７年１１月３０日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　小暮和敏　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　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、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成２７年４月１日から平成２８年３月３１日までの第２１期事業年度の中間会計期間（平成２７年４月１日から平成２７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平成２７年９月３０日現在の財政状態及び同日を

もって終了する中間会計期間（平成２７年４月１日から平成２７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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。