【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】	2017年5月19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：2017年5月20日（土）～ 2017年11月20日（月）
○ 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

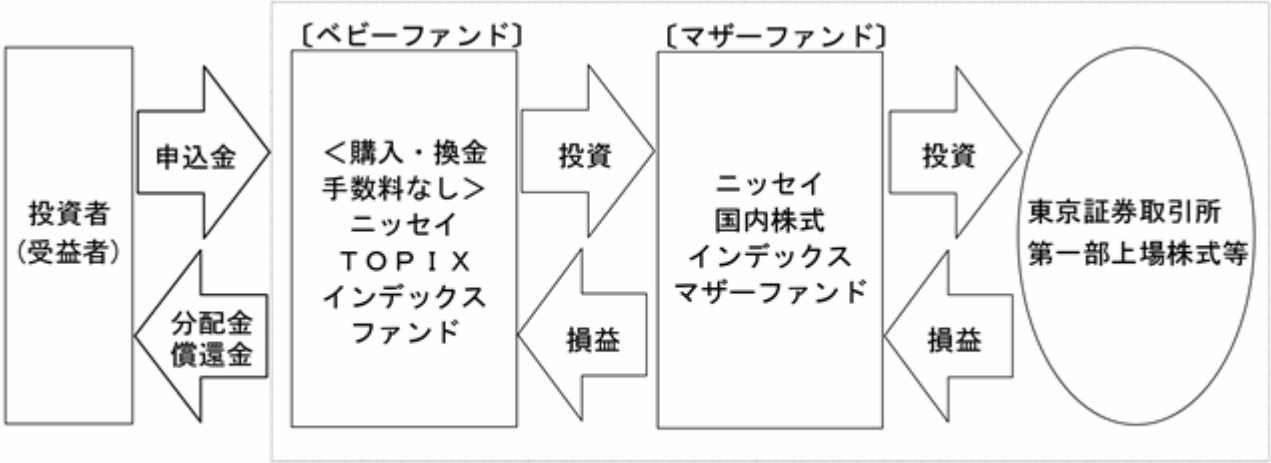
ファンドは、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

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

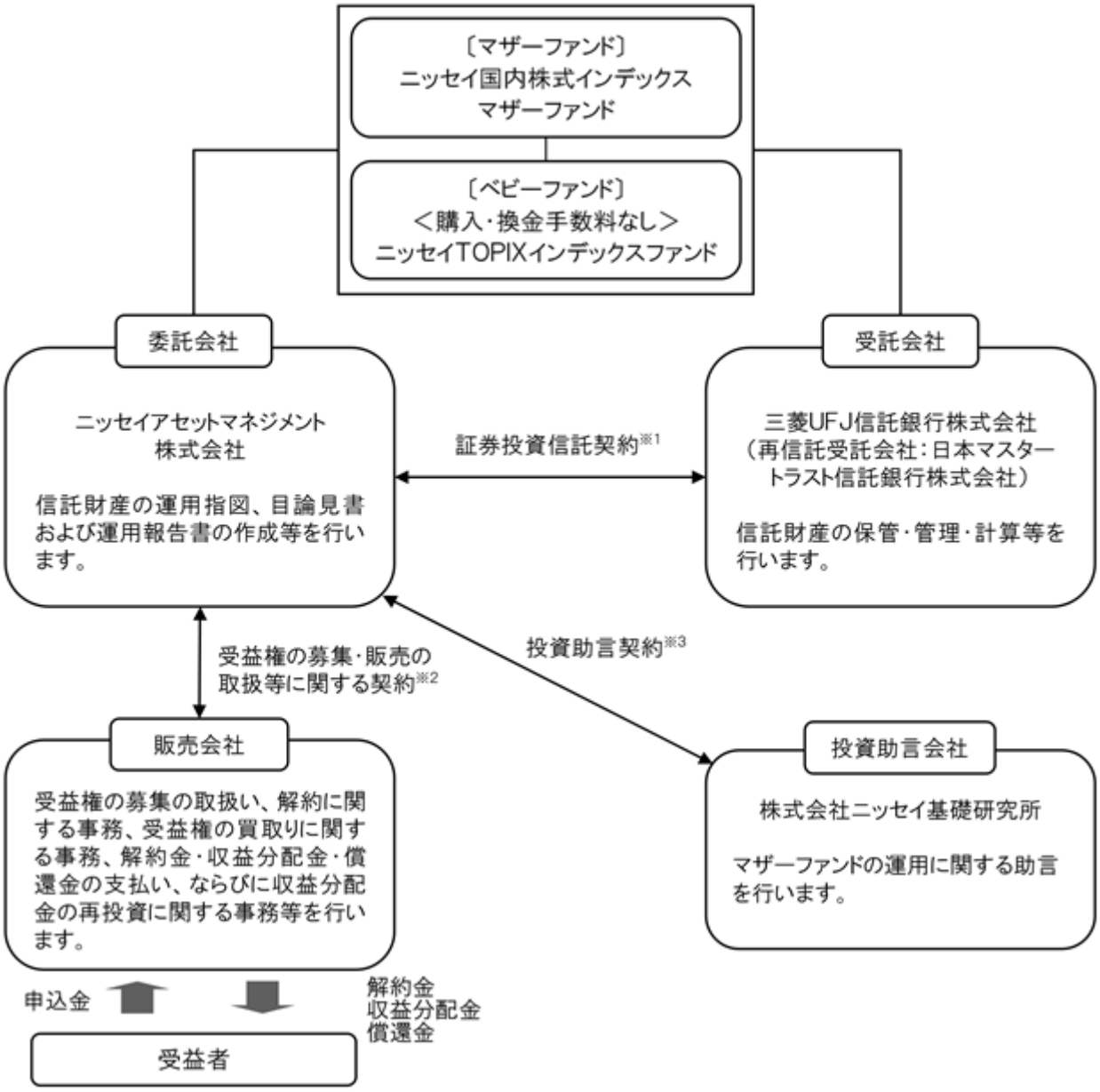
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投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

2015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（2017年2月末現在）

１．委託会社の名称　　：ニッセイアセットマネジメント株式会社
２．本店の所在の場所　　：東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
３．資本金の額　　：100億円
４．代表者の役職氏名　　：代表取締役社長　　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　　：1995年4月4日
７．沿革

1985年7月1日　ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。

1995年4月4日　ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。

1998年7月1日　ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。

2000年5月8日　定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

８．大株主の状況

名　　称	住　　所	保有株数	比　率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号	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

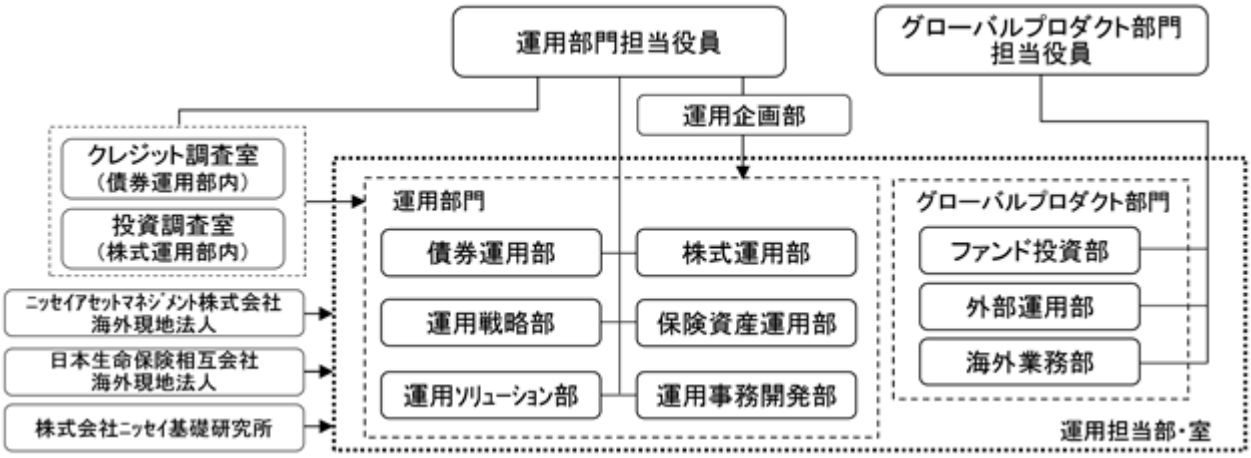
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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。

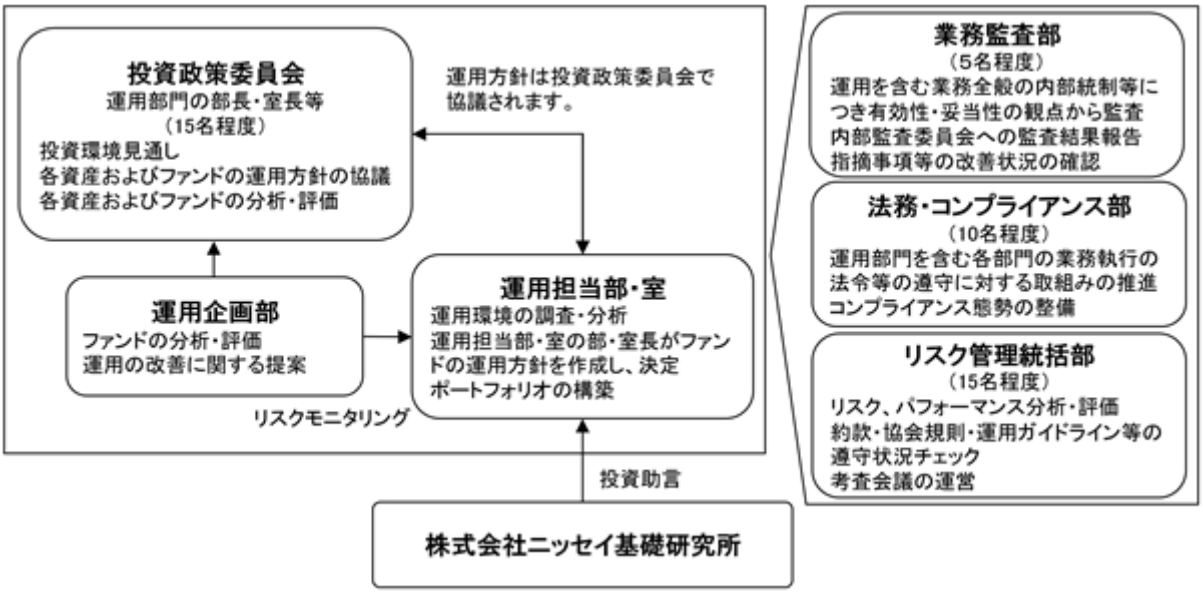
（３）【運用体制】

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、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。

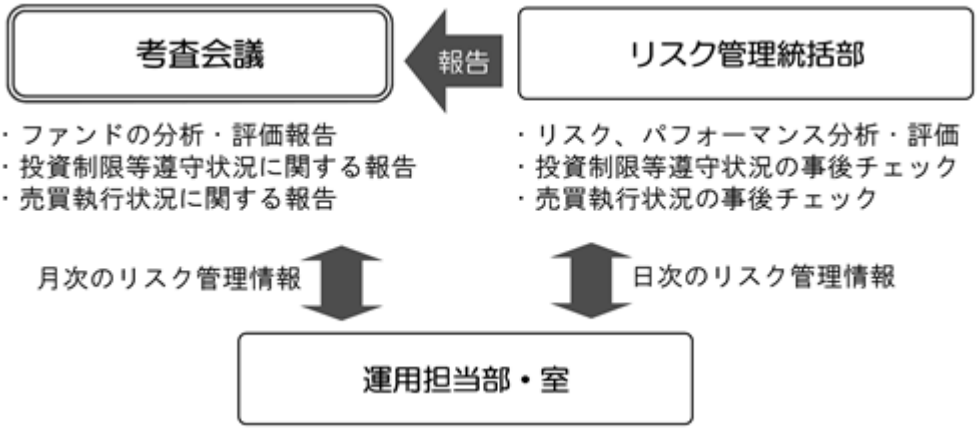
・基準価額と指数の連動性に関する留意点
ファンドはＴＯＰＩＸ（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざしますが、主に以下の理由から基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。
・ファンドは、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、または、ファンドの構成銘柄のウエイトが当該指数の構成銘柄のウエイトと異なる場合があること
・株価指数先物と当該指数の動きの不一致
・ファンドは、流動性確保のために現金・預金等を保有すること
・ファンドは、運用管理費用（信託報酬）等の管理費用負担および売買委託手数料等の取引コストを負担すること
・ファンドにおける株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使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

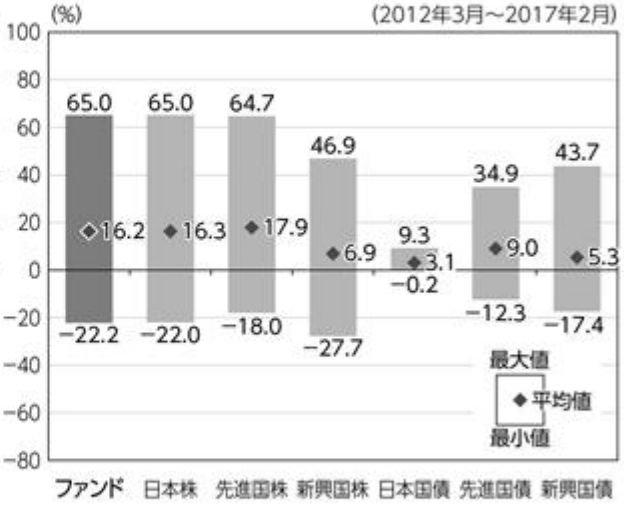
２．運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

○　上記投資リスク管理体制は、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、ファンドの設定日以降のデータが5年分に満たないため、ファンドの騰落率において、不足するデータに関してはファンドのベンチマーク(TOPIX(配当込み))を用いて算出しています。したがって、グラフにおけるファンドの騰落率は、すべてがファンドの実績ではありませんのでご留意ください。

・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0.1944%（税抜0.18%）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、2017年5月19日現在の信託報酬率は年0.1944%（税抜0.18%）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
0.08%	0.08%	0.02%

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）

2037年12月31日まで	20.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%・地方税5%）
2038年 1月 1日以降	20%　　（所得税15%・地方税5%）

税率は原則として20%（所得税15%・地方税5%）ですが、2037年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

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

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

税率（法人）

2037年12月31日まで	15.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%）
2038年 1月 1日以降	15%　　（所得税15%）

税率は原則として15%（所得税のみ）ですが、2037年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

個別元本

・追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

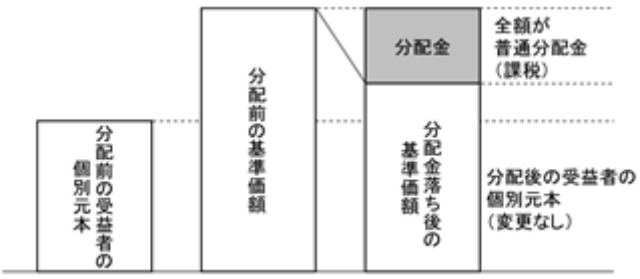
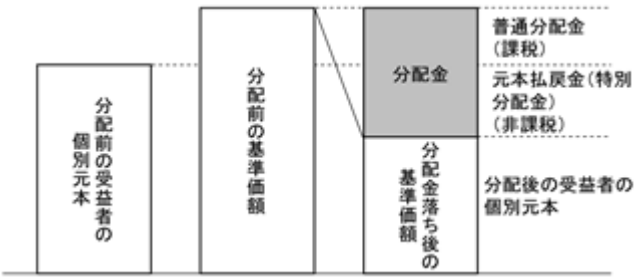
・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出※されます。

・受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を差引いた額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※　同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、分配金受取コースと分配金再投資コースの両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

普通分配金	元本払戻金（特別分配金）
	
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」

（2017年02月28日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		6,476,402,643	100.00
	内　日本	6,476,402,643	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△34,885	△0.00
純資産総額		6,476,367,758	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」

（2017年02月28日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		39,762,402,460	97.46
	内　日本	39,762,402,460	97.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,038,087,113	2.54
純資産総額		40,800,489,573	100.00

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

その他資産の投資状況

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		1,043,120,000	2.56
	内　日本	1,043,120,000	2.56

（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】

（2017年02月28日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価（円） 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	4,197,007,740	1.5543 6,523,735,855	1.5431 6,476,402,643	－ －	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

（2017年02月28日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	215,900	6,432.00 1,388,668,800	6,365.00 1,374,203,500	－ －	3.37%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,328,400	767.80 1,019,945,520	738.40 980,890,560	－ －	2.40%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	140,700	4,771.00 671,279,700	4,751.00 668,465,700	－ －	1.64%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	78,900	8,789.00 693,452,100	8,362.00 659,761,800	－ －	1.62%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	140,400	4,549.00 638,679,600	4,377.00 614,530,800	－ －	1.51%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	159,800	3,574.00 571,125,200	3,489.00 557,542,200	－ －	1.37%
7	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	173,400	2,935.50 509,015,700	2,939.00 509,622,600	－ －	1.25%
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,380,100	210.40 500,773,040	209.70 499,106,970	－ －	1.22%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	125,400	3,508.00 439,903,200	3,478.00 436,141,200	－ －	1.07%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	110,300	3,774.00 416,272,200	3,757.00 414,397,100	－ －	1.02%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	18,000	22,345.00 402,210,000	22,125.00 398,250,000	－ －	0.98%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	69,700	5,242.00 365,367,400	5,222.00 363,973,400	－ －	0.89%
13	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	131,000	2,691.00 352,521,000	2,667.00 349,377,000	－ －	0.86%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	34,400	10,275.00 353,460,000	10,155.00 349,332,000	－ －	0.86%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	71,000	5,089.00 361,319,000	4,919.00 349,249,000	－ －	0.86%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	8,000	44,250.00 354,000,000	43,460.00 347,680,000	－ －	0.85%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	131,500	2,609.50 343,149,250	2,534.50 333,286,750	－ －	0.82%
18	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	73,400	4,401.00 323,033,400	4,400.00 322,960,000	－ －	0.79%
19	信越化学工業 日本	株式 化学	33,400	9,865.00 329,491,000	9,503.00 317,400,200	－ －	0.78%
20	キヤノン 日本	株式 電気機器	95,600	3,289.00 314,428,400	3,281.00 313,663,600	－ －	0.77%
21	三菱電機 日本	株式 電気機器	189,500	1,681.00 318,549,500	1,647.50 312,201,250	－ －	0.77%

22	村田製作所 日本	株式 電気機器	18,600	16,390.00 304,854,000	16,150.00 300,390,000	— —	0.74%
23	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	190,000	1,513.00 287,470,000	1,512.00 287,280,000	— —	0.70%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	130,000	2,258.50 293,605,000	2,195.00 285,350,000	— —	0.70%
25	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	62,800	4,549.00 285,677,200	4,481.00 281,406,800	— —	0.69%
26	花王 日本	株式 化学	47,300	5,727.00 270,887,100	5,801.00 274,387,300	— —	0.67%
27	三井物産 日本	株式 卸売業	158,500	1,703.00 269,925,500	1,719.00 272,461,500	— —	0.67%
28	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	14,800	18,620.00 275,576,000	18,380.00 272,024,000	— —	0.67%
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	426,000	626.70 266,974,200	618.80 263,608,800	— —	0.65%
30	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	358,400	750.00 268,800,000	729.30 261,381,120	— —	0.64%

（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	12.23
		輸送用機器	9.05
		銀行業	8.29
		情報・通信業	7.59
		化学	6.57
		機械	4.97
		医薬品	4.65
		小売業	4.53
		卸売業	4.46
		食料品	4.32
		陸運業	4.08
		サービス業	3.61
		建設業	2.84
		保険業	2.67
		不動産業	2.43
		電気・ガス業	1.73
		その他製品	1.69
		精密機器	1.49
		鉄鋼	1.32
		その他金融業	1.22
		証券、商品先物取引業	1.21
		ガラス・土石製品	0.97
		非鉄金属	0.96
		ゴム製品	0.93
		繊維製品	0.70
		金属製品	0.69
		空運業	0.56
		石油・石炭製品	0.54
		鉱業	0.33
		パルプ・紙	0.25
		海運業	0.25
		倉庫・運輸関連業	0.19
		水産・農林業	0.11
	小計		97.46
合　計（対純資産総額比）			97.46

（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　２９０３月	買建	68	1,050,924,320	1,043,120,000	2.56%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。
（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】

2017年02月28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 (2016年2月22日)	2,843,409,790	2,843,409,790	0.8098	0.8098
第2計算期間末 (2017年2月20日)	6,347,379,420	6,347,379,420	0.9820	0.9820
2016年2月末日	2,892,056,712	－	0.8085	－
3月末日	3,308,249,586	－	0.8469	－
4月末日	3,425,708,001	－	0.8424	－
5月末日	3,698,778,020	－	0.8673	－
6月末日	3,659,820,381	－	0.7841	－
7月末日	4,040,997,622	－	0.8324	－
8月末日	4,260,266,795	－	0.8367	－
9月末日	4,446,702,273	－	0.8390	－
10月末日	4,916,881,559	－	0.8833	－
11月末日	5,273,106,293	－	0.9318	－
12月末日	5,567,142,850	－	0.9639	－
2017年1月末日	6,025,357,958	－	0.9658	－
2月末日	6,476,367,758	－	0.9748	－

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△19.0
第2計算期間	21.3

(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
第2計算期間	6,672,478,056	3,719,777,649	6,464,017,336

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

＜参考情報＞

3.運用実績

2017年2月末現在

●基準価額・純資産の推移

基準価額	9,748円
純資産総額	64億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2016年 2 月	0円
2017年 2 月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・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。

●組入上位業種(マザーファンド)

	業 種	比 率
1	電気機器	12.6%
2	輸送用機器	9.3%
3	銀行業	8.5%
4	情報・通信業	7.8%
5	化学	6.7%
6	機械	5.1%
7	医薬品	4.8%
8	小売業	4.7%
9	卸売業	4.6%
10	食料品	4.4%

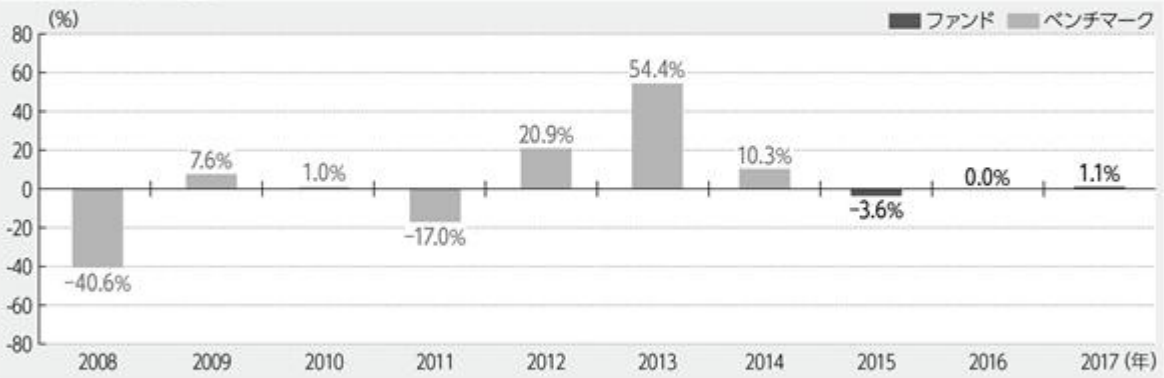
・比率は対組入株式評価額比です。

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘 柄	比 率
1	トヨタ自動車	3.5%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.5%
3	日本電信電話	1.7%
4	ソフトバンクグループ	1.7%
5	三井住友フィナンシャルグループ	1.5%
6	本田技研工業	1.4%
7	KDDI	1.3%
8	みずほフィナンシャルグループ	1.3%
9	ソニー	1.1%
10	日本たばこ産業	1.0%

・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、2017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2期計算期間（平成28年2月23日から平成29年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【＜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)	第2期 (平成29年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,169,406	89,657
コール・ローン	181,310	6,136,073
親投資信託受益証券	2,843,483,731	6,347,482,695
未収入金	10,424,040	32,581,962
流動資産合計	2,856,258,487	6,386,290,387
資産合計	2,856,258,487	6,386,290,387
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,350,168	32,478,615
未払受託者報酬	252,279	670,827
未払委託者報酬	2,186,651	5,600,276
その他未払費用	59,599	161,249
流動負債合計	12,848,697	38,910,967
負債合計	12,848,697	38,910,967
純資産の部		
元本等		
元本	3,511,316,929	6,464,017,336
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△667,907,139	△116,637,916
純資産合計	2,843,409,790	6,347,379,420
負債純資産合計	2,856,258,487	6,386,290,387

（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)	第2期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月20日)
営業収益		
受取利息	210	44
有価証券売買等損益	△443,440,321	959,243,596
営業収益合計	△443,440,111	959,243,640
営業費用		
支払利息	－	1,699
受託者報酬	411,126	1,240,946
委託者報酬	3,563,628	10,541,562
その他費用	106,822	283,120
営業費用合計	4,081,576	12,067,327
営業利益又は営業損失（△）	△447,521,687	947,176,313
経常利益又は経常損失（△）	△447,521,687	947,176,313
当期純利益又は当期純損失（△）	△447,521,687	947,176,313
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	241,754,311
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△667,907,139
剰余金増加額又は欠損金減少額	50,335,249	633,392,183
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	633,392,183
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	787,544,962
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	787,544,962
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△667,907,139	△116,637,916

（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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成29年2月20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）	第2期 （平成29年2月20日現在）
１．　受益権総口数	3,511,316,929口	6,464,017,336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	667,907,139円	116,637,916円
３．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8098円 (8,098円)	0.9820円 (9,820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）	第2期 （自平成28年2月23日 至平成29年2月20日）
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（85,598,635円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（419,683,158円）、収益調整金（33,213,741円）及び分配準備積立金（6,452,958円）より分配対象収益は544,948,492円（1口当たり0.084305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）	第2期 （自平成28年2月23日 至平成29年2月20日）
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

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）	第2期 （平成29年2月20日現在）
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 （平成28年2月22日現在）	第2期 （平成29年2月20日現在）
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△397,627,474	714,599,582
合計	△397,627,474	714,599,582

（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）	第2期 （平成29年2月20日現在）
期首元本額	182,848,809円	3,511,316,929円
期中追加設定元本額	5,032,385,821円	6,672,478,056円
期中一部解約元本額	1,703,917,701円	3,719,777,649円

（４）【附属明細表】（平成29年2月20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	4,083,558,090	6,347,482,695	
親投資信託受益証券　合計		4,083,558,090	6,347,482,695	
合計		4,083,558,090	6,347,482,695	

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）	（平成29年2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,552,328,027	13,509,005
コール・ローン	129,737,550	924,551,222
株式	33,569,060,310	40,065,445,160
派生商品評価勘定	2,176,240	10,666,100
未収入金	38,804,780	―
未収配当金	53,632,336	66,042,813
前払金	26,650,000	―
差入委託証拠金	122,130,000	33,390,000
流動資産合計	35,494,519,243	41,113,604,300
資産合計	35,494,519,243	41,113,604,300
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	―	588,500
前受金	―	8,290,000
未払金	1,295,076,600	―
未払解約金	61,994,903	106,717,303
その他未払費用	―	1,069
流動負債合計	1,357,071,503	115,596,872
負債合計	1,357,071,503	115,596,872
純資産の部		
元本等		
元本	26,708,202,183	26,374,834,259
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,429,245,557	14,623,173,169
純資産合計	34,137,447,740	40,998,007,428
負債純資産合計	35,494,519,243	41,113,604,300

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）	（平成29年2月20日現在）
１．　受益権総口数	26,708,202,183口	26,374,834,259口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2782円 (12,782円)	1.5544円 (15,544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）	（自　平成28年2月23日 至　平成29年2月20日）
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

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）	（平成29年2月20日現在）
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（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）	（平成29年2月20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	6,354,313,576
合計	△5,047,967,953	6,354,313,576

（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）				（平成29年2月20日 現在）			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	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	918,090,000	－	928,200,000	10,110,000
合計	568,920,000	－	571,120,000	2,200,000	918,090,000	－	928,200,000	10,110,000

（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）	（平成29年2月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	27,249,359,761円	26,708,202,183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	10,006,231,236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	10,339,599,160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	7,816,865,155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	6,332,736,059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	14,519,282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	6,437,271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	555,106,395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	2,800,563,440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	2,128,386,619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	46,174,999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	225,366,268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	217,749,600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	1,897,634,169円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	6,973,595円	33,239,884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	－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	－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	4,083,558,090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	216,164,160円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	－円	332,868円
計	26,708,202,183円	26,374,834,259円

附属明細表（平成29年2月20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	800	2,851.00	2,280,800	
日本水産	25,800	562.00	14,499,600	
マルハニチロ	3,800	3,285.00	12,483,000	
カネコ種苗	800	1,435.00	1,148,000	
サカタのタネ	2,900	3,185.00	9,236,500	
ホクト	2,000	2,136.00	4,272,000	
ショーボンドホールディングス	2,100	5,000.00	10,500,000	
ミライト・ホールディングス	6,200	1,053.00	6,528,600	
サンヨーホームズ	1,900	664.00	1,261,600	
住石ホールディングス	2,900	99.00	287,100	
日鉄鉱業	600	6,030.00	3,618,000	
三井松島産業	1,200	1,510.00	1,812,000	
国際石油開発帝石	104,800	1,118.50	117,218,800	
日本海洋掘削	700	2,413.00	1,689,100	

石油資源開発	3,200	2,705.00	8,656,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,300	1,766.00	2,295,800	
ダイセキ環境ソリューション	800	1,591.00	1,272,800	
安藤・間	14,300	850.00	12,155,000	
東急建設	7,100	835.00	5,928,500	
コムシスホールディングス	7,800	2,025.00	15,795,000	
ミサワホーム	2,400	1,054.00	2,529,600	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,648.00	3,972,000	
東建コーポレーション	800	8,020.00	6,416,000	
ヤマウラ	2,100	608.00	1,276,800	
大成建設	101,000	806.00	81,406,000	
大林組	59,700	1,065.00	63,580,500	
清水建設	61,000	1,042.00	63,562,000	
飛島建設	19,200	175.00	3,360,000	
長谷工コーポレーション	23,200	1,288.00	29,881,600	
松井建設	2,200	1,062.00	2,336,400	
錢高組	3,000	428.00	1,284,000	
鹿島建設	87,000	741.00	64,467,000	
不動テトラ	16,100	203.00	3,268,300	
鉄建建設	12,000	337.00	4,044,000	
西松建設	23,000	585.00	13,455,000	
三井住友建設	76,300	123.00	9,384,900	
大豊建設	7,000	526.00	3,682,000	
前田建設工業	12,000	1,002.00	12,024,000	
佐田建設	2,800	423.00	1,184,400	
奥村組	16,000	706.00	11,296,000	
東鉄工業	2,400	3,145.00	7,548,000	
淺沼組	7,000	359.00	2,513,000	
戸田建設	23,000	668.00	15,364,000	
熊谷組	31,000	319.00	9,889,000	
青木あすなろ建設	1,500	820.00	1,230,000	
北野建設	4,000	320.00	1,280,000	
植木組	5,000	263.00	1,315,000	
三井ホーム	3,000	576.00	1,728,000	
矢作建設工業	2,700	1,051.00	2,837,700	
ピーエス三菱	3,200	404.00	1,292,800	
日本ハウスホールディングス	4,100	517.00	2,119,700	
大東建託	7,300	15,775.00	115,157,500	
新日本建設	2,400	929.00	2,229,600	
ＮＩＰＰＯ	5,000	2,176.00	10,880,000	
東亜道路工業	4,000	345.00	1,380,000	
前田道路	6,000	2,012.00	12,072,000	
日本道路	6,000	481.00	2,886,000	
東亜建設工業	1,600	1,954.00	3,126,400	
若築建設	11,000	152.00	1,672,000	
東洋建設	5,700	424.00	2,416,800	
五洋建設	22,100	516.00	11,403,600	
大林道路	2,100	686.00	1,440,600	
世紀東急工業	2,900	516.00	1,496,400	
福田組	3,000	1,044.00	3,132,000	
日本ドライケミカル	500	2,310.00	1,155,000	
住友林業	13,700	1,607.00	22,015,900	
日本基礎技術	3,500	363.00	1,270,500	
日成ビルド工業	6,000	551.00	3,306,000	
巴コーポレーション	3,400	358.00	1,217,200	
パナホーム	7,000	1,057.00	7,399,000	
大和ハウス工業	58,800	3,109.00	182,809,200	
ライト工業	3,800	1,156.00	4,392,800	
積水ハウス	62,600	1,798.00	112,554,800	
日特建設	2,600	442.00	1,149,200	

北陸電気工事	1,300	885.00	1,150,500	
ユアテック	3,000	804.00	2,412,000	
西部電気工業	500	2,295.00	1,147,500	
四電工	3,000	425.00	1,275,000	
中電工	2,500	2,367.00	5,917,500	
関電工	8,000	925.00	7,400,000	
きんでん	13,200	1,485.00	19,602,000	
東京エネシス	2,000	951.00	1,902,000	
トーエネック	3,000	559.00	1,677,000	
住友電設	1,400	1,278.00	1,789,200	
日本電設工業	3,200	1,991.00	6,371,200	
協和エクシオ	7,800	1,592.00	12,417,600	
新日本空調	1,500	1,375.00	2,062,500	
日本工営	1,200	2,734.00	3,280,800	
ＮＤＳ	400	2,920.00	1,168,000	
九電工	3,900	2,948.00	11,497,200	
三機工業	4,400	1,002.00	4,408,800	
日揮	18,600	2,053.00	38,185,800	
中外炉工業	6,000	240.00	1,440,000	
太平電業	3,000	1,052.00	3,156,000	
高砂熱学工業	5,500	1,649.00	9,069,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,900	2,124.00	4,035,600	
朝日工業社	500	3,035.00	1,517,500	
明星工業	3,600	613.00	2,206,800	
大氣社	2,600	2,891.00	7,516,600	
ダイダン	3,000	961.00	2,883,000	
日比谷総合設備	2,200	1,721.00	3,786,200	
東芝プラントシステム	3,200	1,611.00	5,155,200	
日本製粉	5,900	1,695.00	10,000,500	
日清製粉グループ本社	21,800	1,685.00	36,733,000	
昭和産業	8,000	609.00	4,872,000	
鳥越製粉	1,600	809.00	1,294,400	
中部飼料	2,200	1,154.00	2,538,800	
フィード・ワン	12,000	180.00	2,160,000	
日本甜菜製糖	1,000	2,461.00	2,461,000	
三井製糖	1,400	2,658.00	3,721,200	
塩水港精糖	4,800	256.00	1,228,800	
日新製糖	800	1,836.00	1,468,800	
ネクスト	4,600	738.00	3,394,800	
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,547.00	1,701,700	
日本Ｍ＆Ａセンター	5,400	3,435.00	18,549,000	
タケエイ	1,600	1,025.00	1,640,000	
トラスト・テック	800	1,720.00	1,376,000	
コシダカホールディングス	600	2,482.00	1,489,200	
パソナグループ	1,600	812.00	1,299,200	
リンクアンドモチベーション	4,400	436.00	1,918,400	
ＧＣＡ	1,600	955.00	1,528,000	
エス・エム・エス	2,600	2,566.00	6,671,600	
テンプホールディングス	14,300	1,937.00	27,699,100	
リニカル	1,100	1,443.00	1,587,300	
クックパッド	4,100	975.00	3,997,500	
アイ・ケイ・ケイ	1,800	718.00	1,292,400	
森永製菓	3,900	4,710.00	18,369,000	
中村屋	500	5,130.00	2,565,000	
江崎グリコ	5,000	5,300.00	26,500,000	
不二家	11,000	223.00	2,453,000	
山崎製パン	14,600	2,224.00	32,470,400	
モロゾフ	3,000	508.00	1,524,000	
亀田製菓	1,100	4,965.00	5,461,500	
寿スピリッツ	1,400	2,594.00	3,631,600	

カルビー	8,100	3,750.00	30,375,000	
森永乳業	18,000	740.00	13,320,000	
六甲バター	900	2,451.00	2,205,900	
ヤクルト本社	10,700	6,270.00	67,089,000	
明治ホールディングス	11,800	8,670.00	102,306,000	
雪印メグミルク	4,300	2,947.00	12,672,100	
プリマハム	13,000	449.00	5,837,000	
日本ハム	14,000	3,065.00	42,910,000	
林兼産業	1,400	877.00	1,227,800	
丸大食品	10,000	497.00	4,970,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,100	3,240.00	3,564,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,500	1,094.00	12,581,000	
学情	1,000	1,204.00	1,204,000	
スタジオアリス	800	2,249.00	1,799,200	
シミックホールディングス	900	1,487.00	1,338,300	
システナ	1,400	1,630.00	2,282,000	
ＮＪＳ	900	1,398.00	1,258,200	
デジタルアーツ	800	3,310.00	2,648,000	
新日鉄住金ソリューションズ	2,900	2,285.00	6,626,500	
綜合警備保障	6,800	4,330.00	29,444,000	
いちご	16,700	366.00	6,112,200	
日本駐車場開発	21,100	153.00	3,228,300	
コア	1,000	1,385.00	1,385,000	
カカクコム	13,200	1,613.00	21,291,600	
ルネサンス	900	1,704.00	1,533,600	
ディップ	2,400	2,321.00	5,570,400	
ＳＢＳホールディングス	1,800	833.00	1,499,400	
オプトホールディング	1,700	931.00	1,582,700	
新日本科学	2,100	562.00	1,180,200	
ツクイ	4,400	683.00	3,005,200	
キャリアデザインセンター	900	1,163.00	1,046,700	
エムスリー	16,100	2,845.00	45,804,500	
ツカダ・グローバルホールディング	1,800	623.00	1,121,400	
アウトソーシング	1,100	3,735.00	4,108,500	
ウェルネット	1,400	1,293.00	1,810,200	
ディー・エヌ・エー	8,300	2,463.00	20,442,900	
博報堂ＤＹホールディングス	25,700	1,337.00	34,360,900	
ぐるなび	2,700	2,217.00	5,985,900	
エスアールジータカミヤ	2,000	585.00	1,170,000	
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	253.00	1,265,000	
ファンコミュニケーションズ	4,700	775.00	3,642,500	
ＷＤＢホールディングス	1,000	1,368.00	1,368,000	
ティア	1,900	696.00	1,322,400	
インフォマート	7,900	593.00	4,684,700	
サッポロホールディングス	6,500	2,851.00	18,531,500	
アサヒグループホールディングス	37,300	4,110.00	153,303,000	
キリンホールディングス	85,700	1,908.50	163,558,450	
宝ホールディングス	14,400	1,109.00	15,969,600	
オエノンホールディングス	5,000	265.00	1,325,000	
養命酒製造	600	1,870.00	1,122,000	
コカ・コーラウエスト	6,700	3,165.00	21,205,500	
コカ・コーライーストジャパン	7,700	2,357.00	18,148,900	
サントリー食品インターナショナル	13,600	4,650.00	63,240,000	
ダイドーグループホールディングス	900	5,640.00	5,076,000	
伊藤園	5,900	3,705.00	21,859,500	
キーコーヒー	1,800	2,197.00	3,954,600	
ユニカフェ	1,300	976.00	1,268,800	
日清オイリオグループ	11,000	580.00	6,380,000	
不二製油グループ本社	5,300	2,419.00	12,820,700	
Ｊ－オイルミルズ	900	4,100.00	3,690,000	

ローソン	6,100	8,010.00	48,861,000	
サンエー	1,300	5,170.00	6,721,000	
カワチ薬品	1,400	2,997.00	4,195,800	
エービーシー・マート	3,200	6,710.00	21,472,000	
高千穂交易	1,200	1,054.00	1,264,800	
アスクル	2,100	3,315.00	6,961,500	
ゲオホールディングス	2,900	1,365.00	3,958,500	
アダストリア	2,700	2,956.00	7,981,200	
伊藤忠食品	400	4,515.00	1,806,000	
くらコーポレーション	1,100	4,640.00	5,104,000	
キャンドゥ	900	1,814.00	1,632,600	
エレマテック	700	1,962.00	1,373,400	
パルグループホールディングス	900	2,779.00	2,501,100	
ＪＡＬＵＸ	600	2,218.00	1,330,800	
エディオン	6,800	1,030.00	7,004,000	
あらた	800	2,839.00	2,271,200	
サーラコーポレーション	2,200	625.00	1,375,000	
ワッツ	1,100	1,297.00	1,426,700	
トーメンデバイス	600	2,160.00	1,296,000	
ハローズ	600	2,359.00	1,415,400	
ＪＰホールディングス	5,300	258.00	1,367,400	
あみやき亭	400	4,070.00	1,628,000	
東京エレクトロン　デバイス	800	1,599.00	1,279,200	
ひらまつ	2,400	660.00	1,584,000	
フィールズ	1,300	1,250.00	1,625,000	
双日	103,500	292.00	30,222,000	
ゲンキー	400	6,440.00	2,576,000	
アルフレッサ　ホールディングス	20,700	1,999.00	41,379,300	
大黒天物産	400	5,030.00	2,012,000	
ハニーズ	1,500	1,113.00	1,669,500	
ファーマライズホールディングス	2,400	515.00	1,236,000	
キッコーマン	14,000	3,395.00	47,530,000	
味の素	41,000	2,319.50	95,099,500	
キユーピー	10,100	2,942.00	29,714,200	
ハウス食品グループ本社	7,400	2,392.00	17,700,800	
カゴメ	7,100	2,878.00	20,433,800	
アリアケジャパン	1,600	6,240.00	9,984,000	
ピエトロ	700	1,655.00	1,158,500	
エバラ食品工業	600	2,099.00	1,259,400	
ニチレイ	9,800	2,565.00	25,137,000	
横浜冷凍	4,300	1,055.00	4,536,500	
東洋水産	9,800	3,980.00	39,004,000	
日清食品ホールディングス	7,800	6,140.00	47,892,000	
永谷園ホールディングス	2,000	1,425.00	2,850,000	
一正蒲鉾	1,100	1,182.00	1,300,200	
フジッコ	1,900	2,450.00	4,655,000	
ロック・フィールド	2,100	1,690.00	3,549,000	
日本たばこ産業	110,300	3,774.00	416,272,200	
ケンコーマヨネーズ	700	2,710.00	1,897,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	2,553.00	3,063,600	
なとり	1,000	1,865.00	1,865,000	
ユーグレナ	6,400	1,240.00	7,936,000	
片倉工業	2,300	1,511.00	3,475,300	
グンゼ	14,000	422.00	5,908,000	
ヒューリック	36,600	1,088.00	39,820,800	
ラサ商事	2,000	696.00	1,392,000	
アルペン	1,600	1,964.00	3,142,400	
クオール	2,000	1,534.00	3,068,000	
アルコニックス	1,000	1,779.00	1,779,000	
神戸物産	900	3,755.00	3,379,500	

ジェイアイエヌ	1,200	5,970.00	7,164,000	
ビックカメラ	10,100	1,074.00	10,847,400	
ＤＣＭホールディングス	10,600	993.00	10,525,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6,200	3,235.00	20,057,000	
ダイヤモンドダイニング	900	1,677.00	1,509,300	
あい　ホールディングス	3,100	2,249.00	6,971,900	
きちり	1,900	660.00	1,254,000	
アークランドサービスホールディングス	500	3,205.00	1,602,500	
Ｊ．フロント　リテイリング	22,200	1,720.00	38,184,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,100	2,239.00	6,940,900	
マツモトキヨシホールディングス	3,300	5,280.00	17,424,000	
ブロンコビリー	900	2,804.00	2,523,600	
スタートトゥデイ	16,000	2,487.00	39,792,000	
物語コーポレーション	500	4,460.00	2,230,000	
ココカラファイン	1,800	4,680.00	8,424,000	
三越伊勢丹ホールディングス	34,900	1,383.00	48,266,700	
東洋紡	74,000	197.00	14,578,000	
ユニチカ	51,000	90.00	4,590,000	
富士紡ホールディングス	900	3,365.00	3,028,500	
日清紡ホールディングス	9,900	1,156.00	11,444,400	
倉敷紡績	19,000	237.00	4,503,000	
ダイワボウホールディングス	15,000	295.00	4,425,000	
シキボウ	10,000	153.00	1,530,000	
日東紡績	15,000	506.00	7,590,000	
トヨタ紡織	6,200	2,452.00	15,202,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,200	1,685.00	5,392,000	
ウエルシアホールディングス	1,700	6,290.00	10,693,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,600	2,572.00	6,687,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,300	1,014.00	3,346,200	
八洲電機	1,900	644.00	1,223,600	
ＵＫＣホールディングス	1,100	2,238.00	2,461,800	
ＯＣＨＩホールディングス	900	1,358.00	1,222,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,700	838.00	6,452,600	
三洋貿易	1,000	1,817.00	1,817,000	
チムニー	500	2,859.00	1,429,500	
ウイン・パートナーズ	1,300	988.00	1,284,400	
ジョイフル本田	2,800	3,465.00	9,702,000	
鳥貴族	500	2,427.00	1,213,500	
キリン堂ホールディングス	1,400	853.00	1,194,200	
ホットランド	1,100	1,032.00	1,135,200	
すかいらーく	7,500	1,604.00	12,030,000	
綿半ホールディングス	800	1,621.00	1,296,800	
日本毛織	5,200	905.00	4,706,000	
ヨシックス	900	1,321.00	1,188,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,800	1,010.00	5,858,000	
野村不動産ホールディングス	11,600	1,925.00	22,330,000	
三重交通グループホールディングス	3,100	390.00	1,209,000	
サムティ	1,400	1,195.00	1,673,000	
日本商業開発	1,000	1,942.00	1,942,000	
プレサンスコーポレーション	2,800	1,407.00	3,939,600	
ユニゾホールディングス	1,400	3,095.00	4,333,000	
ＴＨＥグローバル社	2,700	454.00	1,225,800	
日本管理センター	1,300	1,387.00	1,803,100	
サンセイランディック	1,700	758.00	1,288,600	
フージャースホールディングス	2,300	613.00	1,409,900	
オープンハウス	2,500	2,716.00	6,790,000	
東急不動産ホールディングス	42,400	655.00	27,772,000	
飯田グループホールディングス	14,600	1,819.00	26,557,400	

帝国繊維	1,900	1,699.00	3,228,100	
ブックオフコーポレーション	1,500	857.00	1,285,500	
日本コークス工業	15,000	104.00	1,560,000	
あさひ	1,300	1,311.00	1,704,300	
日本調剤	600	3,730.00	2,238,000	
コスモス薬品	900	21,210.00	19,089,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,400	2,978.00	10,125,200	
セブン＆アイ・ホールディングス	73,400	4,401.00	323,033,400	
薬王堂	900	2,428.00	2,185,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,700	1,031.00	4,845,700	
ツルハホールディングス	4,000	10,480.00	41,920,000	
サンマルクホールディングス	1,100	3,490.00	3,839,000	
トリドールホールディングス	2,200	2,366.00	5,205,200	
帝人	15,200	2,159.00	32,816,800	
東レ	135,000	972.50	131,287,500	
クラレ	31,300	1,717.00	53,742,100	
旭化成	116,000	1,095.00	127,020,000	
稲葉製作所	1,000	1,331.00	1,331,000	
トーカロ	1,200	2,722.00	3,266,400	
ＳＵＭＣＯ	19,400	1,777.00	34,473,800	
川田テクノロジーズ	400	7,830.00	3,132,000	
シーアールイー	800	1,683.00	1,346,400	
住江織物	5,000	291.00	1,455,000	
日本フエルト	2,400	524.00	1,257,600	
イチカワ	4,000	301.00	1,204,000	
アツギ	15,000	127.00	1,905,000	
コメダホールディングス	2,400	1,925.00	4,620,000	
バロックジャパンリミテッド	1,000	1,405.00	1,405,000	
クスリのアオキホールディングス	1,600	4,775.00	7,640,000	
共和レザー	1,400	926.00	1,296,400	
セーレン	4,600	1,579.00	7,263,400	
ソトー	1,100	1,166.00	1,282,600	
東海染工	9,000	147.00	1,323,000	
小松精練	2,600	735.00	1,911,000	
ワコールホールディングス	11,000	1,420.00	15,620,000	
ホギメディカル	1,200	6,770.00	8,124,000	
レナウン	10,700	114.00	1,219,800	
ＴＳＩホールディングス	7,700	826.00	6,360,200	
ＴＩＳ	5,800	2,696.00	15,636,800	
グリー	10,700	674.00	7,211,800	
コーエーテクモホールディングス	4,200	2,180.00	9,156,000	
三菱総合研究所	700	3,185.00	2,229,500	
ボルテージ	1,200	1,005.00	1,206,000	
電算	500	2,433.00	1,216,500	
ＡＧＳ	900	1,916.00	1,724,400	
ファインデックス	1,300	963.00	1,251,900	
ヒト・コミュニケーションズ	800	1,675.00	1,340,000	
ＫＬａｂ	3,300	808.00	2,666,400	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,300	1,097.00	1,426,100	
ネクソン	19,200	1,925.00	36,960,000	
アイスタイル	2,700	979.00	2,643,300	
エムアップ	2,000	901.00	1,802,000	
エイチーム	1,000	2,136.00	2,136,000	
テクノスジャパン	1,400	1,240.00	1,736,000	
コロプラ	4,900	1,025.00	5,022,500	
ブロードリーフ	4,300	633.00	2,721,900	
ハーツユナイテッドグループ	900	1,504.00	1,353,600	
メディアドゥ	500	1,716.00	858,000	

ブイキューブ	1,800	622.00	1,119,600	
サイバーリンクス	1,200	1,045.00	1,254,000	
オプティム	200	5,260.00	1,052,000	
特種東海製紙	1,100	4,205.00	4,625,500	
ティーガイア	1,700	1,866.00	3,172,200	
豆蔵ホールディングス	1,300	885.00	1,150,500	
テクマトリックス	600	2,573.00	1,543,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,800	256.00	9,420,800	
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	6,480.00	9,072,000	
ザッパラス	2,800	457.00	1,279,600	
インターネットイニシアティブ	2,600	2,026.00	5,267,600	
さくらインターネット	1,300	1,138.00	1,479,400	
ＳＲＡホールディングス	900	2,795.00	2,515,500	
朝日ネット	2,500	525.00	1,312,500	
コムチュア	400	3,520.00	1,408,000	
王子ホールディングス	73,000	520.00	37,960,000	
日本製紙	8,300	1,981.00	16,442,300	
三菱製紙	2,600	760.00	1,976,000	
北越紀州製紙	10,400	751.00	7,810,400	
中越パルプ工業	7,000	242.00	1,694,000	
大王製紙	7,400	1,295.00	9,583,000	
阿波製紙	1,400	606.00	848,400	
ｇｕｍｉ	1,800	1,254.00	2,257,200	
パイプドHD	1,100	1,109.00	1,219,900	
ＬＩＮＥ	2,900	3,540.00	10,266,000	
レンゴー	17,900	651.00	11,652,900	
トーモク	6,000	335.00	2,010,000	
ザ・パック	1,300	3,075.00	3,997,500	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,400	842.00	1,178,800	
昭和電工	12,400	1,982.00	24,576,800	
住友化学	137,000	638.00	87,406,000	
住友精化	800	4,725.00	3,780,000	
日産化学工業	10,200	3,915.00	39,933,000	
ラサ工業	9,000	147.00	1,323,000	
クレハ	1,400	4,860.00	6,804,000	
テイカ	3,000	725.00	2,175,000	
石原産業	3,300	1,120.00	3,696,000	
日本曹達	11,000	670.00	7,370,000	
東ソー	54,000	1,004.00	54,216,000	
トクヤマ	29,000	573.00	16,617,000	
セントラル硝子	19,000	547.00	10,393,000	
東亞合成	11,600	1,272.00	14,755,200	
大阪ソーダ	8,000	495.00	3,960,000	
関東電化工業	4,000	1,159.00	4,636,000	
デンカ	39,000	610.00	23,790,000	
イビデン	12,400	1,919.00	23,795,600	
信越化学工業	33,400	9,865.00	329,491,000	
日本カーバイド工業	8,000	162.00	1,296,000	
堺化学工業	7,000	411.00	2,877,000	
エア・ウォーター	15,300	2,162.00	33,078,600	
大陽日酸	14,300	1,426.00	20,391,800	
日本化学工業	7,000	241.00	1,687,000	
日本パーカライジング	9,500	1,408.00	13,376,000	
高圧ガス工業	2,800	765.00	2,142,000	
四国化成工業	3,000	1,185.00	3,555,000	
戸田工業	4,000	285.00	1,140,000	
ステラ　ケミファ	900	3,430.00	3,087,000	
保土谷化学工業	600	3,650.00	2,190,000	
日本触媒	2,900	7,470.00	21,663,000	

大日精化工業	8,000	724.00	5,792,000	
カネカ	25,000	900.00	22,500,000	
協和発酵キリン	22,300	1,639.00	36,549,700	
三菱瓦斯化学	17,300	2,325.00	40,222,500	
三井化学	85,000	553.00	47,005,000	
ＪＳＲ	18,700	2,019.00	37,755,300	
東京応化工業	3,500	3,785.00	13,247,500	
大阪有機化学工業	1,300	972.00	1,263,600	
三菱ケミカルホールディングス	125,300	859.30	107,670,290	
ＫＨネオケム	2,300	1,340.00	3,082,000	
ダイセル	25,100	1,401.00	35,165,100	
住友ベークライト	16,000	665.00	10,640,000	
積水化学工業	42,200	1,875.00	79,125,000	
日本ゼオン	16,000	1,298.00	20,768,000	
アイカ工業	6,000	2,898.00	17,388,000	
宇部興産	94,000	285.00	26,790,000	
積水樹脂	2,900	1,882.00	5,457,800	
タキロン	4,000	544.00	2,176,000	
旭有機材	6,000	242.00	1,452,000	
日立化成	10,300	3,225.00	33,217,500	
ニチバン	2,000	930.00	1,860,000	
リケンテクノス	4,000	547.00	2,188,000	
大倉工業	4,000	564.00	2,256,000	
積水化成品工業	2,600	830.00	2,158,000	
群栄化学工業	400	3,785.00	1,514,000	
タイガースポリマー	1,500	802.00	1,203,000	
ミライアル	1,200	940.00	1,128,000	
ダイキアクシス	1,100	1,342.00	1,476,200	
ダイキョーニシカワ	3,300	1,454.00	4,798,200	
日本化薬	12,000	1,581.00	18,972,000	
カーリットホールディングス	2,200	594.00	1,306,800	
ＥＰＳホールディングス	2,300	1,525.00	3,507,500	
プレステージ・インターナショナル	2,600	890.00	2,314,000	
アミューズ	1,000	2,023.00	2,023,000	
野村総合研究所	13,100	3,895.00	51,024,500	
ドリームインキュベータ	600	2,121.00	1,272,600	
サイバネットシステム	1,900	823.00	1,563,700	
ＴＡＣ	5,400	229.00	1,236,600	
ＣＥホールディングス	1,100	1,135.00	1,248,500	
ケネディクス	24,900	441.00	10,980,900	
電通	20,700	5,970.00	123,579,000	
インテージホールディングス	1,000	2,172.00	2,172,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	957.00	1,531,200	
東邦システムサイエンス	1,800	647.00	1,164,600	
ぴあ	600	2,922.00	1,753,200	
イオンファンタジー	500	3,120.00	1,560,000	
シーティーエス	900	1,555.00	1,399,500	
メディカルシステムネットワーク	2,800	454.00	1,271,200	
日本精化	1,500	947.00	1,420,500	
扶桑化学工業	1,300	3,140.00	4,082,000	
ＡＤＥＫＡ	8,000	1,562.00	12,496,000	
日油	15,000	1,264.00	18,960,000	
ミヨシ油脂	8,000	142.00	1,136,000	
新日本理化	7,500	153.00	1,147,500	
ハリマ化成グループ	1,600	787.00	1,259,200	
花王	47,300	5,727.00	270,887,100	
第一工業製薬	4,000	454.00	1,816,000	
三洋化成工業	1,200	4,710.00	5,652,000	
武田薬品工業	69,700	5,242.00	365,367,400	
アステラス製薬	190,000	1,513.00	287,470,000	

大日本住友製薬	13,200	1,967.00	25,964,400	
塩野義製薬	25,200	5,490.00	138,348,000	
田辺三菱製薬	21,700	2,295.00	49,801,500	
あすか製薬	2,000	1,720.00	3,440,000	
日本新薬	4,300	6,110.00	26,273,000	
ビオフェルミン製薬	400	3,085.00	1,234,000	
中外製薬	18,500	3,840.00	71,040,000	
科研製薬	3,500	5,890.00	20,615,000	
エーザイ	22,900	6,114.00	140,010,600	
理研ビタミン	600	4,340.00	2,604,000	
ロート製薬	9,100	2,194.00	19,965,400	
小野薬品工業	42,200	2,523.00	106,470,600	
久光製薬	5,200	6,130.00	31,876,000	
持田製薬	1,300	8,430.00	10,959,000	
参天製薬	34,300	1,623.00	55,668,900	
扶桑薬品工業	600	2,869.00	1,721,400	
日本ケミファ	300	5,540.00	1,662,000	
ツムラ	6,200	3,390.00	21,018,000	
日医工	4,300	1,724.00	7,413,200	
テルモ	27,200	3,895.00	105,944,000	
みらかホールディングス	4,700	5,070.00	23,829,000	
キッセイ薬品工業	3,300	2,864.00	9,451,200	
生化学工業	3,400	1,727.00	5,871,800	
栄研化学	1,600	3,040.00	4,864,000	
日水製薬	300	1,367.00	410,100	
鳥居薬品	1,300	2,909.00	3,781,700	
ＪＣＲファーマ	1,400	2,856.00	3,998,400	
東和薬品	900	5,260.00	4,734,000	
富士製薬工業	600	3,085.00	1,851,000	
沢井製薬	3,200	6,130.00	19,616,000	
ゼリア新薬工業	3,800	1,706.00	6,482,800	
第一三共	54,700	2,563.50	140,223,450	
キョーリン製薬ホールディングス	4,500	2,359.00	10,615,500	
大幸薬品	900	1,797.00	1,617,300	
ダイト	1,000	2,275.00	2,275,000	
大塚ホールディングス	40,000	5,155.00	206,200,000	
大正製薬ホールディングス	4,000	9,230.00	36,920,000	
ペプチドリーム	3,200	5,330.00	17,056,000	
大日本塗料	11,000	233.00	2,563,000	
日本ペイントホールディングス	14,400	3,595.00	51,768,000	
関西ペイント	19,500	2,200.00	42,900,000	
中国塗料	5,300	854.00	4,526,200	
日本特殊塗料	1,300	1,753.00	2,278,900	
藤倉化成	2,500	682.00	1,705,000	
太陽ホールディングス	1,500	4,775.00	7,162,500	
ＤＩＣ	7,300	3,950.00	28,835,000	
サカタインクス	3,800	1,614.00	6,133,200	
東洋インキＳＣホールディングス	18,000	555.00	9,990,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,300	1,082.00	1,406,600	
アルプス技研	700	3,055.00	2,138,500	
ダイオーズ	1,100	1,074.00	1,181,400	
日本空調サービス	2,000	666.00	1,332,000	
オリエンタルランド	20,100	6,317.00	126,971,700	
フォーカスシステムズ	2,200	588.00	1,293,600	
ダスキン	4,800	2,441.00	11,716,800	
パーク２４	8,900	3,095.00	27,545,500	
明光ネットワークジャパン	2,300	1,209.00	2,780,700	
ファルコホールディングス	900	1,495.00	1,345,500	
クレスコ	500	2,493.00	1,246,500	
フジ・メディア・ホールディングス	18,300	1,537.00	28,127,100	

秀英予備校	2,800	481.00	1,346,800	
ラウンドワン	5,800	880.00	5,104,000	
リゾートトラスト	7,200	2,201.00	15,847,200	
オービック	6,000	5,350.00	32,100,000	
ジャストシステム	2,800	1,215.00	3,402,000	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	1,100	1,246.00	1,370,600	
ヤフー	125,600	527.00	66,191,200	
ビー・エム・エル	2,400	2,477.00	5,944,800	
ワタベウェディング	2,900	573.00	1,661,700	
トレンドマイクロ	9,300	4,840.00	45,012,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,090.00	3,379,000	
リソー教育	3,200	626.00	2,003,200	
日本オラクル	2,800	6,600.00	18,480,000	
アルファシステムズ	600	1,975.00	1,185,000	
フューチャー	2,400	899.00	2,157,600	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,400	1,085.00	1,519,000	
ソフトバンク・テクノロジー	400	4,125.00	1,650,000	
トーセ	1,500	829.00	1,243,500	
ユー・エス・エス	22,500	1,933.00	43,492,500	
オービックビジネスコンサルタント	900	5,560.00	5,004,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	4,000	3,150.00	12,600,000	
アイティフォー	2,300	655.00	1,506,500	
サイバーエージェント	9,800	3,010.00	29,498,000	
楽天	94,800	1,028.00	97,454,400	
大塚商会	4,700	5,890.00	27,683,000	
総合メディカル	800	3,995.00	3,196,000	
サイボウズ	2,700	443.00	1,196,100	
セントラルスポーツ	600	3,580.00	2,148,000	
パラカ	600	1,990.00	1,194,000	
電通国際情報サービス	1,100	2,219.00	2,440,900	
デジタルガレージ	2,700	2,062.00	5,567,400	
イーエムシステムズ	700	1,627.00	1,138,900	
ウェザーニューズ	600	3,565.00	2,139,000	
ＣＩＪ	2,300	532.00	1,223,600	
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,546.00	1,236,800	
日本エンタープライズ	4,300	281.00	1,208,300	
WOWOW	800	3,670.00	2,936,000	
スカラ	1,500	857.00	1,285,500	
フルキャストホールディングス	1,900	1,074.00	2,040,600	
富士フイルムホールディングス	36,900	4,360.00	160,884,000	
コニカミノルタ	41,600	1,105.00	45,968,000	
資生堂	35,300	2,873.00	101,416,900	
ライオン	23,000	1,874.00	43,102,000	
高砂香料工業	1,200	3,605.00	4,326,000	
マンダム	1,900	5,200.00	9,880,000	
ミルボン	1,000	5,290.00	5,290,000	
ファンケル	4,000	1,614.00	6,456,000	
コーセー	3,000	9,190.00	27,570,000	
シーズ・ホールディングス	2,400	3,115.00	7,476,000	
シーボン	200	2,555.00	511,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	10,920.00	20,748,000	
ノエビアホールディングス	1,200	4,280.00	5,136,000	
アジュバンコスメジャパン	1,300	974.00	1,266,200	
エステー	1,300	1,732.00	2,251,600	
アグロ　カネショウ	1,000	1,310.00	1,310,000	
コニシ	2,900	1,360.00	3,944,000	
長谷川香料	2,400	1,957.00	4,696,800	
星光ＰＭＣ	1,000	1,132.00	1,132,000	
小林製薬	5,200	5,210.00	27,092,000	
荒川化学工業	1,600	2,042.00	3,267,200	

メック	1,400	1,238.00	1,733,200	
日本高純度化学	500	2,480.00	1,240,000	
タカラバイオ	4,000	1,544.00	6,176,000	
ＪＣＵ	600	7,500.00	4,500,000	
デクセリアルズ	4,900	1,288.00	6,311,200	
アース製薬	1,300	5,110.00	6,643,000	
イハラケミカル工業	2,600	1,055.00	2,743,000	
大成ラミック	500	3,145.00	1,572,500	
クミアイ化学工業	3,800	673.00	2,557,400	
日本農薬	4,200	700.00	2,940,000	
昭和シェル石油	16,700	1,084.00	18,102,800	
富士興産	2,600	495.00	1,287,000	
ニチレキ	2,300	915.00	2,104,500	
東燃ゼネラル石油	30,000	1,317.00	39,510,000	
ユシロ化学工業	1,000	1,452.00	1,452,000	
ビーピー・カストロール	900	1,651.00	1,485,900	
富士石油	4,300	394.00	1,694,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	700	1,752.00	1,226,400	
出光興産	8,800	3,555.00	31,284,000	
ＪＸホールディングス	206,500	527.00	108,825,500	
コスモエネルギーホールディングス	5,600	1,933.00	10,824,800	
横浜ゴム	11,200	2,196.00	24,595,200	
東洋ゴム工業	9,800	1,707.00	16,728,600	
ブリヂストン	62,800	4,549.00	285,677,200	
住友ゴム工業	17,400	1,811.00	31,511,400	
オカモト	6,000	1,029.00	6,174,000	
アキレス	1,500	1,826.00	2,739,000	
フコク	800	939.00	751,200	
ニッタ	1,700	2,990.00	5,083,000	
住友理工	3,400	1,159.00	3,940,600	
三ツ星ベルト	5,000	1,005.00	5,025,000	
バンドー化学	3,400	1,062.00	3,610,800	
旭硝子	92,000	918.00	84,456,000	
日本板硝子	8,500	855.00	7,267,500	
有沢製作所	3,100	789.00	2,445,900	
日本山村硝子	8,000	204.00	1,632,000	
日本電気硝子	38,000	705.00	26,790,000	
住友大阪セメント	35,000	461.00	16,135,000	
太平洋セメント	112,000	409.00	45,808,000	
日本ヒューム	1,800	710.00	1,278,000	
日本コンクリート工業	4,200	343.00	1,440,600	
三谷セキサン	900	2,553.00	2,297,700	
アジアパイルホールディングス	2,300	579.00	1,331,700	
東海カーボン	17,400	468.00	8,143,200	
日本カーボン	9,000	299.00	2,691,000	
東洋炭素	1,000	1,953.00	1,953,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	2,925.00	2,925,000	
ＴＯＴＯ	13,700	4,220.00	57,814,000	
日本碍子	23,500	2,455.00	57,692,500	
日本特殊陶業	16,000	2,584.00	41,344,000	
ＭＡＲＵＷＡ	700	3,715.00	2,600,500	
品川リフラクトリーズ	5,000	302.00	1,510,000	
黒崎播磨	4,000	464.00	1,856,000	
東京窯業	6,400	209.00	1,337,600	
ニッカトー	3,000	425.00	1,275,000	
フジミインコーポレーテッド	1,600	2,589.00	4,142,400	
ニチアス	10,000	1,099.00	10,990,000	
新日鐵住金	83,900	2,818.00	236,430,200	
神戸製鋼所	32,200	1,139.00	36,675,800	
中山製鋼所	2,100	781.00	1,640,100	

合同製鐵	1,000	1,885.00	1,885,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	50,800	2,142.00	108,813,600	
日新製鋼	8,500	1,573.00	13,370,500	
東京製鐵	9,400	1,043.00	9,804,200	
共英製鋼	2,000	2,146.00	4,292,000	
大和工業	3,700	3,320.00	12,284,000	
東京鐵鋼	4,000	474.00	1,896,000	
大阪製鐵	1,200	2,194.00	2,632,800	
淀川製鋼所	2,600	3,360.00	8,736,000	
東洋鋼鈑	4,400	463.00	2,037,200	
丸一鋼管	6,200	3,595.00	22,289,000	
モリ工業	600	2,319.00	1,391,400	
大同特殊鋼	31,000	570.00	17,670,000	
日本冶金工業	15,400	232.00	3,572,800	
山陽特殊製鋼	11,000	614.00	6,754,000	
愛知製鋼	1,100	4,870.00	5,357,000	
日立金属	18,900	1,677.00	31,695,300	
日本金属	1,000	1,306.00	1,306,000	
大平洋金属	12,000	417.00	5,004,000	
新日本電工	10,500	337.00	3,538,500	
栗本鐵工所	900	2,384.00	2,145,600	
日本製鋼所	6,100	2,026.00	12,358,600	
三菱製鋼	13,000	261.00	3,393,000	
日亜鋼業	4,600	285.00	1,311,000	
日本精線	2,000	611.00	1,222,000	
大紀アルミニウム工業所	3,000	531.00	1,593,000	
日本軽金属ホールディングス	42,100	286.00	12,040,600	
三井金属鉱業	51,000	381.00	19,431,000	
東邦亜鉛	10,000	635.00	6,350,000	
三菱マテリアル	11,600	3,840.00	44,544,000	
住友金属鉱山	48,000	1,618.50	77,688,000	
ＤＯＷＡホールディングス	21,000	944.00	19,824,000	
古河機械金属	29,000	238.00	6,902,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	1,966.00	4,128,600	
東邦チタニウム	3,100	994.00	3,081,400	
ＵＡＣＪ	24,000	321.00	7,704,000	
古河電気工業	6,200	4,105.00	25,451,000	
住友電気工業	70,100	1,880.00	131,788,000	
フジクラ	24,500	853.00	20,898,500	
昭和電線ホールディングス	22,000	91.00	2,002,000	
タツタ電線	3,500	461.00	1,613,500	
カナレ電気	600	2,258.00	1,354,800	
平河ヒューテック	1,000	1,119.00	1,119,000	
リョービ	11,000	511.00	5,621,000	
アーレスティ	2,200	1,180.00	2,596,000	
アサヒホールディングス	2,800	1,980.00	5,544,000	
東洋製罐グループホールディングス	13,200	2,070.00	27,324,000	
ホッカンホールディングス	5,000	545.00	2,725,000	
コロナ	1,100	1,164.00	1,280,400	
横河ブリッジホールディングス	3,300	1,404.00	4,633,200	
ＯＳＪＢホールディングス	6,100	251.00	1,531,100	
高田機工	5,000	243.00	1,215,000	
三和ホールディングス	18,500	1,085.00	20,072,500	
文化シヤッター	5,200	861.00	4,477,200	
三協立山	2,400	1,767.00	4,240,800	
アルインコ	1,300	1,050.00	1,365,000	
ＬＩＸＩＬグループ	25,900	2,770.00	71,743,000	
日本フイルコン	2,200	559.00	1,229,800	
ノーリツ	3,600	2,177.00	7,837,200	
長府製作所	2,000	2,724.00	5,448,000	

リンナイ	3,200	8,730.00	27,936,000	
ユニプレス	3,400	2,336.00	7,942,400	
ダイニチ工業	1,700	732.00	1,244,400	
日東精工	2,900	428.00	1,241,200	
岡部	3,900	996.00	3,884,400	
ジーテクト	1,900	2,151.00	4,086,900	
東プレ	3,600	2,922.00	10,519,200	
高周波熱錬	3,500	918.00	3,213,000	
東京製綱	1,300	1,819.00	2,364,700	
サンコール	2,200	554.00	1,218,800	
モリテックスチール	4,200	300.00	1,260,000	
パイオラックス	900	7,790.00	7,011,000	
日本発条	17,500	1,290.00	22,575,000	
アドバネクス	700	1,899.00	1,329,300	
三浦工業	7,600	1,727.00	13,125,200	
タクマ	6,000	1,022.00	6,132,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,000	3,855.00	11,565,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	700	2,155.00	1,508,500	
リブセンス	2,700	441.00	1,190,700	
ジャパンマテリアル	1,400	1,523.00	2,132,200	
ベクトル	1,500	1,248.00	1,872,000	
ウチヤマホールディングス	2,800	439.00	1,229,200	
キャリアリンク	1,600	735.00	1,176,000	
ＩＢＪ	1,900	600.00	1,140,000	
アサンテ	700	1,736.00	1,215,200	
Ｎ・フィールド	900	1,471.00	1,323,900	
アビスト	300	3,960.00	1,188,000	
ウィルグループ	1,700	709.00	1,205,300	
日本ビューホテル	900	1,350.00	1,215,000	
リクルートホールディングス	40,500	5,330.00	215,865,000	
ツガミ	5,000	692.00	3,460,000	
オークマ	12,000	1,215.00	14,580,000	
東芝機械	11,000	491.00	5,401,000	
アマダホールディングス	25,000	1,264.00	31,600,000	
アイダエンジニアリング	5,300	1,013.00	5,368,900	
滝澤鉄工所	8,000	187.00	1,496,000	
富士機械製造	5,700	1,533.00	8,738,100	
牧野フライス製作所	9,000	1,066.00	9,594,000	
オーエスジー	8,500	2,397.00	20,374,500	
ダイジェット工業	7,000	183.00	1,281,000	
旭ダイヤモンド工業	5,300	928.00	4,918,400	
ＤＭＧ森精機	11,000	1,717.00	18,887,000	
ソディック	4,700	1,085.00	5,099,500	
ディスコ	2,200	17,080.00	37,576,000	
日東工器	1,100	2,549.00	2,803,900	
日本郵政	48,400	1,474.00	71,341,600	
ベルシステム２４ホールディングス	2,800	1,000.00	2,800,000	
豊田自動織機	16,200	5,550.00	89,910,000	
豊和工業	2,000	667.00	1,334,000	
ＯＫＫ	10,000	126.00	1,260,000	
石川製作所	1,800	764.00	1,375,200	
東洋機械金属	2,600	573.00	1,489,800	
津田駒工業	8,000	178.00	1,424,000	
島精機製作所	2,400	3,835.00	9,204,000	
ＮＣホールディングス	1,300	937.00	1,218,100	
フリュー	400	4,660.00	1,864,000	
日阪製作所	2,500	921.00	2,302,500	
やまびこ	3,400	1,450.00	4,930,000	
ペガサスミシン製造	1,800	846.00	1,522,800	
ナブテスコ	9,700	3,215.00	31,185,500	

三井海洋開発	1,900	2,440.00	4,636,000	
レオン自動機	1,600	1,086.00	1,737,600	
ＳＭＣ	5,600	31,700.00	177,520,000	
新川	1,500	821.00	1,231,500	
ホソカワミクロン	3,000	822.00	2,466,000	
ユニオンツール	800	3,595.00	2,876,000	
オイレス工業	2,400	2,059.00	4,941,600	
日精エー・エス・ビー機械	600	2,404.00	1,442,400	
サトーホールディングス	2,300	2,499.00	5,747,700	
日本エアーテック	1,900	654.00	1,242,600	
日精樹脂工業	1,500	1,125.00	1,687,500	
小松製作所	85,800	2,801.00	240,325,800	
住友重機械工業	54,000	823.00	44,442,000	
日立建機	8,300	2,663.00	22,102,900	
巴工業	800	1,877.00	1,501,600	
井関農機	19,000	258.00	4,902,000	
ＴＯＷＡ	1,500	2,080.00	3,120,000	
丸山製作所	7,000	195.00	1,365,000	
北川鉄工所	900	2,460.00	2,214,000	
シンニッタン	200	710.00	142,000	
ローツェ	700	2,535.00	1,774,500	
クボタ	89,300	1,850.00	165,205,000	
荏原実業	900	1,370.00	1,233,000	
東洋エンジニアリング	12,000	270.00	3,240,000	
三菱化工機	6,000	224.00	1,344,000	
月島機械	3,500	1,296.00	4,536,000	
帝国電機製作所	1,400	1,047.00	1,465,800	
新東工業	4,200	1,037.00	4,355,400	
澁谷工業	1,600	2,913.00	4,660,800	
アイチコーポレーション	2,600	886.00	2,303,600	
小森コーポレーション	4,500	1,522.00	6,849,000	
鶴見製作所	1,400	1,540.00	2,156,000	
住友精密工業	3,000	368.00	1,104,000	
荏原製作所	8,200	3,365.00	27,593,000	
石井鐵工所	200	1,785.00	357,000	
西島製作所	1,800	1,145.00	2,061,000	
北越工業	2,000	975.00	1,950,000	
千代田化工建設	14,000	720.00	10,080,000	
ダイキン工業	24,200	10,720.00	259,424,000	
オルガノ	4,000	498.00	1,992,000	
トーヨーカネツ	9,000	318.00	2,862,000	
栗田工業	10,500	2,735.00	28,717,500	
椿本チエイン	11,000	987.00	10,857,000	
日機装	6,100	1,216.00	7,417,600	
新興プランテック	4,100	931.00	3,817,100	
アネスト岩田	3,200	1,094.00	3,500,800	
ダイフク	8,900	2,706.00	24,083,400	
加藤製作所	1,000	3,065.00	3,065,000	
タダノ	9,300	1,460.00	13,578,000	
フジテック	5,200	1,310.00	6,812,000	
ＣＫＤ	5,300	1,496.00	7,928,800	
キトー	2,200	1,251.00	2,752,200	
平和	5,500	2,937.00	16,153,500	
理想科学工業	1,800	2,122.00	3,819,600	
ＳＡＮＫＹＯ	4,900	3,965.00	19,428,500	
日本金銭機械	1,600	1,504.00	2,406,400	
マースエンジニアリング	1,000	2,297.00	2,297,000	
福島工業	1,100	3,715.00	4,086,500	
ダイコク電機	700	1,867.00	1,306,900	
竹内製作所	3,200	2,326.00	7,443,200	

アマノ	5,500	2,278.00	12,529,000	
ＪＵＫＩ	2,800	1,283.00	3,592,400	
サンデンホールディングス	11,000	387.00	4,257,000	
蛇の目ミシン工業	1,700	796.00	1,353,200	
ブラザー工業	23,000	2,054.00	47,242,000	
マックス	3,000	1,527.00	4,581,000	
モリタホールディングス	3,100	1,540.00	4,774,000	
グローリー	5,700	3,810.00	21,717,000	
新晃工業	1,200	1,461.00	1,753,200	
大和冷機工業	2,900	1,026.00	2,975,400	
セガサミーホールディングス	17,600	1,678.00	29,532,800	
日本ピストンリング	700	2,361.00	1,652,700	
リケン	800	4,285.00	3,428,000	
ＴＰＲ	2,000	3,660.00	7,320,000	
ツバキ・ナカシマ	2,000	1,944.00	3,888,000	
ホシザキ	3,900	8,710.00	33,969,000	
大豊工業	1,400	1,540.00	2,156,000	
日本精工	36,500	1,616.00	58,984,000	
ＮＴＮ	41,000	546.00	22,386,000	
ジェイテクト	18,900	1,886.00	35,645,400	
不二越	18,000	614.00	11,052,000	
ミネベアミツミ	32,200	1,411.00	45,434,200	
日本トムソン	5,700	560.00	3,192,000	
ＴＨＫ	12,500	2,982.00	37,275,000	
ユーシン精機	800	2,924.00	2,339,200	
前澤給装工業	800	1,529.00	1,223,200	
イーグル工業	1,900	1,609.00	3,057,100	
日本ピラー工業	1,800	1,569.00	2,824,200	
キッツ	8,500	744.00	6,324,000	
日立製作所	426,000	626.70	266,974,200	
東芝	397,000	186.30	73,961,100	
三菱電機	189,500	1,681.00	318,549,500	
富士電機	54,000	629.00	33,966,000	
東洋電機製造	800	1,734.00	1,387,200	
安川電機	20,600	2,145.00	44,187,000	
シンフォニア　テクノロジー	11,000	306.00	3,366,000	
明電舎	16,000	381.00	6,096,000	
オリジン電気	4,000	317.00	1,268,000	
山洋電気	5,000	884.00	4,420,000	
デンヨー	1,600	1,785.00	2,856,000	
日立工機	4,800	867.00	4,161,600	
三櫻工業	2,300	864.00	1,987,200	
マキタ	11,600	7,740.00	89,784,000	
東芝テック	11,000	601.00	6,611,000	
芝浦メカトロニクス	5,000	282.00	1,410,000	
マブチモーター	5,000	6,230.00	31,150,000	
日本電産	23,000	10,690.00	245,870,000	
東光高岳	900	2,197.00	1,977,300	
ダブル・スコープ	1,700	1,842.00	3,131,400	
ダイヘン	10,000	721.00	7,210,000	
田淵電機	3,200	346.00	1,107,200	
ヤーマン	200	6,160.00	1,232,000	
ＪＶＣケンウッド	13,000	304.00	3,952,000	
日新電機	3,600	1,373.00	4,942,800	
大崎電気工業	4,000	1,091.00	4,364,000	
オムロン	18,900	4,855.00	91,759,500	
日東工業	2,600	1,585.00	4,121,000	
ＩＤＥＣ	2,300	1,187.00	2,730,100	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	34,000	501.00	17,034,000	
サクサホールディングス	5,000	231.00	1,155,000	

メルコホールディングス	1,000	3,355.00	3,355,000	
日本電気	244,000	276.00	67,344,000	
富士通	171,000	659.80	112,825,800	
沖電気工業	7,700	1,592.00	12,258,400	
岩崎通信機	14,000	91.00	1,274,000	
電気興業	5,000	562.00	2,810,000	
サンケン電気	10,000	514.00	5,140,000	
ナカヨ	3,000	420.00	1,260,000	
アイホン	1,000	1,858.00	1,858,000	
ルネサスエレクトロニクス	9,200	1,019.00	9,374,800	
セイコーエプソン	26,400	2,560.00	67,584,000	
ワコム	13,800	409.00	5,644,200	
アルバック	3,300	5,110.00	16,863,000	
ＥＩＺＯ	1,800	3,265.00	5,877,000	
ジャパンディスプレイ	33,200	282.00	9,362,400	
日本信号	4,900	1,063.00	5,208,700	
京三製作所	4,000	409.00	1,636,000	
能美防災	2,000	1,492.00	2,984,000	
ホーチキ	1,300	1,416.00	1,840,800	
エレコム	1,500	2,026.00	3,039,000	
日本無線	1,100	1,414.00	1,555,400	
パナソニック	202,900	1,247.00	253,016,300	
アンリツ	12,900	870.00	11,223,000	
富士通ゼネラル	6,000	2,160.00	12,960,000	
日立国際電気	4,600	2,385.00	10,971,000	
ソニー	125,400	3,508.00	439,903,200	
ＴＤＫ	10,000	7,840.00	78,400,000	
帝国通信工業	7,000	188.00	1,316,000	
タムラ製作所	7,000	455.00	3,185,000	
アルプス電気	16,400	3,465.00	56,826,000	
池上通信機	3,000	154.00	462,000	
パイオニア	26,700	229.00	6,114,300	
日本電波工業	1,700	846.00	1,438,200	
鈴木	2,400	575.00	1,380,000	
日本トリム	400	4,040.00	1,616,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	3,550.00	3,195,000	
フォスター電機	2,100	1,919.00	4,029,900	
クラリオン	9,000	436.00	3,924,000	
ＳＭＫ	5,000	422.00	2,110,000	
ヨコオ	1,300	1,320.00	1,716,000	
ティアック	26,000	45.00	1,170,000	
ホシデン	5,400	1,005.00	5,427,000	
ヒロセ電機	2,900	14,800.00	42,920,000	
日本航空電子工業	6,000	1,539.00	9,234,000	
ＴＯＡ	2,100	1,009.00	2,118,900	
日立マクセル	2,600	2,247.00	5,842,200	
古野電気	2,300	770.00	1,771,000	
ユニデンホールディングス	7,000	168.00	1,176,000	
アルパイン	4,200	1,679.00	7,051,800	
スミダコーポレーション	1,500	1,299.00	1,948,500	
アイコム	1,000	2,379.00	2,379,000	
リオン	800	1,574.00	1,259,200	
船井電機	2,000	950.00	1,900,000	
横河電機	19,300	1,727.00	33,331,100	
新電元工業	7,000	480.00	3,360,000	
アズビル	5,400	3,555.00	19,197,000	
日本光電工業	7,400	2,483.00	18,374,200	
チノー	1,100	1,219.00	1,340,900	
共和電業	3,100	449.00	1,391,900	
日本電子材料	2,000	634.00	1,268,000	

堀場製作所	3,500	6,240.00	21,840,000	
アドバンテスト	12,100	1,977.00	23,921,700	
小野測器	1,400	877.00	1,227,800	
エスペック	1,600	1,285.00	2,056,000	
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	1,600	843.00	1,348,800	
キーエンス	8,000	44,250.00	354,000,000	
日置電機	900	2,228.00	2,005,200	
シスメックス	13,800	6,390.00	88,182,000	
日本マイクロニクス	3,300	901.00	2,973,300	
メガチップス	1,700	2,744.00	4,664,800	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	4,995.00	4,995,000	
イマジカ・ロボット　ホールディングス	1,800	794.00	1,429,200	
澤藤電機	6,000	250.00	1,500,000	
デンソー	43,800	5,085.00	222,723,000	
コーセル	2,500	1,396.00	3,490,000	
イリソ電子工業	600	7,140.00	4,284,000	
オプテックスグループ	1,300	3,145.00	4,088,500	
千代田インテグレ	900	2,407.00	2,166,300	
レーザーテック	2,100	2,889.00	6,066,900	
スタンレー電気	12,700	3,160.00	40,132,000	
岩崎電気	6,000	174.00	1,044,000	
ウシオ電機	10,800	1,456.00	15,724,800	
岡谷電機産業	3,000	420.00	1,260,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	2,300	610.00	1,403,000	
日本セラミック	1,500	2,429.00	3,643,500	
遠藤照明	1,400	935.00	1,309,000	
古河電池	2,000	759.00	1,518,000	
双信電機	4,200	306.00	1,285,200	
山一電機	1,700	1,543.00	2,623,100	
図研	1,200	1,293.00	1,551,600	
日本電子	6,000	537.00	3,222,000	
カシオ計算機	14,300	1,553.00	22,207,900	
ファナック	18,000	22,345.00	402,210,000	
日本シイエムケイ	3,800	656.00	2,492,800	
エンプラス	800	3,525.00	2,820,000	
ローム	8,600	7,440.00	63,984,000	
浜松ホトニクス	13,900	3,380.00	46,982,000	
三井ハイテック	2,300	890.00	2,047,000	
新光電気工業	6,700	784.00	5,252,800	
京セラ	29,200	6,228.00	181,857,600	
協栄産業	8,000	172.00	1,376,000	
太陽誘電	8,600	1,530.00	13,158,000	
村田製作所	18,600	16,390.00	304,854,000	
ユーシン	2,400	803.00	1,927,200	
双葉電子工業	2,900	2,018.00	5,852,200	
日東電工	13,400	9,528.00	127,675,200	
東海理化電機製作所	4,700	2,232.00	10,490,400	
ニチコン	5,600	1,063.00	5,952,800	
日本ケミコン	15,000	319.00	4,785,000	
ＫＯＡ	2,500	1,331.00	3,327,500	
三井造船	64,000	178.00	11,392,000	
日立造船	14,100	645.00	9,094,500	
三菱重工業	298,000	445.10	132,639,800	
川崎重工業	138,000	355.00	48,990,000	
ＩＨＩ	136,000	339.00	46,104,000	
名村造船所	5,300	793.00	4,202,900	
サノヤスホールディングス	4,500	298.00	1,341,000	
日本車輌製造	6,000	304.00	1,824,000	
ニチユ三菱フォークリフト	2,000	717.00	1,434,000	
ＦＰＧ	6,300	1,113.00	7,011,900	

島根銀行	900	1,410.00	1,269,000	
じもとホールディングス	12,600	196.00	2,469,600	
全国保証	4,900	3,620.00	17,738,000	
めぶきフィナンシャルグループ	84,500	488.00	41,236,000	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2,500	4,000.00	10,000,000	
九州フィナンシャルグループ	28,700	794.00	22,787,800	
かんぽ生命保険	6,600	2,780.00	18,348,000	
ゆうちょ銀行	49,600	1,425.00	70,680,000	
富山第一銀行	4,500	551.00	2,479,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	114,800	613.90	70,475,720	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,900	1,259.00	14,982,100	
日産自動車	212,600	1,116.50	237,367,900	
いすゞ自動車	51,500	1,540.50	79,335,750	
トヨタ自動車	215,900	6,432.00	1,388,668,800	
日野自動車	25,300	1,321.00	33,421,300	
三菱自動車工業	65,100	681.00	44,333,100	
エフテック	900	1,339.00	1,205,100	
レシップホールディングス	300	854.00	256,200	
ＧＭＢ	1,100	1,419.00	1,560,900	
ファルテック	900	1,409.00	1,268,100	
武蔵精密工業	2,100	2,816.00	5,913,600	
日産車体	7,800	1,089.00	8,494,200	
新明和工業	7,000	1,178.00	8,246,000	
極東開発工業	3,500	1,785.00	6,247,500	
日信工業	4,000	1,985.00	7,940,000	
トピー工業	1,500	3,255.00	4,882,500	
ティラド	7,000	311.00	2,177,000	
曙ブレーキ工業	8,200	284.00	2,328,800	
タチエス	3,000	2,101.00	6,303,000	
ＮＯＫ	8,600	2,555.00	21,973,000	
フタバ産業	5,400	793.00	4,282,200	
ＫＹＢ	20,000	628.00	12,560,000	
市光工業	4,000	519.00	2,076,000	
大同メタル工業	2,200	1,031.00	2,268,200	
プレス工業	9,400	562.00	5,282,800	
ミクニ	3,000	433.00	1,299,000	
カルソニックカンセイ	12,000	1,285.00	15,420,000	
太平洋工業	3,600	1,448.00	5,212,800	
ケーヒン	4,100	1,971.00	8,081,100	
河西工業	2,400	1,386.00	3,326,400	
アイシン精機	16,300	5,660.00	92,258,000	
マツダ	56,200	1,588.50	89,273,700	
今仙電機製作所	1,600	1,008.00	1,612,800	
本田技研工業	159,800	3,574.00	571,125,200	
スズキ	35,200	4,404.00	155,020,800	
富士重工業	55,100	4,282.00	235,938,200	
安永	700	1,658.00	1,160,600	
ヤマハ発動機	25,100	2,587.00	64,933,700	
ショーワ	4,600	967.00	4,448,200	
小糸製作所	10,600	5,820.00	61,692,000	
ＴＢＫ	2,400	529.00	1,269,600	
エクセディ	2,400	3,190.00	7,656,000	
ミツバ	3,300	2,249.00	7,421,700	
豊田合成	5,700	2,842.00	16,199,400	
愛三工業	3,100	977.00	3,028,700	
ヨロズ	1,700	1,756.00	2,985,200	
エフ・シー・シー	2,900	2,254.00	6,536,600	
新家工業	8,000	179.00	1,432,000	
シマノ	7,200	16,570.00	119,304,000	

タカタ	3,200	548.00	1,753,600	
テイ・エス　テック	4,100	2,918.00	11,963,800	
ジャムコ	1,000	2,624.00	2,624,000	
小野建	1,500	1,421.00	2,131,500	
はるやまホールディングス	1,400	982.00	1,374,800	
ノジマ	2,000	1,406.00	2,812,000	
佐鳥電機	1,600	798.00	1,276,800	
カッパ・クリエイト	2,500	1,279.00	3,197,500	
エコートレーディング	1,800	704.00	1,267,200	
伯東	1,200	1,077.00	1,292,400	
コンドーテック	1,400	874.00	1,223,600	
ライトオン	1,300	983.00	1,277,900	
ナガイレーベン	2,500	2,471.00	6,177,500	
ジーンズメイト	4,200	259.00	1,087,800	
三菱食品	1,900	3,470.00	6,593,000	
良品計画	2,300	22,430.00	51,589,000	
三城ホールディングス	2,600	476.00	1,237,600	
松田産業	1,300	1,596.00	2,074,800	
第一興商	2,900	4,735.00	13,731,500	
メディパルホールディングス	17,500	1,838.00	32,165,000	
アドヴァン	1,800	1,159.00	2,086,200	
萩原電気	600	2,177.00	1,306,200	
アルビス	500	3,255.00	1,627,500	
アズワン	1,400	5,010.00	7,014,000	
尾家産業	1,100	1,164.00	1,280,400	
シモジマ	1,100	1,199.00	1,318,900	
ドウシシャ	2,100	2,130.00	4,473,000	
コナカ	2,200	600.00	1,320,000	
高速	1,100	1,115.00	1,226,500	
ハウス　オブ　ローゼ	800	1,550.00	1,240,000	
イオン北海道	2,000	617.00	1,234,000	
ヒマラヤ	1,400	857.00	1,199,800	
コーナン商事	2,500	2,182.00	5,455,000	
黒田電気	2,400	2,285.00	5,484,000	
ネットワンシステムズ	7,600	883.00	6,710,800	
エコス	1,000	1,210.00	1,210,000	
ワタミ	2,100	1,144.00	2,402,400	
マルシェ	1,500	840.00	1,260,000	
ドンキホーテホールディングス	11,300	3,935.00	44,465,500	
丸文	1,800	735.00	1,323,000	
西松屋チェーン	3,100	1,300.00	4,030,000	
ゼンショーホールディングス	9,100	1,894.00	17,235,400	
ハピネット	1,500	1,458.00	2,187,000	
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,677.00	1,844,700	
橋本総業ホールディングス	800	1,502.00	1,201,600	
日本ライフライン	1,500	2,040.00	3,060,000	
サイゼリヤ	2,900	2,640.00	7,656,000	
エクセル	800	1,499.00	1,199,200	
ＶＴホールディングス	5,900	524.00	3,091,600	
アルゴグラフィックス	800	2,463.00	1,970,400	
魚力	900	1,300.00	1,170,000	
ＩＤＯＭ	4,700	750.00	3,525,000	
日本エム・ディ・エム	1,400	765.00	1,071,000	
ユナイテッドアローズ	2,300	3,495.00	8,038,500	
進和	1,000	1,783.00	1,783,000	
エスケイジャパン	4,000	307.00	1,228,000	
ハイデイ日高	1,600	2,890.00	4,624,000	
シークス	1,300	4,240.00	5,512,000	
京都きもの友禅	1,200	995.00	1,194,000	
コロワイド	5,800	1,866.00	10,822,800	

ピーシーデポコーポレーション	2,300	559.00	1,285,700	
田中商事	1,700	724.00	1,230,800	
オーハシテクニカ	1,000	1,439.00	1,439,000	
壱番屋	1,600	3,775.00	6,040,000	
白銅	800	1,786.00	1,428,800	
トップカルチャー	2,500	482.00	1,205,000	
ＰＬＡＮＴ	1,000	1,198.00	1,198,000	
スギホールディングス	3,800	5,350.00	20,330,000	
島津製作所	22,900	1,879.00	43,029,100	
ＪＭＳ	4,000	325.00	1,300,000	
長野計器	1,700	705.00	1,198,500	
ブイ・テクノロジー	400	17,340.00	6,936,000	
スター精密	3,100	1,671.00	5,180,100	
東京計器	6,000	240.00	1,440,000	
オーバル	3,800	272.00	1,033,600	
東京精密	3,400	3,835.00	13,039,000	
マニー	2,400	2,719.00	6,525,600	
ニコン	31,000	1,707.00	52,917,000	
トプコン	8,900	2,023.00	18,004,700	
オリンパス	28,300	3,940.00	111,502,000	
理研計器	1,600	1,636.00	2,617,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	3,600	7,640.00	27,504,000	
キヤノン電子	1,600	1,786.00	2,857,600	
タムロン	1,600	2,115.00	3,384,000	
ＨＯＹＡ	36,500	5,060.00	184,690,000	
ノーリツ鋼機	1,800	971.00	1,747,800	
エー・アンド・デイ	2,600	468.00	1,216,800	
キヤノン	95,600	3,289.00	314,428,400	
リコー	53,400	1,002.00	53,506,800	
シチズン時計	19,400	738.00	14,317,200	
リズム時計工業	7,000	187.00	1,309,000	
大研医器	1,600	800.00	1,280,000	
メニコン	1,200	3,520.00	4,224,000	
スノーピーク	400	2,841.00	1,136,400	
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,155.00	7,063,500	
ＳＨＯ‐ＢＩ	2,900	439.00	1,273,100	
ニホンフラッシュ	900	1,283.00	1,154,700	
前田工繊	1,800	1,326.00	2,386,800	
アートネイチャー	1,900	748.00	1,421,200	
ダンロップスポーツ	1,100	1,039.00	1,142,900	
バンダイナムコホールディングス	19,600	3,110.00	60,956,000	
共立印刷	3,800	337.00	1,280,600	
ＳＨＯＥＩ	800	2,556.00	2,044,800	
フランスベッドホールディングス	2,200	940.00	2,068,000	
マーベラス	3,000	964.00	2,892,000	
パイロットコーポレーション	3,100	4,590.00	14,229,000	
萩原工業	500	2,616.00	1,308,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,200	1,610.00	5,152,000	
トッパン・フォームズ	3,200	1,070.00	3,424,000	
フジシールインターナショナル	4,000	2,271.00	9,084,000	
タカラトミー	6,900	1,198.00	8,266,200	
廣済堂	3,000	391.00	1,173,000	
Ａｓ－ｍｅエステール	1,700	692.00	1,176,400	
アーク	9,800	108.00	1,058,400	
レック	600	4,535.00	2,721,000	
タカノ	1,400	999.00	1,398,600	
プロネクサス	1,700	1,235.00	2,099,500	
ホクシン	5,900	220.00	1,298,000	
大建工業	1,200	2,176.00	2,611,200	

きもと	5,000	249.00	1,245,000	
凸版印刷	50,000	1,129.00	56,450,000	
大日本印刷	51,000	1,186.00	60,486,000	
図書印刷	3,000	482.00	1,446,000	
共同印刷	5,000	384.00	1,920,000	
日本写真印刷	3,000	3,325.00	9,975,000	
光村印刷	5,000	267.00	1,335,000	
藤森工業	1,400	3,020.00	4,228,000	
宝印刷	900	1,579.00	1,421,100	
前澤化成工業	1,200	1,209.00	1,450,800	
アシックス	17,600	1,956.00	34,425,600	
ツツミ	700	2,116.00	1,481,200	
ＪＳＰ	900	2,584.00	2,325,600	
ニチハ	2,500	3,155.00	7,887,500	
エフピコ	1,600	5,150.00	8,240,000	
小松ウオール工業	600	1,943.00	1,165,800	
ヤマハ	12,000	2,932.00	35,184,000	
河合楽器製作所	700	2,300.00	1,610,000	
クリナップ	2,100	834.00	1,751,400	
ピジョン	10,700	3,125.00	33,437,500	
天馬	1,200	2,145.00	2,574,000	
キングジム	1,500	857.00	1,285,500	
リンテック	4,200	2,475.00	10,395,000	
信越ポリマー	3,600	835.00	3,006,000	
東リ	4,400	413.00	1,817,200	
イトーキ	3,700	728.00	2,693,600	
任天堂	10,900	23,095.00	251,735,500	
三菱鉛筆	1,500	5,640.00	8,460,000	
松風	900	1,369.00	1,232,100	
タカラスタンダード	3,700	1,914.00	7,081,800	
コクヨ	9,200	1,557.00	14,324,400	
ニフコ	3,300	5,710.00	18,843,000	
グローブライド	900	1,801.00	1,620,900	
岡村製作所	6,200	1,021.00	6,330,200	
日本バルカー工業	1,400	1,843.00	2,580,200	
ＭＵＴＯＨホールディングス	5,000	268.00	1,340,000	
伊藤忠商事	128,400	1,629.00	209,163,600	
丸紅	172,500	730.40	125,994,000	
スクロール	3,600	352.00	1,267,200	
ヨンドシーホールディングス	1,300	2,557.00	3,324,100	
三陽商会	10,000	172.00	1,720,000	
長瀬産業	10,500	1,649.00	17,314,500	
蝶理	1,100	1,998.00	2,197,800	
豊田通商	19,500	3,335.00	65,032,500	
オンワードホールディングス	12,000	858.00	10,296,000	
三共生興	2,900	414.00	1,200,600	
兼松	37,000	195.00	7,215,000	
美津濃	10,000	605.00	6,050,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	7,700	7,050.00	54,285,000	
三井物産	158,500	1,703.00	269,925,500	
日本紙パルプ商事	9,000	372.00	3,348,000	
東京エレクトロン	11,800	11,180.00	131,924,000	
日立ハイテクノロジーズ	6,100	4,815.00	29,371,500	
カメイ	2,300	1,355.00	3,116,500	
東都水産	300	1,964.00	589,200	
スターゼン	700	4,885.00	3,419,500	
セイコーホールディングス	13,000	464.00	6,032,000	
山善	6,700	1,064.00	7,128,800	
住友商事	110,400	1,494.50	164,992,800	

日本ユニシス	4,800	1,520.00	7,296,000	
内田洋行	900	2,556.00	2,300,400	
三菱商事	131,500	2,609.50	343,149,250	
第一実業	4,000	783.00	3,132,000	
キヤノンマーケティングジャパン	5,000	2,280.00	11,400,000	
西華産業	6,000	364.00	2,184,000	
佐藤商事	1,600	880.00	1,408,000	
菱洋エレクトロ	1,700	1,586.00	2,696,200	
東京産業	2,600	474.00	1,232,400	
ユアサ商事	1,700	3,280.00	5,576,000	
神鋼商事	500	2,467.00	1,233,500	
小林産業	4,700	277.00	1,301,900	
阪和興業	18,000	779.00	14,022,000	
カナデン	1,700	1,048.00	1,781,600	
菱電商事	3,000	735.00	2,205,000	
ニプロ	12,300	1,379.00	16,961,700	
フルサト工業	1,000	1,737.00	1,737,000	
岩谷産業	19,000	665.00	12,635,000	
すてきナイスグループ	8,000	152.00	1,216,000	
昭光通商	12,000	101.00	1,212,000	
兼松エレクトロニクス	1,100	2,577.00	2,834,700	
三愛石油	4,700	894.00	4,201,800	
稲畑産業	4,200	1,511.00	6,346,200	
明和産業	3,100	425.00	1,317,500	
ゴールドウイン	800	5,750.00	4,600,000	
ユニ・チャーム	37,700	2,444.50	92,157,650	
デサント	4,200	1,247.00	5,237,400	
キング	2,500	415.00	1,037,500	
ワキタ	3,700	1,072.00	3,966,400	
ヤマトインターナショナル	3,000	413.00	1,239,000	
東邦ホールディングス	5,600	2,479.00	13,882,400	
サンゲツ	6,000	1,929.00	11,574,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,800	744.00	2,083,200	
シナネンホールディングス	800	2,298.00	1,838,400	
伊藤忠エネクス	3,900	944.00	3,681,600	
サンリオ	5,400	2,190.00	11,826,000	
サンワ　テクノス	1,300	1,081.00	1,405,300	
リョーサン	2,600	3,675.00	9,555,000	
新光商事	1,900	1,350.00	2,565,000	
トーホー	800	2,535.00	2,028,000	
三信電気	1,900	1,350.00	2,565,000	
東陽テクニカ	2,300	1,019.00	2,343,700	
モスフードサービス	2,300	3,330.00	7,659,000	
加賀電子	1,600	2,042.00	3,267,200	
三益半導体工業	1,400	1,760.00	2,464,000	
ソーダニッカ	2,400	520.00	1,248,000	
立花エレテック	1,200	1,322.00	1,586,400	
木曽路	2,100	2,369.00	4,974,900	
サトレストランシステムズ	2,100	865.00	1,816,500	
千趣会	3,200	794.00	2,540,800	
ケーヨー	3,000	585.00	1,755,000	
上新電機	4,000	1,089.00	4,356,000	
日本瓦斯	3,200	3,345.00	10,704,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,012.00	5,834,800	
東天紅	7,000	169.00	1,183,000	
いなげや	1,900	1,567.00	2,977,300	
島忠	4,500	2,844.00	12,798,000	
チヨダ	2,100	2,747.00	5,768,700	
ライフコーポレーション	1,300	3,315.00	4,309,500	
リンガーハット	2,000	2,293.00	4,586,000	

テンアライド	3,200	394.00	1,260,800	
ＡＯＫＩホールディングス	3,500	1,421.00	4,973,500	
オークワ	2,000	1,118.00	2,236,000	
コメリ	2,700	2,740.00	7,398,000	
青山商事	3,700	4,150.00	15,355,000	
しまむら	2,000	14,520.00	29,040,000	
はせがわ	2,700	447.00	1,206,900	
高島屋	29,000	1,000.00	29,000,000	
松屋	3,800	1,007.00	3,826,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	9,000	1,870.00	16,830,000	
近鉄百貨店	7,000	357.00	2,499,000	
パルコ	1,700	1,138.00	1,934,600	
丸井グループ	18,400	1,561.00	28,722,400	
クレディセゾン	13,300	2,175.00	28,927,500	
アクシアル　リテイリング	1,400	4,500.00	6,300,000	
イオン	72,100	1,703.00	122,786,300	
イズミ	3,500	4,905.00	17,167,500	
平和堂	3,600	2,680.00	9,648,000	
フジ	1,900	2,401.00	4,561,900	
ヤオコー	2,000	4,560.00	9,120,000	
ゼビオホールディングス	2,400	1,795.00	4,308,000	
ケーズホールディングス	8,100	2,088.00	16,912,800	
ＰＡＬＴＡＣ	2,800	3,135.00	8,778,000	
三谷産業	3,300	379.00	1,250,700	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,900	637.00	1,210,300	
新生銀行	167,000	209.00	34,903,000	
あおぞら銀行	111,000	417.00	46,287,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,328,400	767.80	1,019,945,520	
りそなホールディングス	205,100	629.40	129,089,940	
三井住友トラスト・ホールディングス	36,600	4,225.00	154,635,000	
三井住友フィナンシャルグループ	140,400	4,549.00	638,679,600	
第四銀行	21,000	537.00	11,277,000	
北越銀行	1,900	2,744.00	5,213,600	
千葉銀行	68,000	788.00	53,584,000	
群馬銀行	39,000	670.00	26,130,000	
武蔵野銀行	2,800	3,710.00	10,388,000	
千葉興業銀行	4,800	630.00	3,024,000	
筑波銀行	7,300	353.00	2,576,900	
七十七銀行	27,000	538.00	14,526,000	
青森銀行	14,000	394.00	5,516,000	
秋田銀行	11,000	368.00	4,048,000	
山形銀行	10,000	495.00	4,950,000	
岩手銀行	1,100	4,785.00	5,263,500	
東邦銀行	16,000	441.00	7,056,000	
東北銀行	9,000	160.00	1,440,000	
みちのく銀行	9,000	191.00	1,719,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	71,000	505.00	35,855,000	
静岡銀行	48,000	1,018.00	48,864,000	
十六銀行	24,000	413.00	9,912,000	
スルガ銀行	17,900	2,562.00	45,859,800	
八十二銀行	33,800	723.00	24,437,400	
山梨中央銀行	11,000	557.00	6,127,000	
大垣共立銀行	23,000	453.00	10,419,000	
福井銀行	15,000	284.00	4,260,000	
北國銀行	19,000	479.00	9,101,000	
清水銀行	600	3,780.00	2,268,000	
富山銀行	300	4,180.00	1,254,000	
滋賀銀行	16,000	634.00	10,144,000	
南都銀行	1,700	4,730.00	8,041,000	
百五銀行	16,000	520.00	8,320,000	

京都銀行	31,000	964.00	29,884,000	
紀陽銀行	6,600	1,923.00	12,691,800	
三重銀行	800	2,531.00	2,024,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,700	2,053.00	24,020,100	
広島銀行	52,000	550.00	28,600,000	
山陰合同銀行	10,500	1,029.00	10,804,500	
中国銀行	12,400	1,813.00	22,481,200	
鳥取銀行	600	1,936.00	1,161,600	
伊予銀行	18,700	842.00	15,745,400	
百十四銀行	19,000	401.00	7,619,000	
四国銀行	14,000	315.00	4,410,000	
阿波銀行	15,000	760.00	11,400,000	
大分銀行	10,000	450.00	4,500,000	
宮崎銀行	12,000	378.00	4,536,000	
佐賀銀行	11,000	313.00	3,443,000	
十八銀行	11,000	364.00	4,004,000	
沖縄銀行	1,700	4,230.00	7,191,000	
琉球銀行	3,600	1,663.00	5,986,800	
セブン銀行	65,700	331.00	21,746,700	
みずほフィナンシャルグループ	2,380,100	210.40	500,773,040	
山口フィナンシャルグループ	17,000	1,321.00	22,457,000	
アクリーティブ	2,500	398.00	995,000	
芙蓉総合リース	2,000	5,300.00	10,600,000	
興銀リース	3,300	2,502.00	8,256,600	
東京センチュリー	3,500	3,900.00	13,650,000	
ＳＢＩホールディングス	19,800	1,547.00	30,630,600	
日本証券金融	7,700	632.00	4,866,400	
アイフル	29,400	355.00	10,437,000	
ポケットカード	1,200	607.00	728,400	
長野銀行	700	2,022.00	1,415,400	
名古屋銀行	1,500	4,365.00	6,547,500	
北洋銀行	28,600	479.00	13,699,400	
愛知銀行	600	7,120.00	4,272,000	
第三銀行	1,000	1,757.00	1,757,000	
中京銀行	700	2,305.00	1,613,500	
大光銀行	6,000	252.00	1,512,000	
愛媛銀行	2,100	1,419.00	2,979,900	
みなと銀行	1,600	2,438.00	3,900,800	
京葉銀行	14,000	548.00	7,672,000	
関西アーバン銀行	2,400	1,579.00	3,789,600	
栃木銀行	9,700	593.00	5,752,100	
北日本銀行	500	3,170.00	1,585,000	
東和銀行	33,000	127.00	4,191,000	
福島銀行	19,000	97.00	1,843,000	
大東銀行	9,000	172.00	1,548,000	
リコーリース	1,400	3,650.00	5,110,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,200	2,124.00	23,788,800	
アコム	35,200	494.00	17,388,800	
ジャックス	10,000	508.00	5,080,000	
オリエントコーポレーション	37,900	215.00	8,148,500	
日立キャピタル	4,100	2,945.00	12,074,500	
アプラスフィナンシャル	10,500	119.00	1,249,500	
オリックス	124,100	1,762.00	218,664,200	
三菱ＵＦＪリース	44,500	620.00	27,590,000	
ジャフコ	2,900	3,940.00	11,426,000	
トモニホールディングス	14,400	654.00	9,417,600	
大和証券グループ本社	164,000	711.00	116,604,000	
野村ホールディングス	358,400	750.00	268,800,000	
岡三証券グループ	15,000	758.00	11,370,000	
丸三証券	5,600	962.00	5,387,200	

東洋証券	6,000	272.00	1,632,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,100	647.00	13,004,700	
光世証券	7,000	191.00	1,337,000	
水戸証券	5,400	312.00	1,684,800	
いちよし証券	3,900	900.00	3,510,000	
松井証券	10,000	933.00	9,330,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	36,600	4,281.00	156,684,600	
だいこう証券ビジネス	2,000	639.00	1,278,000	
日本取引所グループ	54,500	1,602.00	87,309,000	
マネックスグループ	18,800	294.00	5,527,200	
カブドットコム証券	13,100	391.00	5,122,100	
極東証券	2,400	1,681.00	4,034,400	
岩井コスモホールディングス	1,700	1,107.00	1,881,900	
藍澤證券	3,300	647.00	2,135,100	
フィデアホールディングス	17,000	217.00	3,689,000	
池田泉州ホールディングス	18,600	521.00	9,690,600	
アニコム　ホールディングス	1,200	2,260.00	2,712,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	52,400	3,845.00	201,478,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	16,800	2,017.00	33,885,600	
マネーパートナーズグループ	1,700	531.00	902,700	
第一生命ホールディングス	105,700	2,206.50	233,227,050	
東京海上ホールディングス	71,000	5,089.00	361,319,000	
イー・ギャランティ	500	2,613.00	1,306,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	700	1,823.00	1,276,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	63,900	1,808.00	115,531,200	
アドバンスクリエイト	500	2,082.00	1,041,000	
三井不動産	93,000	2,622.50	243,892,500	
三菱地所	130,000	2,258.50	293,605,000	
平和不動産	3,300	1,612.00	5,319,600	
東京建物	20,300	1,589.00	32,256,700	
ダイビル	4,500	1,067.00	4,801,500	
京阪神ビルディング	2,900	655.00	1,899,500	
住友不動産	42,000	3,246.00	136,332,000	
大京	33,000	232.00	7,656,000	
テーオーシー	6,800	964.00	6,555,200	
東京楽天地	3,000	528.00	1,584,000	
レオパレス２１	22,100	606.00	13,392,600	
スターツコーポレーション	1,800	2,433.00	4,379,400	
フジ住宅	2,200	746.00	1,641,200	
空港施設	2,100	593.00	1,245,300	
明和地所	1,700	712.00	1,210,400	
住友不動産販売	1,600	2,847.00	4,555,200	
ゴールドクレスト	1,600	2,137.00	3,419,200	
リログループ	700	15,800.00	11,060,000	
日本エスリード	900	1,525.00	1,372,500	
日神不動産	2,300	551.00	1,267,300	
タカラレーベン	7,600	601.00	4,567,600	
サンヨーハウジング名古屋	1,200	1,011.00	1,213,200	
イオンモール	11,300	1,732.00	19,571,600	
ファースト住建	800	1,433.00	1,146,400	
東祥	400	5,150.00	2,060,000	
トーセイ	2,400	776.00	1,862,400	
穴吹興産	500	2,669.00	1,334,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,900	1,053.00	11,477,700	
サンフロンティア不動産	1,900	1,026.00	1,949,400	
ランドビジネス	4,400	289.00	1,271,600	
グランディハウス	2,900	418.00	1,212,200	
東武鉄道	95,000	573.00	54,435,000	

相鉄ホールディングス	28,000	568.00	15,904,000	
東京急行電鉄	96,000	826.00	79,296,000	
京浜急行電鉄	49,000	1,221.00	59,829,000	
小田急電鉄	28,500	2,232.00	63,612,000	
京王電鉄	50,000	883.00	44,150,000	
京成電鉄	13,300	2,654.00	35,298,200	
富士急行	5,000	1,011.00	5,055,000	
新京成電鉄	1,000	420.00	420,000	
東日本旅客鉄道	34,400	10,275.00	353,460,000	
西日本旅客鉄道	17,100	7,350.00	125,685,000	
東海旅客鉄道	14,800	18,620.00	275,576,000	
西武ホールディングス	24,500	1,965.00	48,142,500	
鴻池運輸	2,500	1,425.00	3,562,500	
西日本鉄道	21,000	489.00	10,269,000	
ハマキョウレックス	1,200	2,083.00	2,499,600	
サカイ引越センター	600	3,100.00	1,860,000	
近鉄グループホールディングス	179,000	420.00	75,180,000	
阪急阪神ホールディングス	22,400	3,760.00	84,224,000	
南海電気鉄道	38,000	552.00	20,976,000	
京阪ホールディングス	40,000	717.00	28,680,000	
神戸電鉄	4,000	381.00	1,524,000	
名古屋鉄道	65,000	522.00	33,930,000	
山陽電気鉄道	6,000	607.00	3,642,000	
トランコム	500	5,500.00	2,750,000	
日本通運	69,000	569.00	39,261,000	
ヤマトホールディングス	31,800	2,248.50	71,502,300	
山九	23,000	716.00	16,468,000	
日新	7,000	364.00	2,548,000	
丸全昭和運輸	6,000	449.00	2,694,000	
センコー	8,000	720.00	5,760,000	
トナミホールディングス	4,000	352.00	1,408,000	
ニッコンホールディングス	6,000	2,410.00	14,460,000	
福山通運	11,000	649.00	7,139,000	
セイノーホールディングス	12,500	1,248.00	15,600,000	
神奈川中央交通	2,000	722.00	1,444,000	
日立物流	3,700	2,346.00	8,680,200	
丸和運輸機関	400	2,571.00	1,028,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,800	1,577.00	2,838,600	
日本郵船	151,000	247.00	37,297,000	
商船三井	94,000	364.00	34,216,000	
川崎汽船	68,000	296.00	20,128,000	
ＮＳユナイテッド海運	8,000	230.00	1,840,000	
飯野海運	9,200	510.00	4,692,000	
九州旅客鉄道	13,200	3,385.00	44,682,000	
日本航空	32,000	3,660.00	117,120,000	
ＡＮＡホールディングス	330,000	327.40	108,042,000	
パスコ	1,000	412.00	412,000	
三菱倉庫	12,000	1,582.00	18,984,000	
三井倉庫ホールディングス	10,000	335.00	3,350,000	
住友倉庫	13,000	634.00	8,242,000	
澁澤倉庫	5,000	351.00	1,755,000	
ヤマタネ	900	1,628.00	1,465,200	
乾汽船	1,300	993.00	1,290,900	
日本トランスシティ	4,000	461.00	1,844,000	
ケイヒン	8,000	157.00	1,256,000	
中央倉庫	1,100	1,096.00	1,205,600	
安田倉庫	1,600	782.00	1,251,200	
東洋埠頭	2,000	189.00	378,000	
宇徳	2,800	424.00	1,187,200	
上組	21,000	1,055.00	22,155,000	

キユーソー流通システム	600	2,644.00	1,586,400	
郵船ロジスティクス	1,600	1,177.00	1,883,200	
近鉄エクスプレス	3,200	1,702.00	5,446,400	
エーアイテイー	1,200	1,095.00	1,314,000	
内外トランスライン	1,200	1,095.00	1,314,000	
東京放送ホールディングス	11,600	2,044.00	23,710,400	
日本テレビホールディングス	16,000	2,020.00	32,320,000	
朝日放送	1,700	780.00	1,326,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,800	2,313.00	11,102,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	11,400	500.00	5,700,000	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,574.00	3,603,600	
Ｕ－ＮＥＸＴ	1,600	1,165.00	1,864,000	
ワイヤレスゲート	700	1,541.00	1,078,700	
コネクシオ	1,500	1,569.00	2,353,500	
日本通信	14,700	180.00	2,646,000	
日本電信電話	140,700	4,771.00	671,279,700	
ＫＤＤＩ	173,400	2,935.50	509,015,700	
光通信	2,100	10,970.00	23,037,000	
ＮＴＴドコモ	131,000	2,691.00	352,521,000	
エムティーアイ	2,700	686.00	1,852,200	
ＧＭＯインターネット	6,400	1,522.00	9,740,800	
カドカワ	5,100	1,620.00	8,262,000	
学研ホールディングス	6,000	308.00	1,848,000	
ゼンリン	2,300	2,194.00	5,046,200	
昭文社	1,800	710.00	1,278,000	
インプレスホールディングス	8,200	147.00	1,205,400	
東京電力ホールディングス	150,700	433.00	65,253,100	
中部電力	58,500	1,483.50	86,784,750	
関西電力	72,500	1,243.00	90,117,500	
中国電力	24,600	1,223.00	30,085,800	
北陸電力	17,400	1,117.00	19,435,800	
東北電力	44,400	1,440.00	63,936,000	
四国電力	16,000	1,093.00	17,488,000	
九州電力	39,200	1,243.00	48,725,600	
北海道電力	16,600	807.00	13,396,200	
沖縄電力	2,600	2,614.00	6,796,400	
電源開発	14,100	2,690.00	37,929,000	
エフオン	1,200	1,001.00	1,201,200	
イーレックス	700	3,670.00	2,569,000	
東京瓦斯	190,000	516.20	98,078,000	
大阪瓦斯	172,000	431.50	74,218,000	
東邦瓦斯	45,000	794.00	35,730,000	
北海道瓦斯	4,000	278.00	1,112,000	
広島ガス	3,600	372.00	1,339,200	
西部瓦斯	20,000	262.00	5,240,000	
静岡ガス	5,500	721.00	3,965,500	
メタウォーター	1,000	2,945.00	2,945,000	
アイネット	1,100	1,228.00	1,350,800	
松竹	12,000	1,319.00	15,828,000	
東宝	11,500	3,260.00	37,490,000	
エイチ・アイ・エス	3,000	2,927.00	8,781,000	
東映	7,000	1,004.00	7,028,000	
ラックランド	600	1,998.00	1,198,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	10,800	5,360.00	57,888,000	
共立メンテナンス	1,500	6,930.00	10,395,000	
イチネンホールディングス	1,900	1,196.00	2,272,400	
建設技術研究所	1,200	1,094.00	1,312,800	
スペース	1,000	1,285.00	1,285,000	
アインホールディングス	2,100	8,530.00	17,913,000	
東京テアトル	8,000	152.00	1,216,000	

ナガワ	300	4,550.00	1,365,000	
よみうりランド	4,000	462.00	1,848,000	
東京都競馬	13,000	258.00	3,354,000	
常磐興産	800	1,614.00	1,291,200	
カナモト	2,600	2,885.00	7,501,000	
東京ドーム	7,400	1,094.00	8,095,600	
ＤＴＳ	1,800	2,587.00	4,656,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,700	3,405.00	22,813,500	
シーイーシー	1,000	1,839.00	1,839,000	
カプコン	4,100	2,391.00	9,803,100	
西尾レントオール	1,500	3,300.00	4,950,000	
日本空港ビルデング	5,600	3,955.00	22,148,000	
トランス・コスモス	2,200	2,617.00	5,757,400	
乃村工藝社	4,000	1,912.00	7,648,000	
ジャステック	1,100	1,035.00	1,138,500	
ＳＣＳＫ	4,800	4,165.00	19,992,000	
藤田観光	6,000	370.00	2,220,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,000	138.00	1,380,000	
日本管財	1,600	1,789.00	2,862,400	
トーカイ	800	4,100.00	3,280,000	
白洋舎	500	2,700.00	1,350,000	
セコム	19,300	8,194.00	158,144,200	
日本システムウエア	800	1,614.00	1,291,200	
セントラル警備保障	800	1,898.00	1,518,400	
アイネス	2,200	1,144.00	2,516,800	
丹青社	3,200	867.00	2,774,400	
メイテック	2,200	4,350.00	9,570,000	
ＴＫＣ	1,600	3,420.00	5,472,000	
アサツー　ディ・ケイ	3,000	2,891.00	8,673,000	
富士ソフト	2,600	2,824.00	7,342,400	
応用地質	1,800	1,466.00	2,638,800	
船井総研ホールディングス	2,400	1,958.00	4,699,200	
ＮＳＤ	3,700	1,751.00	6,478,700	
進学会	2,200	571.00	1,256,200	
コナミホールディングス	7,900	4,605.00	36,379,500	
学究社	800	1,627.00	1,301,600	
ベネッセホールディングス	6,200	3,340.00	20,708,000	
イオンディライト	2,100	3,470.00	7,287,000	
ナック	1,200	991.00	1,189,200	
福井コンピュータホールディングス	500	2,830.00	1,415,000	
ニチイ学館	3,200	882.00	2,822,400	
ダイセキ	3,200	2,317.00	7,414,400	
ステップ	900	1,402.00	1,261,800	
日鉄住金物産	1,500	4,890.00	7,335,000	
元気寿司	600	2,269.00	1,361,400	
トラスコ中山	4,000	2,568.00	10,272,000	
ヤマダ電機	58,600	577.00	33,812,200	
オートバックスセブン	6,500	1,802.00	11,713,000	
アークランドサカモト	3,000	1,423.00	4,269,000	
ニトリホールディングス	7,600	12,250.00	93,100,000	
グルメ杵屋	1,000	1,041.00	1,041,000	
愛眼	6,200	197.00	1,221,400	
ケーユーホールディングス	1,500	914.00	1,371,000	
吉野家ホールディングス	6,100	1,666.00	10,162,600	
加藤産業	2,700	2,932.00	7,916,400	
イノテック	2,100	696.00	1,461,600	
イエローハット	1,700	2,789.00	4,741,300	
松屋フーズ	800	4,170.00	3,336,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,600	806.00	1,289,600	

ＪＫホールディングス	2,000	672.00	1,344,000	
サガミチェーン	2,200	1,376.00	3,027,200	
日伝	700	3,500.00	2,450,000	
関西スーパーマーケット	1,400	1,534.00	2,147,600	
ミロク情報サービス	1,300	1,789.00	2,325,700	
北沢産業	6,100	219.00	1,335,900	
杉本商事	1,000	1,558.00	1,558,000	
因幡電機産業	2,500	4,000.00	10,000,000	
王将フードサービス	1,300	4,245.00	5,518,500	
プレナス	2,000	2,495.00	4,990,000	
ミニストップ	1,300	2,166.00	2,815,800	
アークス	3,300	2,585.00	8,530,500	
バローホールディングス	3,800	2,774.00	10,541,200	
バイテックホールディングス	1,000	1,375.00	1,375,000	
ミスミグループ本社	19,700	2,075.00	40,877,500	
藤久	700	1,745.00	1,221,500	
ベルク	800	4,530.00	3,624,000	
大　庄	900	1,595.00	1,435,500	
タキヒヨー	3,000	483.00	1,449,000	
ファーストリテイリング	2,900	34,990.00	101,471,000	
ソフトバンクグループ	78,900	8,789.00	693,452,100	
スズケン	8,000	3,835.00	30,680,000	
サンドラッグ	3,300	7,440.00	24,552,000	
サックスバー　ホールディングス	1,600	1,255.00	2,008,000	
ジェコス	1,200	1,130.00	1,356,000	
やまや	700	1,721.00	1,204,700	
ルネサスイーストン	2,200	615.00	1,353,000	
ベルーナ	4,400	849.00	3,735,600	
合計	26,741,300		40,065,445,160	

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」　（2017年02月28日現在）

Ⅰ　資産総額	6,503,921,988円
Ⅱ　負債総額	27,554,230円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,476,367,758円
Ⅳ　発行済数量	6,643,959,268口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9748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

2017年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間に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。

2017年2月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	322	52,916
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	55	10,443
単位型公社債投資信託	3	112
合計	380	63,472

○　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21期事業年度（自平成27年4月1日　至平成28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22期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日　至平成28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27年3月31日）		当事業年度 （平成28年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,488,730		9,619,679
有価証券		5,209,385		7,602,477
前払費用		499,710		390,202
未収委託者報酬		2,778,650		3,426,935
未収運用受託報酬		1,519,030		1,649,081
未収投資助言報酬		216,814		208,775
繰延税金資産		417,418		480,820
その他		52,788		19,980
流動資産合計		14,182,529		23,397,951
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	88,529	※1	80,574
車両	※1	588	※1	294
器具備品	※1	90,111	※1	114,079
有形固定資産合計		179,229		194,948
無形固定資産				
ソフトウェア		854,449		742,019
ソフトウェア仮勘定		17,421		88,417
その他		8,075		8,043
無形固定資産合計		879,946		838,479
投資その他の資産				
投資有価証券		35,677,217		35,476,609
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		285,819
繰延税金資産		-		170,956
その他		17		793
投資その他の資産合計		36,203,608		36,000,401
固定資産合計		37,262,784		37,033,830
資産合計		51,445,314		60,431,781

負債の部		
流動負債		
預り金	33,209	34,054
未払収益分配金	-	1,531
未払償還金	137,094	118,764
未払手数料	995,185	1,204,424
未払運用委託報酬	655,766	746,912
未払投資助言報酬	410,223	624,770
その他未払金	324,326	447,074
未払費用	97,490	110,997
未払法人税等	1,556,244	2,793,014
賞与引当金	787,638	864,968
その他	498,615	505,003
流動負債合計	5,495,794	7,451,515
固定負債		
退職給付引当金	1,253,790	1,404,058
役員退職慰労引当金	25,400	26,800
繰延税金負債	13,483	-
固定負債合計	1,292,673	1,430,858
負債合計	6,788,467	8,882,374
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	23,998,814	31,277,901
利益剰余金合計	24,678,621	31,957,708
株主資本合計	42,960,461	50,239,548
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,696,385	1,309,858
評価・換算差額等合計	1,696,385	1,309,858
純資産合計	44,656,846	51,549,407
負債・純資産合計	51,445,314	60,431,781

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

		前事業年度 （自　平成26年4月１日 至　平成27年3月31日）		当事業年度 （自　平成27年4月1日 至　平成28年3月31日）
営業収益				
委託者報酬		15,670,934		23,796,732
運用受託報酬		7,825,480		10,253,108
投資助言報酬		872,448		887,392
業務受託料		47,100		-
営業収益計		24,415,963		34,937,233
営業費用				
支払手数料		6,834,391		10,915,789
広告宣伝費		28,551		59,346
調査費		4,581,959		5,358,400
支払運用委託報酬		1,811,448		2,043,036
支払投資助言報酬		1,722,179		2,189,966
委託調査費		80,518		90,937
調査費		967,812		1,034,460
委託計算費		148,832		189,969
営業雑経費		581,870		712,706
通信費		53,825		47,397
印刷費		170,610		207,694
協会費		21,379		22,682
その他営業雑経費		336,053		434,931
営業費用計		12,175,604		17,236,212
一般管理費				
役員報酬	※1	62,272	※1	69,958
給料・手当		2,905,979		2,984,319
賞与引当金繰入額		782,365		864,968
賞与		237,611		245,495
福利厚生費		532,618		581,952
退職給付費用		283,064		298,054
役員退職慰労引当金繰入額		7,250		7,450
役員退職慰労金		-		100
その他人件費		101,498		134,593
不動産賃借料		544,587		544,913
その他不動産経費		25,737		25,766
交際費		20,059		24,568
旅費交通費		100,791		114,715
固定資産減価償却費		440,227		401,740
租税公課		104,874		183,280
業務委託費		194,856		225,301
器具備品費		156,991		173,657
保険料		56,700		57,047
諸経費		135,187		146,268
一般管理費計		6,692,676		7,084,153
営業利益		5,547,682		10,616,866
営業外収益				
受取利息		274		747
有価証券利息		70,792		66,047
受取配当金	※4	177,354	※4	214,632
為替差益		31,164		-

その他営業外収益		6,906		32,180
営業外収益計		286,492		313,608
営業外費用				
為替差損		-		18,136
控除対象外消費税		19,444		10,447
その他営業外費用		6,244		499
営業外費用計		25,689		29,083
経常利益		5,808,485		10,901,391
特別利益				
投資有価証券売却益		366,068		100,523
投資有価証券償還益		15,343		17,323
事故受取保険金		-	※5	5,609
特別利益計		381,411		123,456
特別損失				
投資有価証券売却損		-		726
固定資産除却損	※3	8,042	※3	6,419
事故損失賠償金	※2	25,550		-
特別損失計		33,593		7,145
税引前当期純利益		6,156,304		11,017,702
法人税、住民税及び事業税		2,284,237		3,740,258
法人税等調整額		14,162		△137,203
法人税等合計		2,298,400		3,603,055
当期純利益		3,857,904		7,414,647

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自　平成27年4月１日　至　平成28年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	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
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△135,560	△135,560	△135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,087
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△386,526	△386,526	△386,526
当期変動額合計	△386,526	△386,526	6,892,580
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

注記事項
（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自　平成27年4月1日 至　平成28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．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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
建物	272,378千円	287,659千円
車両	6,425	6,720
器具備品	481,704	453,566
計	760,508	747,946

（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26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
器具備品	4,128千円	6,419千円
その他	3,914	―
計	8,042	6,419

※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26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
関係会社からの受取配当金	41,126千円	51,062千円

※５．事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

	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27年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
１株当たり配当額	1,250円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月25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28年6月24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28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24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

該当するものはありません。

② 未経過リース料期末残高相当額等

該当するものはありません。

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26年4月１日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月１日 至　平成28年3月31日）
支払リース料	108	－
減価償却費相当額	100	－
支払利息相当額	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資金運用リスク管理規程に従い、適切なリスク管理を図っております。

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	―

当事業年度（平成28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	9,619,679	9,619,679	―
②　有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
③　投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
その他有価証券	13,290,620	13,290,620	―

（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

預金はすべて短期であるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28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。

当事業年度(平成28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	9,619,679	―	―	―
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	7,600,000	22,100,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

（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

当事業年度（平成28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	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	―	―	―
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	―	―	―
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

２．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価または償却原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	5,882,680	5,808,946	73,733
	①国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
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）	989,229	1,118,670	△129,440
	小計	989,229	1,118,670	△129,440
合計		13,290,620	11,398,606	1,892,014

（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	－

当事業年度（自平成27年4月1日　至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	－	－	－
(2)債券	－	－	－
(3)その他	2,120,246	100,523	726
合計	2,120,246	100,523	726

（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。

当事業年度（自 平成27年4月1日　至 平成28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	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	△70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

（２）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	220,314 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、46,819千円であります。

（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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
（流動資産）		
繰延税金資産		
賞与引当金	260,708 千円	266,903 千円
未払事業税	120,645	179,194
その他	36,064	34,722
繰延税金資産合計	417,418	480,820
（固定資産）		
繰延税金資産		
退職給付引当金	405,952	430,318
税務上の繰延資産償却超過額	4,573	2,980
役員退職慰労引当金	8,214	8,207
投資有価証券評価損	97,089	36,550
投資有価証券評価差額	2,266	39,867
その他	1,703	2,207
小計	519,799	520,132
評価性引当額	△90,623	△8,246
繰延税金資産合計	429,176	511,885
繰延税金負債		
特別分配金否認	56,555	68,623
投資有価証券評価差額	386,104	272,306
繰延税金負債合計	442,659	340,929
繰延税金資産(△は負債)の純額	△13,483	170,956

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27年3月31日）		当事業年度 （平成28年3月31日）	
法定実効税率	35.64 %	法定実効税率	33.06 %
（調整）		（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.07
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.26	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.15
住民税均等割	0.09	住民税均等割	0.05
税率変更に伴う影響	1.63	税率変更に伴う影響	0.71
特定外国子会社留保金課税	0.44	特定外国子会社留保金課税	0.16
所得拡大促進税制による特別控除額	△0.37	所得拡大促進税制による特別控除額	△0.35
評価性引当額の増加	0.03	評価性引当額の増減	△0.76
その他	0.03	外国税額控除	△0.08
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33	その他	0.00
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.70

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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32.34%から平成28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30.86%に、平成30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30.63%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33,334千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,097千円、その他有価証券評価差額金が29,763千円、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

当事業年度（自平成27年4月1日　至平成28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	4,199,085

[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	-	-

当事業年度（自平成27年4月１日　至平成28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	3,566,369	未収運用受託報酬	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

（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26年4月１日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月１日 至　平成28年3月31日）
１株当たり純資産額	411,781円19銭	475,337円55銭
１株当たり当期純利益金額	35,573円77銭	68,370円53銭

（注）　１．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が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26年4月１日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月１日 至　平成28年3月31日）
当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
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22期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		15,063,257
有価証券		6,100,434
前払費用		332,057
未収委託者報酬		3,387,820
未収運用受託報酬		1,987,018
未収投資助言報酬		77,619
繰延税金資産		235,224
その他		12,300
流動資産合計		27,195,731
固定資産		
有形固定資産	※1	177,912
無形固定資産		939,013
投資その他の資産		
投資有価証券		32,061,699
関係会社株式		66,222
差入保証金		285,884
繰延税金資産		358,138
その他		56
投資その他の資産合計		32,772,001
固定資産合計		33,888,927
資産合計		61,084,658

負債の部		
流動負債		
預り金		34,656
未払収益分配金		2,498
未払償還金		83,820
未払手数料		1,148,447
未払運用委託報酬		732,230
未払投資助言報酬		460,615
その他未払金		205,555
未払費用		162,124
未払法人税等		1,392,159
前受投資助言報酬		46,905
賞与引当金		412,947
その他	※2	203,375
流動負債合計		4,885,336
固定負債		
退職給付引当金		1,473,953
役員退職慰労引当金		20,525
固定負債合計		1,494,478
負債合計		6,379,815
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		34,819,634
利益剰余金合計		35,499,441
株主資本合計		53,781,281
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		923,561
評価・換算差額等合計		923,561
純資産合計		54,704,843
負債・純資産合計		61,084,658

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		12,190,330
運用受託報酬		4,378,762
投資助言報酬		282,418
営業収益計		16,851,511
営業費用		8,389,290
一般管理費	※1	3,636,282
営業利益		4,825,938
営業外収益	※2	156,270
営業外費用	※3	17,987
経常利益		4,964,221
特別利益	※4	277,431
特別損失	※5	7,077
税引前中間純利益		5,234,575
法人税、住民税及び事業税		1,327,094
法人税等調整額		238,395
法人税等合計		1,565,490
中間純利益		3,669,085

(3)中間株主資本等変動計算書

第22期中間会計期間(自 平成28年4月１日　至 平成28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	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
遡及処理後当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△ 135,560	△ 135,560	△ 135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,669,085	3,669,085	3,669,085
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	-	-	-	-	-	-	-	3,533,525	3,533,525	3,533,525
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	34,819,634	35,499,441	53,781,281

	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	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 135,560
中間純利益	-	-	3,669,085
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 386,296	△ 386,296	△ 386,296
当中間期変動額合計	△ 386,296	△ 386,296	3,147,228
当中間期末残高	923,561	923,561	54,704,843

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28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（ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。 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。

（会計方針の変更）

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号　平成28年3月28日。以下「回収可能性適用指針」という。）を当中間会計期間から適用し、繰延税金資産の回収可能性に関する会計処理の方法の一部を見直しております。

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3)①から③に該当する定めを適用した場合の繰延税金資産の額と、前事業年度末の繰延税金資産の額との差額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

この結果、当中間会計期間の期首において、繰延税金資産（投資その他の資産）が8,207千円、繰越利益剰余金が8,207千円増加しております。

当中間会計期間の期首の純資産に影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は8,207千円増加しております。

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ74千円増加しております。

（中間貸借対照表関係）

第22期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在）	
※１．有形固定資産の減価償却累計額	767,987千円
※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22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
※１．減価償却の実施額	
有形固定資産	24,369千円
無形固定資産	155,387千円
※２．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	90,866千円
時効成立収益分配金・償還金	34,943千円
有価証券利息	28,471千円
※３．営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	11,944千円
為替差損	5,980千円
※４．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	195,321千円
投資有価証券売却益	82,110千円
※５．特別損失のうち主要なもの	
事故損失賠償金	4,746千円
投資有価証券売却損	2,080千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第22期中間会計期間
（自　平成28年4月1日
至　平成28年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首株式数（千株）	当中間会計期間増加株式数（千株）	当中間会計期間減少株式数（千株）	当中間会計期間末株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	108	－	－	108
合計	108	－	－	108

２．配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月24日定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成28年3月31日	平成28年6月24日

（金融商品関係）

第22期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成28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	15,063,257	15,063,257	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	6,100,434	6,120,410	19,975
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	19,015,969	19,219,090	203,120
その他有価証券	12,978,229	12,978,229	―

（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（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22期中間会計期間末（平成28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	25,116,403	25,339,500	223,096
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	25,116,403	25,339,500	223,096
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		25,116,403	25,339,500	223,096

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	5,807,626	5,876,090	68,463
	①国債・地方債等	5,807,626	5,876,090	68,463
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注1）	2,505,459	4,016,701	1,511,241
	小計	8,313,086	9,892,791	1,579,705
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）	3,331,200	3,085,438	△245,761
	小計	3,331,200	3,085,438	△245,761
合計		11,644,286	12,978,229	1,333,943

（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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日　至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日　至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日　至 平成28年9月30日）
１．サービスごとの情報
当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

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

（２）有形固定資産
本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]
第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日　至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日　至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日　至 平成28年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第22期中間会計期間 （自　平成28年4月１日 至　平成28年9月30日）
1株当たり純資産額	504,433円86銭
1株当たり中間純利益金額	33,832円67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	3,669,085千円
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	3,669,085千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第22期中間会計期間（自　平成28年4月1日　至　平成28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

2016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

2016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

(2016年9月末現在)

ａ．名称	ｂ．資本金の額	ｃ．事業の内容
岡三オンライン証券株式会社	1,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	7,657百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
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	
ＧＭＯクリック証券株式会社	4,346百万円	
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

2016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２８年6月3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２８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２９年３月２８日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　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２８年２月２３日から平成２９年２月２０日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、＜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２９年２月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

※　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
　　２．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２８年１１月２９日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　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２８年４月１日から平成２９年３月３１日までの第２２期事業年度の中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８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２８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２８年４月１日から平成２８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。