NISSAY
ASSET MANAGEMENT

投資信託説明書
（請求目論見書）
2020.11.21

ニッセイTOPIXオープン

追加型投信／国内／株式／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

ニッセイ アセットマネジメント株式会社

［本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。］

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」は、主に国内の株式を投資対象としますので、組入株式の価格の下落、組入株式の発行会社の倒産または財務状況の悪化等の影響により、ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

●本書は、金融商品取引法（昭和 23 年法律第 25 号）第 13 条第２項第２号に規定する詳細情報を記載した投資信託説明書（請求目論見書）です。
●この投資信託説明書（請求目論見書）により行う「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法第５条の規定により有価証券届出書を 2020 年 11 月 20 日に関東財務局長に提出しており、2020 年 11 月 21 日にその届出の効力が生じております。
●なお、有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所について、該当事項はありません。

目　　次

第一部　証券情報 …… 1
（１）ファンドの名称　（２）内国投資信託受益証券の形態等
（３）発行（売出）価額の総額　（４）発行（売出）価格
（５）申込手数料　（６）申込単位　（７）申込期間
（８）申込取扱場所　（９）払込期日　（10）払込取扱場所
（11）振替機関に関する事項　（12）その他

第二部　ファンド情報 …… 3
第１　ファンドの状況 …… 3
１　ファンドの性格
（１）ファンドの目的及び基本的性格
（２）ファンドの沿革　（３）ファンドの仕組み
２　投資方針
（１）投資方針　（２）投資対象　（３）運用体制
（４）分配方針　（５）投資制限
３　投資リスク
４　手数料等及び税金
（１）申込手数料　（２）換金（解約）手数料　（３）信託報酬等
（４）その他の手数料等　（５）課税上の取扱い
５　運用状況
（１）投資状況　（２）投資資産　（３）運用実績　（４）設定及び解約の実績
第２　管理及び運営 …… 29
１　申込（販売）手続等
２　換金（解約）手続等
３　資産管理等の概要
（１）資産の評価　（２）保管　（３）信託期間　（４）計算期間　（５）その他
４　受益者の権利等
第３　ファンドの経理状況 …… 34
１　財務諸表
（１）貸借対照表　（２）損益及び剰余金計算書
（３）注記表　（４）附属明細表
２　ファンドの現況
第４　内国投資信託受益証券事務の概要 …… 96

第三部　委託会社等の情報 …… 委託-1
第１　委託会社等の概況 …… 委託-1
１　委託会社等の概況　２　事業の内容及び営業の概況
３　委託会社等の経理状況　４　利害関係人との取引制限
５　その他

添付　　約 款

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ニッセイＴＯＰＩＸオープン
（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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。

○ 手数料は変更となる場合があります。

申込手数料につきましては、販売会社にお問合せください。

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

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

（７）【申込期間】

継続申込期間：2020年11月21日（土）～ 2021年5月20日（木）

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

（８）【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター ０１２０-７６２-５０６
（午前９時～午後５時 土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ https://www.nam.co.jp/

（９）【払込期日】

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

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を経由して、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　　https://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

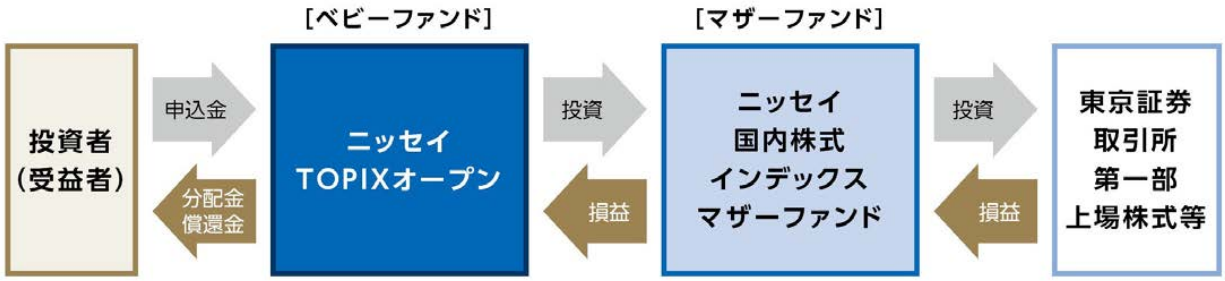
ファンドは、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

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）に連動する投資成果をめざします。

・主に「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」に投資することでTOPIXに連動する投資成果をめざします。

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

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

＜TOPIXの特徴＞

■日本の代表的な株価指数です。

TOPIXは、テレビや新聞などでも日々の動きが報じられており、日本を代表する株価指数のひとつです。TOPIXは、東証一部に上場されている銘柄すべての時価総額の増減を表す指数です。

■国内株式市場の動きを表します。

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

TOPIXは、以下の数式で算出されます。

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

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

TOPIXの著作権等について

TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

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

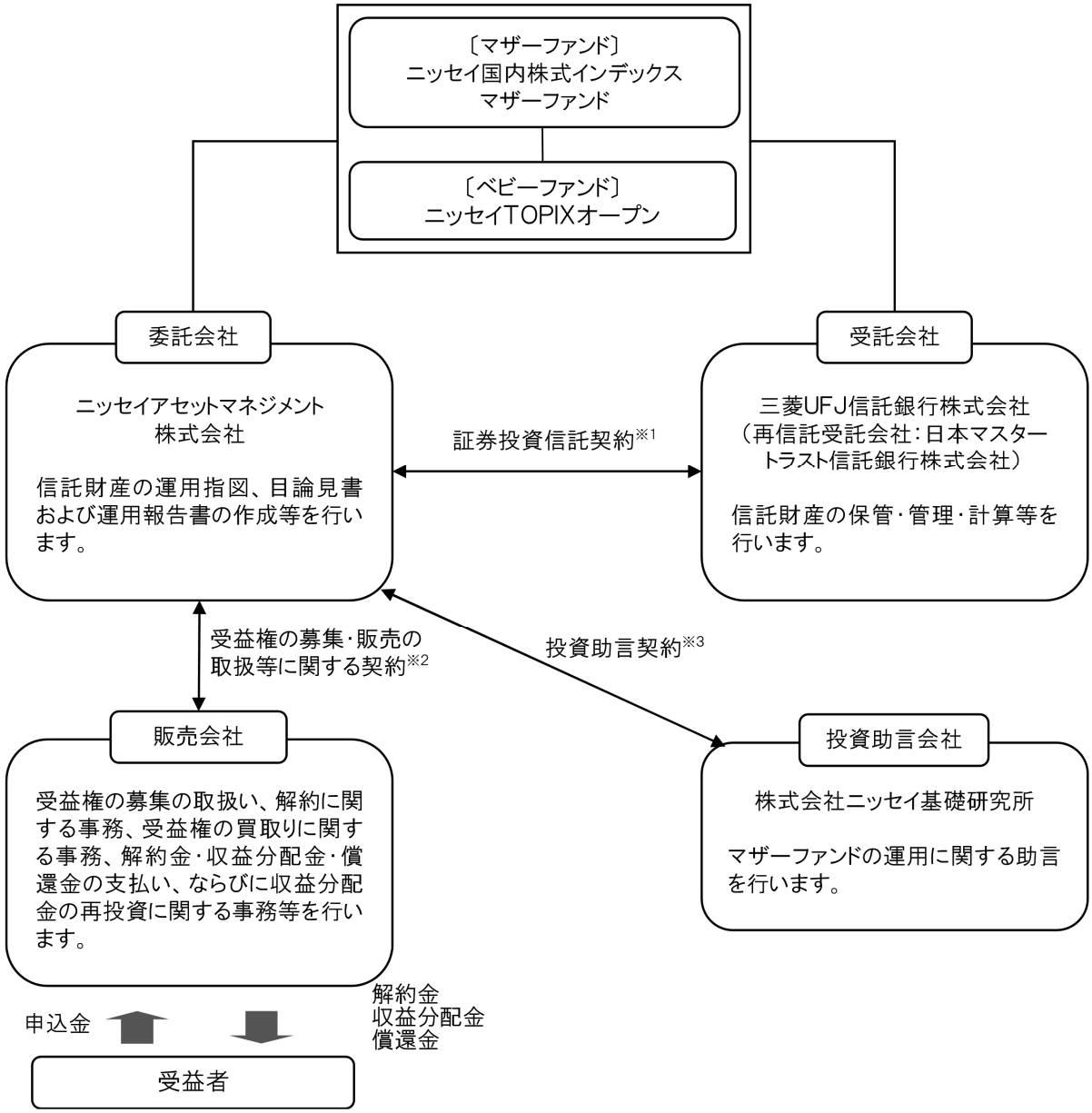
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投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

（２）【ファンドの沿革】

2001年4月27日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



※１　委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

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

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

委託会社の概況（2020年8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　　大関　洋
５．金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
６．設立年月日　　：1995年4月4日

７．沿革

1985年7月1日	ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
1995年4月4日	ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
1998年7月1日	ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
2000年5月8日	定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

８．大株主の状況

名　　称	住　　所	保有株数	比　率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号	108,448株	100％

２【投資方針】

（１）【投資方針】

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　株式以外の資産の実質組入比率は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。

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

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

⑨　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。

⑩　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．金銭債権（イ．およびニ．に掲げるものに該当するものを除きます）
ニ．約束手形（イ．に掲げるものを除きます）
２．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

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）ならびに次の１．から22．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます）に投資します。

１．株券または新株引受権証書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）
６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます）
７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます）
８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます）
９．特定目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
12．外国または外国の者の発行する日本の通貨建表示の証券または証書で、１．から11．の証券または証書の性質を有するもの
13．証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるもので日本の通貨建表示のものとします）
14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるもので日本の通貨建表示のものとします）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます）
16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）
18．外国法人が発行する日本の通貨建表示の譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

なお、１．の証券または証書、12．および17．の証券または証書のうち１．の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、２．から６．までの証券ならびに12．および

17．の証券または証書のうち２．から６．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13．および14．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③　金融商品

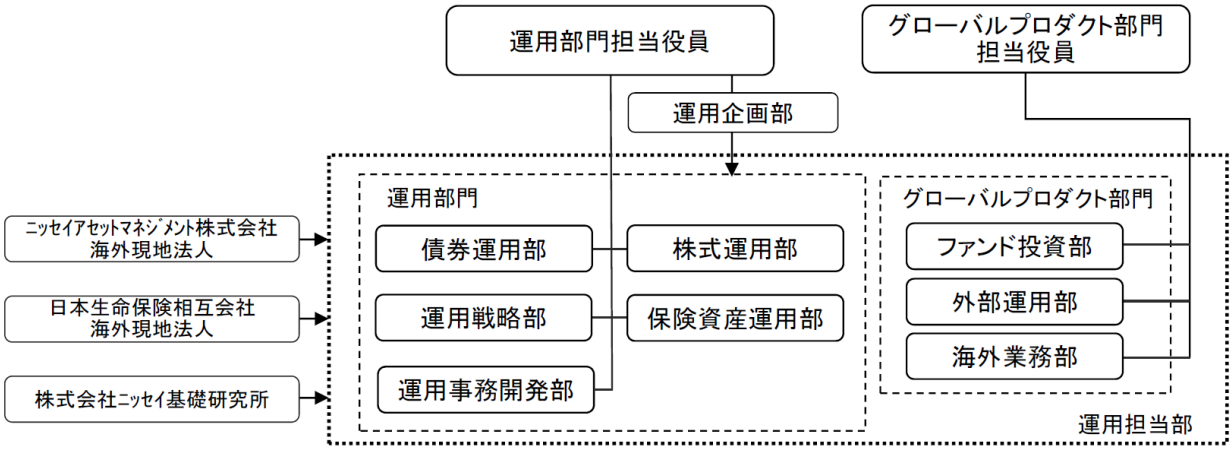
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記③の１．から４．までに掲げる金融商品により運用することができます。

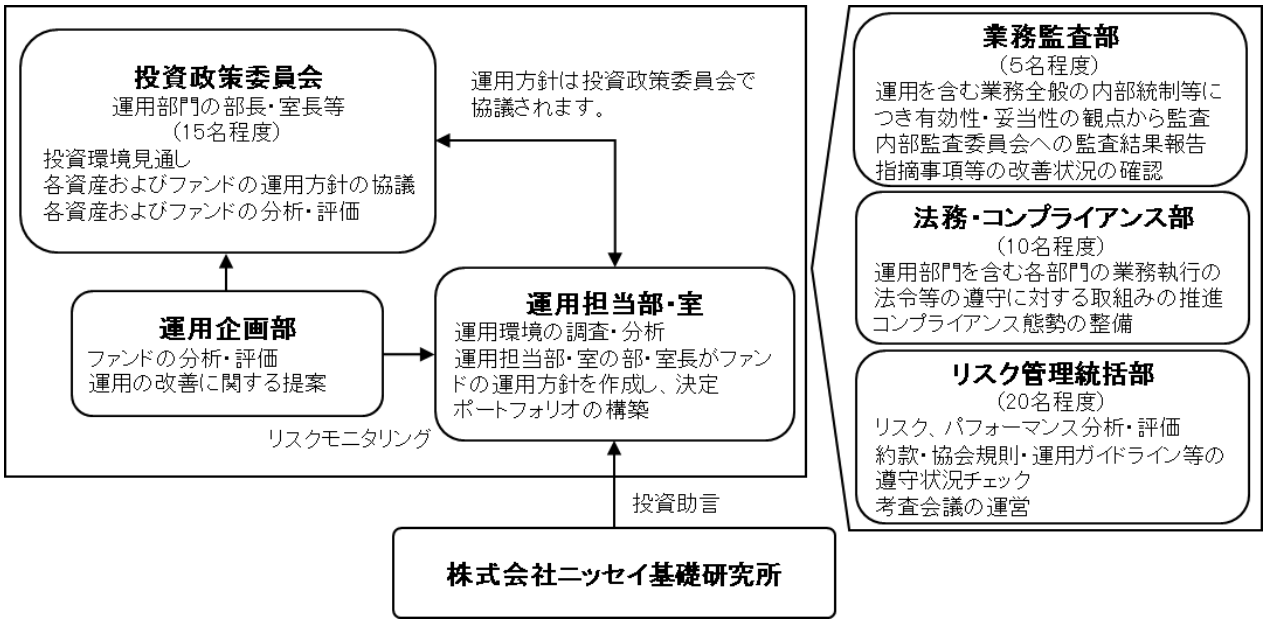
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



＜受託会社に対する管理体制等＞
委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性について、監査人による報告書を定期的に受託会社より受取っています。

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

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

２．分配対象額についての分配方針
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

３．留保益の運用方針
特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20％以内とします。
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％以内とします。

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％以内とします。
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（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
⑨　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。
⑩　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、国内の証券取引所※に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

※　金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号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。

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

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場合には、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済します。

③　先物取引等

１．国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ）ならびに外国の取引所における国内の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ）。
２．国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における国内の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

④　スワップ取引

１．異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
２．スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．

において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約します。

4．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。

5．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価します。

6．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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．金利先渡取引を行うことができます。

2．金利先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価します。

4．金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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た場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約します。

3．有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れを行います。

⑦　公社債の空売り

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

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

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

⑧　公社債の借入れ

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

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

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

4．上記１．の借入れに関する品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　資金の借入れ

1．信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを

目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行いません。

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

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

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

ｃ　法令に定める投資制限

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の動きに連動することを目標に運用しますので、TOPIXの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。
ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。

（１）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

・ファンドは、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、または、ファンドの構成銘柄のウエイトが当該指数の構成銘柄のウエイトと異なる場合があること

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

・収益分配金に関する留意点

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

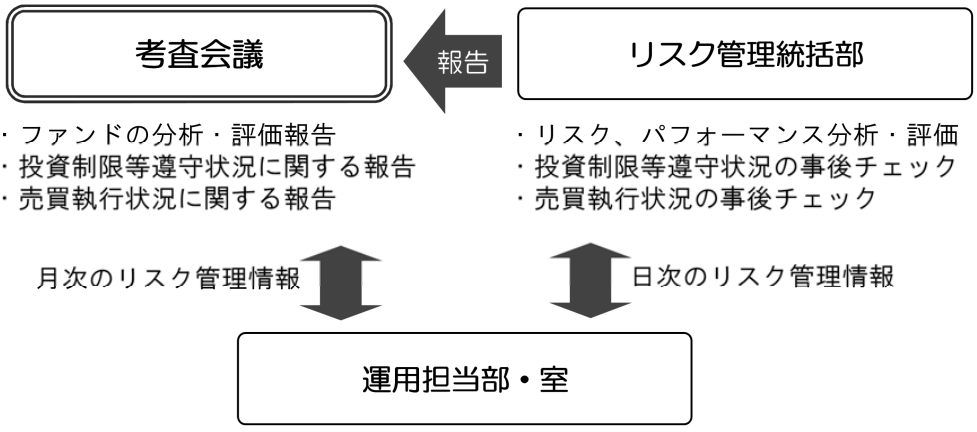
・短期金融資産の運用に関する留意点

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



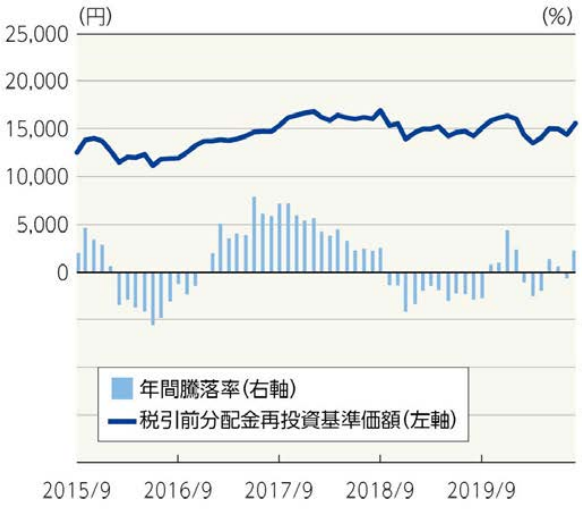
１．リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。

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。

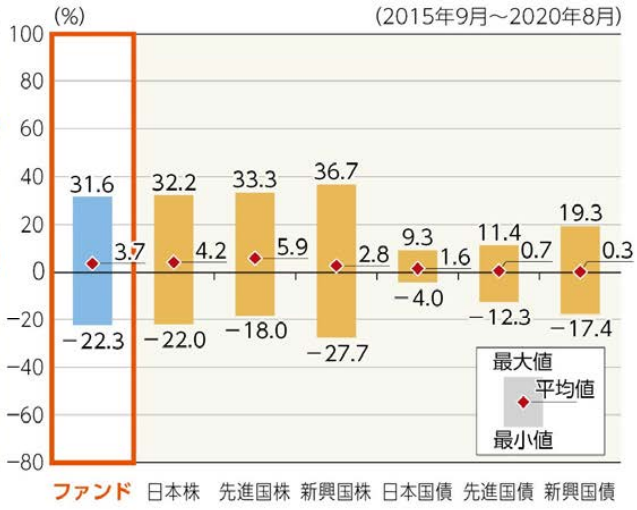
○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

① ありません。

○ 手数料は変更となる場合があります。

② 前記についての詳細は、販売会社にお問合せください。なお、販売会社につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター ０１２０-７６２-５０６

（午前９時～午後５時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ https://www.nam.co.jp/

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

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0.55%（税抜0.5%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.215%	0.215%	0.070%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

換金請求受付日の基準価額に0.3%をかけた額とします。

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

解約請求・償還・買 取 請 求 時 ： 解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

個別元本

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

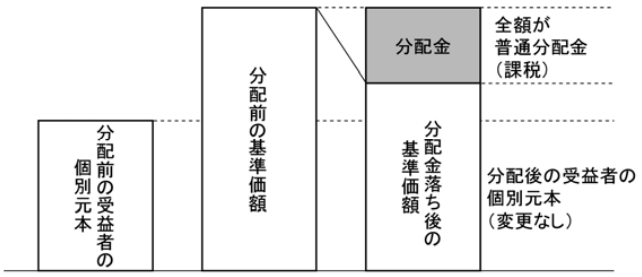
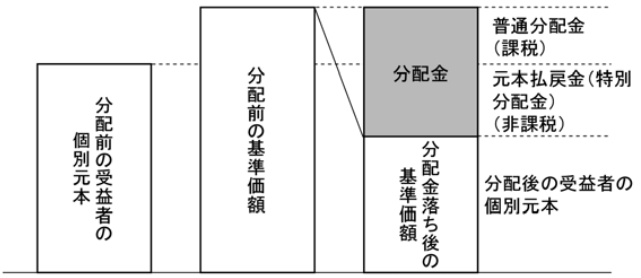
・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出※されます。

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

<table>
<tr><th>普通分配金</th><th>元本払戻金（特別分配金）</th></tr>
<tr><td> 
</td><td> 
</td></tr>
<tr><td>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。</td><td>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。</td></tr>
</table>

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

５【運用状況】

（１）【投資状況】

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

（2020年8月31日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		10,815,125,942	100.00
	内　日本	10,815,125,942	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△445,713	△0.00
純資産総額		10,814,680,229	100.00

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

（参考情報）

「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」

（2020年8月31日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		139,007,765,680	96.74
	内　日本	139,007,765,680	96.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,681,399,773	3.26
純資産総額		143,689,165,453	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）		4,557,120,000	3.17
	内　日本	4,557,120,000	3.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。
　　その他資産として、先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

（2020年8月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（％） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,132,762,088	1.7810 10,922,557,130	1.7635 10,815,125,942	－ －	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。

（参考情報）
「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」

（2020年8月31日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	683,900	7,056.25 4,825,773,979	7,006.00 4,791,403,400	－ －	3.33%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	383,900	6,802.07 2,611,317,920	8,309.00 3,189,825,100	－ －	2.22%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	477,200	4,630.37 2,209,613,854	6,598.00 3,148,565,600	－ －	2.19%
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,500	35,619.76 1,976,896,933	43,680.00 2,424,240,000	－ －	1.69%
5	任天堂 日本	株式 その他製品	37,600	38,580.08 1,450,611,338	56,740.00 2,133,424,000	－ －	1.48%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	509,900	3,718.15 1,895,886,501	3,959.00 2,018,694,100	－ －	1.40%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	803,900	2,618.37 2,104,912,446	2,411.50 1,938,604,850	－ －	1.35%
8	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,135,100	489.16 2,022,762,460	442.50 1,829,781,750	－ －	1.27%
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	419,600	3,725.86 1,563,374,180	4,026.00 1,689,309,600	－ －	1.18%
10	第一三共 日本	株式 医薬品	175,400	7,171.26 1,257,839,186	9,447.00 1,657,003,800	－ －	1.15%
11	ダイキン工業 日本	株式 機械	78,100	14,149.15 1,105,048,620	19,965.00 1,559,266,500	－ －	1.09%
12	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	438,500	3,241.63 1,421,456,881	3,078.00 1,349,703,000	－ －	0.94%
13	信越化学工業 日本	株式 化学	103,100	11,839.71 1,220,674,484	12,885.00 1,328,443,500	－ －	0.92%
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	482,600	2,702.29 1,304,125,218	2,729.00 1,317,015,400	－ －	0.92%
15	日本電産 日本	株式 電気機器	147,500	6,329.02 933,530,868	8,911.00 1,314,372,500	－ －	0.91%
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	418,100	3,244.12 1,356,370,047	3,118.00 1,303,635,800	－ －	0.91%
17	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	430,100	3,130.86 1,346,585,614	2,959.00 1,272,665,900	－ －	0.89%
18	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	121,600	9,671.51 1,176,055,681	10,415.00 1,266,464,000	－ －	0.88%
19	花王 日本	株式 化学	146,700	8,303.71 1,218,155,151	8,069.00 1,183,722,300	－ －	0.82%
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	8,214,100	140.20 1,151,687,050	143.80 1,181,187,580	－ －	0.82%
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	422,200	2,375.76 1,003,048,034	2,723.50 1,149,861,700	－ －	0.80%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	180,000	5,691.29 1,024,433,589	6,280.00 1,130,400,000	－ －	0.79%

23	ＳＭＣ 日本	株式 機械	19,200	45,435.39 872,359,630	58,250.00 1,118,400,000	－ －	0.78%
24	ファナック 日本	株式 電気機器	57,600	17,515.89 1,008,915,591	18,605.00 1,071,648,000	－ －	0.75%
25	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	38,900	22,298.69 867,419,410	27,150.00 1,056,135,000	－ －	0.74%
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	213,700	5,446.42 1,163,901,150	4,890.00 1,044,993,000	－ －	0.73%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	294,500	3,592.03 1,057,855,194	3,530.00 1,039,585,000	－ －	0.72%
28	三井物産 日本	株式 卸売業	522,700	1,725.11 901,719,432	1,914.00 1,000,447,800	－ －	0.70%
29	三菱商事 日本	株式 卸売業	395,800	2,593.50 1,026,508,929	2,512.50 994,447,500	－ －	0.69%
30	中外製薬 日本	株式 医薬品	191,700	3,936.16 754,563,250	4,721.00 905,015,700	－ －	0.63%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	14.55
		情報・通信業	9.84
		輸送用機器	7.07
		化学	6.93
		医薬品	6.35
		サービス業	5.33
		機械	5.27
		小売業	4.83
		銀行業	4.81
		卸売業	4.61
		陸運業	3.72
		食料品	3.65
		その他製品	2.61
		精密機器	2.53
		建設業	2.45
		保険業	1.93
		不動産業	1.93
		電気・ガス業	1.39
		その他金融業	1.08
		証券、商品先物取引業	0.80
		ガラス・土石製品	0.74
		非鉄金属	0.66
		鉄鋼	0.56
		ゴム製品	0.54
		金属製品	0.53
		繊維製品	0.47
		石油・石炭製品	0.42
		空運業	0.35
		パルプ・紙	0.21
		倉庫・運輸関連業	0.18
		鉱業	0.17
		海運業	0.13
		水産・農林業	0.09
	小計		96.74
合　計（対純資産総額比）			96.74

（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】

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

該当事項はありません。

（参考情報）
「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」

（2020年8月31日現在）

種類	取引所名称	資産名	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０２０９月	買建	282	4,445,195,100	4,557,120,000	3.17%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率であります。
（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】
「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	1口当たりの純資産額（分配落）（円）	1口当たりの純資産額（分配付）（円）
第10計算期間末（2011年2月21日）	8,714,276,623	8,714,276,623	0.7946	0.7946
第11計算期間末（2012年2月20日）	7,946,380,753	7,946,380,753	0.6804	0.6804
第12計算期間末（2013年2月20日）	11,366,392,129	11,366,392,129	0.8242	0.8242
第13計算期間末（2014年2月20日）	11,901,115,847	11,901,115,847	1.0261	1.0261
第14計算期間末（2015年2月20日）	11,751,116,675	11,751,116,675	1.3102	1.3102
第15計算期間末（2016年2月22日）	10,630,356,936	10,630,356,936	1.1519	1.1519
第16計算期間末（2017年2月20日）	12,150,036,683	12,150,036,683	1.3943	1.3943
第17計算期間末（2018年2月20日）	12,951,911,472	12,951,911,472	1.6140	1.6140
第18計算期間末（2019年2月20日）	11,844,303,217	11,844,303,217	1.5030	1.5030
第19計算期間末（2020年2月20日）	11,389,329,599	11,389,329,599	1.5918	1.5918
2019年8月末日	10,816,853,728	－	1.4237	－
9月末日	11,341,157,674	－	1.5093	－
10月末日	11,757,590,152	－	1.5842	－
11月末日	11,784,024,751	－	1.6144	－
12月末日	11,844,740,715	－	1.6370	－
2020年1月末日	11,530,357,742	－	1.6014	－
2月末日	10,249,206,518	－	1.4367	－
3月末日	9,728,816,055	－	1.3497	－
4月末日	10,059,336,145	－	1.4073	－
5月末日	10,749,260,164	－	1.5024	－
6月末日	10,561,729,948	－	1.4993	－
7月末日	10,072,696,327	－	1.4385	－
8月末日	10,814,680,229	－	1.5552	－

②【分配の推移】
「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

	1口当たりの分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
2020年2月21日～ 2020年8月20日	－

③【収益率の推移】
「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

	収益率(%)
第10計算期間	8.7
第11計算期間	△14.4
第12計算期間	21.1
第13計算期間	24.5
第14計算期間	27.7
第15計算期間	△12.1
第16計算期間	21.0
第17計算期間	15.8
第18計算期間	△6.9
第19計算期間	5.9
2020年2月21日～ 2020年8月20日	△3.4

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

（４）【設定及び解約の実績】

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第10計算期間	1,730,969,712	2,298,999,559	10,967,460,623
第11計算期間	1,861,523,446	1,149,596,498	11,679,387,571
第12計算期間	5,323,800,228	3,213,083,842	13,790,103,957
第13計算期間	5,135,350,758	7,327,078,364	11,598,376,351
第14計算期間	3,236,440,790	5,866,043,618	8,968,773,523
第15計算期間	2,938,706,523	2,678,626,407	9,228,853,639
第16計算期間	1,837,034,876	2,351,785,223	8,714,103,292
第17計算期間	1,667,238,065	2,356,613,048	8,024,728,309
第18計算期間	1,253,166,962	1,397,504,758	7,880,390,513
第19計算期間	723,029,020	1,448,636,647	7,154,782,886
2020年2月21日～ 2020年8月20日	619,714,832	815,224,876	6,959,272,842

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜参考情報＞

3.運用実績

2020年8月末現在

●基準価額・純資産の推移

基準価額	15,552円
純資産総額	108億円

・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。

●分配の推移　1万口当り（税引前）

2016年 2 月	0円
2017年 2 月	0円
2018年 2 月	0円
2019年 2 月	0円
2020年 2 月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●組入上位業種（マザーファンド）

	業 種	比 率
1	電気機器	15.0%
2	情報・通信業	10.2%
3	輸送用機器	7.3%
4	化学	7.2%
5	医薬品	6.6%
6	サービス業	5.5%
7	機械	5.4%
8	小売業	5.0%
9	銀行業	5.0%
10	卸売業	4.8%

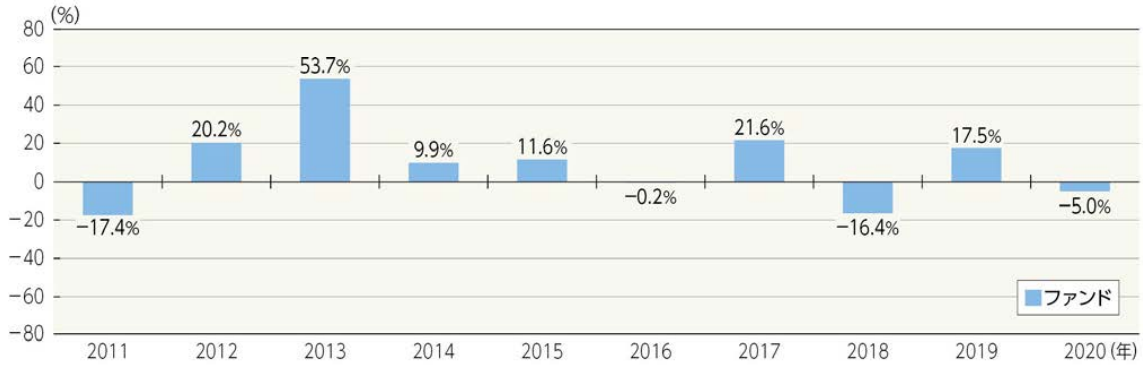
・比率は対組入株式評価額比です。

●組入上位銘柄（マザーファンド）

	銘 柄	比 率
1	トヨタ自動車	3.4%
2	ソニー	2.3%
3	ソフトバンクグループ	2.3%
4	キーエンス	1.7%
5	任天堂	1.5%
6	武田薬品工業	1.5%
7	日本電信電話	1.4%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.3%
9	リクルートホールディングス	1.2%
10	第一三共	1.2%

・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。
・2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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。

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

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

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

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

○　手数料は変更となる場合があります。

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　　https://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。

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

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

１口単位あるいは１万口単位です。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

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から信託財産留保額を差引いた額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○　換金手数料はありません。

⑤　信託財産留保額

換金請求受付日の基準価額に0.3%をかけた額とします。

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　　https://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	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

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　　https://www.nam.co.jp/

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限です。

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

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．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
ⅱ．やむを得ない事情が発生したとき
２．委託会社は、前記１．により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
３．前記２．の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月以上設けるものとします。
４．前記３．の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の２分の１を超えるときは、前記１．の信託契約の解約をしません。
５．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
６．前記３．から５．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記３．の一定の期間を１ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。
７．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
８．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「②　約款の変更　４．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。

9．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「② 約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。

10．償還金については、原則として償還日から起算して５営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して５営業日目）までにお支払いします。

② 約款の変更

１．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

２．委託会社は、前記１．の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

３．前記２．の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月以上設けるものとします。

４．前記３．の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の２分の１を超えるときは、前記１．の約款の変更をしません。

５．委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

６．委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記１．から５．の規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

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」に規定する約款の変更を行う場合において、「① 繰上償還 ３．」または「② 約款の変更 ３．」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定します。

④ 公告

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

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

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られたる受益者に交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（https://www.nam.co.jp/）に掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付します。

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）反対者の買取請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間（2019年2月21日から2020年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

２０２０年3月２６日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　青木裕晃

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイＴＯＰＩＸオープンの２０１９年2月２１日から２０２０年2月２０日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイＴＯＰＩＸオープンの２０２０年２月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

１【財務諸表】

【ニッセイＴＯＰＩＸオープン】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 (2019年2月20日現在)	第19期 (2020年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	78,375	1,007,743
コール・ローン	32,009,613	30,279,094
親投資信託受益証券	11,844,437,558	11,389,461,056
未収入金	13,560,570	66,415,862
流動資産合計	11,890,086,116	11,487,163,755
資産合計	11,890,086,116	11,487,163,755
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,692,640	65,537,999
未払受託者報酬	4,595,190	4,484,168
未払委託者報酬	28,227,743	27,545,852
その他未払費用	267,326	266,137
流動負債合計	45,782,899	97,834,156
負債合計	45,782,899	97,834,156
純資産の部		
元本等		
元本	7,880,390,513	7,154,782,886
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,963,912,704	4,234,546,713
純資産合計	11,844,303,217	11,389,329,599
負債純資産合計	11,890,086,116	11,487,163,755

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 （自2018年2月21日 至2019年2月20日）	第19期 （自2019年2月21日 至2020年2月20日）
営業収益		
受取利息	132	296
有価証券売買等損益	△796,427,311	730,963,387
営業収益合計	△796,427,179	730,963,683
営業費用		
支払利息	12,361	10,068
受託者報酬	9,427,485	8,730,440
委託者報酬	57,912,066	53,630,313
その他費用	542,817	521,860
営業費用合計	67,894,729	62,892,681
営業利益又は営業損失（△）	△864,321,908	668,071,002
経常利益又は経常損失（△）	△864,321,908	668,071,002
当期純利益又は当期純損失（△）	△864,321,908	668,071,002
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△48,392,727	61,484,340
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,927,183,163	3,963,912,704
剰余金増加額又は欠損金減少額	702,461,780	387,084,180
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	702,461,780	387,084,180
剰余金減少額又は欠損金増加額	849,803,058	723,036,833
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	849,803,058	723,036,833
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,963,912,704	4,234,546,713

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

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

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第18期 自2018年2月21日 至2019年2月20日	第19期 自2019年2月21日 至2020年2月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（5,971,661,605円）及び分配準備積立金（3,008,590,366円）より分配対象収益は8,980,251,971円（1口当たり1.139569円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（5,674,260,520円）及び分配準備積立金（2,484,677,095円）より分配対象収益は8,158,937,615円（1口当たり1.140347円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	第18期 自2018年2月21日 至2019年2月20日	第19期 自2019年2月21日 至2020年2月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2019年2月20日現在	第19期 2020年2月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本額の変動

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

（４）【附属明細表】（2020年2月20日現在）

第１　有価証券明細表

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	6,326,072,571	11,389,461,056	
親投資信託受益証券　合計		6,326,072,571	11,389,461,056	
合計		6,326,072,571	11,389,461,056	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第４　不動産等明細表

該当事項はありません。

第５　商品明細表

該当事項はありません。

第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第７　その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第８　借入金明細表

該当事項はありません。

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

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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	2019年2月20日現在	2020年2月20日現在
１．　受益権総口数	34,475,094,643口	37,895,533,054口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6916円 （16,916円）	1.8004円 （18,004円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年2月21日 至　2019年2月20日	自　2019年2月21日 至　2020年2月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年2月20日現在	2020年2月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

株式関連

種類	2019年2月20日 現在				2020年2月20日 現在			
	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	814,445,000	－	855,950,000	41,505,000	1,125,325,000	－	1,107,480,000	△17,845,000
合計	814,445,000	－	855,950,000	41,505,000	1,125,325,000	－	1,107,480,000	△17,845,000

（注）１．時価の算定方法

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

附属明細表（2020年2月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

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

植木組	700	2,494.00	1,745,800	
矢作建設工業	3,900	835.00	3,256,500	
ピーエス三菱	2,900	656.00	1,902,400	
日本ハウスホールディングス	6,100	442.00	2,696,200	
大東建託	10,700	12,420.00	132,894,000	
新日本建設	3,800	860.00	3,268,000	
ＮＩＰＰＯ	7,400	2,680.00	19,832,000	
東亜道路工業	600	3,360.00	2,016,000	
前田道路	9,400	3,400.00	31,960,000	
日本道路	900	7,160.00	6,444,000	
東亜建設工業	2,800	1,765.00	4,942,000	
日本国土開発	6,500	591.00	3,841,500	
若築建設	1,600	1,599.00	2,558,400	
東洋建設	10,000	502.00	5,020,000	
五洋建設	35,300	658.00	23,227,400	
世紀東急工業	4,300	883.00	3,796,900	
福田組	1,000	4,415.00	4,415,000	
住友林業	22,600	1,720.00	38,872,000	
日本基礎技術	4,500	363.00	1,633,500	
巴コーポレーション	4,600	373.00	1,715,800	
大和ハウス工業	88,200	3,300.00	291,060,000	
ライト工業	5,100	1,465.00	7,471,500	
積水ハウス	97,500	2,317.50	225,956,250	
日特建設	2,300	844.00	1,941,200	
ユアテック	5,100	637.00	3,248,700	
四電工	700	2,580.00	1,806,000	
中電工	3,600	2,441.00	8,787,600	
関電工	12,700	1,003.00	12,738,100	
きんでん	21,200	1,793.00	38,011,600	
東京エネシス	3,000	836.00	2,508,000	
トーエネック	900	3,630.00	3,267,000	
住友電設	2,500	2,461.00	6,152,500	
日本電設工業	4,900	2,224.00	10,897,600	
協和エクシオ	13,500	2,629.00	35,491,500	
新日本空調	2,400	1,979.00	4,749,600	
日本工営	1,800	3,320.00	5,976,000	
九電工	6,300	3,130.00	19,719,000	
三機工業	6,400	1,369.00	8,761,600	
日揮ホールディングス	27,400	1,551.00	42,497,400	
中外炉工業	1,000	1,700.00	1,700,000	
ヤマト	2,900	726.00	2,105,400	
太平電業	2,200	2,533.00	5,572,600	
高砂熱学工業	7,700	1,860.00	14,322,000	
三晃金属工業	700	2,607.00	1,824,900	
ＮＥＣネッツエスアイ	2,600	4,220.00	10,972,000	
朝日工業社	600	3,135.00	1,881,000	
明星工業	5,800	787.00	4,564,600	
大氣社	4,300	3,440.00	14,792,000	
ダイダン	2,100	2,735.00	5,743,500	
日比谷総合設備	2,900	1,914.00	5,550,600	
日本製粉	8,300	1,649.00	13,686,700	
日清製粉グループ本社	32,200	1,956.00	62,983,200	
昭和産業	2,600	3,035.00	7,891,000	
鳥越製粉	2,500	826.00	2,065,000	
中部飼料	3,500	1,629.00	5,701,500	
フィード・ワン	19,200	175.00	3,360,000	

東洋精糖	1,500	1,188.00	1,782,000	
日本甜菜製糖	1,500	1,847.00	2,770,500	
三井製糖	2,500	2,082.00	5,205,000	
塩水港精糖	7,800	226.00	1,762,800	
日新製糖	1,400	2,008.00	2,811,200	
ＬＩＦＵＬＬ	9,500	507.00	4,816,500	
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	1,615.00	2,907,000	
日本M&Aセンター	20,500	3,680.00	75,440,000	
メンバーズ	1,100	1,595.00	1,754,500	
ＵＴグループ	3,200	2,689.00	8,604,800	
タケエイ	2,600	1,014.00	2,636,400	
ビーネックスグループ	3,400	981.00	3,335,400	
コシダカホールディングス	6,500	1,493.00	9,704,500	
パソナグループ	2,900	1,320.00	3,828,000	
ＣＤＳ	1,300	1,383.00	1,797,900	
リンクアンドモチベーション	6,000	507.00	3,042,000	
ＧＣＡ	3,300	801.00	2,643,300	
エス・エム・エス	8,400	2,349.00	19,731,600	
サニーサイドアップグループ	1,700	910.00	1,547,000	
パーソルホールディングス	27,100	1,743.00	47,235,300	
リニカル	1,700	993.00	1,688,100	
クックパッド	9,500	311.00	2,954,500	
アイ・ケイ・ケイ	2,500	741.00	1,852,500	
森永製菓	6,700	4,690.00	31,423,000	
中村屋	700	4,015.00	2,810,500	
江崎グリコ	8,500	4,710.00	40,035,000	
名糖産業	1,400	1,390.00	1,946,000	
井村屋グループ	1,200	1,900.00	2,280,000	
不二家	1,600	2,316.00	3,705,600	
山崎製パン	21,400	2,007.00	42,949,800	
モロゾフ	500	4,920.00	2,460,000	
亀田製菓	1,600	4,775.00	7,640,000	
寿スピリッツ	2,700	6,290.00	16,983,000	
カルビー	13,000	3,050.00	39,650,000	
森永乳業	5,300	4,070.00	21,571,000	
六甲バター	1,900	1,545.00	2,935,500	
ヤクルト本社	19,600	5,390.00	105,644,000	
明治ホールディングス	18,900	7,070.00	133,623,000	
雪印メグミルク	6,900	2,470.00	17,043,000	
プリマハム	4,500	2,487.00	11,191,500	
日本ハム	10,900	4,660.00	50,794,000	
丸大食品	3,000	2,001.00	6,003,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	2,300	2,635.00	6,060,500	
柿安本店	1,000	3,105.00	3,105,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	18,400	662.00	12,180,800	
学情	1,000	2,017.00	2,017,000	
スタジオアリス	1,400	1,831.00	2,563,400	
クロスキャット	1,500	1,191.00	1,786,500	
シミックホールディングス	1,500	1,600.00	2,400,000	
システナ	9,900	1,654.00	16,374,600	
ＮＪＳ	1,000	1,793.00	1,793,000	
デジタルアーツ	1,400	5,470.00	7,658,000	
日鉄ソリューションズ	4,200	3,335.00	14,007,000	
綜合警備保障	10,800	5,530.00	59,724,000	
いちご	35,700	396.00	14,137,200	
日本駐車場開発	30,700	146.00	4,482,200	

コア	1,300	1,338.00	1,739,400	
カカクコム	20,300	2,858.00	58,017,400	
セントケア・ホールディング	3,800	459.00	1,744,200	
ルネサンス	1,500	1,693.00	2,539,500	
ディップ	3,800	3,240.00	12,312,000	
ＳＢＳホールディングス	2,500	1,816.00	4,540,000	
オプトホールディング	1,500	1,939.00	2,908,500	
新日本科学	2,900	675.00	1,957,500	
ツクイ	6,400	647.00	4,140,800	
ベネフィット・ワン	7,400	1,961.00	14,511,400	
エムスリー	59,900	3,065.00	183,593,500	
ツカダ・グローバルホールディング	3,200	538.00	1,721,600	
アウトソーシング	15,500	951.00	14,740,500	
ウェルネット	2,700	666.00	1,798,200	
ワールドホールディングス	1,000	1,953.00	1,953,000	
ディー・エヌ・エー	13,300	1,573.00	20,920,900	
博報堂ＤＹホールディングス	37,800	1,443.00	54,545,400	
ぐるなび	4,700	845.00	3,971,500	
タカミヤ	2,900	596.00	1,728,400	
ジャパンベストレスキューシステム	2,100	860.00	1,806,000	
ファンコミュニケーションズ	7,500	436.00	3,270,000	
ライク	900	1,906.00	1,715,400	
ビジネス・ブレークスルー	4,600	407.00	1,872,200	
エスプール	5,200	807.00	4,196,400	
ＷＤＢホールディングス	1,200	2,638.00	3,165,600	
バリューコマース	1,500	2,432.00	3,648,000	
インフォマート	29,800	746.00	22,230,800	
サッポロホールディングス	9,700	2,473.00	23,988,100	
アサヒグループホールディングス	59,700	4,824.00	287,992,800	
キリンホールディングス	120,900	2,266.50	274,019,850	
宝ホールディングス	21,400	952.00	20,372,800	
オエノンホールディングス	7,500	388.00	2,910,000	
養命酒製造	900	1,931.00	1,737,900	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	20,000	2,937.00	58,740,000	
サントリー食品インターナショナル	19,100	4,655.00	88,910,500	
ダイドーグループホールディングス	1,500	3,935.00	5,902,500	
伊藤園	8,700	5,470.00	47,589,000	
キーコーヒー	2,800	2,250.00	6,300,000	
日清オイリオグループ	3,700	3,710.00	13,727,000	
不二製油グループ本社	7,000	2,748.00	19,236,000	
かどや製油	500	3,800.00	1,900,000	
Ｊ－オイルミルズ	1,500	4,250.00	6,375,000	
ローソン	7,100	6,220.00	44,162,000	
サンエー	2,300	4,560.00	10,488,000	
カワチ薬品	2,200	2,090.00	4,598,000	
エービーシー・マート	4,400	6,770.00	29,788,000	
ハードオフコーポレーション	2,200	800.00	1,760,000	
高千穂交易	1,600	1,121.00	1,793,600	
アスクル	2,900	3,365.00	9,758,500	
ゲオホールディングス	5,000	1,225.00	6,125,000	
アダストリア	3,900	2,106.00	8,213,400	
ジーフット	2,900	613.00	1,777,700	
伊藤忠食品	700	4,870.00	3,409,000	
くら寿司	1,500	5,400.00	8,100,000	
キャンドゥ	1,300	1,631.00	2,120,300	

エレマテック	2,600	983.00	2,555,800	
パルグループホールディングス	1,400	3,430.00	4,802,000	
ＪＡＬＵＸ	800	2,266.00	1,812,800	
エディオン	12,800	1,012.00	12,953,600	
あらた	2,200	4,545.00	9,999,000	
サーラコーポレーション	5,700	605.00	3,448,500	
トーメンデバイス	500	3,970.00	1,985,000	
ハローズ	1,100	2,734.00	3,007,400	
ＪＰホールディングス	8,500	309.00	2,626,500	
フジオフードシステム	2,400	1,663.00	3,991,200	
あみやき亭	600	3,415.00	2,049,000	
東京エレクトロン　デバイス	1,000	2,780.00	2,780,000	
ひらまつ	6,700	243.00	1,628,100	
フィールズ	3,300	476.00	1,570,800	
双日	154,600	342.00	52,873,200	
アルフレッサ　ホールディングス	31,100	2,180.00	67,798,000	
大黒天物産	700	3,335.00	2,334,500	
ハニーズホールディングス	2,500	1,342.00	3,355,000	
キッコーマン	20,500	5,880.00	120,540,000	
味の素	63,000	1,987.00	125,181,000	
キユーピー	15,900	2,152.00	34,216,800	
ハウス食品グループ本社	10,700	3,440.00	36,808,000	
カゴメ	10,800	2,664.00	28,771,200	
アリアケジャパン	2,600	7,500.00	19,500,000	
ピエトロ	1,100	1,641.00	1,805,100	
エバラ食品工業	800	2,180.00	1,744,000	
ニチレイ	13,600	2,795.00	38,012,000	
横浜冷凍	7,800	937.00	7,308,600	
東洋水産	14,700	4,555.00	66,958,500	
イートアンド	1,000	1,839.00	1,839,000	
大冷	900	1,952.00	1,756,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,600	1,143.00	1,828,800	
日清食品ホールディングス	12,100	8,900.00	107,690,000	
永谷園ホールディングス	1,400	2,121.00	2,969,400	
一正蒲鉾	1,900	951.00	1,806,900	
フジッコ	3,100	1,884.00	5,840,400	
ロック・フィールド	3,000	1,417.00	4,251,000	
日本たばこ産業	164,700	2,267.00	373,374,900	
ケンコーマヨネーズ	1,600	2,212.00	3,539,200	
わらべや日洋ホールディングス	1,900	1,835.00	3,486,500	
なとり	1,600	1,694.00	2,710,400	
北の達人コーポレーション	10,000	628.00	6,280,000	
ユーグレナ	12,200	824.00	10,052,800	
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,613.00	2,258,200	
片倉工業	4,000	1,332.00	5,328,000	
グンゼ	2,000	4,135.00	8,270,000	
ヒューリック	59,800	1,319.00	78,876,200	
ラサ商事	2,000	903.00	1,806,000	
アルペン	2,100	1,900.00	3,990,000	
クオールホールディングス	4,100	1,388.00	5,690,800	
アルコニックス	3,000	1,237.00	3,711,000	
神戸物産	9,700	4,460.00	43,262,000	
ジンズホールディングス	1,500	7,410.00	11,115,000	
ビックカメラ	16,600	1,080.00	17,928,000	
ＤＣＭホールディングス	15,100	1,044.00	15,764,400	
ペッパーフードサービス	2,200	869.00	1,911,800	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	19,900	2,635.00	52,436,500	
東京一番フーズ	3,000	608.00	1,824,000	
ＤＤホールディングス	1,100	1,684.00	1,852,400	
あい　ホールディングス	4,000	1,731.00	6,924,000	
ディーブイエックス	1,900	918.00	1,744,200	
きちりホールディングス	2,500	713.00	1,782,500	
アークランドサービスホールディングス	2,000	2,010.00	4,020,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	33,400	1,285.00	42,919,000	
ドトール・日レスホールディングス	4,500	2,085.00	9,382,500	
マツモトキヨシホールディングス	11,600	3,875.00	44,950,000	
ブロンコビリー	1,500	2,530.00	3,795,000	
ＺＯＺＯ	19,200	1,723.00	33,081,600	
物語コーポレーション	700	8,410.00	5,887,000	
ココカラファイン	2,900	5,100.00	14,790,000	
三越伊勢丹ホールディングス	48,900	801.00	39,168,900	
東洋紡	11,000	1,500.00	16,500,000	
ユニチカ	8,200	349.00	2,861,800	
富士紡ホールディングス	1,300	3,420.00	4,446,000	
日清紡ホールディングス	18,900	1,038.00	19,618,200	
倉敷紡績	2,800	2,302.00	6,445,600	
ダイワボウホールディングス	2,400	6,270.00	15,048,000	
シキボウ	1,200	1,260.00	1,512,000	
日東紡績	4,200	5,050.00	21,210,000	
トヨタ紡織	8,300	1,624.00	13,479,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	6,700	1,715.00	11,490,500	
Ｈａｍｅｅ	600	1,594.00	956,400	
ラクト・ジャパン	1,000	3,940.00	3,940,000	
ウエルシアホールディングス	8,300	6,250.00	51,875,000	
クリエイトＳＤホールディングス	4,700	2,717.00	12,769,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,300	1,047.00	5,549,100	
八洲電機	2,200	883.00	1,942,600	
レスターホールディングス	2,900	1,844.00	5,347,600	
ジューテックホールディングス	1,600	1,157.00	1,851,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	5,000	367.00	1,835,000	
ＯＣＨＩホールディングス	1,200	1,465.00	1,758,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	14,800	986.00	14,592,800	
黒谷	3,600	480.00	1,728,000	
ミサワ	2,600	774.00	2,012,400	
ティーライフ	2,000	849.00	1,698,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,200	814.00	1,790,800	
三洋貿易	2,800	1,205.00	3,374,000	
チムニー	900	2,225.00	2,002,500	
シュッピン	1,900	979.00	1,860,100	
ビューティガレージ	900	2,032.00	1,828,800	
ウイン・パートナーズ	2,000	1,061.00	2,122,000	
ネクステージ	4,000	1,003.00	4,012,000	
ジョイフル本田	8,200	1,246.00	10,217,200	
鳥貴族	900	2,645.00	2,380,500	
キリン堂ホールディングス	1,100	1,688.00	1,856,800	
ホットランド	1,900	1,292.00	2,454,800	
すかいらーくホールディングス	31,400	1,853.00	58,184,200	
ＳＦＰホールディングス	1,200	2,133.00	2,559,600	
綿半ホールディングス	1,000	1,830.00	1,830,000	
日本毛織	9,200	1,012.00	9,310,400	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8,100	959.00	7,767,900	
三栄建築設計	1,200	1,490.00	1,788,000	
野村不動産ホールディングス	17,000	2,751.00	46,767,000	
三重交通グループホールディングス	5,700	581.00	3,311,700	
サムティ	4,000	1,861.00	7,444,000	
ディア・ライフ	3,600	569.00	2,048,400	
コーセーアールイー	2,900	605.00	1,754,500	
日本商業開発	1,800	1,771.00	3,187,800	
プレサンスコーポレーション	4,600	1,277.00	5,874,200	
ユニゾホールディングス	4,200	5,840.00	24,528,000	
ＴＨＥグローバル社	3,900	439.00	1,712,100	
日本管理センター	1,800	1,408.00	2,534,400	
サンセイランディック	2,000	820.00	1,640,000	
エストラスト	2,100	825.00	1,732,500	
フージャースホールディングス	5,600	697.00	3,903,200	
オープンハウス	8,100	3,100.00	25,110,000	
東急不動産ホールディングス	76,200	782.00	59,588,400	
飯田グループホールディングス	23,400	1,626.00	38,048,400	
イーグランド	2,100	808.00	1,696,800	
ムゲンエステート	2,600	594.00	1,544,400	
帝国繊維	3,100	2,182.00	6,764,200	
日本コークス工業	24,000	76.00	1,824,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,600	694.00	1,804,400	
ＢＥＥＮＯＳ	1,600	1,111.00	1,777,600	
あさひ	2,100	1,265.00	2,656,500	
日本調剤	800	3,850.00	3,080,000	
コスモス薬品	1,200	23,490.00	28,188,000	
シップヘルスケアホールディングス	4,500	4,630.00	20,835,000	
ソフトクリエイトホールディングス	1,200	1,766.00	2,119,200	
オンリー	2,300	778.00	1,789,400	
セブン&アイ・ホールディングス	109,500	3,920.00	429,240,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,500	2,253.00	16,897,500	
明治電機工業	1,200	1,440.00	1,728,000	
ツルハホールディングス	6,100	12,670.00	77,287,000	
サンマルクホールディングス	2,200	2,169.00	4,771,800	
フェリシモ	1,800	942.00	1,695,600	
トリドールホールディングス	3,500	2,735.00	9,572,500	
帝人	22,700	2,011.00	45,649,700	
東レ	201,500	700.00	141,050,000	
クラレ	43,800	1,262.00	55,275,600	
旭化成	184,500	1,024.00	188,928,000	
サカイオーベックス	1,000	1,903.00	1,903,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	3,600	457.00	1,645,200	
稲葉製作所	1,600	1,334.00	2,134,400	
宮地エンジニアリンググループ	900	2,043.00	1,838,700	
トーカロ	7,800	1,125.00	8,775,000	
アルファ	1,400	1,175.00	1,645,000	
ＳＵＭＣＯ	33,600	1,869.00	62,798,400	
川田テクノロジーズ	600	6,190.00	3,714,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	800	2,787.00	2,229,600	
ハウスドゥ	1,500	1,190.00	1,785,000	
アグレ都市デザイン	3,500	517.00	1,809,500	
ジェイ・エス・ビー	300	5,170.00	1,551,000	
テンポイノベーション	1,900	953.00	1,810,700	

住江織物	800	2,332.00	1,865,600	
日本フエルト	3,700	485.00	1,794,500	
イチカワ	1,300	1,431.00	1,860,300	
芦森工業	1,300	1,271.00	1,652,300	
アツギ	2,400	787.00	1,888,800	
ＪＭホールディングス	1,400	2,266.00	3,172,400	
コメダホールディングス	6,100	2,141.00	13,060,100	
サツドラホールディングス	1,000	1,815.00	1,815,000	
バロックジャパンリミテッド	1,900	982.00	1,865,800	
クスリのアオキホールディングス	2,500	6,560.00	16,400,000	
スシローグローバルホールディングス	3,100	8,800.00	27,280,000	
ＬＩＸＩＬビバ	2,800	2,345.00	6,566,000	
セーレン	6,800	1,585.00	10,778,000	
ソトー	1,900	969.00	1,841,100	
東海染工	1,600	1,123.00	1,796,800	
小松マテーレ	4,600	790.00	3,634,000	
ワコールホールディングス	7,300	2,800.00	20,440,000	
ホギメディカル	3,200	3,305.00	10,576,000	
クラウディアホールディングス	3,800	459.00	1,744,200	
ＴＳＩホールディングス	9,300	495.00	4,603,500	
マツオカコーポレーション	900	2,049.00	1,844,100	
ワールド	3,900	2,324.00	9,063,600	
ＴＩＳ	9,300	7,120.00	66,216,000	
電算システム	1,100	2,602.00	2,862,200	
グリー	17,100	457.00	7,814,700	
コーエーテクモホールディングス	5,700	3,080.00	17,556,000	
三菱総合研究所	1,200	4,120.00	4,944,000	
ボルテージ	3,500	507.00	1,774,500	
電算	800	2,251.00	1,800,800	
ＡＧＳ	2,200	792.00	1,742,400	
ファインデックス	2,300	885.00	2,035,500	
ブレインパッド	700	5,090.00	3,563,000	
ＫＬａｂ	5,400	759.00	4,098,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,400	978.00	3,325,200	
ネクソン	79,400	1,823.00	144,746,200	
アイスタイル	7,800	350.00	2,730,000	
エムアップ	800	2,730.00	2,184,000	
エイチーム	1,900	888.00	1,687,200	
エニグモ	2,000	829.00	1,658,000	
テクノスジャパン	3,500	496.00	1,736,000	
コロプラ	9,100	947.00	8,617,700	
オルトプラス	2,100	916.00	1,923,600	
ブロードリーフ	13,800	523.00	7,217,400	
クロス・マーケティンググループ	5,000	430.00	2,150,000	
デジタルハーツホールディングス	1,800	965.00	1,737,000	
システム情報	2,000	836.00	1,672,000	
メディアドゥホールディングス	900	3,080.00	2,772,000	
じげん	6,900	438.00	3,022,200	
フィックスターズ	3,000	1,349.00	4,047,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,600	1,099.00	1,758,400	
オプティム	700	4,650.00	3,255,000	
セレス	1,400	1,280.00	1,792,000	
ＳＨＩＦＴ	700	7,220.00	5,054,000	
特種東海製紙	1,800	3,995.00	7,191,000	
ティーガイア	2,500	2,314.00	5,785,000	

セック	500	3,670.00	1,835,000	
豆蔵ホールディングス	1,900	1,881.00	3,573,900	
テクマトリックス	2,000	2,830.00	5,660,000	
プロシップ	1,300	1,388.00	1,804,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,700	1,839.00	12,321,300	
GMOペイメントゲートウェイ	4,600	7,550.00	34,730,000	
ザッパラス	4,700	355.00	1,668,500	
インターネットイニシアティブ	4,100	3,340.00	13,694,000	
さくらインターネット	3,000	615.00	1,845,000	
GMOクラウド	700	2,479.00	1,735,300	
ＳＲＡホールディングス	1,500	2,579.00	3,868,500	
朝日ネット	2,600	713.00	1,853,800	
ｅＢＡＳＥ	1,700	1,705.00	2,898,500	
アバント	2,000	961.00	1,922,000	
アドソル日進	1,000	2,442.00	2,442,000	
フリービット	2,100	803.00	1,686,300	
コムチュア	3,100	2,258.00	6,999,800	
サイバーコム	900	1,900.00	1,710,000	
アステリア	3,100	529.00	1,639,900	
アイル	1,000	1,826.00	1,826,000	
王子ホールディングス	116,300	597.00	69,431,100	
日本製紙	12,300	1,721.00	21,168,300	
三菱製紙	4,000	440.00	1,760,000	
北越コーポレーション	18,500	491.00	9,083,500	
中越パルプ工業	1,200	1,478.00	1,773,600	
大王製紙	12,200	1,441.00	17,580,200	
阿波製紙	1,100	518.00	569,800	
マークラインズ	1,400	1,998.00	2,797,200	
メディカル・データ・ビジョン	2,100	925.00	1,942,500	
ｇｕｍｉ	3,600	726.00	2,613,600	
モバイルファクトリー	1,000	1,850.00	1,850,000	
テラスカイ	1,000	3,245.00	3,245,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,655.00	1,820,500	
ＰＣＩホールディングス	800	2,250.00	1,800,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	500	2,581.00	1,290,500	
ランドコンピュータ	1,500	1,197.00	1,795,500	
ダブルスタンダード	400	4,020.00	1,608,000	
オープンドア	1,400	1,210.00	1,694,000	
アカツキ	1,000	4,730.00	4,730,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,200	1,319.00	1,582,800	
ＬＩＮＥ	6,400	5,370.00	34,368,000	
レンゴー	26,300	819.00	21,539,700	
トーモク	1,700	1,706.00	2,900,200	
ザ・パック	2,100	4,165.00	8,746,500	
チェンジ	600	4,260.00	2,556,000	
シンクロ・フード	3,300	429.00	1,415,700	
オークネット	1,700	1,191.00	2,024,700	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,800	741.00	2,074,800	
マクロミル	5,700	1,038.00	5,916,600	
ビーグリー	1,400	1,506.00	2,108,400	
オロ	700	3,335.00	2,334,500	
昭和電工	19,800	2,655.00	52,569,000	
住友化学	204,500	442.00	90,389,000	
住友精化	1,200	3,165.00	3,798,000	

日産化学	15,600	5,050.00	78,780,000	
クレハ	2,400	5,950.00	14,280,000	
多木化学	800	4,425.00	3,540,000	
テイカ	2,000	1,631.00	3,262,000	
石原産業	5,000	823.00	4,115,000	
片倉コープアグリ	1,500	1,231.00	1,846,500	
日本曹達	4,100	3,175.00	13,017,500	
東ソー	43,000	1,641.00	70,563,000	
トクヤマ	8,000	2,715.00	21,720,000	
セントラル硝子	5,700	2,275.00	12,967,500	
東亞合成	17,500	1,225.00	21,437,500	
大阪ソーダ	2,800	2,730.00	7,644,000	
関東電化工業	6,600	1,000.00	6,600,000	
デンカ	10,200	2,943.00	30,018,600	
イビデン	17,400	2,736.00	47,606,400	
信越化学工業	47,800	13,745.00	657,011,000	
日本カーバイド工業	1,400	1,271.00	1,779,400	
堺化学工業	1,800	2,186.00	3,934,800	
第一稀元素化学工業	3,000	851.00	2,553,000	
エア・ウォーター	25,900	1,529.00	39,601,100	
大陽日酸	26,700	2,194.00	58,579,800	
日本化学工業	900	2,656.00	2,390,400	
日本パーカライジング	14,000	1,102.00	15,428,000	
高圧ガス工業	4,400	752.00	3,308,800	
四国化成工業	4,300	1,212.00	5,211,600	
ステラ　ケミファ	1,500	3,230.00	4,845,000	
保土谷化学工業	1,000	4,345.00	4,345,000	
日本触媒	4,300	6,050.00	26,015,000	
大日精化工業	2,500	2,629.00	6,572,500	
カネカ	7,200	3,310.00	23,832,000	
協和キリン	28,600	2,710.00	77,506,000	
三菱瓦斯化学	26,300	1,821.00	47,892,300	
三井化学	25,300	2,541.00	64,287,300	
ＪＳＲ	25,900	2,122.00	54,959,800	
東京応化工業	4,800	4,420.00	21,216,000	
大阪有機化学工業	2,600	1,715.00	4,459,000	
三菱ケミカルホールディングス	186,000	787.30	146,437,800	
ＫＨネオケム	4,900	2,434.00	11,926,600	
ダイセル	38,100	1,003.00	38,214,300	
住友ベークライト	4,400	3,595.00	15,818,000	
積水化学工業	59,800	1,807.00	108,058,600	
日本ゼオン	25,100	1,209.00	30,345,900	
アイカ工業	8,300	3,475.00	28,842,500	
宇部興産	14,100	2,166.00	30,540,600	
積水樹脂	5,000	2,373.00	11,865,000	
タキロンシーアイ	6,000	625.00	3,750,000	
旭有機材	1,600	1,604.00	2,566,400	
日立化成	12,900	4,605.00	59,404,500	
ニチバン	1,500	1,680.00	2,520,000	
リケンテクノス	7,000	464.00	3,248,000	
大倉工業	1,300	1,630.00	2,119,000	
積水化成品工業	3,700	677.00	2,504,900	
群栄化学工業	700	2,449.00	1,714,300	
タイガースポリマー	3,200	554.00	1,772,800	
ダイキョーニシカワ	5,900	725.00	4,277,500	
竹本容器	2,100	855.00	1,795,500	

森六ホールディングス	1,500	2,149.00	3,223,500	
日本化薬	17,200	1,286.00	22,119,200	
カーリットホールディングス	3,100	555.00	1,720,500	
ＥＰＳホールディングス	4,100	1,260.00	5,166,000	
プレステージ・インターナショナル	10,200	987.00	10,067,400	
プロトコーポレーション	2,500	1,339.00	3,347,500	
アミューズ	1,500	2,637.00	3,955,500	
野村総合研究所	39,500	2,640.00	104,280,000	
クイック	1,700	1,444.00	2,454,800	
ＴＡＣ	8,900	198.00	1,762,200	
ＣＥホールディングス	3,600	476.00	1,713,600	
ケネディクス	25,300	672.00	17,001,600	
電通グループ	28,000	3,380.00	94,640,000	
インテージホールディングス	3,500	836.00	2,926,000	
東邦システムサイエンス	2,000	907.00	1,814,000	
ぴあ	800	3,885.00	3,108,000	
イオンファンタジー	1,000	2,222.00	2,222,000	
ソースネクスト	13,200	402.00	5,306,400	
シーティーエス	3,100	726.00	2,250,600	
ネクシィーズグループ	1,100	1,564.00	1,720,400	
インフォコム	3,000	2,801.00	8,403,000	
メディカルシステムネットワーク	3,700	484.00	1,790,800	
日本精化	2,200	1,362.00	2,996,400	
扶桑化学工業	2,800	3,420.00	9,576,000	
トリケミカル研究所	600	9,550.00	5,730,000	
ラクスル	1,500	3,445.00	5,167,500	
ＦＩＧ	6,300	288.00	1,814,400	
ＡＤＥＫＡ	12,800	1,547.00	19,801,600	
日油	10,500	3,710.00	38,955,000	
ミヨシ油脂	1,500	1,072.00	1,608,000	
新日本理化	8,600	198.00	1,702,800	
ハリマ化成グループ	2,300	1,051.00	2,417,300	
イーソル	1,000	1,878.00	1,878,000	
アルテリア・ネットワークス	3,100	1,899.00	5,886,900	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,100	1,552.00	1,707,200	
花王	68,000	8,525.00	579,700,000	
第一工業製薬	1,000	4,290.00	4,290,000	
日華化学	2,100	777.00	1,631,700	
ニイタカ	800	2,605.00	2,084,000	
三洋化成工業	1,700	4,835.00	8,219,500	
武田薬品工業	236,400	4,163.00	984,133,200	
アステラス製薬	249,900	1,913.00	478,058,700	
大日本住友製薬	21,100	1,722.00	36,334,200	
塩野義製薬	36,300	6,459.00	234,461,700	
わかもと製薬	7,000	279.00	1,953,000	
あすか製薬	3,200	1,111.00	3,555,200	
日本新薬	7,400	9,220.00	68,228,000	
ビオフェルミン製薬	800	2,374.00	1,899,200	
中外製薬	29,600	12,085.00	357,716,000	
科研製薬	4,900	5,820.00	28,518,000	
エーザイ	34,000	8,968.00	304,912,000	
理研ビタミン	1,300	3,965.00	5,154,500	
ロート製薬	14,600	3,270.00	47,742,000	
小野薬品工業	65,300	2,541.00	165,927,300	
久光製薬	7,600	5,530.00	42,028,000	

有機合成薬品工業	6,900	418.00	2,884,200	
持田製薬	3,900	4,260.00	16,614,000	
参天製薬	52,900	1,954.00	103,366,600	
扶桑薬品工業	1,000	1,955.00	1,955,000	
ツムラ	8,800	2,803.00	24,666,400	
日医工	8,000	1,316.00	10,528,000	
テルモ	80,400	3,844.00	309,057,600	
みらかホールディングス	7,600	2,806.00	21,325,600	
キッセイ薬品工業	5,000	2,858.00	14,290,000	
生化学工業	5,500	1,219.00	6,704,500	
栄研化学	5,000	2,171.00	10,855,000	
日水製薬	1,400	1,319.00	1,846,600	
鳥居薬品	1,800	3,605.00	6,489,000	
ＪＣＲファーマ	2,000	11,030.00	22,060,000	
東和薬品	3,600	2,388.00	8,596,800	
富士製薬工業	1,900	1,239.00	2,354,100	
沢井製薬	5,800	7,040.00	40,832,000	
ゼリア新薬工業	5,200	1,950.00	10,140,000	
第一三共	81,300	7,715.00	627,229,500	
キョーリン製薬ホールディングス	6,300	2,129.00	13,412,700	
大幸薬品	1,100	5,230.00	5,753,000	
ダイト	1,700	3,400.00	5,780,000	
大塚ホールディングス	54,100	4,491.00	242,963,100	
大正製薬ホールディングス	6,000	7,240.00	43,440,000	
ペプチドリーム	14,400	5,190.00	74,736,000	
大日本塗料	3,100	1,071.00	3,320,100	
日本ペイントホールディングス	23,000	5,010.00	115,230,000	
関西ペイント	31,300	2,531.00	79,220,300	
中国塗料	7,900	933.00	7,370,700	
日本特殊塗料	2,100	1,189.00	2,496,900	
藤倉化成	3,800	530.00	2,014,000	
太陽ホールディングス	2,000	4,750.00	9,500,000	
ＤＩＣ	11,800	2,927.00	34,538,600	
サカタインクス	6,100	1,156.00	7,051,600	
東洋インキＳＣホールディングス	5,900	2,392.00	14,112,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	2,200	920.00	2,024,000	
アルプス技研	2,400	1,962.00	4,708,800	
日本空調サービス	2,800	753.00	2,108,400	
オリエンタルランド	28,900	13,795.00	398,675,500	
フォーカスシステムズ	1,900	892.00	1,694,800	
ダスキン	7,000	2,999.00	20,993,000	
パーク２４	15,000	2,629.00	39,435,000	
明光ネットワークジャパン	3,200	916.00	2,931,200	
ファルコホールディングス	1,500	1,931.00	2,896,500	
クレスコ	1,700	1,943.00	3,303,100	
フジ・メディア・ホールディングス	26,900	1,421.00	38,224,900	
秀英予備校	4,000	443.00	1,772,000	
ラウンドワン	7,600	933.00	7,090,800	
リゾートトラスト	12,400	1,613.00	20,001,200	
オービック	9,700	14,630.00	141,911,000	
ジャストシステム	4,500	5,130.00	23,085,000	
ＴＤＣソフト	2,400	929.00	2,229,600	
Ｚホールディングス	382,900	423.00	161,966,700	
ビー・エム・エル	3,500	3,305.00	11,567,500	
トレンドマイクロ	12,400	5,890.00	73,036,000	
りらいあコミュニケーションズ	4,900	1,445.00	7,080,500	

ＩＤホールディングス	1,100	1,629.00	1,791,900	
リソー教育	12,400	382.00	4,736,800	
日本オラクル	5,700	9,560.00	54,492,000	
アルファシステムズ	900	2,829.00	2,546,100	
フューチャー	3,400	1,768.00	6,011,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,800	1,275.00	2,295,000	
ＳＢテクノロジー	1,000	2,363.00	2,363,000	
トーセ	1,900	888.00	1,687,200	
ユー・エス・エス	30,400	1,884.00	57,273,600	
オービックビジネスコンサルタント	2,800	4,165.00	11,662,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	12,700	3,325.00	42,227,500	
アイティフォー	3,400	749.00	2,546,600	
東京個別指導学院	1,700	687.00	1,167,900	
東計電算	400	4,530.00	1,812,000	
サイバーエージェント	15,600	4,410.00	68,796,000	
楽天	126,600	948.00	120,016,800	
エックスネット	1,900	971.00	1,844,900	
クリーク・アンド・リバー社	1,700	1,005.00	1,708,500	
テー・オー・ダブリュー	2,200	859.00	1,889,800	
大塚商会	15,100	4,850.00	73,235,000	
サイボウズ	3,300	2,249.00	7,421,700	
山田コンサルティンググループ	1,300	1,550.00	2,015,000	
セントラルスポーツ	1,000	2,976.00	2,976,000	
電通国際情報サービス	1,700	4,955.00	8,423,500	
デジタルガレージ	5,000	4,075.00	20,375,000	
イーエムシステムズ	3,900	899.00	3,506,100	
ウェザーニューズ	900	3,845.00	3,460,500	
ＣＩＪ	2,200	823.00	1,810,600	
ビジネスエンジニアリング	500	3,180.00	1,590,000	
日本エンタープライズ	6,900	256.00	1,766,400	
ＷＯＷＯＷ	1,300	2,663.00	3,461,900	
スカラ	2,400	709.00	1,701,600	
フルキャストホールディングス	2,700	2,463.00	6,650,100	
エン・ジャパン	4,800	3,485.00	16,728,000	
富士フイルムホールディングス	54,500	5,364.00	292,338,000	
コニカミノルタ	62,100	654.00	40,613,400	
資生堂	56,500	6,985.00	394,652,500	
ライオン	36,900	1,999.00	73,763,100	
高砂香料工業	1,800	2,309.00	4,156,200	
マンダム	6,400	2,551.00	16,326,400	
ミルボン	3,800	5,880.00	22,344,000	
ファンケル	11,500	3,070.00	35,305,000	
コーセー	5,300	14,280.00	75,684,000	
コタ	1,500	1,479.00	2,218,500	
シーボン	700	2,455.00	1,718,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	12,100	2,263.00	27,382,300	
ノエビアホールディングス	2,700	5,090.00	13,743,000	
アジュバンコスメジャパン	1,800	987.00	1,776,600	
エステー	1,800	1,601.00	2,881,800	
アグロ　カネショウ	1,200	1,409.00	1,690,800	
コニシ	4,700	1,529.00	7,186,300	
長谷川香料	3,800	2,177.00	8,272,600	
星光ＰＭＣ	2,000	884.00	1,768,000	
小林製薬	8,000	8,570.00	68,560,000	
荒川化学工業	2,600	1,491.00	3,876,600	
メック	2,000	1,542.00	3,084,000	

日本高純度化学	800	2,661.00	2,128,800	
タカラバイオ	7,400	2,249.00	16,642,600	
ＪＣＵ	3,400	2,962.00	10,070,800	
新田ゼラチン	2,700	640.00	1,728,000	
デクセリアルズ	7,300	915.00	6,679,500	
アース製薬	2,100	6,060.00	12,726,000	
北興化学工業	2,900	625.00	1,812,500	
大成ラミック	900	2,804.00	2,523,600	
クミアイ化学工業	11,700	833.00	9,746,100	
日本農薬	5,100	552.00	2,815,200	
富士興産	2,700	677.00	1,827,900	
ニチレキ	3,400	1,393.00	4,736,200	
ユシロ化学工業	1,600	1,335.00	2,136,000	
ビーピー・カストロール	1,300	1,372.00	1,783,600	
富士石油	3,600	232.00	835,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,300	1,336.00	1,736,800	
出光興産	32,000	2,903.00	92,896,000	
ＪＸＴＧホールディングス	427,500	468.30	200,198,250	
コスモエネルギーホールディングス	8,200	2,000.00	16,400,000	
横浜ゴム	16,500	2,017.00	33,280,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	16,300	1,620.00	26,406,000	
ブリヂストン	87,300	3,983.00	347,715,900	
住友ゴム工業	25,600	1,246.00	31,897,600	
オカモト	1,800	3,660.00	6,588,000	
アキレス	2,000	1,949.00	3,898,000	
フコク	2,600	688.00	1,788,800	
ニッタ	3,200	2,881.00	9,219,200	
クリエートメディック	1,600	1,104.00	1,766,400	
住友理工	5,500	832.00	4,576,000	
三ツ星ベルト	3,700	1,727.00	6,389,900	
バンドー化学	5,000	817.00	4,085,000	
ＡＧＣ	28,100	3,480.00	97,788,000	
日本板硝子	13,600	567.00	7,711,200	
有沢製作所	4,500	910.00	4,095,000	
日本山村硝子	1,500	1,190.00	1,785,000	
日本電気硝子	11,400	2,059.00	23,472,600	
オハラ	1,400	1,274.00	1,783,600	
住友大阪セメント	5,400	4,170.00	22,518,000	
太平洋セメント	17,900	2,946.00	52,733,400	
リソルホールディングス	400	4,145.00	1,658,000	
日本ヒューム	2,800	762.00	2,133,600	
日本コンクリート工業	6,500	288.00	1,872,000	
三谷セキサン	1,300	3,790.00	4,927,000	
アジアパイルホールディングス	4,100	528.00	2,164,800	
東海カーボン	29,800	1,016.00	30,276,800	
日本カーボン	1,500	4,000.00	6,000,000	
東洋炭素	1,700	2,013.00	3,422,100	
ノリタケカンパニーリミテド	1,600	4,170.00	6,672,000	
ＴＯＴＯ	20,300	4,600.00	93,380,000	
日本碍子	34,700	1,882.00	65,305,400	
日本特殊陶業	22,100	1,933.00	42,719,300	
ＭＡＲＵＷＡ	1,100	7,760.00	8,536,000	
品川リフラクトリーズ	700	2,926.00	2,048,200	
黒崎播磨	600	6,320.00	3,792,000	
ヨータイ	2,700	673.00	1,817,100	
イソライト工業	3,100	556.00	1,723,600	

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

コロナ	1,800	991.00	1,783,800	
横河ブリッジホールディングス	5,200	2,218.00	11,533,600	
ＯＳＪＢホールディングス	14,100	264.00	3,722,400	
三和ホールディングス	27,000	1,106.00	29,862,000	
文化シヤッター	8,300	836.00	6,938,800	
三協立山	3,600	1,308.00	4,708,800	
アルインコ	2,000	1,091.00	2,182,000	
ＬＩＸＩＬグループ	41,500	1,907.00	79,140,500	
日本フイルコン	3,500	510.00	1,785,000	
ノーリツ	5,800	1,306.00	7,574,800	
長府製作所	2,900	2,241.00	6,498,900	
リンナイ	5,500	8,170.00	44,935,000	
ユニプレス	5,500	1,296.00	7,128,000	
ダイニチ工業	2,600	664.00	1,726,400	
日東精工	3,900	526.00	2,051,400	
三洋工業	900	1,977.00	1,779,300	
岡部	5,700	852.00	4,856,400	
ジーテクト	3,500	1,460.00	5,110,000	
東プレ	5,200	1,605.00	8,346,000	
高周波熱錬	5,400	814.00	4,395,600	
東京製綱	2,000	946.00	1,892,000	
サンコール	1,400	548.00	767,200	
モリテックスチール	5,100	333.00	1,698,300	
パイオラックス	4,200	1,807.00	7,589,400	
エイチワン	2,800	667.00	1,867,600	
日本発条	30,100	910.00	27,391,000	
三浦工業	12,200	3,840.00	46,848,000	
タクマ	9,500	1,240.00	11,780,000	
テクノプロ・ホールディングス	5,400	7,730.00	41,742,000	
インターワークス	3,300	538.00	1,775,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	7,370.00	8,107,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,500	1,120.00	1,680,000	
三機サービス	1,800	995.00	1,791,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,700	1,159.00	1,970,300	
イー・ガーディアン	1,400	1,914.00	2,679,600	
リブセンス	6,400	281.00	1,798,400	
ジャパンマテリアル	8,300	1,517.00	12,591,100	
ベクトル	3,400	1,199.00	4,076,600	
ウチヤマホールディングス	3,800	447.00	1,698,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	2,300	938.00	2,157,400	
キャリアリンク	3,200	584.00	1,868,800	
ＩＢＪ	1,900	1,221.00	2,319,900	
アサンテ	1,100	1,875.00	2,062,500	
Ｎ・フィールド	3,000	562.00	1,686,000	
バリューＨＲ	600	3,445.00	2,067,000	
Ｍ&Ａキャピタルパートナーズ	1,900	3,750.00	7,125,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,000	1,665.00	1,665,000	
ＥＲＩホールディングス	2,300	766.00	1,761,800	
アビスト	700	2,533.00	1,773,100	
シグマクシス	1,900	1,665.00	3,163,500	
ウィルグループ	1,800	995.00	1,791,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	212.00	1,823,200	
リクルートホールディングス	194,500	4,552.00	885,364,000	
エラン	1,600	1,644.00	2,630,400	
ツガミ	5,800	978.00	5,672,400	

オークマ	3,300	5,000.00	16,500,000	
東芝機械	3,200	3,180.00	10,176,000	
アマダホールディングス	35,700	1,086.00	38,770,200	
アイダエンジニアリング	7,400	878.00	6,497,200	
滝澤鉄工所	1,400	1,285.00	1,799,000	
ＦＵＪＩ	12,100	1,909.00	23,098,900	
牧野フライス製作所	3,300	4,065.00	13,414,500	
オーエスジー	13,000	1,779.00	23,127,000	
ダイジェット工業	1,300	1,379.00	1,792,700	
旭ダイヤモンド工業	7,400	571.00	4,225,400	
ＤＭＧ森精機	17,800	1,528.00	27,198,400	
ソディック	6,600	817.00	5,392,200	
ディスコ	3,800	24,740.00	94,012,000	
日東工器	1,500	2,440.00	3,660,000	
日進工具	800	2,818.00	2,254,400	
パンチ工業	4,100	409.00	1,676,900	
日本郵政	222,500	1,005.00	223,612,500	
ベルシステム２４ホールディングス	4,500	1,508.00	6,786,000	
鎌倉新書	2,000	1,648.00	3,296,000	
一蔵	2,700	623.00	1,682,100	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	900	2,476.00	2,228,400	
エアトリ	1,200	1,328.00	1,593,600	
アトラエ	700	2,805.00	1,963,500	
ストライク	1,000	4,730.00	4,730,000	
ソラスト	7,500	1,060.00	7,950,000	
セラク	1,500	1,226.00	1,839,000	
インソース	1,300	2,893.00	3,760,900	
豊田自動織機	23,000	6,340.00	145,820,000	
豊和工業	2,300	769.00	1,768,700	
ＯＫＫ	2,900	600.00	1,740,000	
東洋機械金属	3,500	501.00	1,753,500	
エンシュウ	1,000	1,112.00	1,112,000	
島精機製作所	4,500	1,928.00	8,676,000	
オプトラン	3,100	3,265.00	10,121,500	
ＮＣホールディングス	2,600	648.00	1,684,800	
イワキ	1,500	1,069.00	1,603,500	
フリュー	2,700	1,158.00	3,126,600	
ヤマシンフィルタ	6,100	692.00	4,221,200	
日阪製作所	3,500	936.00	3,276,000	
やまびこ	5,400	1,004.00	5,421,600	
平田機工	1,300	5,830.00	7,579,000	
ペガサスミシン製造	3,900	456.00	1,778,400	
ナブテスコ	16,600	3,245.00	53,867,000	
三井海洋開発	3,000	1,990.00	5,970,000	
レオン自動機	2,800	1,340.00	3,752,000	
ＳＭＣ	8,900	49,230.00	438,147,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	2,900	748.00	2,169,200	
ホソカワミクロン	1,000	5,380.00	5,380,000	
ユニオンツール	1,000	2,986.00	2,986,000	
オイレス工業	3,600	1,544.00	5,558,400	
日精エー・エス・ビー機械	900	4,110.00	3,699,000	
サトーホールディングス	4,000	2,744.00	10,976,000	
技研製作所	2,500	4,415.00	11,037,500	
日本エアーテック	1,900	1,031.00	1,958,900	
カワタ	1,800	1,004.00	1,807,200	

日精樹脂工業	2,400	929.00	2,229,600	
オカダアイヨン	1,500	1,080.00	1,620,000	
小松製作所	128,700	2,300.00	296,010,000	
住友重機械工業	16,300	2,666.00	43,455,800	
日立建機	11,400	2,952.00	33,652,800	
日工	3,900	776.00	3,026,400	
巴工業	1,200	2,125.00	2,550,000	
井関農機	2,800	1,359.00	3,805,200	
ＴＯＷＡ	2,900	1,111.00	3,221,900	
丸山製作所	1,100	1,614.00	1,775,400	
北川鉄工所	1,300	1,981.00	2,575,300	
シンニッタン	4,400	392.00	1,724,800	
ローツェ	1,200	3,965.00	4,758,000	
タカキタ	3,400	528.00	1,795,200	
クボタ	150,800	1,607.00	242,335,600	
荏原実業	900	2,002.00	1,801,800	
東洋エンジニアリング	3,700	575.00	2,127,500	
三菱化工機	1,000	1,913.00	1,913,000	
月島機械	5,200	1,347.00	7,004,400	
帝国電機製作所	2,300	1,462.00	3,362,600	
新東工業	6,700	900.00	6,030,000	
澁谷工業	2,500	2,735.00	6,837,500	
アイチコーポレーション	4,900	695.00	3,405,500	
小森コーポレーション	7,200	923.00	6,645,600	
鶴見製作所	2,200	1,879.00	4,133,800	
荏原製作所	11,700	2,830.00	33,111,000	
酉島製作所	2,900	841.00	2,438,900	
北越工業	2,900	1,297.00	3,761,300	
ダイキン工業	36,200	15,445.00	559,109,000	
オルガノ	1,000	6,890.00	6,890,000	
トーヨーカネツ	1,200	2,454.00	2,944,800	
栗田工業	15,400	3,235.00	49,819,000	
椿本チエイン	4,100	3,220.00	13,202,000	
日機装	8,500	1,109.00	9,426,500	
木村化工機	3,200	557.00	1,782,400	
レイズネクスト	4,800	1,286.00	6,172,800	
アネスト岩田	4,400	1,024.00	4,505,600	
ダイフク	14,500	6,970.00	101,065,000	
サムコ	900	1,920.00	1,728,000	
加藤製作所	1,600	1,455.00	2,328,000	
油研工業	1,100	1,676.00	1,843,600	
タダノ	13,700	1,014.00	13,891,800	
フジテック	10,300	1,700.00	17,510,000	
ＣＫＤ	7,900	1,966.00	15,531,400	
キトー	2,100	1,682.00	3,532,200	
平和	7,900	2,250.00	17,775,000	
理想科学工業	2,500	1,928.00	4,820,000	
ＳＡＮＫＹＯ	6,300	3,895.00	24,538,500	
日本金銭機械	3,100	780.00	2,418,000	
マースグループホールディングス	1,800	1,992.00	3,585,600	
フクシマガリレイ	1,800	4,025.00	7,245,000	
ダイコク電機	1,300	1,383.00	1,797,900	
竹内製作所	4,800	1,911.00	9,172,800	
アマノ	7,400	2,881.00	21,319,400	
ＪＵＫＩ	4,000	802.00	3,208,000	
サンデンホールディングス	3,700	624.00	2,308,800	

蛇の目ミシン工業	4,600	390.00	1,794,000	
ブラザー工業	34,700	2,142.00	74,327,400	
マックス	4,300	2,007.00	8,630,100	
モリタホールディングス	5,000	1,766.00	8,830,000	
グローリー	7,300	3,160.00	23,068,000	
新晃工業	2,600	1,664.00	4,326,400	
大和冷機工業	4,100	1,071.00	4,391,100	
セガサミーホールディングス	28,200	1,660.00	46,812,000	
日本ピストンリング	1,300	1,432.00	1,861,600	
リケン	1,300	3,405.00	4,426,500	
ＴＰＲ	3,800	1,649.00	6,266,200	
ツバキ・ナカシマ	5,800	1,198.00	6,948,400	
ホシザキ	8,300	10,480.00	86,984,000	
大豊工業	2,600	678.00	1,762,800	
日本精工	53,500	908.00	48,578,000	
ＮＴＮ	65,800	294.00	19,345,200	
ジェイテクト	27,300	1,159.00	31,640,700	
不二越	2,600	4,020.00	10,452,000	
ミネベアミツミ	52,700	2,172.00	114,464,400	
日本トムソン	8,400	429.00	3,603,600	
ＴＨＫ	16,500	2,762.00	45,573,000	
ユーシン精機	2,200	899.00	1,977,800	
前澤給装工業	1,000	2,198.00	2,198,000	
イーグル工業	3,500	934.00	3,269,000	
日本ピラー工業	2,900	1,509.00	4,376,100	
キッツ	11,500	712.00	8,188,000	
日立製作所	136,500	4,189.00	571,798,500	
三菱電機	284,100	1,566.50	445,042,650	
富士電機	17,100	3,385.00	57,883,500	
東洋電機製造	1,200	1,393.00	1,671,600	
安川電機	30,600	3,735.00	114,291,000	
シンフォニア　テクノロジー	3,700	1,185.00	4,384,500	
明電舎	5,200	1,981.00	10,301,200	
オリジン	1,200	1,486.00	1,783,200	
山洋電気	1,400	5,140.00	7,196,000	
デンヨー	2,400	2,041.00	4,898,400	
ベイカレント・コンサルティング	1,600	7,880.00	12,608,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	1,300	1,263.00	1,641,900	
グレイステクノロジー	1,200	3,205.00	3,846,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,900	2,216.00	6,426,400	
フルテック	1,600	1,130.00	1,808,000	
日総工産	2,000	818.00	1,636,000	
キュービーネットホールディングス	1,100	2,280.00	2,508,000	
ＲＰＡホールディングス	1,700	1,091.00	1,854,700	
三櫻工業	3,600	1,014.00	3,650,400	
マキタ	37,100	4,130.00	153,223,000	
東芝テック	3,600	4,160.00	14,976,000	
芝浦メカトロニクス	500	3,390.00	1,695,000	
マブチモーター	7,900	4,160.00	32,864,000	
日本電産	34,200	14,075.00	481,365,000	
トレックス・セミコンダクター	1,600	1,487.00	2,379,200	
東光高岳	1,600	1,142.00	1,827,200	
ダブル・スコープ	4,500	745.00	3,352,500	
ダイヘン	3,100	3,305.00	10,245,500	
ヤーマン	4,600	627.00	2,884,200	

ＪＶＣケンウッド	23,100	252.00	5,821,200	
ミマキエンジニアリング	3,600	499.00	1,796,400	
第一精工	1,200	2,435.00	2,922,000	
日新電機	6,700	1,121.00	7,510,700	
大崎電気工業	5,700	602.00	3,431,400	
オムロン	25,500	6,720.00	171,360,000	
日東工業	4,200	2,146.00	9,013,200	
ＩＤＥＣ	4,100	1,853.00	7,597,300	
不二電機工業	1,500	1,205.00	1,807,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	9,500	2,137.00	20,301,500	
サクサホールディングス	1,000	1,839.00	1,839,000	
メルコホールディングス	1,000	2,537.00	2,537,000	
日本電気	34,500	4,795.00	165,427,500	
富士通	27,400	12,630.00	346,062,000	
沖電気工業	11,500	1,330.00	15,295,000	
電気興業	1,400	3,295.00	4,613,000	
サンケン電気	3,100	2,903.00	8,999,300	
アイホン	1,600	1,676.00	2,681,600	
ルネサスエレクトロニクス	135,800	779.00	105,788,200	
セイコーエプソン	35,300	1,691.00	59,692,300	
ワコム	19,100	388.00	7,410,800	
アルバック	5,200	3,615.00	18,798,000	
ＥＩＺＯ	2,200	3,730.00	8,206,000	
ジャパンディスプレイ	82,100	71.00	5,829,100	
日本信号	7,200	1,358.00	9,777,600	
京三製作所	6,700	555.00	3,718,500	
能美防災	3,800	2,334.00	8,869,200	
ホーチキ	2,100	1,375.00	2,887,500	
エレコム	3,100	3,950.00	12,245,000	
パナソニック	324,600	1,189.00	385,949,400	
シャープ	32,900	1,491.00	49,053,900	
アンリツ	18,300	2,023.00	37,020,900	
富士通ゼネラル	7,700	2,434.00	18,741,800	
ソニー	179,700	7,522.00	1,351,703,400	
ＴＤＫ	13,700	11,450.00	156,865,000	
帝国通信工業	1,500	1,230.00	1,845,000	
タムラ製作所	9,500	574.00	5,453,000	
アルプスアルパイン	25,100	1,836.00	46,083,600	
池上通信機	1,700	1,015.00	1,725,500	
日本電波工業	3,700	480.00	1,776,000	
鈴木	2,100	873.00	1,833,300	
日本トリム	400	3,865.00	1,546,000	
ローランド　ディー．ジー．	1,600	1,835.00	2,936,000	
フォスター電機	3,000	1,545.00	4,635,000	
ＳＭＫ	700	2,832.00	1,982,400	
ヨコオ	1,800	2,954.00	5,317,200	
ホシデン	7,800	1,094.00	8,533,200	
ヒロセ電機	4,400	12,890.00	56,716,000	
日本航空電子工業	6,500	1,921.00	12,486,500	
ＴＯＡ	3,000	1,025.00	3,075,000	
マクセルホールディングス	6,100	1,413.00	8,619,300	
古野電気	3,700	1,059.00	3,918,300	
ユニデンホールディングス	900	2,050.00	1,845,000	
スミダコーポレーション	2,200	1,114.00	2,450,800	
アイコム	1,600	2,579.00	4,126,400	
リオン	1,200	2,821.00	3,385,200	

船井電機	2,900	707.00	2,050,300	
横河電機	26,100	1,939.00	50,607,900	
新電元工業	1,000	3,420.00	3,420,000	
アズビル	17,900	2,937.00	52,572,300	
東亜ディーケーケー	1,800	977.00	1,758,600	
日本光電工業	11,700	3,510.00	41,067,000	
共和電業	4,000	433.00	1,732,000	
日本電子材料	1,600	999.00	1,598,400	
堀場製作所	5,600	6,840.00	38,304,000	
アドバンテスト	21,100	5,610.00	118,371,000	
小野測器	3,000	583.00	1,749,000	
エスペック	2,500	2,184.00	5,460,000	
キーエンス	25,700	38,350.00	985,595,000	
日置電機	1,500	3,695.00	5,542,500	
シスメックス	20,300	7,444.00	151,113,200	
日本マイクロニクス	4,900	1,087.00	5,326,300	
メガチップス	2,600	1,800.00	4,680,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,500	3,090.00	4,635,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	3,800	461.00	1,751,800	
澤藤電機	900	1,951.00	1,755,900	
デンソー	62,600	4,467.00	279,634,200	
原田工業	1,900	957.00	1,818,300	
コーセル	3,800	1,143.00	4,343,400	
イリソ電子工業	2,400	4,060.00	9,744,000	
オプテックスグループ	4,700	1,513.00	7,111,100	
千代田インテグレ	1,300	2,118.00	2,753,400	
アイ・オー・データ機器	1,900	909.00	1,727,100	
レーザーテック	12,500	5,630.00	70,375,000	
スタンレー電気	20,000	2,920.00	58,400,000	
岩崎電気	1,100	1,634.00	1,797,400	
ウシオ電機	16,500	1,475.00	24,337,500	
岡谷電機産業	4,900	363.00	1,778,700	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	4,300	395.00	1,698,500	
エノモト	1,400	1,209.00	1,692,600	
日本セラミック	2,900	2,463.00	7,142,700	
遠藤照明	2,600	686.00	1,783,600	
古河電池	2,400	700.00	1,680,000	
山一電機	2,100	1,877.00	3,941,700	
図研	1,800	2,426.00	4,366,800	
日本電子	5,600	3,365.00	18,844,000	
カシオ計算機	25,100	2,100.00	52,710,000	
ファナック	27,000	20,470.00	552,690,000	
日本シイエムケイ	6,700	560.00	3,752,000	
エンプラス	1,400	2,993.00	4,190,200	
ローム	12,600	8,230.00	103,698,000	
浜松ホトニクス	20,400	4,615.00	94,146,000	
三井ハイテック	3,100	1,611.00	4,994,100	
新光電気工業	9,500	1,361.00	12,929,500	
京セラ	40,000	7,472.00	298,880,000	
協栄産業	1,300	1,379.00	1,792,700	
太陽誘電	12,600	3,485.00	43,911,000	
村田製作所	83,500	6,289.00	525,131,500	
双葉電子工業	4,500	1,185.00	5,332,500	
日東電工	19,600	6,000.00	117,600,000	
北陸電気工業	1,600	1,041.00	1,665,600	
東海理化電機製作所	7,500	1,818.00	13,635,000	

ニチコン	9,600	877.00	8,419,200	
日本ケミコン	2,200	1,786.00	3,929,200	
ＫＯＡ	4,300	1,185.00	5,095,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	10,300	878.00	9,043,400	
日立造船	22,500	424.00	9,540,000	
三菱重工業	47,600	3,762.00	179,071,200	
川崎重工業	22,100	2,219.00	49,039,900	
ＩＨＩ	20,500	2,737.00	56,108,500	
名村造船所	9,200	243.00	2,235,600	
スプリックス	1,700	980.00	1,666,000	
日本車輌製造	1,000	2,870.00	2,870,000	
三菱ロジスネクスト	3,800	1,679.00	6,380,200	
近畿車輌	1,300	1,357.00	1,764,100	
ＦＰＧ	8,600	970.00	8,342,000	
島根銀行	2,800	609.00	1,705,200	
じもとホールディングス	18,900	103.00	1,946,700	
全国保証	7,900	4,550.00	35,945,000	
めぶきフィナンシャルグループ	145,600	234.00	34,070,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,800	1,205.00	4,579,000	
九州フィナンシャルグループ	46,000	410.00	18,860,000	
かんぽ生命保険	9,900	1,821.00	18,027,900	
ゆうちょ銀行	79,400	1,008.00	80,035,200	
富山第一銀行	6,700	308.00	2,063,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	164,800	420.00	69,216,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	19,100	682.00	13,026,200	
日本モーゲージサービス	800	2,225.00	1,780,000	
アルヒ	4,500	1,808.00	8,136,000	
プレミアグループ	1,500	2,059.00	3,088,500	
日産自動車	335,100	504.40	169,024,440	
いすゞ自動車	82,300	1,137.00	93,575,100	
トヨタ自動車	317,100	7,752.00	2,458,159,200	
日野自動車	35,500	1,010.00	35,855,000	
三菱自動車工業	105,200	405.00	42,606,000	
エフテック	900	738.00	664,200	
武蔵精密工業	6,300	1,343.00	8,460,900	
日産車体	5,500	1,073.00	5,901,500	
新明和工業	7,700	1,286.00	9,902,200	
極東開発工業	5,300	1,385.00	7,340,500	
日信工業	5,800	2,240.00	12,992,000	
トピー工業	2,300	1,720.00	3,956,000	
ティラド	1,000	1,770.00	1,770,000	
曙ブレーキ工業	15,600	238.00	3,712,800	
タチエス	4,700	1,252.00	5,884,400	
ＮＯＫ	15,300	1,564.00	23,929,200	
フタバ産業	7,900	620.00	4,898,000	
ＫＹＢ	3,200	2,725.00	8,720,000	
市光工業	4,200	716.00	3,007,200	
大同メタル工業	5,400	668.00	3,607,200	
プレス工業	14,100	352.00	4,963,200	
ミクニ	5,500	320.00	1,760,000	
太平洋工業	5,900	1,293.00	7,628,700	
ケーヒン	6,500	2,587.00	16,815,500	
河西工業	3,800	740.00	2,812,000	
アイシン精機	23,400	3,905.00	91,377,000	
マツダ	83,600	898.00	75,072,800	

今仙電機製作所	2,600	854.00	2,220,400	
本田技研工業	223,700	3,041.00	680,271,700	
スズキ	56,300	4,850.00	273,055,000	
ＳＵＢＡＲＵ	88,200	2,922.50	257,764,500	
安永	1,500	1,142.00	1,713,000	
ヤマハ発動機	37,100	1,946.00	72,196,600	
ショーワ	6,700	2,286.00	15,316,200	
小糸製作所	17,000	4,655.00	79,135,000	
ＴＢＫ	4,000	427.00	1,708,000	
エクセディ	3,900	2,227.00	8,685,300	
ミツバ	5,200	726.00	3,775,200	
豊田合成	9,200	2,501.00	23,009,200	
愛三工業	4,400	693.00	3,049,200	
日本プラスト	2,700	656.00	1,771,200	
ヨロズ	2,700	1,446.00	3,904,200	
エフ・シー・シー	4,600	2,134.00	9,816,400	
シマノ	10,600	15,550.00	164,830,000	
テイ・エス　テック	6,600	3,090.00	20,394,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	16,400	566.00	9,282,400	
三十三フィナンシャルグループ	2,600	1,526.00	3,967,600	
第四北越フィナンシャルグループ	4,900	2,546.00	12,475,400	
ジャムコ	1,400	1,297.00	1,815,800	
小野建	2,500	1,273.00	3,182,500	
ノジマ	5,000	2,137.00	10,685,000	
佐鳥電機	2,100	861.00	1,808,100	
カッパ・クリエイト	3,900	1,448.00	5,647,200	
伯東	1,700	1,194.00	2,029,800	
コンドーテック	2,200	1,166.00	2,565,200	
ライトオン	3,100	570.00	1,767,000	
ナガイレーベン	4,000	2,343.00	9,372,000	
三菱食品	3,100	2,932.00	9,089,200	
良品計画	37,200	1,741.00	64,765,200	
松田産業	2,000	1,499.00	2,998,000	
第一興商	4,200	4,795.00	20,139,000	
メディパルホールディングス	30,200	2,205.00	66,591,000	
アドヴァン	4,300	1,246.00	5,357,800	
ＳＰＫ	700	2,623.00	1,836,100	
萩原電気ホールディングス	1,000	2,525.00	2,525,000	
アルビス	1,100	2,152.00	2,367,200	
アズワン	1,900	9,070.00	17,233,000	
スズデン	1,300	1,415.00	1,839,500	
シモジマ	1,700	1,104.00	1,876,800	
ドウシシャ	2,600	1,568.00	4,076,800	
小津産業	1,000	1,689.00	1,689,000	
コナカ	4,500	400.00	1,800,000	
高速	1,700	1,202.00	2,043,400	
Ｇ－７ホールディングス	1,600	2,512.00	4,019,200	
イオン北海道	2,800	831.00	2,326,800	
コジマ	4,800	490.00	2,352,000	
ヒマラヤ	2,200	833.00	1,832,600	
コーナン商事	4,000	2,410.00	9,640,000	
ネットワンシステムズ	10,600	2,467.00	26,150,200	
エコス	1,100	1,671.00	1,838,100	
ワタミ	3,300	1,178.00	3,887,400	
マルシェ	2,400	766.00	1,838,400	
システムソフト	18,600	94.00	1,748,400	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	61,500	1,962.00	120,663,000	
丸文	2,900	596.00	1,728,400	
西松屋チェーン	6,100	906.00	5,526,600	
ゼンショーホールディングス	13,400	2,462.00	32,990,800	
ハピネット	2,300	1,274.00	2,930,200	
幸楽苑ホールディングス	1,800	1,849.00	3,328,200	
日本ライフライン	8,300	1,403.00	11,644,900	
サイゼリヤ	4,600	2,282.00	10,497,200	
ＶＴホールディングス	11,600	414.00	4,802,400	
マルカ	1,000	2,069.00	2,069,000	
アルゴグラフィックス	2,400	3,675.00	8,820,000	
ＩＤＯＭ	7,500	630.00	4,725,000	
日本エム・ディ・エム	1,600	1,918.00	3,068,800	
ユナイテッドアローズ	2,900	2,755.00	7,989,500	
進和	1,700	2,181.00	3,707,700	
ダイトロン	1,200	1,930.00	2,316,000	
ハイデイ日高	4,000	1,907.00	7,628,000	
シークス	3,600	1,358.00	4,888,800	
京都きもの友禅	5,500	325.00	1,787,500	
コロワイド	9,300	2,204.00	20,497,200	
ピーシーデポコーポレーション	3,700	583.00	2,157,100	
田中商事	2,500	708.00	1,770,000	
オーハシテクニカ	1,600	1,482.00	2,371,200	
壱番屋	2,000	5,430.00	10,860,000	
白銅	1,200	1,408.00	1,689,600	
ＰＬＡＮＴ	3,200	551.00	1,763,200	
スギホールディングス	5,600	5,430.00	30,408,000	
薬王堂ホールディングス	1,200	2,180.00	2,616,000	
島津製作所	34,000	2,877.00	97,818,000	
ＪＭＳ	2,400	840.00	2,016,000	
長野計器	2,100	976.00	2,049,600	
ブイ・テクノロジー	1,300	4,460.00	5,798,000	
スター精密	4,400	1,328.00	5,843,200	
東京計器	1,900	898.00	1,706,200	
インターアクション	1,500	2,761.00	4,141,500	
オーバル	7,500	231.00	1,732,500	
東京精密	5,100	3,875.00	19,762,500	
マニー	11,300	2,548.00	28,792,400	
ニコン	46,000	1,195.00	54,970,000	
トプコン	14,300	1,227.00	17,546,100	
オリンパス	157,200	2,110.00	331,692,000	
理研計器	2,500	2,230.00	5,575,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	4,900	6,210.00	30,429,000	
キヤノン電子	3,000	2,027.00	6,081,000	
タムロン	2,300	2,698.00	6,205,400	
ＨＯＹＡ	56,700	10,195.00	578,056,500	
シード	1,800	961.00	1,729,800	
ノーリツ鋼機	1,900	1,510.00	2,869,000	
エー・アンド・デイ	2,600	1,008.00	2,620,800	
朝日インテック	24,100	2,830.00	68,203,000	
キヤノン	153,000	2,787.50	426,487,500	
リコー	72,300	1,111.00	80,325,300	
シチズン時計	33,300	487.00	16,217,100	
リズム時計工業	2,000	880.00	1,760,000	
大研医器	1,000	678.00	678,000	

メニコン	3,900	5,030.00	19,617,000	
スノーピーク	1,700	851.00	1,446,700	
パラマウントベッドホールディングス	3,000	4,570.00	13,710,000	
トランザクション	1,800	1,073.00	1,931,400	
粧美堂	4,600	391.00	1,798,600	
ニホンフラッシュ	1,300	2,549.00	3,313,700	
前田工繊	3,100	2,131.00	6,606,100	
永大産業	5,500	326.00	1,793,000	
アートネイチャー	3,000	733.00	2,199,000	
バンダイナムコホールディングス	29,400	5,910.00	173,754,000	
共立印刷	11,000	167.00	1,837,000	
ＳＨＯＥＩ	1,400	5,370.00	7,518,000	
フランスベッドホールディングス	4,000	917.00	3,668,000	
マーベラス	4,300	672.00	2,889,600	
パイロットコーポレーション	4,700	4,195.00	19,716,500	
萩原工業	1,600	1,642.00	2,627,200	
エイベックス	4,800	1,241.00	5,956,800	
トッパン・フォームズ	6,100	1,155.00	7,045,500	
フジシールインターナショナル	6,400	2,108.00	13,491,200	
タカラトミー	12,700	1,059.00	13,449,300	
廣済堂	2,000	869.00	1,738,000	
アーク	19,800	90.00	1,782,000	
レック	3,000	1,165.00	3,495,000	
三光合成	5,200	335.00	1,742,000	
プロネクサス	2,400	1,132.00	2,716,800	
ホクシン	11,900	145.00	1,725,500	
大建工業	1,900	1,895.00	3,600,500	
凸版印刷	40,100	2,038.00	81,723,800	
大日本印刷	37,200	2,936.00	109,219,200	
共同印刷	900	2,859.00	2,573,100	
ＮＩＳＳＨＡ	5,800	988.00	5,730,400	
光村印刷	1,100	1,656.00	1,821,600	
藤森工業	2,500	3,285.00	8,212,500	
ヴィア・ホールディングス	3,400	656.00	2,230,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	1,400	1,655.00	2,317,000	
前澤化成工業	1,800	1,122.00	2,019,600	
未来工業	1,500	2,029.00	3,043,500	
アシックス	23,500	1,336.00	31,396,000	
ツツミ	900	1,973.00	1,775,700	
ＪＳＰ	1,700	1,784.00	3,032,800	
ニチハ	4,000	2,529.00	10,116,000	
エフピコ	3,200	6,890.00	22,048,000	
小松ウオール工業	900	2,073.00	1,865,700	
ヤマハ	16,900	5,880.00	99,372,000	
河合楽器製作所	900	3,015.00	2,713,500	
ピジョン	17,200	3,930.00	67,596,000	
天馬	1,900	1,915.00	3,638,500	
オリバー	700	3,725.00	2,607,500	
キングジム	2,400	840.00	2,016,000	
象印マホービン	8,300	1,916.00	15,902,800	
リンテック	6,800	2,544.00	17,299,200	
信越ポリマー	5,100	950.00	4,845,000	
東リ	7,100	292.00	2,073,200	
イトーキ	6,100	422.00	2,574,200	
任天堂	17,400	40,100.00	697,740,000	
三菱鉛筆	4,700	1,590.00	7,473,000	

松風	1,300	1,959.00	2,546,700	
タカラスタンダード	5,900	1,716.00	10,124,400	
コクヨ	13,600	1,589.00	21,610,400	
ニフコ	10,400	2,852.00	29,660,800	
立川ブラインド工業	1,400	1,213.00	1,698,200	
グローブライド	1,300	2,208.00	2,870,400	
オカムラ	9,900	1,006.00	9,959,400	
バルカー	2,300	2,318.00	5,331,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,688.00	1,688,000	
伊藤忠商事	195,700	2,604.50	509,700,650	
丸紅	291,300	789.50	229,981,350	
スクロール	5,200	344.00	1,788,800	
高島	900	1,894.00	1,704,600	
ヨンドシーホールディングス	2,800	2,297.00	6,431,600	
三陽商会	1,400	1,523.00	2,132,200	
長瀬産業	15,700	1,437.00	22,560,900	
蝶理	1,800	2,100.00	3,780,000	
豊田通商	31,200	3,690.00	115,128,000	
オンワードホールディングス	16,700	612.00	10,220,400	
三共生興	4,200	549.00	2,305,800	
兼松	10,400	1,286.00	13,374,400	
美津濃	2,600	2,505.00	6,513,000	
ファミリーマート	22,400	2,508.00	56,179,200	
三井物産	246,000	1,929.50	474,657,000	
日本紙パルプ商事	1,600	3,860.00	6,176,000	
東京エレクトロン	18,900	25,165.00	475,618,500	
日立ハイテク	9,700	8,020.00	77,794,000	
カメイ	3,600	1,097.00	3,949,200	
東都水産	600	2,856.00	1,713,600	
ＯＵＧホールディングス	700	2,601.00	1,820,700	
スターゼン	1,000	4,405.00	4,405,000	
セイコーホールディングス	4,000	2,287.00	9,148,000	
山善	10,900	1,006.00	10,965,400	
椿本興業	500	3,990.00	1,995,000	
住友商事	176,600	1,649.50	291,301,700	
日本ユニシス	8,700	3,750.00	32,625,000	
内田洋行	1,200	6,020.00	7,224,000	
三菱商事	196,400	2,852.00	560,132,800	
第一実業	1,400	3,530.00	4,942,000	
キヤノンマーケティングジャパン	8,000	2,731.00	21,848,000	
西華産業	1,600	1,300.00	2,080,000	
佐藤商事	2,300	919.00	2,113,700	
菱洋エレクトロ	2,800	1,923.00	5,384,400	
東京産業	3,000	585.00	1,755,000	
ユアサ商事	2,700	3,320.00	8,964,000	
神鋼商事	700	2,391.00	1,673,700	
阪和興業	5,200	2,496.00	12,979,200	
正栄食品工業	1,800	3,730.00	6,714,000	
カナデン	2,300	1,307.00	3,006,100	
菱電商事	2,000	1,644.00	3,288,000	
ニプロ	19,700	1,240.00	24,428,000	
フルサト工業	1,500	1,623.00	2,434,500	
岩谷産業	6,200	3,650.00	22,630,000	
昭光通商	2,500	680.00	1,700,000	
イワキ	3,700	503.00	1,861,100	
兼松エレクトロニクス	1,500	3,390.00	5,085,000	

三愛石油	6,900	1,064.00	7,341,600	
稲畑産業	6,200	1,439.00	8,921,800	
ゴールドウイン	5,000	7,170.00	35,850,000	
ユニ・チャーム	54,800	3,945.00	216,186,000	
デサント	5,400	1,633.00	8,818,200	
ワキタ	6,000	1,020.00	6,120,000	
ヤマトインターナショナル	4,400	405.00	1,782,000	
東邦ホールディングス	9,000	2,242.00	20,178,000	
サンゲツ	7,700	1,795.00	13,821,500	
ミツウロコグループホールディングス	4,100	1,143.00	4,686,300	
シナネンホールディングス	1,200	2,154.00	2,584,800	
伊藤忠エネクス	6,200	920.00	5,704,000	
サンリオ	7,900	1,967.00	15,539,300	
サンワ　テクノス	2,000	891.00	1,782,000	
リョーサン	3,100	2,413.00	7,480,300	
新光商事	4,400	792.00	3,484,800	
トーホー	1,300	1,748.00	2,272,400	
三信電気	1,500	1,616.00	2,424,000	
東陽テクニカ	3,200	1,038.00	3,321,600	
モスフードサービス	3,700	2,988.00	11,055,600	
加賀電子	2,800	2,285.00	6,398,000	
三益半導体工業	2,200	2,226.00	4,897,200	
ソーダニッカ	2,900	582.00	1,687,800	
立花エレテック	2,100	1,721.00	3,614,100	
木曽路	3,700	2,847.00	10,533,900	
ＳＲＳホールディングス	3,300	1,038.00	3,425,400	
千趣会	5,100	518.00	2,641,800	
ケーヨー	5,700	546.00	3,112,200	
上新電機	3,300	2,017.00	6,656,100	
日本瓦斯	4,400	3,730.00	16,412,000	
ロイヤルホールディングス	4,900	2,128.00	10,427,200	
東天紅	1,400	1,251.00	1,751,400	
いなげや	3,500	1,357.00	4,749,500	
島忠	5,300	3,005.00	15,926,500	
チヨダ	2,900	1,459.00	4,231,100	
ライフコーポレーション	2,100	2,589.00	5,436,900	
リンガーハット	3,400	2,407.00	8,183,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	3,800	473.00	1,797,400	
テンアライド	4,100	435.00	1,783,500	
ＡＯＫＩホールディングス	5,600	1,019.00	5,706,400	
オークワ	4,400	1,464.00	6,441,600	
コメリ	4,300	2,209.00	9,498,700	
青山商事	5,800	1,286.00	7,458,800	
しまむら	3,300	7,720.00	25,476,000	
はせがわ	4,600	395.00	1,817,000	
高島屋	20,400	1,116.00	22,766,400	
松屋	5,600	776.00	4,345,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	13,300	936.00	12,448,800	
近鉄百貨店	1,100	3,420.00	3,762,000	
丸井グループ	25,700	2,371.00	60,934,700	
クレディセゾン	19,600	1,834.00	35,946,400	
アクシアル　リテイリング	2,300	3,695.00	8,498,500	
イオン	107,700	2,300.00	247,710,000	
イズミ	5,700	3,325.00	18,952,500	
平和堂	5,700	1,859.00	10,596,300	
フジ	3,400	1,824.00	6,201,600	

ヤオコー	3,200	5,800.00	18,560,000	
ゼビオホールディングス	3,400	1,100.00	3,740,000	
ケーズホールディングス	27,000	1,316.00	35,532,000	
ＰＡＬＴＡＣ	4,500	5,020.00	22,590,000	
三谷産業	5,100	353.00	1,800,300	
新生銀行	20,600	1,690.00	34,814,000	
あおぞら銀行	16,700	3,030.00	50,601,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,929,200	562.80	1,085,753,760	
りそなホールディングス	307,600	439.30	135,128,680	
三井住友トラスト・ホールディングス	53,000	4,001.00	212,053,000	
三井住友フィナンシャルグループ	193,900	3,751.00	727,318,900	
千葉銀行	96,400	605.00	58,322,000	
群馬銀行	55,100	357.00	19,670,700	
武蔵野銀行	4,200	1,657.00	6,959,400	
千葉興業銀行	7,700	332.00	2,556,400	
筑波銀行	11,700	196.00	2,293,200	
七十七銀行	9,500	1,566.00	14,877,000	
青森銀行	2,200	2,573.00	5,660,600	
秋田銀行	1,800	1,888.00	3,398,400	
山形銀行	3,100	1,367.00	4,237,700	
岩手銀行	1,800	2,543.00	4,577,400	
東邦銀行	25,100	243.00	6,099,300	
みちのく銀行	1,800	1,333.00	2,399,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	23,600	1,846.00	43,565,600	
静岡銀行	69,400	751.00	52,119,400	
十六銀行	3,500	2,071.00	7,248,500	
スルガ銀行	28,700	436.00	12,513,200	
八十二銀行	67,600	403.00	27,242,800	
山梨中央銀行	3,300	917.00	3,026,100	
大垣共立銀行	5,500	2,232.00	12,276,000	
福井銀行	2,400	1,550.00	3,720,000	
北國銀行	2,900	3,130.00	9,077,000	
清水銀行	1,200	1,947.00	2,336,400	
富山銀行	800	1,968.00	1,574,400	
滋賀銀行	5,600	2,624.00	14,694,400	
南都銀行	4,700	2,475.00	11,632,500	
百五銀行	25,200	316.00	7,963,200	
京都銀行	10,100	4,200.00	42,420,000	
紀陽銀行	9,900	1,589.00	15,731,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	18,700	1,008.00	18,849,600	
広島銀行	41,400	520.00	21,528,000	
山陰合同銀行	16,600	609.00	10,109,400	
中国銀行	24,100	947.00	22,822,700	
鳥取銀行	1,400	1,311.00	1,835,400	
伊予銀行	40,000	535.00	21,400,000	
百十四銀行	3,000	2,002.00	6,006,000	
四国銀行	4,300	917.00	3,943,100	
阿波銀行	4,600	2,372.00	10,911,200	
大分銀行	1,600	2,273.00	3,636,800	
宮崎銀行	1,900	2,351.00	4,466,900	
佐賀銀行	1,700	1,501.00	2,551,700	
沖縄銀行	2,600	3,320.00	8,632,000	
琉球銀行	6,500	1,051.00	6,831,500	
セブン銀行	93,600	319.00	29,858,400	
みずほフィナンシャルグループ	3,808,300	158.70	604,377,210	
山口フィナンシャルグループ	35,000	647.00	22,645,000	

芙蓉総合リース	2,900	6,920.00	20,068,000	
みずほリース	4,400	3,220.00	14,168,000	
東京センチュリー	5,600	5,130.00	28,728,000	
ＳＢＩホールディングス	31,300	2,462.00	77,060,600	
日本証券金融	12,400	498.00	6,175,200	
アイフル	42,800	302.00	12,925,600	
長野銀行	1,200	1,466.00	1,759,200	
名古屋銀行	2,300	3,380.00	7,774,000	
北洋銀行	42,200	227.00	9,579,400	
愛知銀行	1,000	3,395.00	3,395,000	
中京銀行	1,200	2,202.00	2,642,400	
大光銀行	1,100	1,598.00	1,757,800	
愛媛銀行	4,000	1,076.00	4,304,000	
京葉銀行	11,900	570.00	6,783,000	
栃木銀行	13,500	194.00	2,619,000	
北日本銀行	900	2,065.00	1,858,500	
東和銀行	4,900	774.00	3,792,600	
リコーリース	2,200	4,215.00	9,273,000	
イオンフィナンシャルサービス	17,200	1,819.00	31,286,800	
アコム	56,300	522.00	29,388,600	
ジャックス	3,100	2,470.00	7,657,000	
オリエントコーポレーション	75,900	160.00	12,144,000	
日立キャピタル	6,600	3,085.00	20,361,000	
アプラスフィナンシャル	21,300	82.00	1,746,600	
オリックス	175,300	1,925.00	337,452,500	
三菱ＵＦＪリース	71,100	699.00	49,698,900	
ジャフコ	4,300	4,680.00	20,124,000	
九州リースサービス	3,000	604.00	1,812,000	
トモニホールディングス	21,700	340.00	7,378,000	
大和証券グループ本社	224,900	537.20	120,816,280	
野村ホールディングス	493,200	564.40	278,362,080	
岡三証券グループ	23,900	393.00	9,392,700	
丸三証券	8,300	505.00	4,191,500	
東洋証券	12,000	149.00	1,788,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	32,200	322.00	10,368,400	
光世証券	3,100	591.00	1,832,100	
水戸証券	8,100	222.00	1,798,200	
いちよし証券	5,200	615.00	3,198,000	
松井証券	16,000	897.00	14,352,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	52,700	4,367.00	230,140,900	
だいこう証券ビジネス	2,700	669.00	1,806,300	
日本取引所グループ	80,400	1,980.00	159,192,000	
マネックスグループ	21,100	251.00	5,296,100	
極東証券	3,800	755.00	2,869,000	
岩井コスモホールディングス	2,600	1,267.00	3,294,200	
藍澤證券	5,000	693.00	3,465,000	
フィデアホールディングス	27,200	121.00	3,291,200	
池田泉州ホールディングス	32,200	188.00	6,053,600	
アニコム　ホールディングス	2,300	3,910.00	8,993,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	73,300	3,738.00	273,995,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	23,000	2,387.00	54,901,000	
スパークス・グループ	9,700	262.00	2,541,400	
第一生命ホールディングス	158,600	1,629.50	258,438,700	
東京海上ホールディングス	100,200	6,126.00	613,825,200	

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

京阪ホールディングス	12,000	4,755.00	57,060,000	
神戸電鉄	600	3,955.00	2,373,000	
名古屋鉄道	22,100	3,065.00	67,736,500	
山陽電気鉄道	1,900	2,108.00	4,005,200	
トランコム	800	7,780.00	6,224,000	
日本通運	9,500	5,890.00	55,955,000	
ヤマトホールディングス	47,200	1,927.00	90,954,400	
山九	7,500	5,100.00	38,250,000	
日新	2,300	1,688.00	3,882,400	
丸全昭和運輸	2,200	2,763.00	6,078,600	
センコーグループホールディングス	14,800	867.00	12,831,600	
トナミホールディングス	600	4,855.00	2,913,000	
ニッコンホールディングス	9,600	2,404.00	23,078,400	
日本石油輸送	500	3,095.00	1,547,500	
福山通運	3,400	3,595.00	12,223,000	
セイノーホールディングス	20,200	1,341.00	27,088,200	
エスライン	1,700	985.00	1,674,500	
神奈川中央交通	700	3,925.00	2,747,500	
日立物流	4,900	3,110.00	15,239,000	
丸和運輸機関	2,800	1,992.00	5,577,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	2,700	1,265.00	3,415,500	
日本郵船	22,600	1,746.00	39,459,600	
商船三井	17,100	2,565.00	43,861,500	
川崎汽船	8,300	1,486.00	12,333,800	
ＮＳユナイテッド海運	1,500	1,844.00	2,766,000	
飯野海運	12,800	357.00	4,569,600	
九州旅客鉄道	24,000	3,620.00	86,880,000	
ＳＧホールディングス	28,200	2,229.00	62,857,800	
日本航空	48,400	2,998.50	145,127,400	
ＡＮＡホールディングス	49,200	3,272.00	160,982,400	
パスコ	600	1,932.00	1,159,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	500	3,145.00	1,572,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	2,097.00	1,677,600	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,200	1,947.00	2,336,400	
国際紙パルプ商事	6,600	288.00	1,900,800	
総合メディカルホールディングス	2,400	2,547.00	6,112,800	
ブックオフグループホールディングス	1,800	926.00	1,666,800	
三菱倉庫	8,500	2,908.00	24,718,000	
三井倉庫ホールディングス	3,100	1,738.00	5,387,800	
住友倉庫	9,900	1,440.00	14,256,000	
澁澤倉庫	1,500	2,071.00	3,106,500	
ヤマタネ	1,400	1,476.00	2,066,400	
東陽倉庫	5,800	310.00	1,798,000	
乾汽船	1,600	1,191.00	1,905,600	
日本トランスシティ	5,900	477.00	2,814,300	
ケイヒン	1,400	1,348.00	1,887,200	
中央倉庫	1,600	1,131.00	1,809,600	
安田倉庫	2,200	1,003.00	2,206,600	
東洋埠頭	1,300	1,373.00	1,784,900	
宇徳	3,500	510.00	1,785,000	
上組	15,400	2,266.00	34,896,400	
キユーソー流通システム	900	1,883.00	1,694,700	
近鉄エクスプレス	5,700	1,897.00	10,812,900	
東海運	5,900	282.00	1,663,800	
エーアイテイー	1,900	960.00	1,824,000	

東京放送ホールディングス	17,000	1,898.00	32,266,000	
日本テレビホールディングス	23,300	1,458.00	33,971,400	
朝日放送グループホールディングス	2,800	720.00	2,016,000	
テレビ朝日ホールディングス	7,700	2,027.00	15,607,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	18,300	469.00	8,582,700	
テレビ東京ホールディングス	2,300	2,365.00	5,439,500	
日本ＢＳ放送	1,400	1,234.00	1,727,600	
ビジョン	2,600	1,115.00	2,899,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,100	1,684.00	1,852,400	
コネクシオ	1,600	1,531.00	2,449,600	
日本通信	21,700	215.00	4,665,500	
日本電信電話	372,700	2,776.00	1,034,615,200	
ＫＤＤＩ	207,800	3,409.00	708,390,200	
ソフトバンク	253,400	1,484.50	376,172,300	
光通信	2,900	23,170.00	67,193,000	
ＮＴＴドコモ	206,000	3,131.00	644,986,000	
エムティーアイ	2,700	648.00	1,749,600	
ＧＭＯインターネット	11,000	2,076.00	22,836,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	7,500	1,645.00	12,337,500	
学研ホールディングス	900	7,160.00	6,444,000	
ゼンリン	5,600	1,460.00	8,176,000	
インプレスホールディングス	10,500	166.00	1,743,000	
東京電力ホールディングス	226,800	436.00	98,884,800	
中部電力	86,900	1,521.00	132,174,900	
関西電力	107,700	1,268.00	136,563,600	
中国電力	39,300	1,470.00	57,771,000	
北陸電力	26,000	831.00	21,606,000	
東北電力	71,000	1,021.00	72,491,000	
四国電力	25,600	876.00	22,425,600	
九州電力	58,600	853.00	49,985,800	
北海道電力	26,600	519.00	13,805,400	
沖縄電力	5,300	2,009.00	10,647,700	
電源開発	22,600	2,526.00	57,087,600	
エフオン	1,400	657.00	919,800	
イーレックス	4,000	1,480.00	5,920,000	
レノバ	4,700	1,132.00	5,320,400	
東京瓦斯	54,600	2,379.00	129,893,400	
大阪瓦斯	55,100	1,875.00	103,312,500	
東邦瓦斯	14,000	4,090.00	57,260,000	
北海道瓦斯	1,500	1,600.00	2,400,000	
広島ガス	5,800	339.00	1,966,200	
西部瓦斯	3,200	2,360.00	7,552,000	
静岡ガス	8,100	954.00	7,727,400	
メタウォーター	1,400	4,100.00	5,740,000	
アイネット	1,400	1,468.00	2,055,200	
松竹	1,800	13,870.00	24,966,000	
東宝	16,700	3,870.00	64,629,000	
エイチ・アイ・エス	4,200	2,485.00	10,437,000	
東映	1,000	13,960.00	13,960,000	
ラックランド	800	2,129.00	1,703,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	74,200	1,455.00	107,961,000	
共立メンテナンス	4,500	4,040.00	18,180,000	
イチネンホールディングス	3,000	1,375.00	4,125,000	
建設技術研究所	1,900	2,220.00	4,218,000	
スペース	1,800	1,154.00	2,077,200	
アインホールディングス	3,400	6,780.00	23,052,000	

燦ホールディングス	1,200	1,564.00	1,876,800	
東京テアトル	1,300	1,316.00	1,710,800	
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,804.00	1,682,400	
ナガワ	900	6,620.00	5,958,000	
よみうりランド	600	4,095.00	2,457,000	
東京都競馬	1,800	3,675.00	6,615,000	
常磐興産	1,100	1,621.00	1,783,100	
カナモト	4,400	2,654.00	11,677,600	
東京ドーム	11,000	967.00	10,637,000	
ＤＴＳ	6,200	2,190.00	13,578,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,900	4,960.00	59,024,000	
シーイーシー	3,000	1,938.00	5,814,000	
カプコン	13,100	3,455.00	45,260,500	
西尾レントオール	2,800	2,926.00	8,192,800	
アイ・エス・ビー	900	2,322.00	2,089,800	
日本空港ビルデング	8,900	5,170.00	46,013,000	
トランス・コスモス	2,600	2,652.00	6,895,200	
乃村工藝社	11,600	1,181.00	13,699,600	
ジャステック	1,800	1,044.00	1,879,200	
ＳＣＳＫ	6,400	6,240.00	39,936,000	
藤田観光	1,200	2,467.00	2,960,400	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,700	1,146.00	1,948,200	
日本管財	2,900	1,901.00	5,512,900	
トーカイ	2,600	2,462.00	6,401,200	
白洋舎	700	2,766.00	1,936,200	
セコム	28,800	9,641.00	277,660,800	
日本システムウエア	900	2,289.00	2,060,100	
セントラル警備保障	1,300	5,460.00	7,098,000	
アイネス	2,700	1,680.00	4,536,000	
丹青社	5,100	1,149.00	5,859,900	
メイテック	3,400	5,640.00	19,176,000	
ＴＫＣ	2,400	5,300.00	12,720,000	
富士ソフト	3,600	4,115.00	14,814,000	
応用地質	2,900	1,418.00	4,112,200	
船井総研ホールディングス	5,600	2,981.00	16,693,600	
ＮＳＤ	9,000	1,894.00	17,046,000	
進学会ホールディングス	3,600	510.00	1,836,000	
丸紅建材リース	1,000	1,829.00	1,829,000	
コナミホールディングス	10,100	4,375.00	44,187,500	
学究社	1,300	1,350.00	1,755,000	
ベネッセホールディングス	9,000	2,952.00	26,568,000	
イオンディライト	3,300	3,760.00	12,408,000	
ナック	1,700	995.00	1,691,500	
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,130.00	3,443,000	
ニチイ学館	3,900	1,334.00	5,202,600	
ダイセキ	4,600	2,923.00	13,445,800	
ステップ	1,100	1,648.00	1,812,800	
日鉄物産	2,000	4,575.00	9,150,000	
泉州電業	900	2,976.00	2,678,400	
元気寿司	700	2,906.00	2,034,200	
トラスコ中山	5,800	2,357.00	13,670,600	
ヤマダ電機	85,300	594.00	50,668,200	
オートバックスセブン	10,400	1,539.00	16,005,600	
モリト	2,300	792.00	1,821,600	
アークランドサカモト	4,400	1,181.00	5,196,400	

ニトリホールディングス	12,100	16,560.00	200,376,000	
グルメ杵屋	2,000	1,161.00	2,322,000	
愛眼	7,300	242.00	1,766,600	
吉野家ホールディングス	9,200	2,529.00	23,266,800	
加藤産業	4,400	3,465.00	15,246,000	
イノテック	1,700	1,086.00	1,846,200	
イエローハット	5,300	1,645.00	8,718,500	
松屋フーズホールディングス	1,300	4,460.00	5,798,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,900	1,927.00	3,661,300	
ＪＫホールディングス	2,500	743.00	1,857,500	
サガミホールディングス	3,700	1,323.00	4,895,100	
日伝	2,500	1,942.00	4,855,000	
関西スーパーマーケット	2,300	1,001.00	2,302,300	
ミロク情報サービス	2,500	2,650.00	6,625,000	
北沢産業	6,600	255.00	1,683,000	
杉本商事	1,500	1,892.00	2,838,000	
因幡電機産業	8,000	2,615.00	20,920,000	
王将フードサービス	2,100	6,430.00	13,503,000	
プレナス	3,100	1,930.00	5,983,000	
ミニストップ	2,100	1,522.00	3,196,200	
アークス	5,700	1,915.00	10,915,500	
バローホールディングス	6,200	1,801.00	11,166,200	
東テク	900	2,453.00	2,207,700	
ミスミグループ本社	35,100	2,661.00	93,401,100	
ベルク	1,400	5,590.00	7,826,000	
大　庄	1,500	1,626.00	2,439,000	
タキヒヨー	1,000	1,825.00	1,825,000	
ファーストリテイリング	3,700	59,640.00	220,668,000	
ソフトバンクグループ	221,200	5,531.00	1,223,457,200	
蔵王産業	1,200	1,450.00	1,740,000	
スズケン	11,900	4,005.00	47,659,500	
サンドラッグ	10,500	3,295.00	34,597,500	
サックスバー　ホールディングス	2,400	802.00	1,924,800	
ジェコス	1,900	1,034.00	1,964,600	
やまや	800	2,206.00	1,764,800	
ベルーナ	6,000	614.00	3,684,000	
合計	33,485,100		67,041,297,600	

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。

中間財務諸表

１）当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年2月21日から2020年8月20日まで）の中間財務諸表について、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。

独立監査人の中間監査報告書

２０２０年１０月１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　百瀬和政

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイＴＯＰＩＸオープンの２０２０年２月２１日から２０２０年８月２０日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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ＴＯＰＩＸオープンの２０２０年８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中間計算期間（２０２０年２月２１日から２０２０年８月２０日まで）の損益の状況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

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

【ニッセイＴＯＰＩＸオープン】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 (2020年2月20日現在)	第20期中間計算期間 (2020年8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,007,743	89,123
コール・ローン	30,279,094	27,161,306
親投資信託受益証券	11,389,461,056	10,696,080,660
未収入金	66,415,862	30,567,289
流動資産合計	11,487,163,755	10,753,898,378
資産合計	11,487,163,755	10,753,898,378
負債の部		
流動負債		
未払解約金	65,537,999	29,746,090
未払受託者報酬	4,484,168	3,912,391
未払委託者報酬	27,545,852	24,033,515
その他未払費用	266,137	247,585
流動負債合計	97,834,156	57,939,581
負債合計	97,834,156	57,939,581
純資産の部		
元本等		
元本	7,154,782,886	6,959,272,842
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,234,546,713	3,736,685,955
純資産合計	11,389,329,599	10,695,958,797
負債純資産合計	11,487,163,755	10,753,898,378

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 （自2019年2月21日 至2019年8月20日）	第20期中間計算期間 （自2020年2月21日 至2020年8月20日）
営業収益		
受取利息	110	258
有価証券売買等損益	△609,387,289	△360,350,127
営業収益合計	△609,387,179	△360,349,869
営業費用		
支払利息	5,596	3,458
受託者報酬	4,246,272	3,912,391
委託者報酬	26,084,461	24,033,515
その他費用	255,537	247,632
営業費用合計	30,591,866	28,196,996
営業利益又は営業損失（△）	△639,979,045	△388,546,865
経常利益又は経常損失（△）	△639,979,045	△388,546,865
中間純利益又は中間純損失（△）	△639,979,045	△388,546,865
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△8,680,872	△122,791,509
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,963,912,704	4,234,546,713
剰余金増加額又は欠損金減少額	152,429,116	237,740,054
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	152,429,116	237,740,054
剰余金減少額又は欠損金増加額	305,922,913	469,845,456
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	305,922,913	469,845,456
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,179,120,734	3,736,685,955

（３）【中間注記表】

（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。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第19期 2020年2月20日現在	第20期中間計算期間 2020年8月20日現在
１．　受益権総口数	7,154,782,886口	6,959,272,842口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5918円 （15,918円）	1.5369円 （15,369円）

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第19期 2020年2月20日現在	第20期中間計算期間 2020年8月20日現在
１．　中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（その他の注記）

元本額の変動

項目	第19期 2020年2月20日現在	第20期中間計算期間 2020年8月20日現在
期首元本額	7,880,390,513円	7,154,782,886円
期中追加設定元本額	723,029,020円	619,714,832円
期中一部解約元本額	1,448,636,647円	815,224,876円

＜参考＞
開示対象ファンド（ニッセイＴＯＰＩＸオープン）は、「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間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）

	2020年2月20日現在	2020年8月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	42,827,796	14,353,534
コール・ローン	1,286,823,310	4,374,435,476
株式	67,041,297,600	137,379,464,150
派生商品評価勘定	－	85,228,700
未収入金	6,565,600	－
未収配当金	108,315,429	176,688,358
前払金	22,135,000	－
差入委託証拠金	31,680,000	177,525,000
流動資産合計	68,539,644,735	142,207,695,218
資産合計	68,539,644,735	142,207,695,218
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,881,300	18,968,350
前受金	－	104,540,000
未払解約金	296,452,837	239,360,160
その他未払費用	3,233	5,314
流動負債合計	314,337,370	362,873,824
負債合計	314,337,370	362,873,824
純資産の部		
元本等		
元本	37,895,533,054	81,402,720,930
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,329,774,311	60,442,100,464
純資産合計	68,225,307,365	141,844,821,394
負債純資産合計	68,539,644,735	142,207,695,218

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	2020年2月20日現在	2020年8月20日現在
１．　受益権総口数	37,895,533,054口	81,402,720,930口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8004円 （18,004円）	1.7425円 （17,425円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年2月20日現在	2020年8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
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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	2020年2月20日 現在				2020年8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	1,125,325,000	－	1,107,480,000	△17,845,000	4,140,280,000	－	4,206,685,000	66,405,000
合計	1,125,325,000	－	1,107,480,000	△17,845,000	4,140,280,000	－	4,206,685,000	66,405,000

（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。

（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	2020年2月20日現在	2020年8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	34,475,094,643円	37,895,533,054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	14,196,038,295円	53,211,037,618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	10,775,599,884円	9,703,849,742円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	6,326,072,571円	6,138,353,320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）	4,354,685,255円	4,142,137,127円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	4,063,446円	4,193,969円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,533,145,263円	1,902,705,689円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,401,509,272円	6,306,314,256円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,653,662,525円	4,214,295,435円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	8,430,005円	6,706,816円
ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	35,457,287円	31,422,769円
ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	33,985,449円	35,034,496円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	308,410,353円	372,577,271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	14,991,687,269円	17,095,909,825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）	708,282,393円	991,358,230円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	95,609,361円	132,243,700円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	86,255,178円	139,586,855円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	69,742,388円	133,817,103円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	126,906,078円	308,571,050円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	31,936,187円	75,638,093円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	49,469,361円	59,898,689円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	5,859,103円	7,099,325円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	4,160,513円	5,685,465円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	1,135,532円	1,563,137円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）	3,585,333円	4,641,750円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	19,339,643円	20,741,115円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	9,914,628円	32,125,828円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	7,978,547円	25,335,511円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	12,198,373円	95,849,332円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	12,051,741円	151,572,164円
ニッセイ国内株式市場連動ＳＡファンド（適格機関投資家限定）	－円	38,963,573,732円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）	－円	3,768,878円
計	37,895,533,054円	81,402,720,930円

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「ニッセイＴＯＰＩＸオープン」　　（2020年8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	10,837,857,102円
Ⅱ　負債総額	23,176,873円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,814,680,229円
Ⅳ　発行済数量	6,953,792,046口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5552円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

2020年8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。

2020年8月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	403	67,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	130	26,028
単位型公社債投資信託	0	0
合計	533	93,243

○　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.財務諸表の作成方法について

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。

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

２.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25期事業年度（自2019年4月1日　至2020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。

独立監査人の監査報告書

2020年5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
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　樋口誠之

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　牧野あや子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以　上

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （2019年3月31日）		当事業年度 （2020年3月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		18,401,863		28,674,230
有価証券		8,008,550		6,301,326
前払費用		608,442		546,666
未収委託者報酬		4,705,229		4,882,250
未収運用受託報酬		1,911,554		2,039,974
未収投資助言報酬		168,445		174,892
その他		31,744		50,572
流動資産合計		33,835,830		42,669,914
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	※1	72,641	※1	98,471
車両	※1	3,268	※1	2,180
器具備品	※1	95,277	※1	142,866
有形固定資産合計		171,187		243,517
無形固定資産				
ソフトウェア		968,052		969,528
ソフトウェア仮勘定		24,478		216,033
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,000,545		1,193,575
投資その他の資産				
投資有価証券		36,902,679		33,634,499
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		167,886		－
差入保証金		293,513		303,875
繰延税金資産		1,066,925		1,292,446
その他		87,940		17,821
投資その他の資産合計		38,585,168		35,314,867
固定資産合計		39,756,901		36,751,960
資産合計		73,592,732		79,421,875

負債の部		
流動負債		
預り金	65,641	45,856
未払収益分配金	6,368	5,643
未払手数料	1,736,084	1,633,415
未払運用委託報酬	702,648	810,981
未払投資助言報酬	723,039	852,782
その他未払金	461,392	3,591,122
未払費用	113,233	146,706
未払法人税等	1,996,248	686,983
賞与引当金	853,083	975,373
その他	289,152	544,366
流動負債合計	6,946,893	9,293,232
固定負債		
退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
役員退職慰労引当金	22,500	22,700
固定負債合計	1,824,248	1,973,446
負債合計	8,771,142	11,266,679
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	45,192,421	48,745,315
利益剰余金合計	45,872,228	49,425,122
株主資本合計	64,154,068	67,706,962
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	711,399	512,183
繰延ヘッジ損益	△ 43,878	△ 63,949
評価・換算差額等合計	667,521	448,234
純資産合計	64,821,590	68,155,196
負債・純資産合計	73,592,732	79,421,875

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2018年4月１日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	26,471,631	27,088,982
運用受託報酬	11,784,292	13,165,624
投資助言報酬	610,372	677,248
その他営業収益	16,907	2,000
営業収益計	38,883,204	40,933,856
営業費用		
支払手数料	11,518,158	11,090,478
広告宣伝費	23,965	25,032
公告費	130	－
調査費	5,954,296	6,466,222
支払運用委託報酬	1,695,119	1,866,932
支払投資助言報酬	3,019,717	3,238,306
委託調査費	106,467	125,262
調査費	1,132,991	1,235,721
委託計算費	229,936	249,653
営業雑経費	812,655	929,200
通信費	49,932	47,749
印刷費	190,576	189,820
協会費	34,445	38,958
その他営業雑経費	537,701	652,672
営業費用計	18,539,142	18,760,587
一般管理費		
役員報酬	137,828	142,108
給料・手当	3,685,286	3,934,995
賞与引当金繰入額	851,086	974,031
賞与	279,376	285,503
福利厚生費	710,135	762,163
退職給付費用	311,969	307,637
役員退職慰労引当金繰入額	8,350	7,000
役員退職慰労金	150	30
その他人件費	151,765	172,763
不動産賃借料	673,220	682,105
その他不動産経費	30,378	31,283
交際費	29,832	28,014
旅費交通費	209,373	170,993
固定資産減価償却費	405,606	442,697
租税公課	325,740	341,195
業務委託費	261,111	291,579
器具備品費	332,440	354,221
保険料	52,393	46,549
諸経費	189,822	225,408
一般管理費計	8,645,865	9,200,283
営業利益	11,698,196	12,972,984
営業外収益		
受取利息	573	1,176
有価証券利息	24,008	12,651

受取配当金		124,674		200,028
金融派生商品収益		35,286		14,042
為替差益		22,977		―
その他営業外収益		14,395		13,606
営業外収益計		221,915		241,504
営業外費用				
為替差損		－		27,288
金融派生商品費用		20,127		9,593
控除対象外消費税		17,501		5,453
その他営業外費用		1,080		8,493
営業外費用計		38,709		50,829
経常利益		11,881,403		13,163,659
特別利益				
投資有価証券売却益		655,395		4,459
投資有価証券償還益		46,876		1,744
特別利益計		702,272		6,204
特別損失				
投資有価証券売却損		81,265		72,045
投資有価証券償還損		68,047		4,115
固定資産除却損	※1	1,089	※1	8,422
事故損失賠償金	※2	511	※2	4,351
特別損失計		150,913		88,934
税引前当期純利益		12,432,761		13,080,929
法人税、住民税及び事業税		3,862,523		4,134,957
法人税等調整額		43,320		△ 106,970
法人税等合計		3,905,844		4,027,986
当期純利益		8,526,917		9,052,942

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2018年4月１日　至2019年3月31日)

（単位：千円）

	株主資本									
	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	41,733,107	42,412,914	60,694,754
当期変動額										
剰余金の配当	－	－	－	－	－	－	－	△5,067,603	△5,067,603	△5,067,603
当期純利益	－	－	－	－	－	－	－	8,526,917	8,526,917	8,526,917
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	－	3,459,314	3,459,314	3,459,314
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068

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

当事業年度(自2019年4月１日　至2020年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068
当期変動額										
剰余金の配当	－	－	－	－	－	－	－	△5,500,048	△5,500,048	△5,500,048
当期純利益	－	－	－	－	－	－	－	9,052,942	9,052,942	9,052,942
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	－	3,552,893	3,552,893	3,552,893
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	711,399	△43,878	667,521	64,821,590
当期変動額				
剰余金の配当	－	－	－	△5,500,048
当期純利益	－	－	－	9,052,942
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△199,216	△20,071	△219,287	△219,287
当期変動額合計	△199,216	△20,071	△219,287	3,333,606
当期末残高	512,183	△63,949	448,234	68,155,196

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	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．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18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。
４．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。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、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。
５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
６．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②ヘッジ手段とヘッジ対象

	ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 ③ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
７．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
８．連結納税	日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日　企業会計基準委員会　実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

（会計上の見積りの変更）

（退職給付債務の計算方法に係る見積りの変更）

年俸制適用者について、退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法へ変更しております。この変更は、従業員数が増加したことに伴い、退職給付債務の金額の算定の精度を高め、退職給付費用の期間損益計算を適正化するために行ったものであります。

この変更に伴い、当事業年度末における退職給付引当金が54,100千円減少し、同額を一般管理費の退職給付費用より減額しております。

（未適用の会計基準等）

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

（１） 概要

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

（２） 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（３） 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年7月4日　企業会計基準委員会）
・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日　企業会計基準委員会）
・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2019年7月4日　企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2020年3月31日　企業会計基準委員会）

（１）　概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてはほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまでわが国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

（２）　適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（３）　当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

（貸借対照表関係）

※１．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
建物附属設備	325.809千円	310,385千円
車両	3,460	4,549
器具備品	474,339	394,258
計	803,609	709,193

（損益計算書関係）

※１．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　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
建物付属設備	－千円	4,181千円
器具備品	623	4,240
ソフトウェア	465	－
計	1,089	8,422

※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。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自2018年4月1日　至2019年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

	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

2018年6月22日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

2019年3月19日開催の臨時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当財産の種類	投資有価証券
配当財産の帳簿価額	67,500千円
譲渡株数	1,350株
１株当たり配当額	－

当事業年度（自2019年4月1日　至2020年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

	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

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	50,716円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28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

2020年6月29日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	50,716円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月29日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2019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	18,401,863	18,401,863	－
②有価証券			
満期保有目的の債券	2,199,830	2,205,940	6,109
その他有価証券	5,808,720	5,808,720	－
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,649,504	17,681,300	31,795
その他有価証券	19,253,174	19,253,174	－
④デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△47,244	△47,244	－

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

当事業年度（2020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	28,674,230	28,674,230	－
②有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	△259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	－
④デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	10,218	10,218	－

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

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

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。

④デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度（2019年3月31日）	当事業年度（2020年3月31日）
関係会社株式	66,222	66,222

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(2019年3月31日)

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
①現金・預金	18,401,863	－	－	－
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	2,200,000	17,650,000	－	－
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	7,033,352	15,714,537	2,156,988	138,951
合計	27,635,215	33,364,537	2,156,988	138,951

（注）投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2020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）
①現金・預金	28,674,230	－	－	－
②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	6,300,000	11,550,000	－	－
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	6,148,442	12,928,752	2,006,497	－
合計	41,122,673	24,478,752	2,006,497	－

（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（2019年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	18,749,335	18,787,460	38,124
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	18,749,335	18,787,460	38,124
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	1,100,000	1,099,780	△220
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	1,100,000	1,099,780	△220
合計		19,849,335	19,887,240	37,904

当事業年度（2020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	11,798,934	11,806,740	7,805
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	11,798,934	11,806,740	7,805
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	6,049,621	6,047,560	△2,061
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	6,049,621	6,047,560	△2,061
合計		17,848,556	17,854,300	5,743

２．その他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価または償却原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	－	－	－
	(2)債券	－	－	－
	① 国債・地方債等			
	② 社債	－	－	－
	③ その他	－	－	－
	(3)その他（注１）	14,350,630	13,532,359	818,270
	小計	14,350,630	13,532,359	818,270
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）	7,736,640	8,140,850	△404,209
	小計	7,736,640	8,140,850	△404,209
合計		22,087,270	21,673,209	414,060

（注１）投資信託受益証券等であります。

（注２）関係会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自2018年4月1日　至2019年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	－	－	－
(2)債券	－	－	－
(3)その他	2,232,532	655,395	81,265
合計	2,232,532	655,395	81,265

当事業年度（自2019年4月1日　至2020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	1,650,233	4,459	72,045
合計	1,650,233	4,459	72,045

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2020年3月31日）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

前事業年度（2019年3月31日）

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

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	1,860,993	－	10,218
合計			1,860,993	－	10,218

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

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

（退職給付関係）

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、年俸制総合職及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、従来まで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したが、対象従業員が300人を超えたため、当事業年度末より原則法に変更しております。

２．確定給付制度

（１）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表（簡便法を適用した制度を除く）

	前事業年度 （自　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
退職給付債務の期首残高	－ 千円	－ 千円
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	－	1,887,492
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	－	△54,100
退職給付債務の期末残高	－	1,833,391

（２）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	1,682,532 千円	1,801,748 千円
退職給付費用	229,805	274,595
退職給付の支払額	△110,589	△71,495
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	－	△1,887,492
退職給付引当金の期末残高	1,801,748	117,355

（３）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	1,801,748 千円	1,950,746 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,801,748	1,950,746
退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,801,748	1,950,746

（４）退職給付費用

	前事業年度 （自　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
簡便法で計算した退職給付費用	229,805 千円	274,595 千円
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	－	△54,100
確定給付制度に係る退職給付費用	229,805	220,494

（５）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

	前事業年度 （自　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
割引率	－ %	0.32 %

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において58,788千円、当事業年度において62,535千円であり、退職給付費用に計上しております。

（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 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
繰延税金資産		
賞与引当金	261,214　千円	298,659　千円
未払事業税	119,420	130,502
退職給付引当金	551,695	597,318
税務上の繰延資産償却超過額	6,126	4,337
役員退職慰労引当金	6,889	6,950
投資有価証券評価差額	88,160	254,174
その他	62,896	82,112
小計	1,096,402	1,374,055
評価性引当額	△9	△19
繰延税金資産合計	1,096,393	1,374,036
繰延税金負債		
特別分配金否認	5,022	3,682
投資有価証券評価差額	24,444	77,906
繰延税金負債合計	29,467	81,589
繰延税金資産(△は負債)の純額	1,066,925	1,292,446

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

［関連情報］

前事業年度（自2018年4月1日　至2019年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2019年4月1日　至2020年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1　関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自2018年4月１日　至2019年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	（被所有）直接100.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,299,726	未収運用受託報酬	762,239
								投資助言報酬の受取	130,542	未収投資助言報酬	11,530

当事業年度（自2019年4月１日　至2020年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	（被所有）直接100.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,360,908	未収運用受託報酬	802,463
								投資助言報酬の受取	130,557	未収投資助言報酬	11,984
								連結納税	3,123,434	その他未払金	3,123,434

（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　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
１株当たり純資産額	597,720円47銭	628,459円68銭
１株当たり当期純利益金額	78,626円78銭	83,477円26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　2018年4月 1日 至　2019年3月31日）	当事業年度 （自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日）
当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
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。

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。

追加型証券投資信託

ニッセイＴＯＰＩＸオープン

約　款

ニッセイ アセットマネジメント株式会社

運　用　の　基　本　方　針

約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

１．基　本　方　針

この投資信託は、わが国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

（１）投資対象

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。また、追加設定・一部解約等に伴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。

（２）投資態度

① 主としてニッセイ国内株式インデックス マザーファンドの受益証券に投資を行い、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

② 主として上記親投資信託の受益証券に投資を行いますが、追加設定・一部解約に伴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投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ 株式以外の資産の実質組入比率は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。

（３）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、取得時において投資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実質投資割合は、投資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実質投資割合は、取得時において投資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。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以内とします。

⑥ 投資信託証券への実質投資割合は、投資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（法人税法第 61 条の５に定めるものをいいます。）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑨ 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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

３．収益分配方針

毎期、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

① 分配対象額の範囲

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

② 分配対象額についての分配方針

委託者が基準価額水準、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 留保益の運用方針については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
ニッセイＴＯＰＩＸオープン
約　　款

（信託の種類、委託者および受託者）

第１条　この信託は、証券投資信託であり、ニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第１条の２　受託者は、信託法第26条第１項に基づき、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第 29 条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的および金額）

第２条　委託者は、金 308,452,030 円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第３条　委託者は、受託者と合意のうえ、金 5,000 億円を限度として信託金を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第４条　この信託の期間は、信託契約締結日から第49条第１項、第50条第１項、第51条第１項、または第53条第２項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第５条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第６条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第７条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第７条　委託者は、第２条の規定による受益権については 308,452,030 口を、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第８条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第８条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および

第29条に規定する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投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第９条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 10 条　この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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、以下「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（以下、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。）。

②　委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

③　委託者は、第７条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者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ないます。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成 18 年 12 月 29 日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成 19 年 1 月 4 日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成 19 年 1 月 4 日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、取扱販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第11条　受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位、価額および手数料等）

第12条　取扱販売会社は、第７条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、最低申込単位を１口単位として取扱販売会社が定める単位をもって取得申込に応じることができるものとします。ただし、別に定めるニッセイＴＯＰＩＸオープン自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権の取得申込者に対

しては、１口の整数倍をもって取得申込に応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

③ 第１項の場合の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、１口につき１円に、手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

④ 前項の手数料の額は取得申込日の基準価額に取扱販売会社がそれぞれ別に定める率を乗じて得た額とします。

⑤ 別に定める契約を結んだ受益者が第46条第２項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第40条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（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号の取引を行な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。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項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なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（受益証券を毀損した場合等の再交付）

第15条 （削除）

（受益証券の再交付の費用）

第16条 （削除）

（投資の対象とする資産の種類）

第17条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第 20 項に規定するものをいい、約款第 24 条、第 25 条および第 26 条に定めるものに限ります。）
ハ．金銭債権（イ及びニに掲げるものに該当するものを除きます。）
ニ．約束手形（イに掲げるものを除きます。）
２．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

（運用の指図範囲等）

第18条　委託者は、信託金を、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者とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託者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。）の受益証券ならびに次の第１号から第 22 号までに掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
９．特定目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12．外国または外国の者の発行する本邦通貨建表示の証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13．証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第 10 号で定めるもので本邦通貨建表示のものとします。）
14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第 11 号で定めるもので本邦通貨建表示のものとします。）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第 18 号で定めるものをいいます。）
16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
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本邦通貨建表示の譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の

受益証券に限ります。）

20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第１号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第１号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、第２号から第６号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第２号から第６号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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。以下本条において同じ。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

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前号の権利の性質を有するもの

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項第１号から第４号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④ 委託者は、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 20 を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前２項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券、当該新株予約権証券および当該投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦ 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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧ 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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、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。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第18条の２ 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、第30条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第17条および第18条第１項に定める資産への投資を、

信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関係法令に反しない限り行うことができます。

② 前項の取扱いは、第23条から第27条まで、第35条、第36条および第37条における委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第19条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第20条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場することが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の株式等への投資制限）

第21条 委託者は、取得時において投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 20 を超えることとなる投資の指図をしません。

② 委託者は、取得時において投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

③ 前２項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第22条 委託者は、投資信託財産に属する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。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならび当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信用取引の指図範囲）

第23条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③　投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとします。

（先物取引等の運用指図）

第24条　委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるわが国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の指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

②　委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第25条　委託者は、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②　スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第４条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③　スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に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投資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投資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。以下本項において同じ。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④　前項においてマザーファンドの投資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投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資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投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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　委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引の運用指図）

第26条　委託者は、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②　金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第４条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③　金利先渡取引の評価は、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　委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第27条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

（公社債の空売りの指図範囲）

第28条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③　投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとします。

（公社債の借入れ）

第29条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

②　前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③　投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④　第１項の借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支弁します。

（信託業務の委託等）

第30条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業法第 22 条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務に係る実績等に照らし､委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②　受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③　前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することがで

きるものとします。

１．投資信託財産の保存に係る業務

２．投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

４．受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（有価証券の保管）

第31条　（削除）

（混蔵寄託）

第32条　金融機関または証券会社（金融商品取引法第 28 条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

（一括登録）

第33条　（削除）

（投資信託財産の登記等および記載等の留保等）

第34条　信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求ならびに有価証券売却等の指図）

第35条　委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第36条　委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第37条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴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。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴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投資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

開始日から投資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投資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、資金借入額は借入指図を行う日における投資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投資信託財産から収益分配金が支弁さ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　借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第38条　委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第39条　投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　投資信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第40条　この信託の計算期間は、原則として毎年 2 月 21 日から翌年 2 月 20 日までとします。ただし、第１計算期間は、平成 13 年 4 月 27 日から平成 14 年 2 月 20 日までとします。

②　前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、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、第４条に規定する信託期間の終了日とします。

（投資信託財産に関する報告）

第41条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

（信託事務の諸費用および会計監査費用）

第42条　投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②　投資信託財産にかかる会計監査費用および当該会計監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

（信託報酬等の総額および支弁の方法）

第43条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 50 の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとします。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（収益の分配方式）

第44条　投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第45条　受託者は、収益分配金については第46条第１項に規定する支払開始日および第46条第２項に規定する交付開始前までに、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第46条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第46条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②　受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第46条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

②　前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が取扱販売会社に交付されます。この場合、取扱販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第 10 条第３項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③　償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④　一部解約金は、第 48 条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、５

営業日目から当該受益者に支払います。

⑤　前各項（第２項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、取扱販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥　収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金および償還金の時効）

第47条　受益者が、収益分配金については第46条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第46条第３項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（一部解約）

第48条　受益者（取扱販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位または１万口単位として取扱販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益証券については１口単位）をもって一部解約の実行を請求することができます。

②　委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。

③　前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の基準価額から当該基準価額に 0.3％の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

④　平成 19 年１月４日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、取扱販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年１月４日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年１月４日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

⑤　委託者は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

⑥　前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第３項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載又は記録の受益権の取り扱い）

第48条の２　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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

（信託契約の解約）

第49条　委託者は、信託期間中において、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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②　委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契

約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑤　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥　第３項から前項までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第３項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第50条　委託者は、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、信託契約を解約し信託を終了させます。

②　委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第54条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第51条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

②　前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第54条第４項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第52条　委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第53条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第54条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

（投資信託約款の変更）

第54条　委託者は、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、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第１項の投資信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

（反対者の買取請求権）

第55条　第49条に規定する投資信託約款の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第49条第３項または前条第３項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。ただし、当該請求の取り扱いは、委託者と受託者の協議により定めた手続きにより行うものとします。

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第55条の２　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することとし、次のアドレスに掲載します。

http://www.nam.co.jp/

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

（公告）

第56条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

http://www.nam.co.jp/

②　前項の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。

（投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第57条　この投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

附則第１条　約款第 12 条第１項の「ニッセイＴＯＰＩＸオープン自動けいぞく（累積）投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「ニッセイＴＯＰＩＸオープン自動けいぞく（累積）投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「ニッセイＴＯＰＩＸオープン自動けいぞく（累積）投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとします。

附則第２条　第46条第６項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

附則第３条　平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条（ただし、第２項の「別に定めるニッセイＴＯＰＩＸオープン自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって取得申込者が結んだ契約（以下「別に定める契約」といいます。）に基づいて大券をもって混蔵保管されるため、」を除きます。）、第 11 条、第 13 条から第 16 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効

力を有するものとします。

附則第４条　約款第26条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 13 年 4 月 27 日（信託契約締結日）

委託者　東京都千代田区大手町一丁目８番１号
ニッセイアセットマネジメント株式会社
取 締 役 社 長　山田　昌弘

受託者　東京都千代田区永田町二丁目１１番１号
三菱信託銀行株式会社
取 締 役 社 長　内海　暎郎