

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年8月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 啓介
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債 券）
【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)
上記ファンドの愛称として「ファンドパック日本」ということがあります。
(以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5)【申込手数料】

ありません。

(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：2019年8月21日(水)～2020年2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經由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時~午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

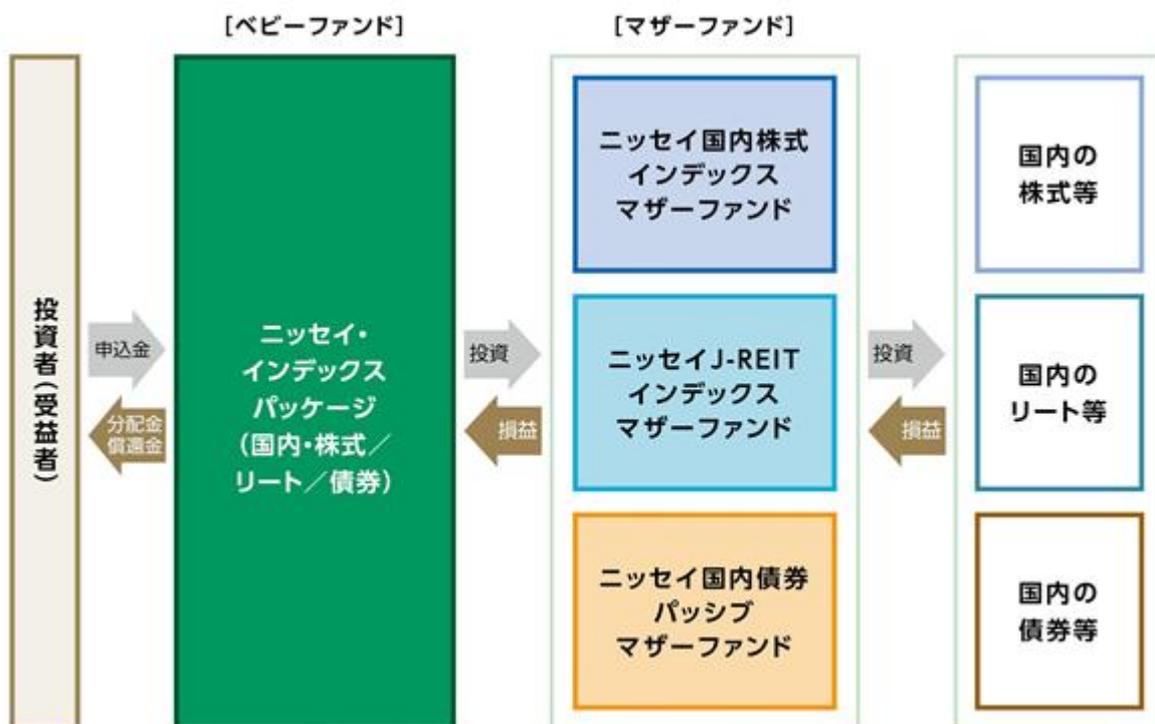
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

- 投資対象とするマザーファンドは、各投資対象資産の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド	マザーファンドの概要
国内株式	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	「TOPIX(東証株価指数)(配当込み)」の動きに連動する投資 成果をめざします。
国内リート	ニッセイ・REIT インデックスマザーファンド	「東証REIT指数(配当込み)」の動きに連動する投資成果を めざします。
国内債券	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざし ます。

〈各マザーファンドの運用プロセス〉

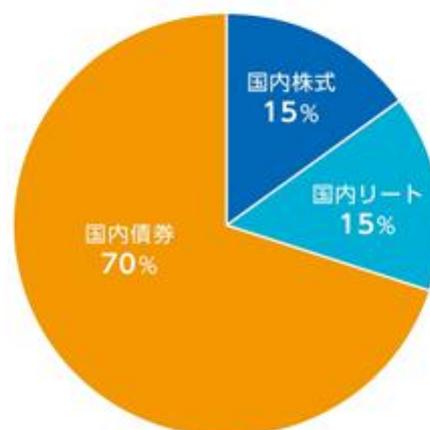


2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

- ファンドは、各投資対象資産の指数を基本投資割合で組合せた合成ベンチマーク[®]の動きに連動する投資成果をめざします。

※各投資対象資産の指数の騰落率を基本投資割合で加重平均し、委託会社が独自に指数化したもの(以下「ベンチマーク」ということがあります)。各投資対象資産の指数は、国内株式:TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、国内リート:東証REIT指数(配当込み)、国内債券:NOMURA-BPI総合。

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各指数の構成銘柄すべてを組めないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングがずれること、売買時のコストや運用管理費用(信託報酬)等の費用を負担することなどから、基準価額と合成ベンチマークの動きは完全に一致するものではありません。

〈各指数について〉**●TOPIX(東証株価指数)**

株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の高標または標章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、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行また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。

●東証REIT指数

東証REIT指数は、東証市場に上場する不動産投資信託(Real Estate Investment Trust)全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。東証REIT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・ノウハウおよび東証REIT指数の高標または標章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。

●NOMURA-BPI総合

日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、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、一切の責任を負うものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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

ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 資産複合 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	

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

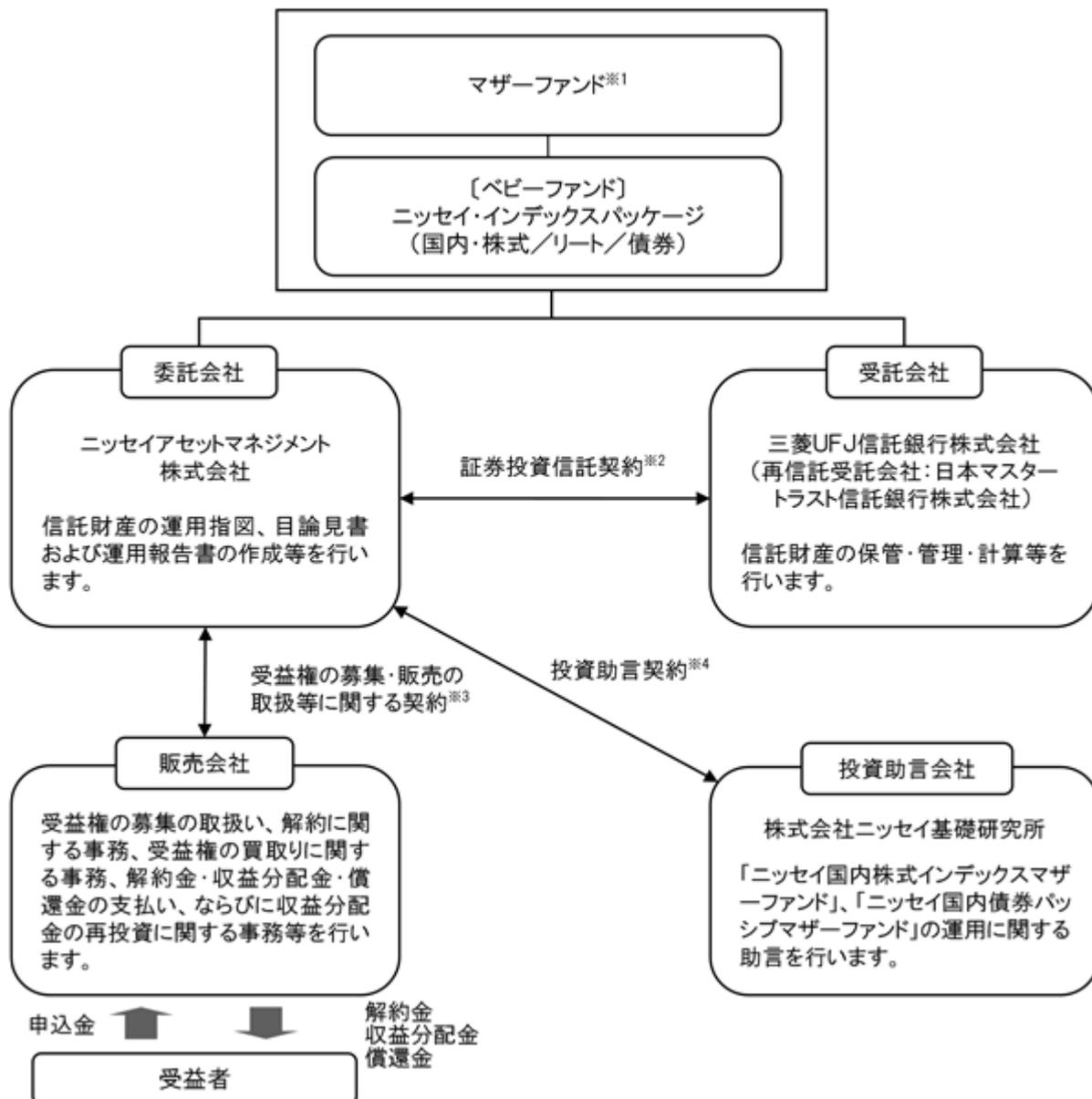
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 不動産投信・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主た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、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする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、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等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。
その他の指数 (合成ベンチマーク)	目論見書または約款において、合成ベンチマーク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】

2017年11月17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 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド
- 2 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 3 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。
- 4 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（2019年5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 西 啓介
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】

複数のマザーファンドへの投資を通じ、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）および東証REIT指数（配当込み）をそれぞれ15%、NOMURA-BPI総合を70%ずつ組合せた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

各マザーファンドへの基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドおよびニッセイJ-REITインデックスマザーファンドへそれぞれ15%、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドへ70%とします。

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）している不動産投資信託証券（不動産投資法人の投資証券または不動産投資信託の受益証券をいいます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）している不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。

不動産投資信託証券への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含まず）に投資を行うものとします。なお、東証REIT指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜不動産投資信託証券の追加・見直しを行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、主として国内の公社債への投資を行うことにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、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）の新株予約権をいいます。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、

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

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

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

複数のマザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、株式、上場不動産投資信託証券、公社債等に投資を行う場合があります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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前記「a 主な投資対象」に定めるマザーファンドのほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます）に投資します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます）

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます）

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. までの証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます）

14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限り）

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品

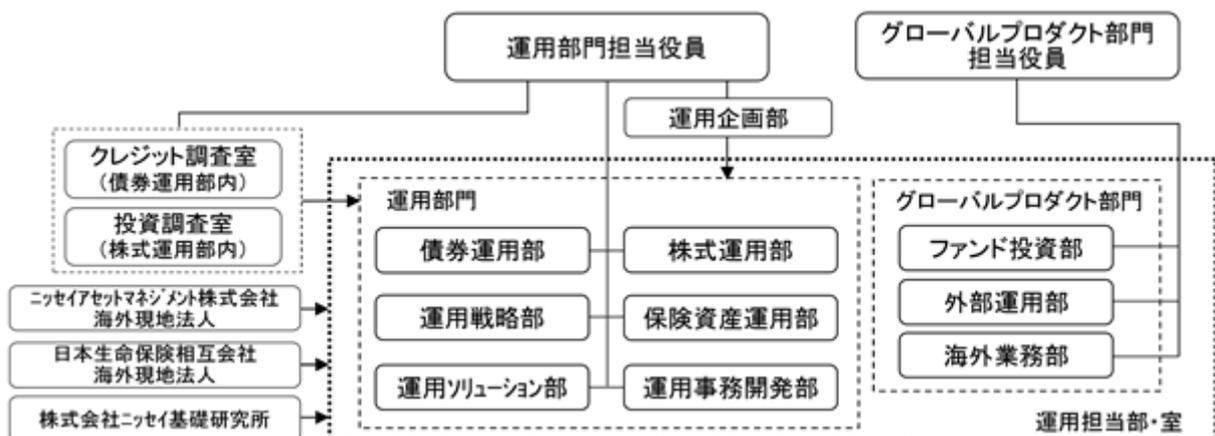
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

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

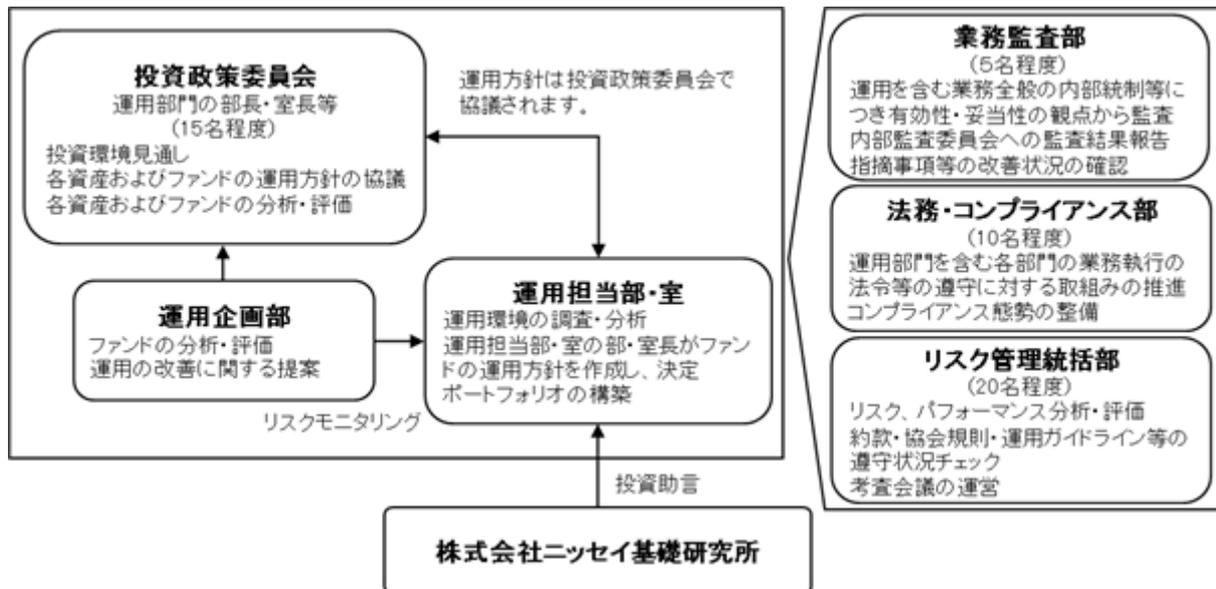
（3）【運用体制】

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・マネージャー/アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（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

留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。

分配時期

毎決算日とし、決算日は11月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式、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25%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りま

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。

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

信用取引の範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
2. 前記1.の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

先物取引等

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

スワップ取引

1. 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

金利先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
 - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。

有価証券の空売り

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとします。
2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
 4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。
- 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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます)を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
 3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c 法令に定める投資制限

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。

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。

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、ベンチマークの動きに連動することを目標に運用しますので、ベンチマーク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。

・債券投資リスク

金利変動リスク

金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

信用リスク

債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

リーートの価格は、リートが保有する不動産の価値および賃貸料収入の増減等、また不動産市況や景気動向等の影響を受け変動します。

リートが保有する不動産の賃貸料や稼働率の低下、また自然災害等によって保有する不動産に損害等が生じた場合、リーートの価格が下落することがあります。

金利変動リスク

リートは、金利が上昇する場合、他の債券の利回り等との比較から売却され、価格が下落することがあります。

また、金融機関等から借入れを行うリートは、金利上昇時には金利負担の増加により収益性が悪化し、リーートの価格が下落することがあります。

信用リスク

リートは一般の法人と同様に倒産のリスクがあり、リーートの経営や財務状況が悪化した場合、リーートの価格が下落することがあります。

J-REITの税制に関するリスク

一般に、J-REITの発行者には課税の実質免除措置が適用されますが、税法上の一定の要件を満たさない場合、当該措置は適用されず発行者の税負担が増大し、J-REITの価格が下落することおよび分配金が減少することがあります。

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

リートおよび不動産等に関する法制度（税制・建築規制等）の変更により不動産の価値および収益性が低下する場合、リーートの価格が下落することおよび分配金が減少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

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングがずれること、売買時のコストや運用管理費用（信託報

酬)等の費用を負担することなどから、基準価額と合成ベンチマークの動きは完全に一致するものではありません。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

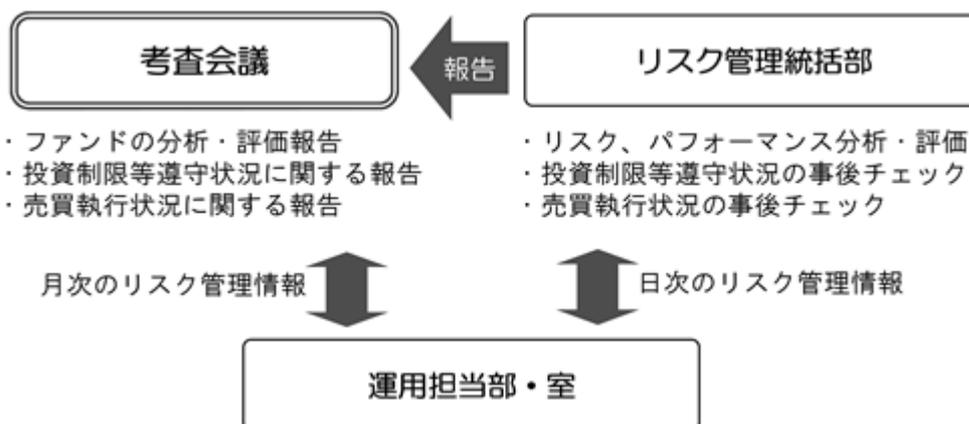
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2018年11月20日現在、ファンドを1百万円(受益権口数1百万口、ファンド全体の10.0%)保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

(2) 投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の年間騰落率のデータが5年分に満たないため、不足するデータに関してはファンドのベンチマークを用いて算出しています。したがって、**グラフにおけるファンドの騰落率は、すべてがファンドの実績ではありませんのでご注意ください。**

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数) (配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (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・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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0.30456%（税抜0.282%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

消費税率が10%になった場合は、年0.3102%となります。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.130%	0.130%	0.022%

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

ファンドが実質的な投資対象とする上場不動産投資信託証券（リート）は、市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託証券の費用は表示しておりません。

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00216% （税抜0.002%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00324% （税抜0.003%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00540% （税抜0.005%）
10億円以下 の部分	年 0.01080% （税抜0.010%）

消費税率が10%になった場合は、以下の通りとなります。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.0022% （税抜0.002%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.0033% （税抜0.003%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.0055% （税抜0.005%）
10億円以下 の部分	年 0.0110% （税抜0.010%）

信託事務の諸費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

申込手数料	投資者のファンドの取得時に、販売会社からの商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売会社における当該取得にかかる事務手続き等の対価として販売会社が收受
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收受
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收受
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收受
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（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。
- 解約請求・償還・
買 取 請 求 時：解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

税率（法人）

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

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

個別元本

- ・追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ・受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を差引いた額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）」

(2019年5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	20,136,174	100.00
内 日本	20,136,174	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	172	0.00
純資産総額	20,136,002	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」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	53,929,180,730	95.03
内 日本	53,929,180,730	95.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,819,267,525	4.97
純資産総額	56,748,448,255	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）	2,771,040,000	4.88
内 日本	2,771,040,000	4.88

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

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

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	62,835,927,640	72.33
内 日本	62,835,927,640	72.33
地方債証券	8,346,563,414	9.61
内 日本	8,346,563,414	9.61
特殊債券	8,650,913,303	9.96
内 日本	8,650,913,303	9.96
社債券	6,291,122,900	7.24
内 日本	5,876,919,100	6.76
内 スウェーデン	414,203,800	0.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	748,120,021	0.86
純資産総額	86,872,647,278	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」-REITインデックス マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	21,154,932,150	98.74
内 日本	21,154,932,150	98.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	269,935,004	1.26
純資産総額	21,424,867,154	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。

(2) 【投資資産】

「ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)」

【投資有価証券の主要銘柄】

(2019年5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)	評価単価(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
				簿価金額(円)	評価金額(円)		
1	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	14,339,565	0.9743 13,971,719	0.9916 14,219,112	- -	70.62%
2	ニッセイJ-REITインデッ クス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,868,304	1.5442 2,885,170	1.6472 3,077,470	- -	15.28%
3	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	1,770,430	1.6752 2,965,914	1.6039 2,839,592	- -	14.10%

(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別及び各業種の評価金額の比率であります。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2019年5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)	評価単価(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
				簿価金額(円)	評価金額(円)		
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	276,800	6,789.90 1,879,445,030	6,384.00 1,767,091,200	- -	3.11%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	101,900	10,400.85 1,059,847,515	10,250.00 1,044,475,000	- -	1.84%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	166,700	5,272.18 878,873,582	5,257.00 876,341,900	- -	1.54%
4	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	1,686,700	586.90 989,938,070	501.10 845,205,370	- -	1.49%

5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	166,700	4,698.60 783,257,880	4,866.00 811,162,200	- -	1.43%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	216,900	4,474.75 970,573,950	3,669.00 795,806,100	- -	1.40%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	12,200	62,570.00 763,354,000	61,510.00 750,422,000	- -	1.32%
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	172,700	4,040.87 697,859,726	3,783.00 653,324,100	- -	1.15%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	214,800	2,717.72 583,767,706	2,788.50 598,969,800	- -	1.06%
10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	170,100	3,025.30 514,604,670	3,468.00 589,906,800	- -	1.04%
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	209,600	3,033.08 635,735,184	2,651.00 555,649,600	- -	0.98%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	14,200	29,675.00 421,385,000	38,700.00 549,540,000	- -	0.97%
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,329,500	176.19 586,643,174	153.70 511,744,150	- -	0.90%
14	花王 日本	株式 化学	60,300	8,329.95 502,296,405	8,480.00 511,344,000	- -	0.90%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	22,200	24,839.22 551,430,778	22,645.00 502,719,000	- -	0.89%
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	171,700	3,253.99 558,711,102	2,833.00 486,426,100	- -	0.86%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	87,600	5,569.64 487,900,668	5,401.00 473,127,600	- -	0.83%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	44,200	10,620.66 469,433,400	10,310.00 455,702,000	- -	0.80%
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	33,900	12,351.28 418,708,600	13,230.00 448,497,000	- -	0.79%
20	ファナック 日本	株式 電気機器	23,600	19,408.80 458,047,900	18,475.00 436,010,000	- -	0.77%
21	日立製作所 日本	株式 電気機器	111,800	3,482.38 389,331,024	3,686.00 412,094,800	- -	0.73%
22	キヤノン 日本	株式 電気機器	133,700	3,223.95 431,042,810	3,065.00 409,790,500	- -	0.72%
23	日本電産 日本	株式 電気機器	29,900	13,401.25 400,697,600	13,590.00 406,341,000	- -	0.72%
24	信越化学工業 日本	株式 化学	42,900	9,595.17 411,633,100	9,047.00 388,116,300	- -	0.68%
25	資生堂 日本	株式 化学	49,400	7,217.80 356,559,600	7,833.00 386,950,200	- -	0.68%
26	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	154,300	2,607.50 402,337,250	2,495.50 385,055,650	- -	0.68%
27	HOYA 日本	株式 精密機器	50,000	6,772.45 338,622,755	7,558.00 377,900,000	- -	0.67%
28	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	102,600	4,973.56 510,288,244	3,666.00 376,131,600	- -	0.66%
29	第一三共 日本	株式 医薬品	71,100	3,906.31 277,738,869	5,255.00 373,630,500	- -	0.66%
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	28,100	12,286.24 345,243,600	13,250.00 372,325,000	- -	0.66%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	12.48
		情報・通信業	8.68
		輸送用機器	7.32
		化学	6.95
		銀行業	5.69
		医薬品	5.27
		サービス業	5.07
		機械	4.74
		卸売業	4.71
		陸運業	4.67
		小売業	4.38
		食料品	4.01
		建設業	2.72
		不動産業	2.35
		保険業	2.21
		その他製品	2.08
		精密機器	2.02
		電気・ガス業	1.65
		その他金融業	1.05
		鉄鋼	0.85
		ガラス・土石製品	0.80
		ゴム製品	0.73
		証券、商品先物取引業	0.72
		非鉄金属	0.70
		繊維製品	0.61
		石油・石炭製品	0.58
空運業	0.54		
金属製品	0.51		
パルプ・紙	0.26		
鋳業	0.24		
倉庫・運輸関連業	0.19		
海運業	0.14		
水産・農林業	0.11		
	小計		95.03
合 計（対純資産総額比）			95.03

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	TOPI X 先物 0106月	買建	184	2,903,079,360	2,771,040,000	4.88%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2019年5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	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	103.22 1,032,263,000	103.25 1,032,520,000	0.828000 2023/5/19	1.19%
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	849,000,000	101.68 863,263,200	102.18 867,525,180	0.100000 2028/3/20	1.00%
3	第342回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	827,000,000	101.84 842,216,800	102.06 844,085,820	0.100000 2026/3/20	0.97%
4	第312回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	779,000,000	102.40 797,696,000	102.12 795,561,540	1.200000 2020/12/20	0.92%
5	第343回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	741,000,000	101.91 755,153,100	102.14 756,887,040	0.100000 2026/6/20	0.87%
6	第344回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	720,000,000	101.94 733,968,000	102.18 735,724,800	0.100000 2026/9/20	0.85%
7	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	714,000,000	101.77 726,637,800	102.20 729,765,120	0.100000 2027/12/20	0.84%
8	第347回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	696,000,000	101.92 709,363,200	102.24 711,618,240	0.100000 2027/6/20	0.82%
9	第339回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	680,000,000	103.54 704,072,000	103.67 704,969,600	0.400000 2025/6/20	0.81%
10	第348回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	689,000,000	101.85 701,746,500	102.22 704,357,810	0.100000 2027/9/20	0.81%
11	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	664,000,000	103.69 688,501,600	103.82 689,411,280	0.400000 2025/9/20	0.79%
12	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	665,000,000	101.58 675,546,900	102.15 679,310,800	0.100000 2028/6/20	0.78%
13	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	643,000,000	103.15 663,254,500	103.31 664,328,310	0.300000 2025/12/20	0.76%
14	第346回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	647,000,000	101.94 659,597,090	102.21 661,318,110	0.100000 2027/3/20	0.76%
15	第352回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	625,000,000	101.48 634,275,000	102.11 638,225,000	0.100000 2028/9/20	0.73%
16	第137回 利付国債(5 年) 日本	国債証券	592,000,000	101.31 599,755,200	101.30 599,696,000	0.100000 2023/9/20	0.69%
17	第353回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	576,000,000	101.64 585,486,320	102.02 587,669,760	0.100000 2028/12/20	0.68%

18	第338回 利付国債（10年） 日本	国債証券	559,000,000	103.40 578,006,000	103.51 578,660,030	0.400000 2025/3/20	0.67%
19	第127回 利付国債（5年） 日本	国債証券	572,000,000	100.50 574,876,520	100.50 574,882,880	0.100000 2021/3/20	0.66%
20	第345回 利付国債（10年） 日本	国債証券	532,000,000	101.96 542,459,120	102.22 543,810,400	0.100000 2026/12/20	0.63%
21	第396回 利付国債（2年） 日本	国債証券	528,000,000	100.47 530,500,400	100.43 530,296,800	0.100000 2021/1/1	0.61%
22	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	103.86 519,347,500	103.71 518,574,000	0.660000 2024/5/31	0.60%
23	第190回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	102.90 514,509,000	102.82 514,135,500	0.605000 2023/5/31	0.59%
24	第139回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	102.81 514,068,000	102.55 512,792,000	1.100000 2021/7/30	0.59%
25	第37回 利付国債（30年） 日本	国債証券	362,000,000	131.54 476,174,800	134.40 486,538,860	1.900000 2042/9/20	0.56%
26	第36回 利付国債（30年） 日本	国債証券	350,000,000	133.30 466,550,000	136.12 476,437,500	2.000000 2042/3/20	0.55%
27	第399回 利付国債（2年） 日本	国債証券	473,000,000	100.48 475,284,590	100.51 475,426,490	0.100000 2021/4/1	0.55%
28	第128回 利付国債（5年） 日本	国債証券	464,000,000	100.57 466,644,800	100.57 466,668,000	0.100000 2021/6/20	0.54%
29	第398回 利付国債（2年） 日本	国債証券	463,000,000	100.46 465,134,430	100.48 465,264,070	0.100000 2021/3/1	0.54%
30	第147回 利付国債（20年） 日本	国債証券	374,000,000	120.52 450,744,800	121.77 455,419,800	1.600000 2033/12/20	0.52%

（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（%）
公社債券	国内	国債証券	72.33
		地方債証券	9.61
		特殊債券	9.96
		社債券	6.76
	小計	98.66	
	外国	社債券	0.48
	小計	0.48	
合計（対純資産総額比）			99.14

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

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ」- R E I Tインデックス マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2019年5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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	2,152	716,835.13 1,542,629,217	742,000.00 1,596,784,000	- -	7.45%
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,223	617,589.06 1,372,900,502	645,000.00 1,433,835,000	- -	6.69%
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	6,916	164,485.55 1,137,582,092	168,400.00 1,164,654,400	- -	5.44%
4	日本リテールファンド投資 法人 日本	投資証券	4,201	211,155.42 887,063,938	218,600.00 918,338,600	- -	4.29%
5	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	4,902	179,098.22 877,939,501	179,000.00 877,458,000	- -	4.10%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	4,429	194,158.32 859,927,237	194,600.00 861,883,400	- -	4.02%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	2,982	252,167.46 751,963,369	256,600.00 765,181,200	- -	3.57%
8	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	2,981	239,209.84 713,084,546	236,100.00 703,814,100	- -	3.29%
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	2,166	308,118.54 667,384,779	314,000.00 680,124,000	- -	3.17%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	5,508	122,955.18 677,237,152	120,800.00 665,366,400	- -	3.11%
11	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	1,407	447,405.05 629,498,906	464,000.00 652,848,000	- -	3.05%
12	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	7,154	88,906.33 636,035,943	88,100.00 630,267,400	- -	2.94%
13	アクティブピア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	1,168	462,019.22 539,638,449	469,500.00 548,376,000	- -	2.56%
14	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証券	688	750,002.22 516,001,528	747,000.00 513,936,000	- -	2.40%
15	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	5,735	82,001.96 470,281,297	81,100.00 465,108,500	- -	2.17%
16	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,668	54,460.64 417,604,233	57,800.00 443,210,400	- -	2.07%
17	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	739	574,103.15 424,262,233	573,000.00 423,447,000	- -	1.98%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	513	764,478.82 392,177,638	751,000.00 385,263,000	- -	1.80%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	2,549	149,027.65 379,871,480	149,500.00 381,075,500	- -	1.78%

20	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証券	1,452	245,711.59 356,773,232	241,800.00 351,093,600	- -	1.64%
21	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証券	756	461,476.32 348,876,105	458,500.00 346,626,000	- -	1.62%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	2,590	129,418.07 335,192,816	130,100.00 336,959,000	- -	1.57%
23	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証券	1,797	180,617.76 324,570,116	179,800.00 323,100,600	- -	1.51%
24	ジャパンエクセレント投資 法人 日本	投資証券	1,990	158,656.99 315,727,412	161,200.00 320,788,000	- -	1.50%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,281	133,844.83 305,300,076	136,000.00 310,216,000	- -	1.45%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	717	417,267.84 299,181,047	424,500.00 304,366,500	- -	1.42%
27	プレミア投資法人 日本	投資証券	2,113	138,248.08 292,118,203	138,500.00 292,650,500	- -	1.37%
28	コンフォリア・レジデン シャル投資法人 日本	投資証券	922	297,361.87 274,167,645	297,500.00 274,295,000	- -	1.28%
29	森トラスト総合リート投資 法人 日本	投資証券	1,589	169,088.75 268,682,029	172,500.00 274,102,500	- -	1.28%
30	東急リアル・エステート投 資法人 日本	投資証券	1,490	180,231.15 268,544,416	177,100.00 263,879,000	- -	1.23%

（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 (%)
投資証券	国内	投資証券	98.74
	小計		98.74
合 計（対純資産総額比）			98.74

（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。

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

「ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)」

【純資産の推移】

2019年5月31日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	10,125,048	10,125,048	1.0114	1.0114
2018年5月末日	5,974,311	-	1.0175	-
6月末日	6,566,163	-	1.0197	-
7月末日	7,270,843	-	1.0210	-
8月末日	8,070,535	-	1.0149	-
9月末日	8,700,159	-	1.0242	-
10月末日	9,465,066	-	1.0077	-
11月末日	10,611,661	-	1.0187	-
12月末日	12,214,842	-	1.0051	-
2019年1月末日	13,691,545	-	1.0218	-
2月末日	15,221,565	-	1.0275	-
3月末日	17,132,240	-	1.0375	-
4月末日	18,584,642	-	1.0363	-
5月末日	20,136,002	-	1.0332	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2018年11月21日～ 2019年5月20日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
2018年11月21日～ 2019年5月20日	2.4

(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・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	11,339,331	1,327,996	10,011,335
2018年11月21日～ 2019年5月20日	10,452,446	1,538,945	18,924,836

(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

2019年5月末現在

● 基準価額・純資産の推移



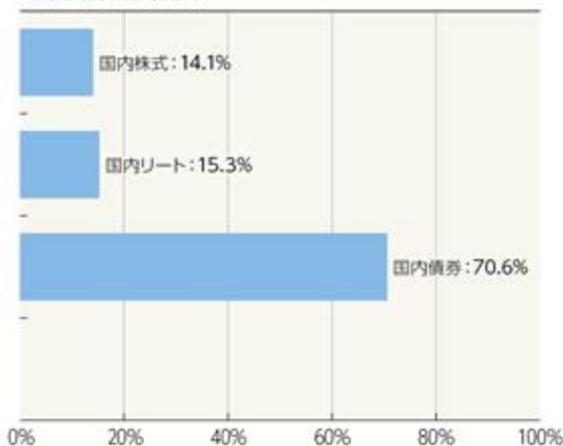
基準価額	10,332円
純資産総額	20百万円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

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

● 資産別組入比率



- ・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。
- ・2017年はファンド設定時から年末まで、2019年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
- ・2016年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

3.運用実績

2019年5月末現在

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.3%
2	ソフトバンクグループ	1.9%
3	ソニー	1.6%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%
5	日本電信電話	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

2. ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.5%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.8%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.5%
4	日本リテールファンド投資法人	4.3%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.1%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

3. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.2%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第342回 利付国債(10年)	2026/03/20	0.100%	1.0%
4	第312回 利付国債(10年)	2020/12/20	1.200%	0.9%
5	第343回 利付国債(10年)	2026/06/20	0.100%	0.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	13.1%
2	情報・通信業	9.1%
3	輸送用機器	7.7%
4	化学	7.3%
5	銀行業	6.0%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.7%
短期金融資産等	1.3%

・比率は対純資産総額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	-
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

1. ファンドの取得申込者は、販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
2. 定期引出契約とは、分配金再投資コースにおいて、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

金融商品取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときには、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

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。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内不動産投資信託証券	金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法で評価します。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限です。

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

・受益権の口数が30億口を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

3. 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該

3. において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前記2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 前記2. から4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記2. から4. までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
6. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更等 2. 」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
9. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。
- 約款の変更等
1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前記1. の事項(前記1. の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2. の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3. において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2. から5. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1. から6. までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1. から7. までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知れている受益者に交付します。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)に掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付します。

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

分配金再投資コースの場合、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2017年11月17日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2017年11月17日から2018年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2018年11月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		4,933
コール・ローン		6,863
親投資信託受益証券		10,125,134
未収入金		2,936
流動資産合計		10,139,866
資産合計		10,139,866
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,508
未払受託者報酬		879
未払委託者報酬		11,106
その他未払費用		325
流動負債合計		14,818
負債合計		14,818
純資産の部		
元本等		
元本		10,011,335
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		113,713
純資産合計		10,125,048
負債純資産合計		10,139,866

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 (自2017年11月17日 至2018年11月20日)
営業収益	
有価証券売買等損益	7,199
営業収益合計	7,199
営業費用	
受託者報酬	1,151
委託者報酬	14,914
その他費用	394
営業費用合計	16,459
営業利益又は営業損失（ ）	23,658
経常利益又は経常損失（ ）	23,658
当期純利益又は当期純損失（ ）	23,658
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（ ）	1,717
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	155,332
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	155,332
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,244
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,244
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（ ）	113,713

(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1期 (2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	10,011,335口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0114円 (10,114円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 (自2017年11月17日 至2018年11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(113,713円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は113,713円(1口当たり0.011358円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 (自2017年11月17日 至2018年11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。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2018年11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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年11月20日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	11,352
合計	11,352

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第1期 (2018年11月20日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	10,339,331円
期中一部解約元本額	1,327,996円

(4)【附属明細表】(2018年11月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	880,678	1,498,209	
	ニッセイ国内債券バッシブ マザーファンド	7,329,823	7,083,540	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	1,022,448	1,543,385	
親投資信託受益証券 合計		9,232,949	10,125,134	
合計		9,232,949	10,125,134	

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・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券））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、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」-REIT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、すべて各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。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

（2018年11月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	471,797,753
コール・ローン	656,414,314
株式	54,651,417,270
派生商品評価勘定	2,849,740
未収配当金	473,077,219
前払金	9,685,000
差入委託証拠金	44,625,000
流動資産合計	56,309,866,296
資産合計	56,309,866,296
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,605,640
未払解約金	118,516,537
その他未払費用	36,709
流動負債合計	145,158,886
負債合計	145,158,886
純資産の部	
元本等	
元本	33,015,590,469
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,149,116,941
純資産合計	56,164,707,410
負債純資産合計	56,309,866,296

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	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	33,015,590,469口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7012円 (17,012円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 2017年11月17日 至 2018年11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。
2 . 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11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。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	4,203,418,286	
合計	4,203,418,286	

（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	（2018年11月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
先物取引				
買 建	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000
合計	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000

（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	(2018年11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	25,660,183,895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	15,502,337,729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	8,146,931,155円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	7,091,055,877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)	5,174,155,540円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,502,125円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,135,818円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,126,664,808円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,002,161,723円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,800,194,280円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	12,096,632円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,290,695円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,317,865円
DCニッセイ国内株式インデックス	145,946,565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	12,044,346,864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)	407,253,399円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	17,881,836円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,201,733円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,809,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	14,634,712円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,304,455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)	14,120,028円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,504,084円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,655,590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)	598,026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)	880,678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)	8,877,953円
計	33,015,590,469円

附属明細表(2018年11月20日現在)

第1 有価証券明細表
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,000	3,075.00	3,075,000	
日本水産	32,300	711.00	22,965,300	
マルハニチロ	4,700	4,265.00	20,045,500	
カネコ種苗	1,100	1,438.00	1,581,800	
サカタのタネ	3,900	3,745.00	14,605,500	
ホクト	2,700	2,020.00	5,454,000	
ヒノキヤグループ	700	2,220.00	1,554,000	
ショーボンドホールディングス	2,500	8,300.00	20,750,000	
ミライト・ホールディングス	8,200	1,582.00	12,972,400	
タマホーム	2,000	1,072.00	2,144,000	
TATERU	3,900	400.00	1,560,000	
スペースバリューホールディングス	3,900	1,037.00	4,044,300	
住石ホールディングス	9,500	112.00	1,064,000	
日鉄鉱業	700	5,050.00	3,535,000	
三井松島ホールディングス	1,300	1,574.00	2,046,200	
国際石油開発帝石	129,300	1,259.00	162,788,700	
石油資源開発	4,600	2,338.00	10,754,800	
K&Oエナジーグループ	1,600	1,552.00	2,483,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	849.00	1,528,200	
安藤・間	20,600	711.00	14,646,600	
東急建設	9,400	1,117.00	10,499,800	
コムシスホールディングス	11,400	2,829.00	32,250,600	
ミサワホーム	2,500	786.00	1,965,000	
高松コンストラクショングループ	2,000	2,850.00	5,700,000	
東建コーポレーション	1,000	7,600.00	7,600,000	
ソネック	1,900	776.00	1,474,400	
ヤマウラ	1,600	903.00	1,444,800	
大成建設	26,500	4,855.00	128,657,500	
大林組	79,700	1,106.00	88,148,200	
清水建設	81,300	928.00	75,446,400	
飛島建設	2,300	1,517.00	3,489,100	
長谷工コーポレーション	33,200	1,323.00	43,923,600	
松井建設	2,900	856.00	2,482,400	
銭高組	300	5,380.00	1,614,000	
鹿島建設	62,300	1,499.00	93,387,700	
不動テトラ	2,000	1,824.00	3,648,000	
大末建設	1,300	1,135.00	1,475,500	
鉄建建設	1,600	2,908.00	4,652,800	
西松建設	5,700	2,526.00	14,398,200	
三井住友建設	19,200	712.00	13,670,400	
大豊建設	1,800	3,460.00	6,228,000	
前田建設工業	19,000	1,096.00	20,824,000	
佐田建設	3,600	417.00	1,501,200	
ナカノフード建設	2,200	633.00	1,392,600	
奥村組	4,400	3,645.00	16,038,000	
東鉄工業	3,200	3,125.00	10,000,000	
浅沼組	900	3,380.00	3,042,000	
戸田建設	30,900	736.00	22,742,400	
熊谷組	3,800	3,335.00	12,673,000	
青木あすなろ建設	1,500	986.00	1,479,000	
北野建設	600	4,060.00	2,436,000	
植木組	600	2,373.00	1,423,800	
矢作建設工業	3,600	754.00	2,714,400	
ピーエス三菱	2,800	730.00	2,044,000	

日本ハウスホールディングス	5,100	485.00	2,473,500
大東建託	9,500	14,320.00	136,040,000
新日本建設	3,200	1,207.00	3,862,400
N I P P O	7,000	1,810.00	12,670,000
東亜道路工業	500	3,170.00	1,585,000
前田道路	8,300	2,154.00	17,878,200
日本道路	700	5,990.00	4,193,000
東亜建設工業	2,300	1,528.00	3,514,400
若築建設	1,300	1,609.00	2,091,700
東洋建設	9,700	396.00	3,841,200
五洋建設	31,600	664.00	20,982,400
世紀東急工業	3,900	643.00	2,507,700
福田組	900	4,880.00	4,392,000
住友林業	18,800	1,588.00	29,854,400
日本基礎技術	4,400	329.00	1,447,600
巴コーポレーション	3,300	436.00	1,438,800
大和ハウス工業	73,700	3,464.00	255,296,800
ライト工業	5,100	1,465.00	7,471,500
積水ハウス	81,400	1,687.00	137,321,800
日特建設	2,300	688.00	1,582,400
北陸電気工事	1,400	1,021.00	1,429,400
ユアテック	4,300	864.00	3,715,200
四電工	600	2,597.00	1,558,200
中電工	3,400	2,441.00	8,299,400
関電工	12,100	1,122.00	13,576,200
きんでん	17,700	1,904.00	33,700,800
東京エネシス	2,700	921.00	2,486,700
トーエネック	700	3,120.00	2,184,000
住友電設	1,800	1,920.00	3,456,000
日本電設工業	4,500	2,378.00	10,701,000
協和エクシオ	10,400	2,782.00	28,932,800
新日本空調	2,200	1,830.00	4,026,000
日本工営	1,500	2,416.00	3,624,000
九電工	5,200	4,350.00	22,620,000
三機工業	6,100	1,148.00	7,002,800
日揮	22,900	1,754.00	40,166,600
中外炉工業	700	2,388.00	1,671,600
ヤマト	2,400	616.00	1,478,400
太平電業	1,800	2,777.00	4,998,600
高砂熱学工業	6,700	2,002.00	13,413,400
三晃金属工業	500	2,900.00	1,450,000
N E C ネットエスアイ	2,600	2,472.00	6,427,200
朝日工業社	600	3,110.00	1,866,000
明星工業	4,900	810.00	3,969,000
大気社	3,600	2,915.00	10,494,000
ダイダン	1,800	2,543.00	4,577,400
日比谷総合設備	2,500	1,815.00	4,537,500
東芝プラントシステム	5,800	2,358.00	13,676,400
日本製粉	7,900	1,835.00	14,496,500
日清製粉グループ本社	26,900	2,288.00	61,547,200
日東富士製粉	200	5,420.00	1,084,000
昭和産業	2,200	2,839.00	6,245,800
鳥越製粉	2,100	931.00	1,955,100
中部飼料	2,900	1,336.00	3,874,400
フィード・ワン	16,000	201.00	3,216,000
東洋精糖	1,300	1,172.00	1,523,600
日本甜菜製糖	1,400	1,965.00	2,751,000
三井製糖	1,900	3,030.00	5,757,000
塩水港精糖	6,100	240.00	1,464,000
日新製糖	1,100	2,282.00	2,510,200

L I F U L L	7,900	771.00	6,090,900
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	2,070.00	3,726,000
日本M&Aセンター	16,900	2,504.00	42,317,600
タケエイ	2,400	826.00	1,982,400
トラスト・テック	1,100	2,926.00	3,218,600
コシダカホールディングス	6,100	1,394.00	8,503,400
パソナグループ	2,200	1,257.00	2,765,400
C D S	1,200	1,244.00	1,492,800
リンクアンドモチベーション	4,200	928.00	3,897,600
G C A	2,300	788.00	1,812,400
エス・エム・エス	8,300	1,759.00	14,599,700
パーソルホールディングス	22,700	1,919.00	43,561,300
リニカル	1,300	1,478.00	1,921,400
クックパッド	7,100	387.00	2,747,700
アイ・ケイ・ケイ	2,100	720.00	1,512,000
森永製菓	6,000	4,880.00	29,280,000
中村屋	600	4,505.00	2,703,000
江崎グリコ	7,200	5,370.00	38,664,000
名糖産業	1,100	1,474.00	1,621,400
井村屋グループ	1,000	2,991.00	2,991,000
不二家	1,300	2,461.00	3,199,300
山崎製パン	19,500	2,390.00	46,605,000
モロゾフ	400	5,450.00	2,180,000
亀田製菓	1,500	5,250.00	7,875,000
寿スピリッツ	2,500	4,340.00	10,850,000
カルビー	10,900	3,720.00	40,548,000
森永乳業	4,800	3,360.00	16,128,000
六甲バター	1,700	2,315.00	3,935,500
ヤクルト本社	17,600	8,170.00	143,792,000
明治ホールディングス	16,900	8,760.00	148,044,000
雪印メグミルク	5,700	3,075.00	17,527,500
プリマハム	3,400	2,226.00	7,568,400
日本ハム	10,300	4,200.00	43,260,000
丸大食品	2,500	1,887.00	4,717,500
S F o o d s	2,100	4,715.00	9,901,500
伊藤ハム米久ホールディングス	15,300	745.00	11,398,500
学情	1,000	1,408.00	1,408,000
スタジオアリス	1,100	2,583.00	2,841,300
シミックホールディングス	1,300	2,087.00	2,713,100
システナ	8,300	1,289.00	10,698,700
N J S	800	1,727.00	1,381,600
デジタルアーツ	1,200	6,210.00	7,452,000
新日鉄住金ソリューションズ	3,500	3,165.00	11,077,500
総合警備保障	9,000	5,250.00	47,250,000
いちご	29,800	391.00	11,651,800
日本駐車場開発	28,200	152.00	4,286,400
コア	1,100	1,365.00	1,501,500
カカクコム	17,100	1,979.00	33,840,900
アイロムグループ	900	2,224.00	2,001,600
セントケア・ホールディング	2,500	567.00	1,417,500
ルネサンス	1,300	2,287.00	2,973,100
ディップ	3,700	2,274.00	8,413,800
S B Sホールディングス	2,300	1,336.00	3,072,800
オプトホールディング	1,400	1,991.00	2,787,400
新日本科学	3,100	647.00	2,005,700
ツクイ	5,300	977.00	5,178,100
エムスリー	47,700	1,703.00	81,233,100
ツカダ・グローバルホールディング	2,400	599.00	1,437,600
アウトソーシング	11,900	1,277.00	15,196,300
ウェルネット	2,300	1,103.00	2,536,900

ワールドホールディングス	600	2,470.00	1,482,000
ディー・エヌ・エー	12,200	2,103.00	25,656,600
博報堂DYホールディングス	31,500	1,673.00	52,699,500
ぐるなび	3,200	856.00	2,739,200
エスアルジータカミヤ	2,300	646.00	1,485,800
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	1,455.00	2,619,000
ファンコミュニケーションズ	6,200	638.00	3,955,600
ライク	900	1,553.00	1,397,700
ビジネス・ブレークスルー	3,900	371.00	1,446,900
WDBホールディングス	1,000	2,687.00	2,687,000
バリューコマース	1,500	1,392.00	2,088,000
インフォマート	12,400	1,362.00	16,888,800
サッポロホールディングス	8,700	2,483.00	21,602,100
アサヒグループホールディングス	49,900	4,906.00	244,809,400
麒麟ホールディングス	107,800	2,571.00	277,153,800
宝ホールディングス	17,800	1,402.00	24,955,600
オエノンホールディングス	6,800	382.00	2,597,600
養命酒製造	700	2,376.00	1,663,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	18,200	3,350.00	60,970,000
サントリー食品インターナショナル	15,900	4,590.00	72,981,000
ダイドーグループホールディングス	1,300	6,190.00	8,047,000
伊藤園	7,900	5,330.00	42,107,000
キーコーヒー	2,300	2,091.00	4,809,300
日清オイリオグループ	3,100	3,565.00	11,051,500
不二製油グループ本社	5,800	3,385.00	19,633,000
かどや製油	300	5,880.00	1,764,000
J-オイルミルズ	1,200	3,975.00	4,770,000
ローソン	5,900	7,280.00	42,952,000
サンエー	1,800	4,620.00	8,316,000
カワチ薬品	1,800	2,194.00	3,949,200
エービーシー・マート	3,600	5,980.00	21,528,000
ハードオフコーポレーション	1,600	914.00	1,462,400
高千穂交易	1,400	1,045.00	1,463,000
アスクル	2,000	2,931.00	5,862,000
ゲオホールディングス	3,600	1,857.00	6,685,200
アダストリア	3,200	2,017.00	6,454,400
ジーフット	2,000	748.00	1,496,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	734.00	1,468,000
伊藤忠食品	600	5,040.00	3,024,000
くらコーポレーション	1,400	6,880.00	9,632,000
キャンドウ	1,100	1,682.00	1,850,200
エレマテック	1,100	2,204.00	2,424,400
パルグループホールディングス	1,200	3,100.00	3,720,000
JALUX	700	2,732.00	1,912,400
エディオン	9,900	1,187.00	11,751,300
あらた	1,300	4,490.00	5,837,000
サーラコーポレーション	4,700	650.00	3,055,000
トーメンデバイス	500	2,417.00	1,208,500
ハローズ	900	2,533.00	2,279,700
JPホールディングス	6,500	312.00	2,028,000
あみやき亭	500	4,090.00	2,045,000
東京エレクトロン デバイス	800	1,960.00	1,568,000
ひらまつ	4,700	355.00	1,668,500
フィールズ	2,000	1,030.00	2,060,000
双日	129,100	401.00	51,769,100
アルフレッサ ホールディングス	26,000	3,060.00	79,560,000
大黒天物産	600	4,350.00	2,610,000
ハニーズホールディングス	2,300	902.00	2,074,600
キッコーマン	15,700	5,950.00	93,415,000

味の素	54,800	1,886.50	103,380,200
キューピー	13,300	2,742.00	36,468,600
ハウス食品グループ本社	9,100	3,835.00	34,898,500
カゴメ	9,500	3,245.00	30,827,500
アリアケジャパン	2,200	9,960.00	21,912,000
ピエトロ	900	1,647.00	1,482,300
エバラ食品工業	700	2,183.00	1,528,100
ニチレイ	12,400	3,150.00	39,060,000
横浜冷凍	6,100	973.00	5,935,300
東洋水産	12,300	3,805.00	46,801,500
イートアンド	900	1,660.00	1,494,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,300	640.00	1,472,000
日清食品ホールディングス	10,100	6,910.00	69,791,000
永谷園ホールディングス	1,300	2,690.00	3,497,000
フジッコ	2,600	2,428.00	6,312,800
ロック・フィールド	2,600	1,664.00	4,326,400
日本たばこ産業	137,600	2,829.00	389,270,400
ケンコーマヨネーズ	1,300	2,168.00	2,818,400
わらべや日洋ホールディングス	1,600	1,915.00	3,064,000
なとり	1,300	1,850.00	2,405,000
ピックルスコーポレーション	700	2,212.00	1,548,400
北の達人コーポレーション	9,400	486.00	4,568,400
ユージェナ	9,500	686.00	6,517,000
片倉工業	2,900	1,184.00	3,433,600
グンゼ	1,700	4,355.00	7,403,500
ヒューリック	48,900	1,069.00	52,274,100
ラサ商事	1,600	916.00	1,465,600
アルペン	1,800	1,890.00	3,402,000
クオールホールディングス	3,400	2,050.00	6,970,000
アルコニックス	2,500	1,230.00	3,075,000
神戸物産	3,500	3,250.00	11,375,000
ジンズ	1,600	6,850.00	10,960,000
ビックカメラ	12,500	1,491.00	18,637,500
DCMホールディングス	12,600	1,113.00	14,023,800
ペッパーフードサービス	1,800	3,840.00	6,912,000
Monotaro	14,800	2,608.00	38,598,400
DDホールディングス	600	2,528.00	1,516,800
あいホールディングス	3,800	2,146.00	8,154,800
ディーブイエックス	1,300	1,192.00	1,549,600
きちり	1,800	833.00	1,499,400
アークランドサービスホールディングス	1,700	2,362.00	4,015,400
J.フロントリテイリング	29,900	1,607.00	48,049,300
ドトール・日レスホールディングス	4,100	2,144.00	8,790,400
マツモトキヨシホールディングス	9,700	4,105.00	39,818,500
ブロンコピリー	1,200	2,900.00	3,480,000
ZOZO	25,300	2,230.00	56,419,000
物語コーポレーション	700	10,570.00	7,399,000
ココカラファイン	2,600	6,170.00	16,042,000
三越伊勢丹ホールディングス	43,700	1,331.00	58,164,700
東洋紡	9,800	1,572.00	15,405,600
ユニチカ	6,800	539.00	3,665,200
富士紡ホールディングス	1,200	3,120.00	3,744,000
日清紡ホールディングス	13,200	1,004.00	13,252,800
倉敷紡績	2,200	2,667.00	5,867,400
ダイワボウホールディングス	2,100	6,660.00	13,986,000
シキボウ	1,300	1,129.00	1,467,700
日東紡績	3,500	2,118.00	7,413,000
トヨタ紡織	8,300	1,823.00	15,130,900
マクニカ・富士エレホールディングス	6,500	1,652.00	10,738,000
Hamee	900	1,677.00	1,509,300

ラクト・ジャパン	500	6,710.00	3,355,000
ウエルシアホールディングス	6,200	5,780.00	35,836,000
クリエイトSDホールディングス	3,400	2,998.00	10,193,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	1,202.00	5,288,800
八洲電機	1,800	804.00	1,447,200
UKCホールディングス	1,500	2,325.00	3,487,500
ジュテックホールディングス	1,400	1,055.00	1,477,000
大光	2,100	704.00	1,478,400
OCHIホールディングス	1,200	1,232.00	1,478,400
TOKAIホールディングス	12,400	940.00	11,656,000
ミサワ	3,200	463.00	1,481,600
ティーライフ	1,500	973.00	1,459,500
Cominix	1,800	832.00	1,497,600
三洋貿易	1,200	1,997.00	2,396,400
チムニー	700	2,728.00	1,909,600
シュッピン	1,600	1,014.00	1,622,400
ビューティガレージ	900	1,623.00	1,460,700
ウイン・パートナーズ	1,500	1,262.00	1,893,000
ネクステージ	3,600	1,102.00	3,967,200
ジョイフル本田	6,800	1,656.00	11,260,800
鳥貴族	800	2,085.00	1,668,000
キリン堂ホールディングス	1,000	1,562.00	1,562,000
ホットランド	1,200	1,477.00	1,772,400
すかいらくホールディングス	21,800	1,776.00	38,716,800
綿半ホールディングス	900	2,505.00	2,254,500
日本毛織	7,600	911.00	6,923,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,800	1,299.00	8,833,200
三栄建築設計	900	1,518.00	1,366,200
スター・マイカ	1,100	1,697.00	1,866,700
野村不動産ホールディングス	15,600	2,176.00	33,945,600
三重交通グループホールディングス	4,700	588.00	2,763,600
サムティ	3,200	1,622.00	5,190,400
ディア・ライフ	3,000	512.00	1,536,000
コーセーアールイー	1,700	844.00	1,434,800
日本商業開発	1,500	1,677.00	2,515,500
プレサンスコーポレーション	3,700	1,326.00	4,906,200
ユニゾホールディングス	3,500	2,372.00	8,302,000
THEグローバル社	2,300	602.00	1,384,600
日本管理センター	1,500	947.00	1,420,500
サンセイランディック	1,300	995.00	1,293,500
フージャースホールディングス	5,200	651.00	3,385,200
オープンハウス	3,800	3,680.00	13,984,000
東急不動産ホールディングス	63,000	613.00	38,619,000
飯田グループホールディングス	19,500	1,933.00	37,693,500
イーグランド	2,000	716.00	1,432,000
帝国繊維	2,600	2,362.00	6,141,200
日本コークス工業	20,000	103.00	2,060,000
あさひ	1,900	1,418.00	2,694,200
日本調剤	800	3,435.00	2,748,000
コスモス薬品	1,200	21,610.00	25,932,000
シップヘルスケアホールディングス	4,900	4,290.00	21,021,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,000	1,689.00	1,689,000
オンリー	900	1,169.00	1,052,100
セブン&アイ・ホールディングス	98,000	4,973.00	487,354,000
薬王堂	1,000	3,275.00	3,275,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,300	1,242.00	7,824,600
明治電機工業	700	2,207.00	1,544,900

ツルハホールディングス	5,100	11,280.00	57,528,000
サンマルクホールディングス	1,800	2,700.00	4,860,000
フェリシモ	1,200	1,232.00	1,478,400
トリドールホールディングス	2,900	1,935.00	5,611,500
帝人	19,000	1,925.00	36,575,000
東レ	180,300	916.40	165,226,920
クラレ	39,200	1,787.00	70,050,400
旭化成	165,400	1,209.00	199,968,600
サカイオーベックス	600	2,416.00	1,449,600
稲葉製作所	1,300	1,374.00	1,786,200
宮地エンジニアリンググループ	700	2,104.00	1,472,800
トーカロ	6,100	929.00	5,666,900
アルファ	1,000	1,393.00	1,393,000
SUMCO	25,900	1,529.00	39,601,100
川田テクノロジーズ	500	7,500.00	3,750,000
RS Technologies	500	4,565.00	2,282,500
ハウズドゥ	1,300	1,125.00	1,462,500
シーアールイー	1,500	1,023.00	1,534,500
ケイアイスター不動産	800	1,811.00	1,448,800
住江織物	600	2,632.00	1,579,200
日本フェルト	3,100	472.00	1,463,200
イチカワ	900	1,539.00	1,385,100
芦森工業	200	1,631.00	326,200
アツギ	1,900	1,019.00	1,936,100
ジャパンミート	900	2,100.00	1,890,000
コメダホールディングス	5,400	2,297.00	12,403,800
サツドラホールディングス	700	1,961.00	1,372,700
パロックジャパンリミテッド	1,900	1,058.00	2,010,200
クスリのアオキホールディングス	1,900	8,210.00	15,599,000
共和レザー	1,700	856.00	1,455,200
スシローグローバルホールディングス	2,600	6,280.00	16,328,000
LIXILビバ	2,000	1,771.00	3,542,000
セーレン	5,700	1,787.00	10,185,900
ソトー	1,500	975.00	1,462,500
東海染工	800	1,122.00	897,600
小松マテーレ	3,800	894.00	3,397,200
ワコールホールディングス	6,800	3,025.00	20,570,000
ホギメディカル	2,900	3,280.00	9,512,000
クラウドシアホールディングス	3,000	518.00	1,554,000
TSIホールディングス	8,600	783.00	6,733,800
マツオカコーポレーション	700	3,070.00	2,149,000
ワールド	2,400	2,020.00	4,848,000
TIS	7,800	5,050.00	39,390,000
電算システム	900	2,258.00	2,032,200
グリー	12,500	480.00	6,000,000
コーエーテクモホールディングス	4,800	1,683.00	8,078,400
三菱総合研究所	900	3,785.00	3,406,500
ボルテージ	2,300	672.00	1,545,600
電算	700	2,096.00	1,467,200
AGS	1,600	760.00	1,216,000
ファインデックス	2,200	662.00	1,456,400
ヒト・コミュニケーションズ	700	1,970.00	1,379,000
ブレインパッド	500	6,950.00	3,475,000
KLab	4,200	986.00	4,141,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	2,273.00	3,409,500
ネクソン	59,300	1,098.00	65,111,400
アイスタイル	5,900	1,011.00	5,964,900
エムアップ	800	2,695.00	2,156,000
エイチーム	1,500	1,664.00	2,496,000

テクノスジャパン	2,000	1,013.00	2,026,000
コロプラ	6,600	798.00	5,266,800
ブロードリーフ	11,500	602.00	6,923,000
デジタルハーツホールディングス	1,100	1,622.00	1,784,200
メディアドゥホールディングス	700	2,551.00	1,785,700
じげん	2,500	651.00	1,627,500
サイバーリンクス	1,400	1,016.00	1,422,400
フィックスターズ	2,200	1,318.00	2,899,600
VOYAGE GROUP	1,200	1,242.00	1,490,400
オプティム	500	4,525.00	2,262,500
セレス	800	2,090.00	1,672,000
特種東海製紙	1,500	4,130.00	6,195,000
ティーガイア	2,300	2,307.00	5,306,100
セック	400	4,395.00	1,758,000
豆蔵ホールディングス	1,600	948.00	1,516,800
テクマトリックス	1,600	1,667.00	2,667,200
プロシップ	600	2,507.00	1,504,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	56,100	238.00	13,351,800
GMOペイメントゲートウェイ	3,800	5,530.00	21,014,000
ザッパラス	3,900	376.00	1,466,400
インターネットイニシアティブ	3,800	2,388.00	9,074,400
さくらインターネット	2,800	554.00	1,551,200
GMOクラウド	500	3,560.00	1,780,000
SRAホールディングス	1,200	2,753.00	3,303,600
MINORIソリューションズ	1,000	1,482.00	1,482,000
朝日ネット	2,900	506.00	1,467,400
アドソル日進	800	1,912.00	1,529,600
フリービット	1,700	856.00	1,455,200
コムチュア	1,300	3,090.00	4,017,000
サイバーコム	900	1,622.00	1,459,800
王子ホールディングス	104,600	666.00	69,663,600
日本製紙	11,100	2,059.00	22,854,900
三菱製紙	3,800	562.00	2,135,600
北越コーポレーション	15,400	553.00	8,516,200
中越パルプ工業	1,000	1,661.00	1,661,000
大王製紙	11,300	1,333.00	15,062,900
阿波製紙	1,900	568.00	1,079,200
メディカル・データ・ピジョン	2,100	1,041.00	2,186,100
gumi	2,700	612.00	1,652,400
モバイルファクトリー	1,100	1,317.00	1,448,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,526.00	1,526,000
PCIホールディングス	600	2,645.00	1,587,000
パイプドHD	1,500	1,000.00	1,500,000
ランドコンピュータ	1,400	1,006.00	1,408,400
オープンドア	1,200	2,888.00	3,465,600
アカツキ	800	5,510.00	4,408,000
LINE	7,100	3,165.00	22,471,500
レンゴー	24,000	918.00	22,032,000
トーモク	1,400	1,840.00	2,576,000
ザ・バック	1,800	3,205.00	5,769,000
シンクロ・フード	2,600	611.00	1,588,600
オークネット	1,300	1,050.00	1,365,000
AOI TYO HOLDINGS	2,500	1,047.00	2,617,500
マクロミル	2,900	1,746.00	5,063,400
ビーグリー	1,100	1,021.00	1,123,100
昭和電工	15,400	4,350.00	66,990,000
住友化学	183,000	589.00	107,787,000
住友精化	1,100	4,795.00	5,274,500

日産化学	14,300	5,890.00	84,227,000
ラサ工業	900	1,579.00	1,421,100
クレハ	2,100	7,320.00	15,372,000
多木化学	300	7,770.00	2,331,000
テイカ	1,900	1,969.00	3,741,100
石原産業	4,500	1,253.00	5,638,500
片倉コープアグリ	1,300	1,175.00	1,527,500
日東エフシー	1,900	782.00	1,485,800
日本曹達	3,700	2,685.00	9,934,500
東ソー	35,900	1,610.00	57,799,000
トクヤマ	6,700	2,697.00	18,069,900
セントラル硝子	5,100	2,619.00	13,356,900
東亜合成	14,600	1,220.00	17,812,000
大阪ソーダ	2,500	2,674.00	6,685,000
関東電化工業	5,500	938.00	5,159,000
デンカ	9,100	3,415.00	31,076,500
イビデン	14,500	1,661.00	24,084,500
信越化学工業	41,000	9,685.00	397,085,000
日本カーバイド工業	800	1,866.00	1,492,800
堺化学工業	1,500	2,708.00	4,062,000
第一稀元素化学工業	1,900	983.00	1,867,700
エア・ウォーター	19,000	1,808.00	34,352,000
大陽日酸	19,100	1,856.00	35,449,600
日本化学工業	800	2,641.00	2,112,800
日本パーカライジング	12,700	1,466.00	18,618,200
高圧ガス工業	3,700	872.00	3,226,400
四国化成工業	3,900	1,186.00	4,625,400
戸田工業	600	2,411.00	1,446,600
ステラ ケミファ	1,400	3,175.00	4,445,000
保土谷化学工業	800	2,540.00	2,032,000
日本触媒	3,900	6,970.00	27,183,000
大日精化工業	1,900	3,340.00	6,346,000
カネカ	6,200	4,190.00	25,978,000
協和発酵キリン	29,700	2,244.00	66,646,800
三菱瓦斯化学	23,900	1,834.00	43,832,600
三井化学	21,100	2,919.00	61,590,900
J S R	23,300	1,723.00	40,145,900
東京応化工業	4,000	3,405.00	13,620,000
大阪有機化学工業	2,100	1,422.00	2,986,200
三菱ケミカルホールディングス	155,400	914.10	142,051,140
K Hネオケム	3,500	3,335.00	11,672,500
ダイセル	36,100	1,289.00	46,532,900
住友ベークライト	4,000	3,850.00	15,400,000
積水化学工業	50,800	1,865.00	94,742,000
日本ゼオン	21,000	1,100.00	23,100,000
アイカ工業	7,000	3,460.00	24,220,000
宇部興産	11,700	2,575.00	30,127,500
積水樹脂	3,800	2,066.00	7,850,800
タキロンシーアイ	5,000	578.00	2,890,000
旭有機材	1,600	1,803.00	2,884,800
日立化成	10,700	1,760.00	18,832,000
ニチバン	1,200	2,132.00	2,558,400
リケンテクノス	6,300	504.00	3,175,200
大倉工業	1,200	2,022.00	2,426,400
積水化成成品工業	3,500	953.00	3,335,500
群栄化学工業	600	3,165.00	1,899,000
タイガースポリマー	2,200	673.00	1,480,600
ミライアル	1,500	943.00	1,414,500
ダイキョーニシカワ	4,900	989.00	4,846,100
竹本容器	500	2,670.00	1,335,000

森六ホールディングス	1,200	2,906.00	3,487,200
日本化薬	14,800	1,439.00	21,297,200
カーリットホールディングス	2,500	872.00	2,180,000
E P Sホールディングス	3,400	1,999.00	6,796,600
プレステージ・インターナショナル	4,200	1,250.00	5,250,000
アミューズ	1,400	2,692.00	3,768,800
野村総合研究所	14,800	4,905.00	72,594,000
ドリームインキュベータ	800	1,806.00	1,444,800
サイバネットシステム	2,200	657.00	1,445,400
クイック	1,400	1,450.00	2,030,000
T A C	5,900	249.00	1,469,100
C Eホールディングス	2,000	723.00	1,446,000
ケネディクス	21,200	525.00	11,130,000
日本システム技術	700	1,964.00	1,374,800
電通	27,600	5,010.00	138,276,000
インテージホールディングス	3,000	985.00	2,955,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	1,909.00	1,718,100
東邦システムサイエンス	1,600	893.00	1,428,800
ぴあ	600	5,130.00	3,078,000
イオンファンタジー	700	3,050.00	2,135,000
ソースネクスト	4,500	1,224.00	5,508,000
シーティーエス	2,600	684.00	1,778,400
ネクシィーズグループ	800	1,591.00	1,272,800
メディカルシステムネットワーク	3,200	440.00	1,408,000
日本精化	1,900	1,049.00	1,993,100
扶桑化学工業	2,400	2,280.00	5,472,000
トリケミカル研究所	500	4,335.00	2,167,500
F I G	3,300	381.00	1,257,300
A D E K A	11,500	1,695.00	19,492,500
日油	9,000	3,750.00	33,750,000
ミヨシ油脂	1,200	1,234.00	1,480,800
新日本理化	7,700	181.00	1,393,700
ハリマ化成グループ	1,900	1,024.00	1,945,600
花王	57,600	7,988.00	460,108,800
第一工業製薬	900	2,542.00	2,287,800
ニイタカ	800	1,786.00	1,428,800
三洋化成工業	1,600	5,510.00	8,816,000
武田薬品工業	93,700	4,476.00	419,401,200
アステラス製薬	218,800	1,661.00	363,426,800
大日本住友製薬	17,600	2,882.00	50,723,200
塩野義製薬	31,100	7,582.00	235,800,200
田辺三菱製薬	24,800	1,665.00	41,292,000
わかもと製薬	5,000	294.00	1,470,000
あすか製薬	2,900	1,205.00	3,494,500
日本新薬	6,200	7,390.00	45,818,000
中外製薬	24,700	7,130.00	176,111,000
科研製薬	4,300	5,490.00	23,607,000
エーザイ	28,400	9,846.00	279,626,400
理研ビタミン	1,100	3,550.00	3,905,000
ロート製薬	12,200	3,440.00	41,968,000
小野薬品工業	56,100	2,654.00	148,889,400
久光製薬	7,000	7,030.00	49,210,000
有機合成薬品工業	5,800	248.00	1,438,400
持田製薬	1,800	9,750.00	17,550,000
参天製薬	45,000	1,802.00	81,090,000
扶桑薬品工業	800	2,887.00	2,309,600
日本ケミファ	400	4,085.00	1,634,000
ツムラ	7,400	3,495.00	25,863,000
日医工	5,800	1,720.00	9,976,000
テルモ	33,600	6,254.00	210,134,400

みらかホールディングス	6,300	2,675.00	16,852,500
キッセイ薬品工業	4,200	3,295.00	13,839,000
生化学工業	4,600	1,572.00	7,231,200
栄研化学	4,200	2,458.00	10,323,600
日水製薬	1,200	1,200.00	1,440,000
鳥居薬品	1,300	2,332.00	3,031,600
J C Rファーマ	1,700	5,300.00	9,010,000
東和薬品	1,100	8,400.00	9,240,000
富士製薬工業	1,600	1,842.00	2,947,200
沢井製薬	4,900	5,670.00	27,783,000
ゼリア新薬工業	4,700	2,102.00	9,879,400
第一三共	67,900	4,043.00	274,519,700
キョーリン製薬ホールディングス	6,100	2,666.00	16,262,600
大幸薬品	1,100	2,012.00	2,213,200
ダイト	1,400	3,465.00	4,851,000
大塚ホールディングス	45,200	5,064.00	228,892,800
大正製薬ホールディングス	5,300	12,150.00	64,395,000
ペプチドリーム	10,900	4,415.00	48,123,500
大日本塗料	2,600	1,111.00	2,888,600
日本ペイントホールディングス	19,200	3,670.00	70,464,000
関西ペイント	26,100	1,871.00	48,833,100
中国塗料	7,600	957.00	7,273,200
日本特殊塗料	1,700	1,729.00	2,939,300
藤倉化成	3,100	632.00	1,959,200
太陽ホールディングス	1,900	3,705.00	7,039,500
D I C	10,500	3,520.00	36,960,000
サカタインクス	5,100	1,254.00	6,395,400
東洋インキS Cホールディングス	4,900	2,628.00	12,877,200
T & K T O K A	1,800	1,116.00	2,008,800
アルプス技研	2,000	2,004.00	4,008,000
日本空調サービス	2,600	775.00	2,015,000
オリエンタルランド	26,800	10,960.00	293,728,000
フォーカスシステムズ	1,600	1,110.00	1,776,000
ダスキン	6,100	2,510.00	15,311,000
パーク24	13,700	2,960.00	40,552,000
明光ネットワークジャパン	2,900	1,023.00	2,966,700
ファルコホールディングス	1,200	1,636.00	1,963,200
クレスコ	700	3,445.00	2,411,500
フジ・メディア・ホールディングス	24,200	1,703.00	41,212,600
秀英予備校	3,000	484.00	1,452,000
ラウンドワン	7,000	1,210.00	8,470,000
リゾートトラスト	9,600	1,801.00	17,289,600
オービック	8,100	9,430.00	76,383,000
ジャストシステム	3,300	2,241.00	7,395,300
T D Cソフト	2,000	966.00	1,932,000
ヤフー	151,800	306.00	46,450,800
ビー・エム・エル	2,900	2,693.00	7,809,700
トレンドマイクロ	12,400	6,180.00	76,632,000
りらいあコミュニケーションズ	4,100	1,024.00	4,198,400
インフォメーション・ディベロプメント	1,000	1,485.00	1,485,000
リソー教育	3,800	1,166.00	4,430,800
日本オラクル	3,800	7,180.00	27,284,000
アルファシステムズ	800	2,610.00	2,088,000
フューチャー	3,200	1,584.00	5,068,800
C A C Holdings	1,700	1,034.00	1,757,800
ソフトバンク・テクノロジー	1,000	1,966.00	1,966,000
トーセ	1,600	913.00	1,460,800
ユー・エス・エス	27,700	1,836.00	50,857,200
オービックビジネスコンサルタント	1,200	9,250.00	11,100,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,600	2,007.00	21,274,200

アイティフォー	2,800	770.00	2,156,000
東計電算	400	3,370.00	1,348,000
サイバーエージェント	14,000	4,690.00	65,660,000
楽天	105,700	916.00	96,821,200
エックスネット	1,600	906.00	1,449,600
クリーク・アンド・リバー社	1,400	1,060.00	1,484,000
テー・オー・ダブリュー	2,200	882.00	1,940,400
大塚商会	12,600	3,740.00	47,124,000
サイボウズ	2,700	639.00	1,725,300
セントラルスポーツ	800	3,610.00	2,888,000
パラカ	800	1,881.00	1,504,800
電通国際情報サービス	1,400	3,795.00	5,313,000
デジタルガレージ	4,500	2,926.00	13,167,000
イーエムシステムズ	1,900	1,095.00	2,080,500
ウェザーニューズ	800	3,370.00	2,696,000
C I J	2,000	741.00	1,482,000
東洋ビジネスエンジニアリング	700	2,160.00	1,512,000
日本エンタープライズ	6,500	228.00	1,482,000
WOWOW	1,100	3,175.00	3,492,500
スカラ	1,900	794.00	1,508,600
フルキャストホールディングス	2,300	2,116.00	4,866,800
エン・ジャパン	2,500	4,015.00	10,037,500
富士フイルムホールディングス	49,300	4,453.00	219,532,900
コニカミノルタ	51,900	1,038.00	53,872,200
資生堂	47,200	7,269.00	343,096,800
ライオン	33,100	2,045.00	67,689,500
高砂香料工業	1,600	3,690.00	5,904,000
マンダム	5,300	3,170.00	16,801,000
ミルボン	2,900	4,280.00	12,412,000
ファンケル	5,300	5,640.00	29,892,000
コーセー	4,000	18,200.00	72,800,000
コタ	1,100	1,514.00	1,665,400
シーズ・ホールディングス	2,900	5,860.00	16,994,000
シーボン	500	2,645.00	1,322,500
ポーラ・オルビスホールディングス	10,100	3,165.00	31,966,500
ノエビアホールディングス	1,600	5,320.00	8,512,000
アジュバンコスメジャパン	1,500	1,017.00	1,525,500
エステー	1,700	2,115.00	3,595,500
アグロ カネショウ	1,000	2,356.00	2,356,000
コニシ	4,200	1,717.00	7,211,400
長谷川香料	2,800	1,565.00	4,382,000
星光PMC	1,600	893.00	1,428,800
小林製薬	6,700	7,330.00	49,111,000
荒川化学工業	2,100	1,511.00	3,173,100
メック	1,600	1,249.00	1,998,400
日本高純度化学	700	2,344.00	1,640,800
タカラバイオ	6,200	2,494.00	15,462,800
JCU	3,100	1,881.00	5,831,100
新田ゼラチン	2,000	741.00	1,482,000
デクセリアルズ	6,100	983.00	5,996,300
アース製薬	1,800	5,440.00	9,792,000
北興化学工業	2,500	570.00	1,425,000
大成ラミック	800	3,045.00	2,436,000
クミアイ化学工業	9,800	694.00	6,801,200
日本農薬	5,700	567.00	3,231,900
昭和シェル石油	22,200	1,752.00	38,894,400
富士興産	2,400	615.00	1,476,000
ニチレキ	3,000	1,064.00	3,192,000
ユシロ化学工業	1,200	1,359.00	1,630,800
ビーピー・カストロール	800	1,453.00	1,162,400

富士石油	5,800	340.00	1,972,000
MORESCO	900	1,659.00	1,493,100
出光興産	18,400	4,070.00	74,888,000
JXTGホールディングス	404,000	670.80	271,003,200
コスモエネルギーホールディングス	6,900	2,801.00	19,326,900
横浜ゴム	13,700	2,358.00	32,304,600
東洋ゴム工業	12,200	1,740.00	21,228,000
ブリヂストン	73,000	4,361.00	318,353,000
住友ゴム工業	21,300	1,552.00	33,057,600
藤倉ゴム工業	2,800	507.00	1,419,600
オカモト	1,700	5,760.00	9,792,000
アキレス	1,700	2,237.00	3,802,900
フコク	200	905.00	181,000
ニッタ	2,700	3,875.00	10,462,500
クリエートメディック	1,300	1,095.00	1,423,500
住友理工	4,600	1,064.00	4,894,400
三ツ星ベルト	3,100	2,400.00	7,440,000
バンドー化学	4,500	1,192.00	5,364,000
AGC	23,900	3,835.00	91,656,500
日本板硝子	11,300	948.00	10,712,400
石塚硝子	700	2,132.00	1,492,400
有沢製作所	3,700	800.00	2,960,000
日本山村硝子	1,000	1,708.00	1,708,000
日本電気硝子	10,300	2,925.00	30,127,500
オハラ	900	2,284.00	2,055,600
住友大阪セメント	4,800	4,865.00	23,352,000
太平洋セメント	15,000	3,820.00	57,300,000
リソルホールディングス	400	4,025.00	1,610,000
日本ヒューム	2,400	904.00	2,169,600
日本コンクリート工業	5,100	305.00	1,555,500
三谷セキサン	1,100	2,800.00	3,080,000
アジアパイルホールディングス	3,400	653.00	2,220,200
東海カーボン	21,500	1,579.00	33,948,500
日本カーボン	1,100	5,490.00	6,039,000
東洋炭素	1,400	2,721.00	3,809,400
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	5,580.00	7,812,000
TOTO	18,300	4,355.00	79,696,500
日本碍子	29,000	1,657.00	48,053,000
日本特殊陶業	20,000	2,400.00	48,000,000
MARUWA	800	5,740.00	4,592,000
品川リフラクトリーズ	600	4,190.00	2,514,000
黒崎播磨	500	6,530.00	3,265,000
ヨータイ	2,100	673.00	1,413,300
東京窯業	3,500	439.00	1,536,500
ニッカトー	1,500	961.00	1,441,500
フジインコーポレーテッド	2,100	2,393.00	5,025,300
エーアンドエーマテリアル	900	1,104.00	993,600
ニチアス	6,500	2,228.00	14,482,000
新日鐵住金	105,000	2,132.50	223,912,500
神戸製鋼所	43,000	940.00	40,420,000
中山製鋼所	3,300	576.00	1,900,800
合同製鐵	1,100	1,941.00	2,135,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	63,400	2,082.00	131,998,800
日新製鋼	5,700	1,511.00	8,612,700
東京製鐵	12,600	992.00	12,499,200
共英製鋼	2,600	2,401.00	6,242,600
大和工業	5,000	2,890.00	14,450,000
東京鐵鋼	1,000	1,328.00	1,328,000
大阪製鐵	1,600	2,056.00	3,289,600
淀川製鋼所	3,200	2,376.00	7,603,200

丸一鋼管	8,300	3,295.00	27,348,500
モリ工業	700	2,640.00	1,848,000
大同特殊鋼	3,800	4,510.00	17,138,000
日本高周波鋼業	2,100	697.00	1,463,700
日本冶金工業	19,400	282.00	5,470,800
山陽特殊製鋼	3,000	2,618.00	7,854,000
愛知製鋼	1,300	3,920.00	5,096,000
日立金属	25,300	1,297.00	32,814,100
日本金属	900	1,369.00	1,232,100
大平洋金属	1,600	3,215.00	5,144,000
新日本電工	14,100	258.00	3,637,800
栗本鐵工所	1,200	1,625.00	1,950,000
日本製鋼所	7,100	2,095.00	14,874,500
三菱製鋼	1,700	1,911.00	3,248,700
日亜鋼業	4,600	330.00	1,518,000
日本精線	400	3,285.00	1,314,000
大紀アルミニウム工業所	3,900	670.00	2,613,000
日本軽金属ホールディングス	64,000	242.00	15,488,000
三井金属鉱業	6,300	2,401.00	15,126,300
東邦亜鉛	1,300	3,885.00	5,050,500
三菱マテリアル	15,500	3,055.00	47,352,500
住友金属鉱山	32,100	3,172.00	101,821,200
DOWAホールディングス	5,500	3,600.00	19,800,000
古河機械金属	3,900	1,413.00	5,510,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,700	1,881.00	5,078,700
東邦チタニウム	4,200	1,303.00	5,472,600
UACJ	3,600	2,256.00	8,121,600
CKサンエツ	100	2,871.00	287,100
古河電気工業	6,800	3,205.00	21,794,000
住友電気工業	87,800	1,573.00	138,109,400
フジクラ	28,300	465.00	13,159,500
昭和電線ホールディングス	2,700	656.00	1,771,200
東京特殊電線	700	1,972.00	1,380,400
タツタ電線	4,700	517.00	2,429,900
カナレ電気	700	2,018.00	1,412,600
平河ヒューテック	1,100	1,240.00	1,364,000
リョービ	2,900	3,035.00	8,801,500
アーレスティ	2,900	681.00	1,974,900
アサヒホールディングス	4,400	2,329.00	10,247,600
東洋製罐グループホールディングス	14,900	2,475.00	36,877,500
ホッカンホールディングス	1,200	1,613.00	1,935,600
コロナ	1,300	1,120.00	1,456,000
横河ブリッジホールディングス	4,400	1,760.00	7,744,000
OSJBホールディングス	11,700	301.00	3,521,700
三和ホールディングス	24,200	1,340.00	32,428,000
文化シャッター	6,900	753.00	5,195,700
三協立山	3,300	1,286.00	4,243,800
アルインコ	1,900	1,050.00	1,995,000
LIXILグループ	34,600	1,448.00	50,100,800
日本フィルコン	2,400	602.00	1,444,800
ノーリツ	5,200	1,710.00	8,892,000
長府製作所	2,400	2,354.00	5,649,600
リンナイ	4,200	8,440.00	35,448,000
ユニプレス	4,600	2,023.00	9,305,800
ダイニチ工業	2,000	735.00	1,470,000
日東精工	3,200	628.00	2,009,600
岡部	4,800	964.00	4,627,200
ジーテクト	2,600	1,598.00	4,154,800
東プレ	4,400	2,277.00	10,018,800
高周波熱錬	4,500	955.00	4,297,500

東京製綱	1,400	1,083.00	1,516,200
サンコール	2,000	775.00	1,550,000
モリテックスチール	3,200	453.00	1,449,600
パイオラックス	3,800	2,615.00	9,937,000
エイチワン	2,300	1,047.00	2,408,100
日本発条	23,400	987.00	23,095,800
アドバネクス	900	1,546.00	1,391,400
三浦工業	10,200	2,768.00	28,233,600
タクマ	8,600	1,516.00	13,037,600
テクノプロ・ホールディングス	4,300	5,160.00	22,188,000
インターワークス	1,900	740.00	1,406,000
Keeper 技研	1,300	1,111.00	1,444,300
Gunosy	1,400	2,860.00	4,004,000
イー・ガーディアン	1,100	2,479.00	2,726,900
リブセンス	4,200	324.00	1,360,800
ジャパンマテリアル	6,200	1,091.00	6,764,200
ベクトル	2,800	1,766.00	4,944,800
ウチヤマホールディングス	3,000	480.00	1,440,000
キャリアリンク	3,500	415.00	1,452,500
I B J	2,300	738.00	1,697,400
アサンテ	900	2,185.00	1,966,500
N・フィールド	1,500	1,230.00	1,845,000
M&Aキャピタルパートナーズ	600	4,255.00	2,553,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,100	1,650.00	1,815,000
E R Iホールディングス	1,600	909.00	1,454,400
アピスト	400	3,575.00	1,430,000
シグマクシス	1,400	1,049.00	1,468,600
ウィルグループ	1,500	1,095.00	1,642,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,100	441.00	1,367,100
日本ビューホテル	1,200	1,186.00	1,423,200
リクルートホールディングス	162,500	2,884.00	468,650,000
エラン	800	3,335.00	2,668,000
ツガミ	5,300	818.00	4,335,400
オークマ	3,000	5,350.00	16,050,000
東芝機械	2,700	1,912.00	5,162,400
アマダホールディングス	36,200	1,130.00	40,906,000
アイダエンジニアリング	6,500	897.00	5,830,500
滝澤鉄工所	900	1,565.00	1,408,500
F U J I	7,000	1,441.00	10,087,000
牧野フライス製作所	2,800	4,390.00	12,292,000
オーエスジー	11,600	2,148.00	24,916,800
旭ダイヤモンド工業	6,200	718.00	4,451,600
D M G 森精機	14,800	1,435.00	21,238,000
ソディック	5,100	807.00	4,115,700
ディスコ	3,200	16,320.00	52,224,000
日東工器	1,300	2,541.00	3,303,300
日進工具	700	2,422.00	1,695,400
パンチ工業	2,400	565.00	1,356,000
日本郵政	185,900	1,391.00	258,586,900
ベルシステム24ホールディングス	3,800	1,470.00	5,586,000
鎌倉新書	1,600	996.00	1,593,600
一蔵	2,000	709.00	1,418,000
エポラブルアジア	700	2,094.00	1,465,800
ストライク	600	2,782.00	1,669,200
ソラスト	5,500	1,303.00	7,166,500
セラク	2,000	715.00	1,430,000
インソース	700	2,505.00	1,753,500
豊田自動織機	19,200	5,730.00	110,016,000
豊和工業	1,700	826.00	1,404,200

OKK	1,400	928.00	1,299,200
石川製作所	1,000	1,404.00	1,404,000
東洋機械金属	2,400	585.00	1,404,000
島精機製作所	3,200	3,270.00	10,464,000
オプトラ	2,300	2,196.00	5,050,800
NCホールディングス	2,500	564.00	1,410,000
フリー	1,900	973.00	1,848,700
ヤマシンフィルタ	4,100	887.00	3,636,700
日阪製作所	2,900	950.00	2,755,000
やまびこ	4,600	1,190.00	5,474,000
平田機工	1,100	5,690.00	6,259,000
ペガサスミシン製造	2,200	825.00	1,815,000
ナブテスコ	12,900	2,812.00	36,274,800
三井海洋開発	2,500	2,799.00	6,997,500
レオン自動機	2,300	1,705.00	3,921,500
S M C	7,000	37,550.00	262,850,000
新川	3,000	481.00	1,443,000
ホソカワミクロン	800	4,955.00	3,964,000
ユニオンツール	1,000	3,550.00	3,550,000
オイレス工業	3,300	1,949.00	6,431,700
日精エー・エス・ピー機械	700	3,675.00	2,572,500
サトーホールディングス	2,800	2,957.00	8,279,600
技研製作所	1,600	3,840.00	6,144,000
日本エアテック	2,000	708.00	1,416,000
カワタ	900	1,703.00	1,532,700
日精樹脂工業	2,000	1,022.00	2,044,000
小松製作所	107,500	2,894.50	311,158,750
住友重機械工業	13,600	3,610.00	49,096,000
日立建機	9,500	3,015.00	28,642,500
日工	600	2,452.00	1,471,200
巴工業	1,000	2,370.00	2,370,000
井関農機	2,400	1,699.00	4,077,600
T O W A	2,000	727.00	1,454,000
丸山製作所	900	1,595.00	1,435,500
北川鉄工所	1,100	2,535.00	2,788,500
シンニッタン	4,000	444.00	1,776,000
ローツェ	1,000	1,701.00	1,701,000
タカキタ	2,200	644.00	1,416,800
クボタ	127,300	1,889.50	240,533,350
荏原実業	800	1,872.00	1,497,600
東洋エンジニアリング	3,100	785.00	2,433,500
三菱化工機	900	1,715.00	1,543,500
月島機械	4,700	1,268.00	5,959,600
帝国電機製作所	1,700	1,671.00	2,840,700
新東工業	5,600	899.00	5,034,400
澁谷工業	2,100	3,985.00	8,368,500
アイチコーポレーション	4,100	649.00	2,660,900
小森コーポレーション	6,400	1,197.00	7,660,800
鶴見製作所	1,800	1,961.00	3,529,800
荏原製作所	10,500	2,861.00	30,040,500
石井鐵工所	800	1,884.00	1,507,200
西島製作所	2,400	997.00	2,392,800
北越工業	2,400	1,203.00	2,887,200
千代田化工建設	19,200	319.00	6,124,800
ダイキン工業	32,400	11,510.00	372,924,000
オルガノ	900	3,005.00	2,704,500
トーヨーカネツ	900	2,376.00	2,138,400
栗田工業	12,800	2,906.00	37,196,800
椿本チエイン	3,100	4,170.00	12,927,000
日機装	7,100	1,095.00	7,774,500

木村化工機	1,100	449.00	493,900
新興プランテック	4,800	1,050.00	5,040,000
アネスト岩田	3,700	1,177.00	4,354,900
ダイフク	13,100	5,450.00	71,395,000
サムコ	1,300	1,152.00	1,497,600
加藤製作所	1,200	2,782.00	3,338,400
油研工業	700	2,048.00	1,433,600
タダノ	11,500	1,312.00	15,088,000
フジテック	8,600	1,369.00	11,773,400
C K D	6,600	1,004.00	6,626,400
キトー	1,800	1,910.00	3,438,000
平和	6,600	2,395.00	15,807,000
理想科学工業	2,100	1,912.00	4,015,200
S A N K Y O	5,900	4,450.00	26,255,000
日本金銭機械	2,600	1,060.00	2,756,000
マースグループホールディングス	1,500	2,324.00	3,486,000
福島工業	1,500	4,445.00	6,667,500
ダイコク電機	1,100	1,518.00	1,669,800
竹内製作所	4,000	2,161.00	8,644,000
アマノ	6,800	2,464.00	16,755,200
J U K I	3,300	1,506.00	4,969,800
サンデンホールディングス	2,900	867.00	2,514,300
蛇の目マシン工業	2,600	542.00	1,409,200
ブラザー工業	30,900	1,883.00	58,184,700
マックス	3,600	1,440.00	5,184,000
モリタホールディングス	4,100	2,122.00	8,700,200
グローリー	6,600	2,925.00	19,305,000
新晃工業	2,200	1,571.00	3,456,200
大和冷機工業	3,400	1,324.00	4,501,600
セガサミーホールディングス	23,500	1,637.00	38,469,500
日本ピストンリング	900	2,074.00	1,866,600
リケン	1,100	5,170.00	5,687,000
T P R	3,200	2,703.00	8,649,600
ツバキ・ナカシマ	3,600	1,824.00	6,566,400
ホシザキ	6,900	8,200.00	56,580,000
大豊工業	1,900	1,053.00	2,000,700
日本精工	48,700	1,051.00	51,183,700
N T N	51,000	380.00	19,380,000
ジェイテクト	22,800	1,371.00	31,258,800
不二越	2,200	4,635.00	10,197,000
ミネベアミツミ	44,100	1,633.00	72,015,300
日本トムソン	7,000	612.00	4,284,000
T H K	14,800	2,455.00	36,334,000
ユーシン精機	1,800	1,182.00	2,127,600
前澤給装工業	900	1,858.00	1,672,200
イーグル工業	2,900	1,459.00	4,231,100
日本ピラー工業	2,400	1,499.00	3,597,600
キッツ	9,600	947.00	9,091,200
日立製作所	106,900	3,220.00	344,218,000
三菱電機	237,300	1,458.50	346,102,050
富士電機	15,400	3,300.00	50,820,000
東洋電機製造	1,000	1,512.00	1,512,000
安川電機	27,500	3,230.00	88,825,000
シンフォニア テクノロジー	3,300	1,556.00	5,134,800
明電舎	4,700	1,520.00	7,144,000
山洋電気	1,100	4,085.00	4,493,500
デンヨー	2,200	1,563.00	3,438,600
M S - J a p a n	1,000	1,308.00	1,308,000
グレイステクノロジー	700	2,374.00	1,661,800

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,300	2,044.00	2,657,200
フルテック	1,300	1,103.00	1,433,900
日総工産	700	1,701.00	1,190,700
キュービーネットホールディングス	1,200	2,267.00	2,720,400
三櫻工業	3,000	625.00	1,875,000
マキタ	28,900	4,380.00	126,582,000
東芝テック	3,000	3,090.00	9,270,000
芝浦メカトロニクス	400	3,965.00	1,586,000
マブチモーター	6,600	3,815.00	25,179,000
日本電産	28,600	13,855.00	396,253,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,300	2,382.00	3,096,600
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,417.00	1,417,000
東光高岳	1,200	1,591.00	1,909,200
ダブル・スコープ	3,500	1,206.00	4,221,000
ダイヘン	2,600	2,558.00	6,650,800
ヤーマン	3,400	1,919.00	6,524,600
JVCケンウッド	17,400	284.00	4,941,600
ミマキエンジニアリング	2,100	835.00	1,753,500
第一精工	1,100	1,256.00	1,381,600
日新電機	5,600	932.00	5,219,200
大崎電気工業	4,700	757.00	3,557,900
オムロン	25,200	4,630.00	116,676,000
日東工業	3,800	1,845.00	7,011,000
I D E C	3,200	2,310.00	7,392,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	8,500	2,501.00	21,258,500
メルコホールディングス	1,000	3,810.00	3,810,000
日本電気	30,700	3,365.00	103,305,500
富士通	22,900	6,910.00	158,239,000
沖電気工業	10,300	1,544.00	15,903,200
電気興業	1,200	2,759.00	3,310,800
サンケン電気	2,800	2,437.00	6,823,600
アイホン	1,300	1,633.00	2,122,900
ルネサスエレクトロニクス	24,600	545.00	13,407,000
セイコーエプソン	29,400	1,852.00	54,448,800
ワコム	17,200	551.00	9,477,200
アルバック	5,500	4,025.00	22,137,500
アクセル	2,500	576.00	1,440,000
E I Z O	2,200	4,485.00	9,867,000
ジャパンディスプレイ	56,100	70.00	3,927,000
日本信号	6,000	970.00	5,820,000
京三製作所	5,100	471.00	2,402,100
能美防災	3,100	2,250.00	6,975,000
ホーチキ	1,500	1,182.00	1,773,000
星和電機	2,900	460.00	1,334,000
エレコム	2,100	2,865.00	6,016,500
パナソニック	271,100	1,109.00	300,649,900
シャープ	23,500	1,722.00	40,467,000
アンリツ	15,300	1,693.00	25,902,900
富士通ゼネラル	7,200	1,556.00	11,203,200
ソニー	159,100	5,709.00	908,301,900
T D K	12,400	8,680.00	107,632,000
帝国通信工業	1,200	1,218.00	1,461,600
タムラ製作所	9,100	580.00	5,278,000
アルプス電気	21,900	2,473.00	54,158,700
池上通信機	1,100	1,343.00	1,477,300
パイオニア	39,500	93.00	3,673,500
日本電波工業	2,800	515.00	1,442,000
鈴木	2,100	680.00	1,428,000
日本トリム	400	5,970.00	2,388,000

ローランド ディー・ジー	1,200	2,405.00	2,886,000
フォスター電機	2,800	1,516.00	4,244,800
クラリオン	2,100	2,471.00	5,189,100
SMK	700	2,368.00	1,657,600
ヨコオ	1,700	1,535.00	2,609,500
ホシデン	7,000	821.00	5,747,000
ヒロセ電機	3,400	11,680.00	39,712,000
日本航空電子工業	5,400	1,391.00	7,511,400
TOA	2,500	1,110.00	2,775,000
マクセルホールディングス	5,100	1,562.00	7,966,200
古野電気	3,100	1,190.00	3,689,000
ユニデンホールディングス	700	2,507.00	1,754,900
アルパイン	4,100	1,781.00	7,302,100
スミダコーポレーション	2,000	1,441.00	2,882,000
アイコム	1,300	2,354.00	3,060,200
リオン	1,100	1,972.00	2,169,200
船井電機	2,400	725.00	1,740,000
横河電機	23,800	2,088.00	49,694,400
新電元工業	900	4,310.00	3,879,000
アズビル	15,300	2,238.00	34,241,400
東亜ディーケーケー	1,400	963.00	1,348,200
日本光電工業	10,500	3,255.00	34,177,500
チノー	1,100	1,415.00	1,556,500
共和電業	3,500	415.00	1,452,500
日本電子材料	1,900	690.00	1,311,000
堀場製作所	4,700	4,925.00	23,147,500
アドバンテスト	16,200	2,152.00	34,862,400
小野測器	2,000	709.00	1,418,000
エスベック	2,100	1,919.00	4,029,900
キーエンス	11,600	61,000.00	707,600,000
日置電機	1,200	4,010.00	4,812,000
シスメックス	18,500	6,209.00	114,866,500
日本マイクロニクス	3,800	824.00	3,131,200
メガチップス	1,900	2,199.00	4,178,100
OBARA GROUP	1,400	4,485.00	6,279,000
IMAGICA GROUP	2,400	580.00	1,392,000
澤藤電機	700	1,912.00	1,338,400
デンソー	52,700	5,134.00	270,561,800
コーセル	3,300	1,104.00	3,643,200
イリソ電子工業	2,200	4,695.00	10,329,000
オプテックスグループ	4,200	2,111.00	8,866,200
千代田インテグレ	1,000	2,367.00	2,367,000
アイ・オー・データ機器	1,200	1,200.00	1,440,000
レーザーテック	4,900	3,250.00	15,925,000
スタンレー電気	16,800	3,270.00	54,936,000
岩崎電気	1,000	1,525.00	1,525,000
ウシオ電機	14,400	1,282.00	18,460,800
岡谷電機産業	3,400	431.00	1,465,400
ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	745.00	1,639,000
日本セラミック	2,400	2,716.00	6,518,400
遠藤照明	1,800	782.00	1,407,600
古河電池	1,800	820.00	1,476,000
双信電機	3,500	414.00	1,449,000
山一電機	1,700	1,291.00	2,194,700
図研	1,500	1,826.00	2,739,000
日本電子	4,700	1,878.00	8,826,600
カシオ計算機	21,000	1,574.00	33,054,000
ファナック	22,600	18,595.00	420,247,000
日本シイエムケイ	6,000	873.00	5,238,000
エンプラス	1,100	3,065.00	3,371,500

ローム	11,500	7,730.00	88,895,000
浜松ホトニクス	17,000	3,650.00	62,050,000
三井ハイテック	2,600	1,193.00	3,101,800
新光電気工業	8,000	762.00	6,096,000
京セラ	36,200	5,780.00	209,236,000
協栄産業	900	1,708.00	1,537,200
太陽誘電	10,600	2,015.00	21,359,000
村田製作所	24,900	15,705.00	391,054,500
ユーシン	3,700	985.00	3,644,500
双葉電子工業	3,900	1,724.00	6,723,600
日東電工	17,900	5,893.00	105,484,700
北陸電気工業	1,400	1,068.00	1,495,200
東海理化電機製作所	6,200	2,069.00	12,827,800
ニチコン	7,500	849.00	6,367,500
日本ケミコン	1,700	2,222.00	3,777,400
K O A	3,600	1,469.00	5,288,400
三井E & Sホールディングス	8,600	1,133.00	9,743,800
日立造船	18,800	380.00	7,144,000
三菱重工業	39,800	4,320.00	171,936,000
川崎重工業	18,500	2,622.00	48,507,000
I H I	18,200	3,740.00	68,068,000
名村造船所	7,100	535.00	3,798,500
スプリックス	700	2,241.00	1,568,700
日本車輛製造	900	2,634.00	2,370,600
三菱ロジスネクスト	2,800	1,224.00	3,427,200
近畿車輛	600	2,436.00	1,461,600
F P G	7,500	1,250.00	9,375,000
島根銀行	1,500	924.00	1,386,000
じもとホールディングス	15,800	153.00	2,417,400
全国保証	6,600	3,815.00	25,179,000
めぶきフィナンシャルグループ	121,600	341.00	41,465,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,200	1,936.00	6,195,200
九州フィナンシャルグループ	38,400	507.00	19,468,800
かんぽ生命保険	8,800	2,875.00	25,300,000
ゆうちょ銀行	66,300	1,324.00	87,781,200
富山第一銀行	5,600	441.00	2,469,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	149,100	509.00	75,891,900
西日本フィナンシャルホールディングス	15,000	1,117.00	16,755,000
日本モーゲージサービス	1,200	1,070.00	1,284,000
アルヒ	2,100	1,831.00	3,845,100
日産自動車	279,900	950.70	266,100,930
いすゞ自動車	75,000	1,597.50	119,812,500
トヨタ自動車	264,500	6,717.00	1,776,646,500
日野自動車	29,600	1,067.00	31,583,200
三菱自動車工業	87,900	680.00	59,772,000
エフテック	1,700	1,053.00	1,790,100
レシップホールディングス	2,000	713.00	1,426,000
武蔵精密工業	5,600	1,719.00	9,626,400
日産車体	4,600	905.00	4,163,000
新明和工業	11,100	1,452.00	16,117,200
極東開発工業	4,700	1,590.00	7,473,000
日信工業	4,300	1,517.00	6,523,100
トピー工業	2,000	2,641.00	5,282,000
ティラド	900	2,552.00	2,296,800
曙ブレーキ工業	13,000	209.00	2,717,000
タチエス	4,000	1,512.00	6,048,000
N O K	12,800	1,636.00	20,940,800
フタバ産業	6,600	606.00	3,999,600
K Y B	2,500	2,692.00	6,730,000

市光工業	3,500	702.00	2,457,000
大同メタル工業	3,900	903.00	3,521,700
プレス工業	11,800	581.00	6,855,800
ミクニ	3,000	585.00	1,755,000
太平洋工業	5,000	1,605.00	8,025,000
ケーヒン	5,500	1,936.00	10,648,000
河西工業	2,900	942.00	2,731,800
アイシン精機	19,500	4,455.00	86,872,500
マツダ	74,500	1,178.50	87,798,250
今仙電機製作所	2,200	1,047.00	2,303,400
本田技研工業	200,200	3,166.00	633,833,200
スズキ	43,400	5,330.00	231,322,000
S U B A R U	73,700	2,551.00	188,008,700
安永	1,100	1,710.00	1,881,000
ヤマハ発動機	33,500	2,242.00	75,107,000
ショーワ	5,600	1,500.00	8,400,000
小糸製作所	14,200	6,000.00	85,200,000
T B K	100	442.00	44,200
エクセディ	3,200	2,807.00	8,982,400
ミツバ	4,400	716.00	3,150,400
豊田合成	7,700	2,169.00	16,701,300
愛三工業	3,700	803.00	2,971,100
盟和産業	1,300	1,076.00	1,398,800
日本プラスト	1,900	903.00	1,715,700
ヨロズ	2,200	1,438.00	3,163,600
エフ・シー・シー	4,300	2,787.00	11,984,100
シマノ	9,600	15,720.00	150,912,000
テイ・エス テック	5,500	3,285.00	18,067,500
関西みらいフィナンシャルグループ	11,000	868.00	9,548,000
三十三フィナンシャルグループ	2,000	1,918.00	3,836,000
第四北越フィナンシャルグループ	4,100	3,720.00	15,252,000
ジャムコ	1,200	3,045.00	3,654,000
小野建	2,100	1,647.00	3,458,700
ノジマ	4,200	2,608.00	10,953,600
佐島電機	1,700	1,060.00	1,802,000
カップ・クリエイト	3,300	1,477.00	4,874,100
エコートレーディング	2,300	648.00	1,490,400
伯東	1,600	1,294.00	2,070,400
コンドーテック	1,800	1,015.00	1,827,000
ライトオン	2,000	930.00	1,860,000
ナガイレーベン	3,400	2,677.00	9,101,800
三菱食品	2,600	3,010.00	7,826,000
良品計画	3,300	28,930.00	95,469,000
三城ホールディングス	3,000	481.00	1,443,000
松田産業	1,700	1,511.00	2,568,700
第一興商	3,500	5,200.00	18,200,000
メディカルホールディングス	25,200	2,561.00	64,537,200
アドヴァン	3,600	1,056.00	3,801,600
S P K	600	2,375.00	1,425,000
萩原電気ホールディングス	900	3,015.00	2,713,500
アルビス	900	2,892.00	2,602,800
アズワン	1,700	7,940.00	13,498,000
シモジマ	1,400	1,090.00	1,526,000
ドウシシャ	2,200	2,002.00	4,404,400
小津産業	700	1,945.00	1,361,500
コナカ	3,000	489.00	1,467,000
高速	1,400	1,206.00	1,688,400
G - 7 ホールディングス	700	2,559.00	1,791,300
イオン北海道	2,300	812.00	1,867,600
コジマ	3,400	502.00	1,706,800

ヒマラヤ	1,500	993.00	1,489,500
コーナン商事	3,100	2,699.00	8,366,900
ネットワンシステムズ	8,200	2,116.00	17,351,200
エコス	900	2,186.00	1,967,400
ワタミ	3,100	1,332.00	4,129,200
マルシェ	1,800	800.00	1,440,000
システムソフト	12,900	109.00	1,406,100
ドンキホーテホールディングス	15,200	7,000.00	106,400,000
丸文	2,100	738.00	1,549,800
西松屋チェーン	5,100	1,014.00	5,171,400
ゼンショーホールディングス	11,000	2,749.00	30,239,000
ハピネット	1,900	1,547.00	2,939,300
幸楽苑ホールディングス	1,500	1,957.00	2,935,500
日本ライフライン	7,300	1,681.00	12,271,300
サイゼリヤ	3,900	2,121.00	8,271,900
エクセル	900	1,889.00	1,700,100
VTホールディングス	7,900	479.00	3,784,100
マルカキカイ	800	2,309.00	1,847,200
アルゴグラフィックス	1,000	4,340.00	4,340,000
魚力	1,000	1,418.00	1,418,000
IDOM	7,900	499.00	3,942,100
日本エム・ディ・エム	1,400	1,373.00	1,922,200
ユナイテッドアローズ	2,700	3,915.00	10,570,500
進和	1,400	2,371.00	3,319,400
ダイトロン	1,100	1,558.00	1,713,800
ハイデイ日高	3,100	2,253.00	6,984,300
シークス	3,000	1,689.00	5,067,000
京都きもの友禅	3,200	451.00	1,443,200
コロワイド	7,800	2,511.00	19,585,800
ビーシーデポコーポレーション	3,100	515.00	1,596,500
田中商事	2,300	625.00	1,437,500
オーハシテクニカ	1,300	1,397.00	1,816,100
壱番屋	1,600	4,490.00	7,184,000
白銅	800	1,688.00	1,350,400
トップカルチャー	3,900	382.00	1,489,800
PLANT	1,300	1,077.00	1,400,100
スギホールディングス	5,100	5,240.00	26,724,000
島津製作所	30,500	2,485.00	75,792,500
長野計器	1,900	948.00	1,801,200
バイ・テクノロジー	600	16,110.00	9,666,000
スター精密	4,100	1,534.00	6,289,400
東京計器	1,500	1,066.00	1,599,000
インターアクション	1,300	2,368.00	3,078,400
オーバル	1,600	282.00	451,200
東京精密	4,300	3,220.00	13,846,000
マニー	2,900	4,970.00	14,413,000
ニコン	41,400	1,814.00	75,099,600
トプコン	12,700	1,557.00	19,773,900
オリンパス	35,400	3,625.00	128,325,000
理研計器	2,100	2,321.00	4,874,100
SCREENホールディングス	4,100	5,290.00	21,689,000
キヤノン電子	2,200	2,005.00	4,411,000
タムロン	2,100	1,813.00	3,807,300
HOYA	47,800	6,747.00	322,506,600
シード	1,000	1,690.00	1,690,000
ノーリツ鋼機	1,900	1,845.00	3,505,500
エー・アンド・デイ	2,200	812.00	1,786,400
朝日インテック	8,600	5,160.00	44,376,000
キヤノン	127,800	3,203.00	409,343,400
リコー	71,400	1,110.00	79,254,000

シチズン時計	26,000	602.00	15,652,000
リズム時計工業	800	1,981.00	1,584,800
大研医器	1,900	766.00	1,455,400
メニコン	3,300	2,803.00	9,249,900
シンシア	2,800	619.00	1,733,200
スノーピーク	1,000	1,392.00	1,392,000
パラマウントベッドホールディングス	2,700	4,490.00	12,123,000
トランザクション	1,700	824.00	1,400,800
SHOBI	3,800	396.00	1,504,800
ニホンフラッシュ	1,000	1,838.00	1,838,000
前田工織	2,600	2,530.00	6,578,000
永大産業	3,400	428.00	1,455,200
アートネイチャー	2,500	669.00	1,672,500
バンダイナムコホールディングス	24,500	4,900.00	120,050,000
共立印刷	5,600	256.00	1,433,600
SHOEI	1,100	4,435.00	4,878,500
フランスベッドホールディングス	3,400	952.00	3,236,800
マーベラス	3,600	886.00	3,189,600
パイロットコーポレーション	4,100	5,720.00	23,452,000
萩原工業	1,300	1,654.00	2,150,200
エイベックス	4,000	1,511.00	6,044,000
トッパン・フォームズ	5,100	996.00	5,079,600
フジシールインターナショナル	5,400	3,635.00	19,629,000
タカラトミー	9,900	1,317.00	13,038,300
廣済堂	3,400	430.00	1,462,000
エステールホールディングス	2,200	675.00	1,485,000
アーク	15,600	93.00	1,450,800
レック	2,500	2,139.00	5,347,500
プロネクス	2,000	1,052.00	2,104,000
ホクシン	9,200	157.00	1,444,400
大建工業	1,800	2,103.00	3,785,400
凸版印刷	33,500	1,783.00	59,730,500
大日本印刷	33,400	2,596.00	86,706,400
図書印刷	2,200	808.00	1,777,600
共同印刷	700	2,591.00	1,813,700
NISSHA	4,900	1,899.00	9,305,100
藤森工業	2,100	3,020.00	6,342,000
ヴィア・ホールディングス	2,900	703.00	2,038,700
宝印刷	1,200	1,798.00	2,157,600
前澤化成工業	1,600	1,099.00	1,758,400
アシックス	23,600	1,520.00	35,872,000
ツツミ	700	2,194.00	1,535,800
JSP	1,400	2,387.00	3,341,800
ニチハ	3,300	2,953.00	9,744,900
エフピコ	2,000	6,720.00	13,440,000
小松ウオール工業	700	2,006.00	1,404,200
ヤマハ	14,100	4,755.00	67,045,500
河合楽器製作所	700	3,335.00	2,334,500
クリナップ	2,300	689.00	1,584,700
ビジョン	14,300	4,865.00	69,569,500
天馬	1,600	2,048.00	3,276,800
キングジム	2,000	904.00	1,808,000
象印マホービン	4,400	1,163.00	5,117,200
リンテック	5,600	2,560.00	14,336,000
信越ポリマー	4,300	849.00	3,650,700
東リ	5,900	305.00	1,799,500
イトーキ	4,400	601.00	2,644,400
任天堂	14,600	31,220.00	455,812,000
三菱鉛筆	3,900	2,120.00	8,268,000
松風	1,200	1,235.00	1,482,000

タカラスタンダード	4,900	1,750.00	8,575,000
コクヨ	11,400	1,679.00	19,140,600
ナカバヤシ	2,500	587.00	1,467,500
ニフコ	9,500	2,868.00	27,246,000
立川ブラインド工業	1,300	1,136.00	1,476,800
グローブライド	1,100	2,851.00	3,136,100
オカムラ	8,300	1,573.00	13,055,900
バルカー	1,900	2,663.00	5,059,700
MUTOHホールディングス	600	2,300.00	1,380,000
伊藤忠商事	171,500	2,054.00	352,261,000
丸紅	230,500	869.20	200,350,600
スクロール	3,600	441.00	1,587,600
ヨンドシーホールディングス	2,600	2,434.00	6,328,400
三陽商会	1,400	1,916.00	2,682,400
長瀬産業	13,100	1,618.00	21,195,800
蝶理	1,500	1,903.00	2,854,500
豊田通商	26,100	4,010.00	104,661,000
オンワードホールディングス	14,400	691.00	9,950,400
三共生興	4,000	449.00	1,796,000
兼松	9,300	1,475.00	13,717,500
美津濃	2,400	2,532.00	6,076,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,500	15,580.00	101,270,000
三井物産	192,600	1,789.00	344,561,400
日本紙バルブ商事	1,300	4,305.00	5,596,500
東京エレクトロン	15,800	14,645.00	231,391,000
日立ハイテクノロジーズ	7,100	3,975.00	28,222,500
カメイ	3,000	1,289.00	3,867,000
OUGホールディングス	600	2,620.00	1,572,000
スターゼン	900	4,510.00	4,059,000
セイコーホールディングス	3,700	2,440.00	9,028,000
山善	9,100	1,134.00	10,319,400
椿本興業	500	3,430.00	1,715,000
住友商事	138,300	1,750.00	242,025,000
日本ユニシス	7,300	2,718.00	19,841,400
内田洋行	1,100	2,667.00	2,933,700
三菱商事	164,000	3,057.00	501,348,000
第一実業	1,100	3,890.00	4,279,000
キヤノンマーケティングジャパン	6,700	2,105.00	14,103,500
西華産業	1,300	1,622.00	2,108,600
佐藤商事	2,100	975.00	2,047,500
菱洋エレクトロ	2,400	1,655.00	3,972,000
東京産業	2,400	587.00	1,408,800
ユアサ商事	2,400	3,545.00	8,508,000
神鋼商事	500	2,759.00	1,379,500
小林産業	4,800	304.00	1,459,200
阪和興業	4,100	3,115.00	12,771,500
正栄食品工業	1,200	4,575.00	5,490,000
カナデン	2,200	1,287.00	2,831,400
菱電商事	1,900	1,565.00	2,973,500
ニプロ	16,400	1,540.00	25,256,000
フルサト工業	1,300	1,900.00	2,470,000
岩谷産業	5,200	3,905.00	20,306,000
すてきなイスグループ	1,300	1,112.00	1,445,600
昭光通商	1,900	782.00	1,485,800
イワキ	2,900	520.00	1,508,000
兼松エレクトロニクス	1,300	3,530.00	4,589,000
三愛石油	6,300	1,133.00	7,137,900
稲畑産業	5,600	1,540.00	8,624,000
ゴールドウイン	2,100	11,440.00	24,024,000

ユニ・チャーム	50,300	3,323.00	167,146,900
デサント	5,700	2,363.00	13,469,100
キング	3,000	496.00	1,488,000
ワキタ	5,000	1,262.00	6,310,000
ヤマトインターナショナル	3,200	455.00	1,456,000
東邦ホールディングス	6,900	3,120.00	21,528,000
サンゲツ	7,100	2,173.00	15,428,300
ミツウロコグループホールディングス	3,400	674.00	2,291,600
シナネンホールディングス	1,000	2,585.00	2,585,000
伊藤忠エネクス	5,200	1,036.00	5,387,200
サンリオ	7,200	2,188.00	15,753,600
サンワテクノス	1,400	1,210.00	1,694,000
リョーサン	2,600	3,205.00	8,333,000
新光商事	2,200	1,686.00	3,709,200
トーホー	1,100	2,413.00	2,654,300
三信電気	1,900	1,922.00	3,651,800
東陽テクニカ	2,600	885.00	2,301,000
モスフードサービス	3,100	3,015.00	9,346,500
加賀電子	2,300	2,221.00	5,108,300
三益半導体工業	1,800	1,497.00	2,694,600
ソーダニッカ	2,400	657.00	1,576,800
立花エレテック	1,700	1,708.00	2,903,600
木曽路	2,900	2,584.00	7,493,600
S R Sホールディングス	2,800	1,017.00	2,847,600
タカキュー	7,600	194.00	1,474,400
ケーヨー	4,300	583.00	2,506,900
上新電機	2,800	2,601.00	7,282,800
日本瓦斯	4,300	3,795.00	16,318,500
ロイヤルホールディングス	4,100	2,671.00	10,951,100
東天紅	1,000	1,486.00	1,486,000
いなげや	2,600	1,534.00	3,988,400
島忠	5,300	2,950.00	15,635,000
チヨダ	2,500	2,008.00	5,020,000
ライフコーポレーション	1,800	2,760.00	4,968,000
リンガーハット	2,900	2,393.00	6,939,700
MrMaxHD	3,200	514.00	1,644,800
テンアライド	3,500	414.00	1,449,000
AOKIホールディングス	4,700	1,420.00	6,674,000
オークワ	3,300	1,198.00	3,953,400
コメリ	3,600	2,795.00	10,062,000
青山商事	4,500	2,818.00	12,681,000
しまむら	2,700	9,330.00	25,191,000
はせがわ	3,200	468.00	1,497,600
高島屋	18,300	1,895.00	34,678,500
松屋	4,700	1,157.00	5,437,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,000	1,965.00	23,580,000
近鉄百貨店	900	3,620.00	3,258,000
パルコ	2,200	1,266.00	2,785,200
丸井グループ	19,800	2,434.00	48,193,200
クレディセゾン	16,400	1,489.00	24,419,600
アクシアル リテイリング	1,900	3,995.00	7,590,500
イオン	90,000	2,709.00	243,810,000
イズミ	4,800	6,580.00	31,584,000
平和堂	4,700	3,100.00	14,570,000
フジ	2,800	2,148.00	6,014,400
ヤオコー	2,700	6,330.00	17,091,000
ゼビオホールディングス	2,800	1,499.00	4,197,200
ケーズホールディングス	24,300	1,211.00	29,427,300
PALTAC	4,200	5,930.00	24,906,000
三谷産業	4,600	311.00	1,430,600

Olympicグループ	1,900	771.00	1,464,900
新生銀行	17,200	1,595.00	27,434,000
あおぞら銀行	13,100	3,760.00	49,256,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,630,300	638.70	1,041,272,610
りそなホールディングス	256,900	578.00	148,488,200
三井住友トラスト・ホールディングス	46,100	4,524.00	208,556,400
三井住友フィナンシャルグループ	165,000	4,193.00	691,845,000
千葉銀行	82,900	718.00	59,522,200
群馬銀行	46,800	528.00	24,710,400
武蔵野銀行	3,500	3,010.00	10,535,000
千葉興業銀行	6,400	423.00	2,707,200
筑波銀行	9,700	244.00	2,366,800
七十七銀行	7,300	2,255.00	16,461,500
青森銀行	1,900	3,005.00	5,709,500
秋田銀行	1,500	2,389.00	3,583,500
山形銀行	2,600	2,356.00	6,125,600
岩手銀行	1,700	4,185.00	7,114,500
東邦銀行	20,900	380.00	7,942,000
東北銀行	1,200	1,323.00	1,587,600
みちのく銀行	1,500	1,798.00	2,697,000
ふくおかフィナンシャルグループ	19,100	2,556.00	48,819,600
静岡銀行	58,900	1,001.00	58,958,900
十六銀行	3,100	2,586.00	8,016,600
スルガ銀行	23,900	546.00	13,049,400
八十二銀行	42,400	507.00	21,496,800
山梨中央銀行	2,900	1,590.00	4,611,000
大垣共立銀行	3,700	2,469.00	9,135,300
福井銀行	2,000	1,894.00	3,788,000
北國銀行	2,500	4,075.00	10,187,500
清水銀行	1,000	1,858.00	1,858,000
富山銀行	500	3,910.00	1,955,000
滋賀銀行	4,700	2,754.00	12,943,800
南都銀行	2,700	2,535.00	6,844,500
百五銀行	21,100	433.00	9,136,300
京都銀行	8,400	5,250.00	44,100,000
紀陽銀行	8,300	1,766.00	14,657,800
ほくほくフィナンシャルグループ	15,600	1,459.00	22,760,400
広島銀行	34,600	697.00	24,116,200
山陰合同銀行	13,900	909.00	12,635,100
中国銀行	15,100	1,021.00	15,417,100
鳥取銀行	900	1,590.00	1,431,000
伊予銀行	31,000	659.00	20,429,000
百十四銀行	2,500	2,944.00	7,360,000
四国銀行	3,400	1,371.00	4,661,400
阿波銀行	3,800	3,120.00	11,856,000
大分銀行	1,500	3,695.00	5,542,500
宮崎銀行	1,600	3,170.00	5,072,000
佐賀銀行	1,400	2,120.00	2,968,000
十八銀行	1,500	2,820.00	4,230,000
沖縄銀行	2,200	3,770.00	8,294,000
琉球銀行	5,400	1,301.00	7,025,400
セブン銀行	79,100	370.00	29,267,000
みずほフィナンシャルグループ	3,180,900	189.90	604,052,910
山口フィナンシャルグループ	29,200	1,185.00	34,602,000
芙蓉総合リース	2,700	6,160.00	16,632,000
興銀リース	4,400	2,746.00	12,082,400
東京センチュリー	4,700	5,300.00	24,910,000
SBIホールディングス	27,900	2,633.00	73,460,700
日本証券金融	10,300	642.00	6,612,600
アイフル	35,700	302.00	10,781,400

長野銀行	900	1,668.00	1,501,200
名古屋銀行	1,900	3,655.00	6,944,500
北洋銀行	35,300	320.00	11,296,000
愛知銀行	900	4,290.00	3,861,000
中京銀行	1,000	2,303.00	2,303,000
大光銀行	800	2,134.00	1,707,200
愛媛銀行	3,300	1,166.00	3,847,800
京葉銀行	10,300	786.00	8,095,800
栃木銀行	12,100	289.00	3,496,900
北日本銀行	700	2,541.00	1,778,700
東和銀行	4,100	896.00	3,673,600
リコーリース	1,800	3,605.00	6,489,000
イオンフィナンシャルサービス	15,000	2,240.00	33,600,000
アコム	47,100	412.00	19,405,200
ジャックス	2,600	2,031.00	5,280,600
オリエントコーポレーション	63,300	178.00	11,267,400
日立キャピタル	5,500	2,778.00	15,279,000
アプラスフィナンシャル	15,000	99.00	1,485,000
オリックス	156,200	1,792.00	279,910,400
三菱UFJリース	52,800	597.00	31,521,600
ジャフコ	3,800	4,225.00	16,055,000
トモニホールディングス	18,100	462.00	8,362,200
大和証券グループ本社	187,800	627.30	117,806,940
野村ホールディングス	429,600	512.70	220,255,920
岡三証券グループ	19,900	550.00	10,945,000
丸三証券	7,000	887.00	6,209,000
東洋証券	8,400	203.00	1,705,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	27,900	557.00	15,540,300
光世証券	1,400	980.00	1,372,000
水戸証券	6,800	313.00	2,128,400
いちよし証券	4,900	927.00	4,542,300
松井証券	11,500	1,215.00	13,972,500
SOMPOホールディングス	45,900	4,407.00	202,281,300
だいこう証券ビジネス	1,500	497.00	745,500
日本取引所グループ	63,200	2,042.00	129,054,400
マネックスグループ	21,900	415.00	9,088,500
カブドットコム証券	17,500	423.00	7,402,500
極東証券	3,100	1,310.00	4,061,000
岩井コスモホールディングス	2,400	1,403.00	3,367,200
藍澤證券	4,400	759.00	3,339,600
フィデアホールディングス	22,700	154.00	3,495,800
池田泉州ホールディングス	24,800	339.00	8,407,200
アニコムホールディングス	1,800	3,790.00	6,822,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	61,200	3,458.00	211,629,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	19,200	2,416.00	46,387,200
マネーパートナーズグループ	4,000	344.00	1,376,000
第一生命ホールディングス	132,400	2,013.00	266,521,200
東京海上ホールディングス	84,900	5,534.00	469,836,600
イー・ギャランティ	2,200	1,065.00	2,343,000
アサックス	1,600	587.00	939,200
NECキャピタルソリューション	1,000	1,699.00	1,699,000
T&Dホールディングス	72,400	1,671.00	120,980,400
アドバンスクリエイト	600	2,057.00	1,234,200
三井不動産	124,200	2,749.50	341,487,900
三菱地所	164,000	1,751.50	287,246,000
平和不動産	4,400	1,881.00	8,276,400
東京建物	25,600	1,182.00	30,259,200
ダイビル	6,900	1,176.00	8,114,400

京阪神ビルディング	4,200	882.00	3,704,400
住友不動産	52,600	4,148.00	218,184,800
大京	3,700	2,963.00	10,963,100
テーオーシー	5,400	852.00	4,600,800
東京楽天地	300	4,870.00	1,461,000
レオパレス21	29,800	438.00	13,052,400
スターツコーポレーション	3,200	2,659.00	8,508,800
フジ住宅	3,000	861.00	2,583,000
空港施設	2,700	590.00	1,593,000
明和地所	2,300	618.00	1,421,400
ゴールドクレスト	1,800	1,690.00	3,042,000
リログループ	12,400	2,771.00	34,360,400
日本エスリード	800	1,550.00	1,240,000
日神不動産	3,500	495.00	1,732,500
日本エスコン	4,200	684.00	2,872,800
タカラレーベン	11,000	322.00	3,542,000
サンヨーハウジング名古屋	1,400	1,026.00	1,436,400
イオンモール	11,700	2,105.00	24,628,500
ファースト住建	1,200	1,178.00	1,413,600
カチタス	2,600	2,973.00	7,729,800
東祥	1,400	3,920.00	5,488,000
トーセイ	3,200	1,017.00	3,254,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	14,600	1,679.00	24,513,400
サンフロンティア不動産	3,200	1,172.00	3,750,400
エフ・ジェー・ネクスト	2,000	925.00	1,850,000
ランドビジネス	2,700	586.00	1,582,200
グランディハウス	3,400	426.00	1,448,400
東武鉄道	25,000	3,220.00	80,500,000
相鉄ホールディングス	8,100	3,410.00	27,621,000
東京急行電鉄	64,500	1,899.00	122,485,500
京浜急行電鉄	32,500	1,773.00	57,622,500
小田急電鉄	38,000	2,453.00	93,214,000
京王電鉄	13,300	6,270.00	83,391,000
京成電鉄	17,800	3,600.00	64,080,000
富士急行	3,200	3,080.00	9,856,000
新京成電鉄	700	2,153.00	1,507,100
東日本旅客鉄道	42,200	10,340.00	436,348,000
西日本旅客鉄道	21,300	8,056.00	171,592,800
東海旅客鉄道	21,300	22,565.00	480,634,500
西武ホールディングス	30,300	2,160.00	65,448,000
鴻池運輸	3,800	1,718.00	6,528,400
西日本鉄道	6,600	2,940.00	19,404,000
ハマキョウレックス	1,800	3,930.00	7,074,000
サカイ引越センター	1,200	6,020.00	7,224,000
近鉄グループホールディングス	22,500	4,610.00	103,725,000
阪急阪神ホールディングス	30,000	3,815.00	114,450,000
南海電気鉄道	10,000	2,744.00	27,440,000
京阪ホールディングス	10,000	4,685.00	46,850,000
神戸電鉄	600	3,975.00	2,385,000
名古屋鉄道	18,000	2,825.00	50,850,000
山陽電気鉄道	1,700	2,282.00	3,879,400
トランコム	600	6,640.00	3,984,000
日本通運	8,800	7,250.00	63,800,000
ヤマトホールディングス	39,400	2,887.50	113,767,500
山九	6,200	5,510.00	34,162,000
日新	1,900	1,874.00	3,560,600
丸全昭和運輸	1,800	3,015.00	5,427,000
センコーグループホールディングス	12,400	857.00	10,626,800
トナミホールディングス	500	6,020.00	3,010,000
ニッコンホールディングス	8,500	2,934.00	24,939,000

日本石油輸送	500	2,858.00	1,429,000
福山通運	2,900	4,785.00	13,876,500
セイノーホールディングス	16,800	1,656.00	27,820,800
神奈川中央交通	600	3,785.00	2,271,000
日立物流	4,900	3,130.00	15,337,000
丸和運輸機関	1,200	3,425.00	4,110,000
C & F ロジホールディングス	2,300	1,312.00	3,017,600
日本郵船	18,800	1,874.00	35,231,200
商船三井	13,400	2,629.00	35,228,600
川崎汽船	7,000	1,599.00	11,193,000
NSユナイテッド海運	1,300	2,983.00	3,877,900
飯野海運	10,700	462.00	4,943,400
九州旅客鉄道	18,900	3,580.00	67,662,000
S Gホールディングス	21,200	2,907.00	61,628,400
日本航空	41,200	4,212.00	173,534,400
A N Aホールディングス	41,100	4,039.00	166,002,900
パスコ	200	1,135.00	227,000
西本Wismettacホールディングス	500	5,140.00	2,570,000
Genky DrugStores	900	3,480.00	3,132,000
国際紙パルプ商事	4,400	312.00	1,372,800
総合メディカルホールディングス	2,000	2,570.00	5,140,000
三菱倉庫	7,800	2,771.00	21,613,800
三井倉庫ホールディングス	2,800	1,977.00	5,535,600
住友倉庫	8,400	1,414.00	11,877,600
澁澤倉庫	1,200	1,592.00	1,910,400
ヤマタネ	1,200	1,901.00	2,281,200
東陽倉庫	4,800	304.00	1,459,200
乾汽船	2,100	967.00	2,030,700
日本トランスシティ	4,900	471.00	2,307,900
ケイヒン	1,000	1,396.00	1,396,000
中央倉庫	1,400	1,070.00	1,498,000
安田倉庫	1,800	844.00	1,519,200
東洋埠頭	1,000	1,501.00	1,501,000
宇徳	2,800	517.00	1,447,600
上組	13,900	2,431.00	33,790,900
キムラユニティー	1,300	1,104.00	1,435,200
キューソー流通システム	300	2,521.00	756,300
近鉄エクスプレス	4,200	1,834.00	7,702,800
エーアイテイー	1,500	1,010.00	1,515,000
日本コンセプト	1,300	1,128.00	1,466,400
東京放送ホールディングス	15,400	2,022.00	31,138,800
日本テレビホールディングス	21,400	1,784.00	38,177,600
朝日放送グループホールディングス	2,300	776.00	1,784,800
テレビ朝日ホールディングス	6,400	2,199.00	14,073,600
スカパーJ S A Tホールディングス	17,800	528.00	9,398,400
テレビ東京ホールディングス	1,900	2,564.00	4,871,600
日本BS放送	1,200	1,231.00	1,477,200
ビジョン	700	4,365.00	3,055,500
USEN-NEXT HOLDINGS	1,300	1,150.00	1,495,000
ワイヤレスゲート	2,700	523.00	1,412,100
コネクシオ	1,600	1,455.00	2,328,000
日本通信	19,800	131.00	2,593,800
日本電信電話	159,300	4,655.00	741,541,500
KDDI	205,200	2,560.00	525,312,000
光通信	2,700	17,860.00	48,222,000
NTTドコモ	167,200	2,586.50	432,462,800
エムティーアイ	2,700	598.00	1,614,600
GMOインターネット	8,500	1,405.00	11,942,500
カドカワ	6,800	1,396.00	9,492,800

学研ホールディングス	800	4,520.00	3,616,000
ゼンリン	4,600	2,567.00	11,808,200
昭文社	2,500	544.00	1,360,000
インプレスホールディングス	9,100	157.00	1,428,700
東京電力ホールディングス	189,500	662.00	125,449,000
中部電力	72,600	1,727.50	125,416,500
関西電力	96,800	1,813.50	175,546,800
中国電力	32,800	1,448.00	47,494,400
北陸電力	23,200	1,036.00	24,035,200
東北電力	55,600	1,518.00	84,400,800
四国電力	21,400	1,376.00	29,446,400
九州電力	48,900	1,369.00	66,944,100
北海道電力	22,200	746.00	16,561,200
沖縄電力	4,400	2,187.00	9,622,800
電源開発	18,900	2,952.00	55,792,800
エフオン	1,100	1,000.00	1,100,000
イーレックス	4,100	678.00	2,779,800
レノバ	2,500	1,112.00	2,780,000
東京瓦斯	46,600	2,874.50	133,951,700
大阪瓦斯	46,100	2,117.00	97,593,700
東邦瓦斯	11,800	4,505.00	53,159,000
北海道瓦斯	1,300	1,468.00	1,908,400
広島ガス	4,900	352.00	1,724,800
西部瓦斯	2,700	2,403.00	6,488,100
静岡ガス	7,300	960.00	7,008,000
メタウォーター	1,100	3,110.00	3,421,000
アイネット	1,300	1,494.00	1,942,200
松竹	1,500	11,170.00	16,755,000
東宝	15,300	3,690.00	56,457,000
エイチ・アイ・エス	4,000	3,725.00	14,900,000
東映	1,000	13,420.00	13,420,000
ラックランド	500	2,908.00	1,454,000
エヌ・ティ・ティ・データ	62,000	1,298.00	80,476,000
共立メンテナンス	3,500	5,520.00	19,320,000
イチネンホールディングス	2,400	1,447.00	3,472,800
建設技術研究所	1,600	1,474.00	2,358,400
スペース	1,500	1,218.00	1,827,000
アインホールディングス	3,100	8,710.00	27,001,000
燦ホールディングス	500	2,747.00	1,373,500
東京テアトル	1,100	1,336.00	1,469,600
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,025.00	1,417,500
ナガワ	600	5,530.00	3,318,000
よみうりランド	500	4,060.00	2,030,000
東京都競馬	1,500	3,270.00	4,905,000
常磐興産	900	1,702.00	1,531,800
カナモト	3,200	3,390.00	10,848,000
東京ドーム	8,500	1,004.00	8,534,000
D T S	2,600	4,105.00	10,673,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,800	3,395.00	36,666,000
シーイーシー	2,500	2,319.00	5,797,500
カブコン	10,000	2,160.00	21,600,000
西尾レントオール	2,300	3,960.00	9,108,000
アイ・エス・ピー	600	2,308.00	1,384,800
日本空港ビルデング	7,500	4,240.00	31,800,000
トランス・コスモス	2,500	2,618.00	6,545,000
乃村工藝社	5,300	2,633.00	13,954,900
ジャステック	1,400	1,073.00	1,502,200
S C S K	6,100	4,285.00	26,138,500
藤田観光	900	3,065.00	2,758,500

KNT - CTホールディングス	1,200	1,199.00	1,438,800
日本管財	2,400	2,059.00	4,941,600
トーカイ	2,200	2,713.00	5,968,600
白洋舎	500	3,005.00	1,502,500
セコム	24,100	8,976.00	216,321,600
日本システムウエア	800	2,219.00	1,775,200
セントラル警備保障	1,100	5,570.00	6,127,000
アイネス	3,000	1,220.00	3,660,000
丹青社	4,300	1,102.00	4,738,600
メイトック	2,900	4,770.00	13,833,000
TKC	2,000	3,960.00	7,920,000
富士ソフト	3,500	4,965.00	17,377,500
応用地質	2,400	1,279.00	3,069,600
船井総研ホールディングス	4,700	2,153.00	10,119,100
NSD	3,800	2,346.00	8,914,800
進学会ホールディングス	2,400	606.00	1,454,400
丸紅建材リース	700	2,103.00	1,472,100
コナミホールディングス	9,500	4,830.00	45,885,000
いであ	1,400	1,061.00	1,485,400
学究社	900	1,631.00	1,467,900
ベネッセホールディングス	8,300	3,245.00	26,933,500
イオンディライト	2,800	3,945.00	11,046,000
ナック	1,400	1,070.00	1,498,000
福井コンピュータホールディングス	800	1,701.00	1,360,800
ニチイ学館	3,200	1,136.00	3,635,200
ダイセキ	3,800	2,645.00	10,051,000
ステップ	900	1,559.00	1,403,100
日鉄住金物産	1,700	5,120.00	8,704,000
泉州電業	800	2,532.00	2,025,600
元気寿司	700	5,480.00	3,836,000
トラスコ中山	4,900	3,090.00	15,141,000
ヤマダ電機	71,200	528.00	37,593,600
オートバックスセブン	9,300	1,717.00	15,968,100
モリト	1,700	838.00	1,424,600
アークランドサカモト	4,000	1,484.00	5,936,000
ニトリホールディングス	10,100	14,285.00	144,278,500
グルメ杵屋	1,700	1,191.00	2,024,700
愛眼	4,500	321.00	1,444,500
吉野家ホールディングス	8,200	1,904.00	15,612,800
加藤産業	3,700	3,455.00	12,783,500
イノテック	1,600	1,069.00	1,710,400
イエローハット	2,200	2,869.00	6,311,800
松屋フーズホールディングス	1,100	3,735.00	4,108,500
JBCホールディングス	1,800	1,699.00	3,058,200
JKホールディングス	2,200	635.00	1,397,000
サガミホールディングス	3,100	1,368.00	4,240,800
日伝	1,900	1,765.00	3,353,500
関西スーパーマーケット	1,800	1,053.00	1,895,400
ミロク情報サービス	2,300	2,650.00	6,095,000
北沢産業	6,400	229.00	1,465,600
杉本商事	1,300	1,790.00	2,327,000
因幡電機産業	3,300	4,620.00	15,246,000
王将フードサービス	1,700	7,250.00	12,325,000
プレナス	2,600	1,932.00	5,023,200
ミニストップ	1,700	2,058.00	3,498,600
アークス	4,400	2,765.00	12,166,000
パローホールディングス	5,000	2,988.00	14,940,000
バイテックホールディングス	1,100	2,303.00	2,533,300
東テク	800	2,676.00	2,140,800
ミスミグループ本社	29,200	2,329.00	68,006,800

藤久	1,600	878.00	1,404,800	
ベルク	1,200	5,840.00	7,008,000	
大 庄	1,200	1,689.00	2,026,800	
タキヒヨー	100	1,940.00	194,000	
ファーストリテイリング	3,100	58,270.00	180,637,000	
ソフトバンクグループ	97,300	8,803.00	856,531,900	
蔵王産業	1,000	1,442.00	1,442,000	
スズケン	10,700	5,900.00	63,130,000	
サンドラッグ	8,800	3,875.00	34,100,000	
サックスパー ホールディングス	2,000	1,100.00	2,200,000	
ジェコス	1,600	1,082.00	1,731,200	
やまや	600	2,537.00	1,522,200	
ルネサスイーストン	3,200	433.00	1,385,600	
ペルーナ	5,700	1,195.00	6,811,500	
合計	27,250,800		54,651,417,270	

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。

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	276,927,062
コール・ローン	385,289,854
国債証券	61,070,828,590
地方債証券	8,962,582,824
特殊債券	10,327,688,820
社債券	7,228,130,800
未収利息	227,564,980
前払費用	1,137,409
流動資産合計	88,480,150,339
資産合計	88,480,150,339
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,989,115
その他未払費用	12,309
流動負債合計	3,001,424
負債合計	3,001,424
純資産の部	
元本等	
元本	91,553,091,806
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	3,075,942,891
純資産合計	88,477,148,915
負債純資産合計	88,480,150,339

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	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。
--------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	91,553,091,806口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	3,075,942,891円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9664円 (9,664円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 2017年11月17日 至 2018年11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。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年11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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2018年11月20日現在)	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		683,058,940
地方債証券		47,932,410
特殊債証券		40,211,543
社債証券		37,580,000
合計		808,782,893

(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)

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	(2018年11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	139,680,390,792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	3,099,164,197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	51,226,463,183円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	90,032,868,109円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,198,123,874円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	6,925,913円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	196,812,753円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	5,784,972円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	13,759,679円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	47,804,002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)	25,017,328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)	2,688,418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)	7,329,823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)	15,976,935円
計	91,553,091,806円

附属明細表(2018年11月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第383回 利付国債(2年)	163,000,000	163,451,510	
	第384回 利付国債(2年)	148,000,000	148,433,640	
	第385回 利付国債(2年)	516,000,000	517,625,400	
	第386回 利付国債(2年)	547,000,000	548,832,450	
	第387回 利付国債(2年)	103,000,000	103,367,710	
	第388回 利付国債(2年)	97,000,000	97,366,660	
	第389回 利付国債(2年)	52,000,000	52,202,800	
	第390回 利付国債(2年)	117,000,000	117,480,870	
	第392回 利付国債(2年)	200,000,000	200,908,000	
	第393回 利付国債(2年)	200,000,000	200,932,000	
	第122回 利付国債(5年)	605,000,000	606,663,750	
	第123回 利付国債(5年)	603,000,000	605,001,960	
	第124回 利付国債(5年)	299,000,000	300,181,050	
	第125回 利付国債(5年)	284,000,000	285,275,160	
	第126回 利付国債(5年)	429,000,000	431,192,190	
	第127回 利付国債(5年)	391,000,000	393,189,600	
	第128回 利付国債(5年)	354,000,000	356,148,780	
	第129回 利付国債(5年)	264,000,000	265,723,920	
	第130回 利付国債(5年)	229,000,000	230,591,550	
	第131回 利付国債(5年)	297,000,000	299,230,470	
	第132回 利付国債(5年)	164,000,000	165,295,600	
	第133回 利付国債(5年)	402,000,000	405,400,920	
	第134回 利付国債(5年)	307,000,000	309,766,070	
	第1回 利付国債(40年)	102,000,000	143,318,160	
	第2回 利付国債(40年)	140,000,000	190,153,600	
	第3回 利付国債(40年)	139,000,000	189,404,180	
	第4回 利付国債(40年)	190,000,000	259,988,400	
	第5回 利付国債(40年)	172,000,000	226,305,560	
	第6回 利付国債(40年)	180,000,000	232,072,200	
	第7回 利付国債(40年)	191,000,000	235,105,720	
	第8回 利付国債(40年)	208,000,000	237,120,000	
	第9回 利付国債(40年)	224,000,000	184,954,560	
	第10回 利付国債(40年)	245,000,000	239,872,150	
	第11回 利付国債(40年)	162,000,000	152,638,020	
	第305回 利付国債(10年)	549,000,000	557,575,380	
	第306回 利付国債(10年)	183,000,000	186,755,160	
	第307回 利付国債(10年)	57,000,000	58,093,830	
	第308回 利付国債(10年)	61,000,000	62,393,850	
	第309回 利付国債(10年)	316,000,000	322,222,040	
	第310回 利付国債(10年)	165,000,000	168,450,150	
	第311回 利付国債(10年)	123,000,000	125,120,520	
	第312回 利付国債(10年)	862,000,000	885,989,460	
	第313回 利付国債(10年)	262,000,000	270,771,760	
	第314回 利付国債(10年)	100,000,000	102,881,000	
	第315回 利付国債(10年)	246,000,000	254,494,380	
	第316回 利付国債(10年)	110,000,000	113,514,500	
	第317回 利付国債(10年)	80,000,000	82,783,200	
	第318回 利付国債(10年)	208,000,000	214,645,600	
	第319回 利付国債(10年)	106,000,000	109,996,200	
	第320回 利付国債(10年)	225,000,000	232,787,250	
	第321回 利付国債(10年)	231,000,000	239,639,400	

第322回	利付国債(10年)	80,000,000	82,724,800
第323回	利付国債(10年)	59,000,000	61,151,140
第324回	利付国債(10年)	194,000,000	200,376,780
第325回	利付国債(10年)	203,000,000	210,145,600
第326回	利付国債(10年)	2,000,000	2,066,800
第327回	利付国債(10年)	49,000,000	50,837,500
第328回	利付国債(10年)	39,000,000	40,203,540
第329回	利付国債(10年)	9,000,000	9,374,670
第330回	利付国債(10年)	3,000,000	3,131,040
第332回	利付国債(10年)	366,000,000	378,982,020
第333回	利付国債(10年)	325,000,000	336,999,000
第334回	利付国債(10年)	328,000,000	340,591,920
第335回	利付国債(10年)	289,000,000	298,817,330
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	54,844,400
第337回	利付国債(10年)	336,000,000	343,590,240
第338回	利付国債(10年)	646,000,000	665,076,380
第339回	利付国債(10年)	685,000,000	705,803,450
第340回	利付国債(10年)	875,000,000	901,985,000
第341回	利付国債(10年)	854,000,000	874,923,000
第342回	利付国債(10年)	878,000,000	886,700,980
第343回	利付国債(10年)	883,000,000	891,379,670
第344回	利付国債(10年)	911,000,000	919,208,110
第345回	利付国債(10年)	532,000,000	536,293,240
第346回	利付国債(10年)	647,000,000	651,567,820
第347回	利付国債(10年)	905,000,000	910,801,050
第348回	利付国債(10年)	819,000,000	823,316,130
第349回	利付国債(10年)	892,000,000	895,621,520
第350回	利付国債(10年)	915,000,000	917,534,550
第351回	利付国債(10年)	665,000,000	665,944,300
第1回	利付国債(30年)	13,000,000	16,653,520
第2回	利付国債(30年)	27,000,000	33,701,670
第3回	利付国債(30年)	28,000,000	34,723,080
第4回	利付国債(30年)	79,000,000	104,111,730
第5回	利付国債(30年)	50,000,000	62,037,000
第6回	利付国債(30年)	69,000,000	87,784,560
第7回	利付国債(30年)	70,000,000	88,557,000
第8回	利付国債(30年)	73,000,000	87,773,740
第9回	利付国債(30年)	66,000,000	75,756,120
第10回	利付国債(30年)	105,000,000	116,138,400
第11回	利付国債(30年)	77,000,000	91,736,260
第12回	利付国債(30年)	53,000,000	66,262,720
第13回	利付国債(30年)	70,000,000	86,605,400
第14回	利付国債(30年)	119,000,000	154,483,420
第15回	利付国債(30年)	127,000,000	167,088,820
第16回	利付国債(30年)	108,000,000	142,400,160
第17回	利付国債(30年)	79,000,000	103,103,690
第18回	利付国債(30年)	97,000,000	125,243,490
第19回	利付国債(30年)	98,000,000	126,751,240
第20回	利付国債(30年)	113,000,000	150,062,870
第21回	利付国債(30年)	112,000,000	145,323,360
第22回	利付国債(30年)	134,000,000	178,438,420
第23回	利付国債(30年)	138,000,000	184,082,340
第24回	利付国債(30年)	114,000,000	152,322,240
第25回	利付国債(30年)	130,000,000	169,360,100
第26回	利付国債(30年)	334,000,000	441,644,860
第27回	利付国債(30年)	323,000,000	433,801,920
第28回	利付国債(30年)	368,000,000	495,519,360
第29回	利付国債(30年)	261,000,000	347,333,580
第30回	利付国債(30年)	281,000,000	369,548,720
第31回	利付国債(30年)	265,000,000	344,462,900

第32回	利付国債(30年)	331,000,000	437,800,460
第33回	利付国債(30年)	367,000,000	464,827,520
第34回	利付国債(30年)	335,000,000	438,799,750
第35回	利付国債(30年)	366,000,000	465,614,220
第36回	利付国債(30年)	374,000,000	476,749,020
第37回	利付国債(30年)	386,000,000	484,557,380
第38回	利付国債(30年)	267,000,000	329,761,020
第39回	利付国債(30年)	244,000,000	307,008,120
第40回	利付国債(30年)	222,000,000	274,527,420
第41回	利付国債(30年)	231,000,000	280,579,530
第42回	利付国債(30年)	245,000,000	297,704,400
第43回	利付国債(30年)	241,000,000	292,964,420
第44回	利付国債(30年)	238,000,000	289,427,040
第45回	利付国債(30年)	267,000,000	312,381,990
第46回	利付国債(30年)	303,000,000	354,519,090
第47回	利付国債(30年)	288,000,000	343,771,200
第48回	利付国債(30年)	277,000,000	317,569,420
第49回	利付国債(30年)	276,000,000	316,378,800
第50回	利付国債(30年)	272,000,000	271,695,360
第51回	利付国債(30年)	174,000,000	152,109,060
第52回	利付国債(30年)	184,000,000	169,695,840
第53回	利付国債(30年)	166,000,000	156,948,020
第54回	利付国債(30年)	272,000,000	270,436,000
第55回	利付国債(30年)	163,000,000	161,870,410
第56回	利付国債(30年)	237,000,000	235,070,820
第57回	利付国債(30年)	265,000,000	262,522,250
第58回	利付国債(30年)	285,000,000	281,984,700
第44回	利付国債(20年)	5,000,000	5,176,000
第45回	利付国債(20年)	5,000,000	5,169,400
第46回	利付国債(20年)	3,000,000	3,111,630
第47回	利付国債(20年)	78,000,000	81,361,020
第48回	利付国債(20年)	66,000,000	69,645,840
第49回	利付国債(20年)	40,000,000	42,090,800
第50回	利付国債(20年)	54,000,000	56,569,860
第52回	利付国債(20年)	4,000,000	4,253,000
第53回	利付国債(20年)	4,000,000	4,274,440
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,071,700
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,151,960
第70回	利付国債(20年)	51,000,000	58,086,450
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	72,151,040
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,780,900
第76回	利付国債(20年)	8,000,000	8,995,680
第78回	利付国債(20年)	8,000,000	9,032,480
第80回	利付国債(20年)	8,000,000	9,138,160
第81回	利付国債(20年)	106,000,000	120,850,600
第82回	利付国債(20年)	126,000,000	144,515,700
第83回	利付国債(20年)	104,000,000	119,800,720
第84回	利付国債(20年)	136,000,000	155,696,880
第85回	利付国債(20年)	112,000,000	129,514,560
第86回	利付国債(20年)	104,000,000	121,791,280
第87回	利付国債(20年)	101,000,000	117,536,730
第88回	利付国債(20年)	220,000,000	258,735,400
第89回	利付国債(20年)	104,000,000	121,521,920
第90回	利付国債(20年)	331,000,000	388,474,840
第91回	利付国債(20年)	209,000,000	246,929,320
第92回	利付国債(20年)	431,000,000	504,123,460
第93回	利付国債(20年)	230,000,000	267,963,800
第94回	利付国債(20年)	332,000,000	389,562,160
第95回	利付国債(20年)	305,000,000	364,392,650
第96回	利付国債(20年)	174,000,000	204,904,140

第97回	利付国債(20年)	236,000,000	280,976,880
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	203,266,160
第99回	利付国債(20年)	387,000,000	458,703,360
第100回	利付国債(20年)	277,000,000	331,821,070
第101回	利付国債(20年)	224,000,000	272,484,800
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	220,914,120
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	204,660,690
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	160,920,000
第105回	利付国債(20年)	252,000,000	301,208,040
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	183,160,000
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	182,243,440
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	238,164,060
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	190,326,150
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	221,271,040
第111回	利付国債(20年)	145,000,000	176,411,350
第112回	利付国債(20年)	203,000,000	244,856,570
第113回	利付国債(20年)	225,000,000	272,047,500
第114回	利付国債(20年)	119,000,000	144,288,690
第115回	利付国債(20年)	66,000,000	80,745,060
第116回	利付国債(20年)	79,000,000	96,927,470
第117回	利付国債(20年)	126,000,000	153,192,060
第118回	利付国債(20年)	96,000,000	115,881,600
第119回	利付国債(20年)	68,000,000	80,539,200
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	102,172,400
第121回	利付国債(20年)	237,000,000	283,888,080
第122回	利付国債(20年)	154,000,000	182,685,580
第123回	利付国債(20年)	253,000,000	309,694,770
第124回	利付国債(20年)	149,000,000	180,632,700
第125回	利付国債(20年)	164,000,000	203,210,760
第126回	利付国債(20年)	147,000,000	178,506,510
第127回	利付国債(20年)	137,000,000	164,719,210
第128回	利付国債(20年)	238,000,000	286,761,440
第129回	利付国債(20年)	138,000,000	164,585,700
第130回	利付国債(20年)	233,000,000	278,241,610
第131回	利付国債(20年)	127,000,000	150,078,440
第132回	利付国債(20年)	169,000,000	200,035,160
第133回	利付国債(20年)	219,000,000	261,991,890
第134回	利付国債(20年)	190,000,000	227,538,300
第135回	利付国債(20年)	120,000,000	142,164,000
第136回	利付国債(20年)	126,000,000	147,650,580
第137回	利付国債(20年)	137,000,000	162,553,240
第138回	利付国債(20年)	145,000,000	168,139,100
第139回	利付国債(20年)	129,000,000	151,273,140
第140回	利付国債(20年)	373,000,000	442,930,040
第141回	利付国債(20年)	274,000,000	325,818,880
第142回	利付国債(20年)	169,000,000	203,244,470
第143回	利付国債(20年)	267,000,000	314,029,380
第144回	利付国債(20年)	173,000,000	201,100,390
第145回	利付国債(20年)	400,000,000	476,552,000
第146回	利付国債(20年)	347,000,000	413,918,950
第147回	利付国債(20年)	385,000,000	453,930,400
第148回	利付国債(20年)	329,000,000	383,196,170
第149回	利付国債(20年)	359,000,000	418,134,480
第150回	利付国債(20年)	361,000,000	415,052,530
第151回	利付国債(20年)	219,000,000	245,098,230
第152回	利付国債(20年)	219,000,000	244,909,890
第153回	利付国債(20年)	287,000,000	325,386,250
第154回	利付国債(20年)	220,000,000	245,812,600
第155回	利付国債(20年)	237,000,000	257,062,050
第156回	利付国債(20年)	210,000,000	206,650,500

	第157回 利付国債（20年）	218,000,000	206,596,420
	第158回 利付国債（20年）	235,000,000	234,041,200
	第159回 利付国債（20年）	235,000,000	237,516,850
	第160回 利付国債（20年）	339,000,000	347,752,980
	第161回 利付国債（20年）	289,000,000	290,944,970
	第162回 利付国債（20年）	334,000,000	335,416,160
	第163回 利付国債（20年）	347,000,000	347,891,790
	第164回 利付国債（20年）	245,000,000	240,548,350
国債証券 合計		55,245,000,000	61,070,828,590
地方債証券	第682回 東京都公募公債	300,000,000	305,267,100
	第697回 東京都公募公債	200,000,000	205,791,400
	第707回 東京都公募公債	200,000,000	205,796,000
	第708回 東京都公募公債	300,000,000	309,582,900
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	310,295,400
	平成22年度第12回 北海道公募公債	200,000,000	205,652,200
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	306,921,000
	第30回 神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,161,100
	第360回 大阪府公募公債（10年）	300,000,000	309,348,000
	第378回 大阪府公募公債（10年）	144,000,000	148,757,904
	第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	113,336,200
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	310,243,800
	第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	114,630,300
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	309,506,100
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	308,253,000
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	104,261,800
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	123,043,620
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	308,738,700
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	310,020,000
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	310,059,000
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	309,738,300
	第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,366,000
	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,875,500
	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,747,800
	平成22年度第1回 福島県公募公債	200,000,000	204,266,200
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	155,582,250
	第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	95,506,800
	第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	130,645,300
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	338,163,000
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	103,483,100
	平成22年度第1回 横浜市公募公債	300,000,000	306,195,900
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	206,255,400
	第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,919,500
	平成22年度第7回 札幌市公募公債	200,000,000	203,853,000
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	155,388,600
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	153,703,350
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	205,898,000
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	103,156,100
	平成22年度第6回 広島市公募公債	200,000,000	206,191,000
	平成22年度第1回 相模原市公募公債	100,000,000	102,695,800
	平成22年度第1回 岡山県公募公債	200,000,000	204,286,400
地方債証券 合計		8,613,000,000	8,962,582,824
特殊債券	第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	206,355,000
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	330,699,600
	第107回 政保道路機構債券	315,000,000	321,632,325
	第137回 政保道路機構債券	400,000,000	413,220,000
	第139回 政保道路機構債券	500,000,000	515,629,500
	第155回 政保道路機構債券	300,000,000	309,057,300
	第163回 政保道路機構債券	300,000,000	310,000,800
	第190回 政保道路機構債券	500,000,000	514,459,500
	第212回 政保道路機構債券	100,000,000	115,521,300

第218回	政保道路機構債券	500,000,000	518,410,500		
第233回	政府道路機構債券	100,000,000	112,813,000		
第278回	政保道路機構債券	100,000,000	94,562,000		
第12回	政保地方公共団体金融機構債券	313,000,000	319,497,567		
第12回	地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,173,600		
第25回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,509,200		
第36回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,598,600		
第48回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,570,400		
第48回	地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,977,200		
第72回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,427,800		
第5回	政保阪神高速道路債券	140,000,000	142,570,540		
第35回	日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,591,700		
第133回	住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,035,124,000		
第37回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,316,000	37,608,008		
第42回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	95,230,000	100,677,156		
第46回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	115,647,000	124,204,878		
第54回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	93,350,000	98,941,665		
第55回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	101,214,000	107,043,926		
第60回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	103,056,000	108,888,968		
第61回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,792,000	52,386,163		
第62回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	423,912,000	445,022,817		
第63回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	262,860,000	274,557,270		
第73回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	169,185,000	178,371,745		
第78回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	155,172,000	161,751,292		
第19回	沖縄振興開発金融公庫債券	300,000,000	311,400,600		
い第778号	利付農林債券	300,000,000	301,047,300		
い第779号	利付農林債券	300,000,000	301,134,900		
第333回	利付しんきん中金債券	100,000,000	100,041,200		
第335回	利付しんきん中金債券	100,000,000	100,082,300		
第336回	利付しんきん中金債券	100,000,000	100,080,000		
第4回	広島高速道路債券	200,000,000	206,293,400		
第45回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,288,200		
第55回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,465,600		
特殊債券 合計		9,972,734,000	10,327,688,820		
社債券	第3回	ノルデア・バンク	200,000,000	210,754,200	
	第5回	スヴェンスカ・ハンデルスバンク	200,000,000	203,355,000	
	第16回	中日本高速道路債券	500,000,000	509,485,500	
	第33回	中日本高速道路債券	300,000,000	308,932,500	
	第56回	中日本高速道路債券	200,000,000	206,873,600	
	第60回	中日本高速道路債券	100,000,000	102,622,200	
	第20回	西日本高速道路債券	100,000,000	103,333,500	
	第25回	西日本高速道路債券	200,000,000	205,014,800	
	第26回	西日本高速道路債券	200,000,000	206,251,200	
	第14回	森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,557,600	
	第12回	オリエンタルランド	100,000,000	101,074,900	
	第3回	富士フィルムホールディングス	300,000,000	309,385,800	
	第68回	新日本製鐵	200,000,000	205,834,800	
	第19回	豊田自動織機	200,000,000	205,979,800	
	第24回	豊田自動織機	100,000,000	103,178,200	
	第71回	伊藤忠商事	200,000,000	206,196,000	
	第39回	住友商事	100,000,000	105,331,300	
	第45回	住友商事	100,000,000	103,465,900	
	第46回	住友商事	100,000,000	103,112,000	
	第79回	三菱商事	100,000,000	103,303,300	
第1回	三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	102,675,200		

第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	206,633,800	
第1回 三井住友フィナンシャルグループ 劣後特約付	100,000,000	102,927,400	
第9回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	200,000,000	207,793,800	
第23回 三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	103,296,000	
第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	104,685,500	
第173回 オリックス	100,000,000	101,128,000	
第27回 三菱UFJリース	100,000,000	101,010,100	
第46回 三井不動産	100,000,000	103,331,200	
第111回 三菱地所	100,000,000	103,230,200	
第75回 東京急行電鉄	100,000,000	103,135,100	
第77回 東京急行電鉄	100,000,000	103,966,800	
第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	104,588,800	
第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,393,300	
第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	206,202,400	
第27回 西日本旅客鉄道	100,000,000	102,125,900	
第19回 KDDI	100,000,000	101,756,900	
第483回 関西電力	200,000,000	204,177,200	
第381回 中国電力	200,000,000	208,299,400	
第304回 北陸電力	100,000,000	104,176,700	
第306回 北陸電力	100,000,000	103,741,600	
第253回 四国電力	200,000,000	208,221,400	
第429回 九州電力	200,000,000	207,855,800	
第290回 北海道電力	200,000,000	209,813,600	
第13回 電源開発	100,000,000	111,487,900	
第19回 大阪瓦斯	100,000,000	102,434,700	
社債券 合計	7,000,000,000	7,228,130,800	
合計	80,830,734,000	87,589,231,034	

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。

「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	112,422,984
コール・ローン	156,414,598
投資証券	17,146,099,070
未収配当金	91,860,624
流動資産合計	17,506,797,276
資産合計	17,506,797,276
負債の部	
流動負債	
未払金	77,893,800
未払解約金	40,589,882
その他未払費用	4,427
流動負債合計	118,488,109
負債合計	118,488,109
純資産の部	
元本等	
元本	11,518,929,567
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	5,869,379,600
純資産合計	17,388,309,167
負債純資産合計	17,506,797,276

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	11,518,929,567口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5095円 (15,095円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 2017年11月17日 至 2018年11月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年11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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2018年11月20日現在)	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券		87,179,958
合計		87,179,958

(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)

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	(2018年11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	11,278,681,450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	4,955,574,503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	4,715,326,386円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,702,001,026円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,029,916,722円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	5,938,188,472円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,915,320,160円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	654,619,964円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	248,488,740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)	16,289,044円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,945,644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)	702,607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)	1,022,448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)	10,434,740円
計	11,518,929,567円

附属明細表(2018年11月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
投資証券	CRE ロジスティクスファンド投資法人	196	20,658,400	
	GLP 投資法人	4,858	560,613,200	
	MCUBS MidCity 投資法人	2,209	194,392,000	
	One リート投資法人	286	73,301,800	
	いちごオフィスリート投資法人	1,626	152,681,400	
	いちごホテルリート投資法人	343	46,236,400	
	さくら総合リート投資法人	424	36,760,800	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	939	442,738,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,911	569,478,000	
	イオンリート投資法人	2,012	255,322,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	11,621	194,884,170	
	インヴィンシブル投資法人	6,861	319,036,500	
	オリックス不動産投資法人	3,906	702,689,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,254	145,213,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	606	442,380,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,163	199,687,100	
	ケネディクス商業リート投資法人	719	176,298,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	748	208,168,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	392	35,280,000	
	ザイマックス・リート投資法人	181	20,597,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,677	451,321,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,756	264,980,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,960	1,209,320,000	
	スターアジア不動産投資法人	609	64,371,300	
	スターツプロシード投資法人	309	52,097,400	
	タカラレーベン不動産投資法人	293	26,135,600	
	トーセイ・リート投資法人	377	41,243,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,585	262,159,000	
	フロンティア不動産投資法人	667	291,145,500	
	プレミアム投資法人	1,864	227,035,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	260	29,198,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	169	18,302,700	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,324	775,293,200	
	ラサールロジポート投資法人	1,479	158,400,900	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	303	27,391,200	
	阪急阪神リート投資法人	813	117,966,300	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	335	112,057,500	
	三菱地所物流リート投資法人	207	52,081,200	
	産業ファンド投資法人	2,284	252,838,800	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	460	62,744,000	
	森トラスト総合リート投資法人	1,401	228,643,200	
	森ヒルズリート投資法人	2,248	309,100,000	
星野リゾート・リート投資法人	298	160,920,000		
積水ハウス・リート投資法人	5,058	350,013,600		
大江戸温泉リート投資法人	316	27,460,400		
大和ハウスリート投資法人	2,455	609,822,000		
大和証券オフィス投資法人	452	327,700,000		
投資法人みらい	528	96,993,600		

東急リアル・エステート投資法人	1,314	212,211,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	651	345,030,000	
日本ビルファンド投資法人	1,898	1,303,926,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,241	532,389,000	
日本プロロジスリート投資法人	2,630	620,417,000	
日本ヘルスケア投資法人	90	15,408,000	
日本リート投資法人	633	232,944,000	
日本リテールファンド投資法人	3,705	822,510,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,294	292,444,000	
日本賃貸住宅投資法人	2,205	196,024,500	
福岡リート投資法人	1,014	171,366,000	
平和不動産リート投資法人	1,221	138,827,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	5,811	859,446,900	
投資証券 合計	104,449	17,146,099,070	
合計	104,449	17,146,099,070	

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。

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（2018年11月21日から2019年5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。

【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) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,933	179
コール・ローン	6,863	21,809
親投資信託受益証券	10,125,134	19,597,130
未収入金	2,936	103,635
流動資産合計	10,139,866	19,722,753
資産合計		
	10,139,866	19,722,753
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,508	103,134
未払受託者報酬	879	1,694
未払委託者報酬	11,106	20,589
その他未払費用	325	710
流動負債合計	14,818	126,127
負債合計		
	14,818	126,127
純資産の部		
元本等		
元本	10,011,335	18,924,836
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	113,713	671,790
純資産合計	10,125,048	19,596,626
負債純資産合計	10,139,866	19,722,753

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期中間計算期間 (自2017年11月17日 至2018年 5月16日)	第2期中間計算期間 (自2018年11月21日 至2019年 5月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	39,800	375,140
営業収益合計	39,800	375,140
営業費用		
受託者報酬	272	1,694
委託者報酬	3,808	20,589
その他費用	69	710
営業費用合計	4,149	22,993
営業利益又は営業損失()	35,651	352,147
経常利益又は経常損失()	35,651	352,147
中間純利益又は中間純損失()	35,651	352,147
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()	1,525	16,056
期首剰余金又は期首欠損金()	-	113,713
剰余金増加額又は欠損金減少額	56,878	242,264
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	56,878	242,264
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,227	20,278
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,227	20,278
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()	87,827	671,790

(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1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
1. 受益権総口数	10,011,335口	18,924,836口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0114円 (10,114円)	1.0355円 (10,355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1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5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1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
期首元本額	1,000,000円	10,011,335円
期中追加設定元本額	10,339,331円	10,452,446円
期中一部解約元本額	1,327,996円	1,538,945円

< 参考 >

開示対象ファンド（ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式ノリートノ債券））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、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」-REIT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、すべて各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。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	471,797,753	15,030,547
コール・ローン	656,414,314	1,829,389,428
株式	54,651,417,270	55,449,535,440
派生商品評価勘定	2,849,740	3,358,800
未収配当金	473,077,219	661,002,945
前払金	9,685,000	43,260,000
差入委託証拠金	44,625,000	77,520,000
流動資産合計	56,309,866,296	58,079,097,160
資産合計	56,309,866,296	58,079,097,160
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,605,640	50,500,880
未払解約金	118,516,537	142,805,449
その他未払費用	36,709	8,704
流動負債合計	145,158,886	193,315,033
負債合計	145,158,886	193,315,033
純資産の部		
元本等		
元本	33,015,590,469	35,097,981,789
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	23,149,116,941	22,787,800,338
純資産合計	56,164,707,410	57,885,782,127
負債純資産合計	56,309,866,296	58,079,097,160

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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	33,015,590,469口	35,097,981,789口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7012円 (17,012円)	1.6493円 (16,493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	（2018年11月20日現在）	（2019年5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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	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	(2018年11月20日 現在)				(2019年5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	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	2,408,380,000	-	2,361,320,000	47,060,000
合計	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	2,408,380,000	-	2,361,320,000	47,060,000

(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5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	25,660,183,895円	33,015,590,469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	15,502,337,729円	7,232,372,917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	8,146,931,155円	5,149,981,597円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,091,055,877円	6,760,423,316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)	5,174,155,540円	4,817,829,059円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,502,125円	3,160,912円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,135,818円	4,187,559円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,126,664,808円	1,234,953,483円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,002,161,723円	4,434,688,167円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,800,194,280円	3,038,984,221円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	12,096,632円	12,356,142円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,290,695円	42,971,266円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,317,865円	51,465,149円
DCニッセイ国内株式インデックス	145,946,565円	262,087,309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	12,044,346,864円	13,663,052,117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)	407,253,399円	515,353,988円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	17,881,836円	45,078,704円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,201,733円	18,010,073円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,809,183円	31,085,591円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	14,634,712円	62,337,095円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,304,455円	17,865,985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)	14,120,028円	28,022,953円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,504,084円	25,760,807円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,655,590円	2,470,899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)	598,026円	794,757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)	880,678円	1,717,293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)	8,877,953円	14,639,310円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	2,733,707円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	1,316,272円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	2,121,977円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	2,513,678円
計	33,015,590,469円	35,097,981,789円

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	276,927,062	6,052,303
コール・ローン	385,289,854	736,634,521
国債証券	61,070,828,590	62,110,178,250
地方債証券	8,962,582,824	8,334,478,411
特殊債券	10,327,688,820	8,641,735,976
社債券	7,228,130,800	6,283,877,400
未収利息	227,564,980	205,435,750
前払費用	1,137,409	5,939,660
流動資産合計	88,480,150,339	86,324,332,271
資産合計	88,480,150,339	86,324,332,271
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,989,115	3,020,465
その他未払費用	12,309	3,827
流動負債合計	3,001,424	3,024,292
負債合計	3,001,424	3,024,292
純資産の部		
元本等		
元本	91,553,091,806	87,570,499,781
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,075,942,891	1,249,191,802
純資産合計	88,477,148,915	86,321,307,979
負債純資産合計	88,480,150,339	86,324,332,271

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	91,553,091,806口	87,570,499,781口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	3,075,942,891円	1,249,191,802円
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9664円 (9,664円)	0.9857円 (9,857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	（2018年11月20日現在）	（2019年5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	<p>(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。</p>	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)

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	(2018年11月20日現在)	(2019年5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	139,680,390,792円	91,553,091,806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	3,099,164,197円	4,005,824,383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	51,226,463,183円	7,988,416,408円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	90,032,868,109円	85,357,646,489円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,198,123,874円	1,489,109,530円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	6,925,913円	17,755,847円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	196,812,753円	375,537,644円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	5,784,972円	18,626,544円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	13,759,679円	62,099,571円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,804,002円	149,370,094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)	25,017,328円	48,440,017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)	2,688,418円	3,453,088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)	7,329,823円	13,927,152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)	15,976,935円	25,414,980円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	876,295円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	643,042円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	1,475,769円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	6,123,719円
計	91,553,091,806円	87,570,499,781円

「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	112,422,984	2,645,643
コール・ローン	156,414,598	322,004,973
投資証券	17,146,099,070	21,189,129,280
未収配当金	91,860,624	153,118,799
流動資産合計	17,506,797,276	21,666,898,695
資産合計	17,506,797,276	21,666,898,695
負債の部		
流動負債		
未払金	77,893,800	89,977,885
未払解約金	40,589,882	103,547,287
その他未払費用	4,427	1,987
流動負債合計	118,488,109	193,527,159
負債合計	118,488,109	193,527,159
純資産の部		
元本等		
元本	11,518,929,567	12,840,999,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,869,379,600	8,632,372,402
純資産合計	17,388,309,167	21,473,371,536
負債純資産合計	17,506,797,276	21,666,898,695

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	投資証券 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、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. 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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	11,518,929,567口	12,840,999,134口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5095円 (15,095円)	1.6723円 (16,723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	（2018年11月20日現在）	（2019年5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ぬ。	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
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つた場合、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)

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	(2018年11月20日現在)	(2019年5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	11,278,681,450円	11,518,929,567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	4,955,574,503円	3,526,965,072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	4,715,326,386円	2,204,895,505円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,702,001,026円	1,675,485,344円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,029,916,722円	1,369,747,280円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	5,938,188,472円	6,181,801,175円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,915,320,160円	1,884,489,800円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	654,619,964円	1,283,422,186円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	248,488,740円	395,850,585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)	16,289,044円	29,470,708円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,945,644円	2,615,458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)	702,607円	840,183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)	1,022,448円	1,815,946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)	10,434,740円	15,460,469円
計	11,518,929,567円	12,840,999,134円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）」

（2019年5月31日現在）

資産総額	20,148,735円
負債総額	12,733円
純資産総額（ - ）	20,136,002円
発行済数量	19,488,759口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0332円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限

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

(4) 受益権の譲渡

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

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

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2019年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集し、その議長を務めます。

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年5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	394	58,897
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	102	23,975
単位型公社債投資信託	2	85
合計	498	82,957

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

3【委託会社等の経理状況】

1.財務諸表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24期事業年度（自2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

純資産の部

株主資本

資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	41,733,107	45,192,421
利益剰余金合計	42,412,914	45,872,228
株主資本合計	60,694,754	64,154,068

評価・換算差額等

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

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

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位：千円)

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

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

（表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

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

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

2021年4月1日以後開始する会計年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

（貸借対照表関係）

- 1．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

- 1．固定資産売却益の内訳は以下のとおりであります。

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

- 2．固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2017年6月23日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,278,000千円
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

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

2018年6月22日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

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

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2018年6月22日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

2019年3月19日開催の臨時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2019年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	未定 千円
配当の原資	未定
1株当たり配当額	未定 円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	19,824,114	19,824,114	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,102,076	7,115,800	13,723
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,652,704	14,687,680	34,975
その他有価証券	19,735,292	19,735,292	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	103,394	103,394	-

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

現金・預金

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

有価証券

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

また、関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2018年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	19,824,114	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	7,100,000	14,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	2,896,071	14,413,880	2,089,902	299,797
合計	29,820,185	29,063,880	2,089,902	299,797

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2019年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2018年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	15,606,746	15,660,060	53,313
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	15,606,746	15,660,060	53,313
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	6,148,033	6,143,420	4,613
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,148,033	6,143,420	4,613
合計		21,754,780	21,803,480	48,699

当事業年度(2019年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式(前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、当事業年度の貸借対照表計上額は-千円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	344,430	201,537	107
合計	344,430	201,537	107

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

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

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）株価指数先物関連

前事業年度（2018年3月31日）

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

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

当事業年度（2019年3月31日）

該当事項はありません。

（2）通貨関連

前事業年度（2018年3月31日）

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

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度（2019年3月31日）

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

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

(退職給付関係)

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 248,707 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、54,955千円であります。

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 229,805 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、58,788千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2017年4月1日 至2018年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
前事業年度（自2017年4月1日 至2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	150,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,608,592	未収運用受託報酬	833,260
								投資助言報酬の受取	132,212	未収投資助言報酬	11,876

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	566,896円85銭	597,720円47銭
1株当たり当期純利益金額	76,697円61銭	78,626円78銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

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

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2019年3月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2019年3月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(資本金の額：2019年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
光世証券株式会社	12,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	

(3) 投資助言会社（参考情報）

a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

b. 資本金の額

2019年3月末現在、450百万円

c. 事業の内容

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

(3) 投資助言会社（参考情報）

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

3【資本関係】

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

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

第3【その他】

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

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

独立監査人の監査報告書

2019年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2018年12月25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 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)の2017年11月17日から2018年11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・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)の2018年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

2019年6月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）の2018年11月21日から2019年5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・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）の2019年5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（2018年11月21日から2019年5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

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