

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年2月20日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 西 啓介
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【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】</b>	ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債 券）
<b>【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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：2020年2月21日(金)～2020年8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

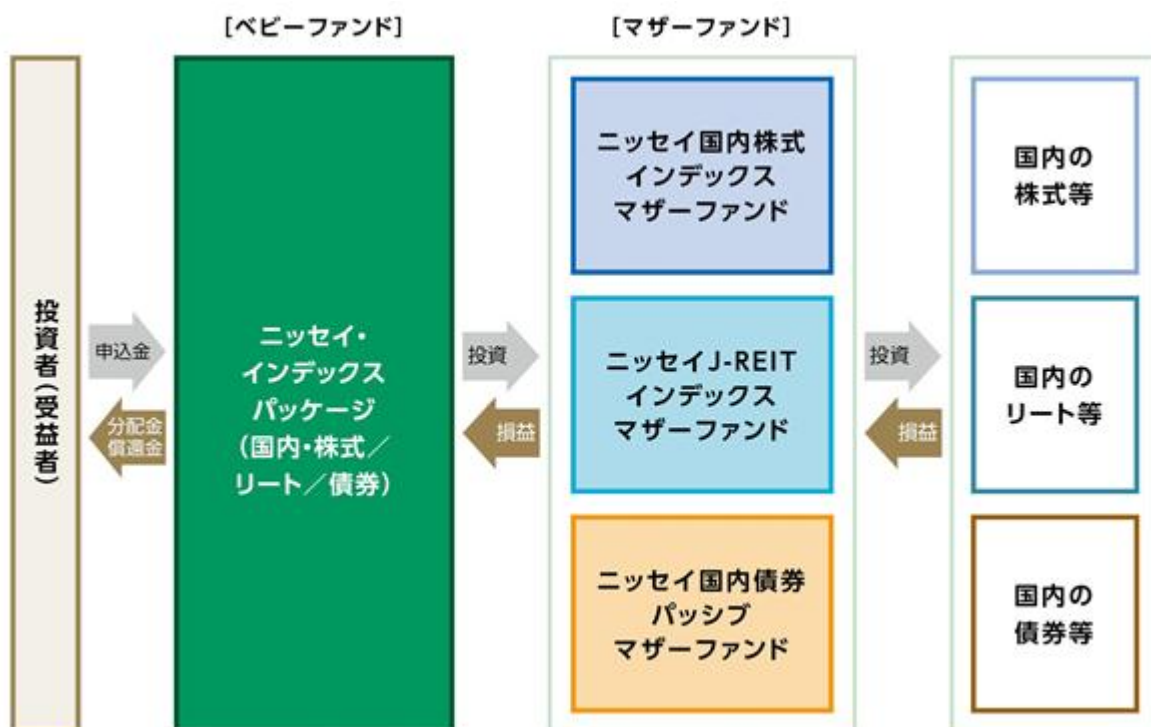
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 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。

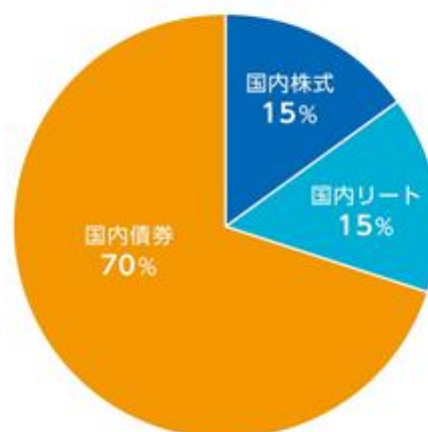
## 〈各マザーファンドの運用プロセス〉

**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<sup>®</sup>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す）。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	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。

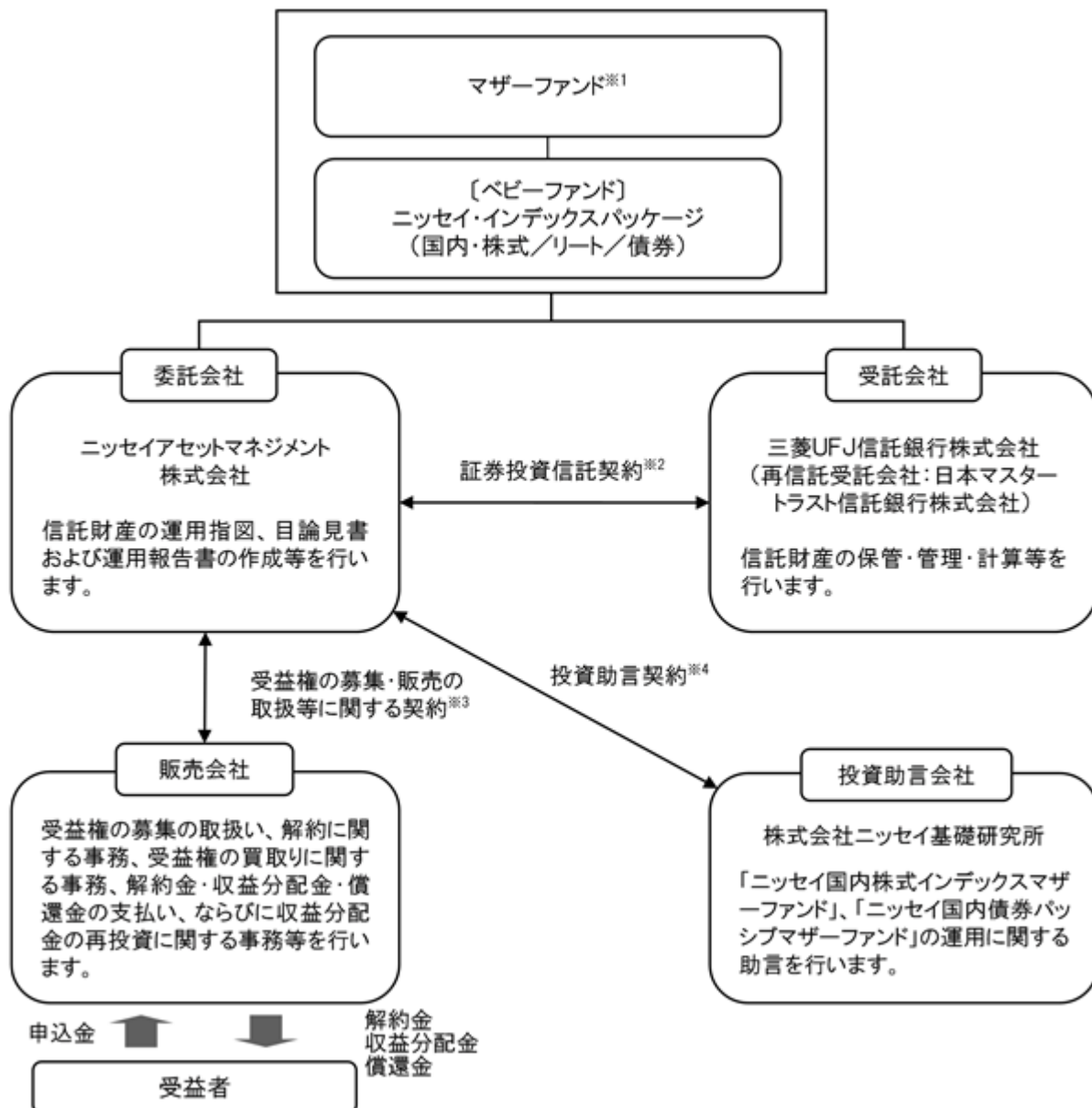
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、  
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

## (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11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

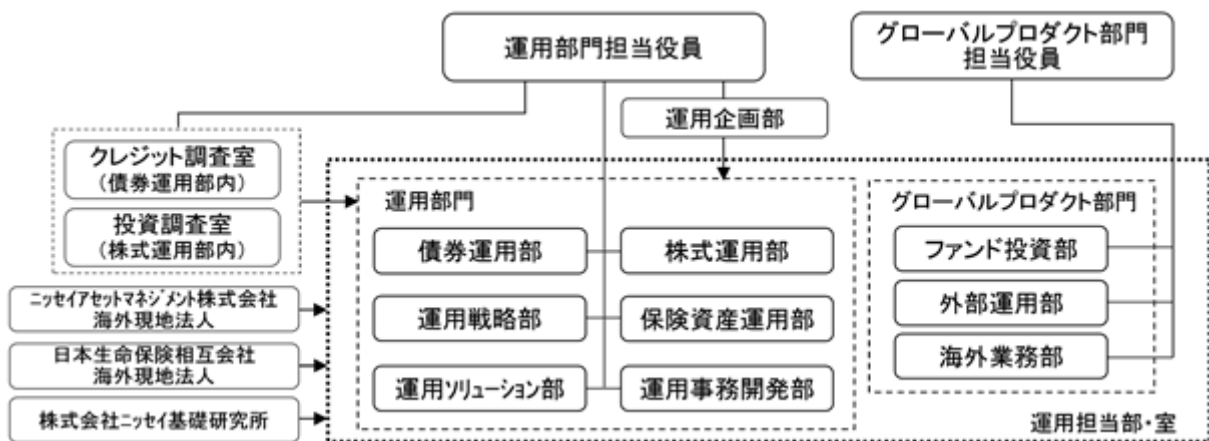
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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。

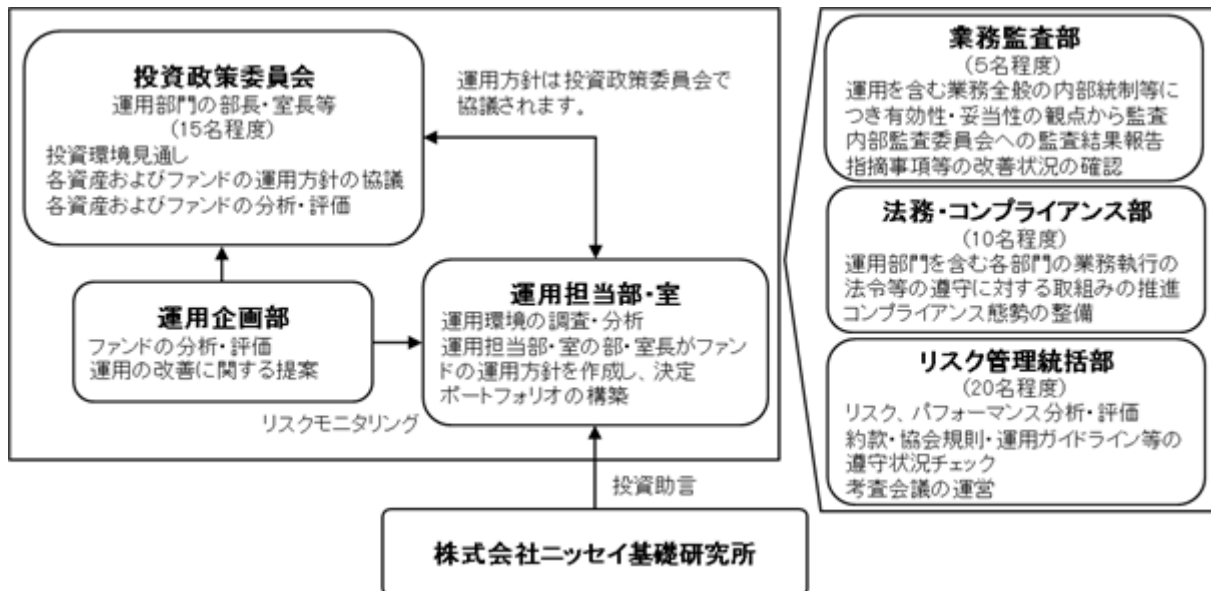
### （3）【運用体制】

#### 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



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

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。

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

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。

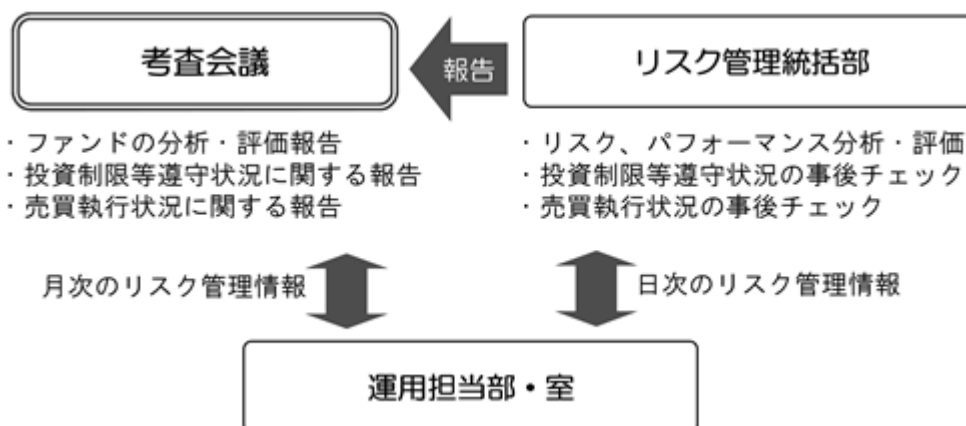
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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2019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3.1%)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



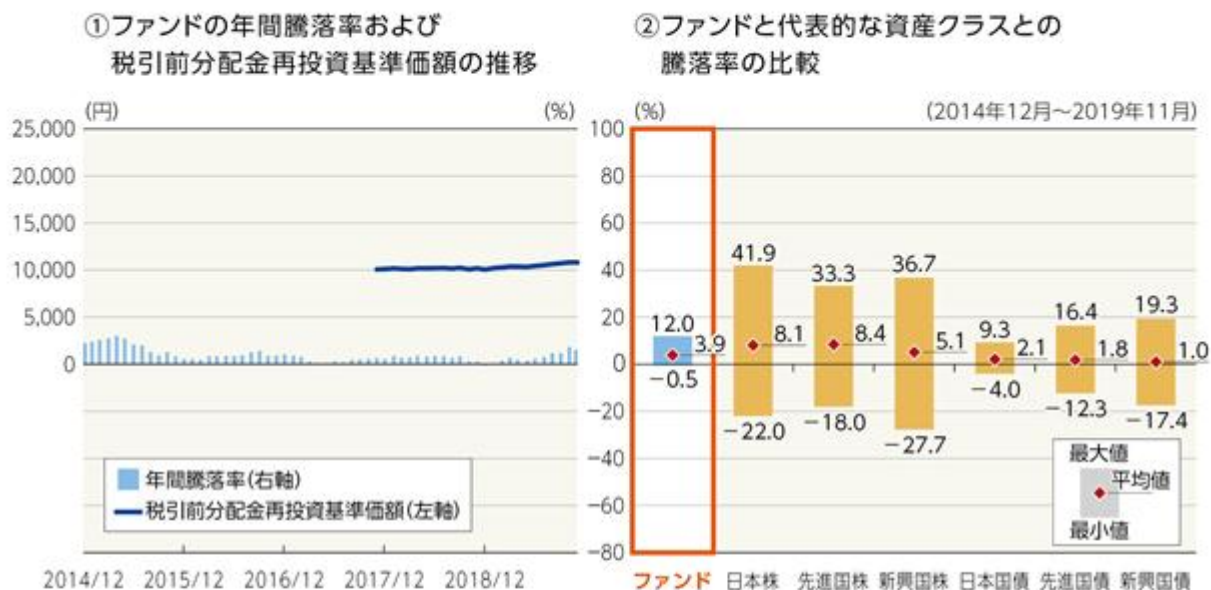
1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。

- ・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。



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年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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。

**1** 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)の高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0.3102%（税抜0.282%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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 0.0022% （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。

## &lt;ご参考&gt;

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

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



## （５）【課税上の取扱い】

## 課税対象

- 分配時：分配時の「普通分配金」に対して課税されます。  
「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。
- 解約請求・償還時：個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額の差益に対して課税されます。  
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。
- 買取請求時：買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

## 個人の課税の取扱い

- 分配時：分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。  
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。  
外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。
- 解約請求・償還・買取請求時：解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。

## 税率（個人）

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

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

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

## &lt; 少額投資非課税制度について &gt;

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

## 法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）」

(2019年11月29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	35,928,664	100.00
内 日本	35,928,664	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	313	0.00
純資産総額	35,928,351	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11月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	66,339,785,980	97.89
内 日本	66,339,785,980	97.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,426,746,394	2.11
純資産総額	67,766,532,374	100.00

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

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,578,210,000	2.33
内 日本	1,578,210,000	2.33

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

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

## (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11月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	58,038,344,910	72.50
内 日本	58,038,344,910	72.50
地方債証券	7,228,281,958	9.03
内 日本	7,228,281,958	9.03
特殊債券	8,346,416,009	10.43
内 日本	8,346,416,009	10.43
社債券	5,748,384,800	7.18
内 日本	5,134,698,400	6.41
内 スウェーデン	412,333,400	0.52
内 フランス	201,353,000	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	690,156,115	0.86
純資産総額	80,051,583,792	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11月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	31,588,501,490	98.72
内 日本	31,588,501,490	98.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	411,109,371	1.28
純資産総額	31,999,610,861	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】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 「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11月29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	25,331,502	0.9942 25,185,495	0.9938 25,174,446	- -	70.07%
2	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,978,725	1.8153 5,407,414	1.8239 5,432,896	- -	15.12%
3	ニッセイ」-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	2,749,043	1.9386 5,329,562	1.9357 5,321,322	- -	14.81%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

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

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

(参考情報)

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

(2019年11月29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	308,000	6,798.72 2,094,007,148	7,638.00 2,352,504,000	- -	3.47%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	174,700	5,311.37 927,896,841	6,904.00 1,206,128,800	- -	1.78%
3	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	1,876,800	579.22 1,087,084,346	578.10 1,084,978,080	- -	1.60%
4	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	230,000	4,394.74 1,010,791,660	4,455.00 1,024,650,000	- -	1.51%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	181,300	4,732.60 858,020,770	5,527.00 1,002,045,100	- -	1.48%
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	25,000	31,372.96 784,324,009	37,440.00 936,000,000	- -	1.38%
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	215,200	5,168.06 1,112,168,059	4,253.00 915,245,600	- -	1.35%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	188,600	4,009.09 756,114,517	3,989.00 752,325,400	- -	1.11%

9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	189,200	3,083.57 583,411,656	3,962.00 749,610,400	- -	1.11%
10	任天堂 日本	株式 その他製品	17,000	31,332.60 532,654,339	42,350.00 719,950,000	- -	1.06%
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	217,700	3,001.23 653,368,361	3,067.00 667,685,900	- -	0.99%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	202,100	2,719.89 549,691,097	3,139.00 634,391,900	- -	0.94%
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,704,700	174.01 644,676,616	169.20 626,835,240	- -	0.92%
14	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	200,400	2,650.85 531,231,090	3,003.00 601,801,200	- -	0.89%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	97,500	5,566.23 542,707,729	5,952.00 580,320,000	- -	0.86%
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	132,800	3,587.24 476,386,214	4,300.00 571,040,000	- -	0.84%
17	花王 日本	株式 化学	66,200	8,309.25 550,073,010	8,612.00 570,114,400	- -	0.84%
18	信越化学工業 日本	株式 化学	47,700	9,678.20 461,650,244	11,710.00 558,567,000	- -	0.82%
19	HOYA 日本	株式 精密機器	55,700	6,954.18 387,348,167	9,990.00 556,443,000	- -	0.82%
20	ダイキン工業 日本	株式 機械	35,200	12,518.29 440,644,146	15,745.00 554,224,000	- -	0.82%
21	ファナック 日本	株式 電気機器	26,300	19,433.46 511,100,206	20,905.00 549,801,500	- -	0.81%
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	191,000	3,205.83 612,314,940	2,866.00 547,406,000	- -	0.81%
23	第一三共 日本	株式 医薬品	79,100	4,194.95 331,820,810	6,862.00 542,784,200	- -	0.80%
24	日本電産 日本	株式 電気機器	33,300	13,532.17 450,621,589	16,190.00 539,127,000	- -	0.80%
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	81,200	5,719.30 464,407,869	6,344.00 515,132,800	- -	0.76%
26	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	23,000	24,530.71 564,206,330	22,095.00 508,185,000	- -	0.75%
27	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	48,700	10,574.62 514,984,402	10,070.00 490,409,000	- -	0.72%
28	三井物産 日本	株式 卸売業	239,300	1,800.99 430,978,808	1,939.50 464,122,350	- -	0.68%
29	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	190,400	2,036.00 387,654,650	2,388.00 454,675,200	- -	0.67%
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	243,200	1,689.90 410,983,760	1,867.50 454,176,000	- -	0.67%

(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	13.91
		情報・通信業	8.36
		輸送用機器	7.66
		化学	7.01
		医薬品	5.89
		銀行業	5.73
		サービス業	5.03
		機械	5.01
		卸売業	4.85
		小売業	4.60
		陸運業	4.46
		食料品	3.82
		建設業	2.72
		不動産業	2.36
		精密機器	2.30
		その他製品	2.28
		保険業	2.24
		電気・ガス業	1.51
		その他金融業	1.15
		ガラス・土石製品	0.83
		証券、商品先物取引業	0.82
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.75
		ゴム製品	0.74
		繊維製品	0.58
		金属製品	0.57
		空運業	0.50
		石油・石炭製品	0.49
		鉱業	0.27
		パルプ・紙	0.24
倉庫・運輸関連業	0.18		
海運業	0.17		
水産・農林業	0.10		
	小計		97.89
合 計（対純資産総額比）			97.89

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

（2019年11月29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 (%)	投資 比率
				簿価金額 (円)	評価金額 (円)	償還日	
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	102.77 1,027,738,000	0.828000 2023/5/19	1.28%
2	第350回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	814,000,000	101.68 827,675,200	102.27 832,485,940	0.100000 2028/3/20	1.04%
3	第344回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	672,000,000	101.94 685,036,800	102.03 685,655,040	0.100000 2026/9/20	0.86%
4	第351回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	650,000,000	101.58 660,270,000	102.20 664,352,000	0.100000 2028/6/20	0.83%
5	第346回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	647,000,000	101.94 659,597,090	102.22 661,369,870	0.100000 2027/3/20	0.83%

6	第349回 利付国債（10年） 日本	国債証券	646,000,000	101.77 657,434,200	102.28 660,767,560	0.100000 2027/12/20	0.83%
7	第348回 利付国債（10年） 日本	国債証券	624,000,000	101.85 635,544,000	102.29 638,327,040	0.100000 2027/9/20	0.80%
8	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	620,000,000	101.91 631,886,240	101.99 632,338,000	0.100000 2026/6/20	0.79%
9	第347回 利付国債（10年） 日本	国債証券	616,000,000	101.92 627,827,200	102.25 629,915,440	0.100000 2027/6/20	0.79%
10	第352回 利付国債（10年） 日本	国債証券	616,000,000	101.48 625,116,800	102.13 629,170,080	0.100000 2028/9/20	0.79%
11	第342回 利付国債（10年） 日本	国債証券	613,000,000	101.84 624,319,520	101.91 624,720,560	0.100000 2026/3/20	0.78%
12	第345回 利付国債（10年） 日本	国債証券	593,000,000	101.98 604,766,960	102.14 605,719,850	0.100000 2026/12/20	0.76%
13	第353回 利付国債（10年） 日本	国債証券	576,000,000	101.64 585,486,320	102.10 588,130,560	0.100000 2028/12/20	0.73%
14	第340回 利付国債（10年） 日本	国債証券	566,000,000	103.69 586,885,400	103.52 585,923,200	0.400000 2025/9/20	0.73%
15	第341回 利付国債（10年） 日本	国債証券	552,000,000	103.15 569,388,000	103.06 568,896,720	0.300000 2025/12/20	0.71%
16	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	536,000,000	103.54 554,974,400	103.36 554,041,760	0.400000 2025/6/20	0.69%
17	第138回 利付国債（5年） 日本	国債証券	539,000,000	101.55 547,361,580	101.18 545,376,370	0.100000 2023/12/20	0.68%
18	第396回 利付国債（2年） 日本	国債証券	528,000,000	100.47 530,500,400	100.28 529,515,360	0.100000 2021/1/1	0.66%
19	第355回 利付国債（10年） 日本	国債証券	518,000,000	102.64 531,703,900	101.92 527,981,860	0.100000 2029/6/20	0.66%
20	第399回 利付国債（2年） 日本	国債証券	520,000,000	100.48 522,546,380	100.37 521,934,400	0.100000 2021/4/1	0.65%
21	第131回 利付国債（5年） 日本	国債証券	516,000,000	100.89 520,592,400	100.66 519,446,880	0.100000 2022/3/20	0.65%
22	第354回 利付国債（10年） 日本	国債証券	508,000,000	101.98 518,100,280	102.02 518,261,600	0.100000 2029/3/20	0.65%
23	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	102.88 514,414,500	0.660000 2024/5/31	0.64%
24	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	102.11 510,580,500	0.605000 2023/5/31	0.64%
25	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	101.86 509,304,000	1.100000 2021/7/30	0.64%

26	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	491,000,000	103.40 507,694,000	103.21 506,766,010	0.400000 2025/3/20	0.63%
27	第401回 利付国債(2年) 日本	国債証券	501,000,000	100.61 504,061,110	100.41 503,099,190	0.100000 2021/6/1	0.63%
28	第400回 利付国債(2年) 日本	国債証券	492,000,000	100.58 494,853,600	100.39 493,948,320	0.100000 2021/5/1	0.62%
29	第127回 利付国債(5年) 日本	国債証券	491,000,000	100.50 493,455,000	100.35 492,718,500	0.100000 2021/3/20	0.62%
30	第113回 利付国債(20年) 日本	国債証券	389,000,000	123.06 478,703,400	121.53 472,759,480	2.100000 2029/9/20	0.59%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	72.50
		地方債証券	9.03
		特殊債証券	10.43
		社債証券	6.41
	小計	98.37	
	外国	社債証券	0.77
小計	0.77		
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。

### (参考情報)

#### 「ニッセイ」- REITインデックス マザーファンド」

(2019年11月29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	2,708	784,036.09 2,123,169,749	822,000.00 2,225,976,000	- -	6.96%
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,797	701,950.84 1,963,356,510	745,000.00 2,083,765,000	- -	6.51%
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	8,721	191,202.55 1,667,477,471	199,800.00 1,742,455,800	- -	5.45%
4	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,572	232,765.45 1,296,969,098	240,700.00 1,341,180,400	- -	4.19%
5	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	6,279	210,388.16 1,321,027,276	213,000.00 1,337,427,000	- -	4.18%
6	日本リテールファンド投資 法人 日本	投資証券	5,285	241,252.84 1,275,021,264	249,300.00 1,317,550,500	- -	4.12%
7	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	4,018	287,780.20 1,156,300,852	293,700.00 1,180,086,600	- -	3.69%
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,770	295,161.10 1,112,757,367	299,400.00 1,128,738,000	- -	3.53%
9	GLP投資法人 日本	投資証券	6,965	131,762.82 917,728,042	145,600.00 1,014,104,000	- -	3.17%
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	2,652	339,861.37 901,312,364	353,500.00 937,482,000	- -	2.93%



11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,770	486,331.99 860,807,632	498,500.00 882,345,000	- -	2.76%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,009	85,082.51 766,508,422	89,700.00 808,107,300	- -	2.53%
13	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,267	62,285.88 764,060,973	65,100.00 798,581,700	- -	2.50%
14	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,401	550,677.67 771,499,424	565,000.00 791,565,000	- -	2.47%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,177	92,091.57 753,032,828	96,800.00 791,533,600	- -	2.47%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	865	806,731.22 697,822,509	829,000.00 717,085,000	- -	2.24%
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	929	660,622.92 613,718,698	688,000.00 639,152,000	- -	2.00%
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,441	164,972.87 567,671,680	171,200.00 589,099,200	- -	1.84%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,218	168,906.71 543,541,795	177,400.00 570,873,200	- -	1.78%
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	645	818,132.95 527,695,758	822,000.00 530,190,000	- -	1.66%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,827	268,508.20 490,564,495	280,200.00 511,925,400	- -	1.60%
22	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,378	196,303.99 466,810,911	202,000.00 480,356,000	- -	1.50%
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	993	469,892.64 466,603,394	476,000.00 472,668,000	- -	1.48%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,504	179,116.18 448,506,928	185,000.00 463,240,000	- -	1.45%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,018	143,583.04 433,333,620	152,400.00 459,943,200	- -	1.44%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	908	471,206.30 427,855,325	484,500.00 439,926,000	- -	1.37%
27	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	2,600	156,433.81 406,727,930	167,200.00 434,720,000	- -	1.36%
28	MCUBS Mid City投資法人 日本	投資証券	3,588	113,417.20 406,940,927	118,300.00 424,460,400	- -	1.33%
29	プレミアム投資法人 日本	投資証券	2,526	152,709.90 385,745,221	163,400.00 412,748,400	- -	1.29%
30	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,164	341,653.84 397,685,070	350,000.00 407,400,000	- -	1.27%

(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	98.72
	小計		98.72
合計(対純資産総額比)			98.72

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

**【投資不動産物件】**

「ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

**【その他投資資産の主要なもの】**

「ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)」

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」

(2019年11月29日現在)

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数 先物取引	大阪取引所	TOPIX 先 物 0112月	買建	93	1,547,426,060	1,578,210,000	2.33%

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率であります。

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

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

「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
第2計算期間末 (2019年11月20日)	34,551,025	34,551,025	1.0807	1.0807
2018年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	-
6月末日	21,508,371	-	1.0436	-
7月末日	23,550,036	-	1.0525	-
8月末日	26,159,693	-	1.0632	-
9月末日	30,791,406	-	1.0717	-
10月末日	31,341,184	-	1.0816	-
11月末日	35,928,351	-	1.0807	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

「ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)」

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
第2計算期間	6.9

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

「ニッセイ・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
第2計算期間	36,243,654	14,283,311	31,971,678

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;

### 3. 運用実績

2019年11月末現在

#### ● 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,807円
純資産総額	35百万円

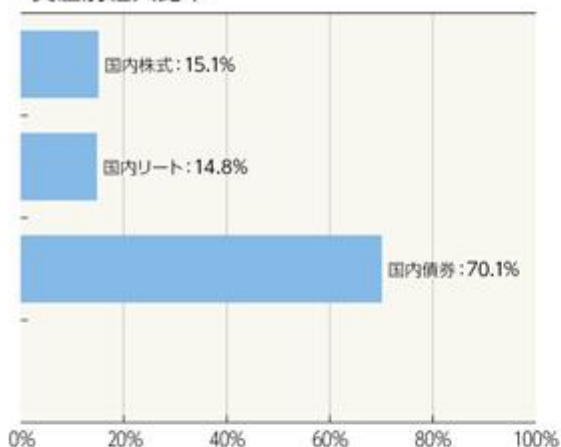
#### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
2019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)を再投資したものと計算しております。

#### ● 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)を再投資したものと計算しております。

・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。

■ 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11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	3.5%
2	ソニー	1.8%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%
4	武田薬品工業	1.5%
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	7.0%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.6%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.5%
4	オリックス不動産投資法人	4.2%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.2%

・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%	1.3%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第344回 利付国債(10年)	2026/09/20	0.100%	0.9%
4	第351回 利付国債(10年)	2028/06/20	0.100%	0.8%
5	第346回 利付国債(10年)	2027/03/20	0.100%	0.8%

・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	14.2%
2	情報・通信業	8.5%
3	輸送用機器	7.8%
4	化学	7.2%
5	医薬品	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2期計算期間（2018年11月21日から2019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)	第2期 (2019年11月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,933	972
コール・ローン	6,863	39,085
親投資信託受益証券	10,125,134	34,551,326
未収入金	2,936	90,007
流動資産合計	10,139,866	34,681,390
資産合計	10,139,866	34,681,390
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,508	88,521
未払受託者報酬	879	3,128
未払委託者報酬	11,106	37,370
その他未払費用	325	1,346
流動負債合計	14,818	130,365
負債合計	14,818	130,365
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,011,335	31,971,678
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	113,713	2,579,347
純資産合計	10,125,048	34,551,025
負債純資産合計	10,139,866	34,681,390

## (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)	第2期 (自2018年11月21日 至2019年11月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	7,199	1,491,578
営業収益合計	7,199	1,491,578
営業費用		
受託者報酬	1,151	4,822
委託者報酬	14,914	57,959
その他費用	394	2,056
営業費用合計	16,459	64,837
営業利益又は営業損失( )	23,658	1,426,741
経常利益又は経常損失( )	23,658	1,426,741
当期純利益又は当期純損失( )	23,658	1,426,741
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	413,998
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	155,332	1,981,619
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	1,981,619
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,244	528,728
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	528,728
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	2,579,347

## ( 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	第2期
	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1 . 受益権総口数	10,011,335口	31,971,678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)	1.0807円 (10,807円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期	第2期
	自2017年11月17日 至2018年11月20日	自2018年11月21日 至2019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。	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(997,887円)、収益調整金(1,581,460円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は2,579,347円(1口当たり0.080676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	第2期 自2018年11月21日 至2019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。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期
	2018年11月20日現在	2019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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	2018年11月20日現在	2019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)	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	988,403
合計	11,352	988,403

(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	第2期
	2018年11月20日現在	2019年11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	36,243,654円
期中一部解約元本額	1,327,996円	14,283,311円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019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	2,865,527	5,200,931	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	24,364,655	24,225,776	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	2,642,646	5,124,619	
親投資信託受益証券	合計	29,872,828	34,551,326	
合計		29,872,828	34,551,326	

## 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、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11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	471,797,753	26,133,173
コール・ローン	656,414,314	1,051,065,921
株式	54,651,417,270	66,020,728,200
派生商品評価勘定	2,849,740	32,833,040
未収配当金	473,077,219	614,918,502
前払金	9,685,000	-
差入委託証拠金	44,625,000	44,640,000
流動資産合計	56,309,866,296	67,790,318,836
資産合計	56,309,866,296	67,790,318,836
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,605,640	7,164,100
前受金	-	29,905,000
未払解約金	118,516,537	222,978,912
その他未払費用	36,709	6,068
流動負債合計	145,158,886	260,054,080
負債合計	145,158,886	260,054,080
純資産の部		
元本等		
元本	33,015,590,469	37,206,074,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,149,116,941	30,324,190,739
純資産合計	56,164,707,410	67,530,264,756
負債純資産合計	56,309,866,296	67,790,318,836

## 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11月20日現在
1. 受益権総口数	33,015,590,469口	37,206,074,017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)	1.8150円 (18,150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	自 2018年11月21日 至 2019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。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2018年11月20日現在	2019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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,203,418,286	3,259,262,001
合計	4,203,418,286	3,259,262,001

(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11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	1,547,375,000	-	1,573,095,000	25,720,000
合計	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	1,547,375,000	-	1,573,095,000	25,720,000

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2018年11月20日現在	2019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	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	14,648,507,258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	10,458,023,710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	6,469,503,110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	4,561,011,771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	-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	4,059,132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	1,460,555,576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	5,163,139,062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	3,451,105,833円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	12,096,632円	8,469,605円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,290,695円	37,232,083円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,317,865円	44,296,788円
DCニッセイ国内株式インデックス	145,946,565円	313,570,047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	14,584,098,618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	626,761,958円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	17,881,836円	83,670,627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	75,262,010円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,809,183円	55,166,663円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	14,634,712円	111,903,417円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,304,455円	34,041,324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	41,445,869円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,504,084円	25,474,150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	3,591,265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	1,026,689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	2,865,527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	16,706,927円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	5,863,187円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	5,563,574円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	9,335,459円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	10,353,746円
計	33,015,590,469円	37,206,074,017円

## 附属明細表(2019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	1,300	2,895.00	3,763,500	
日本水産	37,600	618.00	23,236,800	
マルハニチロ	5,400	2,924.00	15,789,600	
カネコ種苗	1,200	1,535.00	1,842,000	
サカタのタネ	4,500	3,625.00	16,312,500	
ホクト	2,900	1,937.00	5,617,300	
ヒノキヤグループ	900	2,220.00	1,998,000	
ショーボンドホールディングス	5,400	4,275.00	23,085,000	
ミライト・ホールディングス	11,200	1,706.00	19,107,200	
タマホーム	1,800	2,010.00	3,618,000	
ファーストコーポレーション	2,500	708.00	1,770,000	
スペースバリューホールディングス	4,600	516.00	2,373,600	
住石ホールディングス	6,200	145.00	899,000	
日鉄鉱業	900	4,570.00	4,113,000	
三井松島ホールディングス	1,500	1,220.00	1,830,000	
国際石油開発帝石	150,600	1,009.00	151,955,400	
石油資源開発	4,900	2,834.00	13,886,600	
K&Oエナジーグループ	1,800	1,567.00	2,820,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	926.00	1,759,400	
安藤・間	22,400	936.00	20,966,400	
東急建設	11,000	810.00	8,910,000	
コムシスホールディングス	13,300	3,255.00	43,291,500	
ミサワホーム	2,600	1,187.00	3,086,200	
ビーアールホールディングス	4,100	474.00	1,943,400	
高松コンストラクショングループ	2,300	2,711.00	6,235,300	
東建コーポレーション	1,200	7,200.00	8,640,000	
ヤマウラ	2,000	875.00	1,750,000	
大成建設	28,900	4,130.00	119,357,000	
大林組	86,700	1,170.00	101,439,000	
清水建設	88,000	1,057.00	93,016,000	
飛鳥建設	2,500	1,401.00	3,502,500	
長谷工コーポレーション	33,600	1,393.00	46,804,800	
松井建設	3,400	786.00	2,672,400	
銭高組	400	4,025.00	1,610,000	
鹿島建設	68,100	1,438.00	97,927,800	
不動テトラ	2,300	1,524.00	3,505,200	
大末建設	1,100	950.00	1,045,000	
鉄建建設	1,900	2,906.00	5,521,400	
西松建設	6,700	2,365.00	15,845,500	
三井住友建設	20,900	596.00	12,456,400	
大豊建設	1,900	2,960.00	5,624,000	
前田建設工業	21,700	970.00	21,049,000	
佐田建設	4,200	403.00	1,692,600	
ナカノフドー建設	3,500	473.00	1,655,500	
奥村組	4,700	2,958.00	13,902,600	
東鉄工業	3,700	3,285.00	12,154,500	
浅沼組	1,000	4,375.00	4,375,000	
戸田建設	36,000	672.00	24,192,000	
熊谷組	4,000	3,235.00	12,940,000	
北野建設	600	2,673.00	1,603,800	
植木組	700	2,561.00	1,792,700	
矢作建設工業	3,800	764.00	2,903,200	
ピーエス三菱	2,900	694.00	2,012,600	
日本ハウスホールディングス	5,900	499.00	2,944,100	



大東建託	10,400	13,620.00	141,648,000
新日本建設	3,700	926.00	3,426,200
NIPPPO	7,200	2,254.00	16,228,800
東亜道路工業	500	3,620.00	1,810,000
前田道路	9,200	2,483.00	22,843,600
日本道路	800	6,940.00	5,552,000
東亜建設工業	2,700	1,519.00	4,101,300
日本国土開発	5,100	632.00	3,223,200
若築建設	1,600	1,680.00	2,688,000
東洋建設	9,700	500.00	4,850,000
五洋建設	34,400	638.00	21,947,200
世紀東急工業	4,200	867.00	3,641,400
福田組	1,000	4,705.00	4,705,000
住友林業	22,000	1,566.00	34,452,000
日本基礎技術	4,600	403.00	1,853,800
巴コーポレーション	4,100	412.00	1,689,200
大和ハウス工業	85,800	3,299.00	283,054,200
ライト工業	5,000	1,591.00	7,955,000
積水ハウス	94,800	2,373.50	225,007,800
日特建設	2,500	805.00	2,012,500
ユアテック	5,000	680.00	3,400,000
四電工	600	2,758.00	1,654,800
中電工	3,500	2,542.00	8,897,000
関電工	12,300	1,065.00	13,099,500
きんでん	20,600	1,682.00	34,649,200
東京エネシス	2,900	929.00	2,694,100
トーエネック	900	3,695.00	3,325,500
住友電設	2,400	2,352.00	5,644,800
日本電設工業	4,800	2,242.00	10,761,600
協和エクシオ	13,100	2,900.00	37,990,000
新日本空調	2,300	2,180.00	5,014,000
日本工営	1,800	3,405.00	6,129,000
九電工	6,100	3,600.00	21,960,000
三機工業	6,200	1,452.00	9,002,400
日揮ホールディングス	26,700	1,633.00	43,601,100
中外炉工業	1,000	1,733.00	1,733,000
ヤマト	2,800	728.00	2,038,400
太平電業	2,100	2,300.00	4,830,000
高砂熱学工業	7,500	1,910.00	14,325,000
三晃金属工業	700	2,559.00	1,791,300
NEC ネットエスアイ	2,600	3,490.00	9,074,000
朝日工業社	600	3,270.00	1,962,000
明星工業	5,600	900.00	5,040,000
大気社	4,200	3,620.00	15,204,000
ダイダン	2,100	2,606.00	5,472,600
日比谷総合設備	2,800	1,917.00	5,367,600
東芝プラントシステム	6,700	2,664.00	17,848,800
日本製粉	8,100	1,723.00	13,956,300
日清製粉グループ本社	31,300	2,157.00	67,514,100
昭和産業	2,500	3,200.00	8,000,000
鳥越製粉	2,500	945.00	2,362,500
中部飼料	3,400	1,299.00	4,416,600
フィード・ワン	18,600	164.00	3,050,400
東洋精糖	1,500	1,132.00	1,698,000
日本甜菜製糖	1,400	2,070.00	2,898,000
三井製糖	2,400	2,322.00	5,572,800
塩水港精糖	8,100	220.00	1,782,000
日新製糖	1,300	1,996.00	2,594,800
LIFULL	9,200	555.00	5,106,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	2,042.00	3,675,600

日本M&Aセンター	19,900	3,600.00	71,640,000
メンバーズ	800	2,485.00	1,988,000
タケエイ	2,500	1,217.00	3,042,500
トラスト・テック	2,900	1,387.00	4,022,300
コシダカホールディングス	6,400	1,617.00	10,348,800
パソナグループ	3,200	1,642.00	5,254,400
C D S	1,200	1,540.00	1,848,000
リンクアンドモチベーション	5,800	739.00	4,286,200
G C A	3,200	955.00	3,056,000
エス・エム・エス	8,200	2,896.00	23,747,200
サニーサイドアップ	1,800	1,059.00	1,906,200
パーソルホールディングス	26,400	2,001.00	52,826,400
リニカル	1,800	1,007.00	1,812,600
クックパッド	9,200	388.00	3,569,600
アイ・ケイ・ケイ	2,500	711.00	1,777,500
森永製菓	6,600	5,710.00	37,686,000
中村屋	700	4,515.00	3,160,500
江崎グリコ	8,200	5,150.00	42,230,000
名糖産業	1,400	1,318.00	1,845,200
井村屋グループ	1,200	2,076.00	2,491,200
不二家	1,500	2,120.00	3,180,000
山崎製パン	20,800	1,956.00	40,684,800
モロゾフ	500	4,955.00	2,477,500
亀田製菓	1,600	5,040.00	8,064,000
寿スピリッツ	2,700	7,770.00	20,979,000
カルビー	12,600	3,600.00	45,360,000
森永乳業	5,100	4,605.00	23,485,500
六甲バター	1,800	1,770.00	3,186,000
ヤクルト本社	19,100	6,300.00	120,330,000
明治ホールディングス	18,300	7,480.00	136,884,000
雪印メグミルク	6,700	2,698.00	18,076,600
プリマハム	4,300	2,565.00	11,029,500
日本ハム	10,600	4,725.00	50,085,000
林兼産業	2,800	719.00	2,013,200
丸大食品	3,000	2,384.00	7,152,000
S F o o d s	2,200	2,984.00	6,564,800
伊藤ハム米久ホールディングス	17,900	704.00	12,601,600
スタジオアリス	1,300	1,898.00	2,467,400
シミックホールディングス	1,500	1,741.00	2,611,500
システナ	9,700	1,748.00	16,955,600
N J S	1,000	1,728.00	1,728,000
デジタルアーツ	1,300	6,020.00	7,826,000
日鉄ソリューションズ	4,100	3,735.00	15,313,500
総合警備保障	10,500	5,610.00	58,905,000
いちご	34,700	422.00	14,643,400
日本駐車場開発	29,900	170.00	5,083,000
コア	1,300	1,420.00	1,846,000
カカクコム	19,800	2,542.00	50,331,600
セントケア・ホールディング	3,400	515.00	1,751,000
ルネサンス	1,500	1,695.00	2,542,500
ディップ	3,700	3,025.00	11,192,500
S B Sホールディングス	2,400	1,946.00	4,670,400
オプトホールディング	1,400	1,770.00	2,478,000
新日本科学	2,900	846.00	2,453,400
ツクイ	6,200	575.00	3,565,000
ベネフィット・ワン	7,200	2,294.00	16,516,800
エムスリー	58,200	2,929.00	170,467,800
ツカダ・グローバルホールディング	2,900	637.00	1,847,300
アウトソーシング	15,100	1,153.00	17,410,300
ウェルネット	2,500	807.00	2,017,500

ワールドホールディングス	1,000	1,850.00	1,850,000
ディー・エヌ・エー	12,900	1,757.00	22,665,300
博報堂DYホールディングス	36,700	1,808.00	66,353,600
ぐるなび	4,600	1,033.00	4,751,800
タカミヤ	2,800	739.00	2,069,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	1,106.00	1,990,800
ファンコミュニケーションズ	7,300	519.00	3,788,700
ライク	1,000	1,714.00	1,714,000
ビジネス・ブレークスルー	4,900	339.00	1,661,100
エスプール	5,100	670.00	3,417,000
WDBホールディングス	1,200	2,738.00	3,285,600
パリュコマース	1,500	1,866.00	2,799,000
インフォマート	14,500	1,922.00	27,869,000
サッポロホールディングス	9,500	2,666.00	25,327,000
アサヒグループホールディングス	58,100	5,350.00	310,835,000
麒麟ホールディングス	117,700	2,505.50	294,897,350
宝ホールディングス	20,800	1,056.00	21,964,800
オエノンホールディングス	7,400	389.00	2,878,600
養命酒製造	900	1,968.00	1,771,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	19,500	2,733.00	53,293,500
サントリー食品インターナショナル	18,600	4,800.00	89,280,000
ダイドグループホールディングス	1,400	4,595.00	6,433,000
伊藤園	8,400	5,430.00	45,612,000
キーコーヒー	2,700	2,441.00	6,590,700
日清オイリオグループ	3,600	4,005.00	14,418,000
不二製油グループ本社	6,800	3,210.00	21,828,000
かどや製油	500	3,805.00	1,902,500
J-オイルミルズ	1,400	4,540.00	6,356,000
ローソン	6,900	5,980.00	41,262,000
サンエー	2,300	5,130.00	11,799,000
カワチ薬品	2,100	2,330.00	4,893,000
エービーシー・マート	4,300	7,410.00	31,863,000
ハードオフコーポレーション	2,200	806.00	1,773,200
高千穂交易	1,600	1,102.00	1,763,200
アスクル	2,800	2,906.00	8,136,800
ゲオホールディングス	4,900	1,343.00	6,580,700
アダストリア	3,800	2,629.00	9,990,200
ジーフット	2,800	622.00	1,741,600
伊藤忠食品	700	5,210.00	3,647,000
くら寿司	1,400	4,720.00	6,608,000
キャンドウ	1,300	1,644.00	2,137,200
エレマテック	2,500	1,041.00	2,602,500
パルグループホールディングス	1,400	3,480.00	4,872,000
JALUX	800	2,545.00	2,036,000
エディオン	12,500	1,189.00	14,862,500
あらた	2,200	4,305.00	9,471,000
サーラコーポレーション	5,500	639.00	3,514,500
トーメンデバイス	700	2,770.00	1,939,000
ハローズ	1,000	2,518.00	2,518,000
JPホールディングス	8,300	304.00	2,523,200
フジオフードシステム	1,100	3,585.00	3,943,500
あみやき亭	600	3,575.00	2,145,000
東京エレクトロン デバイス	1,000	2,200.00	2,200,000
ひらまつ	5,500	306.00	1,683,000
フィールズ	3,500	488.00	1,708,000
双日	150,400	341.00	51,286,400
アルフレッサ ホールディングス	30,300	2,498.00	75,689,400
大黒天物産	700	3,245.00	2,271,500
ハニーズホールディングス	2,400	1,416.00	3,398,400

キッコーマン	20,000	5,490.00	109,800,000
味の素	61,300	1,833.00	112,362,900
キュービー	15,400	2,489.00	38,330,600
ハウス食品グループ本社	10,400	3,965.00	41,236,000
カゴメ	10,500	2,718.00	28,539,000
アリアケジャパン	2,500	7,910.00	19,775,000
ピエトロ	1,100	1,641.00	1,805,100
エバラ食品工業	800	2,174.00	1,739,200
ニチレイ	13,200	2,523.00	33,303,600
横浜冷凍	7,600	1,105.00	8,398,000
東洋水産	14,300	4,795.00	68,568,500
イトアンド	1,000	1,792.00	1,792,000
大冷	900	1,992.00	1,792,800
日清食品ホールディングス	11,800	8,280.00	97,704,000
永谷園ホールディングス	1,400	2,172.00	3,040,800
一正蒲鉾	1,600	1,097.00	1,755,200
フジッコ	3,000	1,981.00	5,943,000
ロック・フィールド	3,000	1,513.00	4,539,000
日本たばこ産業	160,200	2,465.00	394,893,000
ケンコーマヨネーズ	1,600	2,790.00	4,464,000
わらべや日洋ホールディングス	1,800	1,870.00	3,366,000
なとり	1,500	1,709.00	2,563,500
北の達人コーポレーション	9,700	666.00	6,460,200
ユーグレナ	11,800	779.00	9,192,200
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,754.00	2,455,600
片倉工業	3,900	1,396.00	5,444,400
ゲンゼ	2,000	5,100.00	10,200,000
ヒューリック	58,200	1,183.00	68,850,600
ラサ商事	2,000	874.00	1,748,000
アルペン	2,100	1,798.00	3,775,800
クオールホールディングス	4,000	1,574.00	6,296,000
アルコニックス	2,900	1,513.00	4,387,700
神戸物産	9,400	3,360.00	31,584,000
ジンズホールディングス	1,400	6,600.00	9,240,000
ビックカメラ	16,100	1,210.00	19,481,000
D C Mホールディングス	14,700	1,068.00	15,699,600
ペッパーフードサービス	2,200	1,396.00	3,071,200
Monotaro	19,400	3,100.00	60,140,000
東京一番フーズ	2,900	625.00	1,812,500
DDホールディングス	1,200	1,470.00	1,764,000
あいホールディングス	3,900	2,050.00	7,995,000
ディー・ビー・エックス	1,900	943.00	1,791,700
きちりホールディングス	2,100	874.00	1,835,400
アークランドサービスホールディングス	2,000	1,881.00	3,762,000
J・フロントリテイリング	32,500	1,447.00	47,027,500
ドトール・日レスホールディングス	4,300	2,215.00	9,524,500
マツモトキヨシホールディングス	11,300	4,225.00	47,742,500
ブロンコビリー	1,400	2,677.00	3,747,800
ZOZO	26,700	2,318.00	61,890,600
物語コーポレーション	700	8,560.00	5,992,000
ココカラファイン	2,800	6,570.00	18,396,000
三越伊勢丹ホールディングス	47,600	989.00	47,076,400
東洋紡	10,700	1,608.00	17,205,600
ユニチカ	7,900	364.00	2,875,600
富士紡ホールディングス	1,300	3,275.00	4,257,500
日清紡ホールディングス	18,400	968.00	17,811,200
倉敷紡績	2,800	2,531.00	7,086,800
ダイワボウホールディングス	2,300	5,140.00	11,822,000
シキボウ	1,800	937.00	1,686,600
日東紡績	4,100	3,895.00	15,969,500

トヨタ紡織	8,100	1,715.00	13,891,500
マクニカ・富士エレホールディングス	6,500	1,787.00	11,615,500
H a m e e	1,500	1,319.00	1,978,500
ラクト・ジャパン	1,000	3,500.00	3,500,000
ウエルシアホールディングス	8,100	6,990.00	56,619,000
クリエイトSDホールディングス	4,000	2,688.00	10,752,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,100	1,112.00	5,671,200
八洲電機	2,100	882.00	1,852,200
レスターホールディングス	2,800	1,926.00	5,392,800
ジューテックホールディングス	1,600	1,099.00	1,758,400
丸善CHIホールディングス	4,700	376.00	1,767,200
OCHIホールディングス	1,300	1,390.00	1,807,000
TOKAIホールディングス	14,400	1,078.00	15,523,200
ミサワ	1,900	843.00	1,601,700
ティーライフ	2,000	857.00	1,714,000
C o m i n i x	2,200	820.00	1,804,000
三洋貿易	1,400	2,315.00	3,241,000
チムニー	800	2,342.00	1,873,600
シュッピン	1,900	1,063.00	2,019,700
ビューティガレージ	1,100	1,917.00	2,108,700
ウイン・パートナーズ	2,000	1,518.00	3,036,000
ネクステージ	3,900	1,137.00	4,434,300
ジョイフル本田	8,000	1,465.00	11,720,000
鳥貴族	900	1,978.00	1,780,200
キリン堂ホールディングス	1,100	2,086.00	2,294,600
ホットランド	1,800	1,253.00	2,255,400
すかいらーくホールディングス	30,500	2,171.00	66,215,500
SFPホールディングス	1,200	2,278.00	2,733,600
綿半ホールディングス	1,000	2,050.00	2,050,000
日本毛織	8,900	1,085.00	9,656,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,900	983.00	7,765,700
三栄建築設計	1,100	1,571.00	1,728,100
野村不動産ホールディングス	16,500	2,577.00	42,520,500
三重交通グループホールディングス	5,500	607.00	3,338,500
サムティ	3,900	2,122.00	8,275,800
ディア・ライフ	3,500	563.00	1,970,500
コーセーアールイー	2,200	791.00	1,740,200
日本商業開発	1,700	1,555.00	2,643,500
プレサンスコーポレーション	4,300	1,726.00	7,421,800
ユニゾホールディングス	4,100	4,985.00	20,438,500
T H E グローバル社	3,700	469.00	1,735,300
日本管理センター	1,800	1,332.00	2,397,600
サンセイランディック	1,900	858.00	1,630,200
エストラスト	2,200	790.00	1,738,000
フージャースホールディングス	5,400	703.00	3,796,200
オープンハウス	7,900	3,340.00	26,386,000
東急不動産ホールディングス	74,100	700.00	51,870,000
飯田グループホールディングス	22,700	1,867.00	42,380,900
イーグランド	2,200	767.00	1,687,400
ムゲンエステート	2,500	713.00	1,782,500
帝国繊維	3,000	2,022.00	6,066,000
日本コークス工業	23,300	82.00	1,910,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,500	653.00	1,632,500
B E E N O S	1,300	1,702.00	2,212,600
あさひ	2,000	1,240.00	2,480,000
日本調剤	800	3,915.00	3,132,000
コスモス薬品	1,200	22,990.00	27,588,000
シップヘルスケアホールディングス	4,400	4,585.00	20,174,000

ソフトクリエイトホールディングス	1,200	1,820.00	2,184,000
オンリー	2,200	806.00	1,773,200
セブン&アイ・ホールディングス	106,500	4,123.00	439,099,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,300	1,882.00	13,738,600
明治電機工業	1,100	1,534.00	1,687,400
ツルハホールディングス	5,900	12,810.00	75,579,000
サンマルクホールディングス	2,200	2,371.00	5,216,200
フェリシモ	1,700	1,059.00	1,800,300
トリドールホールディングス	3,400	3,105.00	10,557,000
帝人	22,100	2,053.00	45,371,300
東レ	196,000	738.70	144,785,200
クラレ	42,600	1,314.00	55,976,400
旭化成	180,600	1,197.00	216,178,200
サカイオーベックス	900	1,782.00	1,603,800
T O K Y O B A S E	2,500	703.00	1,757,500
稲葉製作所	1,500	1,434.00	2,151,000
宮地エンジニアリンググループ	800	2,091.00	1,672,800
トーカロ	7,600	1,098.00	8,344,800
アルファ	1,300	1,309.00	1,701,700
S U M C O	32,700	1,685.00	55,099,500
川田テクノロジーズ	600	6,610.00	3,966,000
R S T e c h n o l o g i e s	800	3,745.00	2,996,000
ハウズドゥ	1,500	1,612.00	2,418,000
アグレ都市デザイン	3,500	506.00	1,771,000
ジェイ・エス・ビー	400	4,570.00	1,828,000
テンポイノベーション	1,100	1,623.00	1,785,300
住江織物	800	2,855.00	2,284,000
日本フェルト	3,600	498.00	1,792,800
イチカワ	1,100	1,541.00	1,695,100
芦森工業	1,100	1,409.00	1,549,900
アツギ	2,200	818.00	1,799,600
ジャパンミート	1,400	2,160.00	3,024,000
コメダホールディングス	5,900	2,099.00	12,384,100
サツドラホールディングス	1,000	1,791.00	1,791,000
パロックジャパンリミテッド	1,900	939.00	1,784,100
クスリのアオキホールディングス	2,700	8,800.00	23,760,000
スシログローバルホールディングス	3,000	8,760.00	26,280,000
L I X I L ビバ	2,700	1,874.00	5,059,800
セーレン	6,700	1,513.00	10,137,100
ソトー	1,800	980.00	1,764,000
東海染工	1,600	1,133.00	1,812,800
小松マテーレ	4,400	840.00	3,696,000
ワコールホールディングス	7,100	2,866.00	20,348,600
ホギメディカル	3,100	3,605.00	11,175,500
クラウドシアホールディングス	3,600	484.00	1,742,400
T S I ホールディングス	9,100	566.00	5,150,600
マツオカコーポレーション	400	2,269.00	907,600
ワールド	3,800	2,844.00	10,807,200
T I S	9,000	6,370.00	57,330,000
電算システム	1,000	2,918.00	2,918,000
グリー	18,700	508.00	9,499,600
コーエーテクモホールディングス	5,500	2,558.00	14,069,000
三菱総合研究所	1,200	3,910.00	4,692,000
ボルテージ	3,300	530.00	1,749,000
電算	800	2,133.00	1,706,400
A G S	2,300	732.00	1,683,600
ファインデックス	2,300	936.00	2,152,800
ブレインパッド	500	5,500.00	2,750,000
K L a b	5,200	875.00	4,550,000

ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,300	1,056.00	3,484,800
ネクソン	77,200	1,465.00	113,098,000
アイスタイル	7,000	856.00	5,992,000
エムアップ	900	2,113.00	1,901,700
エイチーム	1,900	1,091.00	2,072,900
エニグモ	1,900	1,027.00	1,951,300
テクノスジャパン	3,600	493.00	1,774,800
コロブラ	8,900	1,279.00	11,383,100
ブロードリーフ	13,400	629.00	8,428,600
クロス・マーケティンググループ	4,700	375.00	1,762,500
デジタルハーツホールディングス	2,000	1,095.00	2,190,000
システム情報	1,800	988.00	1,778,400
メディアドゥホールディングス	900	3,460.00	3,114,000
じげん	6,700	525.00	3,517,500
フィックスターズ	2,900	1,348.00	3,909,200
CARTA HOLDINGS	1,400	1,403.00	1,964,200
オブティム	700	3,260.00	2,282,000
セレス	1,500	1,163.00	1,744,500
特種東海製紙	1,700	4,005.00	6,808,500
ティーガイア	2,400	2,627.00	6,304,800
セック	600	3,340.00	2,004,000
豆蔵ホールディングス	1,800	1,514.00	2,725,200
テクマトリックス	1,900	2,282.00	4,335,800
プロシップ	1,400	1,357.00	1,899,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,500	2,348.00	15,262,000
GMOペイメントゲートウェイ	4,500	7,400.00	33,300,000
ザッパラス	4,600	398.00	1,830,800
インターネットイニシアティブ	4,000	2,536.00	10,144,000
さくらインターネット	2,900	685.00	1,986,500
GMOクラウド	600	2,807.00	1,684,200
SRAホールディングス	1,400	2,552.00	3,572,800
朝日ネット	2,800	623.00	1,744,400
eBASE	1,600	1,203.00	1,924,800
アバント	1,000	2,011.00	2,011,000
アドソル日進	1,000	2,221.00	2,221,000
フリービット	2,100	900.00	1,890,000
コムチュア	3,000	2,385.00	7,155,000
サイバーコム	900	2,159.00	1,943,100
アステリア	2,700	627.00	1,692,900
王子ホールディングス	113,200	606.00	68,599,200
日本製紙	12,000	1,879.00	22,548,000
三菱製紙	1,900	507.00	963,300
北越コーポレーション	18,000	561.00	10,098,000
中越パルプ工業	1,100	1,652.00	1,817,200
大王製紙	11,900	1,488.00	17,707,200
阿波製紙	4,200	464.00	1,948,800
マークライNZ	1,400	2,242.00	3,138,800
メディカル・データ・ビジョン	2,100	1,036.00	2,175,600
gumi	3,500	668.00	2,338,000
モバイルファクトリー	1,200	1,455.00	1,746,000
テラスカイ	1,000	2,674.00	2,674,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,200	1,828.00	2,193,600
PCIホールディングス	800	2,244.00	1,795,200
ランドコンピュータ	1,600	1,146.00	1,833,600
ダブルスタンダード	300	5,810.00	1,743,000
オーブンドア	1,300	1,837.00	2,388,100
アカツキ	1,000	6,230.00	6,230,000

LINE	6,200	5,160.00	31,992,000
レンゴー	25,600	796.00	20,377,600
トーモク	1,700	1,791.00	3,044,700
ザ・パック	2,000	3,760.00	7,520,000
チェンジ	900	2,058.00	1,852,200
シンクロ・フード	3,400	520.00	1,768,000
オークネット	1,700	1,339.00	2,276,300
AOI TYO HOLDINGS	2,700	666.00	1,798,200
マクロミル	4,800	1,024.00	4,915,200
ビーグリー	1,800	1,247.00	2,244,600
オロ	700	4,020.00	2,814,000
昭和電工	19,300	3,075.00	59,347,500
住友化学	198,900	505.00	100,444,500
住友精化	1,200	3,575.00	4,290,000
日産化学	15,100	4,335.00	65,458,500
クレハ	2,300	6,570.00	15,111,000
多木化学	800	4,465.00	3,572,000
テイカ	2,000	1,931.00	3,862,000
石原産業	4,900	1,161.00	5,688,900
片倉コープアグリ	1,500	1,186.00	1,779,000
日本曹達	4,000	2,912.00	11,648,000
東ソー	41,800	1,596.00	66,712,800
トクヤマ	7,800	2,936.00	22,900,800
セントラル硝子	5,500	2,695.00	14,822,500
東亜合成	17,000	1,249.00	21,233,000
大阪ソーダ	2,800	3,010.00	8,428,000
関東電化工業	6,400	1,073.00	6,867,200
デンカ	9,900	3,310.00	32,769,000
イビデン	16,900	2,486.00	42,013,400
信越化学工業	47,700	11,665.00	556,420,500
日本カーバイド工業	1,200	1,460.00	1,752,000
堺化学工業	1,800	2,522.00	4,539,600
第一稀元素化学工業	2,900	835.00	2,421,500
エア・ウォーター	22,200	2,060.00	45,732,000
大陽日酸	26,000	2,534.00	65,884,000
日本化学工業	800	3,205.00	2,564,000
日本パーカライジング	13,700	1,176.00	16,111,200
高圧ガス工業	4,300	816.00	3,508,800
四国化成工業	4,200	1,249.00	5,245,800
戸田工業	800	2,238.00	1,790,400
ステラ ケミファ	1,500	3,230.00	4,845,000
保土谷化学工業	1,000	3,700.00	3,700,000
日本触媒	4,200	6,730.00	28,266,000
大日精化工業	2,400	3,225.00	7,740,000
カネカ	7,000	3,600.00	25,200,000
協和キリン	27,800	2,269.00	63,078,200
三菱瓦斯化学	25,600	1,635.00	41,856,000
三井化学	24,600	2,637.00	64,870,200
J S R	25,200	2,014.00	50,752,800
東京応化工業	4,600	3,960.00	18,216,000
大阪有機化学工業	2,500	1,249.00	3,122,500
三菱ケミカルホールディングス	181,000	823.20	148,999,200
KHネオケム	4,800	2,440.00	11,712,000
ダイセル	37,000	1,084.00	40,108,000
住友ベークライト	4,300	4,535.00	19,500,500
積水化学工業	58,200	1,889.00	109,939,800
日本ゼオン	24,400	1,383.00	33,745,200
アイカ工業	8,100	3,370.00	27,297,000
宇部興産	13,700	2,314.00	31,701,800
積水樹脂	4,900	2,335.00	11,441,500



タキロンシーアイ	5,900	668.00	3,941,200
旭有機材	1,500	1,727.00	2,590,500
日立化成	12,500	3,410.00	42,625,000
ニチバン	1,400	1,905.00	2,667,000
リケンテクノス	6,800	509.00	3,461,200
大倉工業	1,300	2,000.00	2,600,000
積水化成成品工業	3,600	799.00	2,876,400
群栄化学工業	700	2,464.00	1,724,800
タイガースポリマー	3,000	585.00	1,755,000
ダイキョーニシカワ	5,700	847.00	4,827,900
竹本容器	1,800	988.00	1,778,400
森六ホールディングス	1,500	2,391.00	3,586,500
日本化薬	16,800	1,361.00	22,864,800
カーリットホールディングス	2,900	611.00	1,771,900
E P Sホールディングス	4,000	1,407.00	5,628,000
プレステージ・インターナショナル	9,900	928.00	9,187,200
プロトコーポレーション	2,400	1,055.00	2,532,000
アミューズ	1,400	2,998.00	4,197,200
野村総合研究所	45,300	2,390.00	108,267,000
クイック	1,600	1,588.00	2,540,800
T A C	7,800	227.00	1,770,600
C Eホールディングス	3,800	454.00	1,725,200
ケネディクス	25,100	576.00	14,457,600
電通	27,200	4,145.00	112,744,000
インテージホールディングス	3,400	942.00	3,202,800
東邦システムサイエンス	1,900	933.00	1,772,700
ぴあ	800	4,840.00	3,872,000
イオンファンタジー	1,000	3,350.00	3,350,000
ソースネクスト	12,900	487.00	6,282,300
シーティーエス	3,000	748.00	2,244,000
ネクシィーズグループ	900	1,978.00	1,780,200
インフォコム	3,000	2,371.00	7,113,000
メディカルシステムネットワーク	3,100	565.00	1,751,500
日本精化	2,200	1,269.00	2,791,800
扶桑化学工業	2,700	3,140.00	8,478,000
トリケミカル研究所	700	8,350.00	5,845,000
ラクスル	1,400	3,360.00	4,704,000
F I G	5,500	311.00	1,710,500
A D E K A	12,500	1,663.00	20,787,500
日油	10,200	3,670.00	37,434,000
ミヨシ油脂	1,400	1,272.00	1,780,800
新日本理化	8,600	215.00	1,849,000
ハリマ化成グループ	2,200	1,192.00	2,622,400
アルテリア・ネットワークス	3,000	1,525.00	4,575,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,100	1,614.00	1,775,400
花王	66,200	8,449.00	559,323,800
第一工業製薬	1,000	3,655.00	3,655,000
日華化学	1,900	902.00	1,713,800
ニイタカ	1,000	1,752.00	1,752,000
三洋化成工業	1,600	5,320.00	8,512,000
武田薬品工業	230,000	4,529.00	1,041,670,000
アステラス製薬	243,200	1,847.50	449,312,000
大日本住友製薬	20,500	2,140.00	43,870,000
塩野義製薬	35,300	6,435.00	227,155,500
田辺三菱製薬	33,700	2,002.00	67,467,400
わかもと製薬	6,400	276.00	1,766,400
あすか製薬	3,200	1,293.00	4,137,600
日本新薬	7,200	9,980.00	71,856,000
ビオフェルミン製薬	800	2,290.00	1,832,000

中外製薬	28,800	9,422.00	271,353,600
科研製薬	4,700	5,870.00	27,589,000
エーザイ	33,100	7,621.00	252,255,100
理研ビタミン	1,300	4,015.00	5,219,500
ロート製薬	14,200	3,500.00	49,700,000
小野薬品工業	65,300	2,443.00	159,527,900
久光製薬	8,200	5,240.00	42,968,000
有機合成薬品工業	6,200	293.00	1,816,600
持田製薬	3,800	4,460.00	16,948,000
参天製薬	51,500	2,060.00	106,090,000
扶桑薬品工業	1,000	2,066.00	2,066,000
ツムラ	8,600	3,250.00	27,950,000
日医工	7,800	1,282.00	9,999,600
テルモ	78,200	3,764.00	294,344,800
みらかホールディングス	7,400	2,758.00	20,409,200
キッセイ薬品工業	4,900	2,886.00	14,141,400
生化学工業	5,400	1,256.00	6,782,400
栄研化学	4,900	1,945.00	9,530,500
日水製薬	1,400	1,295.00	1,813,000
鳥居薬品	1,700	2,898.00	4,926,600
JCRファーマ	1,900	9,210.00	17,499,000
東和薬品	3,500	2,745.00	9,607,500
富士製薬工業	1,900	1,375.00	2,612,500
沢井製薬	5,700	6,500.00	37,050,000
ゼリア新薬工業	5,000	2,115.00	10,575,000
第一三共	79,100	6,765.00	535,111,500
キョーリン製薬ホールディングス	6,100	1,877.00	11,449,700
大幸薬品	1,100	3,040.00	3,344,000
ダイト	1,600	3,225.00	5,160,000
大塚ホールディングス	52,700	4,925.00	259,547,500
大正製薬ホールディングス	5,800	7,980.00	46,284,000
ペプチドリーム	14,000	5,120.00	71,680,000
大日本塗料	3,100	1,132.00	3,509,200
日本ペイントホールディングス	22,300	6,150.00	137,145,000
関西ペイント	30,400	2,773.00	84,299,200
中国塗料	7,700	1,020.00	7,854,000
日本特殊塗料	2,000	1,407.00	2,814,000
藤倉化成	3,700	581.00	2,149,700
太陽ホールディングス	2,000	4,275.00	8,550,000
DIC	11,400	2,970.00	33,858,000
サカタインクス	5,900	1,156.00	6,820,400
東洋インキSCホールディングス	5,700	2,667.00	15,201,900
T&K TOKA	2,100	1,010.00	2,121,000
アルプス技研	2,300	1,723.00	3,962,900
サニックス	4,600	444.00	2,042,400
日本空調サービス	2,800	746.00	2,088,800
オリエンタルランド	28,100	15,385.00	432,318,500
フォーカスシステムズ	2,000	898.00	1,796,000
ダスキン	6,800	2,868.00	19,502,400
パーク24	14,600	2,492.00	36,383,200
明光ネットワークジャパン	3,100	1,003.00	3,109,300
ファルコホールディングス	1,500	1,734.00	2,601,000
クレスコ	800	3,345.00	2,676,000
フジ・メディア・ホールディングス	26,100	1,533.00	40,011,300
秀英予備校	4,000	447.00	1,788,000
ラウンドワン	7,400	1,145.00	8,473,000
リゾートトラスト	12,100	1,816.00	21,973,600
オービック	9,400	14,470.00	136,018,000
ジャストシステム	4,400	5,490.00	24,156,000
TDCソフト	2,400	934.00	2,241,600

Zホールディングス	372,500	383.00	142,667,500
ビー・エム・エル	3,400	3,215.00	10,931,000
トレンドマイクロ	12,100	5,770.00	69,817,000
りらいあコミュニケーションズ	4,800	1,464.00	7,027,200
IDホールディングス	1,300	1,436.00	1,866,800
リソー教育	12,100	409.00	4,948,900
日本オラクル	5,500	9,870.00	54,285,000
アルファシステムズ	800	2,826.00	2,260,800
フューチャー	3,300	1,879.00	6,200,700
CAC Holdings	1,800	1,518.00	2,732,400
SBテクノロジー	1,000	2,081.00	2,081,000
トーセ	2,000	880.00	1,760,000
ユー・エス・エス	29,600	2,091.00	61,893,600
オービックビジネスコンサルタント	2,800	4,665.00	13,062,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,400	2,984.00	37,001,600
アイティフォー	3,300	887.00	2,927,100
東計電算	500	3,395.00	1,697,500
サイバーエージェント	15,200	3,475.00	52,820,000
楽天	123,100	981.00	120,761,100
エクスネット	1,800	963.00	1,733,400
クリーク・アンド・リバー社	1,600	1,124.00	1,798,400
テー・オー・ダブリュー	2,300	833.00	1,915,900
大塚商会	14,700	4,485.00	65,929,500
サイボウズ	3,200	1,099.00	3,516,800
山田コンサルティンググループ	1,300	1,815.00	2,359,500
セントラルスポーツ	1,000	3,290.00	3,290,000
電通国際情報サービス	1,700	3,930.00	6,681,000
デジタルガレージ	4,900	3,940.00	19,306,000
イーエムシステムズ	1,900	2,159.00	4,102,100
ウェザーニューズ	900	3,470.00	3,123,000
C I J	2,000	919.00	1,838,000
ビジネスエンジニアリング	600	3,095.00	1,857,000
日本エンタープライズ	7,700	232.00	1,786,400
WOWOW	1,300	2,714.00	3,528,200
スカラ	2,100	794.00	1,667,400
フルキャストホールディングス	2,600	2,396.00	6,229,600
エン・ジャパン	4,700	5,210.00	24,487,000
富士フイルムホールディングス	53,000	5,127.00	271,731,000
コニカミノルタ	60,400	723.00	43,669,200
資生堂	54,900	8,001.00	439,254,900
ライオン	35,900	2,250.00	80,775,000
高砂香料工業	1,700	2,514.00	4,273,800
マンダム	6,200	2,914.00	18,066,800
ミルボン	3,700	5,940.00	21,978,000
ファンケル	11,200	3,095.00	34,664,000
コーセー	5,200	17,840.00	92,768,000
コタ	1,400	1,390.00	1,946,000
シーボン	700	2,515.00	1,760,500
ポーラ・オルビスホールディングス	11,800	2,600.00	30,680,000
ノエビアホールディングス	2,600	6,080.00	15,808,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	952.00	1,808,800
エステー	1,800	1,654.00	2,977,200
アグロ カネショウ	1,100	1,432.00	1,575,200
コニシ	4,500	1,472.00	6,624,000
長谷川香料	3,700	1,957.00	7,240,900
星光PMC	2,000	964.00	1,928,000
小林製薬	7,700	8,810.00	67,837,000
荒川化学工業	2,500	1,540.00	3,850,000
メック	1,900	1,772.00	3,366,800
日本高純度化学	800	2,630.00	2,104,000

タカラバイオ	7,200	2,200.00	15,840,000
JCU	3,300	2,776.00	9,160,800
新田ゼラチン	2,500	718.00	1,795,000
デクセリアルズ	7,100	1,066.00	7,568,600
アース製薬	2,100	5,690.00	11,949,000
北興化学工業	2,800	596.00	1,668,800
大成ラミック	900	2,920.00	2,628,000
クミアイ化学工業	11,400	1,004.00	11,445,600
日本農薬	4,900	559.00	2,739,100
富士興産	2,400	709.00	1,701,600
ニチレキ	3,300	1,314.00	4,336,200
ユシロ化学工業	1,600	1,394.00	2,230,400
ピーピー・カストロール	1,200	1,526.00	1,831,200
富士石油	7,300	238.00	1,737,400
MORESCO	700	1,352.00	946,400
出光興産	31,100	2,938.00	91,371,800
JXTGホールディングス	428,700	482.10	206,676,270
コスモエネルギーホールディングス	8,000	2,251.00	18,008,000
横浜ゴム	16,000	2,273.00	36,368,000
TOYO TIRE	15,900	1,558.00	24,772,200
ブリヂストン	85,000	4,330.00	368,050,000
住友ゴム工業	24,900	1,388.00	34,561,200
オカモト	1,700	4,165.00	7,080,500
アキレス	1,900	1,839.00	3,494,100
フコク	2,400	718.00	1,723,200
ニッタ	3,100	3,195.00	9,904,500
クリエートメディック	1,700	1,060.00	1,802,000
住友理工	5,400	997.00	5,383,800
三ツ星ベルト	3,600	2,089.00	7,520,400
バンドー化学	4,900	941.00	4,610,900
AGC	27,300	3,865.00	105,514,500
日本板硝子	13,200	632.00	8,342,400
石塚硝子	800	2,243.00	1,794,400
有沢製作所	4,400	985.00	4,334,000
日本山村硝子	1,300	1,252.00	1,627,600
日本電気硝子	11,100	2,387.00	26,495,700
オハラ	1,200	1,486.00	1,783,200
住友大阪セメント	5,200	4,780.00	24,856,000
太平洋セメント	17,500	3,195.00	55,912,500
リソルホールディングス	400	4,035.00	1,614,000
日本ヒューム	2,800	794.00	2,223,200
日本コンクリート工業	6,000	267.00	1,602,000
三谷セキサン	1,300	3,570.00	4,641,000
アジアパイルホールディングス	3,900	561.00	2,187,900
東海カーボン	29,000	1,043.00	30,247,000
日本カーボン	1,400	4,175.00	5,845,000
東洋炭素	1,600	2,368.00	3,788,800
ノリタケカンパニーリミテド	1,500	4,545.00	6,817,500
TOTO	19,700	4,615.00	90,915,500
日本碍子	33,700	1,788.00	60,255,600
日本特殊陶業	21,500	2,153.00	46,289,500
MARUWA	1,100	7,510.00	8,261,000
品川リフラクトリーズ	700	3,115.00	2,180,500
黒崎播磨	500	5,870.00	2,935,000
ヨータイ	2,500	713.00	1,782,500
イソライト工業	1,800	673.00	1,211,400
ニッカトー	2,200	754.00	1,658,800
フジミインコーポレーテッド	2,500	2,913.00	7,282,500
クニミネ工業	1,500	1,242.00	1,863,000
ニチアス	7,600	2,502.00	19,015,200

日本製鉄	122,300	1,584.50	193,784,350
神戸製鋼所	50,000	549.00	27,450,000
中山製鋼所	3,800	484.00	1,839,200
合同製鐵	1,500	2,566.00	3,849,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	73,800	1,291.00	95,275,800
東京製鐵	13,300	813.00	10,812,900
共英製鋼	3,100	1,968.00	6,100,800
大和工業	5,800	2,681.00	15,549,800
東京鐵鋼	1,100	1,552.00	1,707,200
大阪製鐵	1,500	1,414.00	2,121,000
淀川製鋼所	3,700	2,127.00	7,869,900
丸一鋼管	8,900	3,240.00	28,836,000
モリ工業	800	2,300.00	1,840,000
大同特殊鋼	4,500	5,010.00	22,545,000
日本高周波鋼業	4,000	425.00	1,700,000
日本冶金工業	2,300	2,286.00	5,257,800
山陽特殊製鋼	2,000	1,462.00	2,924,000
愛知製鋼	1,500	3,540.00	5,310,000
日立金属	29,400	1,453.00	42,718,200
日本金属	1,700	926.00	1,574,200
大平洋金属	1,800	2,293.00	4,127,400
新日本電工	17,600	168.00	2,956,800
栗本鐵工所	1,400	1,875.00	2,625,000
日本製鋼所	8,300	2,260.00	18,758,000
三菱製鋼	2,000	1,091.00	2,182,000
日垂鋼業	3,600	347.00	1,249,200
日本精線	600	2,944.00	1,766,400
大紀アルミニウム工業所	4,500	774.00	3,483,000
日本輕金属ホールディングス	69,200	226.00	15,639,200
三井金属鋁業	7,400	2,733.00	20,224,200
東邦亜鉛	1,400	2,023.00	2,832,200
三菱マテリアル	18,100	2,998.00	54,263,800
住友金属鋁山	34,900	3,358.00	117,194,200
DOWAホールディングス	6,900	4,005.00	27,634,500
古河機械金属	4,900	1,530.00	7,497,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	1,623.00	4,544,400
東邦チタニウム	4,900	929.00	4,552,100
UACJ	4,100	2,457.00	10,073,700
古河電気工業	8,500	2,969.00	25,236,500
住友電気工業	102,200	1,539.00	157,285,800
フジクラ	33,000	455.00	15,015,000
昭和電線ホールディングス	3,200	1,011.00	3,235,200
東京特殊電線	800	2,128.00	1,702,400
タツタ電線	5,500	565.00	3,107,500
カナレ電気	900	1,870.00	1,683,000
平河ヒューテック	1,400	1,250.00	1,750,000
リョービ	3,400	2,089.00	7,102,600
アーレスティ	3,600	541.00	1,947,600
アサヒホールディングス	4,800	2,526.00	12,124,800
東洋製罐グループホールディングス	17,400	1,877.00	32,659,800
ホッカンホールディングス	1,500	1,898.00	2,847,000
コロナ	1,500	1,168.00	1,752,000
横河ブリッジホールディングス	5,100	1,896.00	9,669,600
OSJBホールディングス	13,700	271.00	3,712,700
三和ホールディングス	26,200	1,262.00	33,064,400
文化シャッター	8,100	998.00	8,083,800
三協立山	3,800	1,226.00	4,658,800
アルインコ	2,000	1,167.00	2,334,000
LIXILグループ	40,300	1,987.00	80,076,100
日本フィルコン	3,300	563.00	1,857,900

ノーリツ	5,700	1,432.00	8,162,400
長府製作所	2,800	2,401.00	6,722,800
リンナイ	5,300	8,580.00	45,474,000
ユニプレス	5,400	1,659.00	8,958,600
ダイニチ工業	2,600	693.00	1,801,800
日東精工	3,800	551.00	2,093,800
三洋工業	900	2,045.00	1,840,500
岡部	5,500	917.00	5,043,500
ジーテクト	3,400	1,858.00	6,317,200
東プレ	5,100	1,794.00	9,149,400
高周波熱錬	5,300	895.00	4,743,500
東京製綱	2,000	1,127.00	2,254,000
サンコール	3,500	485.00	1,697,500
モリテックスチール	3,900	426.00	1,661,400
パイオラックス	4,000	2,168.00	8,672,000
エイチワン	2,700	729.00	1,968,300
日本発条	29,300	960.00	28,128,000
三浦工業	11,800	3,650.00	43,070,000
タクマ	9,300	1,233.00	11,466,900
テクノプロ・ホールディングス	5,300	7,020.00	37,206,000
インターワークス	3,500	514.00	1,799,000
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	4,515.00	4,966,500
Keeper 技研	1,200	1,381.00	1,657,200
三機サービス	1,800	1,000.00	1,800,000
Gunosy	1,800	1,731.00	3,115,800
イー・ガーディアン	1,300	2,187.00	2,843,100
リブセンス	4,800	309.00	1,483,200
ジャパンマテリアル	8,100	1,626.00	13,170,600
ベクトル	3,300	947.00	3,125,100
ウチヤマホールディングス	3,300	572.00	1,887,600
チャーム・ケア・コーポレーション	800	1,983.00	1,586,400
キャリアリンク	3,100	545.00	1,689,500
I B J	1,800	1,023.00	1,841,400
アサンテ	1,100	2,072.00	2,279,200
N・フィールド	2,700	718.00	1,938,600
バリューHR	500	3,660.00	1,830,000
M&Aキャピタルパートナーズ	900	8,720.00	7,848,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,300	1,675.00	2,177,500
E R Iホールディングス	2,200	804.00	1,768,800
アピスト	700	2,655.00	1,858,500
シグマクス	1,800	2,159.00	3,886,200
ウィルグループ	1,700	1,038.00	1,764,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,800	234.00	1,825,200
リクルートホールディングス	189,200	3,922.00	742,042,400
エラン	1,600	1,658.00	2,652,800
ツガミ	5,700	1,025.00	5,842,500
オークマ	3,200	6,070.00	19,424,000
東芝機械	3,100	2,666.00	8,264,600
アマダホールディングス	34,800	1,218.00	42,386,400
アイダエンジニアリング	7,400	971.00	7,185,400
滝澤鉄工所	1,300	1,399.00	1,818,700
F U J I	11,800	1,976.00	23,316,800
牧野フライス製作所	3,200	5,260.00	16,832,000
オーエスジー	12,600	2,250.00	28,350,000
ダイジェット工業	1,100	1,492.00	1,641,200
旭ダイヤモンド工業	7,200	648.00	4,665,600
D M G 森精機	17,300	1,706.00	29,513,800
ソディック	6,400	953.00	6,099,200
ディスコ	3,700	22,800.00	84,360,000

日東工器	1,500	2,352.00	3,528,000
日進工具	800	2,276.00	1,820,800
パンチ工業	3,200	546.00	1,747,200
日本郵政	216,500	1,016.00	219,964,000
ベルシステム24ホールディングス	4,400	1,801.00	7,924,400
鎌倉新書	2,000	1,682.00	3,364,000
一蔵	2,500	714.00	1,785,000
LITALICO	900	2,441.00	2,196,900
エボラブルアジア	1,200	2,125.00	2,550,000
アトラエ	700	3,620.00	2,534,000
ストライク	1,000	4,500.00	4,500,000
ソラスト	7,300	1,239.00	9,044,700
セラク	2,400	823.00	1,975,200
インソース	1,300	3,295.00	4,283,500
豊田自動織機	22,400	6,370.00	142,688,000
豊和工業	2,400	757.00	1,816,800
OKK	2,300	677.00	1,557,100
東洋機械金属	3,000	565.00	1,695,000
島精機製作所	4,400	2,725.00	11,990,000
オプトラン	3,000	2,870.00	8,610,000
NCホールディングス	3,600	546.00	1,965,600
イワキ	1,700	1,125.00	1,912,500
フリーー	2,700	1,032.00	2,786,400
ヤマシンフィルタ	5,900	927.00	5,469,300
日阪製作所	3,400	977.00	3,321,800
やまびこ	5,300	1,128.00	5,978,400
平田機工	1,300	7,350.00	9,555,000
ペガサスミシン製造	3,400	509.00	1,730,600
ナブテスコ	16,100	3,305.00	53,210,500
三井海洋開発	2,900	2,457.00	7,125,300
レオン自動機	2,700	1,685.00	4,549,500
SMC	8,700	48,710.00	423,777,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	3,100	543.00	1,683,300
ホソカワミクロン	1,000	4,275.00	4,275,000
ユニオンツール	1,000	3,220.00	3,220,000
オイレス工業	3,500	1,688.00	5,908,000
日精エー・エス・ピー機械	900	4,530.00	4,077,000
サトーホールディングス	3,900	3,305.00	12,889,500
技研製作所	2,400	4,065.00	9,756,000
日本エアテック	2,500	700.00	1,750,000
カワタ	1,100	1,155.00	1,270,500
日精樹脂工業	2,300	1,000.00	2,300,000
オカダアイヨン	1,300	1,274.00	1,656,200
小松製作所	125,200	2,564.00	321,012,800
住友重機械工業	15,800	3,110.00	49,138,000
日立建機	11,100	2,730.00	30,303,000
日工	3,800	709.00	2,694,200
巴工業	1,200	2,315.00	2,778,000
井関農機	2,800	1,600.00	4,480,000
TOWA	2,800	1,209.00	3,385,200
丸山製作所	1,400	1,237.00	1,731,800
北川鉄工所	1,200	2,203.00	2,643,600
シンニッタン	4,200	450.00	1,890,000
ローツェ	1,200	3,820.00	4,584,000
タカキタ	3,100	559.00	1,732,900
クボタ	146,700	1,670.50	245,062,350
荏原実業	800	2,108.00	1,686,400
東洋エンジニアリング	3,600	677.00	2,437,200
三菱化工機	1,000	1,960.00	1,960,000

月島機械	5,100	1,682.00	8,578,200
帝国電機製作所	2,300	1,314.00	3,022,200
新東工業	6,600	1,037.00	6,844,200
澁谷工業	2,400	3,025.00	7,260,000
アイチコーポレーション	4,800	682.00	3,273,600
小森コーポレーション	7,000	1,163.00	8,141,000
鶴見製作所	2,100	2,052.00	4,309,200
荏原製作所	12,300	3,275.00	40,282,500
西島製作所	2,800	980.00	2,744,000
北越工業	2,800	1,279.00	3,581,200
ダイキン工業	35,200	15,395.00	541,904,000
オルガノ	1,000	6,780.00	6,780,000
トーヨーカネツ	1,200	2,310.00	2,772,000
栗田工業	15,000	3,090.00	46,350,000
椿本チエイン	3,900	3,785.00	14,761,500
日機装	7,100	1,219.00	8,654,900
木村化工機	100	622.00	62,200
レイズネクスト	4,600	1,193.00	5,487,800
アネスト岩田	4,300	989.00	4,252,700
ダイフク	14,100	6,140.00	86,574,000
サムコ	1,600	1,132.00	1,811,200
加藤製作所	1,500	1,810.00	2,715,000
油研工業	1,100	1,686.00	1,854,600
タダノ	13,300	1,015.00	13,499,500
フジテック	10,000	1,690.00	16,900,000
C K D	7,700	1,797.00	13,836,900
キトー	2,100	1,615.00	3,391,500
平和	7,700	2,305.00	17,748,500
理想科学工業	2,400	1,917.00	4,600,800
S A N K Y O	6,200	3,750.00	23,250,000
日本金銭機械	3,100	933.00	2,892,300
マースグループホールディングス	1,800	2,022.00	3,639,600
福島工業	1,700	3,545.00	6,026,500
ダイコク電機	1,300	1,625.00	2,112,500
竹内製作所	4,600	1,674.00	7,700,400
アマノ	7,200	3,270.00	23,544,000
J U K I	3,800	913.00	3,469,400
サンデンホールディングス	3,600	814.00	2,930,400
蛇の目ミシン工業	4,300	406.00	1,745,800
ブラザー工業	33,800	2,196.00	74,224,800
マックス	4,200	2,233.00	9,378,600
モリタホールディングス	4,800	1,743.00	8,366,400
グローリー	7,700	3,320.00	25,564,000
新晃工業	2,600	1,997.00	5,192,200
大和冷機工業	4,000	1,278.00	5,112,000
セガサミーホールディングス	27,400	1,587.00	43,483,800
日本ピストンリング	1,300	1,417.00	1,842,100
リケン	1,300	4,220.00	5,486,000
T P R	3,700	2,089.00	7,729,300
ツバキ・ナカシマ	5,600	1,744.00	9,766,400
ホシザキ	8,100	9,570.00	77,517,000
大豊工業	2,300	852.00	1,959,600
日本精工	52,000	1,030.00	53,560,000
N T N	64,000	325.00	20,800,000
ジェイテクト	26,500	1,372.00	36,358,000
不二越	2,600	4,985.00	12,961,000
ミネベアミツミ	51,300	2,085.00	106,960,500
日本トムソン	8,200	491.00	4,026,200
T H K	16,100	2,933.00	47,221,300
ユーシン精機	2,100	1,009.00	2,118,900



前澤給装工業	1,000	2,091.00	2,091,000
イーグル工業	3,400	1,102.00	3,746,800
日本ピラー工業	2,800	1,426.00	3,992,800
キット	11,200	748.00	8,377,600
日立製作所	132,800	4,090.00	543,152,000
三菱電機	276,400	1,509.50	417,225,800
富士電機	16,700	3,305.00	55,193,500
東洋電機製造	1,100	1,507.00	1,657,700
安川電機	29,800	4,060.00	120,988,000
シンフォニア テクノロジー	3,600	1,342.00	4,831,200
明電舎	5,100	2,080.00	10,608,000
オリジン	1,100	1,452.00	1,597,200
山洋電気	1,300	5,140.00	6,682,000
デンヨー	2,400	2,072.00	4,972,800
ベイカレント・コンサルティング	1,600	5,860.00	9,376,000
MS - J a p a n	1,300	1,365.00	1,774,500
グレイステクノロジー	1,200	2,964.00	3,556,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,800	2,768.00	7,750,400
フルテック	1,300	1,402.00	1,822,600
日総工産	1,700	1,111.00	1,888,700
キュービーネットホールディングス	1,600	2,498.00	3,996,800
R P Aホールディングス	1,500	1,224.00	1,836,000
三櫻工業	3,500	1,422.00	4,977,000
マキタ	36,000	3,630.00	130,680,000
東芝テック	3,500	4,185.00	14,647,500
芝浦メカトロニクス	500	3,920.00	1,960,000
マブチモーター	7,600	4,385.00	33,326,000
日本電産	33,300	16,100.00	536,130,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,800	534.00	961,200
トレックス・セミコンダクター	1,600	1,447.00	2,315,200
東光高岳	1,500	1,138.00	1,707,000
ダブル・スコープ	4,000	620.00	2,480,000
ダイヘン	3,000	3,525.00	10,575,000
ヤーマン	4,000	681.00	2,724,000
J V Cケンウッド	22,500	271.00	6,097,500
ミマキエンジニアリング	3,000	529.00	1,587,000
第一精工	1,000	2,630.00	2,630,000
日新電機	6,500	1,135.00	7,377,500
大崎電気工業	5,500	726.00	3,993,000
オムロン	25,700	6,480.00	166,536,000
日東工業	4,100	2,359.00	9,671,900
I D E C	4,000	2,277.00	9,108,000
不二電機工業	1,400	1,257.00	1,759,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,200	2,250.00	20,700,000
サクサホールディングス	900	2,000.00	1,800,000
メルコホールディングス	1,000	3,015.00	3,015,000
日本電気	33,500	4,480.00	150,080,000
富士通	26,600	9,860.00	262,276,000
沖電気工業	11,200	1,507.00	16,878,400
電気興業	1,300	3,200.00	4,160,000
サンケン電気	3,000	3,125.00	9,375,000
アイホン	1,600	1,914.00	3,062,400
ルネサスエレクトロニクス	131,800	710.00	93,578,000
セイコーエプソン	34,300	1,558.00	53,439,400
ワコム	18,600	436.00	8,109,600
アルバック	5,500	4,240.00	23,320,000
E I Z O	2,100	4,150.00	8,715,000
ジャパンディスプレイ	79,900	73.00	5,832,700
日本信号	7,000	1,263.00	8,841,000

京三製作所	6,500	499.00	3,243,500
能美防災	3,700	2,264.00	8,376,800
ホーチキ	2,000	1,537.00	3,074,000
エレコム	3,000	4,210.00	12,630,000
パナソニック	315,800	1,002.00	316,431,600
シャープ	32,000	1,690.00	54,080,000
アンリツ	17,800	2,090.00	37,202,000
富士通ゼネラル	7,500	2,060.00	15,450,000
ソニー	174,700	6,697.00	1,169,965,900
T D K	13,300	11,100.00	147,630,000
帝国通信工業	1,500	1,182.00	1,773,000
タムラ製作所	9,200	650.00	5,980,000
アルプスアルパイン	24,500	2,371.00	58,089,500
池上通信機	1,600	1,053.00	1,684,800
日本電波工業	3,800	477.00	1,812,600
鈴木	2,200	781.00	1,718,200
日本トリム	400	5,050.00	2,020,000
ローランド ディー・ジー	1,500	2,128.00	3,192,000
フォスター電機	2,900	1,980.00	5,742,000
S M K	700	2,992.00	2,094,400
ヨコオ	1,800	3,165.00	5,697,000
ホシデン	7,600	1,264.00	9,606,400
ヒロセ電機	4,300	13,770.00	59,211,000
日本航空電子工業	6,300	2,074.00	13,066,200
T O A	3,000	1,093.00	3,279,000
マクセルホールディングス	6,000	1,483.00	8,898,000
古野電気	3,600	1,241.00	4,467,600
ユニデンホールディングス	900	1,804.00	1,623,600
スミダコーポレーション	2,100	1,302.00	2,734,200
アイコム	1,500	2,661.00	3,991,500
リオン	1,200	2,599.00	3,118,800
船井電機	2,800	658.00	1,842,400
横河電機	25,400	1,860.00	47,244,000
新電元工業	1,000	3,630.00	3,630,000
アズビル	17,400	3,200.00	55,680,000
東亜ディーケーケー	2,000	876.00	1,752,000
日本光電工業	11,400	2,936.00	33,470,400
共和電業	4,100	427.00	1,750,700
日本電子材料	2,400	777.00	1,864,800
堀場製作所	5,500	7,230.00	39,765,000
アドバンテスト	20,600	5,410.00	111,446,000
小野測器	3,400	527.00	1,791,800
エスベック	2,400	1,979.00	4,749,600
キーエンス	25,000	36,700.00	917,500,000
日置電機	1,400	3,745.00	5,243,000
シスメックス	19,700	7,674.00	151,177,800
日本マイクロニクス	4,800	1,150.00	5,520,000
メガチップス	2,600	2,404.00	6,250,400
O B A R A G R O U P	1,400	3,890.00	5,446,000
I M A G I C A G R O U P	2,700	653.00	1,763,100
澤藤電機	1,000	2,398.00	2,398,000
デンソー	60,900	4,948.00	301,333,200
原田工業	1,900	931.00	1,768,900
コーセル	3,400	1,262.00	4,290,800
イリソ電子工業	2,300	5,140.00	11,822,000
オブテックグループ	4,500	1,563.00	7,033,500
千代田インテグレ	1,300	2,309.00	3,001,700
アイ・オー・データ機器	1,900	944.00	1,793,600
レーザーテック	5,700	8,720.00	49,704,000
スタンレー電気	19,500	2,991.00	58,324,500

岩崎電気	1,200	1,405.00	1,686,000
ウシオ電機	16,100	1,642.00	26,436,200
岡谷電機産業	4,400	377.00	1,658,800
ヘリオス テクノ ホールディング	3,600	481.00	1,731,600
日本セラミック	2,800	2,733.00	7,652,400
遠藤照明	2,600	692.00	1,799,200
古河電池	2,300	762.00	1,752,600
山一電機	2,000	1,596.00	3,192,000
図研	1,800	2,315.00	4,167,000
日本電子	5,500	2,911.00	16,010,500
カシオ計算機	24,500	2,025.00	49,612,500
ファナック	26,300	20,645.00	542,963,500
日本シイエムケイ	6,500	682.00	4,433,000
エンプラス	1,400	3,540.00	4,956,000
ローム	12,300	9,050.00	111,315,000
浜松ホトニクス	19,800	4,595.00	90,981,000
三井ハイテック	3,000	2,037.00	6,111,000
新光電気工業	9,300	1,077.00	10,016,100
京セラ	38,900	7,075.00	275,217,500
協栄産業	1,200	1,527.00	1,832,400
太陽誘電	12,300	2,805.00	34,501,500
村田製作所	81,200	6,069.00	492,802,800
双葉電子工業	4,400	1,380.00	6,072,000
日東電工	19,100	6,120.00	116,892,000
北陸電気工業	1,500	1,104.00	1,656,000
東海理化電機製作所	7,300	2,055.00	15,001,500
ニチコン	9,400	1,147.00	10,781,800
日本ケミコン	2,100	1,921.00	4,034,100
K O A	4,200	1,395.00	5,859,000
三井E & Sホールディングス	10,000	851.00	8,510,000
日立造船	21,900	418.00	9,154,200
三菱重工業	46,300	4,234.00	196,034,200
川崎重工業	21,500	2,455.00	52,782,500
I H I	19,900	2,489.00	49,531,100
名村造船所	8,900	280.00	2,492,000
スプリックス	1,100	1,249.00	1,373,900
日本車輛製造	1,000	3,010.00	3,010,000
三菱ロジスネクスト	3,700	1,068.00	3,951,600
近畿車輛	1,100	1,425.00	1,567,500
F P G	8,600	1,175.00	10,105,000
島根銀行	2,500	710.00	1,775,000
じもとホールディングス	18,400	111.00	2,042,400
全国保証	7,700	4,295.00	33,071,500
めぶきフィナンシャルグループ	141,700	283.00	40,101,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,700	1,511.00	5,590,700
九州フィナンシャルグループ	44,700	487.00	21,768,900
かんぽ生命保険	9,700	1,805.00	17,508,500
ゆうちょ銀行	77,200	1,043.00	80,519,600
富山第一銀行	6,500	347.00	2,255,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	160,400	445.00	71,378,000
西日本フィナンシャルホールディングス	18,600	848.00	15,772,800
日本モーゲージサービス	1,300	1,552.00	2,017,600
アルヒ	4,300	2,539.00	10,917,700
プレミアグループ	1,500	2,519.00	3,778,500
日産自動車	326,000	670.80	218,680,800
いすゞ自動車	80,100	1,285.50	102,968,550
トヨタ自動車	308,000	7,688.00	2,367,904,000
日野自動車	34,500	1,053.00	36,328,500
三菱自動車工業	102,300	487.00	49,820,100

エフテック	2,400	711.00	1,706,400
武蔵精密工業	6,200	1,522.00	9,436,400
日産車体	5,400	1,042.00	5,626,800
新明和工業	7,400	1,373.00	10,160,200
極東開発工業	5,100	1,559.00	7,950,900
日信工業	5,600	2,230.00	12,488,000
トビー工業	2,300	2,114.00	4,862,200
ティラド	1,000	2,137.00	2,137,000
曙ブレーキ工業	15,200	255.00	3,876,000
タチエス	4,500	1,420.00	6,390,000
N O K	14,900	1,662.00	24,763,800
フタバ産業	7,700	810.00	6,237,000
K Y B	3,100	3,360.00	10,416,000
市光工業	4,100	812.00	3,329,200
大同メタル工業	5,300	695.00	3,683,500
プレス工業	13,700	457.00	6,260,900
ミクニ	4,800	336.00	1,612,800
太平洋工業	5,800	1,543.00	8,949,400
ケーヒン	6,300	2,574.00	16,216,200
河西工業	3,700	863.00	3,193,100
アイシン精機	22,800	4,155.00	94,734,000
マツダ	81,300	952.00	77,397,600
今仙電機製作所	2,600	930.00	2,418,000
本田技研工業	217,700	3,092.00	673,128,400
スズキ	54,800	4,946.00	271,040,800
S U B A R U	85,800	2,903.00	249,077,400
安永	1,300	1,266.00	1,645,800
ヤマハ発動機	36,000	2,263.00	81,468,000
ショーワ	6,500	2,274.00	14,781,000
小糸製作所	16,600	5,580.00	92,628,000
T B K	3,800	421.00	1,599,800
エクセディ	3,800	2,401.00	9,123,800
ミツバ	5,100	726.00	3,702,600
豊田合成	8,900	2,499.00	22,241,100
愛三工業	4,300	885.00	3,805,500
日本プラスト	2,400	695.00	1,668,000
ヨロズ	2,600	1,444.00	3,754,400
エフ・シー・シー	4,500	2,285.00	10,282,500
シマノ	10,300	17,520.00	180,456,000
テイ・エス テック	6,400	3,440.00	22,016,000
関西みらいフィナンシャルグループ	16,000	709.00	11,344,000
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,694.00	4,235,000
第四北越フィナンシャルグループ	4,700	2,884.00	13,554,800
ジャムコ	1,400	1,419.00	1,986,600
小野建	2,400	1,328.00	3,187,200
ノジマ	4,800	2,282.00	10,953,600
佐鳥電機	2,000	918.00	1,836,000
カップ・クリエイト	3,800	1,467.00	5,574,600
伯東	1,700	1,255.00	2,133,500
コンドーテック	2,100	1,079.00	2,265,900
ライトオン	3,100	584.00	1,810,400
ナガイレーベン	3,900	2,569.00	10,019,100
三菱食品	3,000	2,930.00	8,790,000
良品計画	36,100	2,422.00	87,434,200
松田産業	2,000	1,550.00	3,100,000
第一興商	4,100	5,450.00	22,345,000
メディバルホールディングス	29,400	2,544.00	74,793,600
アドヴァン	4,200	1,293.00	5,430,600
S P K	100	2,827.00	282,700
萩原電気ホールディングス	1,000	2,839.00	2,839,000

アルビス	1,000	2,292.00	2,292,000
アズワン	1,800	9,020.00	16,236,000
スズデン	1,200	1,413.00	1,695,600
シモジマ	1,700	1,254.00	2,131,800
ドウシシャ	2,600	1,753.00	4,557,800
小津産業	1,000	1,847.00	1,847,000
コナカ	4,300	399.00	1,715,700
高速	1,600	1,237.00	1,979,200
G-7ホールディングス	800	3,895.00	3,116,000
イオン北海道	2,700	792.00	2,138,400
コジマ	4,700	458.00	2,152,600
ヒマラヤ	2,100	842.00	1,768,200
コーナン商事	3,900	2,542.00	9,913,800
ネットワンシステムズ	10,300	3,050.00	31,415,000
エコス	1,100	1,681.00	1,849,100
ワタミ	3,200	1,276.00	4,083,200
マルシェ	2,300	784.00	1,803,200
システムソフト	15,800	112.00	1,769,600
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	65,200	1,740.00	113,448,000
丸文	2,900	576.00	1,670,400
西松屋チェーン	6,000	938.00	5,628,000
ゼンショーホールディングス	13,000	2,529.00	32,877,000
ハビネット	2,300	1,412.00	3,247,600
幸楽苑ホールディングス	1,700	2,087.00	3,547,900
日本ライフライン	8,100	1,529.00	12,384,900
サイゼリヤ	4,500	2,534.00	11,403,000
エクセル	1,400	1,244.00	1,741,600
V Tホールディングス	11,300	478.00	5,401,400
マルカ	1,000	2,430.00	2,430,000
アルゴグラフィックス	2,300	3,100.00	7,130,000
IDOM	7,300	463.00	3,379,900
日本エム・ディ・エム	1,600	2,183.00	3,492,800
ユナイテッドアローズ	2,900	3,380.00	9,802,000
進和	1,600	2,403.00	3,844,800
ダイトロン	1,200	1,556.00	1,867,200
ハイデイ日高	3,900	2,173.00	8,474,700
シークス	3,500	1,526.00	5,341,000
京都きもの友禅	4,800	354.00	1,699,200
コロワイド	9,000	2,197.00	19,773,000
ピーシーデポコーポレーション	3,600	458.00	1,648,800
田中商事	2,600	715.00	1,859,000
オーハシテクニカ	1,500	1,464.00	2,196,000
壱番屋	1,900	5,010.00	9,519,000
白銅	1,300	1,441.00	1,873,300
PLANT	2,600	660.00	1,716,000
スギホールディングス	5,400	6,400.00	34,560,000
薬王堂ホールディングス	1,200	2,559.00	3,070,800
島津製作所	33,000	3,170.00	104,610,000
JMS	2,600	713.00	1,853,800
長野計器	400	708.00	283,200
ブイ・テクノロジー	1,300	5,750.00	7,475,000
スター精密	4,300	1,519.00	6,531,700
東京計器	1,800	1,007.00	1,812,600
インターアクション	1,500	2,277.00	3,415,500
オーバル	6,900	252.00	1,738,800
東京精密	5,000	3,850.00	19,250,000
マニー	11,000	2,893.00	31,823,000
ニコン	44,700	1,486.00	66,424,200
トプコン	13,900	1,431.00	19,890,900

オリンパス	152,900	1,702.50	260,312,250
理研計器	2,400	2,415.00	5,796,000
S C R E E Nホールディングス	4,800	7,430.00	35,664,000
キヤノン電子	2,900	2,016.00	5,846,400
タムロン	2,200	2,448.00	5,385,600
HOYA	55,700	9,769.00	544,133,300
シード	2,000	1,024.00	2,048,000
ノーリツ鋼機	1,900	1,699.00	3,228,100
エー・アンド・デイ	2,500	788.00	1,970,000
朝日インテック	23,500	3,155.00	74,142,500
キヤノン	148,800	2,982.50	443,796,000
リコー	70,300	1,115.00	78,384,500
シチズン時計	32,400	588.00	19,051,200
リズム時計工業	1,800	901.00	1,621,800
大研医器	3,300	521.00	1,719,300
メニコン	3,800	4,335.00	16,473,000
スノーピーク	1,700	1,062.00	1,805,400
パラマウントベッドホールディングス	2,900	4,175.00	12,107,500
トランザクション	1,900	978.00	1,858,200
S H O B I	4,200	394.00	1,654,800
ニホンフラッシュ	1,300	2,485.00	3,230,500
前田工織	3,000	1,806.00	5,418,000
永大産業	4,900	348.00	1,705,200
アートネイチャー	3,000	729.00	2,187,000
バンダイナムコホールディングス	28,600	6,692.00	191,391,200
共立印刷	100	164.00	16,400
S H O E I	1,300	5,080.00	6,604,000
フランスベッドホールディングス	3,900	1,012.00	3,946,800
マーベラス	4,100	771.00	3,161,100
パイロットコーポレーション	4,800	4,200.00	20,160,000
萩原工業	1,500	1,628.00	2,442,000
エイベックス	4,700	1,330.00	6,251,000
トッパン・フォームズ	5,900	1,101.00	6,495,900
フジシールインターナショナル	6,200	2,454.00	15,214,800
タカラトミー	12,400	1,279.00	15,859,600
廣済堂	2,500	781.00	1,952,500
アーク	18,800	94.00	1,767,200
レック	2,900	1,253.00	3,633,700
三光合成	4,400	422.00	1,856,800
プロネクス	2,400	1,226.00	2,942,400
ホクシン	10,500	167.00	1,753,500
大建工業	1,900	1,934.00	3,674,600
凸版印刷	39,000	2,187.00	85,293,000
大日本印刷	36,200	2,998.00	108,527,600
共同印刷	900	2,892.00	2,602,800
N I S S H A	5,700	1,145.00	6,526,500
光村印刷	1,000	1,719.00	1,719,000
藤森工業	2,500	3,490.00	8,725,000
ヴィア・ホールディングス	3,300	662.00	2,184,600
宝印刷	1,300	1,741.00	2,263,300
前澤化成工業	1,800	1,222.00	2,199,600
未来工業	1,500	2,166.00	3,249,000
アシックス	22,800	1,682.00	38,349,600
ツツミ	900	2,118.00	1,906,200
J S P	1,600	1,909.00	3,054,400
ニチハ	3,800	2,954.00	11,225,200
エフピコ	3,000	6,510.00	19,530,000
小松ウオール工業	800	2,408.00	1,926,400
ヤマハ	16,400	6,060.00	99,384,000
河合楽器製作所	900	3,590.00	3,231,000

ビジョン	16,700	5,110.00	85,337,000
天馬	1,800	1,983.00	3,569,400
キングジム	2,300	889.00	2,044,700
象印マホービン	8,100	1,741.00	14,102,100
リンテック	6,600	2,374.00	15,668,400
信越ポリマー	5,000	956.00	4,780,000
東リ	6,900	298.00	2,056,200
イトーキ	5,900	501.00	2,955,900
任天堂	17,000	42,970.00	730,490,000
三菱鉛筆	4,600	1,730.00	7,958,000
松風	1,200	1,678.00	2,013,600
タカラスタANDARD	5,700	1,975.00	11,257,500
コクヨ	13,300	1,602.00	21,306,600
ニフコ	10,100	2,978.00	30,077,800
立川ブラインド工業	1,200	1,438.00	1,725,600
グロープライド	1,200	2,785.00	3,342,000
オカムラ	9,600	1,055.00	10,128,000
バルカー	2,200	2,557.00	5,625,400
伊藤忠商事	190,400	2,414.50	459,720,800
丸紅	283,400	793.80	224,962,920
スクロール	5,200	346.00	1,799,200
ヨンドシーホールディングス	2,800	2,559.00	7,165,200
三陽商会	1,400	1,428.00	1,999,200
長瀬産業	15,300	1,593.00	24,372,900
蝶理	1,700	1,897.00	3,224,900
豊田通商	30,400	3,820.00	116,128,000
オンワードホールディングス	16,300	629.00	10,252,700
三共生興	4,100	591.00	2,423,100
兼松	10,200	1,420.00	14,484,000
美津濃	2,500	2,876.00	7,190,000
ファミリーマート	21,700	2,648.00	57,461,600
三井物産	239,300	1,928.00	461,370,400
日本紙バルブ商事	1,500	3,990.00	5,985,000
東京エレクトロン	18,400	22,510.00	414,184,000
日立ハイテクノロジーズ	9,500	6,820.00	64,790,000
カメイ	3,500	1,203.00	4,210,500
東都水産	700	2,574.00	1,801,800
OUGホールディングス	700	2,736.00	1,915,200
スターゼン	1,000	4,515.00	4,515,000
セイコーホールディングス	3,900	2,751.00	10,728,900
山善	10,600	1,019.00	10,801,400
椿本興業	500	3,920.00	1,960,000
住友商事	171,800	1,637.50	281,322,500
日本ユニシス	8,500	3,500.00	29,750,000
内田洋行	1,200	4,285.00	5,142,000
三菱商事	191,000	2,829.50	540,434,500
第一実業	1,300	3,650.00	4,745,000
キヤノンマーケティングジャパン	7,800	2,444.00	19,063,200
西華産業	1,500	1,400.00	2,100,000
佐藤商事	2,200	906.00	1,993,200
菱洋エレクトロ	2,800	1,927.00	5,395,600
東京産業	3,100	548.00	1,698,800
ユアサ商事	2,600	3,515.00	9,139,000
神鋼商事	700	2,625.00	1,837,500
阪和興業	5,100	2,752.00	14,035,200
正栄食品工業	1,800	3,195.00	5,751,000
カナデン	2,200	1,322.00	2,908,400
菱電商事	2,000	1,676.00	3,352,000
ニプロ	19,100	1,290.00	24,639,000
フルサト工業	1,500	1,631.00	2,446,500

岩谷産業	6,000	3,675.00	22,050,000
すてきナイスグループ	1,800	1,096.00	1,972,800
昭光通商	2,700	659.00	1,779,300
イワキ	3,800	463.00	1,759,400
兼松エレクトロニクス	1,500	3,380.00	5,070,000
三愛石油	6,700	1,059.00	7,095,300
稲畑産業	6,000	1,512.00	9,072,000
ゴールドウイン	4,900	7,460.00	36,554,000
ユニ・チャーム	53,300	3,489.00	185,963,700
デサント	5,300	1,520.00	8,056,000
ワキタ	5,800	1,100.00	6,380,000
ヤマトインターナショナル	4,400	394.00	1,733,600
東邦ホールディングス	8,700	2,661.00	23,150,700
サンゲツ	7,500	2,100.00	15,750,000
ミツウロコグループホールディングス	4,000	1,397.00	5,588,000
シナネンホールディングス	1,100	1,931.00	2,124,100
伊藤忠エネクス	6,000	878.00	5,268,000
サンリオ	7,600	2,162.00	16,431,200
サンワテクノス	1,900	1,150.00	2,185,000
リョーサン	3,000	2,873.00	8,619,000
新光商事	4,300	882.00	3,792,600
トーホー	1,200	1,791.00	2,149,200
三信電気	1,500	1,634.00	2,451,000
東陽テクニカ	3,100	1,121.00	3,475,100
モスフードサービス	3,600	3,040.00	10,944,000
加賀電子	2,700	2,440.00	6,588,000
三益半導体工業	2,400	2,042.00	4,900,800
ソーダニッカ	2,800	603.00	1,688,400
立花エレテック	2,000	1,723.00	3,446,000
木曽路	3,600	2,817.00	10,141,200
S R Sホールディングス	3,200	1,047.00	3,350,400
千趣会	4,900	385.00	1,886,500
ケーヨー	5,600	534.00	2,990,400
上新電機	3,200	2,416.00	7,731,200
日本瓦斯	4,300	3,155.00	13,566,500
ロイヤルホールディングス	4,800	2,482.00	11,913,600
東天紅	1,400	1,265.00	1,771,000
いなげや	3,400	1,491.00	5,069,400
島忠	5,800	3,085.00	17,893,000
チヨダ	2,900	1,635.00	4,741,500
ライフコーポレーション	2,100	2,465.00	5,176,500
リンガーハット	3,400	2,466.00	8,384,400
MrMaxHD	3,700	497.00	1,838,900
テナアライド	4,000	443.00	1,772,000
AOKIホールディングス	5,400	1,137.00	6,139,800
オークワ	4,300	1,382.00	5,942,600
コメリ	4,200	2,327.00	9,773,400
青山商事	5,600	1,653.00	9,256,800
しまむら	3,200	9,410.00	30,112,000
はせがわ	4,300	407.00	1,750,100
高島屋	19,800	1,304.00	25,819,200
松屋	5,500	859.00	4,724,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	12,900	1,213.00	15,647,700
近鉄百貨店	1,000	3,560.00	3,560,000
パルコ	2,600	1,354.00	3,520,400
丸井グループ	25,000	2,652.00	66,300,000
クレディセゾン	19,100	1,807.00	34,513,700
アクシアルリテイリング	2,300	3,920.00	9,016,000
イオン	104,800	2,248.00	235,590,400
イズミ	5,500	4,220.00	23,210,000



平和堂	5,500	2,093.00	11,511,500
フジ	3,300	1,956.00	6,454,800
ヤオコー	3,100	5,130.00	15,903,000
ゼビオホールディングス	3,300	1,261.00	4,161,300
ケーズホールディングス	26,300	1,328.00	34,926,400
PALTA C	4,400	5,380.00	23,672,000
三谷産業	5,300	341.00	1,807,300
新生銀行	20,000	1,723.00	34,460,000
あおぞら銀行	16,200	2,820.00	45,684,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,876,800	572.20	1,073,904,960
りそなホールディングス	299,200	468.70	140,235,040
三井住友トラスト・ホールディングス	51,600	4,197.00	216,565,200
三井住友フィナンシャルグループ	188,600	3,967.00	748,176,200
千葉銀行	93,800	619.00	58,062,200
群馬銀行	53,600	386.00	20,689,600
武蔵野銀行	4,100	1,974.00	8,093,400
千葉興業銀行	7,500	344.00	2,580,000
筑波銀行	11,300	250.00	2,825,000
七十七銀行	9,300	1,718.00	15,977,400
青森銀行	2,200	2,751.00	6,052,200
秋田銀行	1,700	2,206.00	3,750,200
山形銀行	3,100	1,582.00	4,904,200
岩手銀行	1,800	2,867.00	5,160,600
東邦銀行	24,400	274.00	6,685,600
みちのく銀行	1,800	1,587.00	2,856,600
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	2,033.00	46,759,000
静岡銀行	67,500	822.00	55,485,000
十六銀行	3,400	2,592.00	8,812,800
スルガ銀行	27,900	579.00	16,154,100
八十二銀行	65,800	463.00	30,465,400
山梨中央銀行	3,200	1,113.00	3,561,600
大垣共立銀行	5,400	2,522.00	13,618,800
福井銀行	2,300	1,549.00	3,562,700
北國銀行	2,900	3,315.00	9,613,500
清水銀行	1,100	2,063.00	2,269,300
富山銀行	700	2,587.00	1,810,900
滋賀銀行	5,500	2,633.00	14,481,500
南都銀行	4,500	2,765.00	12,442,500
百五銀行	24,500	355.00	8,697,500
京都銀行	9,800	4,480.00	43,904,000
紀陽銀行	9,700	1,656.00	16,063,200
ほくほくフィナンシャルグループ	18,100	1,114.00	20,163,400
広島銀行	40,200	536.00	21,547,200
山陰合同銀行	16,200	669.00	10,837,800
中国銀行	23,500	1,055.00	24,792,500
鳥取銀行	1,300	1,376.00	1,788,800
伊予銀行	38,900	592.00	23,028,800
百十四銀行	2,900	2,253.00	6,533,700
四国銀行	4,100	999.00	4,095,900
阿波銀行	4,500	2,661.00	11,974,500
大分銀行	1,600	2,817.00	4,507,200
宮崎銀行	1,800	2,607.00	4,692,600
佐賀銀行	1,700	1,627.00	2,765,900
沖縄銀行	2,500	3,590.00	8,975,000
琉球銀行	6,300	1,199.00	7,553,700
セブン銀行	91,100	332.00	30,245,200
みずほフィナンシャルグループ	3,704,700	168.80	625,353,360
山口フィナンシャルグループ	34,000	748.00	25,432,000
芙蓉総合リース	2,900	7,130.00	20,677,000
みずほリース	4,200	3,125.00	13,125,000

東京センチュリー	5,500	5,900.00	32,450,000
SBIホールディングス	30,500	2,237.00	68,228,500
日本証券金融	12,000	525.00	6,300,000
アイフル	41,600	239.00	9,942,400
長野銀行	1,100	1,666.00	1,832,600
名古屋銀行	2,300	3,255.00	7,486,500
北洋銀行	41,100	237.00	9,740,700
愛知銀行	1,000	3,765.00	3,765,000
中京銀行	1,100	2,242.00	2,466,200
大光銀行	1,000	1,731.00	1,731,000
愛媛銀行	3,800	1,215.00	4,617,000
京葉銀行	11,600	645.00	7,482,000
栃木銀行	13,200	232.00	3,062,400
北日本銀行	900	2,097.00	1,887,300
東和銀行	4,800	905.00	4,344,000
リコーリース	2,200	3,745.00	8,239,000
イオンフィナンシャルサービス	16,700	1,659.00	27,705,300
アコム	54,800	446.00	24,440,800
ジャックス	3,000	2,673.00	8,019,000
オリエン特コーポレーション	73,800	172.00	12,693,600
日立キャピタル	6,400	2,568.00	16,435,200
アプラスフィナンシャル	18,100	88.00	1,592,800
オリックス	170,500	1,756.00	299,398,000
三菱UFJリース	69,200	698.00	48,301,600
ジャフコ	4,200	4,160.00	17,472,000
トモニホールディングス	21,100	391.00	8,250,100
大和証券グループ本社	218,800	534.40	116,926,720
野村ホールディングス	479,700	543.90	260,908,830
岡三証券グループ	23,200	402.00	9,326,400
丸三証券	8,100	536.00	4,341,600
東洋証券	10,200	168.00	1,713,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	31,300	335.00	10,485,500
光世証券	2,300	688.00	1,582,400
水戸証券	7,900	265.00	2,093,500
いちよし証券	5,100	689.00	3,513,900
松井証券	15,600	893.00	13,930,800
SOMPOホールディングス	51,300	4,417.00	226,592,100
だいら証券ビジネス	3,000	603.00	1,809,000
日本取引所グループ	78,300	1,884.00	147,517,200
マネックスグループ	20,600	279.00	5,747,400
極東証券	3,700	800.00	2,960,000
岩井コスモホールディングス	2,600	1,218.00	3,166,800
藍澤證券	4,900	726.00	3,557,400
フィデアホールディングス	26,500	134.00	3,551,000
池田泉州ホールディングス	31,400	203.00	6,374,200
アニコムホールディングス	2,300	3,765.00	8,659,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	71,300	3,515.00	250,619,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	22,400	2,400.00	53,760,000
スパークス・グループ	9,400	252.00	2,368,800
第一生命ホールディングス	154,300	1,739.00	268,327,700
東京海上ホールディングス	97,500	5,934.00	578,565,000
イー・ギャランティ	2,900	1,505.00	4,364,500
アサックス	2,800	648.00	1,814,400
NECキャピタルソリューション	1,100	2,457.00	2,702,700
T&Dホールディングス	84,300	1,266.00	106,723,800
アドバンスクリエイト	400	1,874.00	749,600
三井不動産	136,100	2,755.50	375,023,550
三菱地所	191,000	2,013.00	384,483,000

平和不動産	5,000	2,550.00	12,750,000
東京建物	29,800	1,538.00	45,832,400
ダイビル	7,000	1,155.00	8,085,000
京阪神ビルディング	4,400	1,378.00	6,063,200
住友不動産	61,300	3,828.00	234,656,400
テーオーシー	5,300	842.00	4,462,600
東京楽天地	400	6,170.00	2,468,000
レオパレス21	35,700	307.00	10,959,900
スターツコーポレーション	3,700	2,703.00	10,001,100
フジ住宅	3,200	670.00	2,144,000
空港施設	3,100	560.00	1,736,000
明和地所	3,000	588.00	1,764,000
ゴールドクレスト	2,100	2,202.00	4,624,200
リログループ	14,400	2,864.00	41,241,600
エスリード	1,100	2,140.00	2,354,000
日神不動産	4,100	501.00	2,054,100
日本エスコン	4,900	965.00	4,728,500
タカラレーベン	12,500	497.00	6,212,500
サンヨーハウジング名古屋	1,800	975.00	1,755,000
イオンモール	13,700	1,732.00	23,728,400
毎日コムネット	2,200	819.00	1,801,800
ファースト住建	1,300	1,280.00	1,664,000
カチタス	3,400	5,140.00	17,476,000
東祥	1,600	2,406.00	3,849,600
トーセイ	3,800	1,430.00	5,434,000
穴吹興産	600	2,872.00	1,723,200
サンフロンティア不動産	3,800	1,312.00	4,985,600
エフ・ジェー・ネクスト	2,400	1,058.00	2,539,200
グランディハウス	3,500	470.00	1,645,000
東武鉄道	29,200	4,000.00	116,800,000
相鉄ホールディングス	8,800	3,035.00	26,708,000
東急	69,700	2,171.00	151,318,700
京浜急行電鉄	35,500	2,275.00	80,762,500
小田急電鉄	41,100	2,725.00	111,997,500
京王電鉄	14,300	7,000.00	100,100,000
京成電鉄	19,200	4,565.00	87,648,000
富士急行	3,800	4,320.00	16,416,000
新京成電鉄	400	2,285.00	914,000
東日本旅客鉄道	48,700	10,115.00	492,600,500
西日本旅客鉄道	24,600	9,841.00	242,088,600
東海旅客鉄道	23,000	22,440.00	516,120,000
西武ホールディングス	37,100	1,932.00	71,677,200
鴻池運輸	4,400	1,661.00	7,308,400
西日本鉄道	7,700	2,535.00	19,519,500
ハマキョウレックス	2,100	3,725.00	7,822,500
サカイ引越センター	1,500	6,750.00	10,125,000
近鉄グループホールディングス	26,200	6,210.00	162,702,000
阪急阪神ホールディングス	34,900	4,750.00	165,775,000
南海電気鉄道	12,400	2,963.00	36,741,200
京阪ホールディングス	11,700	5,370.00	62,829,000
神戸電鉄	600	3,975.00	2,385,000
名古屋鉄道	21,500	3,585.00	77,077,500
山陽電気鉄道	1,900	2,240.00	4,256,000
トランコム	700	7,270.00	5,089,000
日本通運	9,300	6,770.00	62,961,000
ヤマトホールディングス	45,900	1,819.00	83,492,100
山九	7,300	5,800.00	42,340,000
日新	2,300	1,728.00	3,974,400
丸全昭和運輸	2,100	3,100.00	6,510,000
センコーグループホールディングス	14,400	917.00	13,204,800

トナミホールディングス	600	5,070.00	3,042,000
ニッコンホールディングス	9,400	2,694.00	25,323,600
福山通運	3,400	4,055.00	13,787,000
セイノーホールディングス	19,600	1,520.00	29,792,000
エスライン	1,800	998.00	1,796,400
神奈川中央交通	600	3,960.00	2,376,000
日立物流	4,800	3,120.00	14,976,000
丸和運輸機関	2,800	2,557.00	7,159,600
C & F ロジホールディングス	2,600	1,388.00	3,608,800
日本郵船	21,900	1,905.00	41,719,500
商船三井	16,600	2,927.00	48,588,200
川崎汽船	8,100	1,794.00	14,531,400
NSユニテッド海運	1,500	2,278.00	3,417,000
飯野海運	12,400	355.00	4,402,000
九州旅客鉄道	23,300	3,780.00	88,074,000
SGホールディングス	27,500	2,712.00	74,580,000
日本航空	47,900	3,358.00	160,848,200
ANAホールディングス	47,900	3,749.00	179,577,100
パスコ	400	1,599.00	639,600
西本Wismettacホールディングス	500	3,785.00	1,892,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,465.00	1,758,000
Genky DrugStores	1,300	2,523.00	3,279,900
国際紙バルブ商事	6,400	301.00	1,926,400
総合メディカルホールディングス	2,400	1,972.00	4,732,800
ブックオフグループホールディングス	1,600	1,096.00	1,753,600
三菱倉庫	8,300	2,834.00	23,522,200
三井倉庫ホールディングス	3,000	1,946.00	5,838,000
住友倉庫	9,600	1,509.00	14,486,400
澁澤倉庫	1,400	2,159.00	3,022,600
ヤマタネ	1,400	1,514.00	2,119,600
東陽倉庫	5,200	336.00	1,747,200
乾汽船	1,600	1,197.00	1,915,200
日本トランスシティ	5,800	535.00	3,103,000
ケイヒン	500	1,363.00	681,500
中央倉庫	1,600	1,250.00	2,000,000
安田倉庫	2,100	1,001.00	2,102,100
東洋埠頭	1,200	1,405.00	1,686,000
宇徳	3,300	528.00	1,742,400
上組	15,000	2,523.00	37,845,000
キューソー流通システム	900	1,990.00	1,791,000
近鉄エクスプレス	5,600	1,931.00	10,813,600
東海運	6,200	290.00	1,798,000
エーアイティー	1,900	955.00	1,814,500
日本コンセプト	1,200	1,439.00	1,726,800
東京放送ホールディングス	16,500	1,811.00	29,881,500
日本テレビホールディングス	22,600	1,469.00	33,199,400
朝日放送グループホールディングス	2,700	758.00	2,046,600
テレビ朝日ホールディングス	7,500	1,805.00	13,537,500
スカパーJ S A Tホールディングス	17,800	472.00	8,401,600
テレビ東京ホールディングス	2,200	2,319.00	5,101,800
日本BS放送	1,600	1,085.00	1,736,000
ビジョン	2,500	1,642.00	4,105,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	995.00	1,691,500
コネクシオ	1,500	1,502.00	2,253,000
日本通信	21,000	233.00	4,893,000
日本電信電話	181,300	5,500.00	997,150,000
KDDI	202,100	3,118.00	630,147,800
ソフトバンク	246,500	1,482.00	365,313,000
光通信	2,800	25,170.00	70,476,000

NTTドコモ	200,400	2,977.00	596,590,800
エムティーアイ	2,600	698.00	1,814,800
GMOインターネット	10,700	2,162.00	23,133,400
KADOKAWA	7,300	1,731.00	12,636,300
学研ホールディングス	900	7,070.00	6,363,000
ゼンリン	5,400	1,909.00	10,308,600
インプレスホールディングス	11,200	165.00	1,848,000
東京電力ホールディングス	220,700	479.00	105,715,300
中部電力	84,600	1,506.00	127,407,600
関西電力	104,700	1,225.00	128,257,500
中国電力	38,200	1,447.00	55,275,400
北陸電力	25,300	761.00	19,253,300
東北電力	69,100	1,071.00	74,006,100
四国電力	24,900	1,026.00	25,547,400
九州電力	57,000	926.00	52,782,000
北海道電力	25,900	520.00	13,468,000
沖縄電力	5,100	1,976.00	10,077,600
電源開発	22,000	2,560.00	56,320,000
エフオン	1,300	768.00	998,400
イーレックス	3,900	1,720.00	6,708,000
レノバ	4,600	1,231.00	5,662,600
東京瓦斯	53,200	2,575.50	137,016,600
大阪瓦斯	53,600	2,030.00	108,808,000
東邦瓦斯	13,700	4,000.00	54,800,000
北海道瓦斯	1,500	1,592.00	2,388,000
広島ガス	5,700	357.00	2,034,900
西部瓦斯	3,100	2,464.00	7,638,400
静岡ガス	7,800	889.00	6,934,200
メタウォーター	1,300	3,985.00	5,180,500
アイネット	1,400	1,413.00	1,978,200
松竹	1,800	16,030.00	28,854,000
東宝	16,200	4,475.00	72,495,000
エイチ・アイ・エス	4,100	2,922.00	11,980,200
東映	1,000	17,670.00	17,670,000
ラックランド	700	2,517.00	1,761,900
エヌ・ティ・ティ・データ	72,200	1,507.00	108,805,400
共立メンテナンス	4,400	5,300.00	23,320,000
イチネンホールディングス	3,000	1,442.00	4,326,000
建設技術研究所	1,800	2,053.00	3,695,400
スペース	1,700	1,292.00	2,196,400
アインホールディングス	3,600	6,680.00	24,048,000
燦ホールディングス	1,400	1,307.00	1,829,800
東京テアトル	1,200	1,391.00	1,669,200
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,360.00	1,652,000
ナガワ	900	7,500.00	6,750,000
よみうりランド	600	4,505.00	2,703,000
東京都競馬	1,700	3,330.00	5,661,000
常盤興産	1,100	1,691.00	1,860,100
カナモト	4,300	3,165.00	13,609,500
東京ドーム	10,700	996.00	10,657,200
D T S	6,100	2,256.00	13,761,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,600	5,160.00	59,856,000
シーイーシー	2,900	2,189.00	6,348,100
カプコン	12,800	2,591.00	33,164,800
西尾レントオール	2,700	3,165.00	8,545,500
アイ・エス・ビー	900	1,829.00	1,646,100
日本空港ビルデング	8,700	5,500.00	47,850,000
トランス・コスモス	2,500	3,005.00	7,512,500
乃村工藝社	11,300	1,414.00	15,978,200

ジャステック	1,700	1,161.00	1,973,700
S C S K	6,300	5,790.00	36,477,000
藤田観光	1,200	2,906.00	3,487,200
K N T - C Tホールディングス	1,600	1,472.00	2,355,200
日本管財	2,800	1,930.00	5,404,000
トーカイ	2,600	2,599.00	6,757,400
白洋舎	600	2,984.00	1,790,400
セコム	28,000	9,581.00	268,268,000
日本システムウエア	900	2,466.00	2,219,400
セントラル警備保障	1,300	6,360.00	8,268,000
アイネス	2,700	1,258.00	3,396,600
丹青社	5,000	1,200.00	6,000,000
メイテック	3,300	5,800.00	19,140,000
T K C	2,300	5,060.00	11,638,000
富士ソフト	3,500	4,220.00	14,770,000
応用地質	2,800	1,401.00	3,922,800
船井総研ホールディングス	5,500	2,562.00	14,091,000
N S D	4,500	3,600.00	16,200,000
進学会ホールディングス	3,200	568.00	1,817,600
丸紅建材リース	1,000	1,734.00	1,734,000
コナミホールディングス	9,900	4,880.00	48,312,000
学究社	1,400	1,341.00	1,877,400
ベネッセホールディングス	8,800	2,957.00	26,021,600
イオンディライト	3,300	3,875.00	12,787,500
ナック	1,600	1,064.00	1,702,400
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,675.00	4,042,500
ニチイ学館	3,800	1,724.00	6,551,200
ダイセキ	4,400	3,210.00	14,124,000
ステップ	1,200	1,504.00	1,804,800
日鉄物産	1,900	4,990.00	9,481,000
泉州電業	800	2,924.00	2,339,200
元気寿司	700	3,135.00	2,194,500
トラスコ中山	5,700	2,772.00	15,800,400
ヤマダ電機	82,900	556.00	46,092,400
オートバックスセブン	10,100	1,806.00	18,240,600
モリト	2,200	820.00	1,804,000
アークランドサカモト	4,300	1,281.00	5,508,300
ニトリホールディングス	11,800	17,090.00	201,662,000
グルメ杵屋	1,900	1,183.00	2,247,700
愛眼	6,900	248.00	1,711,200
吉野家ホールディングス	8,900	2,756.00	24,528,400
加藤産業	4,300	3,695.00	15,888,500
イノテック	1,700	1,028.00	1,747,600
イエローハット	5,100	1,872.00	9,547,200
松屋フーズホールディングス	1,300	4,180.00	5,434,000
J B C Cホールディングス	1,800	1,751.00	3,151,800
J Kホールディングス	2,900	640.00	1,856,000
サガミホールディングス	3,600	1,374.00	4,946,400
日伝	2,500	2,047.00	5,117,500
関西スーパーマーケット	2,300	1,054.00	2,424,200
ミロク情報サービス	2,400	3,060.00	7,344,000
北沢産業	6,400	289.00	1,849,600
杉本商事	1,500	2,025.00	3,037,500
因幡電機産業	3,900	5,110.00	19,929,000
王将フードサービス	2,000	6,570.00	13,140,000
プレナス	3,000	1,909.00	5,727,000
ミニストップ	2,000	1,484.00	2,968,000
アークス	5,600	2,342.00	13,115,200
パローホールディングス	6,000	2,052.00	12,312,000
東テク	900	2,457.00	2,211,300

ミスミグループ本社	34,100	2,722.00	92,820,200	
ベルク	1,300	5,100.00	6,630,000	
大 庄	1,500	1,601.00	2,401,500	
タキヒヨー	900	1,928.00	1,735,200	
ファーストリテイリング	3,600	66,090.00	237,924,000	
ソフトバンクグループ	215,200	4,220.00	908,144,000	
蔵王産業	1,200	1,465.00	1,758,000	
スズケン	11,500	5,100.00	58,650,000	
サンドラッグ	10,200	3,855.00	39,321,000	
サックスパー ホールディングス	2,300	901.00	2,072,300	
ジェコス	1,900	936.00	1,778,400	
やまや	800	2,203.00	1,762,400	
ベルーナ	5,800	717.00	4,158,600	
合計	32,397,800		66,020,728,200	

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	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	276,927,062	17,896,530
コール・ローン	385,289,854	719,791,373
国債証券	61,070,828,590	57,768,627,800
地方債証券	8,962,582,824	7,218,000,954
特殊債券	10,327,688,820	8,348,131,578
社債券	7,228,130,800	5,745,638,100
未収利息	227,564,980	185,554,319
前払費用	1,137,409	1,594,822
流動資産合計	88,480,150,339	80,005,235,476
資産合計	88,480,150,339	80,005,235,476
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,989,115	5,369,510
その他未払費用	12,309	3,824
流動負債合計	3,001,424	5,373,334
負債合計	3,001,424	5,373,334
純資産の部		
元本等		
元本	91,553,091,806	80,458,265,938
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,075,942,891	458,403,796
純資産合計	88,477,148,915	79,999,862,142
負債純資産合計	88,480,150,339	80,005,235,476



## 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ありま 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	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	91,553,091,806口	80,458,265,938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	458,403,796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)	0.9943円 (9,943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	自 2018年11月21日 至 2019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。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2018年11月20日現在	2019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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	683,058,940	501,204,720
地方債証券	47,932,410	35,879,623
特殊債券	40,211,543	32,516,691
社債券	37,580,000	26,464,200
合計	808,782,893	406,344,206

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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	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	7,229,627,282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	18,324,453,150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	76,296,408,816円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,198,123,874円	1,851,878,712円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	6,925,913円	34,686,709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	1,648,815,407円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	5,784,972円	34,894,519円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	13,759,679円	117,890,150円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,804,002円	300,648,162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	75,145,871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	4,591,102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	24,364,655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	29,860,218円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	1,990,783円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	2,897,961円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	7,036,801円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	27,156,072円
計	91,553,091,806円	80,458,265,938円

附属明細表（2019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395回 利付国債（2年）	198,000,000	198,631,620	
	第396回 利付国債（2年）	528,000,000	529,821,600	
	第397回 利付国債（2年）	460,000,000	461,711,200	
	第398回 利付国債（2年）	448,000,000	449,827,840	
	第399回 利付国債（2年）	520,000,000	522,267,200	
	第400回 利付国債（2年）	492,000,000	494,273,040	
	第401回 利付国債（2年）	501,000,000	503,414,820	
	第402回 利付国債（2年）	140,000,000	140,711,200	
	第403回 利付国債（2年）	53,000,000	53,283,550	
	第126回 利付国債（5年）	332,000,000	333,112,200	
	第127回 利付国債（5年）	491,000,000	493,052,380	
	第128回 利付国債（5年）	350,000,000	351,743,000	
	第129回 利付国債（5年）	278,000,000	279,581,820	
	第130回 利付国債（5年）	272,000,000	273,787,040	
	第131回 利付国債（5年）	516,000,000	519,859,680	
	第132回 利付国債（5年）	221,000,000	222,832,090	
	第133回 利付国債（5年）	322,000,000	324,978,500	
	第134回 利付国債（5年）	270,000,000	272,718,900	
	第135回 利付国債（5年）	324,000,000	327,528,360	

第137回	利付国債(5年)	229,000,000	231,830,440
第138回	利付国債(5年)	539,000,000	546,098,630
第1回	利付国債(40年)	110,000,000	169,423,100
第2回	利付国債(40年)	142,000,000	212,716,000
第3回	利付国債(40年)	133,000,000	200,731,580
第4回	利付国債(40年)	182,000,000	277,444,440
第5回	利付国債(40年)	182,000,000	268,817,640
第6回	利付国債(40年)	163,000,000	237,693,120
第7回	利付国債(40年)	138,000,000	193,901,040
第8回	利付国債(40年)	149,000,000	196,028,870
第9回	利付国債(40年)	176,000,000	173,794,720
第10回	利付国債(40年)	269,000,000	311,668,780
第11回	利付国債(40年)	162,000,000	182,321,280
第312回	利付国債(10年)	762,000,000	773,620,500
第313回	利付国債(10年)	291,000,000	296,860,740
第314回	利付国債(10年)	106,000,000	107,852,880
第315回	利付国債(10年)	109,000,000	111,441,600
第316回	利付国債(10年)	91,000,000	92,894,620
第318回	利付国債(10年)	55,000,000	56,222,650
第320回	利付国債(10年)	65,000,000	66,642,550
第321回	利付国債(10年)	69,000,000	70,959,600
第323回	利付国債(10年)	32,000,000	32,924,800
第324回	利付国債(10年)	99,000,000	101,604,690
第325回	利付国債(10年)	116,000,000	119,368,640
第327回	利付国債(10年)	28,000,000	28,889,840
第328回	利付国債(10年)	24,000,000	24,663,360
第329回	利付国債(10年)	105,000,000	108,861,900
第330回	利付国債(10年)	3,000,000	3,117,570
第332回	利付国債(10年)	196,000,000	202,573,840
第333回	利付国債(10年)	193,000,000	199,866,940
第334回	利付国債(10年)	257,000,000	266,745,440
第335回	利付国債(10年)	289,000,000	299,158,350
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	54,988,030
第337回	利付国債(10年)	303,000,000	311,250,690
第338回	利付国債(10年)	491,000,000	507,679,270
第339回	利付国債(10年)	536,000,000	555,076,240
第340回	利付国債(10年)	566,000,000	587,066,520
第341回	利付国債(10年)	552,000,000	570,033,840
第342回	利付国債(10年)	557,000,000	568,613,450
第343回	利付国債(10年)	564,000,000	576,233,160
第344回	利付国債(10年)	672,000,000	687,146,880
第345回	利付国債(10年)	532,000,000	544,438,160
第346回	利付国債(10年)	647,000,000	662,657,400
第347回	利付国債(10年)	616,000,000	631,190,560
第348回	利付国債(10年)	624,000,000	639,649,920
第349回	利付国債(10年)	646,000,000	662,182,300
第350回	利付国債(10年)	814,000,000	834,317,440
第351回	利付国債(10年)	650,000,000	666,146,000
第352回	利付国債(10年)	616,000,000	631,190,560
第353回	利付国債(10年)	576,000,000	589,795,200
第354回	利付国債(10年)	372,000,000	380,615,520
第355回	利付国債(10年)	196,000,000	200,370,800
第356回	利付国債(10年)	224,000,000	228,786,880
第1回	利付国債(30年)	10,000,000	12,885,400
第2回	利付国債(30年)	83,000,000	104,379,140
第3回	利付国債(30年)	17,000,000	21,281,450
第4回	利付国債(30年)	54,000,000	71,694,720
第5回	利付国債(30年)	33,000,000	41,534,790
第6回	利付国債(30年)	47,000,000	60,714,600
第7回	利付国債(30年)	45,000,000	57,966,300

第8回 利付国債(30年)	40,000,000	49,265,600	
第9回 利付国債(30年)	37,000,000	43,660,740	
第10回 利付国債(30年)	59,000,000	67,379,180	
第11回 利付国債(30年)	50,000,000	61,250,000	
第12回 利付国債(30年)	57,000,000	73,099,650	
第13回 利付国債(30年)	61,000,000	77,576,140	
第14回 利付国債(30年)	63,000,000	83,939,310	
第15回 利付国債(30年)	78,000,000	105,427,920	
第16回 利付国債(30年)	69,000,000	93,541,230	
第17回 利付国債(30年)	68,000,000	91,437,560	
第18回 利付国債(30年)	108,000,000	143,972,640	
第19回 利付国債(30年)	89,000,000	118,942,270	
第20回 利付国債(30年)	93,000,000	127,582,980	
第21回 利付国債(30年)	93,000,000	124,981,770	
第22回 利付国債(30年)	104,000,000	143,403,520	
第23回 利付国債(30年)	122,000,000	168,784,560	
第24回 利付国債(30年)	99,000,000	137,303,100	
第25回 利付国債(30年)	112,000,000	151,972,800	
第26回 利付国債(30年)	192,000,000	264,504,960	
第27回 利付国債(30年)	187,000,000	262,174,000	
第28回 利付国債(30年)	229,000,000	322,965,570	
第29回 利付国債(30年)	233,000,000	326,018,260	
第30回 利付国債(30年)	232,000,000	321,753,840	
第31回 利付国債(30年)	215,000,000	295,605,650	
第32回 利付国債(30年)	280,000,000	392,546,000	
第33回 利付国債(30年)	307,000,000	414,189,050	
第34回 利付国債(30年)	284,000,000	396,926,920	
第35回 利付国債(30年)	294,000,000	400,501,500	
第36回 利付国債(30年)	350,000,000	479,010,000	
第37回 利付国債(30年)	362,000,000	489,413,140	
第38回 利付国債(30年)	245,000,000	327,256,300	
第39回 利付国債(30年)	202,000,000	274,986,640	
第40回 利付国債(30年)	182,000,000	244,071,100	
第41回 利付国債(30年)	189,000,000	249,542,370	
第42回 利付国債(30年)	203,000,000	268,343,670	
第43回 利付国債(30年)	198,000,000	262,051,020	
第44回 利付国債(30年)	196,000,000	260,009,680	
第45回 利付国債(30年)	218,000,000	279,016,020	
第46回 利付国債(30年)	247,000,000	316,765,150	
第47回 利付国債(30年)	239,000,000	312,805,590	
第48回 利付国債(30年)	246,000,000	310,124,820	
第49回 利付国債(30年)	245,000,000	309,062,600	
第50回 利付国債(30年)	241,000,000	267,787,150	
第51回 利付国債(30年)	174,000,000	171,259,500	
第52回 利付国債(30年)	197,000,000	203,747,250	
第53回 利付国債(30年)	199,000,000	210,782,790	
第54回 利付国債(30年)	240,000,000	266,601,600	
第55回 利付国債(30年)	232,000,000	257,608,160	
第56回 利付国債(30年)	220,000,000	244,175,800	
第57回 利付国債(30年)	227,000,000	252,149,330	
第58回 利付国債(30年)	282,000,000	313,087,680	
第59回 利付国債(30年)	189,000,000	204,853,320	
第60回 利付国債(30年)	186,000,000	211,681,020	
第61回 利付国債(30年)	164,000,000	177,508,680	
第62回 利付国債(30年)	156,000,000	160,304,040	
第63回 利付国債(30年)	112,000,000	111,851,040	
第48回 利付国債(20年)	57,000,000	58,675,230	
第49回 利付国債(20年)	35,000,000	36,081,850	
第50回 利付国債(20年)	45,000,000	46,270,800	
第52回 利付国債(20年)	4,000,000	4,170,000	

第53回	利付国債(20年)	4,000,000	4,192,960
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,050,330
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,115,100
第68回	利付国債(20年)	109,000,000	120,467,890
第70回	利付国債(20年)	40,000,000	44,856,800
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	71,248,640
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,429,600
第76回	利付国債(20年)	8,000,000	8,916,400
第78回	利付国債(20年)	13,000,000	14,560,520
第80回	利付国債(20年)	13,000,000	14,707,290
第81回	利付国債(20年)	64,000,000	72,391,040
第82回	利付国債(20年)	104,000,000	118,249,040
第83回	利付国債(20年)	69,000,000	78,863,550
第84回	利付国債(20年)	124,000,000	140,961,960
第85回	利付国債(20年)	89,000,000	102,212,940
第86回	利付国債(20年)	74,000,000	85,935,460
第87回	利付国債(20年)	71,000,000	81,996,480
第88回	利付国債(20年)	129,000,000	150,647,490
第89回	利付国債(20年)	73,000,000	84,762,490
第90回	利付国債(20年)	237,000,000	276,673,800
第91回	利付国債(20年)	167,000,000	196,113,110
第92回	利付国債(20年)	297,000,000	346,426,740
第93回	利付国債(20年)	189,000,000	220,158,540
第94回	利付国債(20年)	237,000,000	277,837,470
第95回	利付国債(20年)	242,000,000	288,773,760
第96回	利付国債(20年)	169,000,000	199,061,720
第97回	利付国債(20年)	233,000,000	277,591,540
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	203,548,240
第99回	利付国債(20年)	306,000,000	363,647,340
第100回	利付国債(20年)	250,000,000	300,420,000
第101回	利付国債(20年)	182,000,000	221,783,380
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	221,589,250
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	205,426,260
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	161,746,200
第105回	利付国債(20年)	223,000,000	268,257,850
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	184,211,840
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	183,479,200
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	240,115,380
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	191,944,200
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	222,840,560
第111回	利付国債(20年)	176,000,000	215,563,040
第112回	利付国債(20年)	249,000,000	302,559,900
第113回	利付国債(20年)	389,000,000	474,432,180
第114回	利付国債(20年)	161,000,000	197,064,000
第115回	利付国債(20年)	172,000,000	212,278,960
第116回	利付国債(20年)	194,000,000	240,303,920
第117回	利付国債(20年)	266,000,000	326,717,160
第118回	利付国債(20年)	188,000,000	229,595,000
第119回	利付国債(20年)	103,000,000	123,591,760
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	103,715,920
第121回	利付国債(20年)	181,000,000	219,791,920
第122回	利付国債(20年)	117,000,000	140,798,970
第123回	利付国債(20年)	193,000,000	239,362,460
第124回	利付国債(20年)	115,000,000	141,343,050
第125回	利付国債(20年)	125,000,000	156,946,250
第126回	利付国債(20年)	114,000,000	140,539,200
第127回	利付国債(20年)	108,000,000	131,912,280
第128回	利付国債(20年)	187,000,000	229,063,780
第129回	利付国債(20年)	108,000,000	131,038,560
第130回	利付国債(20年)	180,000,000	219,106,800

第131回	利付国債(20年)	95,000,000	114,512,050
第132回	利付国債(20年)	126,000,000	152,240,760
第133回	利付国債(20年)	165,000,000	201,361,050
第134回	利付国債(20年)	145,000,000	177,388,650
第135回	利付国債(20年)	89,000,000	107,781,670
第136回	利付国債(20年)	93,000,000	111,478,170
第137回	利付国債(20年)	103,000,000	125,023,460
第138回	利付国債(20年)	112,000,000	133,131,040
第139回	利付国債(20年)	121,000,000	145,350,040
第140回	利付国債(20年)	292,000,000	355,232,600
第141回	利付国債(20年)	213,000,000	259,681,080
第142回	利付国債(20年)	134,000,000	165,114,800
第143回	利付国債(20年)	209,000,000	252,551,420
第144回	利付国債(20年)	139,000,000	166,120,290
第145回	利付国債(20年)	309,000,000	378,525,000
第146回	利付国債(20年)	249,000,000	305,640,030
第147回	利付国債(20年)	277,000,000	336,790,450
第148回	利付国債(20年)	245,000,000	294,901,600
第149回	利付国債(20年)	267,000,000	322,098,120
第150回	利付国債(20年)	278,000,000	331,781,880
第151回	利付国債(20年)	254,000,000	295,945,560
第152回	利付国債(20年)	246,000,000	286,845,840
第153回	利付国債(20年)	259,000,000	306,202,750
第154回	利付国債(20年)	247,000,000	288,439,190
第155回	利付国債(20年)	267,000,000	303,584,340
第156回	利付国債(20年)	232,000,000	241,433,120
第157回	利付国債(20年)	242,000,000	243,759,340
第158回	利付国債(20年)	279,000,000	294,545,880
第159回	利付国債(20年)	310,000,000	332,121,600
第160回	利付国債(20年)	275,000,000	299,277,000
第161回	利付国債(20年)	278,000,000	297,640,700
第162回	利付国債(20年)	273,000,000	292,049,940
第163回	利付国債(20年)	284,000,000	303,820,360
第164回	利付国債(20年)	353,000,000	371,063,010
第165回	利付国債(20年)	284,000,000	298,191,480
第166回	利付国債(20年)	289,000,000	313,796,200
第167回	利付国債(20年)	305,000,000	319,758,950
第168回	利付国債(20年)	253,000,000	260,235,800
第169回	利付国債(20年)	246,000,000	248,295,180
第170回	利付国債(20年)	54,000,000	54,458,460
国債証券 合計		51,039,000,000	57,768,627,800
地方債証券	第707回 東京都公募公債	200,000,000	203,785,800
	第708回 東京都公募公債	300,000,000	306,408,300
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	307,473,300
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	305,655,000
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,649,500
	第360回 大阪府公募公債(10年)	300,000,000	306,287,100
	第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	147,484,512
	第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	117,106,900
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	306,849,600
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,169,500
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	306,286,800
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	305,733,600
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	103,074,700
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	121,929,542
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	305,993,100
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	306,574,800
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	307,079,700
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	306,929,400
	第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,193,200



	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,533,500	
	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,950,000	
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	153,983,850	
	第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	100,819,200	
	第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	133,817,700	
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	331,448,400	
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	102,531,300	
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	203,876,000	
	第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,888,500	
	第4回 川崎市30年公募公債	100,000,000	135,798,100	
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	153,901,650	
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,877,000	
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	203,617,600	
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	102,163,500	
	平成29年度第1回 仙台市公募公債(20年)	100,000,000	105,130,300	
地方債証券 合計		6,913,000,000	7,218,000,954	
特殊債券	第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	204,593,600	
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	323,754,300	
	第139回 政保道路機構債券	500,000,000	509,651,000	
	第155回 政保道路機構債券	300,000,000	306,156,600	
	第163回 政保道路機構債券	300,000,000	307,052,700	
	第190回 政保道路機構債券	500,000,000	510,911,000	
	第212回 政保道路機構債券	100,000,000	118,949,000	
	第218回 政保道路機構債券	500,000,000	514,863,500	
	第233回 政府道路機構債券	100,000,000	116,880,500	
	第249回 政保道路機構債券	179,000,000	183,879,361	
	第278回 政保道路機構債券	100,000,000	100,175,200	
	第316回 政保道路機構債券	100,000,000	105,431,700	
	第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,645,600	
	第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,486,300	
	第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	410,424,400	
	第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,637,000	
	第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,131,943	
	第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,919,000	
	第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	199,843,000	
	第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,026,449,000	
	第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,173,000	33,429,925	
	第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	84,992,000	90,813,952	
	第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	101,196,000	109,504,191	
	第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,378,000	88,053,844	
	第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	91,368,000	97,544,476	
	第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	92,588,000	98,559,926	
	第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,727,000	47,410,620	
	第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	379,608,000	401,587,303	
	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	238,225,000	250,755,635	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	152,748,000	162,279,475	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	137,154,000	143,915,692	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	253,392,000	256,711,435	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	99,812,100	
第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,048,500		
第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,096,600		
第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,096,200		
第45回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,096,200		
第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,580,800		
特殊債券 合計		8,071,549,000	8,348,131,578	

社債券	第26回 フランス相互信用連合銀行( BFCM) 円貨社債( 2018 )	200,000,000	201,402,800	
	第3回 ノルデア・バンク	200,000,000	208,305,800	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	204,360,000	
	第33回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,570,100	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	205,341,600	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	102,250,300	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	102,520,100	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	204,298,200	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	205,411,200	
	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	102,436,500	
	第12回 オリエンタルランド	100,000,000	100,753,700	
	第3回 富士フィルムホールディングス	300,000,000	307,577,100	
	第68回 新日本製鐵	200,000,000	203,734,000	
	第19回 豊田自動織機	200,000,000	203,693,200	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	102,454,000	
	第71回 伊藤忠商事	200,000,000	204,879,600	
	第39回 住友商事	100,000,000	103,760,800	
	第45回 住友商事	100,000,000	102,483,300	
	第46回 住友商事	100,000,000	102,385,600	
	第79回 三菱商事	100,000,000	102,394,900	
	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	102,009,500	
	第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	204,199,600	
	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	102,027,800	
	第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	103,244,800	
	第46回 三井不動産	100,000,000	102,498,400	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,283,500	
	第111回 三菱地所	100,000,000	102,430,600	
	第75回 東京急行電鉄	100,000,000	102,363,900	
	第77回 東京急行電鉄	100,000,000	103,223,100	
	第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,565,600	
	第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,327,900	
	第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	204,787,400	
	第381回 中国電力	200,000,000	206,898,600	
第304回 北陸電力	100,000,000	103,280,900		
第306回 北陸電力	100,000,000	103,160,000		
第253回 四国電力	200,000,000	206,427,400		
第429回 九州電力	200,000,000	206,838,200		
第13回 電源開発	100,000,000	110,058,100		
社債券 合計	5,600,000,000	5,745,638,100		
合計	71,623,549,000	79,080,398,432		

## 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	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	112,422,984	23,671,023
コール・ローン	156,414,598	952,039,197
投資証券	17,146,099,070	31,416,451,100
未収入金	-	30,846,954
未収配当金	91,860,624	148,501,553
流動資産合計	17,506,797,276	32,571,509,827
資産合計	17,506,797,276	32,571,509,827
負債の部		
流動負債		
未払金	77,893,800	524,172,847
未払解約金	40,589,882	247,460,838
その他未払費用	4,427	5,218
流動負債合計	118,488,109	771,638,903
負債合計	118,488,109	771,638,903
純資産の部		
元本等		
元本	11,518,929,567	16,398,065,583
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,869,379,600	15,401,805,341
純資産合計	17,388,309,167	31,799,870,924
負債純資産合計	17,506,797,276	32,571,509,827

## 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	2019年11月20日現在
1 . 受益権総口数	11,518,929,567口	16,398,065,583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)	1.9392円 (19,392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	自 2018年11月21日 至 2019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。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2018年11月20日現在	2019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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	87,179,958	1,436,964,806
合計	87,179,958	1,436,964,806

(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	2019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	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	12,025,469,621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	7,146,333,605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	1,589,859,033円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,029,916,722円	1,501,629,877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	8,117,494,358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	1,858,643,446円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	654,619,964円	2,484,924,690円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	248,488,740円	785,204,355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	38,195,777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	3,282,914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	938,090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	2,642,646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	15,250,397円
計	11,518,929,567円	16,398,065,583円

附属明細表(2019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	389	53,526,400	
	GLP投資法人	6,899	970,689,300	
	MCUBS MidCity投資法人	3,553	433,110,700	
	Oneリート投資法人	432	150,984,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,145	242,599,500	
	いちごホテルリート投資法人	459	62,194,500	
	さくら総合リート投資法人	599	57,024,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,388	799,488,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,627	937,839,000	
	イオンリート投資法人	2,989	448,648,900	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,795	376,542,200	
	インヴィンシブル投資法人	12,150	793,395,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	284	35,954,400	
	オリックス不動産投資法人	5,519	1,333,390,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,923	281,142,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	857	719,023,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,724	374,970,000	



ケネディクス商業リート投資法人	1,070	304,950,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,153	404,703,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	554	65,482,800	
サンケイリアルエステート投資法人	401	50,004,700	
ザイマックス・リート投資法人	402	52,983,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,923	789,685,500	
ジャパンエクセレント投資法人	2,480	455,080,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,770	2,052,570,000	
スターアジア不動産投資法人	919	105,685,000	
スターツプロシード投資法人	431	87,234,400	
タカラレーベン不動産投資法人	786	95,263,200	
トーセイ・リート投資法人	603	82,671,300	
ヒューリックリート投資法人	2,356	482,980,000	
フロンティア不動産投資法人	984	479,208,000	
プレミア投資法人	2,502	403,822,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	591	80,198,700	
マリモ地方創生リート投資法人	238	31,868,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,219	1,360,095,300	
ラサールロジポート投資法人	2,575	420,497,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	428	51,659,600	
阪急阪神リート投資法人	1,251	218,799,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	682	314,402,000	
三菱地所物流リート投資法人	545	195,655,000	
産業ファンド投資法人	3,408	592,651,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	650	93,665,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,980	383,130,000	
森ヒルズリート投資法人	3,187	566,329,900	
星野リゾート・リート投資法人	421	245,022,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,099	788,842,600	
大江戸温泉リート投資法人	471	46,299,300	
大和ハウスリート投資法人	3,734	1,138,870,000	
大和証券オフィス投資法人	639	531,648,000	
投資法人みらい	3,004	185,647,200	
東急リアル・エステート投資法人	1,857	379,756,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	920	638,480,000	
日本ビルファンド投資法人	2,682	2,209,968,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,753	885,265,000	
日本プロロジスリート投資法人	3,980	1,191,612,000	
日本ヘルスケア投資法人	134	29,145,000	
日本リート投資法人	900	449,550,000	
日本リテールファンド投資法人	5,235	1,315,032,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,810	510,601,000	
日本賃貸住宅投資法人	3,115	334,551,000	
福岡リート投資法人	1,432	264,204,000	
平和不動産リート投資法人	1,725	240,465,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,638	1,739,693,200	
投資証券 合計	160,369	31,416,451,100	
合計	160,369	31,416,451,100	

## 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。

## 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11月29日現在）

資産総額	35,999,992円
負債総額	71,641円
純資産総額（ - ）	35,928,351円
発行済数量	33,244,905口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0807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11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11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	405	64,411
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	119	26,174
単位型公社債投資信託	2	85
合計	526	90,672

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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

#### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第24期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第25期事業年度に係る中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
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
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
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
<b>無形固定資産</b>				
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
<b>投資その他の資産</b>				
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	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	2	1,089
事故損失賠償金	-	3	511
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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

## 負債の部

## 流動負債

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

## 固定負債

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

## 負債合計

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

## 純資産の部

## 株主資本

資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	<u>8,281,840</u>
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	43,751,608
利益剰余金合計	<u>44,431,415</u>
株主資本合計	<u>62,713,255</u>

## 評価・換算差額等

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

## 純資産合計

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

## 負債・純資産合計

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



## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

第25期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:千円)

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

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

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	第25期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>其他有価証券 時価のあるもの ...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

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

## (中間貸借対照表関係)

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

## (中間損益計算書関係)

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

投資有価証券償還損	4,115千円
事故損失賠償金	3,771千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

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

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項  
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2019年6月28日 定時株主総会	普通株式	5,500,048	50,716	2019年3月31日	2019年6月28日

(金融商品関係)

第25期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含まれておりません(注2)を参照ください)。

(単位:千円)

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

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

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

現金・預金

短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

(有価証券関係)

第25期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

## 1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	18,948,948	18,985,550	36,601
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	18,948,948	18,985,550	36,601
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	1,100,000	1,100,000	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,100,000	1,100,000	-
合計		20,048,948	20,085,550	36,601

## 2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,900,074	1,901,140	1,065
	国債・地方債等	1,900,074	1,901,140	1,065
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	13,559,359	14,776,750	1,217,390
	小計	15,459,434	16,677,890	1,218,456
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	5,690,320	5,493,591	196,728
	小計	5,690,320	5,493,591	196,728
合計		21,149,754	22,171,482	1,021,728

(注) 投資信託受益証券等であります。



## （デリバティブ取引関係）

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第25期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

該当事項はありません。

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## （1）通貨関連

第25期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

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

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1．サービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

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

## （2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3．主要な顧客ごとの情報

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

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

## （ 1 株当たり情報）

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

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

2．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

第25期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- a. 名称  
三菱UFJ信託銀行株式会社
- b. 資本金の額  
2019年3月末現在、324,279百万円
- c. 事業の内容  
銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

#### (参考) 再信託受託会社の概況

- a. 名称  
日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- b. 資本金の額  
2019年3月末現在、10,000百万円
- c. 事業の内容  
銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

(資本金の額：2019年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
光世証券株式会社	12,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
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

2019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2018年11月21日から2019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2019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11月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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