【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月20日提出
【計算期間】	第2期（自　2018年11月21日　至　2019年11月20日）
【ファンド名】	ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　西　啓介
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部　　茶木　健
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

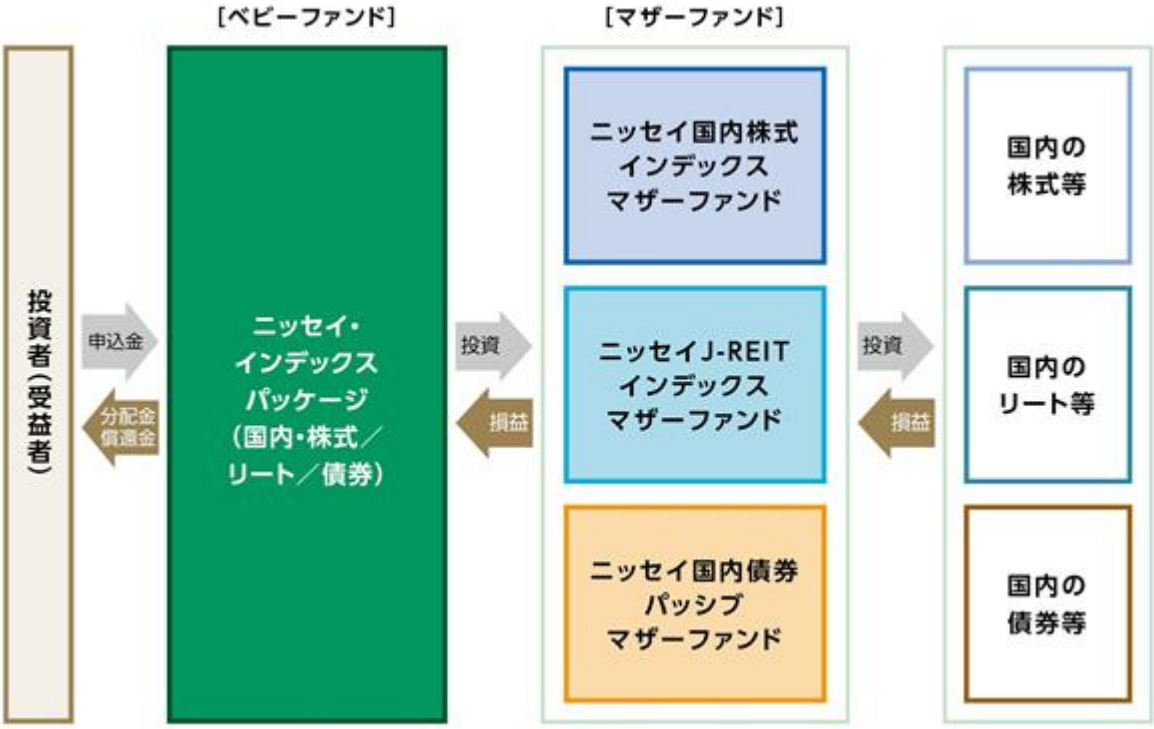
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



③　ファンドの特色

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J-REIT インデックスマザーファンド	「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざします。
国内債券	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざします。

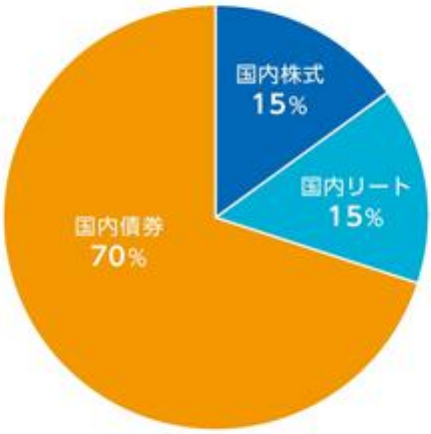
〈各マザーファンドの運用プロセス〉

2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

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

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

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出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）の商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指数の商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。

④　信託金の上限

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／国内／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 追　加　型	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特　殊　型

属性区分表

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

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

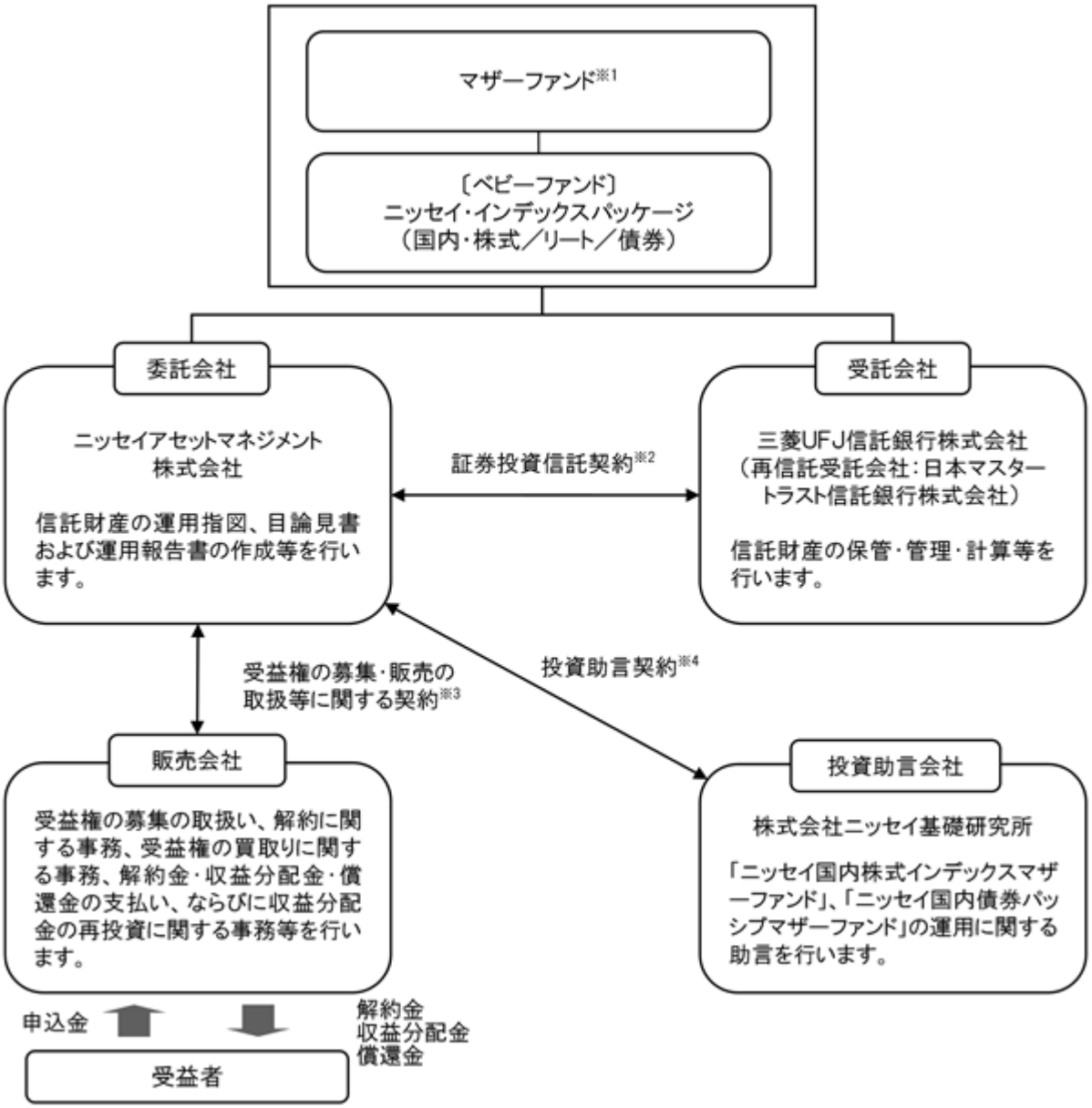
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式・ 不動産投信・債券） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、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】

①　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

②　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。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

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

ｂ　投資態度

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

②　株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

③　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤　同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

⑧　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

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みます）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

①　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みます）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。

②　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（採用予定を含みます）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。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

②　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。

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　デリバティブの直接利用は行いません。

⑥　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

①　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。

②　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。

③　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。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの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

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限　ｂ　約款に定めるその他の投資制限　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引」に定めるものに限ります）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　有価証券

主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された前記「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書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

③　金融商品

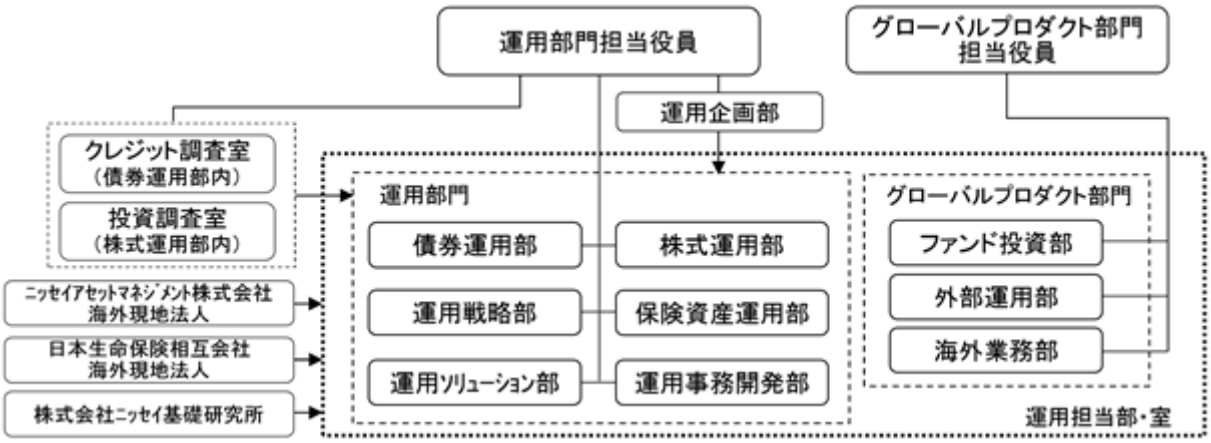
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

④　前記②にかかわらず、このファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記③に掲げる金融商品により運用することができます。

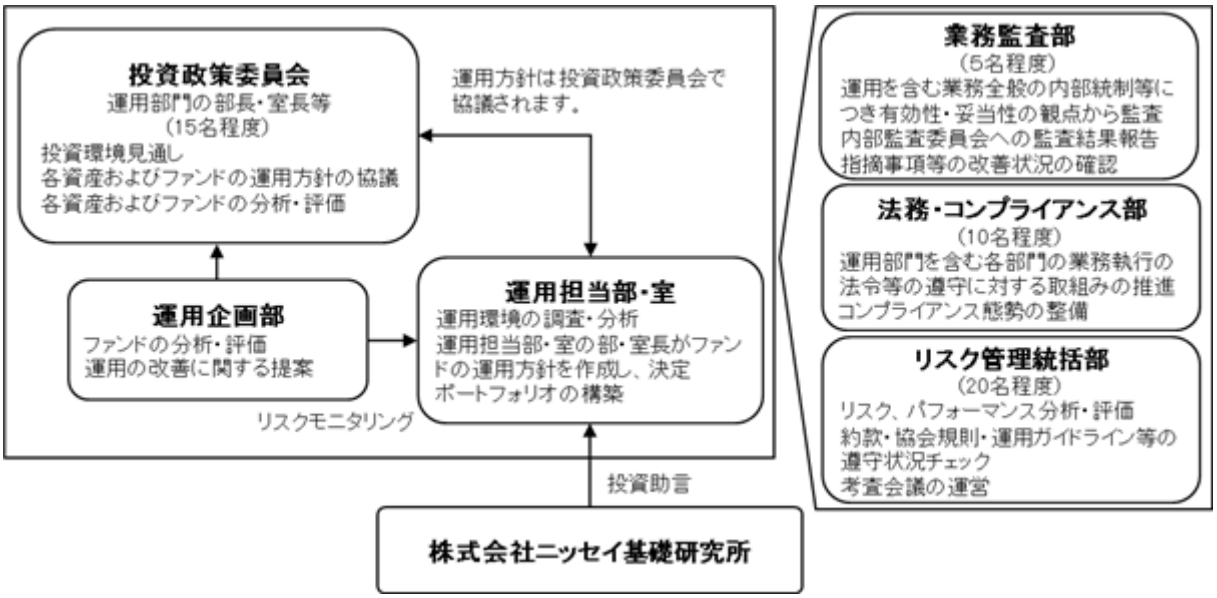
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

１．分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（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。

②　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。

③　支払方法
＜分配金受取コースの場合＞
税金を差引いた後、原則として決算日から起算して５営業日目までにお支払いします。
＜分配金再投資コースの場合＞
税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

○　将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式、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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

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

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

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

②　信用取引の範囲

１．信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

２．前記１．の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

③　先物取引等

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

④　スワップ取引

１．異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。

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

３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

６．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑤　金利先渡取引

１．金利先渡取引を行うことができます。

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

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

４．金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。

ｉ．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ii．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の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たときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　有価証券の空売り

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

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

３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

⑧　有価証券の借入れ

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

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

３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　資金の借入れ

１．信託財産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

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

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第２条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

②　信用リスク集中回避（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号の２）

信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを内容とした運用を行わないものとします。

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

３【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、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、リートの経営や財務状況が悪化した場合、リ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、資金の流出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が小さかった場合も同様です。

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

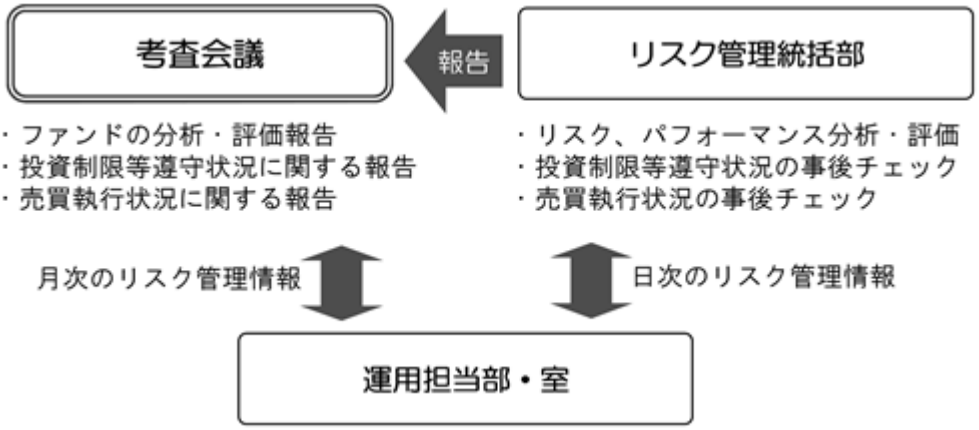
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・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。

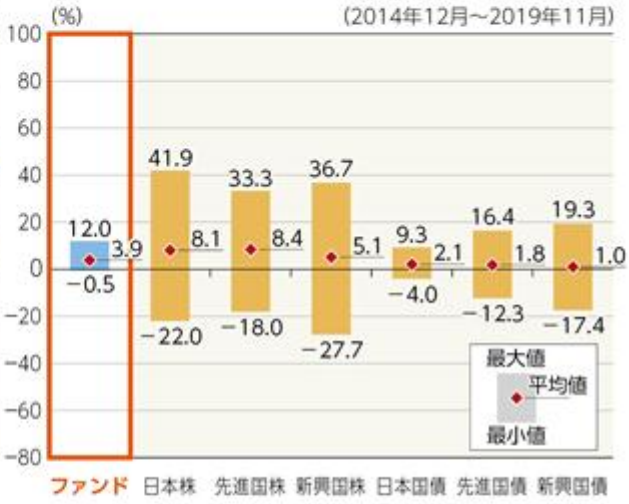
２．運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

○　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。

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>
日 本 株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債 … NOMURA-BPI 国債
先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

! 前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

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

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.3102%（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。

② 前記①の信託報酬については、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払います。

○ 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】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

○ 上記の①、③および④の費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「４ 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

＜ご参考＞

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

分　　配　　時　：　分配時の「普通分配金」に対して課税されます。
「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。

解約請求・償還時　：　個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額※の差益に対して課税されます。
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。

買　取　請　求　時　：　買取請求時の買取価額と取得価額※の差益に対して課税されます。

※　申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

分　　配　　時　：　分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収※され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）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。

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

個別元本

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

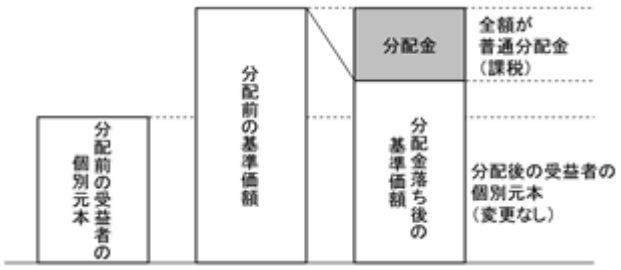
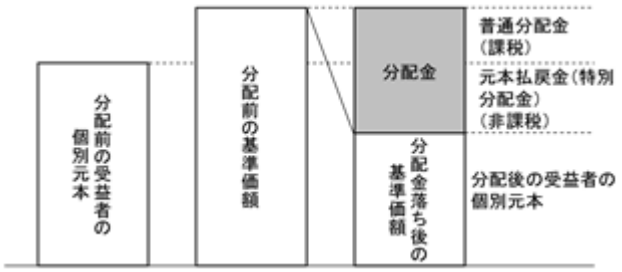
・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出※されます。

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、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Ｊ－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】

①【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） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券パッシブ　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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	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） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	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） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	第１３３回　住宅金融支援機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	103.22 1,032,263,000	102.77 1,027,738,000	0.828000 2023/5/19	1.28%
2	第３５０回　利付国債（１０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（１０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（１０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（１０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
		特殊債券	10.43
		社債券	6.41
	小計		98.37
	外国	社債券	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Ｊ－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	アクティビア・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　ＭｉｄＣｉｔｙ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。

②【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。

③【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】

①【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	－

②【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

③【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。

＜参考情報＞

3.運用実績

2019年11月末現在

●基準価額・純資産の推移

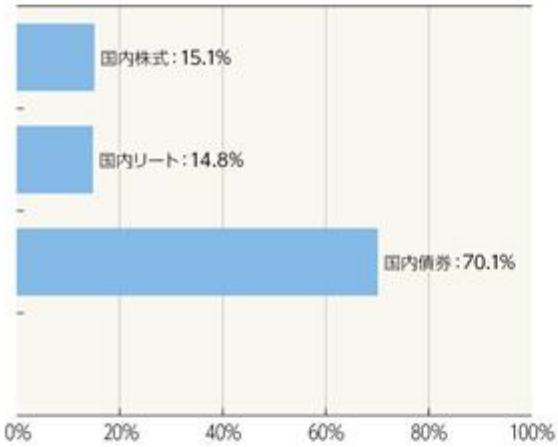
基準価額	10,807円
純資産総額	35百万円

●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して計算しております。

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移

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

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。

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。

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。

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。

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】

①　申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

金融商品取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときには、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。

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

２．定期引出契約とは、分配金再投資コースにおいて、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。

３．詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

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

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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。

②　換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③　換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○　換金手数料はありません。

⑤　信託財産留保額

ありません。

⑥　支払開始日

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

⑦　その他

１．受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

２．換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記④の規定に準じて算出した価額とします。

３．詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①　基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

②　ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	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。

③　外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④　予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

⑤　基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

⑥　基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（午前９時～午後５時　土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限です。

（４）【計算期間】

毎年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】

①　繰上償還

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

ｉ．受益権の口数が30億口を下回っている場合

ii．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

iii．やむを得ない事情が発生したとき

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

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

３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

５．前記２．から４．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記２．から４．までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

６．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。

７．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「②　約款の変更等　２．」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

８．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「②　約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。

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

②　約款の変更等

１．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「②　約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

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

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

５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

③　反対者の買取請求の不適用

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

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

・交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知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。

⑥　信託事務処理の再信託

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

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

①　他の受益者の氏名または名称および住所
②　他の受益者が有する受益権の内容

第３【ファンドの経理状況】

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

２）当ファンドの第1期計算期間については、設定日である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)
資産の部		
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
負債の部		
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
純資産の部		
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 2018年11月20日現在	第2期 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 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．　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）

Ⅰ　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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2018年11月20日現在	第2期 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 2018年11月20日現在	第2期 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 2018年11月20日現在	第2期 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
① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額又は口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	2,865,527	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／リート／債券））は、「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイＪ－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が、それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	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）

Ⅰ　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

II　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 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△4,203,418,286	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
① 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	
飛島建設	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	
錢高組	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	
淺沼組	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	
ＮＩＰＰＯ	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ネッツエスアイ	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	
大氣社	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	
ＣＤＳ	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	
ＧＣＡ	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　Ｆｏｏｄｓ	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	
ＮＪＳ	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	
綜合警備保障	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	
ＳＢＳ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	
バリューコマース	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	
キリンホールディングス	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	
ダイドー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	
キャンドゥ	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	
キユーピー	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	
イートアンド	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	
グンゼ	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	
ＤＣＭ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	
ディーブイエックス	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	
Ｈａｍｅｅ	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	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	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	
ＴＨＥ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	
ＢＥＥＮＯＳ	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	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	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	
ＳＵＭＣＯ	32,700	1,685.00	55,099,500	
川田テクノロジーズ	600	6,610.00	3,966,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	800	3,745.00	2,996,000	
ハウスドゥ	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	
日本フエルト	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	
バ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	
スシローグローバルホールディングス	3,000	8,760.00	26,280,000	
ＬＩＸＩＬ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	
クラウディアホールディングス	3,600	484.00	1,742,400	
ＴＳＩ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	
ＴＩＳ	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	
ＡＧＳ	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	
ＫＬａｂ	5,200	875.00	4,550,000	

ポールトゥウィン・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	
コロプラ	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	
オプティム	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	
マークラインズ	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	
オープンドア	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	
ＪＳＲ	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	
ＥＰＳ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	
ＴＡＣ	7,800	227.00	1,770,600	
ＣＥ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	
ＦＩＧ	5,500	311.00	1,710,500	
ＡＤＥＫＡ	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	
エックスネット	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	
ＣＩＪ	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	
ビーピー・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	
日亜鋼業	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	
日本軽金属ホールディングス	69,200	226.00	15,639,200	
三井金属鉱業	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	
住友金属鉱山	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	
文化シヤッター	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	
日本フイルコン	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	
ＩＢＪ	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	
ＥＲＩホールディングス	2,200	804.00	1,768,800	
アビスト	700	2,655.00	1,858,500	
シグマクシス	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	
ＦＵＪＩ	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	
ＤＭＧ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	
フリュー	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・ビー機械	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	
日本エアーテック	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	
酉島製作所	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	
ＣＫＤ	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	
ＳＡＮＫＹＯ	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	
ＪＵＫＩ	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	
ＴＰＲ	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	
ＮＴＮ	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	
ＴＨＫ	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	
キッツ	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－Ｊａｐａｎ	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	
ＲＰＡ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	
ＪＶＣ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	
ＩＤＥＣ	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	
ＥＩＺＯ	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	
ＴＤＫ	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	
ＳＭＫ	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	
ＴＯＡ	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	
エスペック	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	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,400	3,890.00	5,446,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	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	
オプテックスグループ	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	
ＫＯＡ	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	
ＩＨＩ	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	
日本車輌製造	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	
近畿車輌	1,100	1,425.00	1,567,500	
ＦＰＧ	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	
トピー工業	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	
ＮＯＫ	14,900	1,662.00	24,763,800	
フタバ産業	7,700	810.00	6,237,000	
ＫＹＢ	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	
ＳＵＢＡＲＵ	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	
ＴＢＫ	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	
カッパ・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	
メディパ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	
ＳＰＫ	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	
ハピネット	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	
ＶＴ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	
ＳＣＲＥＥＮ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	
ＳＨＯ‐ＢＩ	4,200	394.00	1,654,800	
ニホンフラッシュ	1,300	2,485.00	3,230,500	
前田工繊	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	
ＳＨＯＥＩ	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	
プロネクサス	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	
ＮＩＳＳＨＡ	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	
ＪＳＰ	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	

ピジョン	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	
タカラスタンダード	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	
グローブライド	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	
日本紙パルプ商事	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	
ＳＲＳ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	
テンアライド	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	
ＰＡＬＴＡＣ	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	
オリエントコーポレーション	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	
だいこう証券ビジネス	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ユナイテッド海運	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	
国際紙パルプ商事	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	
キユ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	
エーアイテイー	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ＪＳＡＴ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	
常磐興産	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	
ＤＴＳ	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	
ＳＣＳＫ	6,300	5,790.00	36,477,000	
藤田観光	1,200	2,906.00	3,487,200	
ＫＮＴ－ＣＴ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	
ＴＫＣ	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	
ＮＳＤ	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	
ＪＢＣＣホールディングス	1,800	1,751.00	3,151,800	
ＪＫ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	
バ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	
サックスバー　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	

② 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第４　不動産等明細表
該当事項はありません。

第５　商品明細表
該当事項はありません。

第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

第７　その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

第８　借入金明細表
該当事項はありません。

「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おります。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	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）

Ⅰ　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

II　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 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△683,058,940	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

① 株式

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額又は口数	評価額（円）	備考
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　富士フイ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Ｊ－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	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年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）

Ⅰ　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

Ⅱ　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 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	87,179,958	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

① 株式

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額又は口数	評価額（円）	備考
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）

Ⅰ　資産総額	35,999,992円
Ⅱ　負債総額	71,641円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	35,928,351円
Ⅳ　発行済数量	33,244,905口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	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

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前記①の申請のある場合には、前記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 前記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

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

３【委託会社等の経理状況】

１．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

(1)　委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
　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)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		19,824,114		18,401,863
有価証券		7,102,076		8,008,550
前払費用		421,985		608,442
未収委託者報酬		4,433,940		4,705,229
未収運用受託報酬		1,806,719		1,911,554
未収投資助言報酬		101,471		168,445
その他		323,490		31,744
流動資産合計		34,013,799		33,835,830
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	※1	82,291	※1	72,641
車両	※1	4,900	※1	3,268
器具備品	※1	94,283	※1	95,277
有形固定資産合計		181,475		171,187
無形固定資産				
ソフトウェア		889,998		968,052
ソフトウェア仮勘定		44,035		24,478
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		942,047		1,000,545
投資その他の資産				
投資有価証券		34,455,496		36,902,679
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		14,723		167,886
差入保証金		299,871		293,513
繰延税金資産		778,580		1,066,925
その他		14,474		87,940
投資その他の資産合計		35,629,369		38,585,168
固定資産合計		36,752,892		39,756,901
資産合計		70,766,691		73,592,732

負債の部		
流動負債		
預り金	70,706	65,641
未払収益分配金	3,465	6,368
未払手数料	1,700,145	1,736,084
未払運用委託報酬	703,881	702,648
未払投資助言報酬	771,152	723,039
その他未払金	437,257	461,392
未払費用	109,199	113,233
未払法人税等	2,548,634	1,996,248
賞与引当金	864,699	853,083
その他	377,984	289,152
流動負債合計	7,587,128	6,946,893
固定負債		
退職給付引当金	1,682,532	1,801,748
役員退職慰労引当金	18,200	22,500
固定負債合計	1,700,732	1,824,248
負債合計	9,287,861	8,771,142
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	41,733,107	45,192,421
利益剰余金合計	42,412,914	45,872,228
株主資本合計	60,694,754	64,154,068
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	779,438	711,399
繰延ヘッジ損益	4,637	△ 43,878
評価・換算差額等合計	784,076	667,521
純資産合計	61,478,830	64,821,590
負債・純資産合計	70,766,691	73,592,732

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

受取配当金		176,877		124,674
金融派生商品収益		—		35,286
為替差益		—		22,977
時効成立償還金		27,718		—
その他営業外収益		13,552		14,395
営業外収益計		252,264		221,915
営業外費用				
為替差損		15,293		—
金融派生商品費用		—		20,127
控除対象外消費税		13,239		17,501
雑損失		27,789		—
その他営業外費用		657		1,080
営業外費用計		56,980		38,709
経常利益		11,861,150		11,881,403
特別利益				
投資有価証券売却益		201,537		655,395
投資有価証券償還益		31,108		46,876
固定資産売却益	※1	169	※1	—
特別利益計		232,815		702,272
特別損失				
投資有価証券売却損		107		81,265
投資有価証券償還損		15,469		68,047
固定資産除却損	※2	5,271	※2	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									
	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	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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△ 5,067,603	△ 5,067,603	△ 5,067,603
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,526,917	8,526,917	8,526,917
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,459,314	3,459,314	3,459,314
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068

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

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

６．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 ③ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
７．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
８．連結納税制度の適用を前提とした会計処理	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。

（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

①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

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

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

①配当金支払額

2018年6月22日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

2019年3月19日開催の臨時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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
①現金・預金	19,824,114	19,824,114	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	7,102,076	7,115,800	13,723
③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	―
④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
①現金・預金	18,401,863	18,401,863	-
②有価証券			
満期保有目的の債券	2,199,830	2,205,940	6,109
その他有価証券	5,808,720	5,808,720	-
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,649,504	17,681,300	31,795
その他有価証券	19,253,174	19,253,174	-
④デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△47,244	△47,244	-

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

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

①現金・預金

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

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

④デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (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、「③投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

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

（注３）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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）
①現金・預金	19,824,114	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	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）
①現金・預金	18,401,863	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	2,200,000	17,650,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	7,033,352	15,714,537	2,156,988	138,951
合計	27,635,215	33,364,537	2,156,988	138,951

（注）投資信託受益証券、国債であります。

（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
	① 国債・地方債等	5,824,610	5,803,679	20,930
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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
	① 国債・地方債等	5,808,720	5,801,046	7,673
	② 社債	―	―	―
	③ その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	13,421,370	12,553,359	868,010
	小計	19,230,090	18,354,406	875,684
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	5,831,804	5,981,670	△149,865
	小計	5,831,804	5,981,670	△149,865
合計		25,061,894	24,336,076	725,818

（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す。

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

２．簡便法を適用した確定給付制度

（１）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,519,642 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す。

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

２．簡便法を適用した確定給付制度

（１）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,682,532 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		6,390,440
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		1,939,192
負債合計		8,329,632
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		43,751,608
利益剰余金合計		44,431,415
株主資本合計		62,713,255
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		897,239
純資産合計		63,610,494
負債・純資産合計		71,940,127

(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	①満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②その他有価証券 時価のあるもの …中間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。 時価のないもの …移動平均法に基づく原価法によっております。 ③関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 ②退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。 なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 ③役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。
５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 ③ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
７．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
８．連結納税制度	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	30,130千円
無形固定資産	172,854千円
※２．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	157,472千円
有価証券利息	7,537千円
金融派生商品収益	6,483千円
※３．営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	28,274千円
金融派生商品損失	3,497千円
控除対象外消費税	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
①現金・預金	18,614,564	18,614,564	―
②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	―
③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	―
④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△で示しております。

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

①現金・預金

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。

②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。

③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。

④デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

（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
	①国債・地方債等	1,900,074	1,901,140	1,065
	②社債	―	―	―
	③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	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③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	4,059,235千円
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。

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

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【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2019年2月20日	有価証券報告書
	有価証券届出書
2019年8月20日	半期報告書
	有価証券届出書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。