

**【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】** 2021年5月20日提出

**【計算期間】** 第1期（自 2020年10月1日 至 2021年2月22日）

**【ファンド名】** ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）  
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）

**【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 大関 洋

**【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】

###### 基本方針

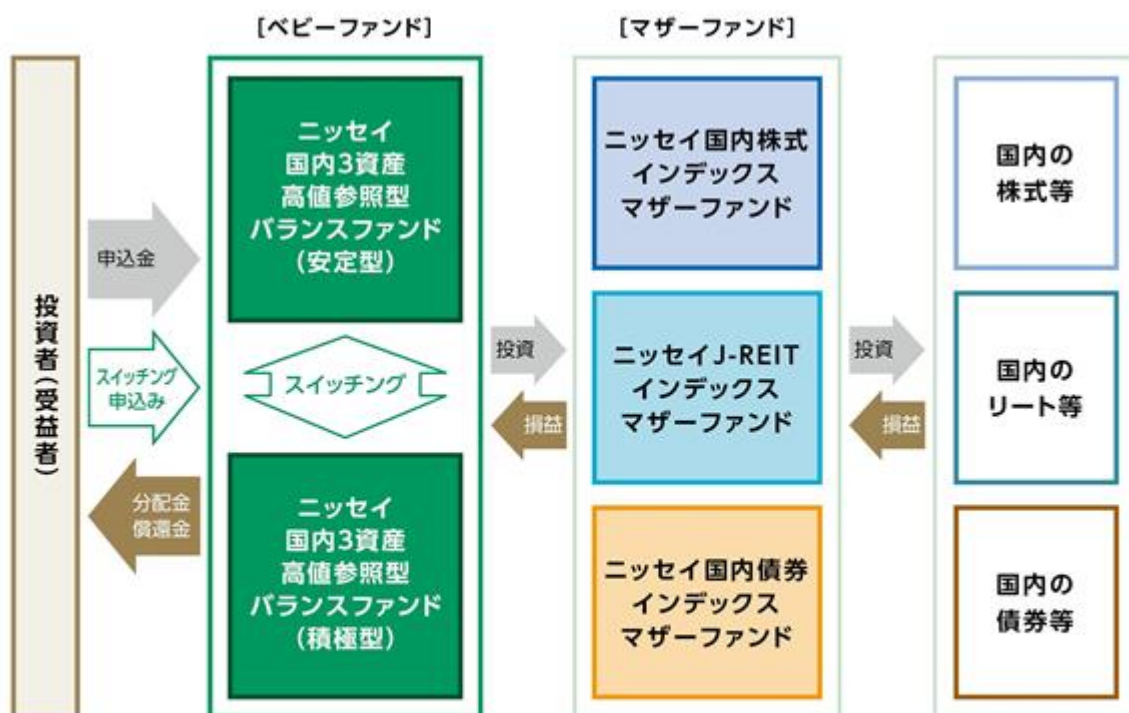
ファンドは、安定した収益の確保および信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



•「安定型」と「積極型」との間でスイッチングが可能です。

•販売会社によっては、どちらか一方のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。

## ファンドの特色

### 1 国内の株式・リート・債券に投資します。

- 国内株式、国内リート、国内債券の運用においては、それぞれTOPIX(配当込み)、東証REIT指数(配当込み)、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざします。

### 2 TOPIX・東証REIT指数の最高値からの下落率を参照し、それぞれの下落局面で国内株式・国内リーートの組入比率を引き上げ、その後の上昇局面で組入比率を引き下げます。

- 「最高値からの下落率」は、2020年10月1日(当ファンドの設定日)以降の最高値(日次、終値)と各月末の終値を用いて算出します。  
・上記は市場環境等によって見直す場合があります。
- 下落局面での「買い増し」とその後の上昇局面での「戻り売り」を反復することで、収益の積み上げをめざします。  
・当ファンドでは、下落局面での国内株式・国内リーートの組入比率の引き上げを「買い増し」、その後の上昇局面での組入比率の引き下げを「戻り売り」といいます。

### 3 「安定型」と「積極型」の2つのファンドから選択いただけます。

- 各資産の組入比率は、以下の範囲をめどに調整します。

	国内株式	国内リート	国内債券
安定型	10%～20%	10%～20%	60%～80%
積極型	20%～40%	20%～40%	20%～60%

・ファンド設定時の各資産の組入比率は、安定型は国内株式10%、国内リート10%、国内債券80%、積極型は国内株式20%、国内リート20%、国内債券60%をめどとする方針です。

## 〈資産配分変更プロセス〉



## 「買い増し」:

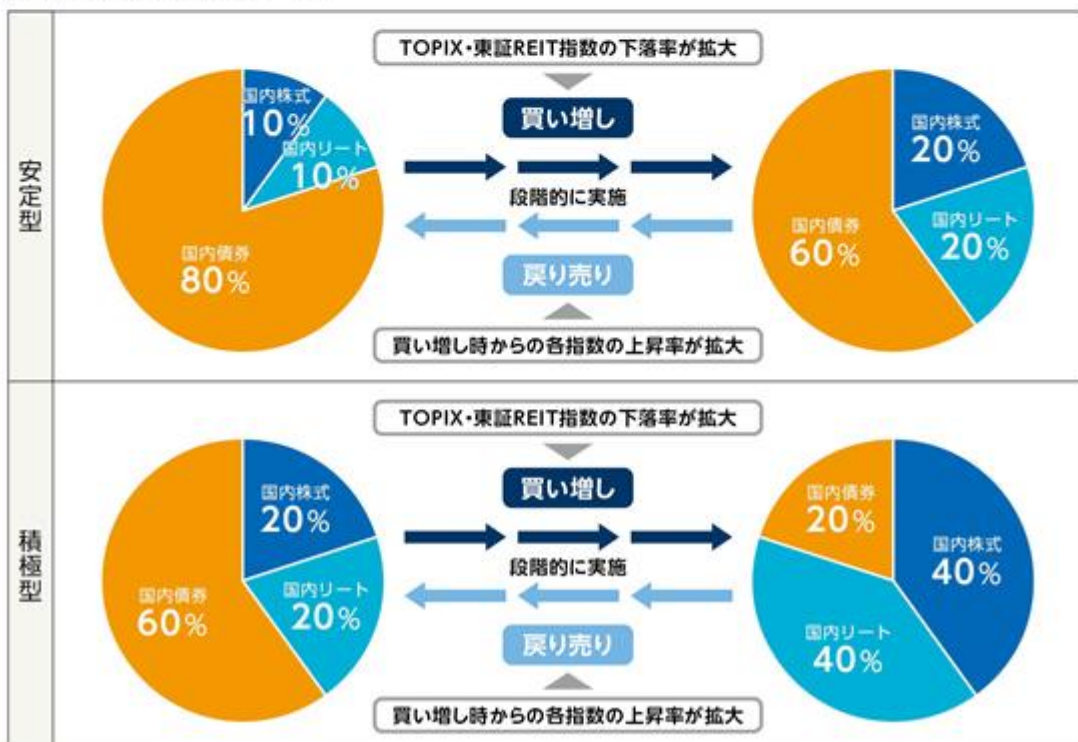
2020年10月1日(当ファンドの設定日)以降のTOPIX・東証REIT指数の最高値(日次、終値)から各月末の終値までの下落率を参照し、それぞれ下落率の水準に応じて段階的に国内株式・国内リートの組入比率を引き上げ

## 「戻り売り」:

上記各指数について組入比率引き上げ時から各月末の終値までの上昇率等を参照し、それぞれの上昇率の水準等に応じて段階的に国内株式・国内リートの組入比率を引き下げ

- ・「買い増し」「戻り売り」につきましては、原則として月次で行います。
- ・上記は市場環境等によって見直す場合があります。

## 〈資産配分変更のイメージ〉



・上記はイメージであり、実際の資産配分とは異なります。

**〈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。
---------------------------------------

## 信託金の上限

各ファンドにつき、1,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
	海 外	債 券
追 加 型	内 外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

## 属性区分表

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

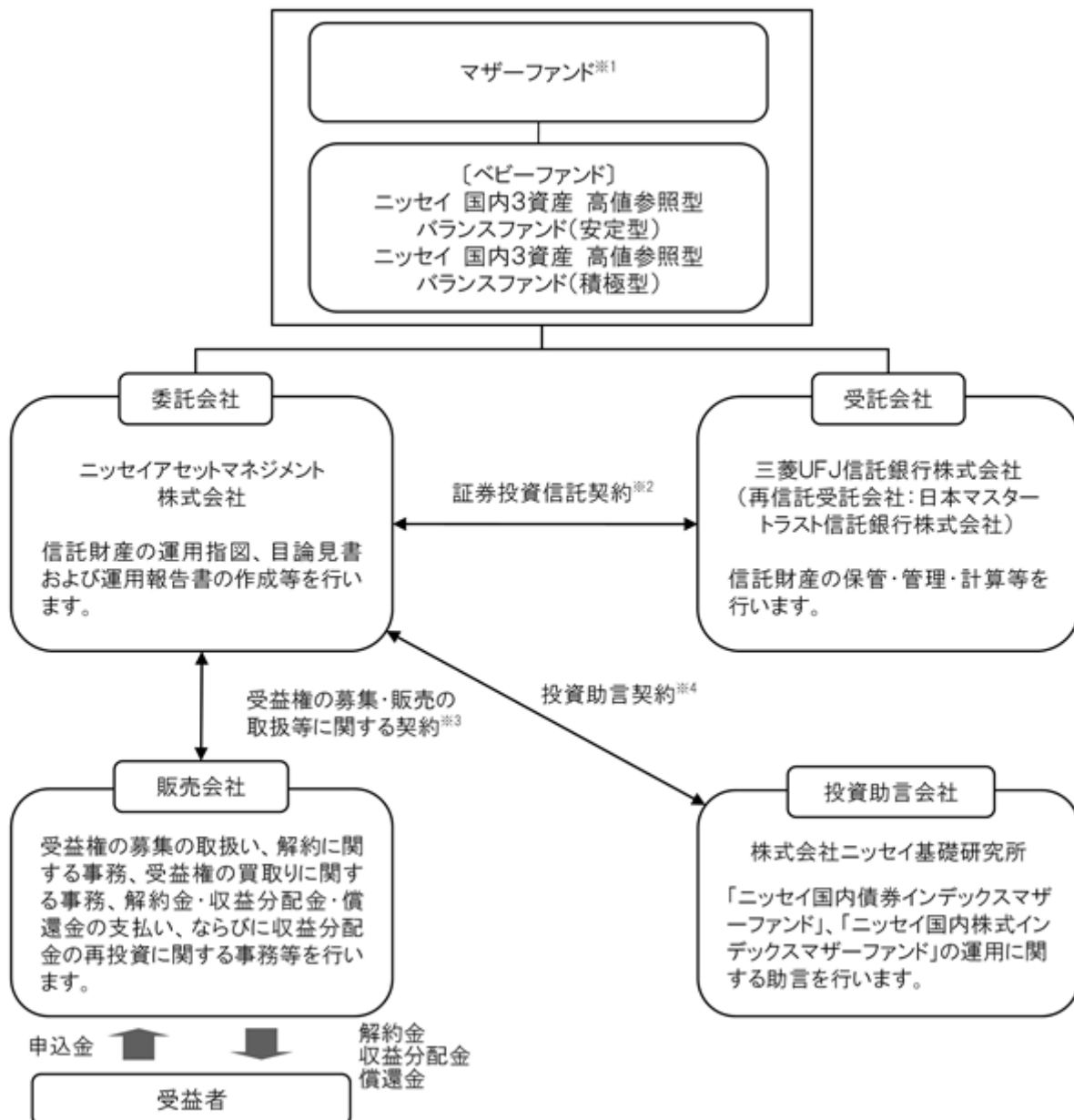
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 不動産投信・債券) 資産配分変更型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 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、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 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。

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】

2020年10月1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 ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド、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
- 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（2021年2月末現在）

- 1．委託会社の名称                  ：ニッセイアセットマネジメント株式会社
- 2．本店の所在の場所              ：東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
- 3．資本金の額                      ：100億円
- 4．代表者の役職氏名              ：代表取締役社長 大関 洋
- 5．金融商品取引業者登録番号      ：関東財務局長（金商）第369号
- 6．設立年月日                      ：1995年4月4日
- 7．沿革
  - 1985年7月1日                  ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
  - 1995年4月4日                  ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
  - 1998年7月1日                  ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
  - 2000年5月8日                  定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

## 8．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （１）【投資方針】

#### 「安定型」

複数のマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内の債券、株式、上場不動産投資信託証券（REIT）等へ分散投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド、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  
ファンド設定当初の各マザーファンドへの投資比率は以下の割合とします。

マザーファンド	投資比率（％）
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	80
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	10
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	10

委託会社が定める基準に基づき算出した、TOPIX、東証REIT指数の高値からの下落率や各指数の動向に基づき資産配分を変更します。株式・REITの下落局面では国内株式・J-REITの組入比率を引き上げ、上昇局面では同組入比率を引き下げます。

各マザーファンドへの投資比率のレンジは概ね以下の割合とします。

マザーファンド	投資比率のレンジ（％）
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	60～80
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	10～20
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	10～20

各マザーファンドは以下インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

マザーファンド	インデックス
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合
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）
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）

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。

#### 「積極型」

（「安定型」のと同規定）

ファンド設定当初の各マザーファンドへの投資比率は以下の割合とします。

マザーファンド	投資比率（％）
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	60
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	20
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	20

（「安定型」のと同規定）

各マザーファンドへの投資比率のレンジは概ね以下の割合とします。

マザーファンド	投資比率のレンジ(%)
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	20～60
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	20～40
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	20～40

(「安定型」のと同規定)

(「安定型」のと同規定)

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内債券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、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

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、

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

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

同一銘柄の転換社債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%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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まず）している不動産投資信託証券（不動産投資法人の投資証券または不動産投資信託の受益証券をいいます）を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

## (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、公社債、株式、上場不動産投資信託証券(REIT)等に投資を行う場合があります。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド、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

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された前記「a 主な投資対象」に定めるマザーファンドのほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます)に投資します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

#### 金融商品

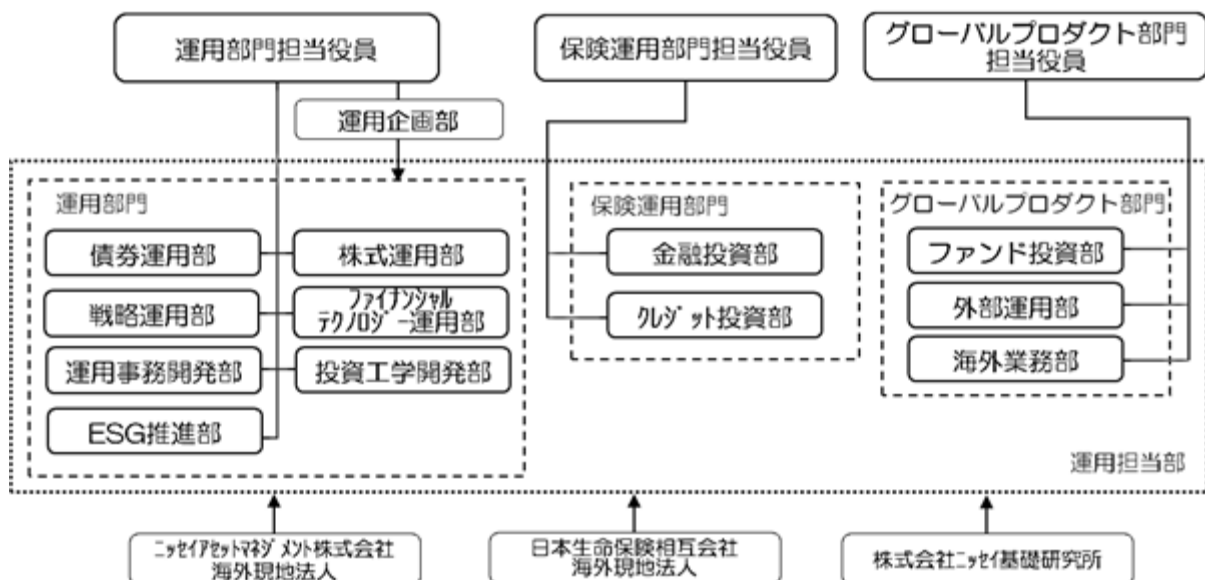
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

### （3）【運用体制】

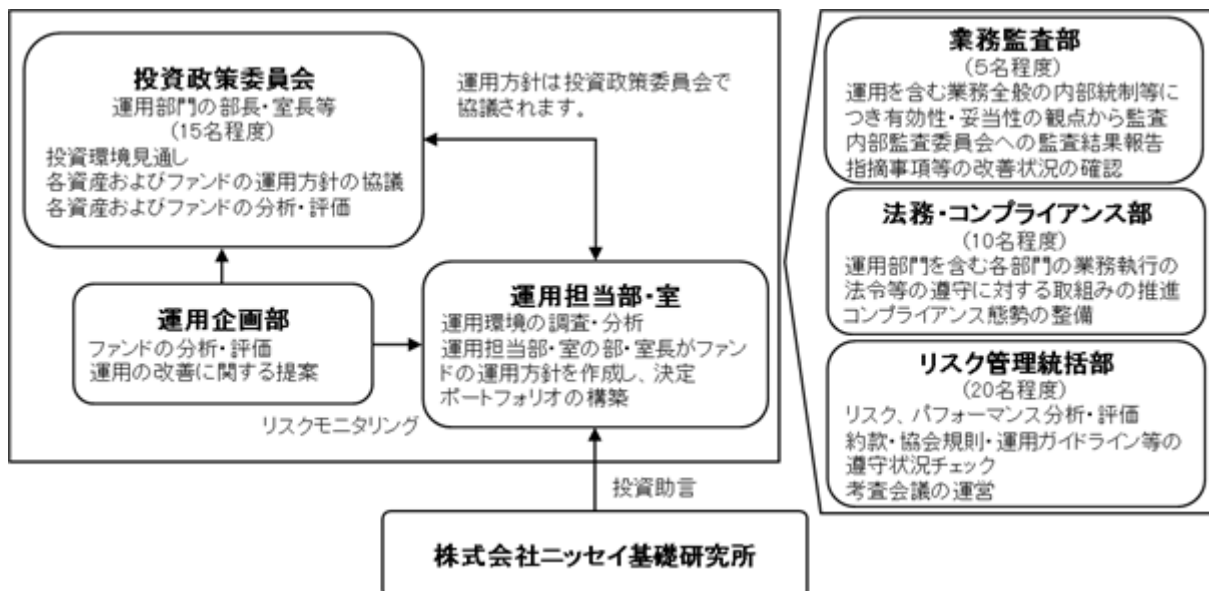
#### 委託会社の組織体制



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



## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

## 1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益（各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます）および売買益（評価益を含みます。ただし、各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます）等の全額とします。

## 2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。

## 3. 留保益の運用方針

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

## 分配時期

毎決算日とし、決算日は2月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

## 支払方法

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

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

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について、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

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10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資対象資産は、本邦通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。

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

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

## b 約款に定めるその他の投資制限

## 投資する株式等の範囲

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

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

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

## 信用取引の範囲

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

## 先物取引等

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

## スワップ取引

1. 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

#### 金利先渡取引

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

#### 有価証券の貸付けおよび範囲

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

#### 有価証券の空売り

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

#### 有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとします。
2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

#### 資金の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます)を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
  3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
  4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。
- c 法令に定める投資制限
- デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
- 金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます)を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。
- 信用リスク集中回避(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)
- 信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法に反することとなる取引を行うことを内容とした運用を行わないものとします。
- 同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
- 委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

### 3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。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。

##### ・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

J-REITの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

##### ・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。

##### ・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。

・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。

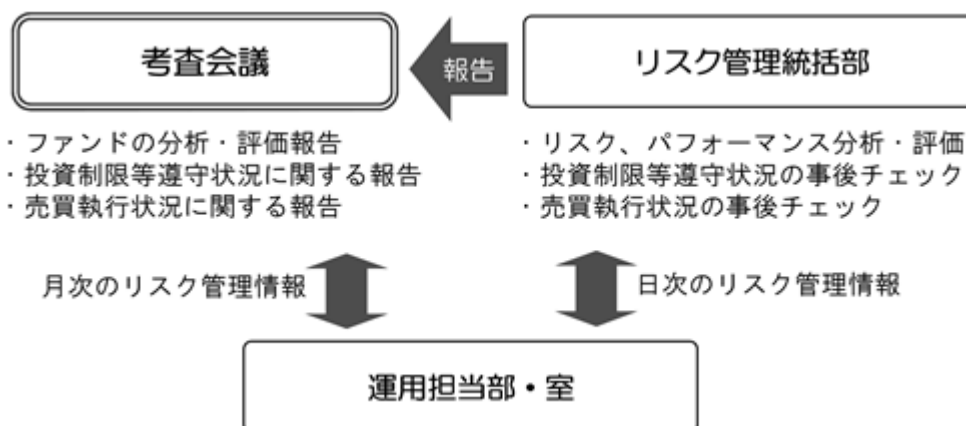
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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2021年2月22日現在、各ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の100%）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。

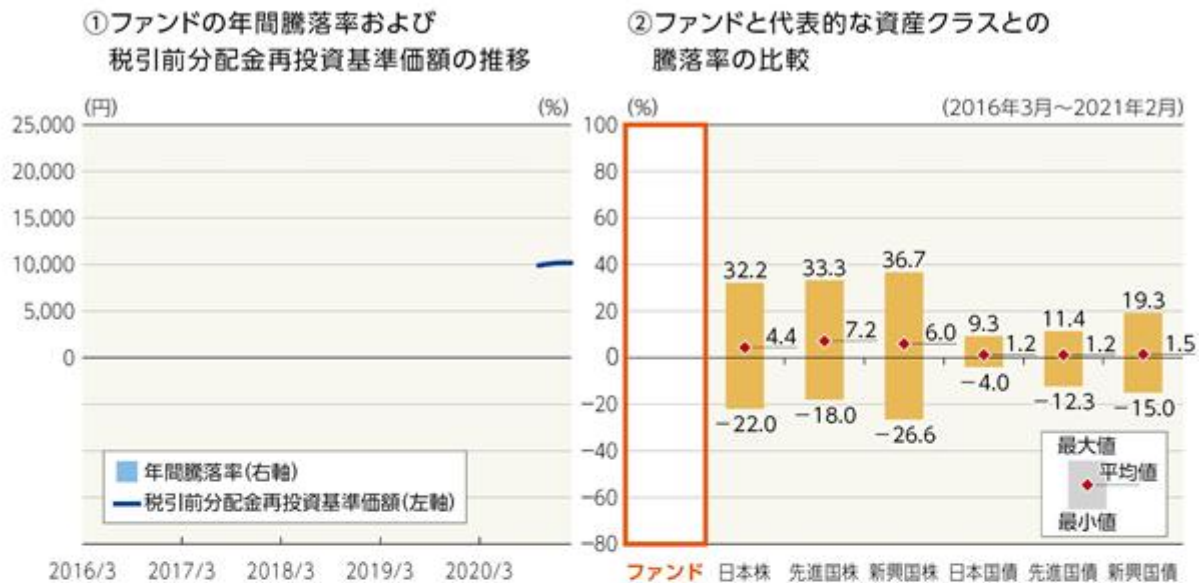
- ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
- ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。

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。

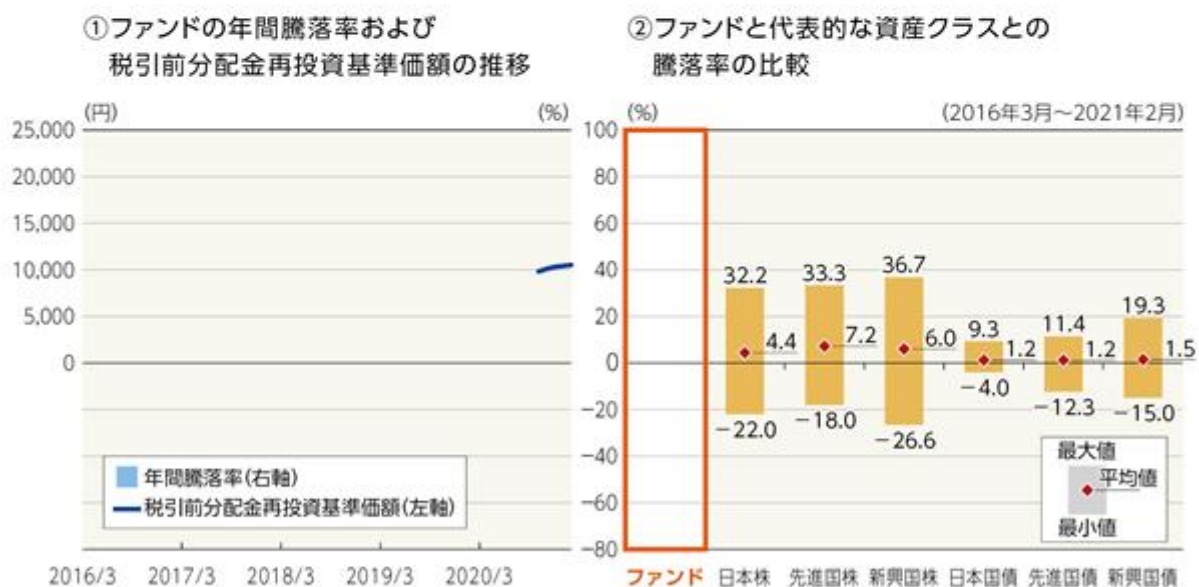
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

**(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。

### ●ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)



### ●ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)



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月末データが1年に満たないため、騰落率を記載していません。

・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。



## &lt;代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数&gt;

- 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 … MSCIE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 … JPMオルガン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。
- ・MSCIE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。
- ・JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPMオ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】

取得申込受付日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

手数料率は変更となる場合があります。

分配金再投資コースで収益分配金を再投資する場合、手数料はかかりません。

償還乗換優遇および換金乗換優遇を受けられる場合があります。

スイッチングの際の申込手数料は、販売会社が定めるものとします。

販売会社によっては、どちらか一方のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

### （２）【換金（解約）手数料】

ありません。

### （３）【信託報酬等】

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以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

ファンド	信託報酬率	配分（税抜）		
		委託会社	販売会社	受託会社
安定型	0.66%（税抜0.6%）	0.29%	0.29%	0.02%
積極型	0.77%（税抜0.7%）	0.34%	0.34%	0.02%

・表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

ファンドが実質的な投資対象とする国内リートは、市場の需給により価格形成されるため、国内リートの費用は表示していません。

### （４）【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

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

信託事務の諸費用

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

## 借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

## &lt;ご参考&gt;

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

## 課税対象

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

## 個人の課税の取扱い

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

## 税率（個人）

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

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

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

## &lt; 少額投資非課税制度について &gt;

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

## 法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）」

(2021年2月26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	1,018,765	100.00
内 日本	1,018,765	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	18	0.00
純資産総額	1,018,747	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。

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）」

(2021年2月26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	1,051,591	100.00
内 日本	1,051,591	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	22	0.00
純資産総額	1,051,569	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)

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」

(2021年2月26日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	47,158,061,010	99.22
内 日本	47,158,061,010	99.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	370,242,405	0.78
純資産総額	47,528,303,415	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」

(2021年2月26日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	161,166,311,160	98.31
内 日本	161,166,311,160	98.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,769,553,801	1.69
純資産総額	163,935,864,961	100.00

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

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,775,740,000	1.69
内 日本	2,775,740,000	1.69

(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」-REITインデックス マザーファンド」

(2021年2月26日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	29,210,592,032	98.22
内 日本	29,210,592,032	98.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	529,991,014	1.78
純資産総額	29,740,583,046	100.00

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)」

(2021年2月26日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円)	評価単価(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
				簿価金額(円)	評価金額(円)		
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	594,755	1.3621	1.3572	-	79.23%
				810,117	807,201	-	
2	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	60,753	1.7888	1.7814	-	10.62%
				108,676	108,225	-	
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	50,336	2.1336	2.0530	-	10.14%
				107,397	103,339	-	

(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。

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)」

(2021年2月26日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円)	評価単価(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
				簿価金額(円)	評価金額(円)		
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	456,083	1.3621	1.3572	-	58.86%
				621,233	618,995	-	
2	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	124,220	1.7888	1.7814	-	21.04%
				222,206	221,285	-	
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	102,928	2.1336	2.0530	-	20.09%
				219,608	211,311	-	

(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）

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」

（2021年2月26日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価 (円)	評価単価 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
				簿価金額 (円)	評価金額 (円)		
1	第338回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	3,506,000,000	101.94 3,574,244,430	101.90 3,572,929,540	0.400000 2025/3/20	7.52%
2	第346回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	3,550,000,000	100.82 3,579,110,000	100.63 3,572,542,500	0.100000 2027/3/20	7.52%
3	第354回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	3,562,000,000	100.48 3,579,168,840	100.16 3,567,699,200	0.100000 2029/3/20	7.51%
4	第143回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	3,503,000,000	100.75 3,529,401,180	100.71 3,527,906,330	0.100000 2025/3/20	7.42%
5	第4回 利付国債 (40年) 日本	国債証券	2,523,000,000	140.57 3,546,682,020	138.79 3,501,772,620	2.200000 2051/3/20	7.37%
6	第325回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	3,339,000,000	101.43 3,386,977,650	101.42 3,386,614,140	0.800000 2022/9/20	7.13%
7	第160回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	2,780,000,000	104.76 2,912,467,000	104.21 2,897,038,000	0.700000 2037/3/20	6.10%
8	第330回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	2,161,000,000	102.33 2,211,376,820	102.31 2,211,113,590	0.800000 2023/9/20	4.65%
9	第328回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	2,070,000,000	101.46 2,100,311,280	101.46 2,100,222,000	0.600000 2023/3/20	4.42%
10	第143回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,812,000,000	116.42 2,109,540,400	115.86 2,099,419,440	1.600000 2033/3/20	4.42%
11	第152回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,864,000,000	112.11 2,089,828,880	111.68 2,081,771,120	1.200000 2035/3/20	4.38%
12	第38回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	1,368,000,000	125.33 1,714,633,560	124.70 1,705,978,080	1.800000 2043/3/20	3.59%
13	第125回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,403,000,000	120.68 1,693,224,580	120.18 1,686,139,430	2.200000 2031/3/20	3.55%
14	第110回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,131,000,000	116.21 1,314,424,620	116.20 1,314,301,170	2.100000 2029/3/20	2.77%
15	第168回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,087,000,000	98.40 1,069,648,680	98.01 1,065,466,530	0.400000 2039/3/20	2.24%
16	第94回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	921,000,000	112.91 1,039,913,370	112.74 1,038,363,030	2.100000 2027/3/20	2.18%

17	第137回 利付国債(5年) 日本	国債証券	1,011,000,000	100.54 1,016,469,510	100.53 1,016,439,180	0.100000 2023/9/20	2.14%
18	第333回 利付国債(10年) 日本	国債証券	991,000,000	102.16 1,012,416,880	102.14 1,012,227,220	0.600000 2024/3/20	2.13%
19	第134回 利付国債(20年) 日本	国債証券	749,000,000	117.29 878,547,040	117.30 878,577,000	1.800000 2032/3/20	1.85%
20	第34回 利付国債(30年) 日本	国債証券	574,000,000	131.84 756,763,020	130.98 751,836,680	2.200000 2041/3/20	1.58%
21	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	584,000,000	100.81 588,732,480	100.73 588,286,560	0.100000 2026/3/20	1.24%
22	第18回 利付国債(30年) 日本	国債証券	448,000,000	127.42 570,850,560	126.71 567,660,800	2.300000 2035/3/20	1.19%
23	第8回 利付国債(40年) 日本	国債証券	477,000,000	120.91 576,744,480	118.92 567,253,170	1.400000 2055/3/20	1.19%
24	第126回 利付国債(20年) 日本	国債証券	473,000,000	118.69 561,409,300	118.20 559,100,190	2.000000 2031/3/20	1.18%
25	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	539,000,000	100.74 542,990,320	100.45 541,463,230	0.100000 2028/3/20	1.14%
26	第12回 利付国債(40年) 日本	国債証券	449,000,000	92.57 415,664,080	91.11 409,106,350	0.500000 2059/3/20	0.86%
27	第5回 利付国債(40年) 日本	国債証券	254,000,000	134.18 340,827,360	134.18 340,832,440	2.000000 2052/3/20	0.72%
28	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	231,000,000	99.77 230,482,560	99.77 230,482,560	0.100000 2030/3/20	0.48%
29	第26回 利付国債(30年) 日本	国債証券	105,000,000	131.18 137,739,210	130.46 136,985,100	2.400000 2037/3/20	0.29%
30	第3回 利付国債(40年) 日本	国債証券	59,000,000	139.77 82,465,480	138.04 81,447,140	2.200000 2050/3/20	0.17%

(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	99.22
	小計		99.22
合計(対純資産総額比)			99.22

(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」

(2021年2月26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	638,500	8,060.00 5,146,310,000	7,873.00 5,026,910,500	- -	3.07%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	490,700	10,530.00 5,167,071,000	9,895.00 4,855,476,500	- -	2.96%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	394,800	11,980.00 4,729,704,000	11,120.00 4,390,176,000	- -	2.68%
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	61,900	56,750.00 3,512,825,000	50,560.00 3,129,664,000	- -	1.91%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,252,500	563.30 2,395,433,250	558.00 2,372,895,000	- -	1.45%
6	任天堂 日本	株式 その他製品	36,100	68,030.00 2,455,883,000	64,750.00 2,337,475,000	- -	1.43%
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	431,400	5,475.00 2,361,915,000	5,281.00 2,278,223,400	- -	1.39%
8	日本電産 日本	株式 電気機器	151,700	14,650.00 2,222,405,000	13,520.00 2,050,984,000	- -	1.25%
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	723,400	2,818.50 2,038,902,900	2,758.00 1,995,137,200	- -	1.22%
10	信越化学工業 日本	株式 化学	114,100	18,740.00 2,138,234,000	17,350.00 1,979,635,000	- -	1.21%
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	524,400	3,687.00 1,933,462,800	3,582.00 1,878,400,800	- -	1.15%
12	村田製作所 日本	株式 電気機器	185,100	9,882.00 1,829,158,200	9,081.00 1,680,893,100	- -	1.03%
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	80,300	22,100.00 1,774,630,000	20,720.00 1,663,816,000	- -	1.01%
14	KDDI 日本	株式 情報・通信業	496,000	3,391.00 1,681,936,000	3,290.00 1,631,840,000	- -	1.00%
15	第一三共 日本	株式 医薬品	541,100	3,261.00 1,764,527,100	3,010.00 1,628,711,000	- -	0.99%
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	430,300	3,763.00 1,619,218,900	3,742.00 1,610,182,600	- -	0.98%
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	36,900	46,300.00 1,708,470,000	43,550.00 1,606,995,000	- -	0.98%
18	HOYA 日本	株式 精密機器	125,000	13,060.00 1,632,500,000	12,100.00 1,512,500,000	- -	0.92%
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	303,000	4,934.00 1,495,002,000	4,876.00 1,477,428,000	- -	0.90%
20	ファナック 日本	株式 電気機器	55,300	27,585.00 1,525,450,500	26,340.00 1,456,602,000	- -	0.89%
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	496,300	2,977.50 1,477,733,250	2,911.50 1,444,977,450	- -	0.88%
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	434,200	3,250.00 1,411,150,000	3,168.00 1,375,545,600	- -	0.84%
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	844,700	1,588.50 1,341,805,950	1,559.00 1,316,887,300	- -	0.80%

24	SMC 日本	株式 機械	18,500	65,860.00 1,218,410,000	62,900.00 1,163,650,000	- -	0.71%
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	64,100	18,040.00 1,156,364,000	17,840.00 1,143,544,000	- -	0.70%
26	三井物産 日本	株式 卸売業	504,000	2,214.50 1,116,108,000	2,263.50 1,140,804,000	- -	0.70%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	378,000	2,982.50 1,127,385,000	3,003.00 1,135,134,000	- -	0.69%
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	206,100	5,351.00 1,102,841,100	5,253.00 1,082,643,300	- -	0.66%
29	花王 日本	株式 化学	150,900	7,270.00 1,097,043,000	7,144.00 1,078,029,600	- -	0.66%
30	資生堂 日本	株式 化学	125,200	8,150.00 1,020,380,000	7,913.00 990,707,600	- -	0.60%

（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	17.36
		情報・通信業	9.44
		化学	7.18
		輸送用機器	6.86
		サービス業	5.65
		機械	5.48
		医薬品	5.36
		銀行業	4.97
		小売業	4.65
		卸売業	4.63
		陸運業	3.57
		食料品	3.27
		精密機器	2.51
		その他製品	2.45
		建設業	2.24
		不動産業	1.97
		保険業	1.86
		電気・ガス業	1.26
		その他金融業	1.07
		証券、商品先物取引業	0.81
		ガラス・土石製品	0.78
		非鉄金属	0.77
		鉄鋼	0.68
		金属製品	0.62
		ゴム製品	0.58
		繊維製品	0.49
空運業	0.48		
石油・石炭製品	0.44		
パルプ・紙	0.25		
海運業	0.20		
鉱業	0.18		
倉庫・運輸関連業	0.17		
水産・農林業	0.09		
小計		98.31	
合計（対純資産総額比）		98.31	

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

(参考情報)

## 「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」

(2021年2月26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	3,170	574,294.98 1,820,515,093	651,000.00 2,063,670,000	- -	6.94%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,817	549,176.49 1,547,030,176	649,000.00 1,828,233,000	- -	6.15%
3	GLP投資法人 日本	投資証券	8,802	160,123.52 1,409,407,293	172,600.00 1,519,225,200	- -	5.11%
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	9,109	135,395.75 1,233,319,932	159,500.00 1,452,885,500	- -	4.89%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,453	352,392.43 1,569,203,526	326,000.00 1,451,678,000	- -	4.88%
6	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,019	245,642.76 987,238,263	279,600.00 1,123,712,400	- -	3.78%
7	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	10,584	82,867.99 877,074,877	105,300.00 1,114,495,200	- -	3.75%
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,613	157,269.84 882,755,627	181,300.00 1,017,636,900	- -	3.42%
9	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,024	127,851.71 770,178,725	146,200.00 880,708,800	- -	2.96%
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,676	306,583.42 820,417,238	323,500.00 865,686,000	- -	2.91%
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,982	181,281.01 721,861,021	183,000.00 728,706,000	- -	2.45%
12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,285	74,877.73 620,362,059	84,600.00 700,911,000	- -	2.36%
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,754	301,515.84 528,858,799	385,500.00 676,167,000	- -	2.27%
14	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,412	412,690.99 582,719,691	468,000.00 660,816,000	- -	2.22%
15	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	871	638,351.99 556,004,587	704,000.00 613,184,000	- -	2.06%
16	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,074	55,409.74 502,788,061	65,700.00 596,161,800	- -	2.00%
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	971	594,336.43 577,100,681	594,000.00 576,774,000	- -	1.94%
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,841	299,207.78 550,841,525	312,000.00 574,392,000	- -	1.93%
19	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	983	498,456.15 489,982,397	519,000.00 510,177,000	- -	1.72%
20	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,778	36,479.37 429,654,111	43,200.00 508,809,600	- -	1.71%
21	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,139	160,667.50 504,335,304	160,700.00 504,437,300	- -	1.70%

22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,309	135,401.23 448,042,681	147,500.00 488,077,500	- -	1.64%
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	935	379,326.34 354,670,135	468,000.00 437,580,000	- -	1.47%
24	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	600	651,012.82 390,607,696	729,000.00 437,400,000	- -	1.47%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,857	123,298.33 352,263,336	148,200.00 423,407,400	- -	1.42%
26	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人 日本	投資証券	1,266	297,496.06 376,630,024	317,000.00 401,322,000	- -	1.35%
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	3,678	99,612.72 366,375,601	104,000.00 382,512,000	- -	1.29%
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,268	144,054.81 326,716,328	168,300.00 381,704,400	- -	1.28%
29	MCUBS MidCity投資 法人 日本	投資証券	3,447	83,305.04 287,152,473	108,086.00 372,572,442	- -	1.25%
30	プレミア投資法人 日本	投資証券	2,544	118,577.81 301,661,957	144,600.00 367,862,400	- -	1.24%

(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	98.22
	小計		98.22
合計(対純資産総額比)			98.22

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

#### 【投資不動産物件】

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)」  
該当事項はありません。

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)」  
該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券インデックス 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J-REITインデックス マザーファンド」  
該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)」  
該当事項はありません。

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)」  
該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

(2021年2月26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 0303月	買建	148	2,861,175,650	2,775,740,000	1.69%

(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J-REITインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)」

	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 (2021年2月22日)	1,026,248	1,026,248	1.0262	1.0262
2020年10月末日	990,172	-	0.9902	-
11月末日	1,004,716	-	1.0047	-
12月末日	1,015,032	-	1.0150	-
2021年1月末日	1,018,254	-	1.0183	-
2月末日	1,018,747	-	1.0187	-

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)」

	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 (2021年2月22日)	1,063,116	1,063,116	1.0631	1.0631
2020年10月末日	982,636	-	0.9826	-
11月末日	1,010,903	-	1.0109	-
12月末日	1,032,230	-	1.0322	-
2021年1月末日	1,041,432	-	1.0414	-
2月末日	1,051,569	-	1.0516	-

## 【分配の推移】

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## 「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）」

	収益率(%)
第1計算期間	2.6

(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。）。

## 「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）」

	収益率(%)
第1計算期間	6.3

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;

### 3. 運用実績

2021年2月末現在

#### ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)

##### ● 基準価額・純資産の推移



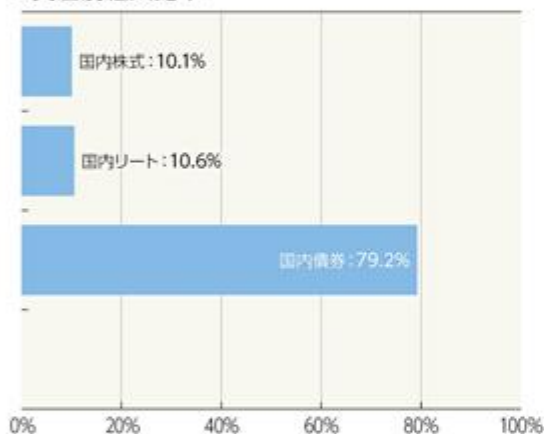
基準価額	10,187円
純資産総額	101万円

##### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2021年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

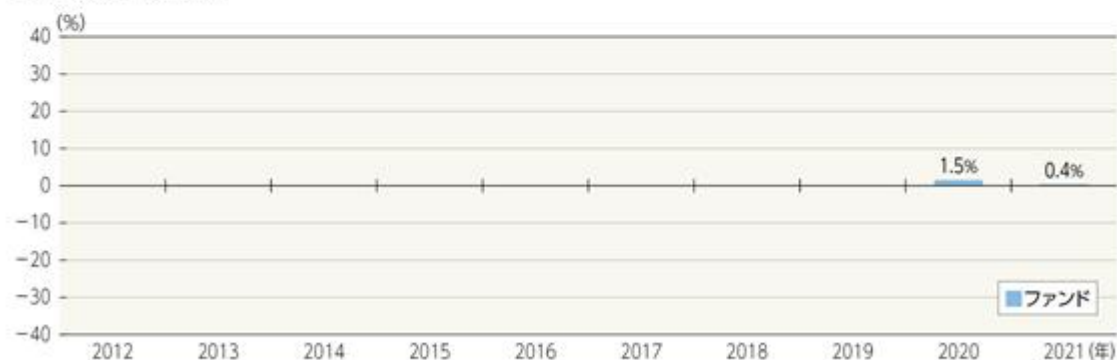
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

##### ● 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



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2020年はファンド設定時から年末まで、2021年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

## 3.運用実績

2021年2月末現在

## ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

## ●基準価額・純資産の推移



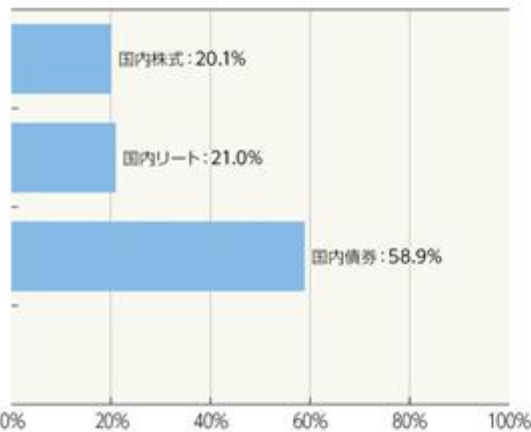
基準価額	10,516円
純資産総額	105万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2021年2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

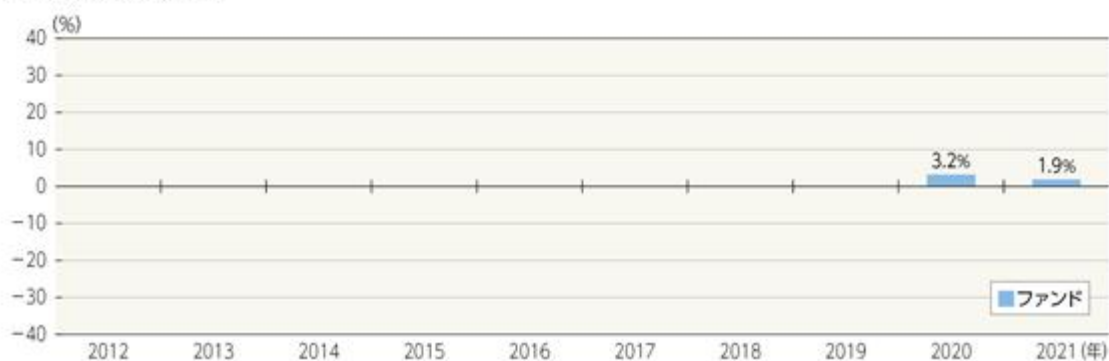
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●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



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2020年はファンド設定時から年末まで、2021年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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



2021年2月末現在

## 3.運用実績

## ●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	3.1%
2	ソフトバンクグループ	3.0%
3	ソニー	2.7%
4	キーエンス	1.9%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.1%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.3%
3	GLP投資法人	5.2%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	5.0%
5	日本プロロジスリート投資法人	5.0%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## 3.ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第338回 利付国債(10年)	2025/03/20	0.400%	7.6%
2	第346回 利付国債(10年)	2027/03/20	0.100%	7.6%
3	第354回 利付国債(10年)	2029/03/20	0.100%	7.6%
4	第143回 利付国債(5年)	2025/03/20	0.100%	7.5%
5	第4回 利付国債(40年)	2051/03/20	2.200%	7.4%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.7%
2	情報・通信業	9.6%
3	化学	7.3%
4	輸送用機器	7.0%
5	サービス業	5.7%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.2%
短期金融資産等	1.8%

・比率は対純資産総額比です。

## 組入比率

種別	比率
債券	99.2%
債券先物	-
現金、その他	0.8%

・比率は対純資産総額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

金融商品取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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（スイッチングの場合も含みます）。

#### 取扱コース

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

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

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

当初設定日：受益権1口当り1円とします。

継続申込期間：取得申込受付日の基準価額とします。

#### 販売価額

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

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

取得申込受付日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

手数料率は変更となる場合があります。

分配金再投資コースで収益分配金を再投資する場合、手数料はかかりません。

償還乗換優遇および換金乗換優遇を受けられる場合があります。

スイッチングの際の申込手数料は、販売会社が定めるものとします。

販売会社によっては、どちらか一方のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

#### 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. 償還乗換優遇とは、償還金の支払いを受けた販売会社で、取得申込みを行う場合に申込手数料の無料または割引等の優遇を受けられることです。それらの措置は販売会社が独自に定めることができます。
4. 換金乗換優遇とは、解約（買取）金の支払いを受けた販売会社で、取得申込みを行う場合に申込手数料の割引等の優遇を受けられることです。それらの措置は販売会社が独自に定めることができます。
5. スwitchingとは、保有しているファンドの換金と同時に乗換えるファンドを購入する取引です。

- 保有しているファンドの換金の際に税金が差引かれます。税金についての詳細は「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。
6. 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  
(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)  
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

## 2【換金(解約)手続等】

### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

金融商品取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときには、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消することがあります(スイッチングの場合も含まれます)。

### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

### 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

### 換金価額

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

<買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

### 信託財産留保額

ありません。

### 支払開始日

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

### その他

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社  
 コールセンター 0120-762-506  
 (9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)  
 ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社  
 コールセンター 0120-762-506  
 (9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)  
 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】

2020年10月1日から2030年9月30日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4)【計算期間】

毎年2月21日から翌年2月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2020年10月1日から2021年2月22日までとします。

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

## (5) 【その他】

## 繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
  - ・ 受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合
  - ・ この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
  - ・ やむを得ない事情が発生したとき
2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知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「 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「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
9. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。

## 約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前記1.の事項（前記1.の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知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發します。

3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知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であっても、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。

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

##### (2) 償還金に対する請求権

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

##### (3) 解約請求権

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

##### (4) 帳簿閲覧権

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

##### (5) 書面決議における議決権

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

##### (6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

### 第3【ファンドの経理状況】

#### ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)

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2020年10月1日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2020年10月1日から2021年2月22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。

#### ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

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2020年10月1日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2020年10月1日から2021年2月22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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2021年2月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		47
コール・ローン		2,427
親投資信託受益証券		1,026,302
未収入金		54
流動資産合計		1,028,830
資産合計		
		1,028,830
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		51
未払委託者報酬		2,531
流動負債合計		2,582
負債合計		
		2,582
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		26,248
純資産合計		1,026,248
負債純資産合計		1,028,830

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2020年10月1日 至2021年2月22日)
営業収益	
有価証券売買等損益	28,830
営業収益合計	28,830
営業費用	
受託者報酬	51
委託者報酬	2,531
営業費用合計	2,582
営業利益又は営業損失( )	26,248
経常利益又は経常損失( )	26,248
当期純利益又は当期純損失( )	26,248
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( )	-
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
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	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,248

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間  当ファンドは、原則として毎年2月20日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2020年10月1日から2021年2月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	1,000,000口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0262円 (10,262円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自2020年10月1日 至2021年2月22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(3,693円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(22,555円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は26,248円(1口当たり0.026248円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自2020年10月1日 至2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 2021年2月22日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	25,299
合計	25,299

(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 2021年2月22日現在
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

## (4)【附属明細表】(2021年2月22日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	594,823	810,208	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	50,342	107,409	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	60,759	108,685	
親投資信託受益証券 合計		705,924	1,026,302	
合計		705,924	1,026,302	

## 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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 (2021年2月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		55
コール・ローン		2,838
親投資信託受益証券		1,063,182
未収入金		66
流動資産合計		1,066,141
資産合計		1,066,141
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		26
未払委託者報酬		2,999
流動負債合計		3,025
負債合計		3,025
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		63,116
純資産合計		1,063,116
負債純資産合計		1,066,141

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2020年10月1日 至2021年2月22日)
営業収益	
有価証券売買等損益	66,141
営業収益合計	66,141
営業費用	
受託者報酬	26
委託者報酬	2,999
営業費用合計	3,025
営業利益又は営業損失( )	63,116
経常利益又は経常損失( )	63,116
当期純利益又は当期純損失( )	63,116
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( )	-
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
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	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	63,116

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間  当ファンドは、原則として毎年2月20日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2020年10月1日から2021年2月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	1,000,000口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0631円 (10,631円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自2020年10月1日 至2021年2月22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(4,928円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(58,188円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は63,116円(1口当たり0.063116円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自2020年10月1日 至2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 2021年2月22日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	59,601
合計	59,601

(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 2021年2月22日現在
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

## (4)【附属明細表】(2021年2月22日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	456,145	621,315	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	102,941	219,634	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	124,236	222,233	
親投資信託受益証券 合計		683,322	1,063,182	
合計		683,322	1,063,182	

## 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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型））は、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」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」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。それらは監査意見の対象外であります。

（参考）

開示対象ファンド（ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型））は、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」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」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。それらは監査意見の対象外であります。

## 「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2021年2月22日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,794,245
コール・ローン	347,375,204
国債証券	47,364,805,230
未収利息	125,297,302
前払費用	31,971,961
流動資産合計	47,876,243,942
資産合計	47,876,243,942
負債の部	
流動負債	
未払解約金	109,053,801
その他未払費用	601
流動負債合計	109,054,402
負債合計	109,054,402
純資産の部	
元本等	
元本	35,069,978,508
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,697,211,032
純資産合計	47,767,189,540
負債純資産合計	47,876,243,942

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	35,069,978,508口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3621円 (13,621円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年2月22日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	795,496,060
合計	795,496,060

## （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	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	32,423,097,681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	5,123,301,354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	2,476,420,527円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	1,698,687,565円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,809,491,186円
ニッセイ日本バランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	3,049,457円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	6,300,241,671円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	9,029,456,364円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,354,067,901円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	18,959,362円
ニッセイインデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	39,633,531円
ニッセイインデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	23,123,863円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	5,996,521,872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）	1,795,443,796円
ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド	250,972円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）	594,823円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）	456,145円
計	35,069,978,508円

## 附属明細表（2021年2月22日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第416回 利付国債(2年)	337,000,000	338,152,540	
	第133回 利付国債(5年)	817,000,000	819,826,820	
	第137回 利付国債(5年)	1,011,000,000	1,016,469,510	
	第143回 利付国債(5年)	3,477,000,000	3,503,216,580	
	第3回 利付国債(40年)	59,000,000	82,465,480	
	第4回 利付国債(40年)	2,523,000,000	3,546,682,020	
	第8回 利付国債(40年)	634,000,000	766,613,780	
	第11回 利付国債(40年)	55,000,000	56,618,100	
	第12回 利付国債(40年)	346,000,000	321,814,600	
	第321回 利付国債(10年)	559,000,000	565,646,510	
	第325回 利付国債(10年)	3,544,000,000	3,594,998,160	
	第328回 利付国債(10年)	1,089,000,000	1,105,008,300	
	第330回 利付国債(10年)	2,043,000,000	2,090,642,760	
	第333回 利付国債(10年)	1,405,000,000	1,435,460,400	
	第338回 利付国債(10年)	2,755,000,000	2,808,915,350	
	第342回 利付国債(10年)	1,006,000,000	1,014,168,720	
	第346回 利付国債(10年)	3,562,000,000	3,591,208,400	
	第350回 利付国債(10年)	1,044,000,000	1,051,746,480	
	第354回 利付国債(10年)	3,562,000,000	3,579,168,840	
	第18回 利付国債(30年)	448,000,000	570,850,560	
	第26回 利付国債(30年)	207,000,000	271,544,670	
	第30回 利付国債(30年)	45,000,000	59,155,650	
	第34回 利付国債(30年)	843,000,000	1,111,428,060	
	第37回 利付国債(30年)	12,000,000	15,270,960	
	第38回 利付国債(30年)	986,000,000	1,238,268,100	
	第49回 利付国債(30年)	411,000,000	485,169,060	
	第94回 利付国債(20年)	669,000,000	755,816,130	
	第100回 利付国債(20年)	496,000,000	573,301,600	
	第110回 利付国債(20年)	50,000,000	58,281,000	
	第125回 利付国債(20年)	1,403,000,000	1,693,224,580	
	第126回 利付国債(20年)	1,185,000,000	1,406,559,450	
	第143回 利付国債(20年)	2,342,000,000	2,726,673,500	
	第152回 利付国債(20年)	1,312,000,000	1,473,349,760	
第160回 利付国債(20年)	2,780,000,000	2,912,467,000		
第168回 利付国債(20年)	735,000,000	724,621,800		
国債証券 合計		43,752,000,000	47,364,805,230	
合計		43,752,000,000	47,364,805,230	

## 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)

	2021年2月22日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	22,734,045
コール・ローン	1,162,343,035
株式	169,111,924,060
派生商品評価勘定	100,174,250
未収配当金	221,013,500
差入委託証拠金	62,400,000
流動資産合計	170,680,588,890
資産合計	170,680,588,890
負債の部	
流動負債	
前受金	94,035,000
未払解約金	292,673,611
その他未払費用	3,774
流動負債合計	386,712,385
負債合計	386,712,385
純資産の部	
元本等	
元本	79,813,755,893
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	90,480,120,612
純資産合計	170,293,876,505
負債純資産合計	170,680,588,890

## 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	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	79,813,755,893口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1336円 (21,336円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年2月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	36,295,243,081	
合計	36,295,243,081	

## （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	2021年2月22日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
先物取引				
買 建	1,160,465,000	-	1,260,675,000	100,210,000
合計	1,160,465,000	-	1,260,675,000	100,210,000

## （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	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	81,311,472,300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	6,638,452,475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	8,136,168,882円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,791,943,526円
ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）	3,838,721,766円
ニッセイ日本バランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	3,845,110円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,824,833,310円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,083,058,971円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	4,223,461,711円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	4,505,216円
ニッセイインデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	21,672,934円
ニッセイインデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	28,960,592円
DCニッセイ国内株式インデックス	492,190,490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	17,275,669,670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)	1,180,490,320円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	152,517,938円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	143,266,411円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	153,665,546円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	328,688,648円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	57,347,460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)	56,221,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,193,882円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	6,520,617円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,793,965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)	4,798,597円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	19,125,276円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	51,866,593円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	34,906,904円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	112,843,783円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	140,615,947円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	37,763,633,451円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	10,242,693円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	50,342円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	102,941円
計	79,813,755,893円

## 附属明細表(2021年2月22日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	2,900	3,050.00	8,845,000	
日本水産	80,400	502.00	40,360,800	
マルハニチロ	13,600	2,480.00	33,728,000	
雪国まいたけ	5,400	1,768.00	9,547,200	
カネコ種苗	2,600	1,597.00	4,152,200	
サカタのタネ	10,400	3,880.00	40,352,000	
ホクト	7,300	2,145.00	15,658,500	
ヒノキヤグループ	2,100	2,191.00	4,601,100	
ショーボンドホールディングス	12,400	4,730.00	58,652,000	
ミライト・ホールディングス	30,000	1,712.00	51,360,000	
タマホーム	5,200	1,898.00	9,869,600	
ファーストコーポレーション	5,900	698.00	4,118,200	
スペースバリューホールディングス	10,600	814.00	8,628,400	
住石ホールディングス	2,400	124.00	297,600	
日鉄鉱業	2,000	5,990.00	11,980,000	
三井松島ホールディングス	5,300	932.00	4,939,600	
国際石油開発帝石	318,400	776.00	247,078,400	
石油資源開発	11,300	2,239.00	25,300,700	
K&Oエナジーグループ	4,200	1,464.00	6,148,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	846.00	2,707,200	
安藤・間	55,500	782.00	43,401,000	
東急建設	25,400	544.00	13,817,600	
コムシスホールディングス	30,700	3,250.00	99,775,000	
ビーアールホールディングス	10,200	684.00	6,976,800	
高松コンストラクショングループ	5,400	2,127.00	11,485,800	
東建コーポレーション	2,700	8,570.00	23,139,000	
ソネック	5,100	832.00	4,243,200	
ヤマウラ	4,500	953.00	4,288,500	
大成建設	62,200	3,790.00	235,738,000	
大林組	199,900	936.00	187,106,400	
清水建設	187,300	817.00	153,024,100	
飛島建設	5,700	1,119.00	6,378,300	
長谷工コーポレーション	65,500	1,354.00	88,687,000	
松井建設	7,900	716.00	5,656,400	
銭高組	1,000	4,575.00	4,575,000	
鹿島建設	146,500	1,421.00	208,176,500	
不動テトラ	4,900	1,805.00	8,844,500	
大末建設	5,000	926.00	4,630,000	
鉄建建設	4,000	1,966.00	7,864,000	
西松建設	14,300	2,596.00	37,122,800	
三井住友建設	48,300	460.00	22,218,000	
大豊建設	4,400	3,680.00	16,192,000	
前田建設工業	50,100	998.00	49,999,800	
佐田建設	9,600	427.00	4,099,200	
ナカノフドー建設	10,600	371.00	3,932,600	
奥村組	11,000	2,682.00	29,502,000	
東鉄工業	8,600	2,648.00	22,772,800	
浅沼組	2,400	4,530.00	10,872,000	
戸田建設	83,000	743.00	61,669,000	
熊谷組	9,300	2,800.00	26,040,000	
北野建設	1,700	2,478.00	4,212,600	
植木組	1,500	2,910.00	4,365,000	
矢作建設工業	8,800	847.00	7,453,600	
ピーエス三菱	6,800	685.00	4,658,000	

日本ハウスホールディングス	13,600	336.00	4,569,600
大東建託	21,800	12,350.00	269,230,000
新日本建設	8,500	846.00	7,191,000
N I P P O	16,500	2,832.00	46,728,000
東亜道路工業	1,200	4,140.00	4,968,000
前田道路	12,400	2,003.00	24,837,200
日本道路	1,900	8,010.00	15,219,000
東亜建設工業	5,300	2,170.00	11,501,000
日本国土開発	19,400	558.00	10,825,200
若築建設	3,600	1,277.00	4,597,200
東洋建設	22,400	553.00	12,387,200
五洋建設	84,900	795.00	67,495,500
世紀東急工業	9,600	890.00	8,544,000
福田組	2,300	5,020.00	11,546,000
住友林業	47,000	2,099.00	98,653,000
日本基礎技術	8,700	498.00	4,332,600
巴コーポレーション	10,500	397.00	4,168,500
大和ハウス工業	184,600	3,200.00	590,720,000
ライト工業	11,400	1,647.00	18,775,800
積水ハウス	216,800	2,081.00	451,160,800
日特建設	5,400	785.00	4,239,000
北陸電気工事	3,500	1,192.00	4,172,000
ユアテック	11,400	816.00	9,302,400
日本リーテック	4,200	2,494.00	10,474,800
四電工	1,500	2,804.00	4,206,000
中電工	9,200	2,211.00	20,341,200
関電工	32,500	884.00	28,730,000
きんでん	43,200	1,776.00	76,723,200
東京エネシス	6,600	918.00	6,058,800
トーエネック	2,000	3,735.00	7,470,000
住友電設	5,600	2,434.00	13,630,400
日本電設工業	11,000	1,932.00	21,252,000
協和エクシオ	30,300	2,722.00	82,476,600
新日本空調	5,300	2,270.00	12,031,000
日本工営	3,800	2,891.00	10,985,800
九電工	14,000	3,390.00	47,460,000
三機工業	14,200	1,296.00	18,403,200
日揮ホールディングス	66,700	1,355.00	90,378,500
中外炉工業	2,500	1,744.00	4,360,000
ヤマト	6,400	669.00	4,281,600
太平電業	4,400	2,663.00	11,717,200
高砂熱学工業	18,100	1,596.00	28,887,600
三晃金属工業	1,500	3,095.00	4,642,500
N E C ネットエスアイ	20,700	1,889.00	39,102,300
朝日工業社	1,500	3,010.00	4,515,000
明星工業	12,900	806.00	10,397,400
大気社	9,700	2,947.00	28,585,900
ダイダン	4,400	2,809.00	12,359,600
日比谷総合設備	6,400	1,878.00	12,019,200
ニッポン	18,700	1,609.00	30,088,300
日清製粉グループ本社	72,300	1,727.00	124,862,100
昭和産業	5,400	3,245.00	17,523,000
鳥越製粉	5,700	859.00	4,896,300
中部飼料	7,800	1,443.00	11,255,400
フィード・ワン	8,600	914.00	7,860,400
日本甜菜製糖	3,300	1,685.00	5,560,500
三井製糖	5,000	1,938.00	9,690,000
塩水港精糖	18,900	228.00	4,309,200
日新製糖	3,000	1,870.00	5,610,000
L I F U L L	21,300	422.00	8,988,600

ミクシィ	11,600	2,747.00	31,865,200
ジェイエイシーリクルートメント	4,100	1,665.00	6,826,500
日本M&Aセンター	49,900	6,090.00	303,891,000
メンバーズ	1,800	2,785.00	5,013,000
UTグループ	8,800	3,285.00	28,908,000
アイティメディア	2,000	1,908.00	3,816,000
タケエイ	6,800	1,272.00	8,649,600
ビーネックスグループ	7,600	1,407.00	10,693,200
コシダカホールディングス	14,700	551.00	8,099,700
アルトナー	4,600	838.00	3,854,800
パソナグループ	6,600	1,923.00	12,691,800
CDS	3,000	1,389.00	4,167,000
リンクアンドモチベーション	11,200	531.00	5,947,200
GCA	8,000	796.00	6,368,000
エス・エム・エス	20,700	3,700.00	76,590,000
サニーサイドアップグループ	6,600	744.00	4,910,400
パーソルホールディングス	60,900	2,169.00	132,092,100
リニカル	5,300	792.00	4,197,600
クックパッド	19,100	311.00	5,940,100
アイ・ケイ・ケイ	6,900	610.00	4,209,000
森永製菓	15,000	3,980.00	59,700,000
中村屋	1,500	3,970.00	5,955,000
江崎グリコ	17,600	4,480.00	78,848,000
名糖産業	3,000	1,515.00	4,545,000
井村屋グループ	3,600	2,516.00	9,057,600
不二家	4,100	2,278.00	9,339,800
山崎製パン	48,000	1,887.00	90,576,000
モロゾフ	1,000	5,650.00	5,650,000
亀田製菓	3,600	4,810.00	17,316,000
寿スピリッツ	6,200	6,820.00	42,284,000
カルビー	29,200	2,903.00	84,767,600
森永乳業	11,800	4,830.00	56,994,000
六甲バター	4,200	1,738.00	7,299,600
ヤクルト本社	44,000	5,530.00	243,320,000
明治ホールディングス	42,300	6,970.00	294,831,000
雪印メグミルク	15,400	2,189.00	33,710,600
プリマハム	9,000	3,340.00	30,060,000
日本ハム	24,500	4,665.00	114,292,500
林兼産業	7,100	626.00	4,444,600
丸大食品	6,300	1,698.00	10,697,400
S Foods	5,700	3,465.00	19,750,500
柿安本店	2,200	2,724.00	5,992,800
伊藤ハム米久ホールディングス	41,200	745.00	30,694,000
学情	3,200	1,416.00	4,531,200
スタジオアリス	3,100	2,139.00	6,630,900
クロスキャット	3,500	1,144.00	4,004,000
シミックホールディングス	3,000	1,717.00	5,151,000
システナ	22,300	1,947.00	43,418,100
NJS	2,100	1,883.00	3,954,300
デジタルアーツ	3,600	10,990.00	39,564,000
日鉄ソリューションズ	9,400	3,225.00	30,315,000
総合警備保障	24,200	4,970.00	120,274,000
キューブシステム	3,300	1,172.00	3,867,600
いちご	70,000	338.00	23,660,000
日本駐車場開発	62,100	142.00	8,818,200
コア	2,800	1,541.00	4,314,800
カカコム	45,000	3,530.00	158,850,000
アイロムグループ	2,300	1,932.00	4,443,600
セントケア・ホールディング	4,400	940.00	4,136,000
ルネサンス	4,500	1,174.00	5,283,000



ディップ	9,500	3,025.00	28,737,500
SBSホールディングス	4,700	2,541.00	11,942,700
デジタルホールディングス	4,200	1,971.00	8,278,200
新日本科学	7,400	650.00	4,810,000
ツクイホールディングス	14,300	924.00	13,213,200
ベネフィット・ワン	22,200	2,931.00	65,068,200
エムスリー	107,500	8,800.00	946,000,000
ツカダ・グローバルホールディング	15,200	354.00	5,380,800
アウトソーシング	34,900	1,483.00	51,756,700
ウェルネット	8,600	529.00	4,549,400
ワールドホールディングス	2,100	2,465.00	5,176,500
ディー・エヌ・エー	25,800	2,253.00	58,127,400
博報堂DYホールディングス	84,800	1,818.00	154,166,400
ぐるなび	10,500	637.00	6,688,500
タカミヤ	7,600	510.00	3,876,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	886.00	4,430,000
ファンコミュニケーションズ	16,700	406.00	6,780,200
ライク	2,000	1,966.00	3,932,000
ビジネス・ブレークスルー	9,200	435.00	4,002,000
エスプール	15,600	1,018.00	15,880,800
WDBホールディングス	2,800	2,700.00	7,560,000
アドウェイズ	7,400	965.00	7,141,000
バリューコマース	4,100	3,080.00	12,628,000
インフォマート	61,600	1,048.00	64,556,800
サッポロホールディングス	21,800	2,244.00	48,919,200
アサヒグループホールディングス	139,800	4,548.00	635,810,400
麒麟ホールディングス	271,300	2,115.00	573,799,500
宝ホールディングス	47,400	1,499.00	71,052,600
オエノンホールディングス	18,200	400.00	7,280,000
養命酒製造	2,200	1,924.00	4,232,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	49,000	1,832.00	89,768,000
サントリー食品インターナショナル	42,800	3,770.00	161,356,000
ダイドーグループホールディングス	3,600	5,410.00	19,476,000
伊藤園	19,400	6,310.00	122,414,000
キーコーヒー	6,300	2,157.00	13,589,100
日清オイリオグループ	8,200	3,195.00	26,199,000
不二製油グループ本社	15,600	3,190.00	49,764,000
かどや製油	1,100	4,095.00	4,504,500
J・オイルミルズ	3,000	3,805.00	11,415,000
ローソン	15,900	5,150.00	81,885,000
サンエー	4,700	4,220.00	19,834,000
カワチ薬品	4,400	2,974.00	13,085,600
エービーシー・マート	9,800	6,130.00	60,074,000
ハードオフコーポレーション	5,500	808.00	4,444,000
アスクル	5,500	3,735.00	20,542,500
ゲオホールディングス	8,400	1,172.00	9,844,800
アダストリア	8,700	2,056.00	17,887,200
ジーフット	10,100	419.00	4,231,900
オルパヘルスケアホールディングス	2,700	1,560.00	4,212,000
伊藤忠食品	1,500	5,270.00	7,905,000
くら寿司	3,700	7,640.00	28,268,000
キャンドゥ	3,000	1,915.00	5,745,000
エレマテック	5,000	988.00	4,940,000
パルグループホールディングス	5,500	1,640.00	9,020,000
エディオン	26,600	1,076.00	28,621,600
あらた	5,000	4,635.00	23,175,000
サーラコーポレーション	12,700	584.00	7,416,800
トーメンデバイス	1,100	3,970.00	4,367,000
ハローズ	2,400	3,000.00	7,200,000

ＪＰホールディングス	17,400	293.00	5,098,200
フジオフードグループ本社	5,300	1,296.00	6,868,800
あみやき亭	1,500	2,934.00	4,401,000
東京エレクトロン デバイス	2,100	3,915.00	8,221,500
双日	346,800	281.00	97,450,800
アルフレッサ ホールディングス	65,100	2,171.00	141,332,100
大黒天物産	1,500	6,170.00	9,255,000
ハニーズホールディングス	5,000	1,033.00	5,165,000
キッコーマン	46,000	7,400.00	340,400,000
味の素	152,200	2,267.50	345,113,500
キューピー	35,600	2,394.00	85,226,400
ハウス食品グループ本社	23,900	3,720.00	88,908,000
カゴメ	26,100	3,340.00	87,174,000
アリアケジャパン	5,800	6,800.00	39,440,000
ピエトロ	2,400	1,780.00	4,272,000
エバラ食品工業	900	2,647.00	2,382,300
ニチレイ	30,500	2,807.00	85,613,500
横浜冷凍	16,400	901.00	14,776,400
東洋水産	32,900	4,615.00	151,833,500
イトアンドホールディングス	2,300	1,940.00	4,462,000
大冷	2,100	1,962.00	4,120,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	957.00	4,689,300
日清食品ホールディングス	25,100	8,340.00	209,334,000
永谷園ホールディングス	3,100	2,358.00	7,309,800
一正蒲鉾	3,700	1,157.00	4,280,900
フジッコ	6,900	2,003.00	13,820,700
ロック・フィールド	6,900	1,555.00	10,729,500
日本たばこ産業	343,100	1,936.50	664,413,150
ケンコーマヨネーズ	3,900	2,024.00	7,893,600
わらべや日洋ホールディングス	4,200	1,716.00	7,207,200
なとり	3,600	2,019.00	7,268,400
ピクルスコーポレーション	1,500	3,580.00	5,370,000
北の達人コーポレーション	22,300	636.00	14,182,800
ユーグレナ	27,700	990.00	27,423,000
スター・マイカ・ホールディングス	3,700	1,194.00	4,417,800
A Dワークスグループ	26,800	157.00	4,207,600
片倉工業	8,400	1,391.00	11,684,400
グンゼ	4,600	3,790.00	17,434,000
ヒューリック	133,400	1,199.00	159,946,600
ラサ商事	4,600	913.00	4,199,800
アルペン	4,800	2,320.00	11,136,000
ラクーンホールディングス	4,400	2,231.00	9,816,400
クオールホールディングス	8,500	1,445.00	12,282,500
アルコニックス	6,700	1,633.00	10,941,100
神戸物産	43,300	2,924.00	126,609,200
ソリトンシステムズ	3,100	1,862.00	5,772,200
ジンズホールディングス	3,300	7,320.00	24,156,000
ビックカメラ	37,200	1,184.00	44,044,800
D C Mホールディングス	38,700	1,101.00	42,608,700
MonotaRO	44,600	6,860.00	305,956,000
東京一番フーズ	7,200	596.00	4,291,200
あい ホールディングス	9,000	2,041.00	18,369,000
ディーブイエックス	4,100	1,044.00	4,280,400
きちりホールディングス	7,200	608.00	4,377,600
アーランドサービスホールディングス	5,200	2,146.00	11,159,200
J . フロント リテイリング	75,000	1,012.00	75,900,000
ドトール・日レスホールディングス	9,900	1,655.00	16,384,500
マツモトキヨシホールディングス	26,000	4,280.00	111,280,000
ブロンコビリー	3,300	2,319.00	7,652,700
Z O Z O	37,000	3,590.00	132,830,000

トレジャー・ファクトリー	5,700	808.00	4,605,600
物語コーポレーション	1,700	12,300.00	20,910,000
ココカラファイン	5,600	7,440.00	41,664,000
三越伊勢丹ホールディングス	109,800	732.00	80,373,600
東洋紡	24,700	1,342.00	33,147,400
ユニチカ	18,300	446.00	8,161,800
富士紡ホールディングス	3,000	4,290.00	12,870,000
日清紡ホールディングス	39,000	804.00	31,356,000
倉敷紡績	5,800	1,920.00	11,136,000
ダイワボウホールディングス	5,700	8,130.00	46,341,000
日東紡績	9,500	4,390.00	41,705,000
トヨタ紡織	18,600	1,733.00	32,233,800
マクニカ・富士エレホールディングス	15,000	2,111.00	31,665,000
H a m e e	2,300	1,672.00	3,845,600
ラクト・ジャパン	2,700	2,643.00	7,136,100
ウエルシアホールディングス	33,200	3,615.00	120,018,000
クリエイトSDホールディングス	9,300	3,395.00	31,573,500
グリムス	1,400	1,752.00	2,452,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,900	790.00	8,611,000
八洲電機	4,800	951.00	4,564,800
メディアスホールディングス	5,200	841.00	4,373,200
レスターホールディングス	6,500	2,055.00	13,357,500
ジューテックホールディングス	4,100	1,057.00	4,333,700
丸善C H Iホールディングス	11,100	379.00	4,206,900
O C H Iホールディングス	3,200	1,347.00	4,310,400
T O K A Iホールディングス	30,400	956.00	29,062,400
ミサワ	5,700	667.00	3,801,900
ティーライフ	3,600	1,223.00	4,402,800
C o m i n i x	5,500	772.00	4,246,000
三洋貿易	6,300	1,078.00	6,791,400
チムニー	3,400	1,400.00	4,760,000
シュッピン	4,400	1,103.00	4,853,200
ビューティガレージ	1,700	2,531.00	4,302,700
オイシックス・ラ・大地	6,200	2,921.00	18,110,200
ウイン・パートナーズ	4,500	1,165.00	5,242,500
ネクステージ	10,700	1,721.00	18,414,700
ジョイフル本田	18,400	1,415.00	26,036,000
鳥貴族ホールディングス	2,800	1,759.00	4,925,200
ホットランド	4,700	1,227.00	5,766,900
すかいらくホールディングス	70,400	1,638.00	115,315,200
S F Pホールディングス	2,100	1,446.00	3,036,600
綿半ホールディングス	4,700	1,262.00	5,931,400
日本毛織	20,500	958.00	19,639,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18,200	1,127.00	20,511,400
三栄建築設計	2,500	1,793.00	4,482,500
野村不動産ホールディングス	38,200	2,415.00	92,253,000
三重交通グループホールディングス	12,700	487.00	6,184,900
サムティ	8,900	1,771.00	15,761,900
ディア・ライフ	9,500	428.00	4,066,000
コーセーアールイー	6,400	592.00	3,788,800
日本商業開発	4,000	1,650.00	6,600,000
プレサンスコーポレーション	10,300	1,503.00	15,480,900
日本管理センター	3,600	1,222.00	4,399,200
サンセイランディック	5,700	768.00	4,377,600
エストラスト	5,900	711.00	4,194,900
フージャースホールディングス	10,300	692.00	7,127,600
オープンハウス	19,800	4,100.00	81,180,000
東急不動産ホールディングス	171,000	678.00	115,938,000

飯田グループホールディングス	52,400	2,449.00	128,327,600
イーランド	5,100	866.00	4,416,600
ムゲンエステート	9,200	488.00	4,489,600
帝国繊維	7,000	2,275.00	15,925,000
日本コークス工業	53,900	104.00	5,605,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,800	1,264.00	6,067,200
B E E N O S	2,900	2,613.00	7,577,700
あさひ	4,700	1,514.00	7,115,800
日本調剤	3,800	1,595.00	6,061,000
コスモス薬品	6,300	15,860.00	99,918,000
シップヘルスケアホールディングス	11,100	5,880.00	65,268,000
ソフトクリエイティブホールディングス	2,500	2,498.00	6,245,000
オンリー	9,200	466.00	4,287,200
セブン&アイ・ホールディングス	245,600	4,202.00	1,032,011,200
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	33,700	840.00	28,308,000
明治電機工業	2,700	1,413.00	3,815,100
ツルハホールディングス	13,700	14,110.00	193,307,000
サンマルクホールディングス	5,000	1,626.00	8,130,000
フェリシモ	3,100	1,354.00	4,197,400
トリドールホールディングス	15,500	1,505.00	23,327,500
帝人	58,800	1,873.00	110,132,400
東レ	452,100	706.80	319,544,280
クラレ	98,300	1,196.00	117,566,800
旭化成	413,800	1,147.50	474,835,500
サカイオーベックス	1,900	2,851.00	5,416,900
T O K Y O B A S E	9,000	722.00	6,498,000
稲葉製作所	3,500	1,427.00	4,994,500
宮地エンジニアリンググループ	2,100	2,221.00	4,664,100
トーカロ	16,300	1,403.00	22,868,900
アルファ	4,200	1,096.00	4,603,200
S U M C O	80,700	2,520.00	203,364,000
川田テクノロジーズ	1,300	4,680.00	6,084,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,000	6,330.00	12,660,000
ハウズドゥ	3,600	1,170.00	4,212,000
ケイアイスター不動産	2,000	3,675.00	7,350,000
グッドコムアセット	3,300	1,410.00	4,653,000
日本フェルト	9,800	444.00	4,351,200
イチカワ	3,200	1,328.00	4,249,600
芦森工業	4,400	1,031.00	4,536,400
アツギ	8,600	546.00	4,695,600
J M ホールディングス	4,800	2,005.00	9,624,000
コメダホールディングス	13,700	1,938.00	26,550,600
アレンザホールディングス	3,600	1,376.00	4,953,600
パロックジャパンリミテッド	5,600	817.00	4,575,200
クスリのアオキホールディングス	6,200	8,840.00	54,808,000
スシローグローバルホールディングス	34,500	4,275.00	147,487,500
アセンテック	2,200	1,689.00	3,715,800
セーレン	15,400	1,909.00	29,398,600
ソトー	5,200	830.00	4,316,000
東海染工	3,700	1,128.00	4,173,600
小松マテーレ	10,200	1,024.00	10,444,800
ワコールホールディングス	15,600	2,223.00	34,678,800
ホギメディカル	8,400	3,185.00	26,754,000
クラウドシアホールディングス	16,000	294.00	4,704,000
T S I ホールディングス	19,000	278.00	5,282,000
マツオカコーポレーション	2,100	1,916.00	4,023,600
ワールド	8,200	1,381.00	11,324,200
T I S	62,500	2,264.00	141,500,000
電算システム	2,300	3,270.00	7,521,000

グリー	38,400	603.00	23,155,200
コーエーテクモホールディングス	12,800	6,370.00	81,536,000
三菱総合研究所	2,700	4,105.00	11,083,500
電算	1,700	2,549.00	4,333,300
A G S	5,100	835.00	4,258,500
ファインデックス	5,300	1,222.00	6,476,600
ブレインパッド	1,600	5,080.00	8,128,000
K L a b	11,400	867.00	9,883,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,300	1,166.00	9,677,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,262.00	3,393,000
ネクソン	158,000	3,490.00	551,420,000
アイスタイル	19,100	551.00	10,524,100
エムアップホールディングス	1,700	2,695.00	4,581,500
エイチーム	4,300	1,238.00	5,323,400
エニグモ	5,900	1,242.00	7,327,800
テクノスジャパン	6,200	693.00	4,296,600
コロプラ	20,500	910.00	18,655,000
ブロードリーフ	31,000	513.00	15,903,000
クロス・マーケティンググループ	11,100	408.00	4,528,800
システム情報	4,700	1,065.00	5,005,500
メディアドゥ	2,400	6,220.00	14,928,000
じげん	15,500	406.00	6,293,000
ブイキューブ	3,400	2,769.00	9,414,600
サイバーリンクス	2,000	2,007.00	4,014,000
フィックスターズ	6,700	1,003.00	6,720,100
C A R T A H O L D I N G S	3,100	1,567.00	4,857,700
オブティム	4,400	3,180.00	13,992,000
セレス	2,100	4,355.00	9,145,500
S H I F T	2,800	14,750.00	41,300,000
特種東海製紙	3,800	4,735.00	17,993,000
ティーガイア	6,700	1,877.00	12,575,900
セック	1,500	2,822.00	4,233,000
日本アジアグループ	6,000	1,246.00	7,476,000
テクマトリックス	9,700	1,751.00	16,984,700
プロシップ	2,900	1,356.00	3,932,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,100	2,363.00	35,681,300
G M O ペイメントゲートウェイ	13,300	15,830.00	210,539,000
ザッパラス	8,900	464.00	4,129,600
インターネットイニシアティブ	16,600	2,311.00	38,362,600
さくらインターネット	6,700	681.00	4,562,700
ヴィンクス	3,500	1,138.00	3,983,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	1,400	8,460.00	11,844,000
S R A ホールディングス	3,300	2,602.00	8,586,600
朝日ネット	5,100	838.00	4,273,800
e B A S E	7,500	930.00	6,975,000
アバント	6,700	1,409.00	9,440,300
アドソル日進	2,200	2,738.00	6,023,600
フリービット	4,100	998.00	4,091,800
コムチュア	5,700	2,887.00	16,455,900
サイバーコム	2,500	1,589.00	3,972,500
アステリア	4,500	916.00	4,122,000
アイル	3,500	1,644.00	5,754,000
王子ホールディングス	281,100	709.00	199,299,900
日本製紙	27,600	1,406.00	38,805,600
三菱製紙	11,900	361.00	4,295,900
北越コーポレーション	44,700	514.00	22,975,800
中越パルプ工業	3,600	1,202.00	4,327,200

大王製紙	30,100	2,224.00	66,942,400
阿波製紙	200	451.00	90,200
マークライズ	2,600	2,400.00	6,240,000
メディカル・データ・ビジョン	7,100	2,158.00	15,321,800
gumi	8,700	989.00	8,604,300
モバイルファクトリー	3,800	1,041.00	3,955,800
テラスカイ	2,000	3,900.00	7,800,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,800	1,644.00	4,603,200
PR TIMES	1,300	3,410.00	4,433,000
ランドコンピュータ	3,700	1,127.00	4,169,900
ダブルスタンダード	900	4,155.00	3,739,500
オープンドア	3,700	2,335.00	8,639,500
アカツキ	2,500	4,340.00	10,850,000
Ubicomホールディングス	1,600	3,110.00	4,976,000
カナミックネットワーク	5,800	777.00	4,506,600
レンゴー	64,400	879.00	56,607,600
トーモク	3,800	1,869.00	7,102,200
ザ・パック	4,700	2,737.00	12,863,900
チェンジ	8,700	3,465.00	30,145,500
シンクロ・フード	11,900	363.00	4,319,700
オークネット	3,300	1,348.00	4,448,400
AOI TYO HOLDINGS	9,400	477.00	4,483,800
マクロミル	12,800	873.00	11,174,400
オロ	2,000	3,950.00	7,900,000
ユーザーローカル	1,000	4,620.00	4,620,000
昭和電工	47,400	2,592.00	122,860,800
住友化学	491,500	522.00	256,563,000
住友精化	3,000	4,020.00	12,060,000
日産化学	34,400	6,240.00	214,656,000
ラサ工業	2,000	2,248.00	4,496,000
クレハ	5,400	7,190.00	38,826,000
多木化学	2,400	6,390.00	15,336,000
テイカ	4,600	1,440.00	6,624,000
石原産業	11,200	821.00	9,195,200
片倉コープアグリ	3,400	1,289.00	4,382,600
日本曹達	8,700	3,385.00	29,449,500
東ソー	96,500	1,989.00	191,938,500
トクヤマ	18,500	2,682.00	49,617,000
セントラル硝子	11,900	2,301.00	27,381,900
東亜合成	38,100	1,243.00	47,358,300
大阪ソーダ	6,300	2,643.00	16,650,900
関東電化工業	14,800	887.00	13,127,600
デンカ	22,800	4,120.00	93,936,000
イビデン	30,700	4,820.00	147,974,000
信越化学工業	115,500	18,740.00	2,164,470,000
日本カーバイド工業	3,300	1,338.00	4,415,400
堺化学工業	4,400	1,976.00	8,694,400
第一稀元素化学工業	6,300	1,046.00	6,589,800
エア・ウォーター	63,700	1,743.00	111,029,100
日本酸素ホールディングス	51,400	2,009.00	103,262,600
日本化学工業	1,800	3,310.00	5,958,000
日本パーカライジング	31,500	1,101.00	34,681,500
高圧ガス工業	9,900	739.00	7,316,100
四国化成工業	8,300	1,261.00	10,466,300
ステラ ケミファ	3,400	3,275.00	11,135,000
保土谷化学工業	1,800	4,930.00	8,874,000
日本触媒	11,300	5,790.00	65,427,000
大日精化工業	5,200	2,404.00	12,500,800
カネカ	16,100	4,275.00	68,827,500

協和キリン	64,100	3,085.00	197,748,500
三菱瓦斯化学	62,500	2,597.00	162,312,500
三井化学	53,900	3,240.00	174,636,000
J S R	62,700	3,390.00	212,553,000
東京応化工業	10,700	6,810.00	72,867,000
大阪有機化学工業	5,800	3,840.00	22,272,000
三菱ケミカルホールディングス	417,400	731.50	305,328,100
K Hネオケム	10,300	2,508.00	25,832,400
ダイセル	83,900	775.00	65,022,500
住友ベークライト	9,800	4,435.00	43,463,000
積水化学工業	132,000	2,021.00	266,772,000
日本ゼオン	56,300	1,654.00	93,120,200
アイカ工業	17,400	3,840.00	66,816,000
宇部興産	31,500	2,141.00	67,441,500
積水樹脂	10,300	2,066.00	21,279,800
タキロンシーアイ	13,500	691.00	9,328,500
旭有機材	3,500	1,473.00	5,155,500
ニチバン	3,300	1,822.00	6,012,600
リケンテクノス	15,200	495.00	7,524,000
大倉工業	2,900	2,000.00	5,800,000
積水化成成品工業	8,400	561.00	4,712,400
群栄化学工業	1,700	2,502.00	4,253,400
タイガースポリマー	10,400	467.00	4,856,800
ダイキョーニシカワ	13,200	799.00	10,546,800
森六ホールディングス	3,400	2,047.00	6,959,800
日本化薬	38,600	1,060.00	40,916,000
カーリットホールディングス	6,200	728.00	4,513,600
E P Sホールディングス	8,200	1,201.00	9,848,200
レグス	2,500	1,685.00	4,212,500
プレステージ・インターナショナル	22,800	764.00	17,419,200
プロトコーポレーション	5,600	1,171.00	6,557,600
ハイマックス	3,400	1,727.00	5,871,800
アミューズ	3,300	2,516.00	8,302,800
野村総合研究所	114,100	3,565.00	406,766,500
ドリームインキュベータ	3,300	1,215.00	4,009,500
サイバネットシステム	4,400	856.00	3,766,400
クイック	3,800	1,194.00	4,537,200
T A C	16,200	276.00	4,471,200
C Eホールディングス	6,600	547.00	3,610,200
ケネディクス	17,500	747.00	13,072,500
電通グループ	68,500	3,670.00	251,395,000
インテージホールディングス	7,800	1,197.00	9,336,600
東邦システムサイエンス	4,500	927.00	4,171,500
ぴあ	1,700	3,325.00	5,652,500
イオンファンタジー	2,300	2,456.00	5,648,800
ソースネクスト	29,700	337.00	10,008,900
シーティーエス	6,900	880.00	6,072,000
ネクシィーズグループ	4,600	1,075.00	4,945,000
インフォコム	5,700	2,808.00	16,005,600
メディカルシステムネットワーク	7,100	732.00	5,197,200
日本精化	4,500	1,417.00	6,376,500
扶桑化学工業	4,900	3,970.00	19,453,000
トリケミカル研究所	5,600	4,250.00	23,800,000
H E R O Z	1,800	3,540.00	6,372,000
ラクスル	5,100	3,810.00	19,431,000
F I G	16,100	269.00	4,330,900
A D E K A	28,700	1,863.00	53,468,100
日油	23,500	5,850.00	137,475,000
ミヨシ油脂	3,600	1,200.00	4,320,000
新日本理化	15,200	279.00	4,240,800

ハリマ化成グループ	4,600	948.00	4,360,800
イーソル	3,400	1,412.00	4,800,800
アルテリア・ネットワークス	6,900	1,567.00	10,812,300
E D U L A B	600	7,210.00	4,326,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,200	2,016.00	4,435,200
トピラシステムズ	3,000	1,608.00	4,824,000
ギフトィ	2,800	4,450.00	12,460,000
花王	152,600	7,270.00	1,109,402,000
第一工業製薬	2,100	3,770.00	7,917,000
日華化学	4,800	888.00	4,262,400
ニイタカ	1,500	2,704.00	4,056,000
三洋化成工業	3,700	5,230.00	19,351,000
武田薬品工業	530,400	3,687.00	1,955,584,800
アステラス製薬	552,700	1,779.00	983,253,300
大日本住友製薬	47,300	1,701.00	80,457,300
塩野義製薬	80,200	5,811.00	466,042,200
わかもと製薬	13,800	245.00	3,381,000
あすか製薬	7,300	1,411.00	10,300,300
日本新薬	18,100	7,810.00	141,361,000
中外製薬	199,400	5,250.00	1,046,850,000
科研製薬	10,900	4,155.00	45,289,500
エーザイ	70,400	7,625.00	536,800,000
理研ビタミン	6,000	1,363.00	8,178,000
ロート製薬	30,400	2,967.00	90,196,800
小野薬品工業	146,400	3,055.00	447,252,000
久光製薬	18,500	7,070.00	130,795,000
有機合成薬品工業	13,200	296.00	3,907,200
持田製薬	8,800	4,145.00	36,476,000
参天製薬	110,900	1,572.00	174,334,800
扶桑薬品工業	2,100	2,654.00	5,573,400
ツムラ	21,300	3,435.00	73,165,500
日医工	18,100	1,106.00	20,018,600
テルモ	195,400	4,278.00	835,921,200
H・U・グループホールディングス	17,000	3,290.00	55,930,000
キッセイ薬品工業	11,300	2,237.00	25,278,100
生化学工業	11,200	1,061.00	11,883,200
栄研化学	11,200	2,142.00	23,990,400
日水製薬	4,200	997.00	4,187,400
鳥居薬品	4,000	3,005.00	12,020,000
J C R ファーマ	18,000	3,270.00	58,860,000
東和薬品	9,200	2,230.00	20,516,000
富士製薬工業	4,300	1,280.00	5,504,000
沢井製薬	14,000	4,895.00	68,530,000
ゼリア新薬工業	11,600	2,024.00	23,478,400
第一三共	547,300	3,261.00	1,784,745,300
キョーリン製薬ホールディングス	14,100	1,931.00	27,227,100
大幸薬品	7,800	1,322.00	10,311,600
ダイト	4,100	3,590.00	14,719,000
大塚ホールディングス	132,500	4,469.00	592,142,500
大正製薬ホールディングス	15,200	6,920.00	105,184,000
ペプチドリーム	32,400	5,420.00	175,608,000
大日本塗料	7,100	924.00	6,560,400
日本ペイントホールディングス	51,500	8,710.00	448,565,000
関西ペイント	70,100	2,917.00	204,481,700
中国塗料	15,000	936.00	14,040,000
日本特殊塗料	4,700	1,154.00	5,423,800
藤倉化成	8,400	525.00	4,410,000
太陽ホールディングス	4,600	5,890.00	27,094,000
D I C	26,400	2,860.00	75,504,000



サカティンクス	13,600	1,103.00	15,000,800
東洋インキSCホールディングス	13,200	2,007.00	26,492,400
T&K TOKA	5,000	828.00	4,140,000
アルプス技研	5,400	2,027.00	10,945,800
日本空調サービス	6,400	736.00	4,710,400
オリエンタルランド	64,800	18,040.00	1,168,992,000
フォーカスシステムズ	4,300	933.00	4,011,900
ダスキン	14,100	2,802.00	39,508,200
パーク24	33,700	2,234.00	75,285,800
明光ネットワークジャパン	7,700	569.00	4,381,300
ファルコホールディングス	2,900	1,616.00	4,686,400
クレスコ	4,300	1,386.00	5,959,800
フジ・メディア・ホールディングス	64,900	1,320.00	85,668,000
秀英予備校	9,800	427.00	4,184,600
ラウンドワン	20,800	1,110.00	23,088,000
リゾートトラスト	27,900	1,747.00	48,741,300
オービック	19,700	19,350.00	381,195,000
ジャストシステム	8,900	6,970.00	62,033,000
TDCソフト	5,500	949.00	5,219,500
Zホールディングス	859,300	661.00	567,997,300
ピー・エム・エル	7,800	3,650.00	28,470,000
トレンドマイクロ	33,400	5,640.00	188,376,000
りらいあコミュニケーションズ	9,300	1,396.00	12,982,800
IDホールディングス	3,400	1,218.00	4,141,200
リソー教育	30,900	334.00	10,320,600
日本オラクル	12,700	11,930.00	151,511,000
早稲田アカデミー	4,300	997.00	4,287,100
アルファシステムズ	1,700	3,600.00	6,120,000
フューチャー	7,500	1,900.00	14,250,000
CAC Holdings	4,100	1,437.00	5,891,700
SBテクノロジー	2,200	3,000.00	6,600,000
トーセ	5,200	814.00	4,232,800
ユー・エス・エス	68,200	2,100.00	143,220,000
オービックビジネスコンサルタント	6,400	6,340.00	40,576,000
伊藤忠テクノソリューションズ	28,500	3,435.00	97,897,500
アイティフォー	8,200	863.00	7,076,600
東京個別指導学院	6,000	675.00	4,050,000
東計電算	1,000	4,285.00	4,285,000
サイバーエージェント	37,500	6,990.00	262,125,000
楽天	283,900	1,145.00	325,065,500
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,294.00	4,529,000
テー・オー・ダブリュー	15,100	304.00	4,590,400
大塚商会	33,800	5,140.00	173,732,000
サイボウズ	7,300	2,497.00	18,228,100
山田コンサルティンググループ	4,300	1,004.00	4,317,200
セントラルスポーツ	2,300	2,429.00	5,586,700
電通国際情報サービス	7,700	3,830.00	29,491,000
ACCESS	5,900	835.00	4,926,500
デジタルガレージ	10,300	4,445.00	45,783,500
イーエムシステムズ	10,300	856.00	8,816,800
ウェザーニューズ	1,900	5,300.00	10,070,000
CIJ	4,700	872.00	4,098,400
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,230.00	4,199,000
日本エンタープライズ	17,200	255.00	4,386,000
WOWOW	3,000	2,872.00	8,616,000
スカラ	5,600	723.00	4,048,800
フルキャストホールディングス	5,300	1,980.00	10,494,000
エン・ジャパン	10,800	3,370.00	36,396,000
富士フイルムホールディングス	112,000	6,333.00	709,296,000
コニカミノルタ	129,300	550.00	71,115,000

資生堂	126,700	8,150.00	1,032,605,000
ライオン	82,900	2,175.00	180,307,500
高砂香料工業	4,000	2,609.00	10,436,000
マンダム	13,400	1,870.00	25,058,000
ミルボン	8,500	6,400.00	54,400,000
ファンケル	23,200	4,080.00	94,656,000
コーセー	12,000	18,100.00	217,200,000
コタ	3,700	1,828.00	6,763,600
シーボン	2,100	1,995.00	4,189,500
ポーラ・オルビスホールディングス	27,200	2,476.00	67,347,200
ノエビアホールディングス	5,400	4,865.00	26,271,000
アジュバンコスメジャパン	4,000	1,099.00	4,396,000
エステー	4,100	1,973.00	8,089,300
アグロ カネショウ	2,700	1,623.00	4,382,100
コニシ	10,500	1,678.00	17,619,000
長谷川香料	11,000	1,951.00	21,461,000
星光PMC	5,400	773.00	4,174,200
小林製薬	17,900	10,990.00	196,721,000
荒川化学工業	5,300	1,295.00	6,863,500
メック	4,400	2,073.00	9,121,200
日本高純度化学	1,800	2,688.00	4,838,400
タカラバイオ	16,700	3,085.00	51,519,500
JCU	7,200	3,410.00	24,552,000
新田ゼラチン	6,200	680.00	4,216,000
OATアグリオ	3,200	1,384.00	4,428,800
デクセリアルズ	17,800	1,538.00	27,376,400
アース製薬	4,800	6,070.00	29,136,000
北興化学工業	5,900	1,046.00	6,171,400
大成ラミック	2,000	2,935.00	5,870,000
クミアイ化学工業	26,400	882.00	23,284,800
日本農薬	11,400	530.00	6,042,000
ニチレキ	7,500	1,538.00	11,535,000
ユシロ化学工業	3,800	1,085.00	4,123,000
富士石油	18,700	211.00	3,945,700
MORESCO	3,700	1,150.00	4,255,000
出光興産	70,800	2,742.00	194,133,600
ENEOSホールディングス	959,000	462.90	443,921,100
コスモエネルギーホールディングス	20,200	2,485.00	50,197,000
横浜ゴム	36,900	1,961.00	72,360,900
TOYO TIRE	33,600	1,906.00	64,041,600
ブリヂストン	169,500	4,199.00	711,730,500
住友ゴム工業	57,300	1,194.00	68,416,200
オカモト	3,900	4,115.00	16,048,500
アキレス	4,400	1,487.00	6,542,800
フコク	5,900	711.00	4,194,900
ニッタ	6,600	2,396.00	15,813,600
住友理工	12,400	641.00	7,948,400
三ツ星ベルト	7,700	1,726.00	13,290,200
バンドー化学	11,200	737.00	8,254,400
AGC	58,500	3,905.00	228,442,500
日本板硝子	32,300	552.00	17,829,600
有沢製作所	8,900	982.00	8,739,800
日本山村硝子	4,800	918.00	4,406,400
日本電気硝子	23,600	2,502.00	59,047,200
オハラ	2,500	2,052.00	5,130,000
住友大阪セメント	11,500	3,560.00	40,940,000
太平洋セメント	37,700	2,748.00	103,599,600
日本ヒューム	5,800	769.00	4,460,200
日本コンクリート工業	13,700	386.00	5,288,200
三谷セキサン	3,000	4,820.00	14,460,000

アジアパイルホールディングス	9,800	530.00	5,194,000
東海カーボン	62,300	1,515.00	94,384,500
日本カーボン	3,500	4,095.00	14,332,500
東洋炭素	3,700	1,987.00	7,351,900
ノリタケカンパニーリミテド	3,500	3,615.00	12,652,500
TOTO	45,500	6,850.00	311,675,000
日本碍子	70,100	1,881.00	131,858,100
日本特殊陶業	48,500	1,868.00	90,598,000
MARUWA	2,200	10,570.00	23,254,000
品川リフラクトリーズ	1,600	2,762.00	4,419,200
黒崎播磨	1,100	4,825.00	5,307,500
ヨータイ	4,900	1,038.00	5,086,200
イソライト工業	7,200	649.00	4,672,800
ニッカトー	5,200	717.00	3,728,400
フジインコーポレーテッド	5,100	4,225.00	21,547,500
クニミネ工業	3,300	1,211.00	3,996,300
ニチアス	16,100	2,486.00	40,024,600
日本製鉄	300,900	1,551.50	466,846,350
神戸製鋼所	115,400	636.00	73,394,400
中山製鋼所	11,600	401.00	4,651,600
合同製鐵	3,400	2,080.00	7,072,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	182,400	1,113.00	203,011,200
東京製鐵	24,600	722.00	17,761,200
共英製鋼	7,100	1,432.00	10,167,200
大和工業	13,400	2,712.00	36,340,800
東京鐵鋼	2,400	2,007.00	4,816,800
大阪製鐵	3,300	1,256.00	4,144,800
淀川製鋼所	8,500	2,303.00	19,575,500
丸一鋼管	20,500	2,502.00	51,291,000
モリ工業	1,900	2,333.00	4,432,700
大同特殊鋼	10,300	4,695.00	48,358,500
日本高周波鋼業	12,000	364.00	4,368,000
日本冶金工業	4,900	2,119.00	10,383,100
山陽特殊製鋼	7,600	1,749.00	13,292,400
愛知製鋼	3,500	3,275.00	11,462,500
日立金属	59,400	1,722.00	102,286,800
大平洋金属	4,300	2,500.00	10,750,000
新日本電工	40,700	298.00	12,128,600
栗本鐵工所	2,900	1,765.00	5,118,500
日本製鋼所	19,100	2,887.00	55,141,700
三菱製鋼	2,000	764.00	1,528,000
日亜鋼業	14,100	294.00	4,145,400
日本精線	1,100	3,655.00	4,020,500
大紀アルミニウム工業所	9,500	802.00	7,619,000
日本軽金属ホールディングス	17,200	2,167.00	37,272,400
三井金属鉱業	17,000	3,885.00	66,045,000
東邦亜鉛	3,500	2,415.00	8,452,500
三菱マテリアル	41,600	2,598.00	108,076,800
住友金属鉱山	80,600	5,578.00	449,586,800
DOWAホールディングス	15,900	4,175.00	66,382,500
古河機械金属	10,400	1,352.00	14,060,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,600	818.00	5,398,800
東邦チタニウム	11,300	981.00	11,085,300
UACJ	9,600	2,507.00	24,067,200
CKサンエツ	1,300	3,955.00	5,141,500
古河電気工業	19,600	2,871.00	56,271,600
住友電気工業	220,000	1,549.50	340,890,000
フジクラ	76,100	525.00	39,952,500
昭和電線ホールディングス	6,100	1,753.00	10,693,300
東京特殊電線	1,700	2,596.00	4,413,200

タツタ電線	11,100	651.00	7,226,100
平河ビューテック	3,500	1,189.00	4,161,500
リョービ	7,800	1,306.00	10,186,800
アーレスティ	10,600	405.00	4,293,000
アサヒホールディングス	11,800	4,315.00	50,917,000
東洋製罐グループホールディングス	40,100	1,361.00	54,576,100
ホッカホホールディングス	3,200	1,430.00	4,576,000
コロナ	4,400	951.00	4,184,400
横河ブリッジホールディングス	10,800	1,912.00	20,649,600
OSJBホールディングス	29,100	273.00	7,944,300
三和ホールディングス	59,400	1,315.00	78,111,000
文化シャッター	18,600	1,000.00	18,600,000
三協立山	8,100	828.00	6,706,800
アルインコ	4,400	974.00	4,285,600
LIXIL	86,800	3,025.00	262,570,000
日本フィルコン	8,300	500.00	4,150,000
ノーリツ	13,100	1,675.00	21,942,500
長府製作所	6,400	2,108.00	13,491,200
リンナイ	12,300	11,460.00	140,958,000
ユニプレス	10,400	962.00	10,004,800
ダイニチ工業	4,600	852.00	3,919,200
日東精工	9,000	667.00	6,003,000
三洋工業	2,200	1,852.00	4,074,400
岡部	12,800	789.00	10,099,200
ジーテクト	7,800	1,448.00	11,294,400
東プレ	11,800	1,586.00	18,714,800
高周波熱錬	12,100	540.00	6,534,000
東京製綱	4,500	1,445.00	6,502,500
サンコール	6,800	487.00	3,311,600
モリテックスチール	9,700	420.00	4,074,000
パイオラックス	9,300	1,594.00	14,824,200
エイチワン	6,200	772.00	4,786,400
日本発条	62,800	812.00	50,993,600
三浦工業	27,300	6,140.00	167,622,000
タクマ	21,400	2,023.00	43,292,200
テクノプロ・ホールディングス	12,200	8,100.00	98,820,000
インターワークス	11,400	381.00	4,343,400
アイ・アールジャパンホールディングス	2,500	13,980.00	34,950,000
Keeper 技研	3,900	1,954.00	7,620,600
三機サービス	4,100	1,010.00	4,141,000
Gunosy	5,400	808.00	4,363,200
イー・ガーディアン	2,700	3,210.00	8,667,000
リブセンス	17,400	234.00	4,071,600
ジャパンマテリアル	18,700	1,464.00	27,376,800
ベクトル	7,600	1,198.00	9,104,800
ウチヤマホールディングス	12,200	365.00	4,453,000
チャーム・ケア・コーポレーション	4,500	1,427.00	6,421,500
キャリアリンク	2,000	2,767.00	5,534,000
IBJ	5,000	1,024.00	5,120,000
アサンテ	2,600	1,733.00	4,505,800
N・フィールド	5,000	1,197.00	5,985,000
バリューHR	2,400	1,995.00	4,788,000
M&Aキャピタルパートナーズ	5,000	4,890.00	24,450,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,300	1,721.00	3,958,300
ERIホールディングス	6,700	618.00	4,140,600
アビスト	1,400	2,972.00	4,160,800
シグマクス	3,300	1,780.00	5,874,000
ウィルグループ	4,500	981.00	4,414,500
メドピア	2,900	6,150.00	17,835,000

リクルートホールディングス	436,400	5,475.00	2,389,290,000
エラン	8,400	1,400.00	11,760,000
ツガミ	13,100	1,635.00	21,418,500
オークマ	7,300	5,970.00	43,581,000
芝浦機械	6,500	2,956.00	19,214,000
アマダ	92,400	1,289.00	119,103,600
アイダエンジニアリング	16,500	957.00	15,790,500
滝澤鉄工所	4,100	1,059.00	4,341,900
F U J I	25,200	2,667.00	67,208,400
牧野フライス製作所	7,400	4,025.00	29,785,000
オーエスジー	31,100	1,973.00	61,360,300
ダイジェット工業	3,100	1,382.00	4,284,200
旭ダイヤモンド工業	16,500	510.00	8,415,000
D M G 森精機	39,900	1,599.00	63,800,100
ソディック	13,700	991.00	13,576,700
ディスコ	8,600	35,500.00	305,300,000
日東工器	3,000	1,858.00	5,574,000
日進工具	2,500	2,746.00	6,865,000
日本郵政	460,900	900.00	414,810,000
ベルシステム24ホールディングス	10,200	1,847.00	18,839,400
鎌倉新書	6,100	903.00	5,508,300
S M N	5,100	752.00	3,835,200
一蔵	12,100	395.00	4,779,500
L I T A L I C O	2,500	3,825.00	9,562,500
エアトリ	3,300	1,995.00	6,583,500
アトラエ	1,900	3,270.00	6,213,000
ストライク	2,300	4,715.00	10,844,500
ソラスト	14,900	1,495.00	22,275,500
セラク	2,300	1,782.00	4,098,600
インソース	5,100	2,249.00	11,469,900
豊田自動織機	51,600	9,520.00	491,232,000
豊和工業	4,800	858.00	4,118,400
東洋機械金属	9,100	458.00	4,167,800
エンシュウ	4,800	880.00	4,224,000
島精機製作所	9,200	2,304.00	21,196,800
オプトラン	7,900	2,775.00	21,922,500
N C ホールディングス	7,100	661.00	4,693,100
イワキ	5,100	836.00	4,263,600
フリーー	6,200	1,120.00	6,944,000
ヤマシンフィルタ	12,700	890.00	11,303,000
日阪製作所	7,800	841.00	6,559,800
やまびこ	12,200	1,177.00	14,359,400
平田機工	3,000	7,280.00	21,840,000
ペガサスミシン製造	12,000	460.00	5,520,000
マルマエ	1,500	1,304.00	1,956,000
タツモ	2,700	1,644.00	4,438,800
ナブテスコ	37,100	4,860.00	180,306,000
三井海洋開発	6,700	1,752.00	11,738,400
レオン自動機	6,200	1,135.00	7,037,000
S M C	18,700	65,860.00	1,231,582,000
ホソカワミクロン	2,200	6,550.00	14,410,000
ユニオンツール	2,300	3,480.00	8,004,000
オイレス工業	8,800	1,697.00	14,933,600
日精エー・エス・ピー機械	1,800	5,630.00	10,134,000
サトーホールディングス	8,300	2,497.00	20,725,100
技研製作所	5,600	5,190.00	29,064,000
カワタ	4,300	905.00	3,891,500
日精樹脂工業	4,800	921.00	4,420,800
オカダアイヨン	3,600	1,190.00	4,284,000
小松製作所	288,800	3,253.00	939,466,400

住友重機械工業	36,500	2,901.00	105,886,500
日立建機	29,800	3,325.00	99,085,000
日工	9,500	727.00	6,906,500
巴工業	2,500	2,054.00	5,135,000
井関農機	6,400	1,541.00	9,862,400
TOWA	5,900	2,179.00	12,856,100
丸山製作所	2,600	1,648.00	4,284,800
北川鉄工所	3,100	1,478.00	4,581,800
シンニッタ	20,600	219.00	4,511,400
ローツェ	2,800	8,110.00	22,708,000
タカキタ	6,000	685.00	4,110,000
クボタ	334,900	2,471.50	827,705,350
荏原実業	1,600	4,650.00	7,440,000
三菱化工機	2,000	2,966.00	5,932,000
月島機械	11,700	1,293.00	15,128,100
帝国電機製作所	4,400	1,210.00	5,324,000
新東工業	15,100	759.00	11,460,900
澁谷工業	5,600	3,530.00	19,768,000
アイチコーポレーション	11,000	897.00	9,867,000
小森コーポレーション	16,200	721.00	11,680,200
鶴見製作所	4,900	1,727.00	8,462,300
荏原製作所	26,400	4,110.00	108,504,000
石井鐵工所	1,500	2,938.00	4,407,000
西島製作所	6,400	836.00	5,350,400
北越工業	6,600	1,118.00	7,378,800
ダイキン工業	81,200	22,100.00	1,794,520,000
オルガノ	2,100	6,190.00	12,999,000
トーヨーカネツ	2,400	2,777.00	6,664,800
栗田工業	34,500	4,430.00	152,835,000
椿本チエイン	9,100	2,941.00	26,763,100
大同工業	5,800	775.00	4,495,000
日機装	20,600	1,075.00	22,145,000
レイズネクスト	10,700	1,177.00	12,593,900
アネスト岩田	10,700	1,087.00	11,630,900
ダイフク	35,100	11,310.00	396,981,000
サムコ	1,600	3,695.00	5,912,000
加藤製作所	4,400	1,002.00	4,408,800
タダノ	30,800	1,013.00	31,200,400
フジテック	21,900	2,536.00	55,538,400
C K D	14,800	2,475.00	36,630,000
キトー	5,400	1,472.00	7,948,800
平和	17,800	1,601.00	28,497,800
理想科学工業	4,900	1,365.00	6,688,500
SANKYO	15,200	2,954.00	44,900,800
日本金銭機械	8,000	553.00	4,424,000
マースグループホールディングス	4,000	1,595.00	6,380,000
フクシマガリレイ	4,400	4,195.00	18,458,000
ダイコク電機	4,700	944.00	4,436,800
竹内製作所	10,700	2,779.00	29,735,300
アマノ	16,700	2,418.00	40,380,600
JUKI	8,900	830.00	7,387,000
蛇の目ミシン工業	5,800	813.00	4,715,400
ブラザー工業	77,800	2,262.00	175,983,600
マックス	8,800	1,614.00	14,203,200
モリタホールディングス	10,200	1,813.00	18,492,600
グローリー	16,400	2,290.00	37,556,000
新晃工業	5,900	1,975.00	11,652,500
大和冷機工業	10,200	1,085.00	11,067,000
セガサミーホールディングス	58,000	1,832.00	106,256,000
日本ピストンリング	4,400	1,040.00	4,576,000

リケン	3,000	2,249.00	6,747,000
T P R	8,600	1,523.00	13,097,800
ツバキ・ナカシマ	12,200	1,274.00	15,542,800
ホシザキ	20,100	9,650.00	193,965,000
日本精工	130,900	1,014.00	132,732,600
N T N	147,500	315.00	46,462,500
ジェイテクト	61,100	1,146.00	70,020,600
不二越	5,900	4,685.00	27,641,500
ミネベアミツミ	109,900	2,670.00	293,433,000
日本トムソン	17,500	569.00	9,957,500
T H K	39,700	3,640.00	144,508,000
ユーシン精機	4,400	945.00	4,158,000
前澤給装工業	2,300	2,233.00	5,135,900
イーグル工業	7,900	1,153.00	9,108,700
日本ピラー工業	6,400	1,723.00	11,027,200
キッツ	19,700	582.00	11,465,400
日立製作所	306,500	4,934.00	1,512,271,000
三菱電機	637,500	1,601.50	1,020,956,250
富士電機	38,400	4,665.00	179,136,000
東洋電機製造	3,500	1,210.00	4,235,000
安川電機	68,600	5,670.00	388,962,000
シンフォニア テクノロジー	8,300	1,339.00	11,113,700
明電舎	10,800	2,372.00	25,617,600
オリジン	3,200	1,373.00	4,393,600
山洋電気	3,100	6,040.00	18,724,000
デンヨー	5,400	2,117.00	11,431,800
ベイクレント・コンサルティング	4,000	21,270.00	85,080,000
M S - J a p a n	3,400	1,146.00	3,896,400
グレイステクノロジー	3,100	5,760.00	17,856,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	17,500	2,241.00	39,217,500
グリーンズ	9,100	573.00	5,214,300
ミダック	1,300	4,480.00	5,824,000
日総工業	5,200	837.00	4,352,400
キュービーネットホールディングス	3,000	1,734.00	5,202,000
R P Aホールディングス	7,000	639.00	4,473,000
三櫻工業	8,800	940.00	8,272,000
マキタ	83,100	4,695.00	390,154,500
東芝テック	6,800	3,860.00	26,248,000
芝浦メカトロニクス	1,100	5,070.00	5,577,000
マブチモーター	17,600	4,885.00	85,976,000
日本電産	153,400	14,650.00	2,247,310,000
トレックス・セミコンダクター	3,400	1,609.00	5,470,600
東光高岳	3,200	1,560.00	4,992,000
ダブル・スコープ	12,600	792.00	9,979,200
ダイヘン	7,000	4,680.00	32,760,000
ヤーマン	10,400	1,935.00	20,124,000
J V Cケンウッド	55,200	193.00	10,653,600
ミマキエンジニアリング	8,700	569.00	4,950,300
I - P E X	3,000	2,024.00	6,072,000
日新電機	14,900	1,270.00	18,923,000
大崎電気工業	12,700	609.00	7,734,300
オムロン	53,100	9,420.00	500,202,000
日東工業	9,400	2,094.00	19,683,600
I D E C	8,500	1,881.00	15,988,500
不二電機工業	3,200	1,271.00	4,067,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	22,900	3,370.00	77,173,000
サクサホールディングス	3,000	1,495.00	4,485,000
メルコホールディングス	2,200	3,910.00	8,602,000
日本電気	81,000	6,290.00	509,490,000

富士通	57,400	15,905.00	912,947,000
沖電気工業	25,900	1,050.00	27,195,000
電気興業	3,100	2,943.00	9,123,300
サンケン電気	7,500	5,580.00	41,850,000
アイホン	3,600	1,753.00	6,310,800
ルネサスエレクトロニクス	274,200	1,255.00	344,121,000
セイコーエプソン	79,100	1,768.00	139,848,800
ワコム	46,100	796.00	36,695,600
アルバック	11,700	5,110.00	59,787,000
E I Z O	5,400	3,830.00	20,682,000
ジャパンディスプレイ	217,700	48.00	10,449,600
日本信号	14,900	957.00	14,259,300
京三製作所	13,700	426.00	5,836,200
能美防災	8,400	2,256.00	18,950,400
ホーチキ	4,600	1,294.00	5,952,400
エレコム	7,300	4,980.00	36,354,000
パナソニック	679,800	1,441.50	979,931,700
シャープ	73,800	2,140.00	157,932,000
アンリツ	38,300	2,380.00	91,154,000
富士通ゼネラル	19,500	2,986.00	58,227,000
ソニー	399,300	11,980.00	4,783,614,000
T D K	30,800	16,260.00	500,808,000
帝国通信工業	3,700	1,143.00	4,229,100
タムラ製作所	22,900	556.00	12,732,400
アルプスアルパイン	52,100	1,437.00	74,867,700
池上通信機	4,900	833.00	4,081,700
日本電波工業	6,200	694.00	4,302,800
日本トリム	1,400	4,390.00	6,146,000
ローランド ディー・ジー・	3,800	1,909.00	7,254,200
フォスター電機	6,700	1,307.00	8,756,900
S M K	1,600	3,015.00	4,824,000
ヨコオ	4,700	2,997.00	14,085,900
ホシデン	17,400	1,087.00	18,913,800
ヒロセ電機	9,800	16,780.00	164,444,000
日本航空電子工業	14,600	1,696.00	24,761,600
T O A	7,500	903.00	6,772,500
マクセルホールディングス	12,700	1,444.00	18,338,800
古野電気	8,200	1,144.00	9,380,800
ユニデンホールディングス	2,000	2,356.00	4,712,000
スミダコーポレーション	5,400	1,027.00	5,545,800
アイコム	2,600	2,780.00	7,228,000
リオン	2,700	2,935.00	7,924,500
横河電機	63,800	2,143.00	136,723,400
新電元工業	2,500	3,160.00	7,900,000
アズビル	43,100	5,010.00	215,931,000
東亜ディーケーケー	4,900	832.00	4,076,800
日本光電工業	26,300	3,020.00	79,426,000
共和電業	10,900	385.00	4,196,500
日本電子材料	2,300	1,903.00	4,376,900
堀場製作所	12,600	6,740.00	84,924,000
アドバンテスト	47,400	9,670.00	458,358,000
小野測器	7,800	545.00	4,251,000
エスベック	5,600	1,927.00	10,791,200
キーエンス	62,600	56,750.00	3,552,550,000
日置電機	3,100	3,810.00	11,811,000
シスメックス	49,700	11,760.00	584,472,000
日本マイクロニクス	11,100	1,888.00	20,956,800
メガチップス	6,400	3,445.00	22,048,000
O B A R A G R O U P	3,700	3,970.00	14,689,000
I M A G I C A G R O U P	10,700	513.00	5,489,100



澤藤電機	1,000	2,319.00	2,319,000
デンソー	140,400	6,672.00	936,748,800
原田工業	4,900	914.00	4,478,600
コーセル	7,800	1,164.00	9,079,200
イリソ電子工業	5,400	5,040.00	27,216,000
オブテックスグループ	10,500	1,762.00	18,501,000
千代田インテグレ	2,700	1,800.00	4,860,000
レーザーテック	28,000	14,580.00	408,240,000
スタンレー電気	44,700	3,440.00	153,768,000
岩崎電気	3,000	1,521.00	4,563,000
ウシオ電機	32,700	1,377.00	45,027,900
岡谷電機産業	11,600	375.00	4,350,000
エノモト	2,600	1,868.00	4,856,800
日本セラミック	6,500	2,740.00	17,810,000
遠藤照明	7,800	647.00	5,046,600
古河電池	4,500	1,588.00	7,146,000
双信電機	9,100	447.00	4,067,700
山一電機	4,200	1,480.00	6,216,000
図研	4,100	2,950.00	12,095,000
日本電子	11,600	4,315.00	50,054,000
カシオ計算機	51,300	2,055.00	105,421,500
ファナック	55,900	27,585.00	1,542,001,500
日本シイエムケイ	13,700	437.00	5,986,900
エンプラス	2,900	4,645.00	13,470,500
大真空	2,100	2,680.00	5,628,000
ローム	26,500	11,470.00	303,955,000
浜松ホトニクス	45,700	6,820.00	311,674,000
三井ハイテック	6,200	4,535.00	28,117,000
新光電気工業	21,400	3,035.00	64,949,000
京セラ	97,200	6,944.00	674,956,800
協栄産業	3,100	1,386.00	4,296,600
太陽誘電	28,300	5,840.00	165,272,000
村田製作所	187,300	9,882.00	1,850,898,600
双葉電子工業	10,900	968.00	10,551,200
日東電工	40,800	9,430.00	384,744,000
北陸電気工業	4,500	937.00	4,216,500
東海理化電機製作所	16,800	1,806.00	30,340,800
ニチコン	20,100	1,147.00	23,054,700
日本ケミコン	6,400	1,847.00	11,820,800
K O A	8,800	1,520.00	13,376,000
三井E & Sホールディングス	24,700	441.00	10,892,700
日立造船	50,500	707.00	35,703,500
三菱重工業	100,200	3,055.00	306,111,000
川崎重工業	49,600	2,307.00	114,427,200
I H I	42,900	1,899.00	81,467,100
スプリックス	5,200	839.00	4,362,800
マネジメントソリューションズ	3,000	1,990.00	5,970,000
プロレド・パートナーズ	1,100	3,520.00	3,872,000
and factory	5,500	845.00	4,647,500
カーブスホールディングス	16,700	972.00	16,232,400
日本車輛製造	2,300	2,491.00	5,729,300
三菱ロジスネクスト	8,400	1,154.00	9,693,600
近畿車輛	3,400	1,254.00	4,263,600
F P G	19,400	614.00	11,911,600
島根銀行	6,200	679.00	4,209,800
じもとホールディングス	5,200	797.00	4,144,400
全国保証	16,400	5,160.00	84,624,000
めぶきフィナンシャルグループ	326,700	234.00	76,447,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,700	1,313.00	4,858,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	1,231.00	9,724,900

九州フィナンシャルグループ	128,400	451.00	57,908,400
かんぽ生命保険	77,900	2,172.00	169,198,800
ゆうちょ銀行	178,100	1,006.00	179,168,600
富山第一銀行	15,000	297.00	4,455,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	383,000	426.00	163,158,000
西日本フィナンシャルホールディングス	41,800	710.00	29,678,000
イントラスト	5,100	721.00	3,677,100
アルヒ	9,300	1,641.00	15,261,300
プレミアグループ	2,900	2,432.00	7,052,800
日産自動車	751,800	587.20	441,456,960
いすゞ自動車	184,700	1,124.00	207,602,800
トヨタ自動車	645,800	8,060.00	5,205,148,000
日野自動車	79,600	1,017.00	80,953,200
三菱自動車工業	236,000	293.00	69,148,000
エフテック	6,800	667.00	4,535,600
武蔵精密工業	14,200	1,897.00	26,937,400
日産車体	9,300	808.00	7,514,400
新明和工業	18,000	961.00	17,298,000
極東開発工業	11,000	1,605.00	17,655,000
トピー工業	5,200	1,448.00	7,529,600
ティラド	3,100	1,849.00	5,731,900
曙ブレーキ工業	35,000	164.00	5,740,000
タチエス	9,800	1,101.00	10,789,800
NOK	30,800	1,473.00	45,368,400
フタバ産業	16,000	540.00	8,640,000
KYB	7,100	3,010.00	21,371,000
市光工業	9,500	763.00	7,248,500
大同メタル工業	13,200	558.00	7,365,600
プレス工業	31,600	332.00	10,491,200
ミクニ	15,400	287.00	4,419,800
太平洋工業	13,300	1,214.00	16,146,200
河西工業	9,100	418.00	3,803,800
アイシン精機	46,700	3,640.00	169,988,000
マツダ	200,100	859.00	171,885,900
今仙電機製作所	5,700	770.00	4,389,000
本田技研工業	501,900	2,977.50	1,494,407,250
スズキ	126,400	4,918.00	621,635,200
SUBARU	182,700	2,035.00	371,794,500
ヤマハ発動機	90,100	2,410.00	217,141,000
小糸製作所	38,200	7,750.00	296,050,000
TBK	9,300	438.00	4,073,400
エクセディ	8,700	1,645.00	14,311,500
ミツバ	11,700	624.00	7,300,800
豊田合成	20,600	2,856.00	58,833,600
愛三工業	10,000	578.00	5,780,000
ヨロズ	5,500	1,309.00	7,199,500
エフ・シー・シー	10,400	1,743.00	18,127,200
シマノ	23,900	25,405.00	607,179,500
テイ・エス テック	14,800	3,050.00	45,140,000
関西みらいフィナンシャルグループ	29,500	611.00	18,024,500
三十三フィナンシャルグループ	5,400	1,369.00	7,392,600
第四北越フィナンシャルグループ	10,200	2,334.00	23,806,800
ひろぎんホールディングス	92,700	650.00	60,255,000
ダイレクトマーケティングミックス	2,400	3,315.00	7,956,000
ジャムコ	6,200	888.00	5,505,600
小野建	5,600	1,323.00	7,408,800
ノジマ	11,200	2,911.00	32,603,200
佐島電機	5,300	807.00	4,277,100
カップ・クリエイト	8,800	1,511.00	13,296,800

伯東	3,800	1,282.00	4,871,600
コンドーテック	4,900	1,068.00	5,233,200
中山福	7,600	517.00	3,929,200
ライトオン	6,800	634.00	4,311,200
ナガイレーベン	8,300	2,785.00	23,115,500
三菱食品	6,900	2,962.00	20,437,800
良品計画	83,400	2,515.00	209,751,000
松田産業	4,600	1,941.00	8,928,600
第一興商	9,300	4,115.00	38,269,500
メディバルホールディングス	62,900	2,236.00	140,644,400
アドヴァン	6,400	1,119.00	7,161,600
S P K	3,300	1,268.00	4,184,400
萩原電気ホールディングス	2,300	2,585.00	5,945,500
アルビス	2,000	2,456.00	4,912,000
アズワン	4,500	14,760.00	66,420,000
スズデン	3,400	1,268.00	4,311,200
シモジマ	3,800	1,399.00	5,316,200
ドウシシャ	5,900	1,832.00	10,808,800
小津産業	2,200	1,919.00	4,221,800
コナカ	13,800	364.00	5,023,200
高速	3,300	1,544.00	5,095,200
G - 7ホールディングス	3,700	2,315.00	8,565,500
イオン北海道	8,300	1,154.00	9,578,200
コジマ	10,800	645.00	6,966,000
ヒマラヤ	4,200	973.00	4,086,600
コーナン商事	8,900	3,015.00	26,833,500
ネットワンシステムズ	25,500	3,300.00	84,150,000
エコス	2,300	1,955.00	4,496,500
ワタミ	8,300	1,007.00	8,358,100
マルシェ	8,500	515.00	4,377,500
システムソフト	44,500	135.00	6,007,500
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	125,500	2,550.00	320,025,000
丸文	7,500	529.00	3,967,500
西松屋チェーン	13,800	1,542.00	21,279,600
ゼンショーホールディングス	33,700	2,885.00	97,224,500
ハピネット	5,200	1,535.00	7,982,000
幸楽苑ホールディングス	4,000	1,799.00	7,196,000
橋本総業ホールディングス	1,600	2,597.00	4,155,200
日本ライフライン	20,300	1,320.00	26,796,000
サイゼリヤ	9,300	2,195.00	20,413,500
V Tホールディングス	23,600	424.00	10,006,400
マルカ	2,200	2,017.00	4,437,400
アルゴグラフィックス	4,900	3,050.00	14,945,000
I D O M	21,200	634.00	13,440,800
日本エム・ディ・エム	3,700	2,006.00	7,422,200
ユナイテッドアローズ	7,200	2,032.00	14,630,400
進和	3,700	2,147.00	7,943,900
ダイترون	2,600	1,567.00	4,074,200
ハイデイ日高	9,100	1,802.00	16,398,200
シークス	8,000	1,756.00	14,048,000
京都きもの友禅	19,200	251.00	4,819,200
コロワイド	20,900	1,994.00	41,674,600
ピーシーデポコーポレーション	7,400	532.00	3,936,800
田中商事	6,000	702.00	4,212,000
オーハシテクニカ	3,200	1,445.00	4,624,000
壱番屋	4,400	4,990.00	21,956,000
白銅	3,000	1,393.00	4,179,000
スギホールディングス	12,500	7,450.00	93,125,000
ダイコー通産	2,600	1,518.00	3,946,800

薬王堂ホールディングス	2,700	2,716.00	7,333,200
島津製作所	82,000	4,365.00	357,930,000
JMS	5,400	983.00	5,308,200
長野計器	4,600	1,006.00	4,627,600
バイ・テクノロジー	3,000	5,940.00	17,820,000
スター精密	9,800	1,618.00	15,856,400
東京計器	4,400	927.00	4,078,800
愛知時計電機	1,000	4,395.00	4,395,000
インターアクション	3,200	2,691.00	8,611,200
オーバル	4,400	305.00	1,342,000
東京精密	10,700	5,130.00	54,891,000
マニー	25,400	2,695.00	68,453,000
ニコン	97,300	919.00	89,418,700
トプコン	32,100	1,270.00	40,767,000
オリンパス	352,700	2,240.50	790,224,350
理研計器	5,600	2,791.00	15,629,600
SCREENホールディングス	11,100	9,370.00	104,007,000
キヤノン電子	5,800	1,692.00	9,813,600
タムロン	5,100	1,969.00	10,041,900
HOYA	126,500	13,060.00	1,652,090,000
ノーリツ鋼機	5,700	2,385.00	13,594,500
エー・アンド・デイ	5,400	1,223.00	6,604,200
朝日インテック	67,100	3,280.00	220,088,000
キヤノン	316,800	2,338.50	740,836,800
リコー	162,200	948.00	153,765,600
シチズン時計	80,900	388.00	31,389,200
リズム	6,000	790.00	4,740,000
大研医器	7,300	573.00	4,182,900
メニコン	9,800	6,810.00	66,738,000
スノーピーク	3,800	3,170.00	12,046,000
パラマウントベッドホールディングス	6,100	4,540.00	27,694,000
粧美堂	10,500	404.00	4,242,000
ニホンフラッシュ	5,500	1,226.00	6,743,000
前田工織	7,000	2,966.00	20,762,000
永大産業	14,600	302.00	4,409,200
アートネイチャー	6,500	670.00	4,355,000
バンダイナムコホールディングス	52,700	8,744.00	460,808,800
共立印刷	34,000	126.00	4,284,000
SHOEI	5,600	4,260.00	23,856,000
フランスベッドホールディングス	8,200	962.00	7,888,400
マーベラス	9,900	947.00	9,375,300
パイロットコーポレーション	11,300	3,305.00	37,346,500
萩原工業	3,500	1,496.00	5,236,000
エイベックス	10,800	1,493.00	16,124,400
トッパン・フォームズ	11,400	1,040.00	11,856,000
フジシールインターナショナル	13,100	2,149.00	28,151,900
タカラトミー	28,600	999.00	28,571,400
廣済堂	4,800	936.00	4,492,800
レック	7,600	1,356.00	10,305,600
三光合成	5,800	444.00	2,575,200
プロネクス	5,500	1,208.00	6,644,000
ホクシン	37,000	118.00	4,366,000
大建工業	4,300	2,012.00	8,651,600
凸版印刷	96,900	1,681.00	162,888,900
大日本印刷	77,000	1,943.00	149,611,000
共同印刷	2,000	3,100.00	6,200,000
NISSHA	13,100	1,441.00	18,877,100
藤森工業	5,700	4,630.00	26,391,000
TAKARA & COMPANY	3,100	1,745.00	5,409,500
前澤化成工業	4,400	968.00	4,259,200

未来工業	2,400	1,736.00	4,166,400
アシックス	56,400	1,777.00	100,222,800
ツツミ	2,300	2,094.00	4,816,200
ウェーブロックホールディングス	4,900	734.00	3,596,600
J S P	3,700	1,815.00	6,715,500
ニチハ	8,900	3,045.00	27,100,500
ローランド	3,700	3,500.00	12,950,000
エフピコ	11,700	4,250.00	49,725,000
小松ウオール工業	2,400	1,934.00	4,641,600
ヤマハ	37,900	5,770.00	218,683,000
河合楽器製作所	1,800	3,650.00	6,570,000
ピジョン	40,900	4,090.00	167,281,000
天馬	4,800	2,150.00	10,320,000
オリバー	1,600	2,573.00	4,116,800
キングジム	5,300	887.00	4,701,100
象印マホービン	17,200	1,824.00	31,372,800
リンテック	13,600	2,415.00	32,844,000
信越ポリマー	9,800	1,027.00	10,064,600
東リ	17,200	245.00	4,214,000
イトーキ	12,700	364.00	4,622,800
任天堂	36,500	68,030.00	2,483,095,000
三菱鉛筆	10,500	1,400.00	14,700,000
松風	2,900	1,808.00	5,243,200
タカラスタンダード	13,200	1,571.00	20,737,200
コクヨ	30,600	1,423.00	43,543,800
ナカバヤシ	6,800	620.00	4,216,000
ニフコ	23,400	3,795.00	88,803,000
立川ブラインド工業	3,200	1,271.00	4,067,200
グローブライド	3,100	4,060.00	12,586,000
オカムラ	24,500	1,073.00	26,288,500
バルカー	5,200	2,123.00	11,039,600
M U T O Hホールディングス	2,700	1,590.00	4,293,000
伊藤忠商事	439,100	3,250.00	1,427,075,000
丸紅	619,100	786.60	486,984,060
スクロール	9,000	1,251.00	11,259,000
高島	2,500	1,713.00	4,282,500
ヨンドシーホールディングス	5,800	1,957.00	11,350,600
三陽商会	400	728.00	291,200
長瀬産業	35,300	1,740.00	61,422,000
蝶理	4,000	1,581.00	6,324,000
豊田通商	63,100	4,605.00	290,575,500
オンワードホールディングス	37,500	276.00	10,350,000
三共生興	9,500	499.00	4,740,500
兼松	25,100	1,388.00	34,838,800
美津濃	6,300	2,228.00	14,036,400
三井物産	509,800	2,214.50	1,128,952,100
日本紙パルプ商事	3,300	3,665.00	12,094,500
東京エレクトロン	37,300	46,300.00	1,726,990,000
カメイ	8,200	1,193.00	9,782,600
O U Gホールディングス	1,500	2,821.00	4,231,500
スターゼン	2,300	4,310.00	9,913,000
セイコーホールディングス	9,000	1,680.00	15,120,000
山善	24,500	1,010.00	24,745,000
椿本興業	1,200	3,780.00	4,536,000
住友商事	396,200	1,565.50	620,251,100
日本ユニシス	21,700	3,245.00	70,416,500
内田洋行	2,500	4,555.00	11,387,500
三菱商事	382,300	2,982.50	1,140,209,750
第一実業	2,900	4,145.00	12,020,500
キャノンマーケティングジャパン	15,600	2,387.00	37,237,200

西華産業	3,300	1,398.00	4,613,400
佐藤商事	5,200	999.00	5,194,800
菱洋エレクトロ	4,800	2,831.00	13,588,800
東京産業	6,900	673.00	4,643,700
ユアサ商事	6,400	3,080.00	19,712,000
神鋼商事	2,300	1,919.00	4,413,700
阪和興業	12,600	2,857.00	35,998,200
正栄食品工業	4,100	3,910.00	16,031,000
カナデン	5,100	1,266.00	6,456,600
菱電商事	4,500	1,573.00	7,078,500
ニプロ	47,500	1,388.00	65,930,000
フルサト工業	3,300	1,322.00	4,362,600
岩谷産業	15,100	6,360.00	96,036,000
昭光通商	6,500	752.00	4,888,000
イワキ	8,200	620.00	5,084,000
兼松エレクトロニクス	3,400	3,655.00	12,427,000
三愛石油	15,500	1,077.00	16,693,500
稲畑産業	15,100	1,532.00	23,133,200
明和産業	9,200	472.00	4,342,400
ヤマエ久野	4,600	1,063.00	4,889,800
ゴールドウイン	10,300	7,380.00	76,014,000
ユニ・チャーム	135,200	4,644.00	627,868,800
デサント	10,700	1,771.00	18,949,700
ワキタ	12,400	1,018.00	12,623,200
ヤマトインターナショナル	12,400	336.00	4,166,400
東邦ホールディングス	20,100	1,969.00	39,576,900
サンゲツ	16,900	1,604.00	27,107,600
ミツウロコグループホールディングス	9,300	1,252.00	11,643,600
シナネンホールディングス	2,300	3,230.00	7,429,000
伊藤忠エネクス	13,900	1,033.00	14,358,700
サンリオ	17,600	1,722.00	30,307,200
サンワテクノス	4,100	1,047.00	4,292,700
リョーサン	6,900	2,274.00	15,690,600
新光商事	8,500	777.00	6,604,500
トーヨー	2,800	1,830.00	5,124,000
三信電気	3,400	2,029.00	6,898,600
東陽テクニカ	6,700	1,131.00	7,577,700
モスフードサービス	8,900	3,120.00	27,768,000
加賀電子	5,700	2,388.00	13,611,600
三益半導体工業	4,900	2,649.00	12,980,100
都築電気	2,500	1,536.00	3,840,000
ソーダニッカ	7,900	541.00	4,273,900
立花エレテック	4,600	1,574.00	7,240,400
木曾路	8,200	2,454.00	20,122,800
S R Sホールディングス	7,800	870.00	6,786,000
リテールパートナーズ	7,600	1,483.00	11,270,800
ケーヨー	11,600	756.00	8,769,600
上新電機	7,400	3,100.00	22,940,000
日本瓦斯	10,300	5,020.00	51,706,000
ロイヤルホールディングス	11,000	1,885.00	20,735,000
東天紅	4,700	940.00	4,418,000
いなげや	7,000	1,685.00	11,795,000
島忠	4,200	5,480.00	23,016,000
チヨダ	6,600	1,001.00	6,606,600
ライフコーポレーション	4,800	3,310.00	15,888,000
リンガーハット	7,700	2,405.00	18,518,500
MrMaxHD	8,600	768.00	6,604,800
テンアライド	12,500	353.00	4,412,500
AOKIホールディングス	12,600	653.00	8,227,800
オークワ	9,800	1,195.00	11,711,000

コメリ	9,700	2,949.00	28,605,300
青山商事	14,000	778.00	10,892,000
しまむら	7,300	11,430.00	83,439,000
はせがわ	14,400	293.00	4,219,200
高島屋	45,700	1,052.00	48,076,400
松屋	13,700	964.00	13,206,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	29,700	842.00	25,007,400
近鉄百貨店	2,400	3,375.00	8,100,000
丸井グループ	53,100	2,062.00	109,492,200
クレディセゾン	36,700	1,323.00	48,554,100
アクシアル リテイリング	5,200	4,790.00	24,908,000
イオン	241,600	3,550.00	857,680,000
イズミ	12,800	3,910.00	50,048,000
フォーバル	5,200	843.00	4,383,600
平和堂	11,600	2,059.00	23,884,400
フジ	7,600	1,984.00	15,078,400
ヤオコー	7,100	6,670.00	47,357,000
ゼビオホールディングス	7,600	931.00	7,075,600
ケーズホールディングス	55,900	1,523.00	85,135,700
PALTAC	10,100	5,690.00	57,469,000
三谷産業	9,800	432.00	4,233,600
新生銀行	51,300	1,541.00	79,053,300
あおぞら銀行	37,500	2,301.00	86,287,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,301,000	563.30	2,422,753,300
りそなホールディングス	683,700	436.30	298,298,310
三井住友トラスト・ホールディングス	118,800	3,613.00	429,224,400
三井住友フィナンシャルグループ	435,200	3,763.00	1,637,657,600
千葉銀行	209,800	711.00	149,167,800
群馬銀行	129,400	348.00	45,031,200
武蔵野銀行	9,400	1,609.00	15,124,600
千葉興業銀行	17,400	272.00	4,732,800
筑波銀行	26,100	187.00	4,880,700
七十七銀行	19,700	1,442.00	28,407,400
青森銀行	4,900	2,462.00	12,063,800
秋田銀行	3,800	1,433.00	5,445,400
山形銀行	7,100	1,115.00	7,916,500
岩手銀行	4,100	2,142.00	8,782,200
東邦銀行	56,200	213.00	11,970,600
みちのく銀行	4,100	1,066.00	4,370,600
ふくおかフィナンシャルグループ	56,700	2,028.00	114,987,600
静岡銀行	153,100	798.00	122,173,800
十六銀行	7,900	2,000.00	15,800,000
スルガ銀行	55,100	361.00	19,891,100
八十二銀行	141,600	366.00	51,825,600
山梨中央銀行	7,300	906.00	6,613,800
大垣共立銀行	12,500	2,077.00	25,962,500
福井銀行	5,400	1,939.00	10,470,600
北國銀行	5,800	2,690.00	15,602,000
清水銀行	2,600	1,657.00	4,308,200
富山銀行	1,500	2,943.00	4,414,500
滋賀銀行	12,600	2,056.00	25,905,600
南都銀行	9,200	1,836.00	16,891,200
百五銀行	56,600	311.00	17,602,600
京都銀行	22,500	6,610.00	148,725,000
紀陽銀行	22,300	1,446.00	32,245,800
ほくほくフィナンシャルグループ	41,900	976.00	40,894,400
山陰合同銀行	39,600	497.00	19,681,200
中国銀行	54,100	870.00	47,067,000
鳥取銀行	3,800	1,127.00	4,282,600
伊予銀行	83,300	641.00	53,395,300

百十四銀行	6,700	1,599.00	10,713,300
四国銀行	8,900	736.00	6,550,400
阿波銀行	9,600	2,297.00	22,051,200
大分銀行	3,600	2,155.00	7,758,000
宮崎銀行	3,900	2,289.00	8,927,100
佐賀銀行	3,600	1,416.00	5,097,600
沖縄銀行	5,800	2,819.00	16,350,200
琉球銀行	13,700	789.00	10,809,300
セブン銀行	210,100	243.00	51,054,300
みずほフィナンシャルグループ	854,400	1,588.50	1,357,214,400
山口フィナンシャルグループ	78,500	673.00	52,830,500
芙蓉総合リース	6,600	7,190.00	47,454,000
みずほリース	9,700	3,375.00	32,737,500
東京センチュリー	14,600	7,350.00	107,310,000
S B Iホールディングス	77,100	3,120.00	240,552,000
日本証券金融	26,600	611.00	16,252,600
アイフル	105,500	279.00	29,434,500
長野銀行	3,300	1,307.00	4,313,100
名古屋銀行	5,100	2,842.00	14,494,200
北洋銀行	94,800	237.00	22,467,600
愛知銀行	2,100	2,933.00	6,159,300
中京銀行	2,300	1,785.00	4,105,500
大光銀行	3,300	1,379.00	4,550,700
愛媛銀行	8,800	1,001.00	8,808,800
京葉銀行	26,800	436.00	11,684,800
栃木銀行	30,400	180.00	5,472,000
北日本銀行	2,200	1,932.00	4,250,400
東和銀行	11,000	695.00	7,645,000
リコーリース	4,900	3,300.00	16,170,000
イオンフィナンシャルサービス	38,500	1,397.00	53,784,500
アコム	126,400	473.00	59,787,200
ジャックス	6,900	2,083.00	14,372,700
オリエントコーポレーション	170,100	154.00	26,195,400
日立キャピタル	14,800	2,904.00	42,979,200
オリックス	390,100	1,784.00	695,938,400
三菱UFJリース	141,800	573.00	81,251,400
ジャフコ グループ	9,700	6,860.00	66,542,000
九州リースサービス	6,800	643.00	4,372,400
トモニホールディングス	48,600	312.00	15,163,200
大和証券グループ本社	470,900	529.00	249,106,100
野村ホールディングス	960,000	632.10	606,816,000
岡三証券グループ	53,600	418.00	22,404,800
丸三証券	18,700	625.00	11,687,500
東洋証券	27,100	187.00	5,067,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	67,000	388.00	25,996,000
光世証券	6,600	703.00	4,639,800
水戸証券	16,800	305.00	5,124,000
いちよし証券	12,600	637.00	8,026,200
松井証券	30,800	926.00	28,520,800
S O M P Oホールディングス	110,800	4,124.00	456,939,200
日本取引所グループ	169,900	2,405.50	408,694,450
マネックスグループ	56,400	974.00	54,933,600
極東証券	8,400	831.00	6,980,400
岩井コスモホールディングス	6,400	1,597.00	10,220,800
藍澤証券	11,300	880.00	9,944,000
フィデアホールディングス	61,000	125.00	7,625,000
池田泉州ホールディングス	72,300	163.00	11,784,900
アニコム ホールディングス	17,700	1,078.00	19,080,600



MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	152,700	3,133.00	478,409,100
スパークス・グループ	29,000	337.00	9,773,000
第一生命ホールディングス	332,200	1,902.00	631,844,400
東京海上ホールディングス	208,400	5,351.00	1,115,148,400
イー・ギャランティ	7,200	2,172.00	15,638,400
アサックス	5,700	739.00	4,212,300
NECキャピタルソリューション	2,600	2,000.00	5,200,000
T & Dホールディングス	187,900	1,467.00	275,649,300
アドバンスクリエイト	1,400	1,818.00	2,545,200
三井不動産	286,600	2,395.00	686,407,000
三菱地所	413,100	1,849.50	764,028,450
平和不動産	10,800	3,575.00	38,610,000
東京建物	62,100	1,560.00	96,876,000
ダイビル	16,200	1,304.00	21,124,800
京阪神ビルディング	10,800	1,535.00	16,578,000
住友不動産	141,300	3,675.00	519,277,500
テーオーシー	12,300	780.00	9,594,000
東京楽天地	1,000	4,430.00	4,430,000
レオパレス21	52,200	130.00	6,786,000
スターツコーポレーション	7,500	2,896.00	21,720,000
フジ住宅	7,300	654.00	4,774,200
空港施設	8,600	524.00	4,506,400
ゴールドクレスト	5,700	1,719.00	9,798,300
リログループ	33,300	2,572.00	85,647,600
エスリード	1,600	1,594.00	2,550,400
日神グループホールディングス	10,000	441.00	4,410,000
日本エスコン	11,400	769.00	8,766,600
タカラレーベン	26,300	350.00	9,205,000
A V A N T I A	4,900	889.00	4,356,100
イオンモール	31,500	1,863.00	58,684,500
毎日コムネット	6,100	690.00	4,209,000
ファースト住建	3,900	1,110.00	4,329,000
カチタス	15,600	3,025.00	47,190,000
東祥	3,800	1,990.00	7,562,000
トーセイ	8,700	1,027.00	8,934,900
穴吹興産	2,600	1,725.00	4,485,000
サンフロンティア不動産	7,700	928.00	7,145,600
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	1,126.00	6,981,200
グランディハウス	10,200	457.00	4,661,400
東武鉄道	66,400	3,040.00	201,856,000
相鉄ホールディングス	21,900	2,473.00	54,158,700
東急	160,800	1,453.00	233,642,400
京浜急行電鉄	81,900	1,807.00	147,993,300
小田急電鉄	102,100	3,225.00	329,272,500
京王電鉄	35,600	8,380.00	298,328,000
京成電鉄	47,800	3,790.00	181,162,000
富士急行	8,700	5,790.00	50,373,000
新京成電鉄	1,900	2,245.00	4,265,500
東日本旅客鉄道	112,200	7,625.00	855,525,000
西日本旅客鉄道	56,800	6,312.00	358,521,600
東海旅客鉄道	53,000	17,600.00	932,800,000
西武ホールディングス	76,800	1,298.00	99,686,400
鴻池運輸	10,100	1,090.00	11,009,000
西日本鉄道	17,700	3,015.00	53,365,500
ハマキョウレックス	4,900	3,345.00	16,390,500
サカイ引越センター	2,900	4,900.00	14,210,000
近鉄グループホールディングス	60,400	4,560.00	275,424,000
阪急阪神ホールディングス	80,500	3,625.00	291,812,500
南海電気鉄道	28,600	2,611.00	74,674,600

京阪ホールディングス	26,900	4,910.00	132,079,000
神戸電鉄	1,400	3,680.00	5,152,000
名古屋鉄道	49,600	2,763.00	137,044,800
山陽電気鉄道	4,300	1,995.00	8,578,500
トランコム	1,800	8,170.00	14,706,000
日本通運	20,900	7,990.00	166,991,000
ヤマトホールディングス	84,600	2,854.00	241,448,400
山九	15,500	4,470.00	69,285,000
日新	4,800	1,391.00	6,676,800
丸全昭和運輸	4,900	3,130.00	15,337,000
センコーグループホールディングス	33,300	1,040.00	34,632,000
トナミホールディングス	1,400	5,440.00	7,616,000
ニッコンホールディングス	20,300	2,154.00	43,726,200
日本石油輸送	1,500	2,661.00	3,991,500
福山通運	7,700	4,335.00	33,379,500
セイノーホールディングス	45,200	1,534.00	69,336,800
神奈川中央交通	1,500	3,825.00	5,737,500
日立物流	13,300	3,355.00	44,621,500
丸和運輸機関	12,700	2,177.00	27,647,900
C & F ロジホールディングス	6,100	1,796.00	10,955,600
日本郵船	50,500	3,055.00	154,277,500
商船三井	35,900	3,355.00	120,444,500
川崎汽船	18,600	2,065.00	38,409,000
NSユニテッド海運	2,900	1,607.00	4,660,300
飯野海運	28,100	453.00	12,729,300
九州旅客鉄道	46,700	2,553.00	119,225,100
SGホールディングス	114,100	2,655.00	302,935,500
日本航空	147,100	2,416.00	355,393,600
ANAホールディングス	162,900	2,550.50	415,476,450
パスコ	1,200	1,370.00	1,644,000
Genky DrugStores	2,800	3,595.00	10,066,000
国際紙バルブ商事	17,700	244.00	4,318,800
ブックオフグループホールディングス	4,900	886.00	4,341,400
三菱倉庫	20,900	3,390.00	70,851,000
三井倉庫ホールディングス	6,400	2,240.00	14,336,000
住友倉庫	21,700	1,463.00	31,747,100
澁澤倉庫	3,300	2,290.00	7,557,000
ヤマタネ	3,100	1,442.00	4,470,200
東陽倉庫	13,000	332.00	4,316,000
乾汽船	4,600	935.00	4,301,000
日本トランスシティ	13,300	569.00	7,567,700
ケイヒン	3,200	1,367.00	4,374,400
安田倉庫	5,000	946.00	4,730,000
東洋埠頭	3,000	1,428.00	4,284,000
宇徳	9,000	466.00	4,194,000
上組	33,700	2,008.00	67,669,600
キューソー流通システム	2,700	1,573.00	4,247,100
近鉄エクスプレス	11,400	2,771.00	31,589,400
東海運	13,300	320.00	4,256,000
エーアイティー	2,400	1,072.00	2,572,800
内外トランスライン	3,500	1,293.00	4,525,500
TBSホールディングス	41,500	2,053.00	85,199,500
日本テレビホールディングス	52,200	1,417.00	73,967,400
朝日放送グループホールディングス	6,200	723.00	4,482,600
テレビ朝日ホールディングス	19,300	2,164.00	41,765,200
スカパーJ S A Tホールディングス	41,200	460.00	18,952,000
テレビ東京ホールディングス	4,600	2,482.00	11,417,200
日本BS放送	3,600	1,168.00	4,204,800
ビジョン	7,800	989.00	7,714,200
USEN-NEXT HOLDINGS	2,400	1,952.00	4,684,800

コネクシオ	3,500	1,396.00	4,886,000
日本通信	55,300	258.00	14,267,400
日本電信電話	731,600	2,818.50	2,062,014,600
KDDI	501,600	3,391.00	1,700,925,600
ソフトバンク	568,500	1,448.00	823,188,000
光通信	7,400	21,200.00	156,880,000
エムティーアイ	6,100	859.00	5,239,900
GMOインターネット	22,400	3,645.00	81,648,000
ファイバーゲート	2,000	2,132.00	4,264,000
アйдママーケティングコミュニケーション	9,600	485.00	4,656,000
KADOKAWA	16,800	4,180.00	70,224,000
学研ホールディングス	8,400	1,585.00	13,314,000
ゼンリン	11,300	1,355.00	15,311,500
インプレスホールディングス	22,600	197.00	4,452,200
東京電力ホールディングス	540,700	358.00	193,570,600
中部電力	195,000	1,322.50	257,887,500
関西電力	241,500	1,072.50	259,008,750
中国電力	91,900	1,304.00	119,837,600
北陸電力	58,300	674.00	39,294,200
東北電力	149,300	945.00	141,088,500
四国電力	53,000	761.00	40,333,000
九州電力	140,800	930.00	130,944,000
北海道電力	59,700	465.00	27,760,500
沖縄電力	12,400	1,457.00	18,066,800
電源開発	50,700	1,761.00	89,282,700
エフオン	3,500	1,048.00	3,668,000
イーレックス	9,400	1,735.00	16,309,000
レノバ	10,700	3,375.00	36,112,500
東京瓦斯	122,600	2,313.00	283,573,800
大阪瓦斯	115,500	1,964.00	226,842,000
東邦瓦斯	31,400	6,470.00	203,158,000
北海道瓦斯	3,400	1,607.00	5,463,800
広島ガス	13,200	381.00	5,029,200
西部瓦斯	7,200	2,936.00	21,139,200
静岡ガス	18,100	957.00	17,321,700
メタウォーター	7,200	2,180.00	15,696,000
アイネット	3,200	1,508.00	4,825,600
松竹	4,100	15,630.00	64,083,000
東宝	36,900	4,230.00	156,087,000
エイチ・アイ・エス	8,800	2,353.00	20,706,400
東映	2,000	21,300.00	42,600,000
ラックランド	1,700	2,366.00	4,022,200
エヌ・ティ・ティ・データ	166,500	1,617.00	269,230,500
共立メンテナンス	10,100	3,890.00	39,289,000
イチネンホールディングス	6,300	1,330.00	8,379,000
建設技術研究所	3,900	2,384.00	9,297,600
スペース	5,300	883.00	4,679,900
アインホールディングス	9,100	7,140.00	64,974,000
燦ホールディングス	3,600	1,121.00	4,035,600
ピー・シー・エー	900	4,230.00	3,807,000
東京テアトル	3,300	1,305.00	4,306,500
タナベ経営	3,000	1,395.00	4,185,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,500	1,709.00	4,272,500
ナガワ	1,900	10,480.00	19,912,000
東京都競馬	4,000	4,810.00	19,240,000
カナモト	10,700	2,398.00	25,658,600
東京ドーム	24,700	1,298.00	32,060,600
DTS	13,000	2,406.00	31,278,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,700	6,510.00	173,817,000
シーイーシー	6,700	1,465.00	9,815,500
カブコン	26,800	6,700.00	179,560,000
西尾レントオール	5,600	2,704.00	15,142,400
アイ・エス・ピー	3,100	1,239.00	3,840,900
日本空港ビルデング	20,100	5,230.00	105,123,000
トランス・コスモス	5,800	2,772.00	16,077,600
乃村工藝社	26,100	822.00	21,454,200
ジャステック	4,000	1,252.00	5,008,000
SCSK	14,400	6,560.00	94,464,000
日本管財	6,500	2,127.00	13,825,500
トーカイ	5,900	2,232.00	13,168,800
セコム	60,000	9,677.00	580,620,000
日本システムウエア	2,100	2,053.00	4,311,300
セントラル警備保障	2,900	3,435.00	9,961,500
アイネス	6,100	1,397.00	8,521,700
丹青社	11,500	823.00	9,464,500
メイテック	7,500	5,830.00	43,725,000
TKC	5,300	6,660.00	35,298,000
富士ソフト	6,700	5,620.00	37,654,000
応用地質	7,100	1,267.00	8,995,700
船井総研ホールディングス	12,500	2,299.00	28,737,500
NSD	20,100	1,914.00	38,471,400
進学会ホールディングス	8,800	472.00	4,153,600
丸紅建材リース	2,400	1,870.00	4,488,000
コナミホールディングス	22,700	7,460.00	169,342,000
学究社	3,200	1,329.00	4,252,800
ベネッセホールディングス	22,300	2,149.00	47,922,700
イオンディライト	7,500	3,135.00	23,512,500
ナック	4,600	979.00	4,503,400
福井コンピュータホールディングス	2,900	3,625.00	10,512,500
ダイセキ	10,200	3,465.00	35,343,000
ステップ	2,700	1,505.00	4,063,500
日鉄物産	4,500	3,935.00	17,707,500
泉州電業	1,800	3,675.00	6,615,000
元気寿司	1,800	2,516.00	4,528,800
トラスコ中山	14,400	2,667.00	38,404,800
ヤマダホールディングス	210,400	542.00	114,036,800
オートバックスセブン	23,300	1,431.00	33,342,300
モリト	6,900	614.00	4,236,600
アークランドサカモト	9,800	1,613.00	15,807,400
ニトリホールディングス	24,900	20,685.00	515,056,500
グルメ杵屋	4,500	985.00	4,432,500
愛眼	18,400	230.00	4,232,000
吉野家ホールディングス	20,600	2,205.00	45,423,000
加藤産業	9,100	3,695.00	33,624,500
イノテック	3,500	1,243.00	4,350,500
イエローハット	11,900	1,745.00	20,765,500
松屋フーズホールディングス	3,000	3,675.00	11,025,000
JBCホールディングス	4,200	1,459.00	6,127,800
JKホールディングス	5,700	813.00	4,634,100
サガミホールディングス	8,500	1,167.00	9,919,500
日伝	5,200	2,199.00	11,434,800
関西スーパーマーケット	4,700	1,145.00	5,381,500
ミロク情報サービス	6,200	2,246.00	13,925,200
北沢産業	15,400	270.00	4,158,000
杉本商事	3,200	2,424.00	7,756,800
因幡電機産業	16,700	2,550.00	42,585,000
王将フードサービス	4,100	5,850.00	23,985,000

プレナス	7,000	1,923.00	13,461,000	
ミニストップ	4,700	1,429.00	6,716,300	
アークス	12,000	2,404.00	28,848,000	
パローホールディングス	12,800	2,347.00	30,041,600	
東テク	2,100	2,781.00	5,840,100	
ミスミグループ本社	78,700	3,455.00	271,908,500	
ベルク	3,100	5,710.00	17,701,000	
大 庄	4,300	1,035.00	4,450,500	
タキヒヨー	2,200	1,889.00	4,155,800	
ファーストリテイリング	8,400	104,900.00	881,160,000	
ソフトバンクグループ	496,300	10,530.00	5,226,039,000	
蔵王産業	3,100	1,390.00	4,309,000	
スズケン	26,600	4,265.00	113,449,000	
サンドラッグ	23,600	4,060.00	95,816,000	
サックスパー ホールディングス	7,400	639.00	4,728,600	
ジェコス	4,400	960.00	4,224,000	
やまや	1,900	2,245.00	4,265,500	
ペルーナ	13,500	1,037.00	13,999,500	
合計	66,696,700		169,111,924,060	

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」-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)

	2021年2月22日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	11,772,439
コール・ローン	601,899,587
投資証券	29,514,011,950
未収配当金	178,256,157
流動資産合計	30,305,940,133
資産合計	30,305,940,133
負債の部	
流動負債	
未払解約金	401,084,274
その他未払費用	878
流動負債合計	401,085,152
負債合計	401,085,152
純資産の部	
元本等	
元本	16,717,528,982
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	13,187,325,999
純資産合計	29,904,854,981
負債純資産合計	30,305,940,133

## 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	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	16,717,528,982口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7888円 (17,888円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年2月22日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	3,476,349,556
合計	3,476,349,556

(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	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	16,129,989,937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	4,019,127,598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	3,431,588,553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)	1,407,461,761円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,315,390,767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	8,291,278,109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)	1,794,999,975円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,614,979,699円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,185,698,190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)	68,399,814円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	7,907,612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)	2,174,064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)	5,873,764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)	23,180,232円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	60,759円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	124,236円
計	16,717,528,982円

附属明細表(2021年2月22日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額(円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド投資法人	901	140,826,300	
	GLP投資法人	8,802	1,589,641,200	
	MCUBS MidCity投資法人	3,447	380,893,500	
	Oneリート投資法人	439	129,329,400	
	SOSILA物流リート投資法人	741	98,775,300	
	いちごオフィスリート投資法人	2,337	203,319,000	
	いちごホテルリート投資法人	493	42,792,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,412	653,050,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,676	864,348,000	
	イオンリート投資法人	2,857	420,550,400	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	18,097	299,505,350	
	インヴィンシブル投資法人	11,778	491,142,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	460	58,144,000	
	オリックス不動産投資法人	5,613	1,021,566,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,956	222,788,400	

ケネディクス・オフィス投資法人	871	600,119,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,838	357,123,400	
ケネディクス商業リート投資法人	1,036	269,567,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,266	399,423,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	542	60,975,000	
サンケイリアルエステート投資法人	689	78,339,300	
ザイマックス・リート投資法人	432	47,952,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,074	569,847,200	
ジャパンエクセレント投資法人	2,614	353,935,600	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,817	1,864,854,000	
スターアジア不動産投資法人	2,894	150,488,000	
スターツプロシード投資法人	439	93,155,800	
タカラレーベン不動産投資法人	846	93,906,000	
トーセイ・リート投資法人	623	76,753,600	
ヒューリックリート投資法人	2,268	393,271,200	
フロンティア不動産投資法人	935	450,670,000	
プレミア投資法人	2,544	357,940,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	601	81,555,700	
マリモ地方創生リート投資法人	264	32,366,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,024	891,552,000	
ラサールロジポート投資法人	3,139	524,840,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,093	144,603,900	
阪急阪神リート投資法人	1,272	187,238,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	983	516,075,000	
三菱地所物流リート投資法人	634	270,718,000	
産業ファンド投資法人	3,982	746,625,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	610	79,422,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,013	296,716,200	
森ヒルズリート投資法人	3,309	477,819,600	
星野リゾート・リート投資法人	429	247,533,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,285	688,483,500	
大江戸温泉リート投資法人	455	35,126,000	
大和ハウスリート投資法人	4,019	1,160,285,300	
大和証券オフィス投資法人	600	419,400,000	
大和証券リビング投資法人	3,678	372,949,200	
投資法人みらい	3,042	135,825,300	
東急リアル・エステート投資法人	1,889	343,231,300	
日本アコモデーションファンド投資法人	971	581,629,000	
日本ビルファンド投資法人	3,170	2,054,160,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,754	687,568,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,453	1,542,964,500	
日本リート投資法人	915	357,765,000	
日本リテールファンド投資法人	5,292	1,175,353,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,841	582,676,500	
福岡リート投資法人	1,457	254,537,900	
平和不動産リート投資法人	1,728	256,953,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	9,109	1,533,044,700	
投資証券 合計	170,748	29,514,011,950	
合計	170,748	29,514,011,950	

## 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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)」 (2021年2月26日現在)

資産総額	1,018,819円
負債総額	72円
純資産総額( - )	1,018,747円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額( / )	1.0187円

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)」 (2021年2月26日現在)

資産総額	1,051,657円
負債総額	88円
純資産総額( - )	1,051,569円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額( / )	1.0516円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

### （2）受益者に対する特典

ありません。

### （3）譲渡制限

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

### （4）受益権の譲渡

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

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

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【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

2021年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年2月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	407	70,129
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	134	25,989
単位型公社債投資信託	0	0
合計	541	96,119

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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

#### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第26期事業年度に係る中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		18,401,863		28,674,230
有価証券		8,008,550		6,301,326
前払費用		608,442		546,666
未収委託者報酬		4,705,229		4,882,250
未収運用受託報酬		1,911,554		2,039,974
未収投資助言報酬		168,445		174,892
その他		31,744		50,572
流動資産合計		33,835,830		42,669,914
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	72,641	1	98,471
車両	1	3,268	1	2,180
器具備品	1	95,277	1	142,866
有形固定資産合計		171,187		243,517
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		968,052		969,528
ソフトウェア仮勘定		24,478		216,033
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,000,545		1,193,575
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		36,902,679		33,634,499
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		167,886		-
差入保証金		293,513		303,875
繰延税金資産		1,066,925		1,292,446
その他		87,940		17,821
投資その他の資産合計		38,585,168		35,314,867
固定資産合計		39,756,901		36,751,960
資産合計		73,592,732		79,421,875



## 負債の部

## 流動負債

預り金	65,641	45,856
未払収益分配金	6,368	5,643
未払手数料	1,736,084	1,633,415
未払運用委託報酬	702,648	810,981
未払投資助言報酬	723,039	852,782
その他未払金	461,392	3,591,122
未払費用	113,233	146,706
未払法人税等	1,996,248	686,983
賞与引当金	853,083	975,373
その他	289,152	544,366
流動負債合計	6,946,893	9,293,232

## 固定負債

退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
役員退職慰労引当金	22,500	22,700
固定負債合計	1,824,248	1,973,446

## 負債合計

負債合計	8,771,142	11,266,679
------	-----------	------------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840

## 利益剰余金

利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	45,192,421	48,745,315
利益剰余金合計	45,872,228	49,425,122
株主資本合計	64,154,068	67,706,962

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	711,399	512,183
繰延ヘッジ損益	43,878	63,949
評価・換算差額等合計	667,521	448,234

## 純資産合計

純資産合計	64,821,590	68,155,196
-------	------------	------------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計	73,592,732	79,421,875
----------	------------	------------

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,471,631	27,088,982
運用受託報酬	11,784,292	13,165,624
投資助言報酬	610,372	677,248
その他営業収益	16,907	2,000
営業収益計	38,883,204	40,933,856
営業費用		
支払手数料	11,518,158	11,090,478
広告宣伝費	23,965	25,032
公告費	130	-
調査費	5,954,296	6,466,222
支払運用委託報酬	1,695,119	1,866,932
支払投資助言報酬	3,019,717	3,238,306
委託調査費	106,467	125,262
調査費	1,132,991	1,235,721
委託計算費	229,936	249,653
営業雑経費	812,655	929,200
通信費	49,932	47,749
印刷費	190,576	189,820
協会費	34,445	38,958
その他営業雑経費	537,701	652,672
営業費用計	18,539,142	18,760,587
一般管理費		
役員報酬	137,828	142,108
給料・手当	3,685,286	3,934,995
賞与引当金繰入額	851,086	974,031
賞与	279,376	285,503
福利厚生費	710,135	762,163
退職給付費用	311,969	307,637
役員退職慰労引当金繰入額	8,350	7,000
役員退職慰労金	150	30
その他人件費	151,765	172,763
不動産賃借料	673,220	682,105
その他不動産経費	30,378	31,283
交際費	29,832	28,014
旅費交通費	209,373	170,993
固定資産減価償却費	405,606	442,697
租税公課	325,740	341,195
業務委託費	261,111	291,579
器具備品費	332,440	354,221
保険料	52,393	46,549
諸経費	189,822	225,408
一般管理費計	8,645,865	9,200,283
営業利益	11,698,196	12,972,984
営業外収益		
受取利息	573	1,176
有価証券利息	24,008	12,651
受取配当金	124,674	200,028

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

## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位：千円)

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

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

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

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

(会計上の見積りの変更)

(退職給付債務の計算方法に係る見積りの変更)

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

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

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

#### (1) 概要

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

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

#### (2) 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。



## (貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物附属設備	325,809千円	310,385千円
車両	3,460	4,549
器具備品	474,339	394,258
計	803,609	709,193

## (損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2018年6月22日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

2019年3月19日開催の臨時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	28,674,230	28,674,230	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	-
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	10,218	10,218	-

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

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

現金・預金

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

有価証券

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額  
前事業年度(2019年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2020年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	28,674,230	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,300,000	11,550,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	6,148,442	12,928,752	2,006,497	-
合計	41,122,673	24,478,752	2,006,497	-

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

## (有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2019年3月31日)

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

当事業年度(2020年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	11,798,934	11,806,740	7,805
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	11,798,934	11,806,740	7,805
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	6,049,621	6,047,560	2,061
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,049,621	6,047,560	2,061
合計		17,848,556	17,854,300	5,743

## 2. その他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

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

当事業年度(2020年3月31日)

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

(注1) 投資信託受益証券等であります。

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



## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,650,233	4,459	72,045
合計	1,650,233	4,459	72,045

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度(2019年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2020年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社が有する退職一時金制度は、従来まで簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、対象従業員が300人を超えたため、当事業年度末より原則法に変更しております。

## 2. 確定給付制度

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

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

## (2) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

## (3) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

## (4) 退職給付費用

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

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

## 1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等  
前事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

## 2 親会社に関する注記

## 親会社情報

日本生命保険相互会社(非上場)

## ( 1 株当たり情報 )

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1 株当たり純資産額	597,720円47銭	628,459円68銭
1 株当たり当期純利益金額	78,626円78銭	83,477円26銭

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

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## ( 重要な後発事象 )

該当事項はありません。



## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		25,867,054
有価証券		2,200,310
前払費用		490,156
未収委託者報酬		5,083,348
未収運用受託報酬		2,860,357
未収投資助言報酬		205,730
その他		5,627
流動資産合計		36,712,587
固定資産		
有形固定資産	1	217,645
無形固定資産		1,388,913
投資その他の資産		
投資有価証券		37,195,151
関係会社株式		66,222
長期前払費用		2,470
差入保証金		300,007
繰延税金資産		850,500
その他		17,695
投資その他の資産合計		38,432,046
固定資産合計		40,038,605
資産合計		76,751,192

## 負債の部

## 流動負債

預り金		48,531
未払収益分配金		4,837
未払手数料		1,745,443
未払運用委託報酬		663,984
未払投資助言報酬		805,922
その他未払金		1,824,956
未払費用		174,548
未払法人税等		521,943
前受投資助言報酬		47,773
賞与引当金		552,768
その他	2	355,688
流動負債合計		<u>6,746,397</u>

## 固定負債

退職給付引当金		2,061,987
役員退職慰労引当金		26,275
固定負債合計		<u>2,088,262</u>

## 負債合計

		<u>8,834,660</u>
--	--	------------------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		<u>8,281,840</u>
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		47,777,753
利益剰余金合計		<u>48,457,560</u>
株主資本合計		<u>66,739,400</u>

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		1,230,312
繰延ヘッジ損益		53,180
評価・換算差額等合計		<u>1,177,132</u>

## 純資産合計

		<u>67,916,532</u>
--	--	-------------------

## 負債・純資産合計

		<u>76,751,192</u>
--	--	-------------------

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第26期中間会計期間	
(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	13,048,440
運用受託報酬	6,476,531
投資助言報酬	425,029
営業収益計	19,950,002
営業費用	8,911,467
一般管理費	1 4,550,470
営業利益	6,488,064
営業外収益	2 82,144
営業外費用	3 35,367
経常利益	6,534,841
特別利益	4 929
特別損失	5 51,744
税引前中間純利益	6,484,025
法人税、住民税及び事業税	1,823,853
法人税等調整額	127,685
法人税等合計	1,951,539
中間純利益	4,532,486

## (3)中間株主資本等変動計算書

第26期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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	48,745,315	49,425,122	67,706,962
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	-	-	-	-	-	-	-	4,532,486	4,532,486	4,532,486
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	-	-	-	-	-	-	-	967,562	967,562	967,562
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	47,777,753	48,457,560	66,739,400

	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	512,183	63,949	448,234	68,155,196
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
中間純利益	-	-	-	4,532,486
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	718,129	10,768	728,898	728,898
当中間期変動額合計	718,129	10,768	728,898	238,663
当中間期末残高	1,230,312	53,180	1,177,132	67,916,532

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	第26期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>其他有価証券 時価のあるもの ...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る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。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8. 連結納税制度	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、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(2020年3月31日 企業会計基準委員会 実務対応報告第39号)に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

## ( 中間貸借対照表関係 )

第26期中間会計期間末 ( 2020年9月30日現在 )	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	740,836千円
<p>2. 消費税等の取扱い</p> <p>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。</p>	

## (中間損益計算書関係)

第26期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	31,642千円
無形固定資産	189,242千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	52,744千円
金融派生商品収益	22,756千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	18,910千円
金融派生商品損失	14,197千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	702千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	39,656千円
事故損失賠償金	12,088千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第26期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	5,500,048	50,716	2020年3月31日	2020年6月29日

(金融商品関係)

第26期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	25,867,054	25,867,054	-
有価証券			
満期保有目的の債券	2,200,310	2,201,100	789
その他有価証券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	12,067,677	12,071,606	3,928
その他有価証券	25,127,473	25,127,473	-
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	7,126	7,126	-

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

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

現金・預金

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

有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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



(有価証券関係)

第26期中間会計期間末(2020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	11,448,319	11,453,125	4,805
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	11,448,319	11,453,125	4,805
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	2,819,668	2,819,581	87
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,819,668	2,819,581	87
合計		14,267,988	14,272,706	4,717

## 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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	15,190,859	16,809,083	1,618,223
小計		15,190,859	16,809,083	1,618,223
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	8,503,340	8,318,390	184,949
小計		8,503,340	8,318,390	184,949
合計		23,694,199	25,127,473	1,433,273

(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26期中間会計期間末（2020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26期中間会計期間末（2020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	1,364,820	-	7,126
合計			1,364,820	-	7,126

（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26期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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26期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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26期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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26期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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26期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

## （ 1 株当たり情報）

	第26期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
1株当たり純資産額	626,258円96銭
1株当たり中間純利益金額	41,794円10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	4,532,486千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>4,532,486千円</u>
期中平均株式数	108千株

## （重要な後発事象）

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2020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

2020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：2020年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279	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。

#### (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

2020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、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」および「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

### 3【資本関係】

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

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

### 第3【参考情報】

該当事項はありません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年5月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之 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

## 監査意見

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

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

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

- 
1. 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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。



# 独立監査人の監査報告書

2021年3月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)の2020年10月1日から2021年2月22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。

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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)の2021年2月22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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年3月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）の2020年10月1日から2021年2月22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。

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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）の2021年2月22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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年11月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020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。

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2020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(2020年4月1日から2020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。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

## 中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる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。

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

## 利害関係

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

以上

- 
1. 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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。