

【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】	2022年2月18日提出
【計算期間】	第4期（自 2020年11月21日 至 2021年11月22日）
【ファンド名】	ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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

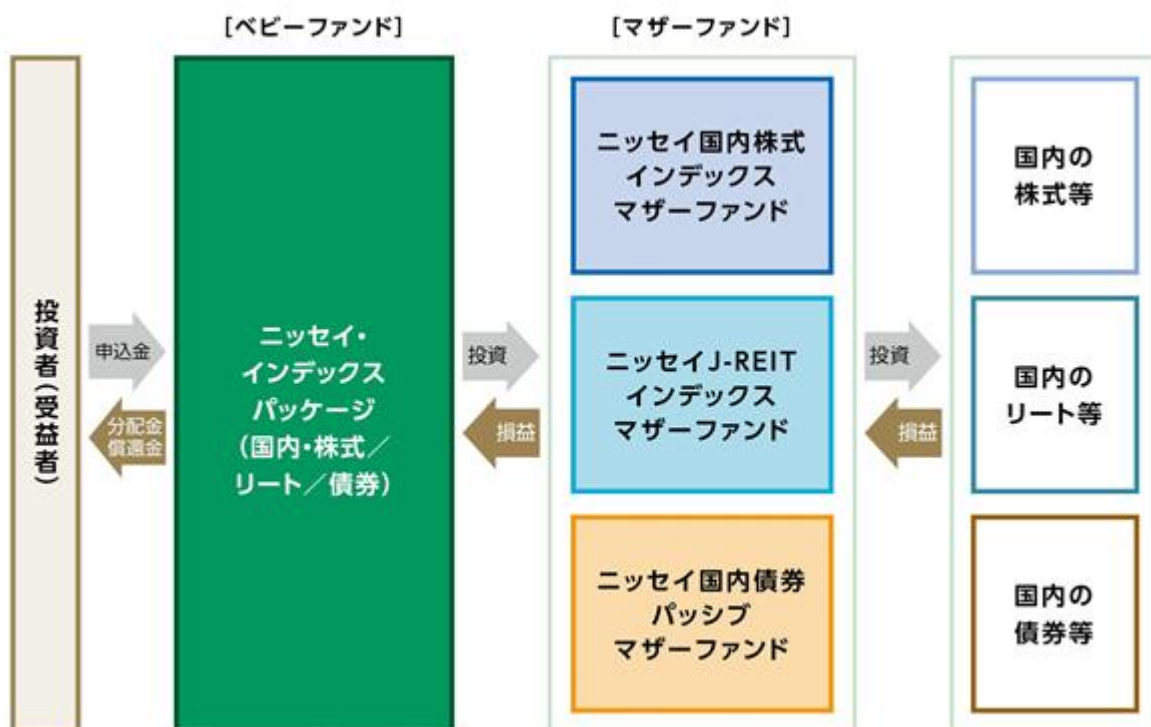
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

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

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

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

〈各マザーファンドの運用プロセス〉

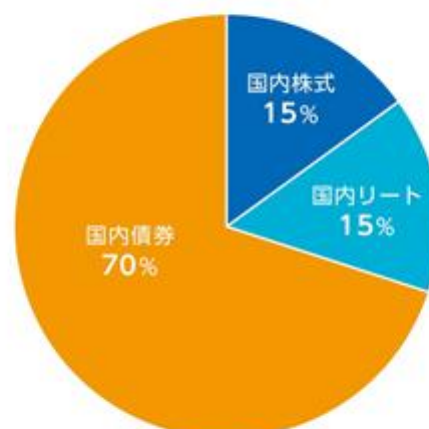


2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

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

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

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

〈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。

- 東京証券取引所の第一部、第二部などの市場は、2022年4月に新しい市場区分への再編が予定されています。これに併せ、TOPIXの算出方法についても変更が予定されています。

●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

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

ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 資産複合 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

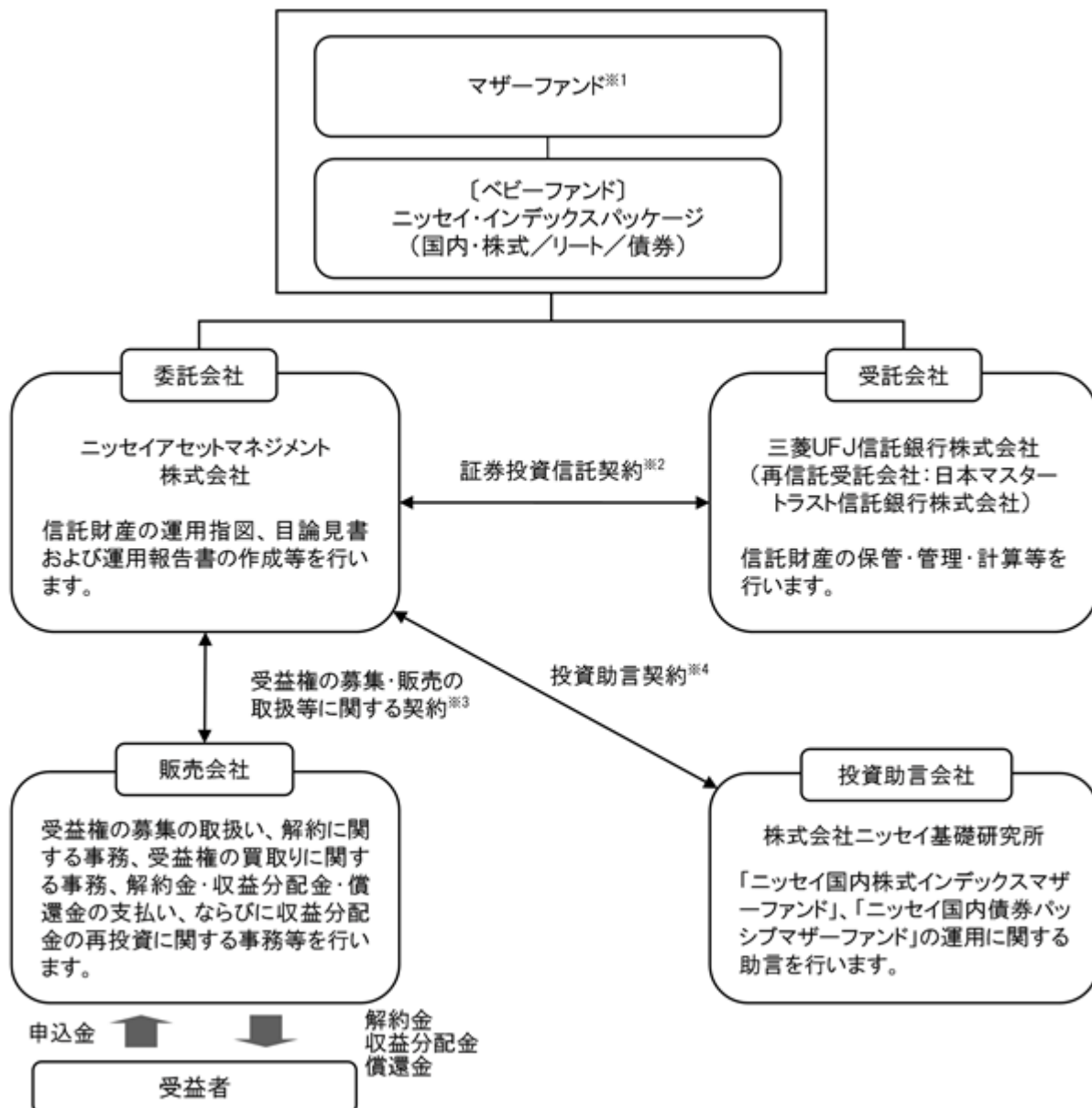
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 不動産投信・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
その他の指数 (合成ベンチマーク)	目論見書または約款において、合成ベンチマークの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年11月17日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- 1 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド
- 2 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 3 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 4 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（2021年11月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
- ・設立年月日：1995年4月4日
- ・資本金の額：100億円
- ・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。
- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）の新株予約権をいいます。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りません。

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。

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

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

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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

金融商品

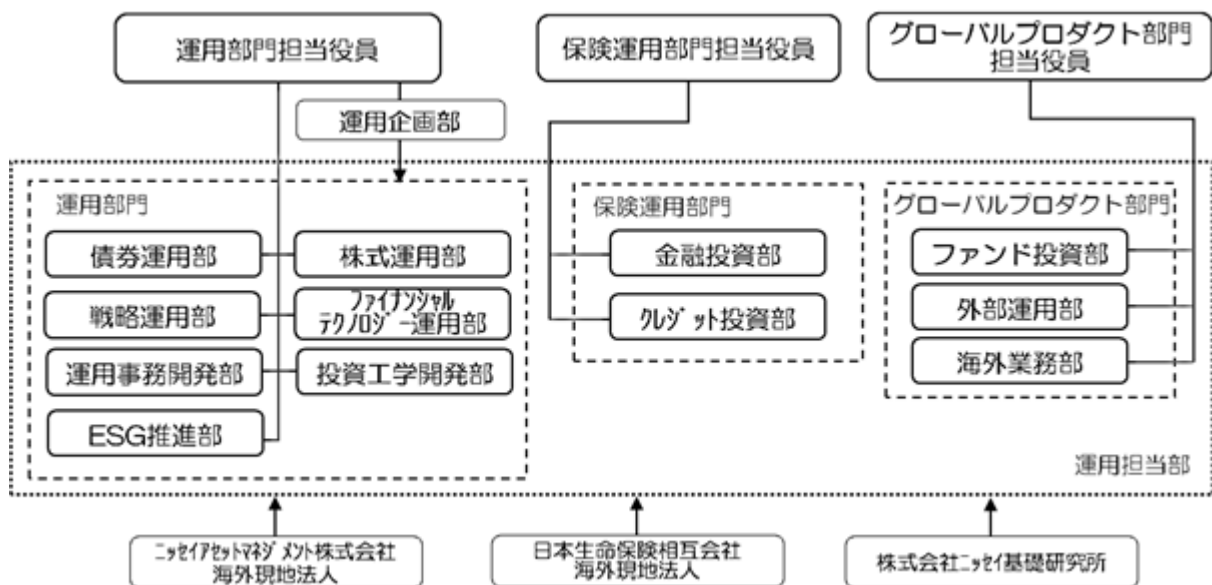
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ)により運用することができます。

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

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

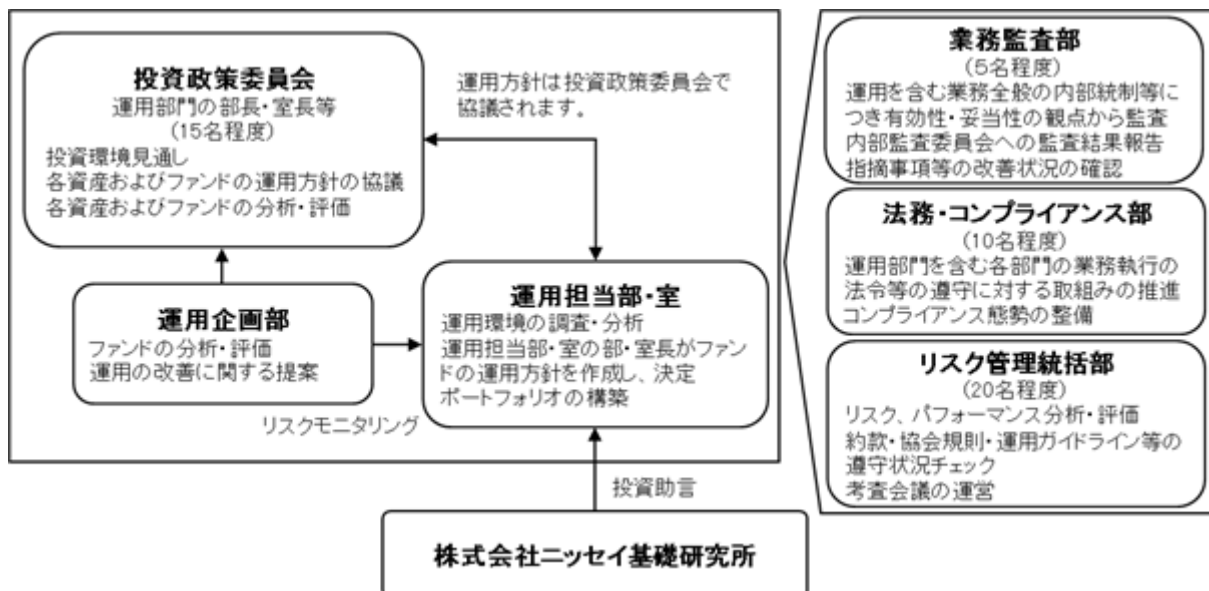
(3) 【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2. 分配対象額についての分配方針

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

3. 留保益の運用方針

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

分配時期

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

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りま

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

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

金利先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

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

有価証券の空売り

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

有価証券の借入れ

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

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

3【投資リスク】

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

(1) 投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

J - R E I T の税制に関するリスク

一般に、J - R E I T 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 - R E I T の価格が下落することおよび分配金が減少することがあります。

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

・収益分配金に関する留意点

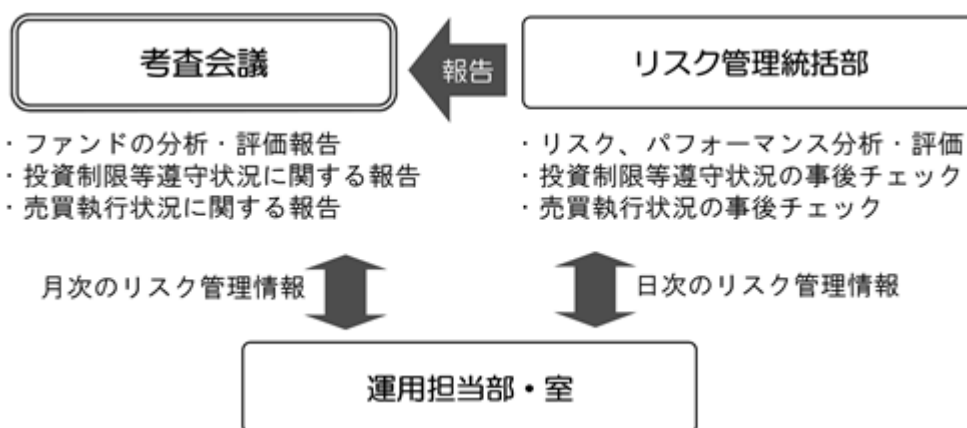
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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。
- ・流動性に関する留意点
 ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短時間で手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。
 これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受付けを中止する、また既に受付けた換金の申込みの受付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

（２）投資リスク管理体制



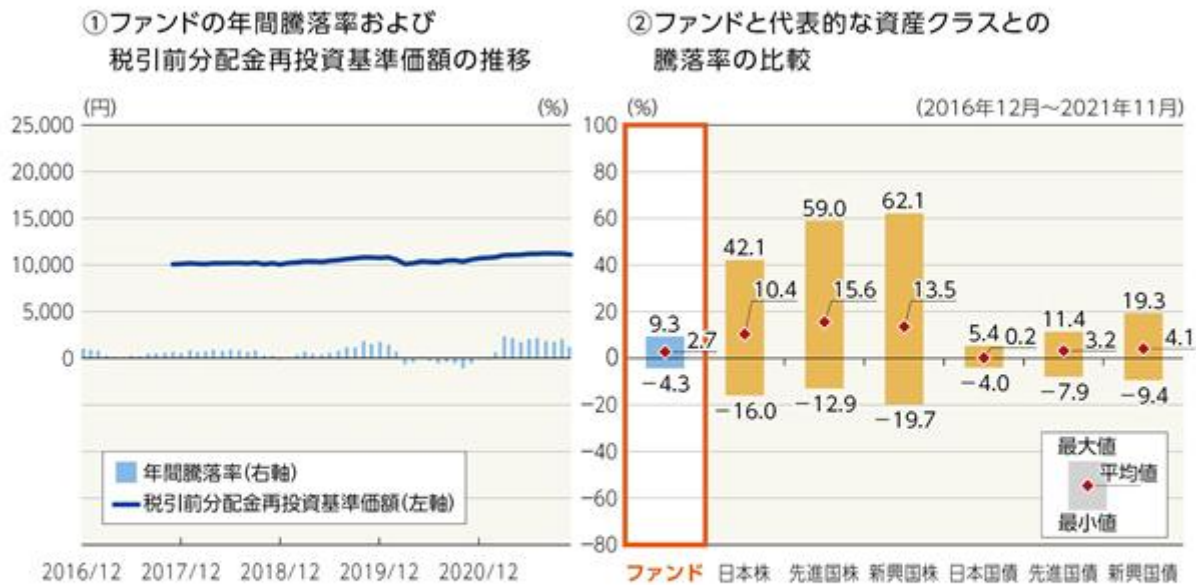
1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
 - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
 - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

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。

< 流動性リスクに関する管理体制 >

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。

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



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … 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・ディバースィファイド(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、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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・ディバースィファイドは、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】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.3102%（税抜0.282%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

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

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

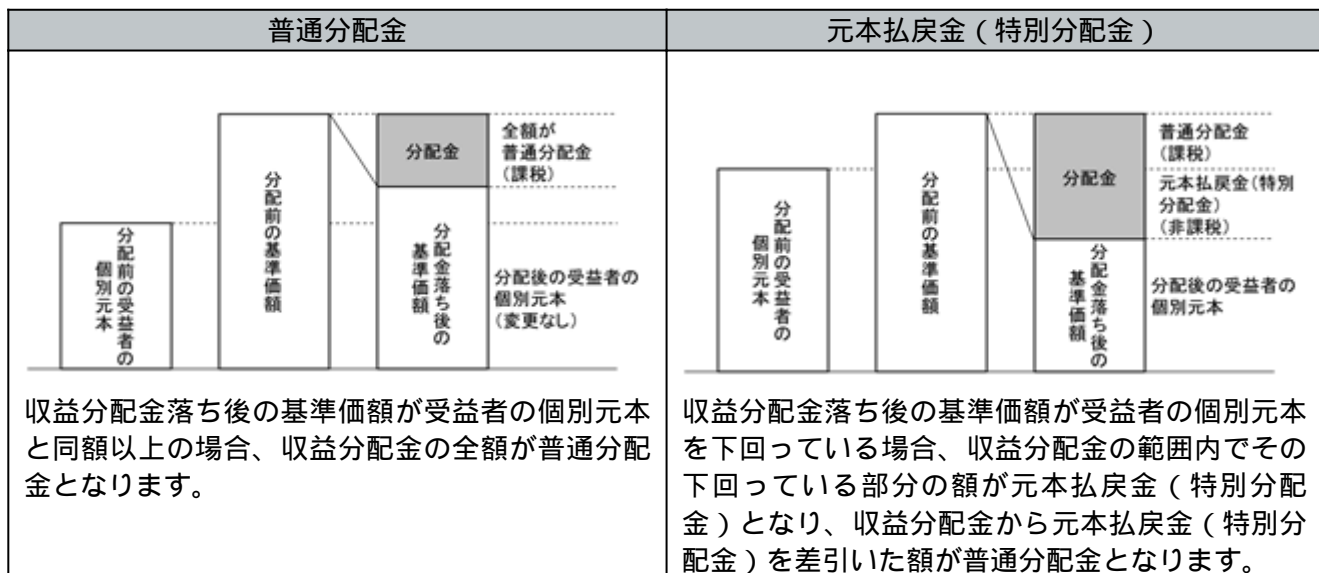
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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



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】

2021年11月30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	90,167,752	100.00
内 日本	90,167,752	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	793	0.00
純資産総額	90,166,959	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の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	109,170,720,870	96.12
内 日本	109,170,720,870	96.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,406,278,254	3.88
純資産総額	113,576,999,124	100.00

その他資産の投資状況

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,664,160,000	4.11
内 日本	4,664,160,000	4.11

（注1）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の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	59,361,864,580	76.49
内 日本	59,361,864,580	76.49
地方債証券	4,890,938,383	6.30
内 日本	4,890,938,383	6.30
特殊債券	7,584,430,347	9.77
内 日本	7,584,430,347	9.77
社債券	5,100,095,000	6.57
内 日本	4,496,511,300	5.79
内 フランス	401,463,900	0.52
内 スウェーデン	202,119,800	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	668,601,396	0.86
純資産総額	77,605,929,706	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の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	30,770,311,400	98.42
内 日本	30,770,311,400	98.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	495,184,906	1.58
純資産総額	31,265,496,306	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の比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	65,030,597	0.9835 63,963,846	0.9849 64,048,634	- -	71.03
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	6,965,244	1.9354 13,480,649	1.8903 13,166,400	- -	14.60
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	5,987,758	2.2925 13,727,421	2.1632 12,952,718	- -	14.37

（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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	国内		100.00
	小計		100.00
合 計（対純資産総額比）			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の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 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	2,092,900	1,633.53 3,418,818,140	2,001.00 4,187,892,900	- -	3.69
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	258,800	11,946.87 3,091,851,495	13,825.00 3,577,910,000	- -	3.15
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	37,400	56,893.10 2,127,802,100	70,330.00 2,630,342,000	- -	2.32
4	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービス 業	304,600	5,656.76 1,723,049,756	6,901.00 2,102,044,600	- -	1.85

5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,613,400	567.42 1,482,915,806	601.40 1,571,698,760	- -	1.38
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	26,200	46,844.74 1,227,332,278	59,840.00 1,567,808,000	- -	1.38
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	474,200	2,829.38 1,341,693,767	3,125.00 1,481,875,000	- -	1.30
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	243,100	10,286.67 2,500,689,819	6,030.00 1,465,893,000	- -	1.29
9	HOYA 日本	株式 精密機器	80,600	13,218.41 1,065,404,344	18,020.00 1,452,412,000	- -	1.28
10	日本電産 日本	株式 電気機器	107,100	14,326.09 1,534,324,620	13,000.00 1,392,300,000	- -	1.23
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	198,700	5,026.14 998,695,794	6,688.00 1,328,905,600	- -	1.17
12	信越化学工業 日本	株式 化学	69,500	18,719.78 1,301,024,958	19,000.00 1,320,500,000	- -	1.16
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	52,600	22,174.64 1,166,386,252	23,150.00 1,217,690,000	- -	1.07
14	任天堂 日本	株式 その他製品	23,300	67,317.39 1,568,495,256	50,100.00 1,167,330,000	- -	1.03
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	282,100	3,770.41 1,063,634,654	3,703.00 1,044,616,300	- -	0.92
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	304,900	3,106.56 947,193,124	3,391.00 1,033,915,900	- -	0.91
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	121,400	9,792.89 1,188,857,312	8,380.00 1,017,332,000	- -	0.90
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	325,300	3,012.89 980,094,736	3,101.00 1,008,755,300	- -	0.89
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	324,800	3,677.39 1,194,416,946	3,031.00 984,468,800	- -	0.87
20	KDDI 日本	株式 情報・通信業	295,600	3,405.06 1,006,537,004	3,300.00 975,480,000	- -	0.86
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	614,100	1,489.31 914,586,640	1,562.50 959,531,250	- -	0.84
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	284,600	3,252.33 925,615,372	3,260.00 927,796,000	- -	0.82
23	第一三共 日本	株式 医薬品	324,700	3,222.63 1,046,390,011	2,824.50 917,115,150	- -	0.81
24	SMC 日本	株式 機械	12,100	65,780.46 795,943,638	72,650.00 879,065,000	- -	0.77
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	46,700	17,916.74 836,711,932	17,840.00 833,128,000	- -	0.73

26	三井物産 日本	株式 卸売業	316,000	2,223.62 702,664,521	2,557.00 808,012,000	- -	0.71
27	ファナック 日本	株式 電気機器	36,300	27,384.07 994,041,848	22,245.00 807,493,500	- -	0.71
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	134,200	5,364.02 719,852,448	5,708.00 766,013,600	- -	0.67
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	91,000	6,723.94 611,879,436	8,331.00 758,121,000	- -	0.67
30	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	521,200	1,589.53 828,467,680	1,402.00 730,722,400	- -	0.64

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	電気機器	19.03
		情報・通信業	8.29
		輸送用機器	7.76
		化学	6.53
		サービス業	6.17
		機械	5.16
		卸売業	4.90
		医薬品	4.63
		銀行業	4.48
		小売業	4.03
		食料品	3.13
		精密機器	2.90
		陸運業	2.87
		建設業	2.10
		その他製品	2.10
		保険業	1.84
		不動産業	1.80
		その他金融業	1.08
		電気・ガス業	1.04
		ガラス・土石製品	0.75
		証券、商品先物取引業	0.71
		鉄鋼	0.68
		非鉄金属	0.67
		ゴム製品	0.63
		金属製品	0.61
		繊維製品	0.44
		海運業	0.41
		石油・石炭製品	0.39
空運業	0.36		
鉱業	0.21		
パルプ・紙	0.20		
倉庫・運輸関連業	0.16		
水産・農林業	0.08		
	小計		96.12
合計(対純資産総額比)			96.12

(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の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債 券	1,000,000,000	101.77 1,017,724,000	101.20 1,012,022,000	0.828 2023/5/19	1.30
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	744,000,000	100.83 750,175,200	101.20 752,950,320	0.1 2028/3/20	0.97
3	第363回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	643,000,000	100.65 647,182,760	100.57 646,665,100	0.1 2031/6/20	0.83
4	第429回 利付国債(2 年) 日本	国債証 券	600,000,000	100.22 601,346,000	100.24 601,488,000	0.005 2023/10/1	0.78

5	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	585,000,000	101.96 596,493,490	101.72 595,073,700	0.4 2025/3/20	0.77
6	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	566,000,000	102.20 578,474,640	101.98 577,240,760	0.4 2025/9/20	0.74
7	第351回 利付国債(10年) 日本	国債証券	570,000,000	100.77 574,389,000	101.21 576,942,600	0.1 2028/6/20	0.74
8	第349回 利付国債(10年) 日本	国債証券	570,000,000	100.86 574,902,000	101.18 576,760,200	0.1 2027/12/20	0.74
9	第352回 利付国債(10年) 日本	国債証券	556,000,000	100.67 559,725,200	101.26 563,033,400	0.1 2028/9/20	0.73
10	第341回 利付国債(10年) 日本	国債証券	552,000,000	101.79 561,924,960	101.68 561,323,280	0.3 2025/12/20	0.72
11	第353回 利付国債(10年) 日本	国債証券	543,000,000	100.62 546,372,030	101.31 550,124,160	0.1 2028/12/20	0.71
12	第339回 利付国債(10年) 日本	国債証券	536,000,000	102.08 547,154,160	101.85 545,937,440	0.4 2025/6/20	0.70
13	第344回 利付国債(10年) 日本	国債証券	533,000,000	100.83 537,429,230	100.96 538,143,450	0.1 2026/9/20	0.69
14	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	532,000,000	100.84 536,468,800	101.01 537,399,800	0.1 2026/12/20	0.69
15	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	525,000,000	100.17 525,892,500	101.20 531,336,750	0.1 2030/3/20	0.68
16	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	523,000,000	100.81 527,262,450	101.06 528,569,950	0.1 2027/3/20	0.68
17	第354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	518,000,000	100.52 520,693,600	101.32 524,842,780	0.1 2029/3/20	0.68
18	第144回 利付国債(5年) 日本	国債証券	512,000,000	100.78 516,008,960	100.78 516,014,080	0.1 2025/6/20	0.66
19	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	510,000,000	100.83 514,238,100	100.90 514,625,700	0.1 2026/3/20	0.66
20	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	101.95 509,752,000	101.75 508,779,000	0.66 2024/5/31	0.66
21	第334回 利付国債(10年) 日本	国債証券	496,000,000	102.31 507,457,600	101.85 505,200,800	0.6 2024/6/20	0.65

22	第348回 利付国債(10年) 日本	国債証券	499,000,000	100.81 503,076,830	101.13 504,673,630	0.1 2027/9/20	0.65
23	第430回 利付国債(2年) 日本	国債証券	500,000,000	100.25 501,263,000	100.25 501,295,000	0.005 2023/11/1	0.65
24	第343回 利付国債(10年) 日本	国債証券	461,000,000	100.82 464,780,200	100.96 465,425,600	0.1 2026/6/20	0.60
25	第361回 利付国債(10年) 日本	国債証券	457,000,000	99.86 456,370,870	100.85 460,925,630	0.1 2030/12/20	0.59
26	第347回 利付国債(10年) 日本	国債証券	433,000,000	100.82 436,552,660	101.08 437,711,040	0.1 2027/6/20	0.56
27	第357回 利付国債(10年) 日本	国債証券	429,000,000	100.26 430,115,400	101.25 434,375,370	0.1 2029/12/20	0.56
28	第355回 利付国債(10年) 日本	国債証券	422,000,000	100.45 423,899,000	101.32 427,604,160	0.1 2029/6/20	0.55
29	第356回 利付国債(10年) 日本	国債証券	418,000,000	100.33 419,379,400	101.29 423,408,920	0.1 2029/9/20	0.55
30	第427回 利付国債(2年) 日本	国債証券	416,000,000	100.23 416,977,600	100.22 416,936,000	0.005 2023/8/1	0.54

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	76.49
		特殊債券	9.77
		地方債証券	6.30
		社債券	5.79
	小計		98.36
	外国	社債券	0.78
	小計		0.78
合計(対純資産総額比)			99.14

(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の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 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	3,182	712,018.86 2,265,644,018	700,000.00 2,227,400,000	- -	7.12
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,808	674,000.97 1,892,594,743	655,000.00 1,839,240,000	- -	5.88
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	4,448	371,522.11 1,652,530,363	369,500.00 1,643,536,000	- -	5.26
4	GLP投資法人 日本	投資証券	9,094	184,900.58 1,681,485,920	180,300.00 1,639,648,200	- -	5.24
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	9,080	168,203.54 1,527,288,160	161,400.00 1,465,512,000	- -	4.69
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,167	101,500.36 1,437,955,729	97,800.00 1,385,532,600	- -	4.43
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,216	325,004.89 1,370,220,634	323,500.00 1,363,876,000	- -	4.36
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,594	186,101.43 1,041,051,440	180,500.00 1,009,717,000	- -	3.23
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	2,807	361,500.63 1,014,732,288	348,500.00 978,239,500	- -	3.13
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	6,321	141,495.80 894,394,984	144,600.00 914,016,600	- -	2.92
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,986	206,801.23 824,309,714	202,800.00 808,360,800	- -	2.59
12	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	1,845	416,011.93 767,542,016	404,500.00 746,302,500	- -	2.39
13	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	8,523	84,501.53 720,206,561	82,500.00 703,147,500	- -	2.25
14	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	1,496	455,003.28 680,684,920	432,000.00 646,272,000	- -	2.07
15	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証券	3,437	188,904.10 649,263,415	187,200.00 643,406,400	- -	2.06
16	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	1,044	585,019.43 610,760,290	583,000.00 608,652,000	- -	1.95
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	969	637,008.86 617,261,592	620,000.00 600,780,000	- -	1.92

18	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	869	710,005.88 616,995,112	689,000.00 598,741,000	- -	1.92
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,835	329,995.54 605,541,819	314,000.00 576,190,000	- -	1.84
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	8,602	68,498.33 589,222,674	58,600.00 504,077,200	- -	1.61
21	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,302	154,899.90 511,479,470	152,000.00 501,904,000	- -	1.61
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,302	155,202.17 512,477,585	150,400.00 496,620,800	- -	1.59
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	984	511,028.17 502,851,720	497,000.00 489,048,000	- -	1.56
24	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,358	44,698.38 552,382,620	38,050.00 470,221,900	- -	1.50
25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,619	172,299.61 451,252,699	166,700.00 436,587,300	- -	1.40
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	594	731,991.47 434,802,936	714,000.00 424,116,000	- -	1.36
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	3,794	113,400.46 430,241,351	109,400.00 415,063,600	- -	1.33
28	N T T都市開発リート投資法人 日本	投資証券	2,691	152,204.34 409,581,900	150,200.00 404,188,200	- -	1.29
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,264	320,022.09 404,507,925	319,000.00 403,216,000	- -	1.29
30	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	1,918	214,199.92 410,835,456	206,100.00 395,299,800	- -	1.26

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	国内		98.42
	小計		98.42
合計(対純資産総額比)			98.42

(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の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

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。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
該当事項はありません。

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】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	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 0 312月	買建	246	4,953,330,300	4,664,160,000	4.11

（注1）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の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
該当事項はありません。

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】

直近日（2021年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	10,125,048	10,125,048	1.0114	1.0114
第2計算期間末 (2019年11月20日)	34,551,025	34,551,025	1.0807	1.0807
第3計算期間末 (2020年11月20日)	60,232,978	60,232,978	1.0555	1.0555
第4計算期間末 (2021年11月22日)	90,328,858	90,328,858	1.1222	1.1222
2020年11月末日	60,492,213	-	1.0580	-
12月末日	62,410,992	-	1.0720	-
2021年1月末日	64,024,690	-	1.0763	-
2月末日	66,463,053	-	1.0834	-
3月末日	70,399,581	-	1.1049	-
4月末日	72,082,406	-	1.1060	-
5月末日	75,027,140	-	1.1095	-
6月末日	76,899,408	-	1.1183	-
7月末日	79,107,360	-	1.1195	-
8月末日	82,521,047	-	1.1233	-
9月末日	85,066,573	-	1.1227	-
10月末日	88,381,042	-	1.1210	-
11月末日	90,166,959	-	1.1098	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
第2計算期間	6.9
第3計算期間	2.3
第4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います（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】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	11,339,331	1,327,996	10,011,335
第2計算期間	36,243,654	14,283,311	31,971,678
第3計算期間	61,535,982	36,443,305	57,064,355
第4計算期間	37,861,170	14,434,176	80,491,349

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 参考情報 >

3. 運用実績

2021年11月末現在

● 基準価額・純資産の推移



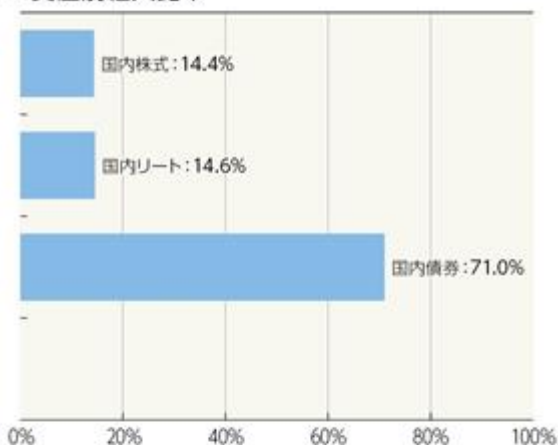
基準価額	11,098円
純資産総額	90百万円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

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

● 資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2017年はファンド設定時から年末まで、2021年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
- ・2016年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

3.運用実績

2021年11月末現在

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.8%
2	ソニーグループ	3.3%
3	キーエンス	2.4%
4	リクルートホールディングス	1.9%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.4%

・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	7.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.0%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.3%
4	GLP投資法人	5.3%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.8%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

3. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.3%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第363回 利付国債(10年)	2031/06/20	0.100%	0.8%
4	第429回 利付国債(2年)	2023/10/01	0.005%	0.8%
5	第338回 利付国債(10年)	2025/03/20	0.400%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	19.8%
2	情報・通信業	8.6%
3	輸送用機器	8.1%
4	化学	6.8%
5	サービス業	6.4%

・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	98.4%
短期金融資産等	1.6%

・比率は対純資産総額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	-
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（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ことがあります。

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

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

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

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

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】

無期限です。

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

繰上償還

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

・受益権の口数が30億口を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年11月21日から2021年11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・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	376	852
コール・ローン	82,470	128,733
親投資信託受益証券	60,233,505	90,331,240
未収入金	328,679	32,800
流動資産合計	60,645,030	90,493,625
資産合計	60,645,030	90,493,625
負債の部		
流動負債		
未払解約金	327,095	30,419
未払受託者報酬	6,375	10,098
未払委託者報酬	75,756	119,736
その他未払費用	2,826	4,514
流動負債合計	412,052	164,767
負債合計	412,052	164,767
純資産の部		
元本等		
元本	57,064,355	80,491,349
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,168,623	9,837,509
（分配準備積立金）	962,557	4,404,020
元本等合計	60,232,978	90,328,858
純資産合計	60,232,978	90,328,858
負債純資産合計	60,645,030	90,493,625

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2019年11月21日 至 2020年11月20日	自	2020年11月21日 至 2021年11月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		478,075		4,417,247
営業収益合計		478,075		4,417,247
営業費用				
受託者報酬		11,489		18,078
委託者報酬		136,772		214,528
その他費用		5,080		8,068
営業費用合計		153,341		240,674
営業利益又は営業損失()		631,416		4,176,573
経常利益又は経常損失()		631,416		4,176,573
当期純利益又は当期純損失()		631,416		4,176,573
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,130,920		542,954
期首剰余金又は期首欠損金()		2,579,347		3,168,623
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,190,384		3,940,484
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		2,190,384		3,940,484
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,100,612		905,217
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,100,612		905,217
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		3,168,623		9,837,509

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	
	自 2020年11月21日	至 2021年11月22日
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礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年11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11月21日から2021年11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3期	第4期
	2020年11月20日現在	2021年11月22日現在
1. 期首元本額	31,971,678円	57,064,355円
期中追加設定元本額	61,535,982円	37,861,170円
期中一部解約元本額	36,443,305円	14,434,176円
2. 受益権の総数	57,064,355口	80,491,349口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年11月21日 至 2020年11月20日	自 2020年11月21日 至 2021年11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(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(499,504円)、収益調整金(2,206,066円)及び分配準備積立金(463,053円)より分配対象収益は3,168,623円(1万口当たり555.27円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,633,619円)、収益調整金(5,433,489円)及び分配準備積立金(770,401円)より分配対象収益は9,837,509円(1万口当たり1,222.18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）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	第4期
	自 2019年11月21日 至 2020年11月20日	自 2020年11月21日 至 2021年11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。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	766,202	3,300,072
合計	766,202	3,300,072

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,0555円 (10,555円)	1,1222円 (11,222円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	5,931,944	13,601,354	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	6,900,140	13,354,530	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	64,432,042	63,375,356	
親投資信託受益証券 合計		77,264,126	90,331,240	
合計			90,331,240	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。

(参考)

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」- R E I Tインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

開示対象ファンドの開示対象期間末日(以下、「計算日」という。)における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,328,489
コール・ローン	1,259,017,269
株式	115,648,485,140
派生商品評価勘定	25,986,650
未収入金	10,941,559,100
未収配当金	1,302,673,541
差入委託証拠金	182,850,000
流動資産合計	129,368,900,189
資産合計	
129,368,900,189	
負債の部	
流動負債	
前受金	48,480,000
未払金	38,645,100
未払解約金	9,616,058,774
その他未払費用	3,249
流動負債合計	9,703,187,123
負債合計	
9,703,187,123	
純資産の部	
元本等	
元本	52,189,089,554
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,476,623,512
元本等合計	
119,665,713,066	
純資産合計	
119,665,713,066	
負債純資産合計	
129,368,900,189	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
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、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、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11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,797,703,529円
同期中追加設定元本額	22,635,548,105円
同期中一部解約元本額	51,244,162,080円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,818,839,727円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,611,745,342円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,584,242円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,990,833,199円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,782,946,869円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,046,092,719円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	3,858,339円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	19,278,584円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	20,056,017円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,045,969,139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	20,264,104,361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)	1,850,681,197円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	177,743,758円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	185,894,961円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	197,316,755円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	420,167,790円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	61,557,909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)	83,246,186円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,088,654円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	9,357,908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)	3,488,696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)	5,931,944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)	24,032,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	116,171,721円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	81,387,246円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	172,610,529円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	184,868,914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)	3,979,672,502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)	20,369,721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)	61,987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)	130,455円
計	52,189,089,554円
2. 受益権の総数	52,189,089,554口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11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当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、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。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11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）」にて記載しております。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	6,145,255,613	
合計	6,145,255,613	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年2月23日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年11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	4,003,540,000	-	4,029,635,000	26,095,000
合計	4,003,540,000	-	4,029,635,000	26,095,000

（注）株価指数先物取引

1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2．株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

3．評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2929円 (22,929円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2021年11月22日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	2,000	3,045.00	6,090,000	
日本水産	56,100	601.00	33,716,100	
マルハニチロ	8,800	2,376.00	20,908,800	
雪国まいたけ	4,100	1,319.00	5,407,900	
カネコ種苗	2,000	1,414.00	2,828,000	
サカタのタネ	6,700	3,245.00	21,741,500	
ホクト	4,700	1,915.00	9,000,500	
ヒノキヤグループ	1,300	2,230.00	2,899,000	
ショーボンドホールディングス	8,000	5,030.00	40,240,000	

ミライト・ホールディングス	18,100	2,040.00	36,924,000
タマホーム	3,400	2,321.00	7,891,400
ファーストコーポレーション	3,900	756.00	2,948,400
スペースバリューホールディングス	5,900	1,146.00	6,761,400
住石ホールディングス	9,900	137.00	1,356,300
日鉄鉱業	1,300	6,490.00	8,437,000
三井松島ホールディングス	2,300	1,375.00	3,162,500
I N P E X	225,100	920.00	207,092,000
石油資源開発	6,600	2,255.00	14,883,000
K & O エナジーグループ	2,700	1,520.00	4,104,000
安藤・間	30,800	882.00	27,165,600
東急建設	16,400	684.00	11,217,600
コムシスホールディングス	18,100	2,706.00	48,978,600
ビーアールホールディングス	7,600	384.00	2,918,400
高松コンストラクショングループ	3,500	1,932.00	6,762,000
東建コーポレーション	1,700	9,270.00	15,759,000
ソネック	2,900	1,010.00	2,929,000
ヤマウラ	3,200	938.00	3,001,600
オリエンタル白石	18,900	242.00	4,573,800
大成建設	37,400	3,545.00	132,583,000
大林組	129,600	895.00	115,992,000
清水建設	121,400	747.00	90,685,800
飛島建設	3,500	1,030.00	3,605,000
長谷工コーポレーション	38,600	1,431.00	55,236,600
松井建設	5,100	744.00	3,794,400
銭高組	800	3,810.00	3,048,000
鹿島建設	94,900	1,333.00	126,501,700
不動テトラ	2,700	1,709.00	4,614,300
鉄建建設	2,800	1,793.00	5,020,400
西松建設	7,800	3,430.00	26,754,000
三井住友建設	29,200	414.00	12,088,800
大豊建設	1,900	3,720.00	7,068,000
佐田建設	6,100	483.00	2,946,300
ナカノフドー建設	8,700	346.00	3,010,200
奥村組	7,600	3,250.00	24,700,000
東鉄工業	6,000	2,366.00	14,196,000
浅沼組	1,500	5,500.00	8,250,000
戸田建設	53,800	709.00	38,144,200
熊谷組	6,600	2,718.00	17,938,800
北野建設	1,400	2,108.00	2,951,200
植木組	2,100	1,431.00	3,005,100
矢作建設工業	5,700	723.00	4,121,100
ピーエス三菱	4,700	625.00	2,937,500
日本ハウスホールディングス	8,800	382.00	3,361,600
大東建託	13,300	13,320.00	177,156,000
新日本建設	5,500	838.00	4,609,000
N I P P O	10,700	4,035.00	43,174,500
東亜道路工業	700	4,860.00	3,402,000
日本道路	1,300	7,910.00	10,283,000
東亜建設工業	3,200	2,492.00	7,974,400

日本国土開発	12,600	576.00	7,257,600
若築建設	2,200	2,037.00	4,481,400
東洋建設	14,500	561.00	8,134,500
五洋建設	51,400	708.00	36,391,200
世紀東急工業	6,200	815.00	5,053,000
福田組	1,400	4,155.00	5,817,000
住友林業	33,200	2,442.00	81,074,400
日本基礎技術	1,000	552.00	552,000
バコーポレーション	6,800	443.00	3,012,400
大和ハウス工業	119,600	3,451.00	412,739,600
ライト工業	8,200	2,034.00	16,678,800
積水ハウス	140,500	2,394.50	336,427,250
日特建設	4,300	683.00	2,936,900
北陸電気工事	2,900	1,001.00	2,902,900
ユアテック	7,400	632.00	4,676,800
日本リーテック	2,700	1,451.00	3,917,700
四電工	1,800	1,588.00	2,858,400
中電工	6,000	2,118.00	12,708,000
関電工	21,100	846.00	17,850,600
きんでん	28,900	1,745.00	50,430,500
東京エネシス	4,300	1,094.00	4,704,200
トーエネック	1,300	3,140.00	4,082,000
住友電設	3,200	2,011.00	6,435,200
日本電設工業	7,100	1,632.00	11,587,200
エクシオグループ	19,600	2,562.00	50,215,200
新日本空調	3,400	2,281.00	7,755,400
日本工営	2,300	3,490.00	8,027,000
九電工	10,000	3,535.00	35,350,000
三機工業	8,400	1,426.00	11,978,400
日揮ホールディングス	39,900	1,052.00	41,974,800
中外炉工業	1,700	1,689.00	2,871,300
ヤマト	3,800	787.00	2,990,600
太平電業	2,900	2,680.00	7,772,000
高砂熱学工業	11,700	1,994.00	23,329,800
三晃金属工業	1,200	2,421.00	2,905,200
NEC ネットエスアイ	13,400	1,917.00	25,687,800
朝日工業社	900	3,125.00	2,812,500
明星工業	8,400	665.00	5,586,000
大気社	6,300	2,981.00	18,780,300
ダイダン	2,900	2,207.00	6,400,300
日比谷総合設備	4,200	1,856.00	7,795,200
ニッポン	12,100	1,602.00	19,384,200
日清製粉グループ本社	46,900	1,720.00	80,668,000
昭和産業	3,900	2,768.00	10,795,200
鳥越製粉	4,000	745.00	2,980,000
中部飼料	4,700	1,020.00	4,794,000
フィード・ワン	5,600	750.00	4,200,000
日本甜菜製糖	2,200	1,632.00	3,590,400
DM三井製糖ホールディングス	3,800	1,955.00	7,429,000
塩水港精糖	13,500	216.00	2,916,000

日新製糖	2,000	1,666.00	3,332,000	
L I F U L L	12,100	270.00	3,267,000	
ミクシィ	9,000	2,280.00	20,520,000	
ジェイエシーリクルートメント	3,200	2,211.00	7,075,200	
日本M&Aセンターホールディングス	64,800	3,645.00	236,196,000	
メンバーズ	1,200	2,469.00	2,962,800	
UTグループ	5,700	4,480.00	25,536,000	
アイティメディア	1,900	2,197.00	4,174,300	
夢真ビーネックスグループ	10,500	1,740.00	18,270,000	
コシダカホールディングス	10,600	664.00	7,038,400	
アルトナー	3,400	837.00	2,845,800	
パソナグループ	4,300	3,650.00	15,695,000	
C D S	1,800	1,618.00	2,912,400	
リンクアンドモチベーション	8,700	884.00	7,690,800	
エス・エム・エス	13,400	4,565.00	61,171,000	
サニーサイドアップグループ	3,800	772.00	2,933,600	
パーソルホールディングス	39,500	3,555.00	140,422,500	
クックパッド	12,400	270.00	3,348,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,400	659.00	2,899,600	
森永製菓	9,700	3,930.00	38,121,000	
中村屋	1,000	3,705.00	3,705,000	
江崎グリコ	11,400	3,700.00	42,180,000	
名糖産業	1,900	1,720.00	3,268,000	
井村屋グループ	2,400	2,305.00	5,532,000	
不二家	2,300	2,303.00	5,296,900	
山崎製パン	31,100	1,581.00	49,169,100	
モロゾフ	700	5,530.00	3,871,000	
亀田製菓	2,400	4,385.00	10,524,000	
寿スピリッツ	4,000	7,190.00	28,760,000	
カルビー	18,900	2,726.00	51,521,400	
森永乳業	7,700	5,770.00	44,429,000	
六甲バター	3,000	1,618.00	4,854,000	
ヤクルト本社	30,700	5,970.00	183,279,000	
明治ホールディングス	27,400	7,030.00	192,622,000	
雪印メグミルク	10,000	2,049.00	20,490,000	
プリマハム	5,200	2,556.00	13,291,200	
日本ハム	15,800	3,890.00	61,462,000	
林兼産業	5,200	560.00	2,912,000	
丸大食品	4,100	1,522.00	6,240,200	
S F o o d s	3,700	3,385.00	12,524,500	
柿安本店	1,400	2,680.00	3,752,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	659.00	17,595,300	
学情	2,200	1,235.00	2,717,000	
スタジオアリス	1,800	2,167.00	3,900,600	
シミックホールディングス	2,200	1,587.00	3,491,400	
システナ	14,500	2,097.00	30,406,500	
N J S	1,500	1,984.00	2,976,000	
デジタルアーツ	2,200	10,500.00	23,100,000	
日鉄ソリューションズ	5,900	3,580.00	21,122,000	
総合警備保障	15,700	5,080.00	79,756,000	

キューブシステム	3,000	994.00	2,982,000	
いちご	45,400	310.00	14,074,000	
日本駐車場開発	44,700	141.00	6,302,700	
コア	1,800	1,677.00	3,018,600	
カカクコム	29,200	3,635.00	106,142,000	
アイロムグループ	1,600	1,827.00	2,923,200	
セントケア・ホールディング	3,600	815.00	2,934,000	
ルネサンス	2,700	1,287.00	3,474,900	
ディップ	6,900	4,590.00	31,671,000	
SBSホールディングス	3,100	3,590.00	11,129,000	
デジタルホールディングス	2,700	1,508.00	4,071,600	
新日本科学	4,800	1,742.00	8,361,600	
ベネフィット・ワン	14,400	5,600.00	80,640,000	
エムスリー	69,700	6,476.00	451,377,200	
ツカダ・グローバルホールディング	9,200	317.00	2,916,400	
アウトソーシング	22,600	1,553.00	35,097,800	
ウェルネット	5,800	495.00	2,871,000	
ワールドホールディングス	1,600	2,708.00	4,332,800	
ディー・エヌ・エー	15,000	1,801.00	27,015,000	
博報堂DYホールディングス	55,000	1,778.00	97,790,000	
ぐるなび	6,500	554.00	3,601,000	
ファンコミュニケーションズ	9,900	424.00	4,197,600	
ビジネス・ブレークスルー	6,400	450.00	2,880,000	
エスプール	11,100	1,286.00	14,274,600	
WDBホールディングス	1,800	3,375.00	6,075,000	
手間いらず	500	6,040.00	3,020,000	
アドウェイズ	5,900	868.00	5,121,200	
バリューコマース	3,100	5,010.00	15,531,000	
インフォマート	43,300	1,060.00	45,898,000	
サッポロホールディングス	14,200	2,302.00	32,688,400	
アサヒグループホールディングス	97,600	4,546.00	443,689,600	
キリンホールディングス	152,400	1,865.50	284,302,200	
宝ホールディングス	28,200	1,350.00	38,070,000	
オエノンホールディングス	11,800	370.00	4,366,000	
養命酒製造	1,600	1,799.00	2,878,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	29,100	1,442.00	41,962,200	
サントリー食品インターナショナル	27,700	4,430.00	122,711,000	
ダイドーグループホールディングス	2,100	5,290.00	11,109,000	
伊藤園	12,600	7,550.00	95,130,000	
キーコーヒー	4,100	2,017.00	8,269,700	
日清オイリオグループ	5,200	2,930.00	15,236,000	
不二製油グループ本社	9,000	2,432.00	21,888,000	
J・オイルミルズ	3,900	1,721.00	6,711,900	
ローソン	9,000	5,850.00	52,650,000	
サンエー	3,100	4,210.00	13,051,000	
カワチ薬品	3,200	2,270.00	7,264,000	
エービーシー・マート	6,400	5,540.00	35,456,000	
ハードオフコーポレーション	3,900	747.00	2,913,300	
アスクル	6,600	1,570.00	10,362,000	

ゲオホールディングス	5,400	1,200.00	6,480,000
アダストリア	4,400	1,987.00	8,742,800
オルバヘルスケアホールディングス	1,900	1,577.00	2,996,300
伊藤忠食品	1,000	5,090.00	5,090,000
くら寿司	4,200	3,970.00	16,674,000
キャンドウ	1,900	2,318.00	4,404,200
エレマテック	3,300	1,021.00	3,369,300
アイケイ	6,200	473.00	2,932,600
パルグループホールディングス	3,600	1,602.00	5,767,200
JALUX	1,200	2,555.00	3,066,000
エディオン	18,700	1,044.00	19,522,800
あらた	3,200	4,100.00	13,120,000
サーラコーポレーション	8,300	613.00	5,087,900
トーマンデバイス	600	7,290.00	4,374,000
ハローズ	1,900	2,767.00	5,257,300
J Pホールディングス	11,100	258.00	2,863,800
フジオフードグループ本社	3,400	1,418.00	4,821,200
あみやき亭	1,000	2,982.00	2,982,000
東京エレクトロン デバイス	1,200	7,340.00	8,808,000
双日	45,000	1,690.00	76,050,000
アルフレッサ ホールディングス	45,200	1,592.00	71,958,400
大黒天物産	1,300	6,500.00	8,450,000
ハニーズホールディングス	3,200	1,073.00	3,433,600
キッコーマン	29,800	9,370.00	279,226,000
味の素	91,600	3,492.00	319,867,200
ブルドックソース	1,700	2,147.00	3,649,900
キューピー	21,800	2,464.00	53,715,200
ハウス食品グループ本社	15,500	2,981.00	46,205,500
カゴメ	15,700	2,933.00	46,048,100
アリアケジャパン	3,800	6,690.00	25,422,000
ピエトロ	1,600	1,786.00	2,857,600
ニチレイ	19,800	2,669.00	52,846,200
横浜冷凍	11,400	842.00	9,598,800
東洋水産	19,900	4,715.00	93,828,500
イートアンドホールディングス	1,600	2,184.00	3,494,400
大冷	1,500	1,937.00	2,905,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,000	725.00	2,900,000
日清食品ホールディングス	16,300	8,680.00	141,484,000
永谷園ホールディングス	1,800	1,920.00	3,456,000
一正蒲鉾	3,200	902.00	2,886,400
フジッコ	4,500	1,917.00	8,626,500
ロック・フィールド	4,500	1,532.00	6,894,000
日本たばこ産業	222,300	2,309.00	513,290,700
ケンコーマヨネーズ	2,300	1,353.00	3,111,900
わらべや日洋ホールディングス	2,700	1,991.00	5,375,700
なとり	2,300	1,926.00	4,429,800
ピククルスコーポレーション	2,000	1,851.00	3,702,000
ファーマフーズ	3,900	2,606.00	10,163,400
北の達人コーポレーション	14,500	395.00	5,727,500
ユーグレナ	21,100	921.00	19,433,100

紀文食品	2,800	1,065.00	2,982,000
スター・マイカ・ホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600
S R Eホールディングス	1,000	10,190.00	10,190,000
A Dワークスグループ	18,400	160.00	2,944,000
片倉工業	4,500	2,200.00	9,900,000
グンゼ	2,700	4,170.00	11,259,000
ヒューリック	97,300	1,127.00	109,657,100
ラサ商事	3,200	919.00	2,940,800
アルペン	3,100	2,334.00	7,235,400
ハブ	4,000	716.00	2,864,000
ラクーンホールディングス	2,900	1,682.00	4,877,800
クオールホールディングス	5,000	1,456.00	7,280,000
アルコニックス	4,300	1,586.00	6,819,800
神戸物産	31,600	4,155.00	131,298,000
ソリトンシステムズ	2,300	1,293.00	2,973,900
ジーンズホールディングス	2,800	7,100.00	19,880,000
ビックカメラ	24,100	990.00	23,859,000
D C Mホールディングス	25,100	1,092.00	27,409,200
ハイパー	5,300	556.00	2,946,800
M o n o t a R O	51,400	2,365.00	121,561,000
東京一番フーズ	4,900	597.00	2,925,300
あい ホールディングス	5,800	2,052.00	11,901,600
ディー・ブイエックス	2,700	1,066.00	2,878,200
アークランドサービスホールディングス	3,000	2,293.00	6,879,000
J . フロント リテイリング	48,600	1,013.00	49,231,800
ドトール・日レスホールディングス	7,000	1,604.00	11,228,000
マツキヨココカラ&カンパニー	25,000	4,690.00	117,250,000
ブロンコビリー	2,300	2,438.00	5,607,400
Z O Z O	28,000	3,910.00	109,480,000
トレジャー・ファクトリー	3,100	970.00	3,007,000
物語コーポレーション	2,200	7,700.00	16,940,000
三越伊勢丹ホールディングス	71,200	827.00	58,882,400
東洋紡	16,000	1,320.00	21,120,000
ユニチカ	11,100	306.00	3,396,600
富士紡ホールディングス	1,800	4,100.00	7,380,000
日清紡ホールディングス	25,300	854.00	21,606,200
倉敷紡績	3,500	1,891.00	6,618,500
ダイワボウホールディングス	19,800	2,044.00	40,471,200
日東紡績	6,100	3,000.00	18,300,000
トヨタ紡織	16,900	2,341.00	39,562,900
マクニカ・富士エレホールディングス	9,700	2,832.00	27,470,400
H a m e e	2,400	1,245.00	2,988,000
マーケットエンタープライズ	4,100	1,016.00	4,165,600
ラクト・ジャパン	1,400	2,545.00	3,563,000
ウエルシアホールディングス	21,500	4,320.00	92,880,000
クリエイトSDホールディングス	6,000	3,375.00	20,250,000
グリムス	1,800	2,961.00	5,329,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,100	805.00	5,715,500

八洲電機	3,200	913.00	2,921,600
メディアスホールディングス	3,100	950.00	2,945,000
レスターホールディングス	3,900	1,905.00	7,429,500
ジュテックホールディングス	2,600	1,119.00	2,909,400
丸善CHIホールディングス	7,900	375.00	2,962,500
OCHIホールディングス	2,300	1,294.00	2,976,200
TOKAIホールディングス	19,700	879.00	17,316,300
ミサワ	4,300	694.00	2,984,200
ティーライフ	2,000	1,470.00	2,940,000
Cominix	4,100	726.00	2,976,600
三洋貿易	4,100	1,001.00	4,104,100
シュッピン	3,400	1,059.00	3,600,600
オイシックス・ラ・大地	5,900	3,620.00	21,358,000
ウイン・パートナーズ	3,200	925.00	2,960,000
ネクステージ	8,200	2,265.00	18,573,000
ジョイフル本田	11,900	1,624.00	19,325,600
ホットランド	3,000	1,365.00	4,095,000
すかいらーくホールディングス	52,500	1,527.00	80,167,500
SFPホールディングス	2,000	1,444.00	2,888,000
綿半ホールディングス	3,100	1,237.00	3,834,700
日本毛織	12,200	920.00	11,224,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	11,800	1,028.00	12,130,400
三栄建築設計	1,700	1,741.00	2,959,700
野村不動産ホールディングス	21,100	2,681.00	56,569,100
三重交通グループホールディングス	8,300	478.00	3,967,400
サムティ	6,600	2,526.00	16,671,600
ディア・ライフ	5,200	550.00	2,860,000
コーセーアールイー	4,300	697.00	2,997,100
日本商業開発	2,600	1,797.00	4,672,200
プレサンスコーポレーション	5,300	1,735.00	9,195,500
日本管理センター	2,600	1,111.00	2,888,600
サンセイランディック	3,600	809.00	2,912,400
エストラスト	4,700	619.00	2,909,300
フージャースホールディングス	5,200	658.00	3,421,600
オープンハウス	12,900	7,030.00	90,687,000
東急不動産ホールディングス	120,000	643.00	77,160,000
飯田グループホールディングス	34,000	2,504.00	85,136,000
イーランド	1,800	1,750.00	3,150,000
ムゲンエステート	5,800	504.00	2,923,200
帝国繊維	4,600	2,052.00	9,439,200
日本コークス工業	34,900	127.00	4,432,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	1,031.00	2,886,800
BENOS	2,100	3,090.00	6,489,000
あさひ	3,400	1,361.00	4,627,400
日本調剤	2,500	1,408.00	3,520,000
コスモス薬品	4,100	19,400.00	79,540,000
シップヘルスケアホールディングス	13,000	2,653.00	34,489,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,800	4,345.00	7,821,000
セブン&アイ・ホールディングス	159,200	4,777.00	760,498,400

クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	21,700	710.00	15,407,000	
明治電機工業	2,300	1,308.00	3,008,400	
ツルハホールディングス	8,900	14,260.00	126,914,000	
サンマルクホールディングス	3,200	1,456.00	4,659,200	
フェリシモ	2,100	1,445.00	3,034,500	
トリドールホールディングス	10,100	2,479.00	25,037,900	
帝人	38,100	1,410.00	53,721,000	
東レ	293,000	718.30	210,461,900	
クラレ	59,200	1,019.00	60,324,800	
旭化成	268,200	1,135.50	304,541,100	
TOKYO BASE	3,700	790.00	2,923,000	
稲葉製作所	2,300	1,384.00	3,183,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,200	2,954.00	3,544,800	
トーカロ	10,500	1,617.00	16,978,500	
アルファ	2,400	1,201.00	2,882,400	
SUMCO	62,900	2,542.00	159,891,800	
川田テクノロジーズ	800	3,780.00	3,024,000	
RS Technologies	1,300	7,040.00	9,152,000	
ファーストブラザーズ	2,900	1,012.00	2,934,800	
ハウズドゥ	2,800	1,002.00	2,805,600	
ケイアイスター不動産	1,800	9,020.00	16,236,000	
グッドコムアセット	500	1,385.00	692,500	
ジェイ・エス・ビー	1,000	2,941.00	2,941,000	
日本フェルト	6,800	437.00	2,971,600	
芦森工業	3,000	957.00	2,871,000	
アツギ	4,400	681.00	2,996,400	
ウイルプラスホールディングス	3,000	895.00	2,685,000	
JMホールディングス	2,700	1,831.00	4,943,700	
コメダホールディングス	8,900	2,019.00	17,969,100	
アレンザホールディングス	3,100	1,105.00	3,425,500	
バロックジャパンリミテッド	3,300	873.00	2,880,900	
クスリのアオキホールディングス	4,000	7,730.00	30,920,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	23,800	5,100.00	121,380,000	
アセンテック	2,400	1,280.00	3,072,000	
セーレン	8,300	2,306.00	19,139,800	
ソトー	3,400	860.00	2,924,000	
東海染工	2,600	1,139.00	2,961,400	
小松マテーレ	6,600	1,197.00	7,900,200	
ワコールホールディングス	10,100	2,115.00	21,361,500	
ホギメディカル	5,500	3,135.00	17,242,500	
クラウドシアホールディングス	10,400	279.00	2,901,600	
TSIホールディングス	13,500	362.00	4,887,000	
マツオカコーポレーション	700	1,421.00	994,700	
ワールド	5,300	1,297.00	6,874,100	
TIS	38,700	3,550.00	137,385,000	
グリー	24,900	1,044.00	25,995,600	
コーエーテクモホールディングス	12,900	5,070.00	65,403,000	
三菱総合研究所	1,700	3,925.00	6,672,500	

電算	1,300	2,387.00	3,103,100	
A G S	3,400	872.00	2,964,800	
ファインデックス	3,400	1,068.00	3,631,200	
ブレインパッド	1,000	6,290.00	6,290,000	
K L a b	7,400	683.00	5,054,200	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	1,028.00	6,065,200	
イーブックイニシアティブジャパン	700	4,720.00	3,304,000	
ネクソン	91,300	2,497.00	227,976,100	
アイスタイル	12,400	313.00	3,881,200	
エムアップホールディングス	1,200	4,580.00	5,496,000	
エイチーム	2,800	1,255.00	3,514,000	
エニグモ	4,400	1,047.00	4,606,800	
テクノスジャパン	5,200	576.00	2,995,200	
コロプラ	13,300	761.00	10,121,300	
ブロードリーフ	20,100	527.00	10,592,700	
デジタルハーツホールディングス	1,800	2,551.00	4,591,800	
システム情報	3,000	1,027.00	3,081,000	
メディアドゥ	1,400	5,110.00	7,154,000	
じげん	11,500	347.00	3,990,500	
ブイキューブ	4,100	1,260.00	5,166,000	
サイバーリンクス	2,500	1,191.00	2,977,500	
フィックスターズ	4,300	877.00	3,771,100	
C A R T A H O L D I N G S	1,600	2,267.00	3,627,200	
オブティム	2,800	1,643.00	4,600,400	
セレス	1,500	2,496.00	3,744,000	
S H I F T	2,000	29,470.00	58,940,000	
特種東海製紙	2,500	4,190.00	10,475,000	
ティーガイア	3,600	1,756.00	6,321,600	
テクマトリックス	6,900	2,034.00	14,034,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11,000	2,840.00	31,240,000	
G M O ペイメントゲートウェイ	7,900	16,670.00	131,693,000	
ザッパラス	5,000	586.00	2,930,000	
インターネットイニシアティブ	10,800	4,875.00	52,650,000	
さくらインターネット	5,200	575.00	2,990,000	
ヴィンクス	3,100	924.00	2,864,400	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	900	4,565.00	4,108,500	
S R A ホールディングス	2,000	2,929.00	5,858,000	
朝日ネット	4,400	673.00	2,961,200	
e B A S E	4,800	683.00	3,278,400	
アバント	4,300	1,413.00	6,075,900	
アドソル日進	1,500	1,924.00	2,886,000	
フリービット	2,400	1,298.00	3,115,200	
コムチュア	4,500	3,430.00	15,435,000	
サイバーコム	2,300	1,260.00	2,898,000	
アステリア	1,100	929.00	1,021,900	
アイル	2,200	1,663.00	3,658,600	
王子ホールディングス	169,200	568.00	96,105,600	

日本製紙	19,400	1,135.00	22,019,000	
三菱製紙	5,700	331.00	1,886,700	
北越コーポレーション	26,500	824.00	21,836,000	
大王製紙	19,500	1,885.00	36,757,500	
阿波製紙	7,900	385.00	3,041,500	
マークライNZ	2,000	3,115.00	6,230,000	
メディカル・データ・ビジョン	5,100	1,531.00	7,808,100	
g u m i	5,600	888.00	4,972,800	
テラスカイ	1,500	2,435.00	3,652,500	
デジタル・インフォメーション・テク ノロジー	1,900	1,589.00	3,019,100	
P R T I M E S	900	3,505.00	3,154,500	
ラクス	13,900	3,620.00	50,318,000	
ランドコンピュータ	3,400	856.00	2,910,400	
ダブルスタンダード	1,200	4,355.00	5,226,000	
オープンドア	2,400	2,178.00	5,227,200	
アカツキ	1,800	2,923.00	5,261,400	
U b i c o mホールディングス	1,100	3,070.00	3,377,000	
カナミックネットワーク	5,200	552.00	2,870,400	
ノムラシステムコーポレーション	11,100	267.00	2,963,700	
レンゴー	38,200	820.00	31,324,000	
トーモク	2,500	1,870.00	4,675,000	
ザ・バック	3,100	2,832.00	8,779,200	
チェンジ	7,500	2,539.00	19,042,500	
シンクロ・フード	7,300	412.00	3,007,600	
オークネット	2,200	1,818.00	3,999,600	
キャピタル・アセット・プランニング	3,500	795.00	2,782,500	
マクロミル	8,300	920.00	7,636,000	
ビーグリー	1,600	1,791.00	2,865,600	
オロ	1,300	3,725.00	4,842,500	
ユーザーローカル	1,500	1,907.00	2,860,500	
マネーフォワード	6,100	8,500.00	51,850,000	
昭和電工	35,100	2,676.00	93,927,600	
住友化学	297,300	556.00	165,298,800	
住友精化	1,800	3,135.00	5,643,000	
日産化学	22,000	7,150.00	157,300,000	
ラサ工業	1,600	1,797.00	2,875,200	
クレハ	3,200	8,460.00	27,072,000	
多木化学	1,600	6,050.00	9,680,000	
テイカ	3,000	1,235.00	3,705,000	
石原産業	6,700	1,325.00	8,877,500	
片倉コープアグリ	900	1,164.00	1,047,600	
日本曹達	5,200	3,310.00	17,212,000	
東ソー	58,400	1,761.00	102,842,400	
トクヤマ	12,900	1,941.00	25,038,900	
セントラル硝子	6,600	2,104.00	13,886,400	
東亜合成	23,000	1,255.00	28,865,000	
大阪ソーダ	3,800	2,720.00	10,336,000	
関東電化工業	8,900	1,051.00	9,353,900	
デンカ	14,800	3,565.00	52,762,000	

イビデン	21,700	7,000.00	151,900,000
信越化学工業	69,500	20,070.00	1,394,865,000
日本カーバイド工業	2,200	1,318.00	2,899,600
電算システムホールディングス	1,700	2,462.00	4,185,400
堺化学工業	2,800	2,252.00	6,305,600
第一稀元素化学工業	3,800	1,522.00	5,783,600
エア・ウォーター	38,300	1,763.00	67,522,900
日本酸素ホールディングス	38,900	2,684.00	104,407,600
日本化学工業	1,300	2,743.00	3,565,900
日本パーカライジング	20,400	1,115.00	22,746,000
高圧ガス工業	6,400	765.00	4,896,000
四国化成工業	5,300	1,380.00	7,314,000
戸田工業	900	3,635.00	3,271,500
ステラ ケミファ	2,000	2,717.00	5,434,000
保土谷化学工業	1,300	4,915.00	6,389,500
日本触媒	6,800	5,490.00	37,332,000
大日精化工業	3,300	2,269.00	7,487,700
カネカ	10,500	3,995.00	41,947,500
協和キリン	48,500	3,375.00	163,687,500
三菱瓦斯化学	37,600	2,001.00	75,237,600
三井化学	36,800	3,310.00	121,808,000
J S R	37,700	4,320.00	162,864,000
東京応化工業	6,900	7,670.00	52,923,000
大阪有機化学工業	3,400	3,965.00	13,481,000
三菱ケミカルホールディングス	270,500	948.90	256,677,450
K Hネオケム	6,700	3,450.00	23,115,000
ダイセル	58,300	831.00	48,447,300
住友ベークライト	6,400	5,550.00	35,520,000
積水化学工業	84,700	1,898.00	160,760,600
日本ゼオン	36,500	1,327.00	48,435,500
アイカ工業	11,300	3,340.00	37,742,000
宇部興産	19,100	2,019.00	38,562,900
積水樹脂	6,100	2,110.00	12,871,000
タキロンシーアイ	8,800	547.00	4,813,600
旭有機材	2,300	1,482.00	3,408,600
ニチバン	2,400	1,890.00	4,536,000
リケンテクノス	9,900	521.00	5,157,900
大倉工業	2,100	2,152.00	4,519,200
積水化成成品工業	5,700	510.00	2,907,000
群栄化学工業	900	3,405.00	3,064,500
ダイキョーニシカワ	8,500	567.00	4,819,500
森六ホールディングス	2,200	1,761.00	3,874,200
恵和	1,000	6,440.00	6,440,000
日本化薬	31,900	1,218.00	38,854,200
カーリットホールディングス	4,000	747.00	2,988,000
レグス	1,900	1,532.00	2,910,800
プレステージ・インターナショナル	14,800	750.00	11,100,000
プロトコーポレーション	4,300	1,343.00	5,774,900
ハイマックス	2,500	1,150.00	2,875,000
アミューズ	2,200	2,010.00	4,422,000

野村総合研究所	78,300	5,040.00	394,632,000	
ドリームインキュベータ	3,600	831.00	2,991,600	
サイバネットシステム	4,100	741.00	3,038,100	
クイック	2,700	1,467.00	3,960,900	
T A C	12,000	237.00	2,844,000	
C Eホールディングス	5,800	505.00	2,929,000	
電通グループ	40,700	3,990.00	162,393,000	
インテージホールディングス	5,100	1,914.00	9,761,400	
東邦システムサイエンス	2,900	1,000.00	2,900,000	
ぴあ	1,400	4,170.00	5,838,000	
イオンファンタジー	1,500	1,915.00	2,872,500	
ソースネクスト	17,500	208.00	3,640,000	
シーティーエス	4,500	836.00	3,762,000	
ネクシィーズグループ	3,600	831.00	2,991,600	
インフォコム	4,400	2,087.00	9,182,800	
メディカルシステムネットワーク	4,800	622.00	2,985,600	
日本精化	3,300	2,000.00	6,600,000	
扶桑化学工業	3,600	5,150.00	18,540,000	
トリケミカル研究所	4,200	3,710.00	15,582,000	
シンプレクス・ホールディングス	4,200	2,851.00	11,974,200	
HEROZ	1,700	1,653.00	2,810,100	
ラクスル	4,400	6,910.00	30,404,000	
F I G	9,200	362.00	3,330,400	
A D E K A	18,600	2,516.00	46,797,600	
日油	13,800	5,990.00	82,662,000	
ミヨシ油脂	2,200	1,317.00	2,897,400	
新日本理化	10,700	271.00	2,899,700	
ハリマ化成グループ	3,500	839.00	2,936,500	
イーソル	3,900	741.00	2,889,900	
アルテリア・ネットワークス	5,100	1,625.00	8,287,500	
E D U L A B	2,000	1,408.00	2,816,000	
ウイングアーク1 s t	2,300	2,169.00	4,988,700	
サーバーワークス	700	4,180.00	2,926,000	
トピラシステムズ	2,900	1,000.00	2,900,000	
S a n s a n	3,600	14,000.00	50,400,000	
ギフティ	3,500	3,385.00	11,847,500	
花王	91,400	6,219.00	568,416,600	
第一工業製薬	1,500	3,255.00	4,882,500	
石原ケミカル	2,200	1,349.00	2,967,800	
日華化学	3,300	897.00	2,960,100	
三洋化成工業	2,400	5,430.00	13,032,000	
ベース	700	4,700.00	3,290,000	
武田薬品工業	324,800	3,185.00	1,034,488,000	
アステラス製薬	358,200	1,953.50	699,743,700	
大日本住友製薬	25,500	1,478.00	37,689,000	
塩野義製薬	52,000	8,083.00	420,316,000	
わかもと製薬	9,400	317.00	2,979,800	
日本新薬	10,800	8,760.00	94,608,000	
中外製薬	129,200	4,168.00	538,505,600	
科研製薬	6,500	4,260.00	27,690,000	

エーザイ	49,500	7,326.00	362,637,000
理研ビタミン	4,300	1,645.00	7,073,500
ロート製薬	21,200	3,385.00	71,762,000
小野薬品工業	94,900	2,461.50	233,596,350
久光製薬	10,900	4,025.00	43,872,500
有機合成薬品工業	10,000	295.00	2,950,000
持田製薬	5,200	3,355.00	17,446,000
参天製薬	77,000	1,569.00	120,813,000
扶桑薬品工業	1,500	2,609.00	3,913,500
ツムラ	12,800	3,530.00	45,184,000
日医工	12,800	700.00	8,960,000
テルモ	117,000	5,022.00	587,574,000
H・U・グループホールディングス	10,300	2,744.00	28,263,200
キッセイ薬品工業	7,300	2,234.00	16,308,200
生化学工業	7,300	976.00	7,124,800
栄研化学	7,300	1,888.00	13,782,400
日水製薬	1,200	960.00	1,152,000
鳥居薬品	2,200	2,936.00	6,459,200
JCRファーマ	11,600	2,661.00	30,867,600
東和薬品	5,900	2,809.00	16,573,100
富士製薬工業	2,600	1,104.00	2,870,400
ゼリア新薬工業	7,500	2,006.00	15,045,000
第一三共	324,700	3,000.00	974,100,000
キョーリン製薬ホールディングス	8,300	1,729.00	14,350,700
大幸薬品	6,200	828.00	5,133,600
ダイト	2,600	2,977.00	7,740,200
大塚ホールディングス	85,900	4,158.00	357,172,200
大正製薬ホールディングス	9,800	5,810.00	56,938,000
ペプチドリーム	21,700	2,941.00	63,819,700
大日本塗料	5,000	836.00	4,180,000
日本ペイントホールディングス	152,000	1,247.00	189,544,000
関西ペイント	42,000	2,774.00	116,508,000
中国塗料	9,500	872.00	8,284,000
日本特殊塗料	3,200	907.00	2,902,400
藤倉化成	5,800	515.00	2,987,000
太陽ホールディングス	6,000	3,350.00	20,100,000
DIC	17,100	3,070.00	52,497,000
サカタインクス	8,000	999.00	7,992,000
東洋インキSCホールディングス	8,600	1,975.00	16,985,000
T&K TOKA	3,600	810.00	2,916,000
アルプス技研	3,500	2,015.00	7,052,500
日本空調サービス	4,100	788.00	3,230,800
オリエンタルランド	46,700	19,470.00	909,249,000
フォーカスシステムズ	2,700	1,116.00	3,013,200
ダスキン	9,200	2,706.00	24,895,200
パーク24	21,900	1,802.00	39,463,800
明光ネットワークジャパン	5,100	555.00	2,830,500
ファルコホールディングス	1,900	1,746.00	3,317,400
クレスコ	3,000	2,062.00	6,186,000
フジ・メディア・ホールディングス	39,100	1,240.00	48,484,000

秀英予備校	7,100	415.00	2,946,500
ラウンドワン	11,000	1,394.00	15,334,000
リゾートトラスト	18,100	2,052.00	37,141,200
オービック	12,800	21,960.00	281,088,000
ジャストシステム	5,800	5,850.00	33,930,000
TDCソフト	3,500	1,247.00	4,364,500
Zホールディングス	589,300	835.00	492,065,500
ビー・エム・エル	5,100	3,700.00	18,870,000
トレンドマイクロ	21,700	6,870.00	149,079,000
りらいあコミュニケーションズ	6,000	1,091.00	6,546,000
IDホールディングス	3,300	884.00	2,917,200
リソー教育	18,000	430.00	7,740,000
日本オラクル	8,200	10,540.00	86,428,000
早稲田アカデミー	2,900	1,033.00	2,995,700
アルファシステムズ	1,100	4,110.00	4,521,000
フューチャー	4,300	4,175.00	17,952,500
CAC Holdings	2,400	1,599.00	3,837,600
SBテクノロジー	1,800	3,005.00	5,409,000
トーセ	3,900	748.00	2,917,200
ユー・エス・エス	44,200	1,819.00	80,399,800
オービックビジネスコンサルタント	3,900	5,440.00	21,216,000
伊藤忠テクノソリューションズ	18,500	3,815.00	70,577,500
アイティフォー	4,900	846.00	4,145,400
東京個別指導学院	4,400	665.00	2,926,000
東計電算	600	4,940.00	2,964,000
サイバーエージェント	97,300	2,182.00	212,308,600
楽天グループ	202,700	1,269.00	257,226,300
クリーク・アンド・リバー社	2,100	2,128.00	4,468,800
モーニングスター	6,900	560.00	3,864,000
テー・オー・ダブリュー	8,400	342.00	2,872,800
大塚商会	21,900	5,530.00	121,107,000
サイボウズ	5,400	2,361.00	12,749,400
山田コンサルティンググループ	2,400	1,203.00	2,887,200
セントラルスポーツ	1,500	2,625.00	3,937,500
電通国際情報サービス	5,900	3,865.00	22,803,500
ACCESS	4,600	841.00	3,868,600
デジタルガレージ	6,700	5,210.00	34,907,000
イーエムシステムズ	6,700	763.00	5,112,100
ウェザーニューズ	1,200	9,700.00	11,640,000
CIJ	3,500	840.00	2,940,000
ビジネスエンジニアリング	800	3,510.00	2,808,000
日本エンタープライズ	15,000	193.00	2,895,000
WOWOW	1,900	2,093.00	3,976,700
スカラ	4,700	652.00	3,064,400
フルキャストホールディングス	3,400	2,902.00	9,866,800
エン・ジャパン	6,400	3,875.00	24,800,000
あすか製薬ホールディングス	4,700	1,020.00	4,794,000
サワイグループホールディングス	9,000	4,470.00	40,230,000
富士フイルムホールディングス	72,600	9,356.00	679,245,600
コニカミノルタ	90,300	486.00	43,885,800

資生堂	77,000	7,341.00	565,257,000	
ライオン	49,900	1,764.00	88,023,600	
高砂香料工業	2,800	2,700.00	7,560,000	
マンダム	8,700	1,561.00	13,580,700	
ミルボン	5,100	6,090.00	31,059,000	
ファンケル	16,700	3,615.00	60,370,500	
コーセー	7,800	14,250.00	111,150,000	
コタ	2,600	1,520.00	3,952,000	
シーボン	1,700	1,768.00	3,005,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	17,600	2,188.00	38,508,800	
ノエビアホールディングス	3,500	5,670.00	19,845,000	
アジュバンホールディングス	2,500	1,189.00	2,972,500	
エステー	2,700	1,547.00	4,176,900	
アグロ カネショウ	2,300	1,315.00	3,024,500	
コニシ	6,800	1,722.00	11,709,600	
長谷川香料	7,100	2,999.00	21,292,900	
星光PMC	3,900	766.00	2,987,400	
小林製薬	11,600	9,500.00	110,200,000	
荒川化学工業	3,400	1,192.00	4,052,800	
メック	3,100	4,215.00	13,066,500	
日本高純度化学	1,100	2,709.00	2,979,900	
タカラバイオ	10,800	2,768.00	29,894,400	
JCU	4,600	5,010.00	23,046,000	
新田ゼラチン	4,800	616.00	2,956,800	
デクセリアルズ	10,700	3,545.00	37,931,500	
アース製薬	3,400	6,460.00	21,964,000	
北興化学工業	3,800	920.00	3,496,000	
大成ラミック	1,300	2,870.00	3,731,000	
クミアイ化学工業	15,400	861.00	13,259,400	
日本農薬	7,400	502.00	3,714,800	
ニチレキ	5,300	1,278.00	6,773,400	
ユシロ化学工業	2,700	1,091.00	2,945,700	
富士石油	10,300	245.00	2,523,500	
MORESCO	2,600	1,137.00	2,956,200	
出光興産	45,900	2,979.00	136,736,100	
ENEOSホールディングス	621,600	432.30	268,717,680	
コスモエネルギーホールディングス	12,000	2,238.00	26,856,000	
テスホールディングス	2,400	2,788.00	6,691,200	
インフロニア・ホールディングス	55,200	1,005.00	55,476,000	
横浜ゴム	23,900	1,925.00	46,007,500	
TOYO TIRE	21,700	1,920.00	41,664,000	
ブリヂストン	119,000	4,930.00	586,670,000	
住友ゴム工業	37,100	1,229.00	45,595,900	
藤倉コンポジット	3,500	844.00	2,954,000	
オカモト	2,500	4,005.00	10,012,500	
アキレス	2,600	1,270.00	3,302,000	
フコク	1,600	984.00	1,574,400	
ニッタ	4,300	2,696.00	11,592,800	
住友理工	8,000	620.00	4,960,000	
三ツ星ベルト	5,000	1,993.00	9,965,000	

バンドー化学	6,700	891.00	5,969,700	
A G C	37,900	5,750.00	217,925,000	
日本板硝子	19,800	582.00	11,523,600	
有沢製作所	6,000	965.00	5,790,000	
日本山村硝子	3,800	800.00	3,040,000	
日本電気硝子	16,600	3,125.00	51,875,000	
住友大阪セメント	7,600	3,375.00	25,650,000	
太平洋セメント	23,500	2,340.00	54,990,000	
日本ヒューム	4,100	706.00	2,894,600	
日本コンクリート工業	10,800	276.00	2,980,800	
三谷セキサン	1,900	7,220.00	13,718,000	
アジアパイルホールディングス	6,700	435.00	2,914,500	
東海カーボン	34,600	1,277.00	44,184,200	
日本カーボン	2,200	4,335.00	9,537,000	
東洋炭素	2,700	3,115.00	8,410,500	
ノリタケカンパニーリミテド	2,300	4,860.00	11,178,000	
T O T O	29,500	5,510.00	162,545,000	
日本碍子	44,800	2,000.00	89,600,000	
日本特殊陶業	31,400	1,956.00	61,418,400	
M A R U W A	1,400	14,170.00	19,838,000	
品川リフラクトリーズ	1,000	3,620.00	3,620,000	
黒崎播磨	700	4,215.00	2,950,500	
ヨータイ	2,600	1,245.00	3,237,000	
イソライト工業	3,100	1,045.00	3,239,500	
ニッカトー	4,000	723.00	2,892,000	
フジインコーポレーテッド	3,400	7,470.00	25,398,000	
クニミネ工業	2,700	1,064.00	2,872,800	
ニチアス	9,600	2,644.00	25,382,400	
日本製鉄	182,900	1,862.00	340,559,800	
神戸製鋼所	76,300	592.00	45,169,600	
中山製鋼所	6,700	457.00	3,061,900	
合同製鉄	2,200	1,411.00	3,104,200	
ジェイ エフ イー ホールディング ス	110,300	1,411.00	155,633,300	
東京製鉄	13,900	1,313.00	18,250,700	
共英製鋼	4,600	1,345.00	6,187,000	
大和工業	7,800	3,710.00	28,938,000	
東京鐵鋼	2,200	1,334.00	2,934,800	
大阪製鉄	2,800	1,054.00	2,951,200	
淀川製鋼所	5,400	2,387.00	12,889,800	
丸一鋼管	14,500	2,560.00	37,120,000	
モリ工業	1,200	2,696.00	3,235,200	
大同特殊鋼	6,700	4,135.00	27,704,500	
日本高周波鋼業	6,100	369.00	2,250,900	
日本冶金工業	3,000	2,216.00	6,648,000	
山陽特殊製鋼	4,200	1,948.00	8,181,600	
愛知製鋼	2,300	2,621.00	6,028,300	
日立金属	44,000	2,134.00	93,896,000	
大平洋金属	2,500	2,211.00	5,527,500	
新日本電工	26,400	315.00	8,316,000	

日本製鋼所	12,400	3,410.00	42,284,000
三菱製鋼	2,900	1,019.00	2,955,100
日亜鋼業	10,500	278.00	2,919,000
日本精線	700	4,560.00	3,192,000
エンビプロ・ホールディングス	1,700	2,073.00	3,524,100
大紀アルミニウム工業所	6,200	1,464.00	9,076,800
日本軽金属ホールディングス	10,300	1,775.00	18,282,500
三井金属鉱業	11,000	3,070.00	33,770,000
東邦亜鉛	2,300	2,304.00	5,299,200
三菱マテリアル	27,000	2,071.00	55,917,000
住友金属鉱山	52,200	4,412.00	230,306,400
DOWAホールディングス	11,100	4,655.00	51,670,500
古河機械金属	6,700	1,225.00	8,207,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,700	874.00	4,107,800
東邦チタニウム	7,300	1,032.00	7,533,600
UACJ	6,200	2,618.00	16,231,600
CKサンエツ	600	3,390.00	2,034,000
古河電気工業	12,700	2,466.00	31,318,200
住友電気工業	152,800	1,626.50	248,529,200
フジクラ	45,500	603.00	27,436,500
昭和電線ホールディングス	3,600	1,988.00	7,156,800
東京特殊電線	1,000	2,799.00	2,799,000
タツタ電線	7,200	478.00	3,441,600
平河ヒューテック	2,500	1,188.00	2,970,000
リョービ	5,000	1,080.00	5,400,000
アーレスティ	7,400	400.00	2,960,000
アサヒホールディングス	16,400	2,020.00	33,128,000
東洋製罐グループホールディングス	26,000	1,477.00	38,402,000
ホッカンホールディングス	2,200	1,465.00	3,223,000
コロナ	3,300	907.00	2,993,100
横河ブリッジホールディングス	7,000	2,211.00	15,477,000
三和ホールディングス	38,500	1,307.00	50,319,500
文化シヤッター	13,000	1,060.00	13,780,000
三協立山	5,300	744.00	3,943,200
アルインコ	3,100	962.00	2,982,200
LIXIL	64,300	3,045.00	195,793,500
日本ファイルコン	5,100	575.00	2,932,500
ノーリツ	7,800	1,706.00	13,306,800
長府製作所	4,200	2,071.00	8,698,200
リンナイ	7,700	12,050.00	92,785,000
ユニプレス	6,200	774.00	4,798,800
ダイニチ工業	3,700	817.00	3,022,900
日東精工	5,100	623.00	3,177,300
三洋工業	1,600	1,884.00	3,014,400
岡部	8,300	692.00	5,743,600
ジーテクト	5,100	1,409.00	7,185,900
東プレ	7,600	1,188.00	9,028,800
高周波熱錬	7,300	584.00	4,263,200
東京製鋼	3,600	822.00	2,959,200
サンコール	6,200	472.00	2,926,400

モリテックスチール	7,300	409.00	2,985,700
パイオラックス	6,000	1,688.00	10,128,000
エイチワン	4,400	679.00	2,987,600
日本発条	37,600	859.00	32,298,400
三浦工業	17,700	4,255.00	75,313,500
タクマ	13,800	1,514.00	20,893,200
テクノプロ・ホールディングス	23,600	3,580.00	84,488,000
インターワークス	7,200	402.00	2,894,400
アイ・アールジャパンホールディングス	1,800	7,850.00	14,130,000
KeepPer 技研	2,500	2,803.00	7,007,500
三機サービス	2,900	997.00	2,891,300
Gunosy	4,700	626.00	2,942,200
イー・ガーディアン	1,600	3,770.00	6,032,000
リブセンス	13,400	214.00	2,867,600
ジャパンマテリアル	12,100	1,541.00	18,646,100
ベクトル	5,500	1,324.00	7,282,000
ウチヤマホールディングス	8,600	316.00	2,717,600
チャーム・ケア・コーポレーション	2,900	1,535.00	4,451,500
キャリアリンク	2,100	1,354.00	2,843,400
I B J	3,200	1,114.00	3,564,800
アサンテ	1,700	1,725.00	2,932,500
バリューHR	1,600	2,280.00	3,648,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,300	5,870.00	19,371,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,528.00	916,800
アビスト	1,000	2,870.00	2,870,000
シグマクス・ホールディングス	2,400	3,205.00	7,692,000
ウィルグループ	2,900	1,497.00	4,341,300
メドピア	3,000	4,020.00	12,060,000
リクルートホールディングス	304,600	7,569.00	2,305,517,400
エラン	5,400	1,291.00	6,971,400
ツガミ	9,900	1,566.00	15,503,400
オークマ	4,800	5,170.00	24,816,000
芝浦機械	4,600	3,320.00	15,272,000
アマダ	64,500	1,158.00	74,691,000
アイダエンジニアリング	10,700	998.00	10,678,600
滝澤鉄工所	2,600	1,131.00	2,940,600
F U J I	18,800	2,754.00	51,775,200
牧野フライス製作所	4,500	3,835.00	17,257,500
オーエスジー	18,900	1,877.00	35,475,300
ダイジェット工業	2,600	1,110.00	2,886,000
旭ダイヤモンド工業	10,700	672.00	7,190,400
D M G 森精機	24,200	1,897.00	45,907,400
ソディック	9,100	825.00	7,507,500
ディスコ	6,000	33,100.00	198,600,000
日東工器	2,200	1,725.00	3,795,000
日進工具	3,200	1,555.00	4,976,000
日本郵政	515,600	875.20	451,253,120
ベルシステム24ホールディングス	5,700	1,382.00	7,877,400

鎌倉新書	4,500	897.00	4,036,500
S M N	4,500	658.00	2,961,000
エアトリ	2,600	3,540.00	9,204,000
アトラエ	2,700	2,643.00	7,136,100
ストライク	1,500	5,940.00	8,910,000
ソラスト	9,700	1,288.00	12,493,600
インソース	3,800	2,685.00	10,203,000
豊田自動織機	33,400	10,110.00	337,674,000
豊和工業	3,600	826.00	2,973,600
東洋機械金属	5,500	541.00	2,975,500
エンシュウ	4,400	675.00	2,970,000
島精機製作所	6,000	2,116.00	12,696,000
オプトラン	5,100	2,420.00	12,342,000
N Cホールディングス	2,000	1,461.00	2,922,000
イワキ	2,800	1,071.00	2,998,800
フリー	3,600	1,337.00	4,813,200
ヤマシンフィルタ	8,200	624.00	5,116,800
日阪製作所	5,000	846.00	4,230,000
やまびこ	7,900	1,284.00	10,143,600
野村マイクロ・サイエンス	1,100	5,180.00	5,698,000
平田機工	1,900	6,480.00	12,312,000
ペガサスミシン製造	6,100	485.00	2,958,500
マルマエ	1,700	3,215.00	5,465,500
タツモ	1,900	1,825.00	3,467,500
ナプテスコ	23,300	3,465.00	80,734,500
三井海洋開発	4,300	1,535.00	6,600,500
レオン自動機	4,400	1,382.00	6,080,800
S M C	12,100	76,820.00	929,522,000
ホソカワミクロン	2,900	3,010.00	8,729,000
ユニオンツール	1,500	3,885.00	5,827,500
オイレス工業	5,700	1,704.00	9,712,800
日精エー・エス・ビー機械	1,400	3,115.00	4,361,000
サトーホールディングス	5,400	2,355.00	12,717,000
技研製作所	3,600	4,420.00	15,912,000
カワタ	3,100	933.00	2,892,300
日精樹脂工業	2,900	1,055.00	3,059,500
オカダアイヨン	900	1,475.00	1,327,500
ワイエイシイホールディングス	2,800	1,029.00	2,881,200
小松製作所	187,300	2,930.00	548,789,000
住友重機械工業	23,600	2,716.00	64,097,600
日立建機	16,600	3,650.00	60,590,000
日工	5,600	641.00	3,589,600
巴工業	1,600	2,344.00	3,750,400
井関農機	3,800	1,533.00	5,825,400
T O W A	3,500	3,565.00	12,477,500
丸山製作所	1,900	1,558.00	2,960,200
北川鉄工所	2,000	1,459.00	2,918,000
シンニッタン	13,000	230.00	2,990,000
ローツェ	2,000	12,890.00	25,780,000
タカキタ	4,600	619.00	2,847,400

クボタ	201,500	2,454.00	494,481,000
荏原実業	1,900	2,692.00	5,114,800
東洋エンジニアリング	5,400	741.00	4,001,400
三菱化工機	1,300	2,456.00	3,192,800
月島機械	7,600	1,146.00	8,709,600
帝国電機製作所	2,900	1,420.00	4,118,000
新東工業	9,100	713.00	6,488,300
澁谷工業	3,600	3,090.00	11,124,000
アイチコーポレーション	6,000	806.00	4,836,000
小森コーポレーション	10,500	659.00	6,919,500
鶴見製作所	3,200	1,533.00	4,905,600
荏原製作所	17,200	6,400.00	110,080,000
石井鐵工所	1,000	3,005.00	3,005,000
西島製作所	3,700	919.00	3,400,300
北越工業	3,900	994.00	3,876,600
ダイキン工業	52,600	25,205.00	1,325,783,000
オルガノ	1,200	7,120.00	8,544,000
トーヨーカネツ	1,600	2,566.00	4,105,600
栗田工業	22,400	5,720.00	128,128,000
椿本チエイン	5,400	3,100.00	16,740,000
大同工業	3,200	928.00	2,969,600
日機装	12,400	928.00	11,507,200
木村化工機	3,400	1,082.00	3,678,800
レイズネクスト	6,300	1,195.00	7,528,500
アネスト岩田	6,400	864.00	5,529,600
ダイフク	22,700	10,050.00	228,135,000
サムコ	1,000	3,215.00	3,215,000
加藤製作所	3,500	861.00	3,013,500
タダノ	21,600	1,148.00	24,796,800
フジテック	15,300	2,530.00	38,709,000
C K D	12,200	2,374.00	28,962,800
キトー	3,500	1,889.00	6,611,500
平和	11,500	1,933.00	22,229,500
理想科学工業	3,500	2,121.00	7,423,500
SANKYO	8,900	3,010.00	26,789,000
日本金銭機械	4,200	745.00	3,129,000
マースグループホールディングス	2,600	1,632.00	4,243,200
フクシマガリレイ	2,800	4,410.00	12,348,000
ダイコク電機	2,400	1,243.00	2,983,200
竹内製作所	6,300	2,920.00	18,396,000
アマノ	10,800	2,683.00	28,976,400
JUKI	5,700	908.00	5,175,600
ジャノメ	4,400	669.00	2,943,600
ブラザー工業	50,500	2,098.00	105,949,000
マックス	5,500	1,849.00	10,169,500
モリタホールディングス	6,600	1,353.00	8,929,800
グローリー	10,600	2,252.00	23,871,200
新晃工業	3,800	1,985.00	7,543,000
大和冷機工業	6,000	1,265.00	7,590,000
セガサミーホールディングス	41,000	1,949.00	79,909,000

日本ピストンリング	2,200	1,327.00	2,919,400
リケン	1,800	2,573.00	4,631,400
T P R	5,600	1,487.00	8,327,200
ツバキ・ナカシマ	9,100	1,456.00	13,249,600
ホシザキ	12,100	8,980.00	108,658,000
大豊工業	3,700	795.00	2,941,500
日本精工	77,800	756.00	58,816,800
N T N	88,700	231.00	20,489,700
ジェイテクト	39,600	1,069.00	42,332,400
不二越	3,500	4,250.00	14,875,000
ミネベアミツミ	71,200	3,210.00	228,552,000
日本トムソン	11,300	742.00	8,384,600
T H K	24,000	2,712.00	65,088,000
ユーシン精機	3,900	774.00	3,018,600
前澤給装工業	3,100	1,024.00	3,174,400
イーグル工業	5,100	1,083.00	5,523,300
日本ピラー工業	4,200	3,280.00	13,776,000
キッツ	13,900	743.00	10,327,700
日立製作所	198,700	7,329.00	1,456,272,300
東芝	72,200	4,747.00	342,733,400
三菱電機	413,200	1,497.00	618,560,400
富士電機	24,900	6,010.00	149,649,000
東洋電機製造	3,000	1,010.00	3,030,000
安川電機	44,500	5,270.00	234,515,000
シンフォニア テクノロジー	5,000	1,362.00	6,810,000
明電舎	7,000	2,731.00	19,117,000
オリジン	2,200	1,357.00	2,985,400
山洋電気	1,800	6,180.00	11,124,000
デンヨー	3,500	1,677.00	5,869,500
ベイクレント・コンサルティング	2,800	55,500.00	155,400,000
Orchestra Holdings	800	4,805.00	3,844,000
MS - Japan	2,900	1,013.00	2,937,700
グレイステクノロジー	5,900	479.00	2,826,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	12,500	2,282.00	28,525,000
G A M E W I T H	5,500	589.00	3,239,500
ウェルビー	2,600	1,483.00	3,855,800
ミダックホールディングス	1,700	5,280.00	8,976,000
日総工産	3,500	827.00	2,894,500
キュービーネットホールディングス	1,800	1,900.00	3,420,000
R P Aホールディングス	6,900	420.00	2,898,000
三櫻工業	5,700	1,026.00	5,848,200
マキタ	50,300	5,240.00	263,572,000
東芝テック	4,400	4,635.00	20,394,000
芝浦メカトロニクス	700	8,920.00	6,244,000
マブチモーター	9,700	3,805.00	36,908,500
日本電産	107,100	13,335.00	1,428,178,500
トレックス・セミコンダクター	2,100	3,770.00	7,917,000
東光高岳	2,300	1,403.00	3,226,900

ダブル・スコープ	11,900	950.00	11,305,000
ダイヘン	4,500	4,645.00	20,902,500
ヤーマン	6,700	1,190.00	7,973,000
JVCケンウッド	33,700	178.00	5,998,600
ミマキエンジニアリング	3,700	961.00	3,555,700
I - P E X	1,900	2,199.00	4,178,100
日新電機	9,700	1,494.00	14,491,800
大崎電気工業	7,600	492.00	3,739,200
オムロン	34,400	11,295.00	388,548,000
日東工業	5,500	1,600.00	8,800,000
I D E C	5,100	2,758.00	14,065,800
不二電機工業	2,300	1,271.00	2,923,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	13,800	2,451.00	33,823,800
サクサホールディングス	2,000	1,458.00	2,916,000
メルコホールディングス	1,100	4,160.00	4,576,000
日本電気	52,500	5,270.00	276,675,000
富士通	37,200	20,420.00	759,624,000
沖電気工業	16,800	923.00	15,506,400
岩崎通信機	3,400	870.00	2,958,000
電気興業	2,200	2,623.00	5,770,600
サンケン電気	3,900	6,010.00	23,439,000
アイホン	2,300	2,198.00	5,055,400
ルネサスエレクトロニクス	223,700	1,554.00	347,629,800
セイコーエプソン	51,300	1,952.00	100,137,600
ワコム	32,000	912.00	29,184,000
アルバック	7,600	6,940.00	52,744,000
E I Z O	3,200	4,100.00	13,120,000
ジャパンディスプレイ	141,200	40.00	5,648,000
日本信号	10,500	914.00	9,597,000
京三製作所	8,900	464.00	4,129,600
能美防災	5,500	2,065.00	11,357,500
ホーチキ	3,000	1,297.00	3,891,000
エレコム	9,500	1,469.00	13,955,500
パナソニック	440,700	1,380.50	608,386,350
シャープ	47,100	1,369.00	64,479,900
アンリツ	26,600	1,912.00	50,859,200
富士通ゼネラル	11,200	2,771.00	31,035,200
ソニーグループ	258,800	14,280.00	3,695,664,000
T D K	59,800	4,790.00	286,442,000
タムラ製作所	15,900	756.00	12,020,400
アルプスアルパイン	36,600	1,107.00	40,516,200
池上通信機	3,900	736.00	2,870,400
日本電波工業	3,700	1,697.00	6,278,900
メイコー	3,400	4,140.00	14,076,000
日本トリム	900	3,565.00	3,208,500
ローランド ディー・ジー・	2,400	2,798.00	6,715,200
フォスター電機	4,200	781.00	3,280,200
S M K	1,200	2,468.00	2,961,600
ヨコオ	3,100	2,799.00	8,676,900
ホシデン	10,000	1,275.00	12,750,000

ヒロセ電機	6,400	20,140.00	128,896,000	
日本航空電子工業	9,500	1,881.00	17,869,500	
TOA	4,400	795.00	3,498,000	
マクセル	8,200	1,388.00	11,381,600	
古野電気	4,900	1,236.00	6,056,400	
ユニデンホールディングス	900	3,495.00	3,145,500	
スミダコーポレーション	3,900	1,331.00	5,190,900	
アイコム	1,500	2,300.00	3,450,000	
リオン	1,600	2,280.00	3,648,000	
横河電機	41,400	2,268.00	93,895,200	
新電元工業	1,600	3,750.00	6,000,000	
アズビル	24,200	5,490.00	132,858,000	
東亜ディーケーケー	3,400	850.00	2,890,000	
日本光電工業	17,100	3,490.00	59,679,000	
共和電業	7,300	402.00	2,934,600	
日本電子材料	2,000	2,269.00	4,538,000	
堀場製作所	7,600	7,300.00	55,480,000	
アドバンテスト	30,700	10,530.00	323,271,000	
小野測器	5,800	500.00	2,900,000	
エスベック	3,400	2,258.00	7,677,200	
キーエンス	37,400	74,280.00	2,778,072,000	
日置電機	2,000	9,560.00	19,120,000	
シスメックス	34,900	14,950.00	521,755,000	
日本マイクロニクス	7,200	1,939.00	13,960,800	
メガチップス	3,800	4,855.00	18,449,000	
OBARA GROUP	1,900	3,555.00	6,754,500	
澤藤電機	1,500	1,934.00	2,901,000	
デンソー	91,000	8,822.00	802,802,000	
原田工業	3,000	981.00	2,943,000	
コーセル	5,000	938.00	4,690,000	
イリソ電子工業	3,500	5,110.00	17,885,000	
オブテックスグループ	6,800	1,552.00	10,553,600	
千代田インテグレ	1,700	2,375.00	4,037,500	
アイ・オー・データ機器	3,000	867.00	2,601,000	
レーザーテック	18,100	31,600.00	571,960,000	
スタンレー電気	28,900	3,235.00	93,491,500	
岩崎電気	1,500	2,306.00	3,459,000	
ウシオ電機	21,200	2,267.00	48,060,400	
岡谷電機産業	8,700	335.00	2,914,500	
日本セラミック	3,800	2,939.00	11,168,200	
遠藤照明	2,500	1,132.00	2,830,000	
古河電池	2,900	1,622.00	4,703,800	
山一電機	3,000	2,380.00	7,140,000	
図研	2,700	4,070.00	10,989,000	
日本電子	8,600	9,590.00	82,474,000	
カシオ計算機	29,900	1,581.00	47,271,900	
ファナック	36,300	23,350.00	847,605,000	
日本シイエムケイ	8,100	531.00	4,301,100	
エンプラス	1,100	2,690.00	2,959,000	
大真空	5,600	1,666.00	9,329,600	

ローム	18,500	11,450.00	211,825,000
浜松ホトニクス	29,600	7,300.00	216,080,000
三井ハイテック	4,100	9,300.00	38,130,000
新光電気工業	12,100	5,340.00	64,614,000
京セラ	58,100	7,141.00	414,892,100
協栄産業	2,000	1,540.00	3,080,000
太陽誘電	20,000	6,880.00	137,600,000
村田製作所	121,400	8,910.00	1,081,674,000
双葉電子工業	7,100	736.00	5,225,600
日東電工	25,000	8,690.00	217,250,000
北陸電気工業	2,400	1,291.00	3,098,400
東海理化電機製作所	10,900	1,628.00	17,745,200
ニチコン	13,000	1,191.00	15,483,000
日本ケミコン	3,900	1,896.00	7,394,400
K O A	6,200	1,680.00	10,416,000
三井E & Sホールディングス	14,900	408.00	6,079,200
日立造船	34,900	882.00	30,781,800
三菱重工業	64,900	2,831.50	183,764,350
川崎重工業	30,200	2,063.00	62,302,600
I H I	25,800	2,501.00	64,525,800
マネジメントソリューションズ	1,900	3,475.00	6,602,500
プロレド・パートナーズ	2,200	1,309.00	2,879,800
and factory	6,300	466.00	2,935,800
カーブスホールディングス	10,800	876.00	9,460,800
フォーラムエンジニアリング	3,400	853.00	2,900,200
日本車輛製造	1,500	2,045.00	3,067,500
三菱ロジスネクスト	5,500	1,141.00	6,275,500
近畿車輛	2,800	1,043.00	2,920,400
フルサト・マルカホールディングス	3,900	2,070.00	8,073,000
ヤマエグループホールディングス	2,700	1,054.00	2,845,800
F P G	13,700	591.00	8,096,700
島根銀行	5,200	554.00	2,880,800
じもとホールディングス	4,500	642.00	2,889,000
全国保証	9,700	5,160.00	50,052,000
めぶきフィナンシャルグループ	211,700	232.00	49,114,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,100	1,216.00	3,769,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,100	1,428.00	7,282,800
九州フィナンシャルグループ	83,300	390.00	32,487,000
かんぽ生命保険	41,000	1,794.00	73,554,000
ゆうちょ銀行	96,200	922.00	88,696,400
富山第一銀行	10,500	277.00	2,908,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	232,800	436.00	101,500,800
ジェイリース	800	2,095.00	1,676,000
西日本フィナンシャルホールディングス	26,600	727.00	19,338,200
イントラスト	3,800	801.00	3,043,800
アルヒ	6,000	1,035.00	6,210,000
プレミアグループ	2,100	3,660.00	7,686,000

日産自動車	487,300	614.50	299,445,850
いすゞ自動車	129,600	1,636.00	212,025,600
トヨタ自動車	2,092,900	2,105.00	4,405,554,500
日野自動車	51,600	1,067.00	55,057,200
三菱自動車工業	152,900	395.00	60,395,500
エフテック	3,300	565.00	1,864,500
武蔵精密工業	9,200	2,020.00	18,584,000
日産車体	6,100	702.00	4,282,200
新明和工業	11,700	904.00	10,576,800
極東開発工業	7,700	1,466.00	11,288,200
トビー工業	3,400	1,129.00	3,838,600
ティラド	1,200	3,000.00	3,600,000
曙ブレーキ工業	22,700	209.00	4,744,300
タチエス	7,200	1,164.00	8,380,800
NOK	20,000	1,318.00	26,360,000
フタバ産業	10,300	405.00	4,171,500
KYB	4,300	3,150.00	13,545,000
市光工業	5,400	540.00	2,916,000
大同メタル工業	7,900	597.00	4,716,300
プレス工業	20,500	406.00	8,323,000
ミクニ	9,600	314.00	3,014,400
太平洋工業	8,700	1,145.00	9,961,500
河西工業	9,600	314.00	3,014,400
アイシン	30,200	4,475.00	135,145,000
マツダ	129,700	1,040.00	134,888,000
今仙電機製作所	5,000	588.00	2,940,000
本田技研工業	325,300	3,292.00	1,070,887,600
スズキ	94,500	5,281.00	499,054,500
SUBARU	118,400	2,292.00	271,372,800
ヤマハ発動機	53,900	3,085.00	166,281,500
小糸製作所	22,700	7,240.00	164,348,000
エクセディ	6,200	1,725.00	10,695,000
ミツバ	7,600	506.00	3,845,600
豊田合成	13,300	2,418.00	32,159,400
愛三工業	6,500	816.00	5,304,000
ヨロズ	3,900	1,163.00	4,535,700
エフ・シー・シー	6,800	1,549.00	10,533,200
シマノ	16,700	32,670.00	545,589,000
テイ・エス テック	17,400	1,439.00	25,038,600
三十三フィナンシャルグループ	3,800	1,403.00	5,331,400
第四北越フィナンシャルグループ	6,600	2,434.00	16,064,400
ひろぎんホールディングス	60,100	634.00	38,103,400
おきなわフィナンシャルグループ	3,700	2,003.00	7,411,100
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	3,940.00	8,274,000
ポピンズホールディングス	900	3,580.00	3,222,000
LITALICO	3,200	4,030.00	12,896,000
十六フィナンシャルグループ	5,500	2,010.00	11,055,000
北國フィナンシャルホールディングス	3,800	1,986.00	7,546,800
ジャムコ	3,000	975.00	2,925,000
小野建	3,900	1,611.00	6,282,900

南陽	1,500	1,953.00	2,929,500	
ノジマ	6,600	2,303.00	15,199,800	
カップ・クリエイト	5,700	1,400.00	7,980,000	
伯東	2,500	2,312.00	5,780,000	
コンドーテック	3,100	1,001.00	3,103,100	
中山福	7,800	368.00	2,870,400	
ライトオン	4,200	715.00	3,003,000	
ナガイレーベン	5,400	2,421.00	13,073,400	
三菱食品	3,900	2,811.00	10,962,900	
良品計画	46,800	2,036.00	95,284,800	
松田産業	3,000	2,973.00	8,919,000	
第一興商	7,700	3,980.00	30,646,000	
メディカルホールディングス	43,900	2,050.00	89,995,000	
アドヴァングループ	4,100	967.00	3,964,700	
S P K	2,200	1,371.00	3,016,200	
萩原電気ホールディングス	1,500	2,086.00	3,129,000	
アルビス	1,300	2,232.00	2,901,600	
アズワン	2,900	14,860.00	43,094,000	
スズデン	1,800	1,692.00	3,045,600	
シモジマ	2,600	1,114.00	2,896,400	
ドウシシャ	3,800	1,637.00	6,220,600	
小津産業	1,500	1,912.00	2,868,000	
コナカ	8,800	337.00	2,965,600	
高速	2,400	1,555.00	3,732,000	
G - 7ホールディングス	4,500	1,743.00	7,843,500	
イオン北海道	7,200	1,450.00	10,440,000	
コジマ	7,000	560.00	3,920,000	
ヒマラヤ	3,000	983.00	2,949,000	
コーナン商事	5,800	3,540.00	20,532,000	
ネットワンシステムズ	15,400	3,725.00	57,365,000	
エコス	1,600	1,856.00	2,969,600	
ワタミ	4,900	935.00	4,581,500	
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	81,400	2,193.00	178,510,200	
丸文	3,600	941.00	3,387,600	
西松屋チェーン	8,900	1,517.00	13,501,300	
ゼンショーホールディングス	19,900	2,688.00	53,491,200	
ハビネット	3,400	1,512.00	5,140,800	
幸楽苑ホールディングス	2,600	1,469.00	3,819,400	
橋本総業ホールディングス	1,400	2,065.00	2,891,000	
日本ライフライン	12,100	1,141.00	13,806,100	
サイゼリヤ	6,000	2,999.00	17,994,000	
V Tホールディングス	15,300	456.00	6,976,800	
アルゴグラフィックス	3,200	3,060.00	9,792,000	
I D O M	12,300	714.00	8,782,200	
日本エム・ディ・エム	2,400	2,211.00	5,306,400	
フジ・コーポレーション	2,400	1,201.00	2,882,400	
ユナイテッドアローズ	4,300	1,968.00	8,462,400	
進和	2,400	2,097.00	5,032,800	
ダイトロン	1,700	2,138.00	3,634,600	

ハイデイ日高	5,900	1,637.00	9,658,300
シークス	5,800	1,384.00	8,027,200
YU-WA CREATION HOLDINGS	13,900	213.00	2,960,700
コロワイド	16,700	1,666.00	27,822,200
ピーシーデポコーポレーション	7,700	368.00	2,833,600
田中商事	4,500	655.00	2,947,500
オーハシテクニカ	2,300	1,545.00	3,553,500
壱番屋	2,900	4,630.00	13,427,000
白銅	1,300	2,410.00	3,133,000
スギホールディングス	8,100	7,780.00	63,018,000
薬王堂ホールディングス	2,000	2,283.00	4,566,000
島津製作所	53,200	5,010.00	266,532,000
JMS	4,500	645.00	2,902,500
長野計器	3,000	1,825.00	5,475,000
ブイ・テクノロジー	1,800	3,710.00	6,678,000
スター精密	6,400	1,583.00	10,131,200
東京計器	2,900	1,023.00	2,966,700
愛知時計電機	600	4,500.00	2,700,000
インターアクション	2,100	2,488.00	5,224,800
オーバル	11,300	263.00	2,971,900
東京精密	7,000	5,060.00	35,420,000
マニー	16,500	1,826.00	30,129,000
ニコン	63,100	1,215.00	76,666,500
トプコン	19,400	1,981.00	38,431,400
オリンパス	216,700	2,600.00	563,420,000
理研計器	3,300	4,975.00	16,417,500
SCREENホールディングス	7,200	12,080.00	86,976,000
キャノン電子	3,800	1,596.00	6,064,800
タムロン	3,300	2,650.00	8,745,000
HOYA	80,600	18,960.00	1,528,176,000
ノーリツ鋼機	3,700	2,374.00	8,783,800
エー・アンド・デイ	3,800	1,356.00	5,152,800
朝日インテック	45,300	2,870.00	130,011,000
キャノン	205,300	2,589.00	531,521,700
リコー	114,700	1,046.00	119,976,200
シチズン時計	48,400	511.00	24,732,400
リズム	2,300	1,259.00	2,895,700
メニコン	13,700	4,030.00	55,211,000
スノーピーク	2,700	8,260.00	22,302,000
パラマウントベッドホールディングス	7,900	1,974.00	15,594,600
トランザクション	2,700	1,089.00	2,940,300
粧美堂	7,500	392.00	2,940,000
ニホンフラッシュ	3,500	1,160.00	4,060,000
前田工織	4,600	3,670.00	16,882,000
永大産業	10,300	284.00	2,925,200
アートネイチャー	4,400	662.00	2,912,800
バンダイナムコホールディングス	37,000	9,319.00	344,803,000
共立印刷	19,500	149.00	2,905,500
SHOEI	3,900	5,300.00	20,670,000

フランスベッドホールディングス	5,300	885.00	4,690,500
マーベラス	6,400	755.00	4,832,000
パイロットコーポレーション	7,000	4,175.00	29,225,000
萩原工業	2,700	1,464.00	3,952,800
エイベックス	7,000	1,815.00	12,705,000
トッパン・フォームズ	5,900	1,546.00	9,121,400
フジシールインターナショナル	10,000	2,194.00	21,940,000
タカラトミー	17,300	1,075.00	18,597,500
広済堂ホールディングス	3,200	885.00	2,832,000
レック	5,400	889.00	4,800,600
三光合成	7,100	418.00	2,967,800
プロネクサス	3,200	1,047.00	3,350,400
大建工業	2,400	2,341.00	5,618,400
凸版印刷	62,800	1,850.00	116,180,000
大日本印刷	48,800	2,800.00	136,640,000
共同印刷	1,300	2,765.00	3,594,500
N I S S H A	8,500	1,720.00	14,620,000
藤森工業	3,700	3,965.00	14,670,500
TAKARA & COMPANY	2,000	1,813.00	3,626,000
前澤化成工業	2,600	1,305.00	3,393,000
未来工業	1,800	1,595.00	2,871,000
アシックス	36,500	3,040.00	110,960,000
ツツミ	1,300	2,245.00	2,918,500
J S P	2,400	1,591.00	3,818,400
ニチハ	5,700	3,020.00	17,214,000
ローランド	2,900	4,595.00	13,325,500
エフピコ	7,600	4,185.00	31,806,000
小松ウオール工業	1,500	1,899.00	2,848,500
ヤマハ	24,600	6,440.00	158,424,000
河合楽器製作所	1,200	3,330.00	3,996,000
ピジョン	25,000	2,368.00	59,200,000
天馬	3,400	2,567.00	8,727,800
キングジム	3,300	880.00	2,904,000
象印マホービン	11,200	1,666.00	18,659,200
リンテック	8,900	2,634.00	23,442,600
信越ポリマー	7,400	1,028.00	7,607,200
東リ	12,600	235.00	2,961,000
イトーキ	8,300	363.00	3,012,900
任天堂	23,300	51,440.00	1,198,552,000
三菱鉛筆	6,800	1,208.00	8,214,400
松風	1,700	2,136.00	3,631,200
タカラスタンダード	8,500	1,420.00	12,070,000
コクヨ	19,800	1,769.00	35,026,200
ナカバヤシ	5,600	524.00	2,934,400
ニフコ	13,800	3,550.00	48,990,000
グローブライド	3,700	3,560.00	13,172,000
オカムラ	14,200	1,326.00	18,829,200
パルカー	3,400	2,590.00	8,806,000
M U T O Hホールディングス	1,700	1,710.00	2,907,000
伊藤忠商事	284,600	3,390.00	964,794,000

丸紅	401,400	1,047.00	420,265,800
スクロール	6,300	827.00	5,210,100
ヨンドシーホールディングス	3,700	1,661.00	6,145,700
三陽商会	3,200	896.00	2,867,200
長瀬産業	22,300	1,749.00	39,002,700
蝶理	2,300	1,803.00	4,146,900
豊田通商	40,900	5,520.00	225,768,000
オンワードホールディングス	24,300	320.00	7,776,000
三共生興	5,400	555.00	2,997,000
兼松	15,200	1,287.00	19,562,400
美津濃	4,100	2,294.00	9,405,400
三井物産	316,000	2,646.00	836,136,000
日本紙パルプ商事	2,100	3,860.00	8,106,000
東京エレクトロン	26,200	63,040.00	1,651,648,000
カメイ	4,800	1,017.00	4,881,600
OUGホールディングス	1,200	2,536.00	3,043,200
スターゼン	3,000	1,918.00	5,754,000
セイコーホールディングス	5,800	2,440.00	14,152,000
山善	17,100	1,033.00	17,664,300
椿本興業	800	3,810.00	3,048,000
住友商事	256,800	1,675.50	430,268,400
日本ユニシス	12,700	3,445.00	43,751,500
内田洋行	1,700	4,800.00	8,160,000
三菱商事	304,900	3,544.00	1,080,565,600
第一実業	1,800	5,110.00	9,198,000
キヤノンマーケティングジャパン	10,100	2,341.00	23,644,100
西華産業	2,100	1,644.00	3,452,400
佐藤商事	3,400	1,186.00	4,032,400
菱洋エレクトロ	2,400	2,424.00	5,817,600
東京産業	3,800	795.00	3,021,000
ユアサ商事	3,900	2,937.00	11,454,300
神鋼商事	900	3,295.00	2,965,500
阪和興業	8,100	3,305.00	26,770,500
正栄食品工業	2,600	4,070.00	10,582,000
カナデン	3,300	1,054.00	3,478,200
菱電商事	3,200	1,742.00	5,574,400
ニプロ	30,800	1,147.00	35,327,600
岩谷産業	9,800	6,180.00	60,564,000
ナイス	1,700	1,740.00	2,958,000
極東貿易	1,200	2,480.00	2,976,000
アステナホールディングス	5,700	565.00	3,220,500
兼松エレクトロニクス	2,200	3,745.00	8,239,000
三愛石油	10,000	1,202.00	12,020,000
稲畑産業	9,000	1,607.00	14,463,000
明和産業	3,800	843.00	3,203,400
ゴールドウイン	7,300	7,030.00	51,319,000
ユニ・チャーム	79,600	4,923.00	391,870,800
デサント	7,900	5,000.00	39,500,000
ワキタ	8,700	1,049.00	9,126,300
ヤマトインターナショナル	9,300	314.00	2,920,200

東邦ホールディングス	13,100	1,703.00	22,309,300
サンゲツ	10,800	1,567.00	16,923,600
ミツウロコグループホールディングス	6,000	1,246.00	7,476,000
シナネンホールディングス	1,500	3,410.00	5,115,000
伊藤忠エネクス	9,000	975.00	8,775,000
サンリオ	12,600	2,823.00	35,569,800
サンワテクノス	2,500	1,717.00	4,292,500
リョーサン	4,500	2,250.00	10,125,000
新光商事	6,100	899.00	5,483,900
トーホー	2,000	1,484.00	2,968,000
三信電気	1,900	1,533.00	2,912,700
東陽テクニカ	4,000	1,139.00	4,556,000
モスフードサービス	5,300	3,090.00	16,377,000
加賀電子	3,700	3,055.00	11,303,500
三益半導体工業	3,200	2,523.00	8,073,600
都築電気	2,100	1,861.00	3,908,100
ソーダニッカ	3,800	669.00	2,542,200
立花エレテック	3,300	1,590.00	5,247,000
木曽路	5,300	2,201.00	11,665,300
S R Sホールディングス	5,500	777.00	4,273,500
千趣会	7,300	403.00	2,941,900
リテールパートナーズ	4,900	1,277.00	6,257,300
ケーヨー	7,500	820.00	6,150,000
上新電機	4,700	2,137.00	10,043,900
日本瓦斯	19,800	1,499.00	29,680,200
ロイヤルホールディングス	7,000	1,973.00	13,811,000
東天紅	2,800	1,091.00	3,054,800
いなげや	5,000	1,376.00	6,880,000
チヨダ	4,000	773.00	3,092,000
ライフコーポレーション	3,800	3,560.00	13,528,000
リンガーハット	5,000	2,229.00	11,145,000
MrMaxHD	5,100	572.00	2,917,200
AOKIホールディングス	7,900	665.00	5,253,500
オークワ	6,400	1,000.00	6,400,000
コメリ	6,300	2,572.00	16,203,600
青山商事	8,400	760.00	6,384,000
しまむら	4,700	9,820.00	46,154,000
はせがわ	11,400	253.00	2,884,200
高島屋	29,600	1,068.00	31,612,800
松屋	8,200	913.00	7,486,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	19,300	849.00	16,385,700
近鉄百貨店	1,600	2,619.00	4,190,400
丸井グループ	34,400	2,322.00	79,876,800
クレディセゾン	26,200	1,224.00	32,068,800
アクシアルリテイリング	3,200	3,350.00	10,720,000
イオン	156,600	2,719.50	425,873,700
イズミ	7,400	3,410.00	25,234,000
フォーパル	2,700	1,054.00	2,845,800
平和堂	7,500	1,904.00	14,280,000
フジ	4,900	1,949.00	9,550,100

ヤオコー	4,600	6,950.00	31,970,000	
ゼビオホールディングス	5,500	914.00	5,027,000	
ケーズホールディングス	37,500	1,209.00	45,337,500	
PALTAC	5,700	4,900.00	27,930,000	
三谷産業	9,100	313.00	2,848,300	
日産東京販売ホールディングス	12,600	237.00	2,986,200	
新生銀行	26,600	1,894.00	50,380,400	
あおぞら銀行	22,800	2,591.00	59,074,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,613,400	629.30	1,644,612,620	
りそなホールディングス	466,400	428.10	199,665,840	
三井住友トラスト・ホールディングス	77,000	3,678.00	283,206,000	
三井住友フィナンシャルグループ	282,100	3,825.00	1,079,032,500	
千葉銀行	136,000	676.00	91,936,000	
群馬銀行	78,300	339.00	26,543,700	
武蔵野銀行	6,100	1,643.00	10,022,300	
千葉興業銀行	11,300	261.00	2,949,300	
七十七銀行	12,800	1,213.00	15,526,400	
青森銀行	3,200	1,720.00	5,504,000	
秋田銀行	2,600	1,467.00	3,814,200	
山形銀行	4,600	834.00	3,836,400	
岩手銀行	2,700	1,647.00	4,446,900	
東邦銀行	34,000	200.00	6,800,000	
みちのく銀行	3,500	799.00	2,796,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	34,300	1,948.00	66,816,400	
静岡銀行	99,200	848.00	84,121,600	
スルガ銀行	35,700	450.00	16,065,000	
八十二銀行	91,800	372.00	34,149,600	
山梨中央銀行	4,400	821.00	3,612,400	
大垣共立銀行	8,000	1,865.00	14,920,000	
福井銀行	3,500	1,422.00	4,977,000	
清水銀行	1,700	1,559.00	2,650,300	
富山銀行	1,600	1,867.00	2,987,200	
滋賀銀行	7,700	1,840.00	14,168,000	
南都銀行	6,400	1,875.00	12,000,000	
百五銀行	39,100	326.00	12,746,600	
京都銀行	14,600	4,945.00	72,197,000	
紀陽銀行	14,400	1,414.00	20,361,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	25,400	807.00	20,497,800	
山陰合同銀行	24,200	589.00	14,253,800	
中国銀行	32,600	863.00	28,133,800	
伊予銀行	54,000	553.00	29,862,000	
百十四銀行	4,300	1,385.00	5,955,500	
四国銀行	6,200	732.00	4,538,400	
阿波銀行	6,200	2,122.00	13,156,400	
大分銀行	2,300	1,783.00	4,100,900	
宮崎銀行	2,500	1,990.00	4,975,000	
佐賀銀行	2,300	1,405.00	3,231,500	
琉球銀行	8,800	735.00	6,468,000	
セブン銀行	121,000	233.00	28,193,000	
みずほフィナンシャルグループ	521,200	1,460.00	760,952,000	

山口フィナンシャルグループ	47,500	645.00	30,637,500	
芙蓉総合リース	4,300	7,770.00	33,411,000	
みずほリース	6,300	3,115.00	19,624,500	
東京センチュリー	7,900	5,790.00	45,741,000	
SBIホールディングス	50,300	2,979.00	149,843,700	
日本証券金融	16,000	867.00	13,872,000	
アイフル	68,400	385.00	26,334,000	
長野銀行	2,700	1,116.00	3,013,200	
名古屋銀行	3,000	2,200.00	6,600,000	
北洋銀行	61,400	224.00	13,753,600	
愛知銀行	1,500	3,590.00	5,385,000	
中京銀行	2,300	1,280.00	2,944,000	
大光銀行	2,200	1,301.00	2,862,200	
愛媛銀行	5,700	755.00	4,303,500	
京葉銀行	17,400	440.00	7,656,000	
栃木銀行	19,700	178.00	3,506,600	
北日本銀行	1,900	1,498.00	2,846,200	
東和銀行	7,200	501.00	3,607,200	
リコーリース	3,600	3,675.00	13,230,000	
イオンフィナンシャルサービス	22,200	1,322.00	29,348,400	
アコム	80,400	362.00	29,104,800	
ジャックス	4,500	2,929.00	13,180,500	
オリエントコーポレーション	110,200	135.00	14,877,000	
オリックス	247,400	2,356.50	582,998,100	
三菱HCキャピタル	150,500	556.00	83,678,000	
ジャフコ グループ	5,200	7,600.00	39,520,000	
九州リースサービス	4,900	586.00	2,871,400	
トモニホールディングス	31,500	298.00	9,387,000	
大和証券グループ本社	305,200	645.70	197,067,640	
野村ホールディングス	622,200	493.20	306,869,040	
岡三証券グループ	32,100	386.00	12,390,600	
丸三証券	12,100	537.00	6,497,700	
東洋証券	19,600	150.00	2,940,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	46,800	388.00	18,158,400	
光世証券	4,400	531.00	2,336,400	
水戸証券	10,900	283.00	3,084,700	
いちよし証券	7,600	637.00	4,841,200	
松井証券	20,000	815.00	16,300,000	
SOMPOホールディングス	71,800	4,866.00	349,378,800	
日本取引所グループ	103,200	2,443.50	252,169,200	
マネックスグループ	33,200	846.00	28,087,200	
極東証券	5,500	755.00	4,152,500	
岩井コスモホールディングス	3,900	1,353.00	5,276,700	
アイザワ証券グループ	6,700	1,025.00	6,867,500	
フィデアホールディングス	3,700	1,219.00	4,510,300	
池田泉州ホールディングス	46,900	152.00	7,128,800	
アニコム ホールディングス	12,500	805.00	10,062,500	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	91,400	3,549.00	324,378,600	

スパークス・グループ	18,800	325.00	6,110,000
第一生命ホールディングス	200,600	2,356.50	472,713,900
東京海上ホールディングス	134,200	6,087.00	816,875,400
イー・ギャランティ	6,000	2,626.00	15,756,000
アサックス	4,200	698.00	2,931,600
NECキャピタルソリューション	1,700	1,973.00	3,354,100
T&Dホールディングス	105,800	1,421.00	150,341,800
アドバンスクリエイト	2,100	1,026.00	2,154,600
三井不動産	185,800	2,543.00	472,489,400
三菱地所	267,700	1,657.50	443,712,750
平和不動産	7,000	3,405.00	23,835,000
東京建物	40,200	1,695.00	68,139,000
ダイビル	10,300	1,537.00	15,831,100
京阪神ビルディング	6,500	1,421.00	9,236,500
住友不動産	85,500	3,887.00	332,338,500
テーオーシー	7,300	603.00	4,401,900
東京楽天地	700	4,060.00	2,842,000
レオパレス21	42,300	216.00	9,136,800
スターツコーポレーション	5,500	2,624.00	14,432,000
フジ住宅	4,700	670.00	3,149,000
空港施設	5,200	554.00	2,880,800
ゴールドクレスト	3,200	1,550.00	4,960,000
リログループ	21,600	2,454.00	53,006,400
エスリード	1,800	1,651.00	2,971,800
日神グループホールディングス	6,600	490.00	3,234,000
日本エスコン	7,600	812.00	6,171,200
タカラレーベン	17,100	279.00	4,770,900
A V A N T I A	3,400	866.00	2,944,400
イオンモール	20,400	1,711.00	34,904,400
ファースト住建	2,400	1,250.00	3,000,000
カチタス	10,100	4,750.00	47,975,000
東祥	2,900	1,931.00	5,599,900
トーセイ	5,600	1,059.00	5,930,400
穴吹興産	1,500	1,995.00	2,992,500
サンフロンティア不動産	5,600	1,027.00	5,751,200
FJネクストホールディングス	4,000	1,035.00	4,140,000
グランディハウス	6,000	494.00	2,964,000
東武鉄道	40,400	2,738.00	110,615,200
相鉄ホールディングス	13,200	2,087.00	27,548,400
東急	104,200	1,700.00	177,140,000
京浜急行電鉄	53,100	1,222.00	64,888,200
小田急電鉄	61,500	2,266.00	139,359,000
京王電鉄	21,400	5,300.00	113,420,000
京成電鉄	28,800	3,585.00	103,248,000
富士急行	4,900	4,885.00	23,936,500
新京成電鉄	1,500	2,036.00	3,054,000
東日本旅客鉄道	72,700	7,033.00	511,299,100
西日本旅客鉄道	50,100	5,217.00	261,371,700
東海旅客鉄道	34,400	16,660.00	573,104,000
西武ホールディングス	54,000	1,251.00	67,554,000

鴻池運輸	6,600	1,156.00	7,629,600
西日本鉄道	11,500	2,721.00	31,291,500
ハマキョウレックス	2,900	2,998.00	8,694,200
サカイ引越センター	1,900	4,400.00	8,360,000
近鉄グループホールディングス	39,100	3,435.00	134,308,500
阪急阪神ホールディングス	48,900	3,540.00	173,106,000
南海電気鉄道	17,500	2,202.00	38,535,000
京阪ホールディングス	17,400	2,775.00	48,285,000
神戸電鉄	900	3,415.00	3,073,500
名古屋鉄道	32,200	1,826.00	58,797,200
山陽電気鉄道	3,000	2,000.00	6,000,000
アルプス物流	3,000	995.00	2,985,000
トランコム	1,100	8,540.00	9,394,000
日本通運	13,500	6,900.00	93,150,000
ヤマトホールディングス	54,800	2,626.00	143,904,800
山九	10,900	4,695.00	51,175,500
日新	3,100	1,744.00	5,406,400
丸全昭和運輸	3,200	3,310.00	10,592,000
センコーグループホールディングス	19,600	943.00	18,482,800
トナミホールディングス	900	3,575.00	3,217,500
ニッコンホールディングス	13,100	2,113.00	27,680,300
日本石油輸送	300	2,679.00	803,700
福山通運	6,400	4,060.00	25,984,000
セイノーホールディングス	26,600	1,217.00	32,372,200
神奈川中央交通	1,000	3,375.00	3,375,000
日立物流	7,600	4,615.00	35,074,000
丸和運輸機関	8,300	1,505.00	12,491,500
C & F ロジホールディングス	4,000	1,608.00	6,432,000
日本郵船	32,700	7,570.00	247,539,000
商船三井	21,700	6,490.00	140,833,000
川崎汽船	12,100	4,865.00	58,866,500
NSユナイテッド海運	2,200	3,295.00	7,249,000
明治海運	4,700	714.00	3,355,800
飯野海運	18,200	518.00	9,427,600
九州旅客鉄道	30,300	2,576.00	78,052,800
SGホールディングス	73,900	2,654.00	196,130,600
日本航空	89,700	2,358.00	211,512,600
ANAホールディングス	99,400	2,655.00	263,907,000
パスコ	800	1,392.00	1,113,600
TREホールディングス	5,400	1,841.00	9,941,400
人・夢・技術グループ	1,600	1,888.00	3,020,800
西本Wismettacホールディングス	900	3,510.00	3,159,000
Genky DrugStores	1,800	5,620.00	10,116,000
国際紙バルブ商事	8,700	362.00	3,149,400
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,175.00	3,055,000
ブックオフグループホールディングス	2,900	996.00	2,888,400
三菱倉庫	12,400	2,978.00	36,927,200
三井倉庫ホールディングス	4,100	2,382.00	9,766,200
住友倉庫	13,800	1,924.00	26,551,200

澁澤倉庫	2,300	2,162.00	4,972,600
ヤマタネ	1,900	1,580.00	3,002,000
東陽倉庫	9,000	327.00	2,943,000
乾汽船	2,700	2,066.00	5,578,200
日本トランスシティ	8,600	598.00	5,142,800
中央倉庫	3,000	974.00	2,922,000
安田倉庫	3,200	957.00	3,062,400
東洋埠頭	2,100	1,427.00	2,996,700
宇徳	5,600	526.00	2,945,600
上組	21,500	2,195.00	47,192,500
近鉄エクスプレス	7,400	2,820.00	20,868,000
東海運	9,800	304.00	2,979,200
エーアイテイー	2,200	1,197.00	2,633,400
内外トランスライン	1,600	1,921.00	3,073,600
日本コンセプト	1,500	1,900.00	2,850,000
TBSホールディングス	24,700	1,913.00	47,251,100
日本テレビホールディングス	33,800	1,258.00	42,520,400
朝日放送グループホールディングス	4,200	708.00	2,973,600
テレビ朝日ホールディングス	9,700	1,631.00	15,820,700
スカパーJ S A Tホールディングス	34,300	422.00	14,474,600
テレビ東京ホールディングス	2,900	2,127.00	6,168,300
日本BS放送	2,600	1,124.00	2,922,400
ビジョン	6,900	1,410.00	9,729,000
USEN-NEXT HOLDINGS	3,900	3,555.00	13,864,500
コネクシオ	2,900	1,467.00	4,254,300
日本通信	33,700	264.00	8,896,800
日本電信電話	474,200	3,209.00	1,521,707,800
KDDI	295,600	3,420.00	1,010,952,000
ソフトバンク	614,100	1,593.50	978,568,350
光通信	4,800	18,450.00	88,560,000
エムティーアイ	4,600	625.00	2,875,000
GMOインターネット	14,400	3,140.00	45,216,000
ファイバーゲート	2,300	1,220.00	2,806,000
アйдママーケティングコミュニケーション	8,900	329.00	2,928,100
KADOKAWA	11,800	6,650.00	78,470,000
学研ホールディングス	5,700	1,072.00	6,110,400
ゼンリン	6,600	1,005.00	6,633,000
インプレスホールディングス	13,100	228.00	2,986,800
東京電力ホールディングス	309,200	308.00	95,233,600
中部電力	126,400	1,165.00	147,256,000
関西電力	156,500	1,023.00	160,099,500
中国電力	64,600	887.00	57,300,200
北陸電力	37,800	568.00	21,470,400
東北電力	96,800	760.00	73,568,000
四国電力	37,200	752.00	27,974,400
九州電力	85,200	816.00	69,523,200
北海道電力	35,900	472.00	16,944,800
沖縄電力	8,800	1,388.00	12,214,400

電源開発	35,200	1,447.00	50,934,400
エフオン	4,300	692.00	2,975,600
イーレックス	6,100	2,699.00	16,463,900
レノバ	8,100	5,570.00	45,117,000
東京瓦斯	79,200	1,980.00	156,816,000
大阪瓦斯	74,800	1,820.00	136,136,000
東邦瓦斯	19,000	3,120.00	59,280,000
北海道瓦斯	2,000	1,490.00	2,980,000
広島ガス	3,400	363.00	1,234,200
西部ガスホールディングス	4,700	2,189.00	10,288,300
静岡ガス	10,800	1,004.00	10,843,200
メタウォーター	4,600	2,035.00	9,361,000
アイネット	2,100	1,402.00	2,944,200
松竹	2,700	11,670.00	31,509,000
東宝	23,900	5,420.00	129,538,000
エイチ・アイ・エス	8,800	2,268.00	19,958,400
東映	1,300	20,230.00	26,299,000
ラックランド	1,100	2,992.00	3,291,200
エヌ・ティ・ティ・データ	107,900	2,550.00	275,145,000
共立メンテナンス	7,000	4,400.00	30,800,000
イチネンホールディングス	4,000	1,419.00	5,676,000
建設技術研究所	2,400	2,635.00	6,324,000
スペース	3,100	961.00	2,979,100
アインホールディングス	5,900	6,190.00	36,521,000
ピー・シー・エー	2,400	1,617.00	3,880,800
東京テアトル	2,400	1,246.00	2,990,400
タナベ経営	3,900	745.00	2,905,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,600	1,832.00	2,931,200
ナガワ	1,300	11,820.00	15,366,000
東京都競馬	3,000	4,220.00	12,660,000
カナモト	7,000	2,397.00	16,779,000
D T S	7,800	2,433.00	18,977,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	18,900	6,470.00	122,283,000
シーイーシー	4,300	1,336.00	5,744,800
カブコン	38,200	3,050.00	116,510,000
西尾レントオール	3,600	2,715.00	9,774,000
アイ・エス・ビー	2,700	1,107.00	2,988,900
日本空港ビルデング	15,500	5,700.00	88,350,000
トランス・コスモス	5,000	3,195.00	15,975,000
乃村工藝社	16,900	1,052.00	17,778,800
ジャステック	2,300	1,264.00	2,907,200
S C S K	28,100	2,246.00	63,112,600
藤田観光	1,700	2,497.00	4,244,900
K N T - C Tホールディングス	2,500	1,643.00	4,107,500
日本管財	4,200	2,844.00	11,944,800
トーカイ	3,500	2,072.00	7,252,000
セコム	38,900	7,987.00	310,694,300
日本システムウエア	1,500	2,355.00	3,532,500
セントラル警備保障	1,900	2,593.00	4,926,700

アイネス	3,700	1,473.00	5,450,100
丹青社	8,100	875.00	7,087,500
メイテック	4,800	6,960.00	33,408,000
T K C	6,900	3,375.00	23,287,500
富士ソフト	4,300	5,500.00	23,650,000
応用地質	4,400	1,982.00	8,720,800
船井総研ホールディングス	8,100	2,633.00	21,327,300
N S D	13,000	2,198.00	28,574,000
進学会ホールディングス	7,900	368.00	2,907,200
丸紅建材リース	1,600	1,823.00	2,916,800
コナミホールディングス	14,700	6,290.00	92,463,000
学究社	2,000	1,486.00	2,972,000
ベネッセホールディングス	13,200	2,317.00	30,584,400
イオンディライト	4,900	3,690.00	18,081,000
ナック	3,200	939.00	3,004,800
福井コンピュータホールディングス	1,900	4,000.00	7,600,000
ダイセキ	7,300	5,210.00	38,033,000
ステップ	1,600	1,850.00	2,960,000
日鉄物産	2,900	4,845.00	14,050,500
泉州電業	1,100	4,675.00	5,142,500
元気寿司	1,100	2,644.00	2,908,400
トラスコ中山	8,500	2,839.00	24,131,500
ヤマダホールディングス	148,800	408.00	60,710,400
オートボックスセブン	13,700	1,369.00	18,755,300
モリト	4,300	689.00	2,962,700
アークランドサカモト	6,400	1,790.00	11,456,000
ニトリホールディングス	16,100	20,845.00	335,604,500
グルメ杵屋	3,200	1,005.00	3,216,000
愛眼	14,800	198.00	2,930,400
吉野家ホールディングス	14,200	2,334.00	33,142,800
加藤産業	5,900	3,165.00	18,673,500
イノテック	2,500	1,464.00	3,660,000
イエローハット	7,000	1,627.00	11,389,000
松屋フーズホールディングス	2,000	3,545.00	7,090,000
J B C Cホールディングス	2,700	1,883.00	5,084,100
J Kホールディングス	3,300	1,032.00	3,405,600
サガミホールディングス	6,200	1,053.00	6,528,600
日伝	3,400	2,300.00	7,820,000
関西スーパーマーケット	3,100	1,504.00	4,662,400
ミロク情報サービス	3,600	1,708.00	6,148,800
北沢産業	11,800	253.00	2,985,400
杉本商事	1,900	2,266.00	4,305,400
因幡電機産業	10,900	2,555.00	27,849,500
王将フードサービス	2,700	6,130.00	16,551,000
プレナス	4,600	1,983.00	9,121,800
ミニストップ	3,000	1,401.00	4,203,000
アークス	7,800	2,146.00	16,738,800
パローホールディングス	9,000	2,272.00	20,448,000
東テク	1,300	2,524.00	3,281,200
ミスミグループ本社	51,100	5,050.00	258,055,000

ベルク	1,800	5,290.00	9,522,000	
タキヒヨー	1,700	1,762.00	2,995,400	
ファーストリテイリング	5,400	74,120.00	400,248,000	
ソフトバンクグループ	243,100	6,822.00	1,658,428,200	
蔵王産業	1,600	1,849.00	2,958,400	
スズケン	15,900	3,020.00	48,018,000	
サンドラッグ	15,300	3,180.00	48,654,000	
サックスパー ホールディングス	5,200	554.00	2,880,800	
ジェコス	3,700	807.00	2,985,900	
ヤマザワ	1,700	1,746.00	2,968,200	
やまや	1,200	2,412.00	2,894,400	
ベルーナ	8,700	712.00	6,194,400	
合計	45,302,900		115,648,485,140	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,018,046
コール・ローン	607,407,727
国債証券	58,968,646,420
地方債証券	4,888,143,254
特殊債券	7,581,022,859
社債券	5,100,841,500
未収入金	1,233,631,200
未収利息	183,564,011
前払費用	3,725,294
流動資産合計	78,571,000,311
資産合計	78,571,000,311
負債の部	
流動負債	
未払解約金	26,577,647
その他未払費用	851
流動負債合計	26,578,498
負債合計	26,578,498
純資産の部	
元本等	
元本	79,850,448,372
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,306,026,559
元本等合計	78,544,421,813
純資産合計	78,544,421,813
負債純資産合計	78,571,000,311

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	81,027,549,554円
同期中追加設定元本額	12,091,790,225円
同期中一部解約元本額	13,268,891,407円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	66,785,660,048円
DCニッセイ日本債券インデックス	3,222,758,768円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	96,226,092円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	5,195,971,979円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	177,258,641円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	792,116,955円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,738,282,881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）	192,477,647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）	20,449,309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）	64,432,042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）	56,352,722円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	41,584,210円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	58,616,659円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	193,258,066円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	1,215,002,353円
計	79,850,448,372円
2. 受益権の総数	79,850,448,372口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,306,026,559円であります。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11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当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、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。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11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		28,842,050
地方債証券		13,273,952
特殊債券		19,918,354
社債券		19,189,600
合計		23,539,856

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年3月11日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額	0.9836円
(1万口当たり純資産額)	(9,836円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第419回 利付国債(2年)	15,000,000	15,036,600	
	第420回 利付国債(2年)	225,000,000	225,596,250	
	第421回 利付国債(2年)	229,000,000	229,638,910	
	第422回 利付国債(2年)	96,000,000	96,285,120	
	第424回 利付国債(2年)	150,000,000	150,300,000	
	第425回 利付国債(2年)	415,000,000	415,879,800	
	第426回 利付国債(2年)	413,000,000	413,925,120	
	第427回 利付国債(2年)	416,000,000	416,981,760	
	第428回 利付国債(2年)	399,000,000	399,989,520	
	第429回 利付国債(2年)	600,000,000	601,554,000	
	第430回 利付国債(2年)	200,000,000	200,542,000	
	第134回 利付国債(5年)	83,000,000	83,209,160	
	第135回 利付国債(5年)	130,000,000	130,393,900	
	第137回 利付国債(5年)	37,000,000	37,158,730	
	第138回 利付国債(5年)	81,000,000	81,395,280	
	第139回 利付国債(5年)	87,000,000	87,475,020	
	第140回 利付国債(5年)	322,000,000	323,909,460	
	第141回 利付国債(5年)	377,000,000	379,454,270	
	第142回 利付国債(5年)	160,000,000	161,134,400	
	第143回 利付国債(5年)	50,000,000	50,383,000	
	第1回 利付国債(40年)	90,000,000	129,019,500	
	第2回 利付国債(40年)	112,000,000	155,518,720	
	第3回 利付国債(40年)	113,000,000	157,716,360	
	第4回 利付国債(40年)	153,000,000	215,105,760	
	第5回 利付国債(40年)	158,000,000	215,015,880	
	第6回 利付国債(40年)	160,000,000	214,553,600	
	第7回 利付国債(40年)	175,000,000	225,884,750	
	第8回 利付国債(40年)	167,000,000	201,854,570	
	第9回 利付国債(40年)	283,000,000	257,017,770	
	第10回 利付国債(40年)	288,000,000	305,173,440	
	第11回 利付国債(40年)	199,000,000	204,464,540	

第12回 利付国債(40年)	2,000,000	1,856,920	
第13回 利付国債(40年)	170,000,000	157,348,600	
第14回 利付国債(40年)	58,000,000	57,380,560	
第327回 利付国債(10年)	372,000,000	375,708,840	
第328回 利付国債(10年)	430,000,000	434,110,800	
第329回 利付国債(10年)	229,000,000	232,329,660	
第330回 利付国債(10年)	3,000,000	3,050,940	
第332回 利付国債(10年)	138,000,000	140,092,080	
第333回 利付国債(10年)	114,000,000	115,934,580	
第334回 利付国債(10年)	618,000,000	629,630,760	
第335回 利付国債(10年)	480,000,000	488,563,200	
第336回 利付国債(10年)	230,000,000	234,466,600	
第337回 利付国債(10年)	386,000,000	391,114,500	
第338回 利付国債(10年)	585,000,000	595,231,650	
第339回 利付国債(10年)	536,000,000	545,991,040	
第340回 利付国債(10年)	566,000,000	577,297,360	
第341回 利付国債(10年)	552,000,000	561,367,440	
第342回 利付国債(10年)	510,000,000	514,646,100	
第343回 利付国債(10年)	461,000,000	465,338,010	
第344回 利付国債(10年)	533,000,000	538,031,520	
第345回 利付国債(10年)	532,000,000	537,144,440	
第346回 利付国債(10年)	523,000,000	528,308,450	
第347回 利付国債(10年)	433,000,000	437,602,790	
第348回 利付国債(10年)	499,000,000	504,399,180	
第349回 利付国債(10年)	570,000,000	576,258,600	
第350回 利付国債(10年)	744,000,000	752,258,400	
第351回 利付国債(10年)	570,000,000	576,395,400	

第352回 利付国債(10年)	556,000,000	562,282,800	
第353回 利付国債(10年)	543,000,000	549,363,960	
第354回 利付国債(10年)	518,000,000	524,091,680	
第355回 利付国債(10年)	422,000,000	426,806,580	
第356回 利付国債(10年)	418,000,000	422,589,640	
第357回 利付国債(10年)	429,000,000	433,508,790	
第358回 利付国債(10年)	525,000,000	530,244,750	
第359回 利付国債(10年)	337,000,000	340,033,000	
第360回 利付国債(10年)	293,000,000	295,323,490	
第361回 利付国債(10年)	457,000,000	460,098,460	
第362回 利付国債(10年)	354,000,000	355,968,240	
第363回 利付国債(10年)	643,000,000	645,752,040	
第364回 利付国債(10年)	51,000,000	51,148,920	
第1回 利付国債(30年)	10,000,000	12,218,800	
第2回 利付国債(30年)	82,000,000	98,420,500	
第3回 利付国債(30年)	123,000,000	147,127,680	
第4回 利付国債(30年)	79,000,000	99,459,420	
第5回 利付国債(30年)	104,000,000	125,167,120	
第6回 利付国債(30年)	78,000,000	96,027,360	
第7回 利付国債(30年)	39,000,000	47,927,490	
第8回 利付国債(30年)	21,000,000	24,828,300	
第9回 利付国債(30年)	12,000,000	13,670,760	
第10回 利付国債(30年)	21,000,000	23,258,970	
第11回 利付国債(30年)	30,000,000	35,328,300	
第12回 利付国債(30年)	32,000,000	39,271,040	
第13回 利付国債(30年)	39,000,000	47,526,180	
第14回 利付国債(30年)	59,000,000	74,918,790	
第15回 利付国債(30年)	76,000,000	97,732,200	
第16回 利付国債(30年)	53,000,000	68,409,750	
第17回 利付国債(30年)	54,000,000	69,220,980	
第18回 利付国債(30年)	76,000,000	96,703,160	
第19回 利付国債(30年)	55,000,000	70,212,450	
第20回 利付国債(30年)	65,000,000	84,993,350	
第21回 利付国債(30年)	66,000,000	84,736,740	
第22回 利付国債(30年)	79,000,000	103,929,240	
第23回 利付国債(30年)	85,000,000	112,200,850	
第24回 利付国債(30年)	70,000,000	92,642,200	
第25回 利付国債(30年)	78,000,000	101,150,400	

第26回	利付国債(30年)	154,000,000	202,546,960	
第27回	利付国債(30年)	148,000,000	197,927,800	
第28回	利付国債(30年)	194,000,000	260,596,320	
第29回	利付国債(30年)	208,000,000	277,280,640	
第30回	利付国債(30年)	219,000,000	289,436,970	
第31回	利付国債(30年)	215,000,000	281,486,600	
第32回	利付国債(30年)	268,000,000	356,732,120	
第33回	利付国債(30年)	299,000,000	383,407,700	
第34回	利付国債(30年)	276,000,000	365,412,960	
第35回	利付国債(30年)	304,000,000	392,606,880	
第36回	利付国債(30年)	287,000,000	371,888,860	
第37回	利付国債(30年)	311,000,000	397,986,700	
第38回	利付国債(30年)	207,000,000	261,356,130	
第39回	利付国債(30年)	192,000,000	246,737,280	
第40回	利付国債(30年)	165,000,000	208,845,450	
第41回	利付国債(30年)	147,000,000	183,338,400	
第42回	利付国債(30年)	151,000,000	188,514,440	
第43回	利付国債(30年)	143,000,000	178,708,530	
第44回	利付国債(30年)	146,000,000	182,635,780	
第45回	利付国債(30年)	190,000,000	229,776,500	
第46回	利付国債(30年)	226,000,000	273,480,340	
第47回	利付国債(30年)	206,000,000	254,045,380	
第48回	利付国債(30年)	216,000,000	257,106,960	
第49回	利付国債(30年)	231,000,000	275,074,800	
第50回	利付国債(30年)	212,000,000	223,607,000	
第51回	利付国債(30年)	214,000,000	201,112,920	
第52回	利付国債(30年)	222,000,000	218,381,400	
第53回	利付国債(30年)	204,000,000	205,115,880	
第54回	利付国債(30年)	213,000,000	223,837,440	
第55回	利付国債(30年)	201,000,000	211,080,150	
第56回	利付国債(30年)	205,000,000	214,887,150	
第57回	利付国債(30年)	208,000,000	217,869,600	
第58回	利付国債(30年)	257,000,000	268,680,650	
第59回	利付国債(30年)	199,000,000	202,862,590	
第60回	利付国債(30年)	181,000,000	193,098,040	
第61回	利付国債(30年)	178,000,000	180,880,040	
第62回	利付国債(30年)	175,000,000	168,714,000	
第63回	利付国債(30年)	188,000,000	176,186,080	
第64回	利付国債(30年)	191,000,000	178,487,590	
第65回	利付国債(30年)	169,000,000	157,658,410	
第66回	利付国債(30年)	174,000,000	162,237,600	
第67回	利付国債(30年)	220,000,000	216,046,600	
第68回	利付国債(30年)	223,000,000	218,963,700	
第69回	利付国債(30年)	215,000,000	216,831,800	
第70回	利付国債(30年)	209,000,000	210,536,150	
第71回	利付国債(30年)	213,000,000	214,312,080	
第72回	利付国債(30年)	80,000,000	80,396,000	
第61回	利付国債(20年)	139,000,000	141,062,760	
第62回	利付国債(20年)	218,000,000	221,169,720	
第70回	利付国債(20年)	437,000,000	465,505,510	

第71回 利付国債(20年)	52,000,000	55,123,640	
第72回 利付国債(20年)	149,000,000	158,387,000	
第73回 利付国債(20年)	126,000,000	134,254,260	
第74回 利付国債(20年)	80,000,000	85,487,200	
第75回 利付国債(20年)	80,000,000	85,929,600	
第76回 利付国債(20年)	115,000,000	122,757,900	
第77回 利付国債(20年)	83,000,000	88,875,570	
第78回 利付国債(20年)	84,000,000	90,066,480	
第79回 利付国債(20年)	69,000,000	74,230,890	
第80回 利付国債(20年)	86,000,000	92,827,540	
第81回 利付国債(20年)	64,000,000	69,182,720	
第82回 利付国債(20年)	104,000,000	112,821,280	
第83回 利付国債(20年)	102,000,000	111,217,740	
第84回 利付国債(20年)	124,000,000	134,698,720	
第85回 利付国債(20年)	136,000,000	149,038,320	
第86回 利付国債(20年)	145,000,000	160,159,750	
第87回 利付国債(20年)	122,000,000	134,225,620	
第88回 利付国債(20年)	249,000,000	276,434,820	
第89回 利付国債(20年)	189,000,000	208,954,620	
第90回 利付国債(20年)	260,000,000	288,904,200	
第91回 利付国債(20年)	185,000,000	206,461,850	
第92回 利付国債(20年)	336,000,000	373,484,160	
第93回 利付国債(20年)	219,000,000	243,455,730	
第94回 利付国債(20年)	267,000,000	298,244,340	
第95回 利付国債(20年)	229,000,000	259,637,910	
第96回 利付国債(20年)	134,000,000	150,427,060	
第97回 利付国債(20年)	196,000,000	222,138,560	
第98回 利付国債(20年)	166,000,000	187,166,660	
第99回 利付国債(20年)	303,000,000	343,192,950	
第100回 利付国債(20年)	252,000,000	288,300,600	
第101回 利付国債(20年)	175,000,000	202,429,500	
第102回 利付国債(20年)	182,000,000	211,600,480	
第103回 利付国債(20年)	131,000,000	151,441,240	
第104回 利付国債(20年)	104,000,000	118,855,360	
第105回 利付国債(20年)	88,000,000	101,019,600	
第106回 利付国債(20年)	64,000,000	73,907,200	
第107回 利付国債(20年)	85,000,000	98,037,300	
第108回 利付国債(20年)	99,000,000	112,778,820	
第109回 利付国債(20年)	79,000,000	90,347,560	
第110回 利付国債(20年)	191,000,000	221,241,030	

第111回 利付国債(20年)	137,000,000	160,361,240	
第112回 利付国債(20年)	197,000,000	229,095,240	
第113回 利付国債(20年)	333,000,000	388,914,030	
第114回 利付国債(20年)	200,000,000	234,466,000	
第115回 利付国債(20年)	138,000,000	162,897,960	
第116回 利付国債(20年)	160,000,000	189,593,600	
第117回 利付国債(20年)	238,000,000	280,037,940	
第118回 利付国債(20年)	155,000,000	181,642,950	
第119回 利付国債(20年)	140,000,000	161,665,000	
第120回 利付国債(20年)	145,000,000	164,952,000	
第121回 利付国債(20年)	221,000,000	257,814,180	
第122回 利付国債(20年)	160,000,000	185,243,200	
第123回 利付国債(20年)	257,000,000	305,400,810	
第124回 利付国債(20年)	170,000,000	200,477,600	
第125回 利付国債(20年)	193,000,000	231,806,510	
第126回 利付国債(20年)	179,000,000	211,665,710	
第127回 利付国債(20年)	189,000,000	221,736,690	
第128回 利付国債(20年)	253,000,000	297,576,070	
第129回 利付国債(20年)	169,000,000	197,167,230	
第130回 利付国債(20年)	250,000,000	292,330,000	
第131回 利付国債(20年)	164,000,000	190,167,840	
第132回 利付国債(20年)	95,000,000	110,374,800	
第133回 利付国債(20年)	156,000,000	182,807,040	
第134回 利付国債(20年)	164,000,000	192,668,840	
第135回 利付国債(20年)	114,000,000	132,762,120	

第136回 利付国債(20年)	118,000,000	136,214,480	
第137回 利付国債(20年)	35,000,000	40,856,900	
第138回 利付国債(20年)	39,000,000	44,710,770	
第139回 利付国債(20年)	42,000,000	48,588,960	
第140回 利付国債(20年)	104,000,000	121,684,160	
第141回 利付国債(20年)	163,000,000	191,138,690	
第142回 利付国債(20年)	95,000,000	112,437,250	
第143回 利付国債(20年)	160,000,000	186,232,000	
第144回 利付国債(20年)	98,000,000	112,974,400	
第145回 利付国債(20年)	255,000,000	300,290,550	
第146回 利付国債(20年)	243,000,000	286,749,720	
第147回 利付国債(20年)	266,000,000	311,360,980	
第148回 利付国債(20年)	235,000,000	272,708,100	
第149回 利付国債(20年)	254,000,000	295,211,500	
第150回 利付国債(20年)	274,000,000	315,497,300	
第151回 利付国債(20年)	267,000,000	301,010,460	
第152回 利付国債(20年)	251,000,000	283,190,750	
第153回 利付国債(20年)	256,000,000	292,620,800	
第154回 利付国債(20年)	242,000,000	273,626,980	
第155回 利付国債(20年)	269,000,000	297,027,110	
第156回 利付国債(20年)	226,000,000	230,684,980	
第157回 利付国債(20年)	234,000,000	231,865,920	
第158回 利付国債(20年)	220,000,000	227,209,400	
第159回 利付国債(20年)	203,000,000	212,392,810	
第160回 利付国債(20年)	178,000,000	188,840,200	

	第161回 利付国債(20年)	189,000,000	197,433,180	
	第162回 利付国債(20年)	212,000,000	221,270,760	
	第163回 利付国債(20年)	215,000,000	224,199,850	
	第164回 利付国債(20年)	298,000,000	305,604,960	
	第165回 利付国債(20年)	274,000,000	280,655,460	
	第166回 利付国債(20年)	262,000,000	276,567,200	
	第167回 利付国債(20年)	278,000,000	284,029,820	
	第168回 利付国債(20年)	245,000,000	245,793,800	
	第169回 利付国債(20年)	266,000,000	261,847,740	
	第170回 利付国債(20年)	239,000,000	234,827,060	
	第171回 利付国債(20年)	254,000,000	249,087,640	
	第172回 利付国債(20年)	243,000,000	242,171,370	
	第173回 利付国債(20年)	309,000,000	307,405,560	
	第174回 利付国債(20年)	305,000,000	303,142,550	
	第175回 利付国債(20年)	287,000,000	290,027,850	
	第176回 利付国債(20年)	292,000,000	294,855,760	
	第177回 利付国債(20年)	266,000,000	263,369,260	
	第178回 利付国債(20年)	95,000,000	95,689,700	
	国債証券 合計	54,444,000,000	58,968,646,420	
地方債証券	第730回 東京都公募公債	300,000,000	304,580,100	
	第34回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,557,100	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	304,308,300	
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,401,600	
	第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	145,994,256	
	第448回 大阪府公募公債(10年)	38,000,000	37,671,908	
	第455回 大阪府公募公債(10年)	180,000,000	180,043,560	

第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	114,457,600	
平成29年度第5回 京都府公募公債(20年)	100,000,000	103,941,100	
第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	115,226,100	
平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	106,873,000	
平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,520,900	
平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	120,793,330	
平成20年度第1回 福岡県公募公債	100,000,000	114,815,600	
平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	115,403,400	
第10回 群馬県公募公債	300,000,000	303,975,900	
第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,067,400	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,976,400	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	151,844,250	
第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	100,196,600	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	129,098,200	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	319,742,400	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	101,536,800	
第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,233,100	
第26回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,333,300	
第9回 川崎市公募公債(20年)	100,000,000	117,383,800	
第4回 川崎市公募公債(30年)	100,000,000	130,224,900	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	152,272,950	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,087,400	
平成30年度第5回 広島市公募公債	200,000,000	201,902,000	
平成29年度第1回 仙台市公募公債(20年)	100,000,000	103,680,000	
地方債証券 合計	4,631,000,000	4,888,143,254	
特殊債券			
第9回 新関西国際空港	300,000,000	322,889,400	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	310,535,700	
第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,590,100	

第115回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,344,900	
第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,764,400	
第205回 政保道路機構債券	100,000,000	115,539,500	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	115,266,100	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	508,882,000	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	113,416,700	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	182,259,053	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	98,878,600	
第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,982,600	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	103,255,300	
第17回 地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	233,458,200	
第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	404,835,600	
第1回 地方公共団体金融機構債券(30年)	100,000,000	126,621,600	
第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,735,400	
第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,129,162	
第120回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,649,800	
第136回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,402,400	
第16回 公営企業債券	200,000,000	217,039,000	
第97回 都市再生債券	100,000,000	106,997,300	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	200,611,400	
第59回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,099,400	
第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,012,194,000	
第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,490,500	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,872,000	24,161,980	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,904,000	61,059,768	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,631,000	72,755,723	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,834,000	64,058,202	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,376,000	73,378,995	
第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,986,000	78,040,432	
第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,068,000	37,882,220	

	第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	309,576,000	324,559,478	
	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	193,965,000	202,363,684	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	125,787,000	132,315,345	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	110,802,000	115,222,999	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	222,393,000	223,082,418	
	い第845号 利付商工債券	200,000,000	200,714,200	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	100,171,100	
	第344回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,166,100	
	第353回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,152,700	
	第116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,069,400	
	特殊債券 合計	7,234,194,000	7,581,022,859	
社債券	第26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	300,000,000	301,314,000	
	第13回 クレディ・アグリコル	100,000,000	100,153,800	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	202,165,000	
	第25回 首都高速道路債券	400,000,000	400,146,800	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	203,110,200	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	101,601,800	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	101,383,200	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,105,600	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	204,015,000	
	第14回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,838,500	
	第5回 電通グループ	400,000,000	402,689,600	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	101,156,700	
	第1回 オリックス銀行	200,000,000	200,732,600	
	第1回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	101,401,800	
	第29回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	107,544,400	
	第1回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	101,501,900	
	第8回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	100,000,000	106,006,400	
	第18回 NTTファイナンス	100,000,000	101,009,300	
	第96回 トヨタファイナンス	100,000,000	99,861,600	
	第6回 三井住友海上火災保険	100,000,000	100,163,600	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,695,000	
	第7回 野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	230,571,400	

第77回 東京急行電鉄	100,000,000	101,455,200	
第27回 KDDI	200,000,000	201,240,400	
第510回 関西電力	100,000,000	101,651,400	
第381回 中国電力	200,000,000	204,413,000	
第304回 北陸電力	100,000,000	101,843,300	
第306回 北陸電力	100,000,000	102,076,300	
第253回 四国電力	200,000,000	203,030,000	
第429回 九州電力	200,000,000	204,856,600	
第331回 北海道電力	100,000,000	101,111,800	
第13回 電源開発	100,000,000	106,995,300	
社債券 合計	5,000,000,000	5,100,841,500	
合計		76,538,654,033	

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。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,445,296
コール・ローン	369,655,191
投資証券	31,590,841,400
未収配当金	150,637,686
流動資産合計	32,113,579,573
資産合計	32,113,579,573
負債の部	
流動負債	
未払解約金	76,653,844
その他未払費用	376
流動負債合計	76,654,220
負債合計	76,654,220
純資産の部	
元本等	
元本	16,553,467,034
剰余金	
剰余金又は欠損金()	15,483,458,319
元本等合計	32,036,925,353
純資産合計	32,036,925,353
負債純資産合計	32,113,579,573

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
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11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,261,892,310円
同期中追加設定元本額	7,821,681,126円
同期中一部解約元本額	7,530,106,402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）	1,369,863,917円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,254,523,882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	8,051,991,861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）	1,744,832,702円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,593,687,653円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,391,874,106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）	96,254,021円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	10,992,362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）	4,097,440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）	6,900,140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）	28,228,485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）	71,012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）	149,453円
計	16,553,467,034円
2. 受益権の総数	16,553,467,034口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11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当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、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。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11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	68,620,137
合計	68,620,137

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年11月13日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額	1.9354円
(1万口当たり純資産額)	(19,354円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	C R E ロジスティクスファンド 投資法人	1,087	236,422,500	
	G L P 投資法人	9,094	1,680,571,200	
	N T T 都市開発リート投資法人	2,691	413,068,500	
	O n e リート投資法人	487	146,100,000	
	S O S I L A 物流リート投資法人	1,178	194,605,600	
	いちごオフィスリート投資法人	2,301	199,266,600	
	いちごホテルリート投資法人	465	41,896,500	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	1,496	679,932,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,807	1,006,309,500	
	イオンリート投資法人	3,302	514,451,600	
	インヴィンシブル投資法人	12,358	521,507,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	565	78,026,500	
	オリックス不動産投資法人	5,594	1,022,583,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,950	236,925,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	869	614,383,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人	1,918	413,904,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,121	316,234,100	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	1,264	409,536,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	636	77,528,400	

サンケイリアルエステート投資法人	889	109,435,900	
ザイマックス・リート投資法人	408	46,879,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,602	557,409,600	
ジャパンエクセレント投資法人	2,605	356,624,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,808	1,895,400,000	
スターアジア不動産投資法人	2,902	177,892,600	
スターツプロシード投資法人	437	101,340,300	
タカラレーベン不動産投資法人	1,107	125,201,700	
トーセイ・リート投資法人	587	75,488,200	
ヒューリックリート投資法人	2,619	447,063,300	
フロンティア不動産投資法人	984	503,808,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	599	95,959,800	
マリモ地方創生リート投資法人	263	35,294,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,321	885,572,100	
ラサールロジポート投資法人	3,437	653,373,700	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,095	180,894,000	
阪急阪神リート投資法人	1,268	213,784,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,044	620,136,000	
三菱地所物流リート投資法人	714	340,578,000	
産業ファンド投資法人	3,986	831,081,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	659	87,778,800	
森トラスト総合リート投資法人	2,007	289,008,000	
森ヒルズリート投資法人	3,302	509,168,400	
星野リゾート・リート投資法人	433	290,110,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,523	725,307,300	
大江戸温泉リート投資法人	453	36,421,200	
大和ハウスリート投資法人	4,216	1,359,660,000	
大和証券オフィス投資法人	594	437,184,000	
大和証券リビング投資法人	3,794	425,686,800	
投資法人みらい	3,201	165,811,800	
東海道リート投資法人	215	23,005,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,882	358,709,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	969	625,005,000	
日本ビルファンド投資法人	3,182	2,300,586,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,845	767,520,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,448	1,699,136,000	
日本リート投資法人	866	363,287,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,835	607,385,000	
日本都市ファンド投資法人	14,167	1,420,950,100	

	福岡リート投資法人	1,452	241,612,800	
	平和不動産リート投資法人	1,819	288,311,500	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,080	1,512,728,000	
投資証券	合計	162,800	31,590,841,400	
合計			31,590,841,400	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年11月30日現在

資産総額	90,185,666円
負債総額	18,707円
純資産総額（ - ）	90,166,959円
発行済数量	81,249,393口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1098円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	114,181,234,240円
負債総額	604,235,116円
純資産総額（ - ）	113,576,999,124円
発行済数量	52,504,554,686口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1632円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	79,580,998,695円
負債総額	1,975,068,989円
純資産総額（ - ）	77,605,929,706円
発行済数量	78,792,655,935口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9849円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	31,378,813,806円
負債総額	113,317,500円
純資産総額（ - ）	31,265,496,306円
発行済数量	16,539,551,286口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8903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11月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年11月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	422	69,113
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	139	26,178
単位型公社債投資信託	0	0
合計	561	95,292

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。

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。

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．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26期事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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27期事業年度に係る中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,674,230		40,822,894
有価証券		6,301,326		-
前払費用		546,666		718,688
未収委託者報酬		4,882,250		5,412,597
未収運用受託報酬		2,039,974		2,425,363
未収投資助言報酬		174,892		216,401
その他		50,572		38,899
流動資産合計		42,669,914		49,634,844
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	98,471	1	130,411
車両	1	2,180	1	1,454
器具備品	1	142,866	1	125,816
有形固定資産合計		243,517		257,681
無形固定資産				
ソフトウェア		969,528		1,225,315
ソフトウェア仮勘定		216,033		359,445
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,193,575		1,592,774
投資その他の資産				
投資有価証券		33,634,499		37,058,043
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		237,055
差入保証金		303,875		382,751
繰延税金資産		1,292,446		1,200,554
その他		17,821		15,154
投資その他の資産合計		35,314,867		38,959,781
固定資産合計		36,751,960		40,810,238
資産合計		79,421,875		90,445,083

負債の部

流動負債

預り金		45,856		47,039
未払収益分配金		5,643		5,643
未払手数料	2	1,633,415	2	1,911,775
未払運用委託報酬	2	810,981	2	1,871,193
未払投資助言報酬	2	852,782	2	1,147,828
その他未払金	2	3,591,122	2	4,839,326
未払費用	2	146,706	2	132,085
未払法人税等		686,983		1,042,946
未払消費税等		527,890		904,947
賞与引当金		975,373		1,123,336
その他		16,476		82,891
流動負債合計		9,293,232		13,109,013

固定負債

退職給付引当金		1,950,746		2,155,971
役員退職慰労引当金		22,700		27,450
固定負債合計		1,973,446		2,183,421

負債合計

		11,266,679		15,292,435
--	--	------------	--	------------

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		48,745,315		55,045,550
利益剰余金合計		49,425,122		55,725,357
株主資本合計		67,706,962		74,007,197

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		512,183		1,242,655
繰延ヘッジ損益		63,949		97,204
評価・換算差額等合計		448,234		1,145,450

純資産合計

		68,155,196		75,152,647
--	--	------------	--	------------

負債・純資産合計

		79,421,875		90,445,083
--	--	------------	--	------------

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	27,088,982	26,838,624
運用受託報酬	13,165,624	18,630,497
投資助言報酬	677,248	878,199
その他営業収益	2,000	-
営業収益計	40,933,856	46,347,320
営業費用		
支払手数料	11,090,478	10,412,572
広告宣伝費	25,032	17,988
調査費	6,466,222	8,251,721
支払運用委託報酬	1,866,932	2,916,886
支払投資助言報酬	3,238,306	3,866,188
委託調査費	125,262	129,355
調査費	1,235,721	1,339,290
委託計算費	249,653	256,942
営業雑経費	929,200	760,920
通信費	47,749	64,179
印刷費	189,820	176,812
協会費	38,958	40,454
その他営業雑経費	652,672	479,472
営業費用計	18,760,587	19,700,144
一般管理費		
役員報酬	142,108	126,093
給料・手当	3,934,995	4,103,410
賞与引当金繰入額	974,031	1,120,241
賞与	285,503	280,494
福利厚生費	762,163	797,392
退職給付費用	307,637	359,252
役員退職慰労引当金繰入額	7,000	7,150
役員退職慰労金	30	-
その他人件費	172,763	166,126
不動産賃借料	682,105	716,925
その他不動産経費	31,283	32,816
交際費	28,014	6,766
旅費交通費	170,993	8,778
固定資産減価償却費	442,697	477,830
租税公課	341,195	395,649
業務委託費	291,579	315,850
器具備品費	354,221	357,066
保険料	46,549	45,818
寄付金	-	30,000
諸経費	225,408	226,790
一般管理費計	9,200,283	9,574,455
営業利益	12,972,984	17,072,720
営業外収益		
受取利息	1,176	289
有価証券利息	12,651	4,705
受取配当金	1 200,028	1 74,260

金融派生商品収益		14,042		40,753
その他営業外収益		13,606		14,644
営業外収益計		241,504		134,653
営業外費用				
為替差損		27,288		32,651
金融派生商品費用		9,593		24,611
控除対象外消費税		5,453		3,018
その他営業外費用		8,493		4,203
営業外費用計		50,829		64,485
経常利益		13,163,659		17,142,888
特別利益				
投資有価証券売却益		4,459		3,376
投資有価証券償還益		1,744		20,904
特別利益計		6,204		24,280
特別損失				
投資有価証券売却損		72,045		49,202
投資有価証券償還損		4,115		105,236
固定資産除却損	2	8,422	2	870
事故損失賠償金	3	4,351	3	12,614
特別損失計		88,934		167,924
税引前当期純利益		13,080,929		16,999,244
法人税、住民税及び事業税		4,134,957		5,395,622
法人税等調整額		106,970		196,661
法人税等合計		4,027,986		5,198,960
当期純利益		9,052,942		11,800,283

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021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	48,745,315	49,425,122	67,706,962
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	-	-	-	-	-	-	-	11,800,283	11,800,283	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	6,300,235	6,300,235	6,300,235
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
当期純利益	-	-	-	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	730,471	33,255	697,216	697,216
当期変動額合計	730,471	33,255	697,216	6,997,451
当期末残高	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021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。

(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 2021年3月26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

財務諸表に与える影響はありません。

- ・「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

財務諸表に与える影響はありません。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物附属設備	310,385千円	318,792千円
車両	4,549	5,275
器具備品	394,258	447,285
計	709,193	771,352

2. 当事業年度において、関係会社に対する負債として、未払手数料、未払運用委託報酬、未払投資助言報酬、その他未払金、未払費用に含まれるものの合計額は、負債及び純資産の合計額の100分の5を超えており、その金額は4,960,571千円であります。前事業年度の関係会社に対する負債は、その金額が負債及び純資産の合計額の100分の5以下であるため、記載を省略しております。

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
受取配当金	70,499千円	9,823千円

2. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
建物附属設備	4,181千円	- 千円
器具備品	4,240	870
計	8,422	870

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021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

2020年6月29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	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月29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

2021年6月30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	9,440,289千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	87,049円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30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・地方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(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	-
資産計	68,610,058	68,615,802	5,744
その他未払金	3,591,122	3,591,122	-
負債計	3,591,122	3,591,122	-
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	-
デリバティブ取引計	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 示しております。

当事業年度(2021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	40,822,894	40,822,894	-
有価証券			
満期保有目的の債券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	15,018,123	15,023,675	5,551
其他有価証券	22,039,919	22,039,919	-
資産計	77,880,937	77,886,489	5,551
其他未払金	4,839,326	4,839,326	-
負債計	4,839,326	4,839,326	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	65,238	65,238	-
デリバティブ取引計	65,238	65,238	-

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

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

資 産

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。

負 債

其他未払金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
関係会社株式	66,222	66,222

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(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	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	6,148,442	12,928,752	2,006,497	-
合計	41,122,673	24,478,752	2,006,497	-

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2021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	40,822,894	-	-	-
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	-	15,020,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	2,802,653	17,140,145	2,093,118	-
合計	43,625,547	32,160,145	2,093,118	-

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(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

当事業年度(2021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	12,218,123	12,224,015	5,891
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,218,123	12,224,015	5,891
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	2,800,000	2,799,660	340
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,800,000	2,799,660	340
合計		15,018,123	15,023,675	5,551

2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度（2021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)	14,512,369	12,884,500	1,627,869
	小計	14,512,369	12,884,500	1,627,869
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)	7,527,550	7,711,000	183,449
	小計	7,527,550	7,711,000	183,449
	合計	22,039,919	20,595,500	1,444,419

(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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021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	3,737,763	3,376	49,202
合計	3,737,763	3,376	49,202

(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(2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2021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(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。

当事業年度(2021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	1,239,952	-	65,238
合計			1,239,952	-	65,238

(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、年俸制適用者及び年俸制非適用者を制度の対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	- 千円	1,833,391 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	-
勤務費用	-	247,178
利息費用	-	5,766
数理計算上の差異の発生額	-	28,155
退職給付の支払額	-	65,497
その他	-	936
退職給付債務の期末残高	1,833,391	2,049,929

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,801,748 千円	117,355 千円
退職給付費用	274,595	19,053
退職給付の支払額	71,495	1,275
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	1,887,492	-
その他	-	936
退職給付引当金の期末残高	117,355	134,197

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,950,746 千円	2,184,126 千円
未認識数理計算上の差異	-	28,155
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,950,746	2,155,971
退職給付引当金	1,950,746	2,155,971
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,950,746	2,155,971

(4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	274,595 千円	19,053 千円
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	54,100	-
勤務費用	-	247,178
利息費用	-	5,766
確定給付制度に係る退職給付費用	220,494	271,997

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
割引率	0.32 %	0.28 %

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62,535千円、当事業年度において64,693千円であり、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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	298,659 千円	343,965 千円
未払事業税	130,502	216,469
退職給付引当金	597,318	660,158
税務上の繰延資産償却超過額	4,337	2,848
役員退職慰労引当金	6,950	8,405
投資有価証券評価差額	254,174	156,971
その他	82,112	96,541
小計	1,374,055	1,485,360
評価性引当額	19	10
繰延税金資産合計	1,374,036	1,485,350
繰延税金負債		
特別分配金否認	3,682	4,093
投資有価証券評価差額	77,906	280,701
繰延税金負債合計	81,589	284,795
繰延税金資産(は負債)の純額	1,292,446	1,200,554

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。

当事業年度（自2020年4月1日 至2021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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021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	3,562,864	未収運用受託報酬	988,094
								投資助言報酬の受取	128,262	未収投資助言報酬	11,387
								連結納税	4,351,846	その他未払金	4,351,846

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1 株当たり純資産額	628,459円68銭	692,983円25銭
1 株当たり当期純利益金額	83,477円26銭	108,810円52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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,052,942千円	11,800,283千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,052,942千円	11,800,283千円
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27期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,397,127
有価証券		3,450,000
前払費用		1,036,262
未収委託者報酬		5,905,517
未収運用受託報酬		4,241,456
未収投資助言報酬		223,450
その他		5,312
流動資産合計		46,259,127
固定資産		
有形固定資産	1	242,517
無形固定資産		1,880,946
投資その他の資産		
投資有価証券		32,410,243
関係会社株式		66,222
長期前払費用		56,143
差入保証金		378,030
繰延税金資産		870,069
その他		10,089
投資その他の資産合計		33,790,798
固定資産合計		35,914,262
資産合計		82,173,390

負債の部

流動負債

預り金		54,095
未払収益分配金		7,093
未払手数料		2,159,272
未払運用委託報酬		1,170,066
未払投資助言報酬		811,258
その他未払金		2,313,329
未払費用		190,552
未払法人税等		626,447
未払消費税等	2	366,077
前受投資助言報酬		42,288
賞与引当金		667,470
その他		10,955
流動負債合計		<u>8,418,909</u>

固定負債

退職給付引当金		2,288,326
役員退職慰労引当金		31,950
その他		20,039
固定負債合計		<u>2,340,315</u>

負債合計

	<u>10,759,224</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		51,534,686
利益剰余金合計		<u>52,214,493</u>

株主資本合計

	<u>70,496,333</u>
--	-------------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		1,028,471
繰延ヘッジ損益		110,639
評価・換算差額等合計		<u>917,831</u>

純資産合計

	<u>71,414,165</u>
--	-------------------

負債・純資産合計

	<u>82,173,390</u>
--	-------------------

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第27期中間会計期間	
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	14,604,756
運用受託報酬	8,499,817
投資助言報酬	479,991
営業収益計	23,584,565
営業費用	10,360,657
一般管理費	1 5,226,094
営業利益	7,997,813
営業外収益	2 85,167
営業外費用	3 17,578
経常利益	8,065,402
特別利益	4 462,465
特別損失	5 39,144
税引前中間純利益	8,488,723
法人税、住民税及び事業税	2,286,317
法人税等調整額	272,980
法人税等合計	2,559,297
中間純利益	5,929,426

(3)中間株主資本等変動計算書

第27期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30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	55,045,550	55,725,357	74,007,197
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,440,289	9,440,289	9,440,289
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	5,929,426	5,929,426	5,929,426
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	-	-	-	-	-	-	-	3,510,863	3,510,863	3,510,863
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	51,534,686	52,214,493	70,496,333

	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	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,440,289
中間純利益	-	-	-	5,929,426
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	214,183	13,435	227,618	227,618
当中間期変動額合計	214,183	13,435	227,618	3,738,481
当中間期末残高	1,028,471	110,639	917,831	71,414,165

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第27期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021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>その他有価証券 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>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．収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p>投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。</p> <p>投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 当該契約については、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。</p>
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>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。</p>
7．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るおります。</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 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るおります。</p>
8．連結納税制度	<p>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。</p>

（会計方針の変更）

1．収益認識に関する会計基準等の適用

「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、当中間会計期間に係る中間財務諸表への影響はありません。また、利益剰余金の当中間会計期間の期首残高への影響もありません。

2．時価の算定に関する会計基準等の適用

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、中間財務諸表に与える影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

（中間貸借対照表関係）

第27期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1．有形固定資産の減価償却累計額	803,871千円
2．消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第27期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1．減価償却の実施額	
有形固定資産	32,767千円
無形固定資産	216,861千円
2．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	75,449千円
為替差益	3,471千円
3．営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	17,202千円
4．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	462,465千円
5．特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	39,113千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第27期中間会計期間
 (自 2021年4月1日
 至 2021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
2021年6月30日 定時株主総会	普通株式	9,440,289	87,049	2021年3月31日	2021年6月30日

(金融商品関係)

第27期中間会計期間末(2021年9月30日現在)

1. 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、以下のとおりであります。

なお、市場価格のない株式等(注1)は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券			
満期保有目的の債券	3,450,000	3,450,000	-
その他有価証券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	13,068,571	13,071,011	2,439
その他有価証券	19,341,671	19,341,671	-
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	20,039	20,039	-

()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 〇 で示しております。

(注1) 市場価格のない株式等

関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格のない株式等と認められるため、上表に記載しておりません。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価: 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価: 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価: 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品
第27期中間会計期間末(2021年9月30日現在)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
デリバティブ取引() 為替予約	-	20,039	-	20,039
合計	-	20,039	-	20,039

()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。

なお、投資信託の時価は上記に含めておりません。投資信託の中間貸借対照表計上額は19,341,671千円であります。

(2) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品
第27期中間会計期間末(2021年9月30日現在)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
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	-	16,521,011	-	16,521,011
合計	-	16,521,011	-	16,521,011

(注) 時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明
有価証券及び投資有価証券

地方債は相場価格を用いて評価しております。当社が保有している地方債は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格と認められないため、その時価をレベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

第27期中間会計期間末（2021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	10,768,571	10,772,071	3,499
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	10,768,571	10,772,071	3,499
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	5,750,000	5,748,940	1,060
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	5,750,000	5,748,940	1,060
合計		16,518,571	16,521,011	2,439

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)	11,941,000	13,348,744	1,407,744
小計		11,941,000	13,348,744	1,407,744
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)	6,107,000	5,992,927	114,072
小計		6,107,000	5,992,927	114,072
合計		18,048,000	19,341,671	1,293,671

(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27期中間会計期間末（2021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27期中間会計期間末（2021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	1,246,788	-	20,039
合計			1,246,788	-	20,039

（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。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

区分	第27期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	14,604,756千円
投資運用業務	8,499,817千円
投資助言業務	479,991千円
計	23,584,565千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	3,214,017

[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27期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021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27期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021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27期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第27期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1株当たり純資産額	658,510円67銭
1株当たり中間純利益金額	54,675円29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	5,929,426千円
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>5,929,426千円</u>
期中平均株式数	108千株

(重要な後発事象)

第27期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021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

2021年6月30日に開催された定時株主総会において、定款の「任期」の条項に関し以下の変更が決議されました。

<変更前>

取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。

<変更後>

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。

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
2021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
2021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：2021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
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	
光世証券株式会社	12,000	
楽天証券株式会社	7,495	
内藤証券株式会社	3,002	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	

(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
2021年3月末現在、450百万円
- c. 事業の内容
「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社

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

（2）販売会社

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

（3）投資助言会社（参考情報）

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

3【資本関係】

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

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

第3【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2021年2月19日	有価証券報告書 有価証券届出書
2021年8月20日	半期報告書 有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2021年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の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2021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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年12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・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)の2020年11月21日から2021年11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・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)の2021年11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

2021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 大竹 新

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021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2021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（2021年4月1日から2021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、継続企業の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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。