【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5月20日提出
【計算期間】	第8期（自　2021年2月23日　至　2022年2月21日）
【ファンド名】	ＤＣニッセイ国内株式インデックス
【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】

① 基本方針

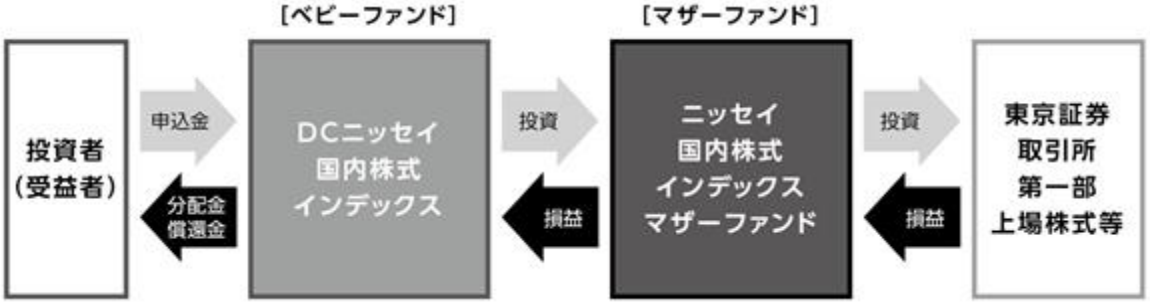
ファンドは、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



③ ファンドの特色

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）に連動する投資成果をめざします。

●主に「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」に投資することでTOPIX（配当込み）に連動する投資成果をめざします。

●マザーファンドの運用は、ニッセイ基礎研究所※が独自に開発したモデルを利用します。なお、モデルについては継続的に評価、分析を行い、必要と判断した場合には、見直しを行うことがあります。

※ニッセイ基礎研究所は、日本生命の創業100周年記念事業として1988年7月に設立された日本生命グループのシンクタンクです。生命保険分野にとどまらず、国内外の経済・金融、資産運用、年金・福祉・雇用に至るまで幅広い分野で、中立公正な立場から基礎的かつ問題解決型の調査・研究を実施しています。

〈TOPIXの特徴〉

■日本の代表的な株価指数です。
TOPIXは、テレビや新聞などでも日々の動きが報じられており、日本を代表する株価指数のひとつです。
TOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。

■国内株式市場の動きを表します。
TOPIXの構成銘柄は、日本の株式市場を広範に網羅しているため、TOPIXの動きは国内株式市場の動きを表しているといえます。TOPIXは1968年1月4日を基準日としています。この基準日の時価総額を100として、時価総額を指数で表しており、基準日の時価総額に対してどのくらい増えたか減ったかを表します。

〈TOPIXの著作権等について〉

TOPIX（東証株価指数）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

④　信託金の上限

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／国内／株式／インデックス型に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単　位　型 追　加　型	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特　殊　型

属性区分表

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

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。
株式	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株式を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

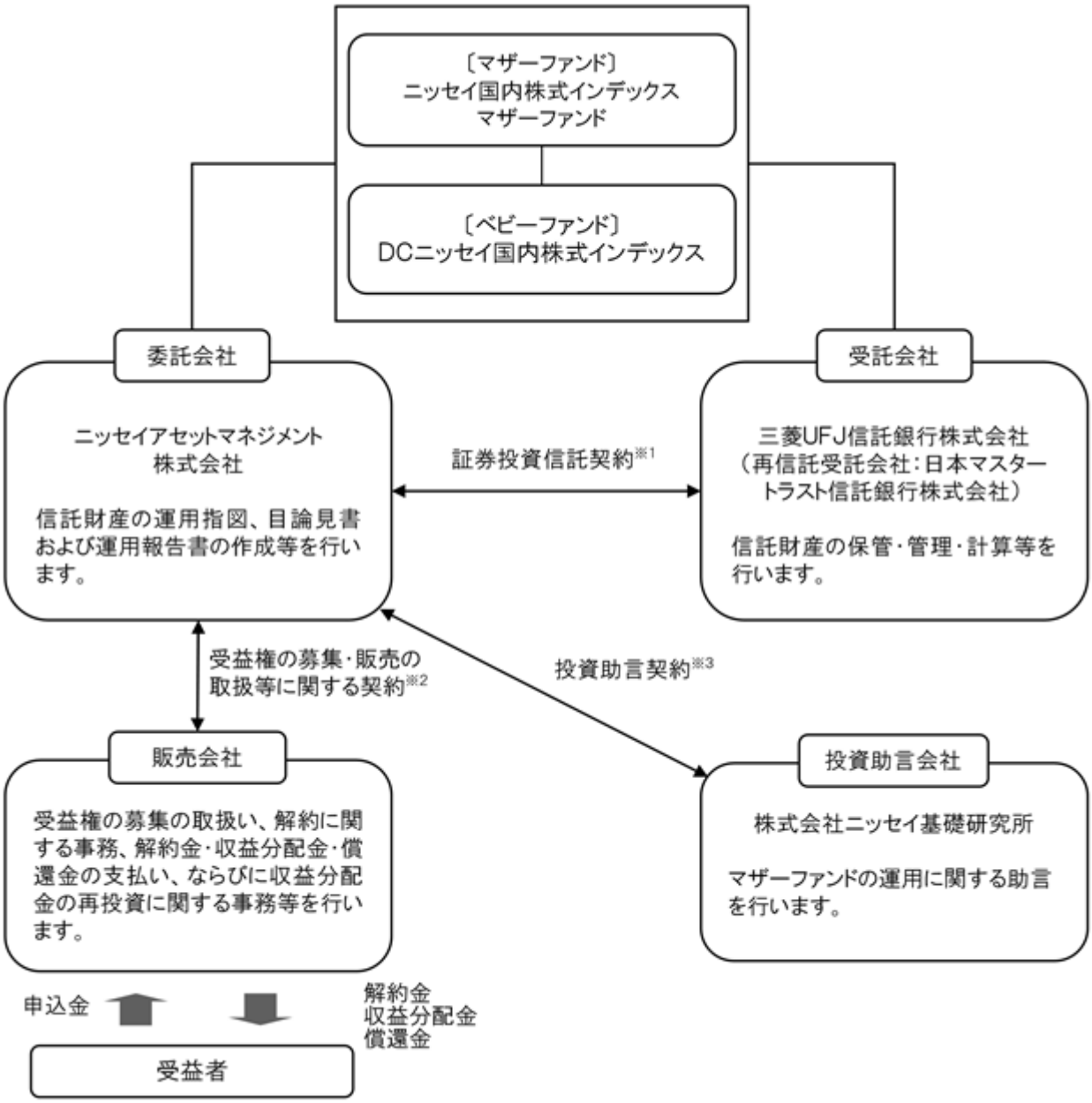
その他資産（投資信託証券（株式（一般））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
ＴＯＰＩＸ	目論見書または約款において、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）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】

2014年9月30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　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。

※２　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。

※３　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（2022年2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】

① 主としてニッセイ国内株式インデックスマザーファンドに投資を行い、ＴＯＰＩＸ（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
② 主として上記マザーファンドに投資を行いますが、追加設定・一部解約にともなう資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。
③ 株式の実質投資割合と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
④ 株式以外の資産（上記マザーファンドを通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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

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

（2）運用方法

a　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

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

b　投資態度

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

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

③ 株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

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

（3）投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦ 外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

（2）【投資対象】

a　主な投資対象

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドを主要投資対象とします。また、追加設定・一部解約等にともなう資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。

なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

b　約款に定める投資対象

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産（国内の通貨建表示のものに限ります）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　有価証券

主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます）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、国内の通貨建表示のものに限ります）に投資します。

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）

20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

③　金融商品

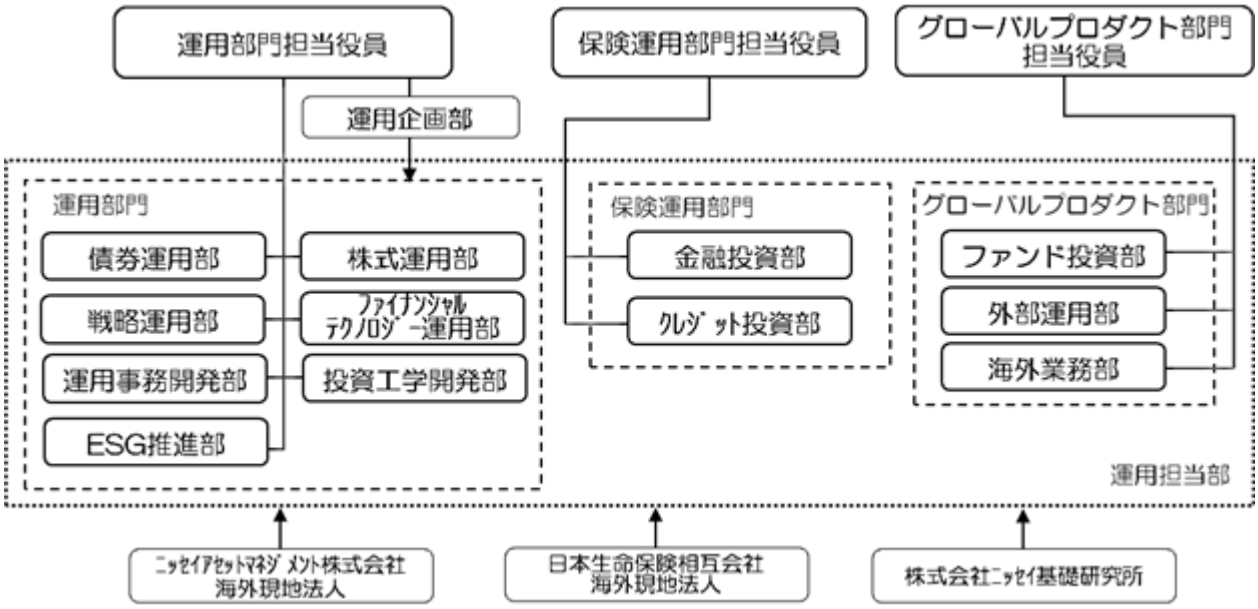
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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

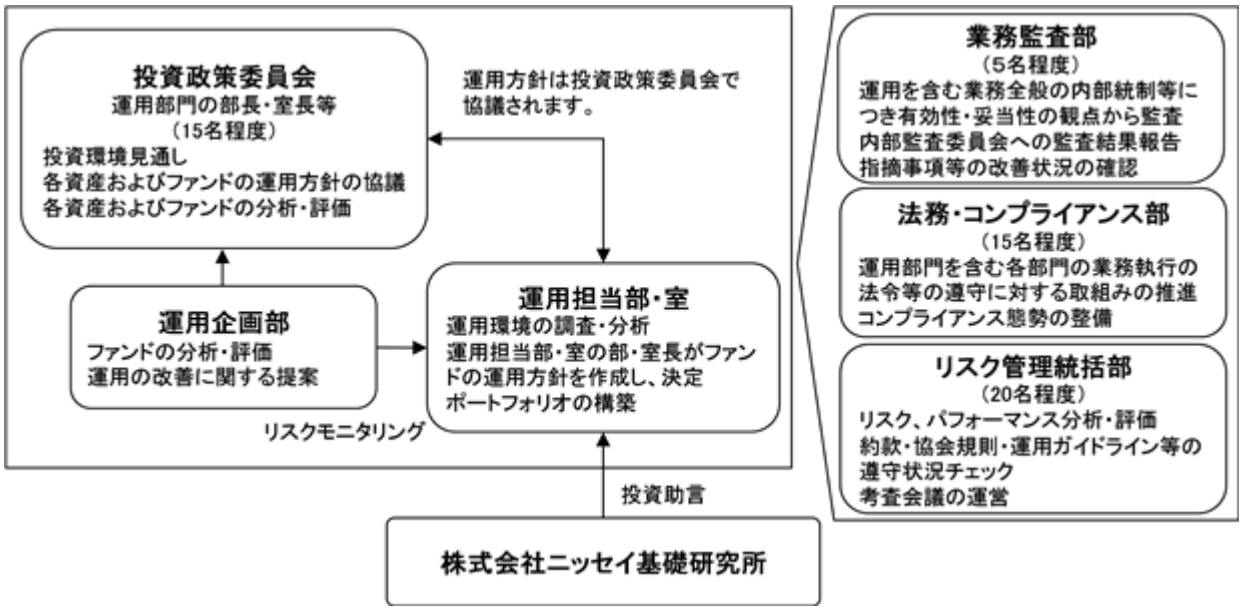
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



＜受託会社に対する管理体制等＞

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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（4）【分配方針】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1．分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2．分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

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、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

②　分配時期

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

③　支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

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＞

自動的に再投資されます。

○　将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

③　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20%以下とします。

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

⑤　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。

⑥　投資信託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。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

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

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

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

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

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

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

②　信用取引の範囲

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

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

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

③　先物取引等

１．国内の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28 条第８項第３号イに掲げるものをいいます）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28 条第８項第３号ロに掲げるものをいいます）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28 条第８項第３号ハに掲げるものをいいます）ならびに外国の金融商品取引所における国内の有価証券にかか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国内の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

④　スワップ取引

１．信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。

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

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引

１．信託財産に属する資産を効率的に運用するため、金利先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

ii．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

２．前記１．に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。

３．有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　有価証券の空売り

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

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　資金の借入れ

１．信託財産の効率的な運用、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

２．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

３．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

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

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

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

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

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、ＴＯＰＩＸ（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、ＴＯＰＩＸ（配当込み）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。

・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ＴＯＰＩＸ（配当込み）に連動する投資成果をめざしますが、主に以下の理由から基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。
・ファンドは、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、または、ファンドの構成銘柄のウエイトが当該指数の構成銘柄のウエイトと異なる場合があること
・株価指数先物と当該指数の動きの不一致
・ファンドは、流動性確保のために現金・預金等を保有すること
・ファンドは、信託報酬等の管理費用負担および売買委託手数料等の取引コストを負担すること
・ファンドにおける株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する価格の不一致
・当該指数の算出に使用する価格と基準価額の算出に使用する価格の不一致
・流動性が低下したとき、ファンドにおける株式および株価指数先物の売買の執行が思惑どおりにいかないこと
・当該指数の構成銘柄の入替えあるいは当該指数の算出方法の変更による影響

・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。

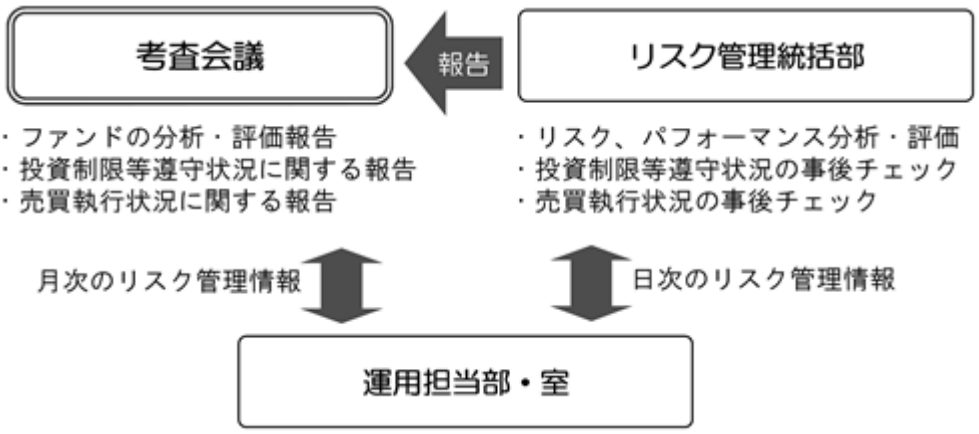
・ファミリーファンド方式に関する留意点
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・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期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。

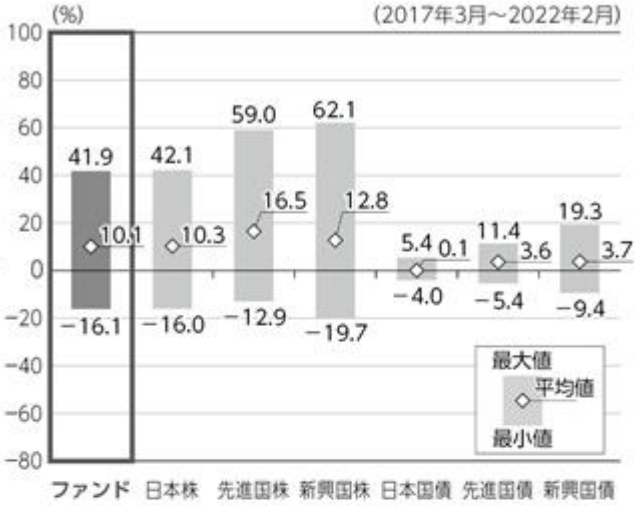
＜流動性リスクに関する管理体制＞

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。

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.143%（税抜0.13%）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
0.06%	0.05%	0.02%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

（4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

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

＜ご参考＞

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

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

（5）【課税上の取扱い】

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

なお、委託会社または販売会社が取得した場合には、上記の税制は適用されません。

○　税法または確定拠出年金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】

2022年2月28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		2,263,891,295	100.00
	内　日本	2,263,891,295	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△29,967	△0.00
純資産総額		2,263,861,328	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

2022年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		111,093,470,350	95.99
	内　日本	111,093,470,350	95.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,637,319,773	4.01
純資産総額		115,730,790,123	100.00

その他資産の投資状況

2022年2月28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）		4,595,130,000	3.97
	内　日本	4,595,130,000	3.97

（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。

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年2月28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	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,066,766,231	2.1480 2,291,509,604	2.1222 2,263,891,295	－ －	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。

種類別及び業種別投資比率

2022年2月28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

2022年2月28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	2,180,500	2,173.00 4,738,226,500	2,138.50 4,662,999,250	－ －	4.03
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	269,700	11,890.00 3,206,733,000	11,810.00 3,185,157,000	－ －	2.75
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	39,000	52,500.00 2,047,500,000	53,780.00 2,097,420,000	－ －	1.81
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,662,700	739.10 1,968,001,570	712.80 1,897,972,560	－ －	1.64
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	317,300	4,643.00 1,473,223,900	4,819.00 1,529,068,700	－ －	1.32
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	27,300	55,140.00 1,505,322,000	55,770.00 1,522,521,000	－ －	1.32
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	441,900	3,330.00 1,471,527,000	3,293.00 1,455,176,700	－ －	1.26
8	任天堂 日本	株式 その他製品	24,300	58,770.00 1,428,111,000	58,020.00 1,409,886,000	－ －	1.22
9	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	253,300	5,160.00 1,307,028,000	5,125.00 1,298,162,500	－ －	1.12
10	信越化学工業 日本	株式 化学	72,400	17,510.00 1,267,724,000	17,670.00 1,279,308,000	－ －	1.11
11	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	84,000	14,975.00 1,257,900,000	14,855.00 1,247,820,000	－ －	1.08
12	三菱商事 日本	株式 卸売業	317,700	4,061.00 1,290,179,700	3,871.00 1,229,816,700	－ －	1.06
13	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	293,900	4,277.00 1,257,010,300	4,121.00 1,211,161,900	－ －	1.05
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	338,900	3,662.00 1,241,051,800	3,525.00 1,194,622,500	－ －	1.03
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	338,300	3,494.00 1,182,020,200	3,501.00 1,184,388,300	－ －	1.02
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	207,000	6,009.00 1,243,863,000	5,650.00 1,169,550,000	－ －	1.01
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	54,800	21,450.00 1,175,460,000	21,205.00 1,162,034,000	－ －	1.00
18	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	308,000	3,793.00 1,168,244,000	3,756.00 1,156,848,000	－ －	1.00

19	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	296,500	3,834.00 1,136,781,000	3,743.00 1,109,799,500	－ －	0.96
20	日本電産 日本	株式 電気機器	111,600	9,956.00 1,111,089,600	9,883.00 1,102,942,800	－ －	0.95
21	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	48,600	21,155.00 1,028,133,000	21,130.00 1,026,918,000	－ －	0.89
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	126,500	7,938.00 1,004,157,000	7,787.00 985,055,500	－ －	0.85
23	第一三共 日本	株式 医薬品	338,300	2,549.50 862,495,850	2,793.50 945,041,050	－ －	0.82
24	三井物産 日本	株式 卸売業	329,300	3,075.00 1,012,597,500	2,865.50 943,609,150	－ －	0.82
25	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	639,800	1,472.00 941,785,600	1,450.50 928,029,900	－ －	0.80
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	165,900	5,726.00 949,943,400	5,591.00 927,546,900	－ －	0.80
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	139,800	7,033.00 983,213,400	6,574.00 919,045,200	－ －	0.79
28	ＳＭＣ 日本	株式 機械	12,600	67,490.00 850,374,000	68,050.00 857,430,000	－ －	0.74
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	543,000	1,592.00 864,456,000	1,525.00 828,075,000	－ －	0.72
30	ファナック 日本	株式 電気機器	37,800	21,525.00 813,645,000	21,155.00 799,659,000	－ －	0.69

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年2月28日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	16.93
		輸送用機器	8.16
		情報・通信業	7.76
		化学	6.35
		サービス業	5.49
		卸売業	5.48
		銀行業	5.21
		機械	5.03
		医薬品	4.84
		小売業	4.18
		食料品	3.29
		陸運業	2.95
		精密機器	2.54
		その他製品	2.30
		建設業	2.27
		保険業	2.10
		不動産業	1.91
		電気・ガス業	1.13
		その他金融業	1.10
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.79
		証券、商品先物取引業	0.75
		ガラス・土石製品	0.74
		ゴム製品	0.65
		海運業	0.62
		金属製品	0.58
		繊維製品	0.45
		石油・石炭製品	0.43
		空運業	0.41
		鉱業	0.27
		パルプ・紙	0.21
		倉庫・運輸関連業	0.17
		水産・農林業	0.09
	小計		95.99
合　計（対純資産総額比）			95.99

（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。

③【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

2022年2月28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　０４０３月	買建	243	4,638,467,700	4,595,130,000	3.97

（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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年2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(2015年2月20日)	1,123,383	1,123,383	1.1234	1.1234
第2計算期間末(2016年2月22日)	8,913,535	8,913,535	0.9904	0.9904
第3計算期間末(2017年2月20日)	51,667,301	51,667,301	1.2022	1.2022
第4計算期間末(2018年2月20日)	125,585,800	125,585,800	1.3955	1.3955
第5計算期間末(2019年2月20日)	268,006,162	268,006,162	1.3035	1.3035
第6計算期間末(2020年2月20日)	555,259,441	555,259,441	1.3849	1.3849
第7計算期間末(2021年2月22日)	1,050,123,658	1,050,123,658	1.6385	1.6385
第8計算期間末(2022年2月21日)	2,300,879,407	2,300,879,407	1.6471	1.6471
2021年2月末日	1,030,480,334	－	1.5766	－
3月末日	1,176,644,796	－	1.6663	－
4月末日	1,210,409,056	－	1.6192	－
5月末日	1,322,802,096	－	1.6410	－
6月末日	1,388,734,282	－	1.6599	－
7月末日	1,385,581,612	－	1.6237	－
8月末日	1,432,776,151	－	1.6748	－
9月末日	2,294,348,582	－	1.7476	－
10月末日	2,359,107,694	－	1.7225	－
11月末日	2,250,573,543	－	1.6592	－
12月末日	2,370,484,011	－	1.7174	－
2022年1月末日	2,266,568,721	－	1.6344	－
2月末日	2,263,861,328	－	1.6271	－

②【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
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	12.3
第2計算期間	△11.8
第3計算期間	21.4
第4計算期間	16.1
第5計算期間	△6.6
第6計算期間	6.2
第7計算期間	18.3
第8計算期間	0.5

（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	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	8,018,657	18,400	9,000,257
第3計算期間	40,235,783	6,258,639	42,977,401
第4計算期間	59,595,858	12,577,806	89,995,453
第5計算期間	140,200,798	24,596,240	205,600,011
第6計算期間	336,405,606	141,077,329	400,928,288
第7計算期間	596,819,131	356,856,386	640,891,033
第8計算期間	1,264,836,685	508,786,257	1,396,941,461

（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

2022年2月末現在

●基準価額・純資産の推移

基準価額	16,271円
純資産総額	22億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年 2 月	0円
2019年 2 月	0円
2020年 2 月	0円
2021年 2 月	0円
2022年 2 月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

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

●組入上位業種

	業 種	比 率
1	電気機器	16.9%
2	輸送用機器	8.2%
3	情報・通信業	7.8%
4	化学	6.4%
5	サービス業	5.5%
6	卸売業	5.5%
7	銀行業	5.2%
8	機械	5.0%
9	医薬品	4.8%
10	小売業	4.2%

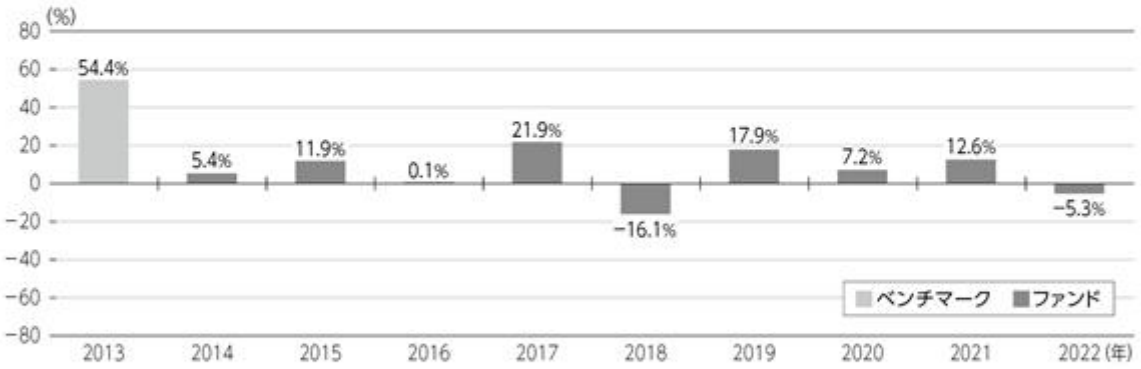
・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●組入上位銘柄

	銘 柄	比 率
1	トヨタ自動車	4.0%
2	ソニーグループ	2.8%
3	キーエンス	1.8%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%
5	リクルートホールディングス	1.3%
6	東京エレクトロン	1.3%
7	日本電信電話	1.3%
8	任天堂	1.2%
9	ソフトバンクグループ	1.1%
10	信越化学工業	1.1%

・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2014年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
・2013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。
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

②　取扱コース

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

分配金再投資コースを選択した場合、販売会社と「自動けいぞく（累積）投資契約」（同様の権利義務を規定する名称の異なる契約または規定も含みます）を締結します。

③　申込単位

１円以上１円単位とします。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

２．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）

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

②　換金単位

１口単位とします。

③　換金価額

換金請求受付日の基準価額とします。

○　換金手数料はありません。

④　信託財産留保額

ありません。

⑤　支払開始日

換金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。

⑥　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③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）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内株式先物取引	金融商品取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

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

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

⑤　基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

（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2月21日から翌年2月20日までとします。

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

（５）【その他】

①　繰上償還

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

ⅰ．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

ⅱ．やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

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

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

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

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

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

②　約款の変更等

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

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

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

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

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

５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

③　反対者の買取請求の不適用

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

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

・交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知れている受益者に交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（https://www.nam.co.jp/）に掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付します。

⑥　信託事務処理の再信託

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

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

分配金受取コースの場合、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、自動的に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（2021年2月23日から2022年2月21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】

【ＤＣニッセイ国内株式インデックス】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2021年2月22日現在	第8期 2022年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	12,854	9,521
コール・ローン	657,178	1,703,066
親投資信託受益証券	1,050,137,629	2,300,910,238
未収入金	11,370,063	8,766,431
流動資産合計	1,062,177,724	2,311,389,256
資産合計	1,062,177,724	2,311,389,256
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,355,938	8,735,483
未払受託者報酬	93,087	240,883
未払委託者報酬	558,666	1,445,474
その他未払費用	46,375	88,009
流動負債合計	12,054,066	10,509,849
負債合計	12,054,066	10,509,849
純資産の部		
元本等		
元本	640,891,033	1,396,941,461
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	409,232,625	903,937,946
（分配準備積立金）	169,486,668	99,942,695
元本等合計	1,050,123,658	2,300,879,407
純資産合計	1,050,123,658	2,300,879,407
負債純資産合計	1,062,177,724	2,311,389,256

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2020年2月21日 至　2021年2月22日	第8期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
営業収益		
受取利息	5	8
有価証券売買等損益	166,702,230	△52,054,263
営業収益合計	166,702,235	△52,054,255
営業費用		
支払利息	17	263
受託者報酬	155,287	377,865
委託者報酬	932,099	2,267,585
その他費用	77,410	149,149
営業費用合計	1,164,813	2,794,862
営業利益又は営業損失（△）	165,537,422	△54,849,117
経常利益又は経常損失（△）	165,537,422	△54,849,117
当期純利益又は当期純損失（△）	165,537,422	△54,849,117
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（△）	11,334,410	11,560,992
期首剰余金又は期首欠損金（△）	154,331,153	409,232,625
剰余金増加額又は欠損金減少額	224,364,689	899,639,202
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	224,364,689	899,639,202
剰余金減少額又は欠損金増加額	123,666,229	338,523,772
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	123,666,229	338,523,772
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（△）	409,232,625	903,937,946

（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8期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21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2月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2021年2月23日から2022年2月21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7期 2021年2月22日現在	第8期 2022年2月21日現在
１．　期首元本額	400,928,288円	640,891,033円
期中追加設定元本額	596,819,131円	1,264,836,685円
期中一部解約元本額	356,856,386円	508,786,257円
２．　受益権の総数	640,891,033口	1,396,941,461口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第7期 自　2020年2月21日 至　2021年2月22日	第8期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21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（154,203,024円）、収益調整金（259,505,255円）及び分配準備積立金（15,283,644円）より分配対象収益は428,991,923円（1万口当たり6,693.68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（0円）、収益調整金（835,125,694円）及び分配準備積立金（99,942,695円）より分配対象収益は935,068,389円（1万口当たり6,693.68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7期 自　2020年2月21日 至　2021年2月22日	第8期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21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7期 2021年2月22日現在	第8期 2022年2月21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7期 2021年2月22日現在	第8期 2022年2月21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	155,132,889	△63,994,195
合計	155,132,889	△63,994,195

（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7期 2021年2月22日現在	第8期 2022年2月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6385円 (16,385円)	1.6471円 (16,471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

2022年2月21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	1,071,087,533	2,300,910,238	
親投資信託受益証券　合計		1,071,087,533	2,300,910,238	
合計			2,300,910,238	

（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が、それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	2022年2月21日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	24,484,290
コール・ローン	4,379,719,491
株式	112,497,641,670
派生商品評価勘定	18,146,300
未収配当金	174,543,011
前払金	63,600,000
差入委託証拠金	182,055,000
流動資産合計	117,340,189,762
資産合計	117,340,189,762
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,482,250
未払解約金	176,705,800
その他未払費用	4,422
流動負債合計	279,192,472
負債合計	279,192,472
純資産の部	
元本等	
元本	54,493,461,224
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	62,567,536,066
元本等合計	117,060,997,290
純資産合計	117,060,997,290
負債純資産合計	117,340,189,762

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年2月23日 至　2022年2月21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		2022年2月21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	79,813,755,893円
	同期中追加設定元本額	23,632,095,039円
	同期中一部解約元本額	48,952,389,708円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,837,157,491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）	3,537,763,643円
	ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,656,374円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,113,704,346円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,082,250,932円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	5,253,789,188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）	4,978,524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）	16,544,754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）	16,615,142円
	ＤＣニッセイ国内株式インデックス	1,071,087,533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	21,344,932,487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）	2,132,535,408円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	201,061,345円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	208,072,492円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	241,020,671円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	473,144,628円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	49,277,264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）	98,857,796円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	7,457,971円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,013,941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）	4,293,106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）	6,605,585円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	26,854,982円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	136,468,048円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	100,987,893円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	224,574,567円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	205,595,072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）	4,063,776,492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）	19,506,730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）	80,115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）	166,146円
	ＦＷニッセイ国内株インデックス	485,273円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	145,285円
	計	54,493,461,224円
２．	受益権の総数	54,493,461,224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　2021年2月23日 至　2022年2月21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	2022年2月21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	2022年2月21日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△1,461,562,800
合計	△1,461,562,800

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年2月21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	4,462,690,000	－	4,378,480,000	△84,210,000
合計	4,462,690,000	－	4,378,480,000	△84,210,000

（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）

	2022年2月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1482円 (21,482円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年2月21日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	2,100	3,205.00	6,730,500	
日本水産	58,500	550.00	32,175,000	
マルハニチロ	9,100	2,579.00	23,468,900	
雪国まいたけ	4,300	1,221.00	5,250,300	
カネコ種苗	2,000	1,546.00	3,092,000	
サカタのタネ	7,000	3,400.00	23,800,000	
ホクト	4,900	1,959.00	9,599,100	
ヒノキヤグループ	1,300	2,384.00	3,099,200	
ショーボンドホールディングス	8,300	5,230.00	43,409,000	
ミライト・ホールディングス	18,800	1,935.00	36,378,000	
タマホーム	3,500	2,289.00	8,011,500	

ファーストコーポレーション	4,200	732.00	3,074,400	
スペースバリューホールディングス	6,100	1,145.00	6,984,500	
住石ホールディングス	11,900	137.00	1,630,300	
日鉄鉱業	1,300	6,370.00	8,281,000	
三井松島ホールディングス	2,400	1,638.00	3,931,200	
ＩＮＰＥＸ	234,500	1,127.00	264,281,500	
石油資源開発	6,900	2,680.00	18,492,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	2,700	1,584.00	4,276,800	
安藤・間	29,000	934.00	27,086,000	
東急建設	17,100	729.00	12,465,900	
コムシスホールディングス	18,800	2,800.00	52,640,000	
ビーアールホールディングス	8,800	345.00	3,036,000	
高松コンストラクショングループ	3,600	1,999.00	7,196,400	
東建コーポレーション	1,800	9,220.00	16,596,000	
ソネック	2,900	1,030.00	2,987,000	
ヤマウラ	3,100	994.00	3,081,400	
オリエンタル白石	19,600	242.00	4,743,200	
大成建設	39,000	3,805.00	148,395,000	
大林組	135,000	969.00	130,815,000	
清水建設	126,500	780.00	98,670,000	
飛島建設	3,600	1,128.00	4,060,800	
長谷工コーポレーション	40,200	1,512.00	60,782,400	
松井建設	5,300	741.00	3,927,300	
錢高組	800	4,085.00	3,268,000	
鹿島建設	98,900	1,565.00	154,778,500	
不動テトラ	2,900	1,550.00	4,495,000	
鉄建建設	2,900	1,924.00	5,579,600	
西松建設	8,200	3,875.00	31,775,000	
三井住友建設	30,400	448.00	13,619,200	
大豊建設	2,000	3,675.00	7,350,000	
佐田建設	6,400	474.00	3,033,600	
ナカノフドー建設	8,700	343.00	2,984,100	
奥村組	8,000	3,225.00	25,800,000	
東鉄工業	6,300	2,526.00	15,913,800	
淺沼組	1,500	5,320.00	7,980,000	
戸田建設	56,100	769.00	43,140,900	
熊谷組	6,900	2,877.00	19,851,300	
北野建設	1,400	2,149.00	3,008,600	
植木組	2,100	1,504.00	3,158,400	
矢作建設工業	6,000	783.00	4,698,000	
ピーエス三菱	4,900	611.00	2,993,900	
日本ハウスホールディングス	9,200	454.00	4,176,800	
大東建託	13,800	12,760.00	176,088,000	
新日本建設	5,700	743.00	4,235,100	
ＮＩＰＰＯ	11,200	4,000.00	44,800,000	
東亜道路工業	700	5,020.00	3,514,000	
日本道路	1,300	9,890.00	12,857,000	
東亜建設工業	3,300	2,673.00	8,820,900	
日本国土開発	13,100	532.00	6,969,200	
若築建設	2,300	1,898.00	4,365,400	

東洋建設	15,100	592.00	8,939,200	
五洋建設	53,500	621.00	33,223,500	
世紀東急工業	6,500	818.00	5,317,000	
福田組	1,400	4,220.00	5,908,000	
住友林業	34,500	2,270.00	78,315,000	
日本基礎技術	5,400	666.00	3,596,400	
巴コーポレーション	6,300	503.00	3,168,900	
大和ハウス工業	124,700	3,352.00	417,994,400	
ライト工業	8,500	1,942.00	16,507,000	
積水ハウス	146,400	2,373.50	347,480,400	
日特建設	4,600	736.00	3,385,600	
北陸電気工事	3,200	805.00	2,576,000	
ユアテック	7,700	713.00	5,490,100	
日本リーテック	2,800	1,438.00	4,026,400	
四電工	1,700	1,599.00	2,718,300	
中電工	6,200	2,152.00	13,342,400	
関電工	21,900	878.00	19,228,200	
きんでん	30,200	1,635.00	49,377,000	
東京エネシス	4,500	945.00	4,252,500	
トーエネック	1,400	3,330.00	4,662,000	
住友電設	3,300	2,241.00	7,395,300	
日本電設工業	7,400	1,537.00	11,373,800	
エクシオグループ	20,300	2,391.00	48,537,300	
新日本空調	3,600	2,036.00	7,329,600	
日本工営	2,400	2,996.00	7,190,400	
九電工	10,400	3,110.00	32,344,000	
三機工業	8,800	1,502.00	13,217,600	
日揮ホールディングス	41,600	1,093.00	45,468,800	
中外炉工業	1,900	1,581.00	3,003,900	
ヤマト	4,000	708.00	2,832,000	
太平電業	3,000	2,688.00	8,064,000	
高砂熱学工業	12,200	1,985.00	24,217,000	
三晃金属工業	1,200	2,527.00	3,032,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	14,000	1,758.00	24,612,000	
朝日工業社	700	3,045.00	2,131,500	
明星工業	8,700	724.00	6,298,800	
大氣社	6,600	3,065.00	20,229,000	
ダイダン	3,000	2,307.00	6,921,000	
日比谷総合設備	4,300	1,888.00	8,118,400	
ニップン	12,600	1,696.00	21,369,600	
日清製粉グループ本社	48,800	1,654.00	80,715,200	
昭和産業	4,100	2,700.00	11,070,000	
鳥越製粉	4,400	669.00	2,943,600	
中部飼料	4,900	1,042.00	5,105,800	
フィード・ワン	5,800	682.00	3,955,600	
日本甜菜製糖	2,300	1,701.00	3,912,300	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	3,900	1,999.00	7,796,100	
塩水港精糖	14,100	217.00	3,059,700	
日新製糖	2,000	1,795.00	3,590,000	
ＬＩＦＵＬＬ	12,600	239.00	3,011,400	

ミクシィ	9,400	2,240.00	21,056,000	
ジェイエイシーリクルートメント	3,300	1,787.00	5,897,100	
日本M&Aセンターホールディングス	67,500	1,686.00	113,805,000	
メンバーズ	1,200	2,877.00	3,452,400	
ＵＴグループ	5,900	3,415.00	20,148,500	
アイティメディア	1,900	1,571.00	2,984,900	
夢真ビーネックスグループ	10,900	1,550.00	16,895,000	
コシダカホールディングス	11,000	635.00	6,985,000	
アルトナー	3,500	875.00	3,062,500	
パソナグループ	4,500	2,457.00	11,056,500	
ＣＤＳ	1,800	1,609.00	2,896,200	
リンクアンドモチベーション	9,100	433.00	3,940,300	
エス・エム・エス	14,000	3,065.00	42,910,000	
サニーサイドアップグループ	4,000	731.00	2,924,000	
パーソルホールディングス	41,100	2,503.00	102,873,300	
クックパッド	12,900	254.00	3,276,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,900	590.00	2,891,000	
森永製菓	10,100	3,610.00	36,461,000	
中村屋	1,000	3,375.00	3,375,000	
江崎グリコ	11,900	3,875.00	46,112,500	
名糖産業	1,900	1,676.00	3,184,400	
井村屋グループ	2,400	2,256.00	5,414,400	
不二家	2,400	2,517.00	6,040,800	
山崎製パン	32,400	1,542.00	49,960,800	
モロゾフ	1,400	2,731.00	3,823,400	
亀田製菓	2,500	4,115.00	10,287,500	
寿スピリッツ	4,200	6,220.00	26,124,000	
カルビー	19,700	2,564.00	50,510,800	
森永乳業	8,000	5,610.00	44,880,000	
六甲バター	3,200	1,565.00	5,008,000	
ヤクルト本社	32,000	6,160.00	197,120,000	
明治ホールディングス	28,600	6,870.00	196,482,000	
雪印メグミルク	10,400	1,992.00	20,716,800	
プリマハム	5,400	2,428.00	13,111,200	
日本ハム	16,500	4,400.00	72,600,000	
林兼産業	5,900	502.00	2,961,800	
丸大食品	4,300	1,513.00	6,505,900	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	3,900	3,220.00	12,558,000	
柿安本店	1,500	2,567.00	3,850,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	27,800	689.00	19,154,200	
学情	2,800	1,036.00	2,900,800	
スタジオアリス	1,800	2,195.00	3,951,000	
シミックホールディングス	2,300	1,509.00	3,470,700	
システナ	60,300	386.00	23,275,800	
ＮＪＳ	1,500	2,009.00	3,013,500	
デジタルアーツ	2,300	6,000.00	13,800,000	
日鉄ソリューションズ	6,100	3,530.00	21,533,000	
綜合警備保障	16,400	4,235.00	69,454,000	
キューブシステム	900	907.00	816,300	
いちご	47,300	279.00	13,196,700	

日本駐車場開発	46,600	139.00	6,477,400	
コア	1,800	1,522.00	2,739,600	
カカクコム	30,200	2,553.00	77,100,600	
アイロムグループ	1,800	1,910.00	3,438,000	
セントケア・ホールディング	3,900	818.00	3,190,200	
ルネサンス	2,900	1,087.00	3,152,300	
ディップ	7,200	3,460.00	24,912,000	
ＳＢＳホールディングス	3,200	3,030.00	9,696,000	
デジタルホールディングス	2,900	1,552.00	4,500,800	
新日本科学	5,000	1,538.00	7,690,000	
ベネフィット・ワン	15,000	2,455.00	36,825,000	
エムスリー	72,600	4,001.00	290,472,600	
ツカダ・グローバルホールディング	10,100	327.00	3,302,700	
アウトソーシング	23,600	1,310.00	30,916,000	
ウェルネット	6,500	447.00	2,905,500	
ワールドホールディングス	1,600	2,077.00	3,323,200	
ディー・エヌ・エー	15,700	1,734.00	27,223,800	
博報堂ＤＹホールディングス	57,300	1,518.00	86,981,400	
ぐるなび	6,900	416.00	2,870,400	
ファンコミュニケーションズ	10,300	412.00	4,243,600	
ビジネス・ブレークスルー	7,000	432.00	3,024,000	
エスプール	11,600	985.00	11,426,000	
ＷＤＢホールディングス	1,900	2,668.00	5,069,200	
手間いらず	600	4,970.00	2,982,000	
アドウェイズ	6,100	642.00	3,916,200	
バリューコマース	3,200	3,325.00	10,640,000	
インフォマート	45,100	618.00	27,871,800	
サッポロホールディングス	14,700	2,408.00	35,397,600	
アサヒグループホールディングス	101,600	5,115.00	519,684,000	
キリンホールディングス	158,800	2,012.00	319,505,600	
宝ホールディングス	29,400	1,176.00	34,574,400	
オエノンホールディングス	12,300	346.00	4,255,800	
養命酒製造	1,700	1,775.00	3,017,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	30,300	1,517.00	45,965,100	
サントリー食品インターナショナル	28,900	4,685.00	135,396,500	
ダイドーグループホールディングス	2,200	5,200.00	11,440,000	
伊藤園	13,100	6,710.00	87,901,000	
キーコーヒー	4,200	2,071.00	8,698,200	
日清オイリオグループ	5,400	2,995.00	16,173,000	
不二製油グループ本社	9,400	2,236.00	21,018,400	
Ｊ－オイルミルズ	4,000	1,742.00	6,968,000	
ローソン	9,400	4,855.00	45,637,000	
サンエー	3,200	4,100.00	13,120,000	
カワチ薬品	3,300	2,406.00	7,939,800	
エービーシー・マート	6,600	5,220.00	34,452,000	
ハードオフコーポレーション	4,100	800.00	3,280,000	
アスクル	6,900	1,692.00	11,674,800	
ゲオホールディングス	5,700	1,512.00	8,618,400	
アダストリア	4,600	1,739.00	7,999,400	

オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,528.00	3,056,000	
伊藤忠食品	1,000	5,030.00	5,030,000	
くら寿司	4,400	3,795.00	16,698,000	
キャンドゥ	2,000	2,066.00	4,132,000	
エレマテック	3,400	1,067.00	3,627,800	
アイケイ	7,300	408.00	2,978,400	
パルグループホールディングス	3,700	1,598.00	5,912,600	
ＪＡＬＵＸ	1,200	2,558.00	3,069,600	
エディオン	19,500	1,194.00	23,283,000	
あらた	3,400	3,900.00	13,260,000	
サーラコーポレーション	8,600	643.00	5,529,800	
トーメンデバイス	600	6,180.00	3,708,000	
ハローズ	1,900	2,763.00	5,249,700	
ＪＰホールディングス	12,200	226.00	2,757,200	
フジオフードグループ本社	3,600	1,317.00	4,741,200	
あみやき亭	1,000	3,020.00	3,020,000	
東京エレクトロン　デバイス	1,300	5,360.00	6,968,000	
双日	46,800	1,958.00	91,634,400	
アルフレッサ　ホールディングス	47,100	1,752.00	82,519,200	
大黒天物産	1,400	4,690.00	6,566,000	
ハニーズホールディングス	3,400	1,025.00	3,485,000	
キッコーマン	31,100	8,990.00	279,589,000	
味の素	95,400	3,324.00	317,109,600	
ブルドックソース	1,800	2,005.00	3,609,000	
キユーピー	22,700	2,441.00	55,410,700	
ハウス食品グループ本社	16,200	3,015.00	48,843,000	
カゴメ	16,400	3,035.00	49,774,000	
アリアケジャパン	3,900	5,740.00	22,386,000	
ピエトロ	1,700	1,805.00	3,068,500	
ニチレイ	19,700	2,579.00	50,806,300	
横浜冷凍	11,900	867.00	10,317,300	
東洋水産	20,700	4,925.00	101,947,500	
イートアンドホールディングス	1,600	2,299.00	3,678,400	
大冷	1,400	1,888.00	2,643,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	511.00	2,503,900	
日清食品ホールディングス	17,000	9,200.00	156,400,000	
永谷園ホールディングス	1,900	2,015.00	3,828,500	
一正蒲鉾	3,800	797.00	3,028,600	
フジッコ	4,000	1,956.00	7,824,000	
ロック・フィールド	4,700	1,590.00	7,473,000	
日本たばこ産業	231,700	2,323.00	538,239,100	
ケンコーマヨネーズ	2,400	1,406.00	3,374,400	
わらべや日洋ホールディングス	2,800	1,833.00	5,132,400	
なとり	2,400	2,070.00	4,968,000	
ピックルスコーポレーション	2,100	1,512.00	3,175,200	
ファーマフーズ	4,100	1,565.00	6,416,500	
北の達人コーポレーション	15,100	221.00	3,337,100	
ユーグレナ	22,000	754.00	16,588,000	
紀文食品	3,100	1,192.00	3,695,200	
スター・マイカ・ホールディングス	2,300	1,239.00	2,849,700	

ＳＲＥホールディングス	1,000	3,590.00	3,590,000	
ＡＤワークスグループ	19,200	141.00	2,707,200	
片倉工業	4,700	2,289.00	10,758,300	
グンゼ	2,800	3,840.00	10,752,000	
ヒューリック	101,400	1,067.00	108,193,800	
ラサ商事	3,000	1,014.00	3,042,000	
アルペン	3,200	2,141.00	6,851,200	
ハブ	4,500	608.00	2,736,000	
ラクーンホールディングス	3,000	1,117.00	3,351,000	
クオールホールディングス	5,200	1,292.00	6,718,400	
アルコニックス	5,300	1,344.00	7,123,200	
神戸物産	32,900	3,770.00	124,033,000	
ジンズホールディングス	2,900	6,530.00	18,937,000	
ビックカメラ	25,100	1,011.00	25,376,100	
ＤＣＭホールディングス	26,200	1,107.00	29,003,400	
ハイパー	5,500	476.00	2,618,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	53,600	2,190.00	117,384,000	
東京一番フーズ	5,100	599.00	3,054,900	
あい　ホールディングス	6,100	1,782.00	10,870,200	
ディーブイエックス	2,800	1,048.00	2,934,400	
アークランドサービスホールディングス	3,100	2,254.00	6,987,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	50,600	1,030.00	52,118,000	
ドトール・日レスホールディングス	7,300	1,606.00	11,723,800	
マツキヨココカラ＆カンパニー	26,100	4,525.00	118,102,500	
ブロンコビリー	2,400	2,241.00	5,378,400	
ＺＯＺＯ	29,200	3,280.00	95,776,000	
トレジャー・ファクトリー	3,100	949.00	2,941,900	
物語コーポレーション	2,300	6,640.00	15,272,000	
三越伊勢丹ホールディングス	74,200	967.00	71,751,400	
東洋紡	16,700	1,251.00	20,891,700	
ユニチカ	11,600	309.00	3,584,400	
富士紡ホールディングス	1,900	3,620.00	6,878,000	
日清紡ホールディングス	26,300	1,041.00	27,378,300	
倉敷紡績	3,600	1,911.00	6,879,600	
ダイワボウホールディングス	20,600	1,770.00	36,462,000	
日東紡績	6,400	3,105.00	19,872,000	
トヨタ紡織	17,600	2,160.00	38,016,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	10,100	2,633.00	26,593,300	
Ｈａｍｅｅ	300	1,136.00	340,800	
ラクト・ジャパン	1,500	2,039.00	3,058,500	
ウエルシアホールディングス	22,400	3,090.00	69,216,000	
クリエイトＳＤホールディングス	6,300	3,130.00	19,719,000	
グリムス	1,900	2,126.00	4,039,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,400	808.00	5,979,200	
八洲電機	3,100	956.00	2,963,600	
メディアスホールディングス	3,100	911.00	2,824,100	
レスターホールディングス	4,000	1,977.00	7,908,000	
ジューテックホールディングス	2,700	1,230.00	3,321,000	

丸善ＣＨＩホールディングス	8,400	372.00	3,124,800	
ＯＣＨＩホールディングス	2,300	1,357.00	3,121,100	
ＴＯＫＡＩホールディングス	20,500	907.00	18,593,500	
ミサワ	4,200	647.00	2,717,400	
ティーライフ	2,200	1,346.00	2,961,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	4,000	745.00	2,980,000	
三洋貿易	4,300	1,016.00	4,368,800	
シュッピン	3,500	1,136.00	3,976,000	
オイシックス・ラ・大地	6,100	2,616.00	15,957,600	
ウイン・パートナーズ	3,100	1,044.00	3,236,400	
ネクステージ	8,600	2,578.00	22,170,800	
ジョイフル本田	12,400	1,556.00	19,294,400	
ホットランド	3,200	1,315.00	4,208,000	
すかいらーくホールディングス	54,700	1,495.00	81,776,500	
ＳＦＰホールディングス	2,100	1,415.00	2,971,500	
綿半ホールディングス	3,200	1,321.00	4,227,200	
日本毛織	12,700	893.00	11,341,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	12,300	1,057.00	13,001,100	
三栄建築設計	1,700	1,615.00	2,745,500	
野村不動産ホールディングス	22,000	2,842.00	62,524,000	
三重交通グループホールディングス	8,600	470.00	4,042,000	
サムティ	6,800	2,134.00	14,511,200	
ディア・ライフ	5,500	517.00	2,843,500	
コーセーアールイー	4,100	577.00	2,365,700	
地主	2,700	1,783.00	4,814,100	
プレサンスコーポレーション	5,500	1,868.00	10,274,000	
日本管理センター	2,900	1,022.00	2,963,800	
サンセイランディック	200	805.00	161,000	
エストラスト	4,500	576.00	2,592,000	
フージャースホールディングス	5,400	691.00	3,731,400	
オープンハウスグループ	13,500	5,000.00	67,500,000	
東急不動産ホールディングス	125,100	664.00	83,066,400	
飯田グループホールディングス	35,400	2,194.00	77,667,600	
イーグランド	1,900	1,371.00	2,604,900	
ムゲンエステート	6,100	480.00	2,928,000	
帝国繊維	4,800	1,908.00	9,158,400	
日本コークス工業	36,400	135.00	4,914,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,600	1,068.00	2,776,800	
ＢＥＥＮＯＳ	2,100	1,462.00	3,070,200	
あさひ	3,500	1,306.00	4,571,000	
日本調剤	2,600	1,381.00	3,590,600	
コスモス薬品	4,300	15,760.00	67,768,000	
シップヘルスケアホールディングス	13,600	2,301.00	31,293,600	
ソフトクリエイトホールディングス	1,800	4,075.00	7,335,000	
セブン&アイ・ホールディングス	165,900	5,726.00	949,943,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	22,600	735.00	16,611,000	
明治電機工業	2,400	1,044.00	2,505,600	
ツルハホールディングス	9,200	9,200.00	84,640,000	

サンマルクホールディングス	3,300	1,631.00	5,382,300	
フェリシモ	2,200	1,184.00	2,604,800	
トリドールホールディングス	10,500	2,575.00	27,037,500	
帝人	39,700	1,418.00	56,294,600	
東レ	305,300	660.00	201,498,000	
クラレ	61,700	1,084.00	66,882,800	
旭化成	279,400	1,090.00	304,546,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	4,900	442.00	2,165,800	
稲葉製作所	2,400	1,303.00	3,127,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,300	3,580.00	4,654,000	
トーカロ	11,000	1,326.00	14,586,000	
アルファ	2,700	1,092.00	2,948,400	
ＳＵＭＣＯ	65,600	1,958.00	128,444,800	
川田テクノロジーズ	900	3,825.00	3,442,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,400	5,250.00	7,350,000	
ファーストブラザーズ	3,300	817.00	2,696,100	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	3,200	910.00	2,912,000	
ケイアイスター不動産	1,900	5,000.00	9,500,000	
グッドコムアセット	2,700	1,136.00	3,067,200	
ジェイ・エス・ビー	700	3,210.00	2,247,000	
日本フエルト	6,800	450.00	3,060,000	
芦森工業	3,300	905.00	2,986,500	
アツギ	5,500	609.00	3,349,500	
ウイルプラスホールディングス	3,000	904.00	2,712,000	
ＪＭホールディングス	2,900	1,782.00	5,167,800	
コメダホールディングス	9,300	2,129.00	19,799,700	
アレンザホールディングス	3,200	1,057.00	3,382,400	
バロックジャパンリミテッド	3,500	850.00	2,975,000	
クスリのアオキホールディングス	4,200	6,960.00	29,232,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	24,800	3,755.00	93,124,000	
アセンテック	3,100	699.00	2,166,900	
セーレン	8,600	2,223.00	19,117,800	
ソトー	3,700	837.00	3,096,900	
東海染工	2,600	1,165.00	3,029,000	
小松マテーレ	6,900	1,292.00	8,914,800	
ワコールホールディングス	10,500	2,013.00	21,136,500	
ホギメディカル	5,700	3,300.00	18,810,000	
クラウディアホールディングス	12,700	238.00	3,022,600	
ＴＳＩホールディングス	14,100	320.00	4,512,000	
マツオカコーポレーション	2,400	1,163.00	2,791,200	
ワールド	5,500	1,234.00	6,787,000	
ＴＩＳ	40,300	2,584.00	104,135,200	
グリー	25,900	808.00	20,927,200	
コーエーテクモホールディングス	13,500	3,985.00	53,797,500	
三菱総合研究所	1,800	3,710.00	6,678,000	
ＡＧＳ	3,400	792.00	2,692,800	
ファインデックス	3,600	694.00	2,498,400	
ブレインパッド	3,300	1,060.00	3,498,000	
ＫＬａｂ	7,700	398.00	3,064,600	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,100	1,029.00	6,276,900	
ネクソン	95,300	2,508.00	239,012,400	
アイスタイル	12,900	189.00	2,438,100	
エムアップホールディングス	4,900	883.00	4,326,700	
エイチーム	3,400	709.00	2,410,600	
エニグモ	4,600	674.00	3,100,400	
テクノスジャパン	5,600	440.00	2,464,000	
コロプラ	13,900	630.00	8,757,000	
ブロードリーフ	20,900	328.00	6,855,200	
デジタルハーツホールディングス	1,900	1,471.00	2,794,900	
システム情報	3,500	1,008.00	3,528,000	
メディアドゥ	1,500	2,427.00	3,640,500	
じげん	11,900	298.00	3,546,200	
ブイキューブ	4,300	758.00	3,259,400	
サイバーリンクス	2,900	900.00	2,610,000	
フィックスターズ	4,500	678.00	3,051,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,700	2,353.00	4,000,100	
オプティム	2,900	875.00	2,537,500	
セレス	1,500	1,321.00	1,981,500	
ＳＨＩＦＴ	2,100	19,920.00	41,832,000	
特種東海製紙	2,600	4,105.00	10,673,000	
ティーガイア	3,700	1,724.00	6,378,800	
テクマトリックス	7,100	1,557.00	11,054,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11,500	2,838.00	32,637,000	
GMOペイメントゲートウェイ	8,200	10,190.00	83,558,000	
ザッパラス	5,300	492.00	2,607,600	
インターネットイニシアティブ	11,300	3,405.00	38,476,500	
さくらインターネット	5,500	513.00	2,821,500	
ヴィンクス	3,500	971.00	3,398,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	900	4,170.00	3,753,000	
ＳＲＡホールディングス	2,000	2,863.00	5,726,000	
朝日ネット	5,100	597.00	3,044,700	
ｅＢＡＳＥ	5,000	618.00	3,090,000	
アバント	4,500	1,044.00	4,698,000	
アドソル日進	1,700	1,601.00	2,721,700	
フリービット	2,900	894.00	2,592,600	
コムチュア	4,700	2,762.00	12,981,400	
サイバーコム	2,600	938.00	2,438,800	
アステリア	3,000	706.00	2,118,000	
アイル	2,300	1,295.00	2,978,500	
王子ホールディングス	176,200	606.00	106,777,200	
日本製紙	20,200	1,148.00	23,189,600	
三菱製紙	6,000	315.00	1,890,000	
北越コーポレーション	27,600	752.00	20,755,200	
大王製紙	20,300	1,777.00	36,073,100	
阿波製紙	9,100	330.00	3,003,000	
マークラインズ	2,100	2,625.00	5,512,500	

メディカル・データ・ビジョン	5,300	1,015.00	5,379,500	
ｇｕｍｉ	5,900	543.00	3,203,700	
テラスカイ	1,700	1,428.00	2,427,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,300	1,258.00	2,893,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,000	2,882.00	2,882,000	
ラクス	14,500	1,674.00	24,273,000	
ランドコンピュータ	3,500	855.00	2,992,500	
ダブルスタンダード	1,300	1,816.00	2,360,800	
オープンドア	2,500	1,944.00	4,860,000	
アカツキ	1,900	2,783.00	5,287,700	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,100	2,042.00	2,246,200	
カナミックネットワーク	6,400	444.00	2,841,600	
ノムラシステムコーポレーション	10,900	221.00	2,408,900	
レンゴー	39,800	861.00	34,267,800	
トーモク	2,600	1,729.00	4,495,400	
ザ・パック	3,200	2,700.00	8,640,000	
チェンジ	7,800	1,611.00	12,565,800	
シンクロ・フード	8,700	261.00	2,270,700	
オークネット	2,200	1,536.00	3,379,200	
キャピタル・アセット・プランニング	4,000	796.00	3,184,000	
マクロミル	8,600	1,178.00	10,130,800	
ビーグリー	1,800	1,238.00	2,228,400	
オロ	1,300	2,412.00	3,135,600	
ユーザーローカル	1,700	1,472.00	2,502,400	
マネーフォワード	6,400	4,485.00	28,704,000	
昭和電工	36,600	2,239.00	81,947,400	
住友化学	309,800	549.00	170,080,200	
住友精化	1,900	3,300.00	6,270,000	
日産化学	22,900	6,490.00	148,621,000	
ラサ工業	1,800	1,593.00	2,867,400	
クレハ	3,300	8,920.00	29,436,000	
多木化学	1,600	4,705.00	7,528,000	
テイカ	3,100	1,318.00	4,085,800	
石原産業	7,000	1,034.00	7,238,000	
片倉コープアグリ	2,600	1,177.00	3,060,200	
日本曹達	5,400	3,355.00	18,117,000	
東ソー	60,800	1,830.00	111,264,000	
トクヤマ	13,500	1,832.00	24,732,000	
セントラル硝子	6,900	2,062.00	14,227,800	
東亞合成	24,000	1,074.00	25,776,000	
大阪ソーダ	3,900	3,120.00	12,168,000	
関東電化工業	9,200	1,181.00	10,865,200	
デンカ	15,400	3,525.00	54,285,000	
イビデン	22,600	5,440.00	122,944,000	
信越化学工業	72,400	17,510.00	1,267,724,000	
日本カーバイド工業	2,200	1,444.00	3,176,800	
電算システムホールディングス	1,700	2,755.00	4,683,500	
堺化学工業	3,000	1,996.00	5,988,000	
第一稀元素化学工業	3,900	988.00	3,853,200	

エア・ウォーター	39,900	1,677.00	66,912,300	
日本酸素ホールディングス	40,500	2,272.00	92,016,000	
日本化学工業	1,300	2,460.00	3,198,000	
日本パーカライジング	21,300	997.00	21,236,100	
高圧ガス工業	6,700	689.00	4,616,300	
四国化成工業	5,500	1,437.00	7,903,500	
戸田工業	900	2,546.00	2,291,400	
ステラ　ケミファ	2,100	2,389.00	5,016,900	
保土谷化学工業	1,300	4,260.00	5,538,000	
日本触媒	7,100	5,680.00	40,328,000	
大日精化工業	3,500	2,201.00	7,703,500	
カネカ	10,900	3,755.00	40,929,500	
協和キリン	50,500	3,050.00	154,025,000	
三菱瓦斯化学	39,200	1,982.00	77,694,400	
三井化学	38,300	2,978.00	114,057,400	
ＪＳＲ	39,300	3,410.00	134,013,000	
東京応化工業	7,200	7,210.00	51,912,000	
大阪有機化学工業	3,600	2,985.00	10,746,000	
三菱ケミカルホールディングス	281,800	826.80	232,992,240	
ＫＨネオケム	7,000	2,792.00	19,544,000	
ダイセル	60,700	869.00	52,748,300	
住友ベークライト	6,600	4,880.00	32,208,000	
積水化学工業	88,200	1,950.00	171,990,000	
日本ゼオン	38,000	1,331.00	50,578,000	
アイカ工業	11,700	3,190.00	37,323,000	
宇部興産	19,900	2,177.00	43,322,300	
積水樹脂	6,400	1,922.00	12,300,800	
タキロンシーアイ	9,100	558.00	5,077,800	
旭有機材	2,400	2,044.00	4,905,600	
ニチバン	2,500	1,789.00	4,472,500	
リケンテクノス	10,300	464.00	4,779,200	
大倉工業	2,200	1,866.00	4,105,200	
積水化成品工業	6,200	452.00	2,802,400	
群栄化学工業	1,000	3,505.00	3,505,000	
ダイキョーニシカワ	8,900	574.00	5,108,600	
森六ホールディングス	2,300	1,856.00	4,268,800	
恵和	1,100	4,435.00	4,878,500	
日本化薬	33,200	1,127.00	37,416,400	
カーリットホールディングス	2,900	690.00	2,001,000	
ＣＬホールディングス	2,100	1,032.00	2,167,200	
プレステージ・インターナショナル	15,400	700.00	10,780,000	
プロトコーポレーション	4,500	1,229.00	5,530,500	
ハイマックス	2,700	1,219.00	3,291,300	
アミューズ	2,200	2,098.00	4,615,600	
野村総合研究所	81,600	3,785.00	308,856,000	
ドリームインキュベータ	1,900	2,532.00	4,810,800	
サイバネットシステム	4,200	627.00	2,633,400	
クイック	2,800	1,578.00	4,418,400	
ＴＡＣ	13,400	226.00	3,028,400	
ＣＥホールディングス	6,400	463.00	2,963,200	

電通グループ	42,400	4,805.00	203,732,000	
インテージホールディングス	5,300	1,759.00	9,322,700	
東邦システムサイエンス	2,900	924.00	2,679,600	
ぴあ	1,400	3,250.00	4,550,000	
イオンファンタジー	1,600	2,083.00	3,332,800	
ソースネクスト	18,200	155.00	2,821,000	
シーティーエス	4,600	808.00	3,716,800	
ネクシィーズグループ	4,300	572.00	2,459,600	
インフォコム	4,600	2,011.00	9,250,600	
メディカルシステムネットワーク	5,100	513.00	2,616,300	
日本精化	3,400	2,004.00	6,813,600	
扶桑化学工業	3,800	4,480.00	17,024,000	
トリケミカル研究所	4,300	2,776.00	11,936,800	
シンプレクス・ホールディングス	4,500	1,559.00	7,015,500	
ＨＥＲＯＺ	2,300	888.00	2,042,400	
ラクスル	4,600	3,060.00	14,076,000	
ＦＩＧ	8,500	281.00	2,388,500	
ＡＤＥＫＡ	19,400	2,599.00	50,420,600	
日油	14,400	5,030.00	72,432,000	
ミヨシ油脂	2,300	1,135.00	2,610,500	
新日本理化	11,600	238.00	2,760,800	
ハリマ化成グループ	3,600	818.00	2,944,800	
イーソル	4,900	482.00	2,361,800	
アルテリア・ネットワークス	5,300	1,312.00	6,953,600	
ウイングアーク１ｓｔ	2,400	1,212.00	2,908,800	
サーバーワークス	900	2,302.00	2,071,800	
トビラシステムズ	3,900	780.00	3,042,000	
Ｓａｎｓａｎ	15,000	982.00	14,730,000	
ギフティ	3,800	834.00	3,169,200	
花王	95,200	5,327.00	507,130,400	
第一工業製薬	1,600	2,706.00	4,329,600	
石原ケミカル	2,100	1,337.00	2,807,700	
日華化学	3,500	760.00	2,660,000	
三洋化成工業	2,500	5,080.00	12,700,000	
ベース	700	4,980.00	3,486,000	
ＪＭＤＣ	4,000	5,480.00	21,920,000	
武田薬品工業	338,300	3,494.00	1,182,020,200	
アステラス製薬	373,200	1,990.50	742,854,600	
大日本住友製薬	26,600	1,247.00	33,170,200	
塩野義製薬	54,100	7,585.00	410,348,500	
わかもと製薬	5,300	290.00	1,537,000	
日本新薬	11,300	7,570.00	85,541,000	
中外製薬	134,600	3,909.00	526,151,400	
科研製薬	6,800	4,140.00	28,152,000	
エーザイ	51,500	5,773.00	297,309,500	
理研ビタミン	4,500	1,780.00	8,010,000	
ロート製薬	22,100	3,755.00	82,985,500	
小野薬品工業	98,900	2,853.00	282,161,700	
久光製薬	11,400	3,645.00	41,553,000	
有機合成薬品工業	11,200	269.00	3,012,800	

持田製薬	5,400	3,885.00	20,979,000	
参天製薬	80,300	1,284.00	103,105,200	
扶桑薬品工業	1,500	2,315.00	3,472,500	
ツムラ	13,300	3,195.00	42,493,500	
日医工	13,400	836.00	11,202,400	
テルモ	121,800	3,636.00	442,864,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	10,700	3,040.00	32,528,000	
キッセイ薬品工業	7,600	2,407.00	18,293,200	
生化学工業	7,600	897.00	6,817,200	
栄研化学	7,600	1,739.00	13,216,400	
日水製薬	2,900	989.00	2,868,100	
鳥居薬品	2,300	2,959.00	6,805,700	
ＪＣＲファーマ	12,100	2,144.00	25,942,400	
東和薬品	6,200	3,005.00	18,631,000	
富士製薬工業	2,900	1,010.00	2,929,000	
ゼリア新薬工業	7,800	1,958.00	15,272,400	
第一三共	338,300	2,549.50	862,495,850	
キョーリン製薬ホールディングス	8,600	1,830.00	15,738,000	
大幸薬品	6,500	601.00	3,906,500	
ダイト	2,800	2,941.00	8,234,800	
大塚ホールディングス	89,500	4,030.00	360,685,000	
大正製薬ホールディングス	10,200	5,720.00	58,344,000	
ペプチドリーム	22,600	2,043.00	46,171,800	
大日本塗料	5,200	818.00	4,253,600	
日本ペイントホールディングス	158,400	1,060.00	167,904,000	
関西ペイント	43,700	2,399.00	104,836,300	
中国塗料	9,900	907.00	8,979,300	
日本特殊塗料	3,400	879.00	2,988,600	
藤倉化成	6,000	461.00	2,766,000	
太陽ホールディングス	6,200	3,020.00	18,724,000	
ＤＩＣ	17,800	2,657.00	47,294,600	
サカタインクス	8,400	935.00	7,854,000	
東洋インキＳＣホールディングス	8,900	1,890.00	16,821,000	
アルプス技研	3,600	1,955.00	7,038,000	
日本空調サービス	4,300	788.00	3,388,400	
オリエンタルランド	48,600	21,155.00	1,028,133,000	
フォーカスシステムズ	3,000	899.00	2,697,000	
ダスキン	9,500	2,774.00	26,353,000	
パーク２４	22,800	1,768.00	40,310,400	
明光ネットワークジャパン	5,300	569.00	3,015,700	
ファルコホールディングス	2,000	2,006.00	4,012,000	
クレスコ	3,100	1,774.00	5,499,400	
フジ・メディア・ホールディングス	40,700	1,255.00	51,078,500	
秀英予備校	7,200	428.00	3,081,600	
ラウンドワン	11,500	1,311.00	15,076,500	
リゾートトラスト	18,900	1,971.00	37,251,900	
オービック	13,300	17,660.00	234,878,000	
ジャストシステム	6,000	5,330.00	31,980,000	
ＴＤＣソフト	3,700	1,105.00	4,088,500	
Ｚホールディングス	614,000	557.80	342,489,200	

ビー・エム・エル	5,300	3,265.00	17,304,500	
トレンドマイクロ	22,600	5,890.00	133,114,000	
りらいあコミュニケーションズ	6,100	1,047.00	6,386,700	
ＩＤホールディングス	3,300	849.00	2,801,700	
リソー教育	18,800	390.00	7,332,000	
日本オラクル	8,600	8,130.00	69,918,000	
早稲田アカデミー	2,800	1,001.00	2,802,800	
アルファシステムズ	1,100	3,715.00	4,086,500	
フューチャー	8,900	1,328.00	11,819,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,500	1,297.00	3,242,500	
ＳＢテクノロジー	1,800	2,517.00	4,530,600	
トーセ	4,200	719.00	3,019,800	
ユー・エス・エス	46,100	1,959.00	90,309,900	
オービックビジネスコンサルタント	4,000	4,155.00	16,620,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	19,200	2,907.00	55,814,400	
アイティフォー	5,100	779.00	3,972,900	
東京個別指導学院	4,700	624.00	2,932,800	
東計電算	600	4,975.00	2,985,000	
サイバーエージェント	101,400	1,491.00	151,187,400	
楽天グループ	211,300	966.00	204,115,800	
クリーク・アンド・リバー社	2,200	1,672.00	3,678,400	
モーニングスター	7,200	578.00	4,161,600	
テー・オー・ダブリュー	9,400	297.00	2,791,800	
大塚商会	22,900	4,240.00	97,096,000	
サイボウズ	5,600	1,287.00	7,207,200	
山田コンサルティンググループ	2,600	1,154.00	3,000,400	
セントラルスポーツ	1,500	2,409.00	3,613,500	
電通国際情報サービス	6,100	3,715.00	22,661,500	
ＡＣＣＥＳＳ	4,800	581.00	2,788,800	
デジタルガレージ	7,000	3,905.00	27,335,000	
イーエムシステムズ	7,000	706.00	4,942,000	
ウェザーニューズ	1,300	7,600.00	9,880,000	
ＣＩＪ	3,400	808.00	2,747,200	
ビジネスエンジニアリング	800	3,590.00	2,872,000	
日本エンタープライズ	16,100	172.00	2,769,200	
WOWOW	2,000	1,748.00	3,496,000	
スカラ	4,400	670.00	2,948,000	
フルキャストホールディングス	3,500	2,273.00	7,955,500	
エン・ジャパン	6,600	2,914.00	19,232,400	
あすか製薬ホールディングス	4,900	1,068.00	5,233,200	
サワイグループホールディングス	9,400	4,425.00	41,595,000	
富士フイルムホールディングス	75,700	7,531.00	570,096,700	
コニカミノルタ	94,100	501.00	47,144,100	
資生堂	80,200	6,746.00	541,029,200	
ライオン	52,000	1,516.00	78,832,000	
高砂香料工業	3,000	2,711.00	8,133,000	
マンダム	9,000	1,392.00	12,528,000	
ミルボン	5,300	6,020.00	31,906,000	
ファンケル	17,400	3,255.00	56,637,000	
コーセー	8,100	13,360.00	108,216,000	

コタ	2,700	1,597.00	4,311,900	
シーボン	1,800	1,828.00	3,290,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	18,400	1,862.00	34,260,800	
ノエビアホールディングス	3,700	5,180.00	19,166,000	
アジュバンホールディングス	2,600	1,145.00	2,977,000	
エステー	2,800	1,561.00	4,370,800	
アグロ　カネショウ	2,300	1,186.00	2,727,800	
コニシ	7,100	1,557.00	11,054,700	
長谷川香料	7,400	2,345.00	17,353,000	
星光ＰＭＣ	4,200	602.00	2,528,400	
小林製薬	12,100	9,830.00	118,943,000	
荒川化学工業	3,600	1,127.00	4,057,200	
メック	3,200	2,859.00	9,148,800	
日本高純度化学	1,200	2,531.00	3,037,200	
タカラバイオ	11,300	2,425.00	27,402,500	
ＪＣＵ	4,800	4,595.00	22,056,000	
新田ゼラチン	5,000	652.00	3,260,000	
デクセリアルズ	11,200	2,960.00	33,152,000	
アース製薬	3,500	5,670.00	19,845,000	
北興化学工業	4,000	837.00	3,348,000	
大成ラミック	1,300	2,766.00	3,595,800	
クミアイ化学工業	16,000	793.00	12,688,000	
日本農薬	7,700	533.00	4,104,100	
ニチレキ	5,500	1,309.00	7,199,500	
ユシロ化学工業	2,700	1,048.00	2,829,600	
富士石油	11,800	268.00	3,162,400	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,600	1,142.00	2,969,200	
出光興産	47,800	3,015.00	144,117,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	647,600	454.30	294,204,680	
コスモエネルギーホールディングス	12,500	2,519.00	31,487,500	
テスホールディングス	2,500	1,253.00	3,132,500	
インフロニア・ホールディングス	57,600	1,060.00	61,056,000	
横浜ゴム	24,900	1,765.00	43,948,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	22,700	1,602.00	36,365,400	
ブリヂストン	124,000	5,134.00	636,616,000	
住友ゴム工業	38,700	1,174.00	45,433,800	
藤倉コンポジット	3,400	685.00	2,329,000	
オカモト	2,600	4,005.00	10,413,000	
アキレス	2,800	1,269.00	3,553,200	
フコク	1,600	974.00	1,558,400	
ニッタ	4,500	2,734.00	12,303,000	
住友理工	8,300	599.00	4,971,700	
三ツ星ベルト	5,200	2,111.00	10,977,200	
バンドー化学	6,900	852.00	5,878,800	
ＡＧＣ	39,500	5,600.00	221,200,000	
日本板硝子	20,700	509.00	10,536,300	
有沢製作所	6,300	993.00	6,255,900	
日本山村硝子	3,800	805.00	3,059,000	
日本電気硝子	17,300	2,824.00	48,855,200	
住友大阪セメント	8,000	3,545.00	28,360,000	

太平洋セメント	24,500	2,321.00	56,864,500	
日本ヒューム	4,300	700.00	3,010,000	
日本コンクリート工業	10,900	299.00	3,259,100	
三谷セキサン	2,000	6,260.00	12,520,000	
アジアパイルホールディングス	6,800	431.00	2,930,800	
東海カーボン	36,100	1,137.00	41,045,700	
日本カーボン	2,200	4,160.00	9,152,000	
東洋炭素	2,800	3,145.00	8,806,000	
ノリタケカンパニーリミテド	2,400	4,455.00	10,692,000	
ＴＯＴＯ	30,700	5,070.00	155,649,000	
日本碍子	46,600	1,857.00	86,536,200	
日本特殊陶業	32,700	2,122.00	69,389,400	
ＭＡＲＵＷＡ	1,500	14,290.00	21,435,000	
品川リフラクトリーズ	1,000	3,915.00	3,915,000	
黒崎播磨	700	4,375.00	3,062,500	
ヨータイ	2,700	1,262.00	3,407,400	
イソライト工業	2,400	1,266.00	3,038,400	
ニッカトー	4,300	572.00	2,459,600	
フジミインコーポレーテッド	3,500	6,490.00	22,715,000	
クニミネ工業	2,900	1,015.00	2,943,500	
ニチアス	10,000	2,623.00	26,230,000	
日本製鉄	190,500	2,074.00	395,097,000	
神戸製鋼所	79,500	614.00	48,813,000	
中山製鋼所	7,000	467.00	3,269,000	
合同製鐵	2,300	1,379.00	3,171,700	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	115,000	1,707.00	196,305,000	
東京製鐵	14,500	1,144.00	16,588,000	
共英製鋼	4,800	1,613.00	7,742,400	
大和工業	8,100	3,670.00	29,727,000	
東京鐵鋼	2,300	1,370.00	3,151,000	
淀川製鋼所	5,600	2,730.00	15,288,000	
丸一鋼管	15,100	2,969.00	44,831,900	
モリ工業	1,300	2,539.00	3,300,700	
大同特殊鋼	7,000	4,185.00	29,295,000	
日本高周波鋼業	9,200	344.00	3,164,800	
日本冶金工業	3,100	2,913.00	9,030,300	
山陽特殊製鋼	4,400	2,077.00	9,138,800	
愛知製鋼	2,400	2,630.00	6,312,000	
日立金属	45,900	2,074.00	95,196,600	
大平洋金属	2,600	3,355.00	8,723,000	
新日本電工	27,400	344.00	9,425,600	
栗本鐵工所	1,900	1,539.00	2,924,100	
日本製鋼所	12,900	3,675.00	47,407,500	
三菱製鋼	2,400	1,333.00	3,199,200	
日亜鋼業	11,100	279.00	3,096,900	
日本精線	700	4,415.00	3,090,500	
エンビプロ・ホールディングス	1,800	1,279.00	2,302,200	
大紀アルミニウム工業所	6,400	1,673.00	10,707,200	
日本軽金属ホールディングス	10,800	1,824.00	19,699,200	

三井金属鉱業	11,500	3,325.00	38,237,500	
東邦亜鉛	2,400	2,694.00	6,465,600	
三菱マテリアル	28,100	2,089.00	58,700,900	
住友金属鉱山	54,400	5,439.00	295,881,600	
ＤＯＷＡホールディングス	11,600	4,900.00	56,840,000	
古河機械金属	7,000	1,300.00	9,100,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,900	860.00	4,214,000	
東邦チタニウム	7,600	910.00	6,916,000	
ＵＡＣＪ	6,500	2,363.00	15,359,500	
ＣＫサンエツ	900	4,025.00	3,622,500	
古河電気工業	13,200	2,402.00	31,706,400	
住友電気工業	159,200	1,580.00	251,536,000	
フジクラ	47,500	655.00	31,112,500	
昭和電線ホールディングス	3,700	1,857.00	6,870,900	
東京特殊電線	1,000	2,851.00	2,851,000	
タツタ電線	7,500	451.00	3,382,500	
平河ヒューテック	2,500	1,172.00	2,930,000	
リョービ	5,200	1,111.00	5,777,200	
アーレスティ	5,500	379.00	2,084,500	
アサヒホールディングス	17,000	2,153.00	36,601,000	
東洋製罐グループホールディングス	27,100	1,588.00	43,034,800	
ホッカンホールディングス	2,300	1,398.00	3,215,400	
コロナ	3,300	901.00	2,973,300	
横河ブリッジホールディングス	7,400	2,062.00	15,258,800	
三和ホールディングス	40,100	1,281.00	51,368,100	
文化シヤッター	13,500	1,057.00	14,269,500	
三協立山	5,500	639.00	3,514,500	
アルインコ	3,100	912.00	2,827,200	
ＬＩＸＩＬ	67,100	2,600.00	174,460,000	
日本フイルコン	5,400	519.00	2,802,600	
ノーリツ	8,100	1,567.00	12,692,700	
長府製作所	4,300	1,982.00	8,522,600	
リンナイ	8,000	9,600.00	76,800,000	
ユニプレス	6,400	814.00	5,209,600	
ダイニチ工業	3,900	697.00	2,718,300	
日東精工	5,300	510.00	2,703,000	
三洋工業	1,700	1,844.00	3,134,800	
岡部	8,600	721.00	6,200,600	
ジーテクト	5,300	1,456.00	7,716,800	
東プレ	7,900	1,225.00	9,677,500	
高周波熱錬	7,600	597.00	4,537,200	
東京製綱	3,600	844.00	3,038,400	
サンコール	5,300	492.00	2,607,600	
モリテックスチール	8,400	311.00	2,612,400	
パイオラックス	6,100	1,767.00	10,778,700	
エイチワン	4,500	657.00	2,956,500	
日本発条	39,100	894.00	34,955,400	
三浦工業	18,400	3,155.00	58,052,000	
タクマ	14,400	1,446.00	20,822,400	
テクノプロ・ホールディングス	24,600	3,305.00	81,303,000	

インターワークス	7,500	372.00	2,790,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,900	3,680.00	6,992,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,600	2,182.00	5,673,200	
三機サービス	2,900	1,010.00	2,929,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	2,900	799.00	2,317,100	
イー・ガーディアン	1,700	2,535.00	4,309,500	
リブセンス	17,000	176.00	2,992,000	
ジャパンマテリアル	12,600	1,728.00	21,772,800	
ベクトル	5,800	1,098.00	6,368,400	
ウチヤマホールディングス	9,500	324.00	3,078,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,100	1,064.00	3,298,400	
キャリアリンク	2,300	1,418.00	3,261,400	
ＩＢＪ	3,400	793.00	2,696,200	
アサンテ	1,800	1,561.00	2,809,800	
バリューＨＲ	1,600	2,462.00	3,939,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	3,400	4,955.00	16,847,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,900	1,373.00	2,608,700	
アビスト	1,000	2,911.00	2,911,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,500	2,029.00	5,072,500	
ウィルグループ	3,000	1,206.00	3,618,000	
メドピア	3,200	2,835.00	9,072,000	
リクルートホールディングス	317,300	4,643.00	1,473,223,900	
エラン	5,700	939.00	5,352,300	
ツガミ	9,400	1,270.00	11,938,000	
オークマ	5,000	4,755.00	23,775,000	
芝浦機械	4,800	3,055.00	14,664,000	
アマダ	67,200	1,038.00	69,753,600	
アイダエンジニアリング	11,100	974.00	10,811,400	
滝澤鉄工所	2,600	1,204.00	3,130,400	
ＦＵＪＩ	19,600	2,323.00	45,530,800	
牧野フライス製作所	4,700	3,700.00	17,390,000	
オーエスジー	19,700	1,973.00	38,868,100	
ダイジェット工業	3,200	1,005.00	3,216,000	
旭ダイヤモンド工業	11,200	573.00	6,417,600	
DMG森精機	25,300	1,691.00	42,782,300	
ソディック	9,400	767.00	7,209,800	
ディスコ	6,300	33,950.00	213,885,000	
日東工器	2,300	1,604.00	3,689,200	
日進工具	3,300	1,416.00	4,672,800	
日本郵政	537,100	969.50	520,718,450	
ベルシステム２４ホールディングス	5,900	1,369.00	8,077,100	
鎌倉新書	4,900	492.00	2,410,800	
ＳＭＮ	4,600	594.00	2,732,400	
エアトリ	2,700	3,205.00	8,653,500	
アトラエ	2,900	1,975.00	5,727,500	
ストライク	1,600	4,345.00	6,952,000	
ソラスト	10,100	1,029.00	10,392,900	
インソース	4,000	1,914.00	7,656,000	

豊田自動織機	34,800	9,090.00	316,332,000	
豊和工業	3,800	824.00	3,131,200	
東洋機械金属	5,700	564.00	3,214,800	
エンシュウ	5,100	650.00	3,315,000	
島精機製作所	6,200	1,829.00	11,339,800	
オプトラン	5,300	1,905.00	10,096,500	
ＮＣホールディングス	500	1,855.00	927,500	
イワキ	2,700	1,022.00	2,759,400	
フリュー	3,800	1,013.00	3,849,400	
ヤマシンフィルタ	8,600	359.00	3,087,400	
日阪製作所	5,200	821.00	4,269,200	
やまびこ	8,300	1,313.00	10,897,900	
野村マイクロ・サイエンス	1,100	3,495.00	3,844,500	
平田機工	2,000	5,270.00	10,540,000	
ペガサスミシン製造	5,700	531.00	3,026,700	
マルマエ	1,700	2,396.00	4,073,200	
タツモ	2,000	1,575.00	3,150,000	
ナブテスコ	24,300	3,155.00	76,666,500	
三井海洋開発	4,500	1,176.00	5,292,000	
レオン自動機	4,600	1,014.00	4,664,400	
ＳＭＣ	12,600	67,490.00	850,374,000	
ホソカワミクロン	3,000	2,647.00	7,941,000	
ユニオンツール	1,600	3,590.00	5,744,000	
オイレス工業	6,000	1,556.00	9,336,000	
日精エー・エス・ビー機械	1,400	2,957.00	4,139,800	
サトーホールディングス	5,600	2,001.00	11,205,600	
技研製作所	3,800	3,675.00	13,965,000	
カワタ	3,000	1,009.00	3,027,000	
日精樹脂工業	3,000	1,002.00	3,006,000	
オカダアイヨン	1,900	1,423.00	2,703,700	
ワイエイシイホールディングス	2,900	1,069.00	3,100,100	
小松製作所	195,100	2,725.50	531,745,050	
住友重機械工業	24,600	2,747.00	67,576,200	
日立建機	17,300	2,921.00	50,533,300	
日工	5,800	623.00	3,613,400	
巴工業	1,700	2,310.00	3,927,000	
井関農機	4,000	1,218.00	4,872,000	
ＴＯＷＡ	3,700	2,314.00	8,561,800	
丸山製作所	1,900	1,509.00	2,867,100	
北川鉄工所	2,000	1,344.00	2,688,000	
シンニッタン	13,200	226.00	2,983,200	
ローツェ	2,100	10,410.00	21,861,000	
タカキタ	4,500	615.00	2,767,500	
クボタ	210,000	2,058.00	432,180,000	
荏原実業	2,000	2,157.00	4,314,000	
東洋エンジニアリング	5,700	566.00	3,226,200	
三菱化工機	1,400	2,008.00	2,811,200	
月島機械	7,900	1,042.00	8,231,800	
帝国電機製作所	3,000	1,397.00	4,191,000	
新東工業	9,500	700.00	6,650,000	

澁谷工業	3,800	2,438.00	9,264,400	
アイチコーポレーション	6,100	859.00	5,239,900	
小森コーポレーション	10,900	736.00	8,022,400	
鶴見製作所	3,300	1,785.00	5,890,500	
荏原製作所	17,900	5,650.00	101,135,000	
石井鐵工所	1,000	3,005.00	3,005,000	
酉島製作所	3,900	959.00	3,740,100	
北越工業	4,000	896.00	3,584,000	
ダイキン工業	54,800	21,450.00	1,175,460,000	
オルガノ	1,200	7,740.00	9,288,000	
トーヨーカネツ	1,600	2,403.00	3,844,800	
栗田工業	23,300	4,730.00	110,209,000	
椿本チエイン	5,600	3,285.00	18,396,000	
大同工業	3,000	925.00	2,775,000	
日機装	12,900	782.00	10,087,800	
木村化工機	3,600	819.00	2,948,400	
レイズネクスト	6,500	1,120.00	7,280,000	
アネスト岩田	6,700	816.00	5,467,200	
ダイフク	23,700	8,380.00	198,606,000	
サムコ	1,100	2,298.00	2,527,800	
加藤製作所	3,700	819.00	3,030,300	
タダノ	22,500	980.00	22,050,000	
フジテック	16,000	2,693.00	43,088,000	
ＣＫＤ	12,700	2,020.00	25,654,000	
キトー	3,700	1,676.00	6,201,200	
平和	12,000	1,945.00	23,340,000	
理想科学工業	3,600	2,171.00	7,815,600	
ＳＡＮＫＹＯ	9,300	3,225.00	29,992,500	
日本金銭機械	4,400	628.00	2,763,200	
マースグループホールディングス	2,700	1,635.00	4,414,500	
フクシマガリレイ	2,900	3,855.00	11,179,500	
ダイコク電機	2,500	1,243.00	3,107,500	
竹内製作所	6,500	2,602.00	16,913,000	
アマノ	11,300	2,255.00	25,481,500	
ＪＵＫＩ	6,000	676.00	4,056,000	
ジャノメ	4,300	719.00	3,091,700	
ブラザー工業	52,600	2,091.00	109,986,600	
マックス	5,700	1,711.00	9,752,700	
モリタホールディングス	6,900	1,247.00	8,604,300	
グローリー	11,100	2,087.00	23,165,700	
新晃工業	4,000	1,720.00	6,880,000	
大和冷機工業	6,200	1,127.00	6,987,400	
セガサミーホールディングス	42,700	2,145.00	91,591,500	
日本ピストンリング	2,300	1,370.00	3,151,000	
リケン	1,900	2,572.00	4,886,800	
ＴＰＲ	5,800	1,416.00	8,212,800	
ツバキ・ナカシマ	9,400	964.00	9,061,600	
ホシザキ	12,600	7,870.00	99,162,000	
大豊工業	3,700	718.00	2,656,600	
日本精工	81,000	738.00	59,778,000	

ＮＴＮ	92,500	226.00	20,905,000	
ジェイテクト	41,300	1,029.00	42,497,700	
不二越	3,700	4,190.00	15,503,000	
ミネベアミツミ	74,200	2,516.00	186,687,200	
日本トムソン	11,800	534.00	6,301,200	
ＴＨＫ	24,300	2,704.00	65,707,200	
ユーシン精機	4,000	684.00	2,736,000	
前澤給装工業	3,200	980.00	3,136,000	
イーグル工業	5,300	1,063.00	5,633,900	
日本ピラー工業	4,400	2,827.00	12,438,800	
キッツ	14,500	671.00	9,729,500	
日立製作所	207,000	6,009.00	1,243,863,000	
東芝	75,200	4,516.00	339,603,200	
三菱電機	430,500	1,425.00	613,462,500	
富士電機	25,900	6,060.00	156,954,000	
東洋電機製造	2,800	963.00	2,696,400	
安川電機	46,300	4,665.00	215,989,500	
シンフォニア　テクノロジー	5,200	1,280.00	6,656,000	
明電舎	7,300	2,367.00	17,279,100	
オリジン	2,400	1,233.00	2,959,200	
山洋電気	1,900	4,910.00	9,329,000	
デンヨー	3,700	1,715.00	6,345,500	
ＰＨＣホールディングス	4,900	1,551.00	7,599,900	
ベイカレント・コンサルティング	2,900	42,700.00	123,830,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	800	2,710.00	2,168,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,200	815.00	2,608,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,000	1,486.00	19,318,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	6,600	449.00	2,963,400	
ウェルビー	2,700	1,190.00	3,213,000	
ミダックホールディングス	1,800	2,323.00	4,181,400	
日総工産	3,400	848.00	2,883,200	
キュービーネットホールディングス	1,900	1,702.00	3,233,800	
ＲＰＡホールディングス	8,700	331.00	2,879,700	
三櫻工業	6,000	713.00	4,278,000	
マキタ	52,400	4,136.00	216,726,400	
東芝テック	4,600	4,910.00	22,586,000	
芝浦メカトロニクス	800	7,680.00	6,144,000	
マブチモーター	10,100	4,180.00	42,218,000	
日本電産	111,600	9,956.00	1,111,089,600	
トレックス・セミコンダクター	2,200	2,485.00	5,467,000	
東光高岳	2,400	1,435.00	3,444,000	
ダブル・スコープ	12,400	1,067.00	13,230,800	
ダイヘン	4,700	4,150.00	19,505,000	
ヤーマン	7,000	931.00	6,517,000	
ＪＶＣケンウッド	35,100	189.00	6,633,900	
ミマキエンジニアリング	3,900	726.00	2,831,400	
Ｉ－ＰＥＸ	2,000	1,466.00	2,932,000	
日新電機	10,100	1,414.00	14,281,400	

大崎電気工業	7,900	487.00	3,847,300	
オムロン	35,800	7,867.00	281,638,600	
日東工業	5,700	1,597.00	9,102,900	
ＩＤＥＣ	5,300	2,407.00	12,757,100	
不二電機工業	2,600	1,064.00	2,766,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	14,000	2,395.00	33,530,000	
サクサホールディングス	2,200	1,402.00	3,084,400	
メルコホールディングス	1,200	3,730.00	4,476,000	
日本電気	54,700	5,120.00	280,064,000	
富士通	38,700	16,150.00	625,005,000	
沖電気工業	17,500	887.00	15,522,500	
岩崎通信機	3,600	816.00	2,937,600	
電気興業	2,300	2,362.00	5,432,600	
サンケン電気	4,000	5,220.00	20,880,000	
アイホン	2,400	2,114.00	5,073,600	
ルネサスエレクトロニクス	233,400	1,392.00	324,892,800	
セイコーエプソン	53,400	1,838.00	98,149,200	
ワコム	33,400	850.00	28,390,000	
アルバック	7,900	5,800.00	45,820,000	
ＥＩＺＯ	3,300	3,665.00	12,094,500	
ジャパンディスプレイ	147,000	44.00	6,468,000	
日本信号	11,000	881.00	9,691,000	
京三製作所	9,200	422.00	3,882,400	
能美防災	5,700	2,021.00	11,519,700	
ホーチキ	3,100	1,213.00	3,760,300	
エレコム	9,900	1,548.00	15,325,200	
パナソニック	459,100	1,209.00	555,051,900	
シャープ	49,100	1,181.00	57,987,100	
アンリツ	27,700	1,624.00	44,984,800	
富士通ゼネラル	11,700	2,567.00	30,033,900	
ソニーグループ	269,700	11,890.00	3,206,733,000	
ＴＤＫ	62,400	4,760.00	297,024,000	
タムラ製作所	16,600	601.00	9,976,600	
アルプスアルパイン	38,100	1,209.00	46,062,900	
池上通信機	4,500	642.00	2,889,000	
日本電波工業	3,900	1,141.00	4,449,900	
メイコー	3,500	3,850.00	13,475,000	
日本トリム	900	2,700.00	2,430,000	
ローランド　ディー．ジー．	2,500	2,839.00	7,097,500	
フォスター電機	4,300	773.00	3,323,900	
ＳＭＫ	1,400	2,180.00	3,052,000	
ヨコオ	3,200	2,624.00	8,396,800	
ホシデン	10,400	1,206.00	12,542,400	
ヒロセ電機	6,600	16,980.00	112,068,000	
日本航空電子工業	9,900	1,847.00	18,285,300	
ＴＯＡ	4,600	767.00	3,528,200	
マクセル	8,600	1,212.00	10,423,200	
古野電気	5,100	1,052.00	5,365,200	
ユニデンホールディングス	900	3,435.00	3,091,500	
スミダコーポレーション	4,000	839.00	3,356,000	

アイコム	1,600	2,358.00	3,772,800	
リオン	1,600	2,079.00	3,326,400	
横河電機	43,100	1,815.00	78,226,500	
新電元工業	1,700	2,984.00	5,072,800	
アズビル	25,200	4,110.00	103,572,000	
東亜ディーケーケー	3,400	912.00	3,100,800	
日本光電工業	17,800	3,140.00	55,892,000	
共和電業	7,400	379.00	2,804,600	
日本電子材料	2,200	1,993.00	4,384,600	
堀場製作所	8,000	6,560.00	52,480,000	
アドバンテスト	32,000	9,380.00	300,160,000	
小野測器	6,100	483.00	2,946,300	
エスペック	3,500	2,035.00	7,122,500	
キーエンス	39,000	52,500.00	2,047,500,000	
日置電機	2,100	6,570.00	13,797,000	
シスメックス	36,400	8,330.00	303,212,000	
日本マイクロニクス	7,500	1,697.00	12,727,500	
メガチップス	4,000	3,805.00	15,220,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,000	3,140.00	6,280,000	
澤藤電機	1,900	1,534.00	2,914,600	
デンソー	94,800	8,431.00	799,258,800	
原田工業	3,000	991.00	2,973,000	
コーセル	5,300	819.00	4,340,700	
イリソ電子工業	3,600	4,100.00	14,760,000	
オプテックスグループ	7,100	1,606.00	11,402,600	
千代田インテグレ	1,800	1,917.00	3,450,600	
アイ・オー・データ機器	3,900	1,297.00	5,058,300	
レーザーテック	18,900	21,170.00	400,113,000	
スタンレー電気	30,100	2,841.00	85,514,100	
岩崎電気	1,600	2,281.00	3,649,600	
ウシオ電機	22,100	1,869.00	41,304,900	
岡谷電機産業	9,300	307.00	2,855,100	
日本セラミック	4,000	2,490.00	9,960,000	
遠藤照明	2,800	1,009.00	2,825,200	
古河電池	3,100	1,256.00	3,893,600	
山一電機	3,100	1,915.00	5,936,500	
図研	2,800	2,988.00	8,366,400	
日本電子	9,000	6,510.00	58,590,000	
カシオ計算機	31,200	1,296.00	40,435,200	
ファナック	37,800	21,525.00	813,645,000	
日本シイエムケイ	8,400	594.00	4,989,600	
エンプラス	1,100	2,619.00	2,880,900	
大真空	5,800	1,073.00	6,223,400	
ローム	19,300	9,210.00	177,753,000	
浜松ホトニクス	30,900	5,640.00	174,276,000	
三井ハイテック	4,200	8,160.00	34,272,000	
新光電気工業	12,600	4,755.00	59,913,000	
京セラ	60,600	6,854.00	415,352,400	
協栄産業	1,700	1,571.00	2,670,700	
太陽誘電	20,900	5,150.00	107,635,000	

村田製作所	126,500	7,938.00	1,004,157,000	
双葉電子工業	7,400	675.00	4,995,000	
日東電工	26,000	8,260.00	214,760,000	
北陸電気工業	100	1,296.00	129,600	
東海理化電機製作所	11,300	1,563.00	17,661,900	
ニチコン	13,600	1,226.00	16,673,600	
日本ケミコン	4,100	1,899.00	7,785,900	
ＫＯＡ	6,500	1,414.00	9,191,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	15,500	359.00	5,564,500	
日立造船	36,400	773.00	28,137,200	
三菱重工業	67,600	3,339.00	225,716,400	
川崎重工業	31,400	2,084.00	65,437,600	
ＩＨＩ	26,900	2,678.00	72,038,200	
マネジメントソリューションズ	2,000	3,075.00	6,150,000	
プロレド・パートナーズ	2,800	783.00	2,192,400	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	7,600	397.00	3,017,200	
カーブスホールディングス	11,300	699.00	7,898,700	
フォーラムエンジニアリング	3,700	854.00	3,159,800	
日本車輌製造	1,600	2,105.00	3,368,000	
三菱ロジスネクスト	5,700	937.00	5,340,900	
近畿車輌	3,000	1,066.00	3,198,000	
フルサト・マルカホールディングス	4,100	2,350.00	9,635,000	
ヤマエグループホールディングス	2,800	1,054.00	2,951,200	
ＦＰＧ	14,300	875.00	12,512,500	
島根銀行	5,500	555.00	3,052,500	
じもとホールディングス	4,700	682.00	3,205,400	
全国保証	10,100	4,830.00	48,783,000	
めぶきフィナンシャルグループ	220,600	281.00	61,988,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,300	1,147.00	3,785,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,300	2,074.00	10,992,200	
九州フィナンシャルグループ	86,700	414.00	35,893,800	
かんぽ生命保険	42,700	2,079.00	88,773,300	
ゆうちょ銀行	100,200	1,014.00	101,602,800	
富山第一銀行	10,200	320.00	3,264,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	242,500	490.00	118,825,000	
ジェイリース	1,500	1,740.00	2,610,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	27,700	843.00	23,351,100	
イントラスト	3,300	589.00	1,943,700	
アルヒ	6,300	1,022.00	6,438,600	
プレミアグループ	2,100	4,160.00	8,736,000	
日産自動車	507,700	598.10	303,655,370	
いすゞ自動車	135,100	1,638.00	221,293,800	
トヨタ自動車	2,180,500	2,173.00	4,738,226,500	
日野自動車	53,800	1,095.00	58,911,000	
三菱自動車工業	159,400	325.00	51,805,000	
エフテック	5,200	527.00	2,740,400	
武蔵精密工業	9,600	1,875.00	18,000,000	

日産車体	6,300	673.00	4,239,900	
新明和工業	12,200	935.00	11,407,000	
極東開発工業	8,000	1,476.00	11,808,000	
トピー工業	3,500	1,118.00	3,913,000	
ティラド	1,200	2,524.00	3,028,800	
曙ブレーキ工業	23,600	171.00	4,035,600	
タチエス	7,500	1,145.00	8,587,500	
ＮＯＫ	20,800	1,233.00	25,646,400	
フタバ産業	10,800	403.00	4,352,400	
ＫＹＢ	4,500	3,095.00	13,927,500	
市光工業	5,700	506.00	2,884,200	
大同メタル工業	8,300	636.00	5,278,800	
プレス工業	21,300	380.00	8,094,000	
ミクニ	9,500	407.00	3,866,500	
太平洋工業	9,000	1,016.00	9,144,000	
河西工業	10,400	288.00	2,995,200	
アイシン	31,500	4,375.00	137,812,500	
マツダ	135,100	931.00	125,778,100	
今仙電機製作所	5,100	592.00	3,019,200	
本田技研工業	338,900	3,662.00	1,241,051,800	
スズキ	98,500	4,864.00	479,104,000	
ＳＵＢＡＲＵ	123,400	1,975.50	243,776,700	
ヤマハ発動機	56,200	2,646.00	148,705,200	
小糸製作所	23,600	6,250.00	147,500,000	
エクセディ	6,500	1,721.00	11,186,500	
ミツバ	8,000	394.00	3,152,000	
豊田合成	13,900	2,257.00	31,372,300	
愛三工業	6,700	749.00	5,018,300	
ヨロズ	4,000	973.00	3,892,000	
エフ・シー・シー	7,000	1,459.00	10,213,000	
シマノ	17,300	26,620.00	460,526,000	
テイ・エス　テック	18,200	1,568.00	28,537,600	
三十三フィナンシャルグループ	3,900	1,522.00	5,935,800	
第四北越フィナンシャルグループ	6,900	2,703.00	18,650,700	
ひろぎんホールディングス	62,600	685.00	42,881,000	
おきなわフィナンシャルグループ	3,800	2,412.00	9,165,600	
ダイレクトマーケティングミックス	4,700	1,492.00	7,012,400	
ポピンズホールディングス	1,000	2,247.00	2,247,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	3,300	2,870.00	9,471,000	
十六フィナンシャルグループ	5,700	2,427.00	13,833,900	
北國フィナンシャルホールディングス	3,900	3,310.00	12,909,000	
ジャムコ	3,100	811.00	2,514,100	
小野建	4,100	1,622.00	6,650,200	
南陽	1,600	1,948.00	3,116,800	
ノジマ	6,900	2,550.00	17,595,000	
カッパ・クリエイト	5,900	1,376.00	8,118,400	
伯東	2,600	2,353.00	6,117,800	
コンドーテック	3,300	1,021.00	3,369,300	
中山福	8,700	405.00	3,523,500	
ライトオン	3,900	712.00	2,776,800	

ナガイレーベン	5,600	2,145.00	12,012,000	
三菱食品	4,100	3,150.00	12,915,000	
良品計画	48,800	1,764.00	86,083,200	
松田産業	3,100	2,274.00	7,049,400	
第一興商	8,000	3,610.00	28,880,000	
メディパルホールディングス	45,800	2,094.00	95,905,200	
アドヴァングループ	4,300	940.00	4,042,000	
ＳＰＫ	2,100	1,306.00	2,742,600	
萩原電気ホールディングス	1,600	2,087.00	3,339,200	
アルビス	1,400	2,215.00	3,101,000	
アズワン	6,100	6,660.00	40,626,000	
スズデン	1,600	2,168.00	3,468,800	
シモジマ	2,600	1,023.00	2,659,800	
ドウシシャ	4,000	1,547.00	6,188,000	
小津産業	1,500	2,005.00	3,007,500	
コナカ	9,000	353.00	3,177,000	
高速	2,500	1,521.00	3,802,500	
Ｇ－７ホールディングス	4,700	1,688.00	7,933,600	
イオン北海道	7,500	1,144.00	8,580,000	
コジマ	7,300	549.00	4,007,700	
ヒマラヤ	3,100	1,001.00	3,103,100	
コーナン商事	6,000	3,670.00	22,020,000	
ネットワンシステムズ	16,100	2,751.00	44,291,100	
エコス	1,600	1,954.00	3,126,400	
ワタミ	5,100	951.00	4,850,100	
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	84,800	1,876.00	159,084,800	
丸文	3,700	712.00	2,634,400	
西松屋チェーン	9,300	1,356.00	12,610,800	
ゼンショーホールディングス	20,700	2,709.00	56,076,300	
ハピネット	3,500	1,589.00	5,561,500	
幸楽苑ホールディングス	2,700	1,427.00	3,852,900	
橋本総業ホールディングス	1,500	2,008.00	3,012,000	
日本ライフライン	12,600	1,037.00	13,066,200	
サイゼリヤ	6,300	2,893.00	18,225,900	
ＶＴホールディングス	16,000	491.00	7,856,000	
アルゴグラフィックス	3,300	3,175.00	10,477,500	
ＩＤＯＭ	12,900	657.00	8,475,300	
日本エム・ディ・エム	2,500	1,564.00	3,910,000	
フジ・コーポレーション	2,600	1,177.00	3,060,200	
ユナイテッドアローズ	4,400	1,771.00	7,792,400	
進和	2,500	2,025.00	5,062,500	
ダイトロン	1,800	1,789.00	3,220,200	
ハイデイ日高	6,100	1,721.00	10,498,100	
シークス	6,100	1,130.00	6,893,000	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	14,800	201.00	2,974,800	
コロワイド	17,400	1,733.00	30,154,200	
ピーシーデポコーポレーション	9,700	282.00	2,735,400	
田中商事	4,700	643.00	3,022,100	

オーハシテクニカ	2,300	1,364.00	3,137,200	
壱番屋	3,000	4,615.00	13,845,000	
白銅	1,400	2,553.00	3,574,200	
スギホールディングス	8,500	6,410.00	54,485,000	
薬王堂ホールディングス	2,100	2,412.00	5,065,200	
島津製作所	55,400	4,020.00	222,708,000	
ＪＭＳ	5,000	609.00	3,045,000	
長野計器	3,100	1,281.00	3,971,100	
ブイ・テクノロジー	1,900	3,525.00	6,697,500	
スター精密	6,500	1,493.00	9,704,500	
東京計器	3,000	1,046.00	3,138,000	
愛知時計電機	1,800	1,892.00	3,405,600	
インターアクション	2,200	2,002.00	4,404,400	
オーバル	12,400	270.00	3,348,000	
東京精密	7,300	4,725.00	34,492,500	
マニー	17,100	1,579.00	27,000,900	
ニコン	65,700	1,250.00	82,125,000	
トプコン	20,300	1,490.00	30,247,000	
オリンパス	225,700	2,317.50	523,059,750	
理研計器	3,500	4,745.00	16,607,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	7,500	11,560.00	86,700,000	
キヤノン電子	3,900	1,612.00	6,286,800	
タムロン	3,300	2,310.00	7,623,000	
ＨＯＹＡ	84,000	14,975.00	1,257,900,000	
ノーリツ鋼機	3,900	1,790.00	6,981,000	
エー・アンド・デイ	3,900	912.00	3,556,800	
朝日インテック	47,200	2,289.00	108,040,800	
キヤノン	213,900	2,823.00	603,839,700	
リコー	119,500	1,048.00	125,236,000	
シチズン時計	50,400	506.00	25,502,400	
リズム	2,400	1,455.00	3,492,000	
メニコン	14,300	2,895.00	41,398,500	
スノーピーク	5,600	2,549.00	14,274,400	
パラマウントベッドホールディングス	8,300	1,990.00	16,517,000	
トランザクション	2,800	974.00	2,727,200	
粧美堂	200	418.00	83,600	
ニホンフラッシュ	3,700	1,028.00	3,803,600	
前田工繊	4,700	3,225.00	15,157,500	
永大産業	10,500	299.00	3,139,500	
アートネイチャー	4,100	725.00	2,972,500	
バンダイナムコホールディングス	38,600	7,790.00	300,694,000	
アイフィスジャパン	4,200	672.00	2,822,400	
共立印刷	21,500	163.00	3,504,500	
ＳＨＯＥＩ	4,000	4,590.00	18,360,000	
フランスベッドホールディングス	5,500	915.00	5,032,500	
マーベラス	6,700	734.00	4,917,800	
パイロットコーポレーション	7,300	4,645.00	33,908,500	
萩原工業	2,800	1,213.00	3,396,400	
エイベックス	7,300	1,364.00	9,957,200	
フジシールインターナショナル	10,500	1,743.00	18,301,500	

タカラトミー	18,000	1,267.00	22,806,000	
広済堂ホールディングス	3,800	870.00	3,306,000	
レック	5,600	943.00	5,280,800	
三光合成	7,700	353.00	2,718,100	
プロネクサス	3,300	1,081.00	3,567,300	
大建工業	2,500	2,231.00	5,577,500	
きもと	13,500	211.00	2,848,500	
凸版印刷	65,400	2,273.00	148,654,200	
大日本印刷	50,900	2,952.00	150,256,800	
共同印刷	1,200	2,834.00	3,400,800	
ＮＩＳＳＨＡ	8,800	1,356.00	11,932,800	
藤森工業	3,900	4,005.00	15,619,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	2,100	1,846.00	3,876,600	
前澤化成工業	2,700	1,271.00	3,431,700	
未来工業	1,900	1,520.00	2,888,000	
アシックス	38,100	2,252.00	85,801,200	
ツツミ	1,500	1,869.00	2,803,500	
ＪＳＰ	2,500	1,589.00	3,972,500	
ニチハ	6,000	2,585.00	15,510,000	
ローランド	3,000	4,080.00	12,240,000	
エフピコ	7,900	3,195.00	25,240,500	
小松ウオール工業	1,500	1,877.00	2,815,500	
ヤマハ	25,600	5,460.00	139,776,000	
河合楽器製作所	1,200	2,971.00	3,565,200	
ピジョン	26,000	2,311.00	60,086,000	
天馬	3,400	2,586.00	8,792,400	
キングジム	3,500	881.00	3,083,500	
象印マホービン	11,600	1,427.00	16,553,200	
リンテック	9,200	2,614.00	24,048,800	
信越ポリマー	7,700	1,087.00	8,369,900	
東リ	14,000	227.00	3,178,000	
イトーキ	7,900	359.00	2,836,100	
任天堂	24,300	58,770.00	1,428,111,000	
三菱鉛筆	7,100	1,250.00	8,875,000	
松風	1,800	1,784.00	3,211,200	
タカラスタンダード	8,900	1,346.00	11,979,400	
コクヨ	20,600	1,591.00	32,774,600	
ナカバヤシ	5,900	507.00	2,991,300	
ニフコ	14,400	3,495.00	50,328,000	
グローブライド	3,800	2,630.00	9,994,000	
オカムラ	14,800	1,173.00	17,360,400	
バルカー	3,500	2,545.00	8,907,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,800	2,043.00	3,677,400	
伊藤忠商事	296,500	3,834.00	1,136,781,000	
丸紅	418,200	1,236.50	517,104,300	
スクロール	6,500	935.00	6,077,500	
ヨンドシーホールディングス	3,900	1,725.00	6,727,500	
三陽商会	400	875.00	350,000	
長瀬産業	23,300	1,856.00	43,244,800	
蝶理	2,400	1,781.00	4,274,400	

豊田通商	42,600	5,040.00	214,704,000	
オンワードホールディングス	25,300	292.00	7,387,600	
三共生興	5,600	571.00	3,197,600	
兼松	15,800	1,407.00	22,230,600	
美津濃	4,300	2,272.00	9,769,600	
三井物産	329,300	3,075.00	1,012,597,500	
日本紙パルプ商事	2,200	4,160.00	9,152,000	
東京エレクトロン	27,300	55,140.00	1,505,322,000	
カメイ	5,000	1,042.00	5,210,000	
ＯＵＧホールディングス	1,100	2,721.00	2,993,100	
スターゼン	3,100	2,124.00	6,584,400	
セイコーホールディングス	6,100	2,344.00	14,298,400	
山善	17,800	1,020.00	18,156,000	
椿本興業	900	4,115.00	3,703,500	
住友商事	267,600	1,899.00	508,172,400	
日本ユニシス	13,200	3,035.00	40,062,000	
内田洋行	1,900	4,595.00	8,730,500	
三菱商事	317,700	4,061.00	1,290,179,700	
第一実業	1,900	4,310.00	8,189,000	
キヤノンマーケティングジャパン	10,500	2,466.00	25,893,000	
西華産業	2,200	1,603.00	3,526,600	
佐藤商事	3,500	1,225.00	4,287,500	
菱洋エレクトロ	2,500	2,136.00	5,340,000	
東京産業	3,900	698.00	2,722,200	
ユアサ商事	4,000	2,986.00	11,944,000	
神鋼商事	900	3,850.00	3,465,000	
阪和興業	8,500	3,275.00	27,837,500	
正栄食品工業	2,700	4,165.00	11,245,500	
カナデン	3,400	1,015.00	3,451,000	
菱電商事	3,400	1,761.00	5,987,400	
ニプロ	32,100	1,101.00	35,342,100	
岩谷産業	10,200	5,360.00	54,672,000	
ナイス	1,700	1,838.00	3,124,600	
極東貿易	1,200	2,244.00	2,692,800	
アステナホールディングス	6,200	416.00	2,579,200	
兼松エレクトロニクス	2,300	3,895.00	8,958,500	
三愛石油	10,400	933.00	9,703,200	
稲畑産業	9,300	2,490.00	23,157,000	
明和産業	3,900	1,114.00	4,344,600	
ゴールドウイン	7,600	5,990.00	45,524,000	
ユニ・チャーム	83,000	4,355.00	361,465,000	
デサント	8,200	2,880.00	23,616,000	
ワキタ	9,000	1,000.00	9,000,000	
ヤマトインターナショナル	10,300	292.00	3,007,600	
東邦ホールディングス	13,600	1,874.00	25,486,400	
サンゲツ	11,200	1,579.00	17,684,800	
ミツウロコグループホールディングス	6,200	1,043.00	6,466,600	
シナネンホールディングス	1,600	3,295.00	5,272,000	
伊藤忠エネクス	9,400	1,025.00	9,635,000	
サンリオ	13,100	2,427.00	31,793,700	

サンワ　テクノス	2,600	1,349.00	3,507,400	
リョーサン	4,700	2,317.00	10,889,900	
新光商事	6,400	917.00	5,868,800	
トーホー	2,500	1,061.00	2,652,500	
三信電気	2,000	1,695.00	3,390,000	
東陽テクニカ	4,200	1,071.00	4,498,200	
モスフードサービス	5,600	3,015.00	16,884,000	
加賀電子	3,800	3,145.00	11,951,000	
三益半導体工業	3,400	2,355.00	8,007,000	
都築電気	2,200	1,385.00	3,047,000	
ソーダニッカ	4,200	777.00	3,263,400	
立花エレテック	3,400	1,588.00	5,399,200	
木曽路	5,600	2,222.00	12,443,200	
ＳＲＳホールディングス	5,800	823.00	4,773,400	
千趣会	7,700	372.00	2,864,400	
リテールパートナーズ	5,100	1,176.00	5,997,600	
ケーヨー	7,800	879.00	6,856,200	
上新電機	4,900	2,088.00	10,231,200	
日本瓦斯	20,600	1,738.00	35,802,800	
ロイヤルホールディングス	7,300	1,951.00	14,242,300	
東天紅	3,100	951.00	2,948,100	
いなげや	5,300	1,394.00	7,388,200	
チヨダ	4,100	750.00	3,075,000	
ライフコーポレーション	4,000	2,958.00	11,832,000	
リンガーハット	5,200	2,222.00	11,554,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	5,300	604.00	3,201,200	
ＡＯＫＩホールディングス	8,200	610.00	5,002,000	
オークワ	6,700	958.00	6,418,600	
コメリ	6,500	2,776.00	18,044,000	
青山商事	8,800	738.00	6,494,400	
しまむら	4,900	10,080.00	49,392,000	
高島屋	30,900	1,161.00	35,874,900	
松屋	8,500	720.00	6,120,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	20,100	864.00	17,366,400	
近鉄百貨店	1,600	2,592.00	4,147,200	
丸井グループ	33,500	2,294.00	76,849,000	
クレディセゾン	27,300	1,357.00	37,046,100	
アクシアル　リテイリング	3,300	3,285.00	10,840,500	
イオン	163,100	2,614.00	426,343,400	
イズミ	7,700	3,200.00	24,640,000	
フォーバル	3,200	842.00	2,694,400	
平和堂	7,800	1,993.00	15,545,400	
フジ	5,100	2,099.00	10,704,900	
ヤオコー	4,800	6,570.00	31,536,000	
ゼビオホールディングス	5,800	948.00	5,498,400	
ケーズホールディングス	39,100	1,253.00	48,992,300	
ＰＡＬＴＡＣ	5,900	4,450.00	26,255,000	
三谷産業	9,400	315.00	2,961,000	
日産東京販売ホールディングス	13,100	235.00	3,078,500	
新生銀行	27,700	2,162.00	59,887,400	

あおぞら銀行	23,700	2,709.00	64,203,300	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	2,662,700	739.10	1,968,001,570	
りそなホールディングス	486,000	536.70	260,836,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	80,300	4,158.00	333,887,400	
三井住友フィナンシャルグループ	293,900	4,277.00	1,257,010,300	
千葉銀行	141,700	774.00	109,675,800	
群馬銀行	81,600	398.00	32,476,800	
武蔵野銀行	6,300	1,929.00	12,152,700	
千葉興業銀行	11,700	276.00	3,229,200	
七十七銀行	13,300	1,556.00	20,694,800	
青森銀行	3,300	1,930.00	6,369,000	
秋田銀行	2,700	1,736.00	4,687,200	
山形銀行	4,800	999.00	4,795,200	
岩手銀行	2,800	1,949.00	5,457,200	
東邦銀行	35,400	223.00	7,894,200	
みちのく銀行	3,700	895.00	3,311,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	35,800	2,383.00	85,311,400	
静岡銀行	103,400	900.00	93,060,000	
スルガ銀行	37,200	451.00	16,777,200	
八十二銀行	95,600	440.00	42,064,000	
山梨中央銀行	4,600	963.00	4,429,800	
大垣共立銀行	8,400	2,055.00	17,262,000	
福井銀行	3,600	1,476.00	5,313,600	
清水銀行	1,900	1,639.00	3,114,100	
富山銀行	1,700	2,274.00	3,865,800	
滋賀銀行	8,000	2,262.00	18,096,000	
南都銀行	6,600	2,129.00	14,051,400	
百五銀行	40,800	359.00	14,647,200	
京都銀行	15,200	5,580.00	84,816,000	
紀陽銀行	14,400	1,551.00	22,334,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	26,500	967.00	25,625,500	
山陰合同銀行	25,200	688.00	17,337,600	
中国銀行	33,900	909.00	30,815,100	
鳥取銀行	1,600	1,258.00	2,012,800	
伊予銀行	56,300	635.00	35,750,500	
百十四銀行	4,500	1,792.00	8,064,000	
四国銀行	6,500	810.00	5,265,000	
阿波銀行	6,500	2,315.00	15,047,500	
大分銀行	2,400	2,042.00	4,900,800	
宮崎銀行	2,700	2,246.00	6,064,200	
佐賀銀行	2,400	1,566.00	3,758,400	
琉球銀行	9,200	860.00	7,912,000	
セブン銀行	126,100	247.00	31,146,700	
みずほフィナンシャルグループ	543,000	1,592.00	864,456,000	
山口フィナンシャルグループ	49,500	736.00	36,432,000	
芙蓉総合リース	4,500	7,700.00	34,650,000	
みずほリース	6,500	3,220.00	20,930,000	
東京センチュリー	8,200	5,700.00	46,740,000	
ＳＢＩホールディングス	52,400	3,045.00	159,558,000	
日本証券金融	16,700	906.00	15,130,200	

アイフル	71,200	363.00	25,845,600	
長野銀行	2,500	1,270.00	3,175,000	
名古屋銀行	3,200	3,125.00	10,000,000	
北洋銀行	64,000	268.00	17,152,000	
愛知銀行	1,500	4,825.00	7,237,500	
中京銀行	1,800	1,635.00	2,943,000	
大光銀行	2,300	1,477.00	3,397,100	
愛媛銀行	5,900	981.00	5,787,900	
京葉銀行	18,100	520.00	9,412,000	
栃木銀行	20,500	233.00	4,776,500	
北日本銀行	1,900	1,742.00	3,309,800	
東和銀行	7,400	584.00	4,321,600	
リコーリース	3,800	3,795.00	14,421,000	
イオンフィナンシャルサービス	23,100	1,240.00	28,644,000	
アコム	83,800	323.00	27,067,400	
ジャックス	4,700	3,265.00	15,345,500	
オリエントコーポレーション	114,900	124.00	14,247,600	
オリックス	257,800	2,368.00	610,470,400	
三菱ＨＣキャピタル	156,800	614.00	96,275,200	
ジャフコ　グループ	16,200	1,708.00	27,669,600	
九州リースサービス	5,000	602.00	3,010,000	
トモニホールディングス	32,800	354.00	11,611,200	
大和証券グループ本社	318,000	691.40	219,865,200	
野村ホールディングス	648,200	538.30	348,926,060	
岡三証券グループ	33,400	391.00	13,059,400	
丸三証券	12,600	547.00	6,892,200	
東洋証券	15,700	155.00	2,433,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	48,800	420.00	20,496,000	
光世証券	6,100	476.00	2,903,600	
水戸証券	11,300	280.00	3,164,000	
いちよし証券	7,900	663.00	5,237,700	
松井証券	20,800	817.00	16,993,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	69,700	5,339.00	372,128,300	
日本取引所グループ	107,500	2,192.50	235,693,750	
マネックスグループ	34,600	512.00	17,715,200	
極東証券	5,700	772.00	4,400,400	
岩井コスモホールディングス	4,000	1,416.00	5,664,000	
アイザワ証券グループ	7,000	898.00	6,286,000	
フィデアホールディングス	3,900	1,412.00	5,506,800	
池田泉州ホールディングス	48,800	189.00	9,223,200	
アニコム　ホールディングス	13,000	770.00	10,010,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	95,200	3,982.00	379,086,400	
スパークス・グループ	19,600	261.00	5,115,600	
第一生命ホールディングス	209,000	2,638.50	551,446,500	
東京海上ホールディングス	139,800	7,033.00	983,213,400	
イー・ギャランティ	6,200	2,079.00	12,889,800	
アサックス	4,200	687.00	2,885,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	1,700	2,180.00	3,706,000	

Ｔ＆Ｄホールディングス	110,200	1,771.00	195,164,200	
アドバンスクリエイト	2,400	1,003.00	2,407,200	
三井不動産	193,600	2,592.50	501,908,000	
三菱地所	279,000	1,813.50	505,966,500	
平和不動産	7,300	3,985.00	29,090,500	
東京建物	41,900	1,816.00	76,090,400	
ダイビル	10,800	2,196.00	23,716,800	
京阪神ビルディング	6,600	1,506.00	9,939,600	
住友不動産	89,100	3,639.00	324,234,900	
テーオーシー	7,600	695.00	5,282,000	
東京楽天地	700	3,960.00	2,772,000	
レオパレス２１	44,000	215.00	9,460,000	
スターツコーポレーション	5,800	2,555.00	14,819,000	
フジ住宅	4,900	659.00	3,229,100	
空港施設	5,400	560.00	3,024,000	
ゴールドクレスト	3,300	1,857.00	6,128,100	
リログループ	22,500	1,712.00	38,520,000	
エスリード	1,800	1,774.00	3,193,200	
日神グループホールディングス	6,900	508.00	3,505,200	
日本エスコン	7,900	758.00	5,988,200	
タカラレーベン	17,800	320.00	5,696,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,400	837.00	2,845,800	
イオンモール	21,300	1,660.00	35,358,000	
ファースト住建	2,500	1,197.00	2,992,500	
カチタス	10,500	3,260.00	34,230,000	
東祥	3,100	1,708.00	5,294,800	
トーセイ	5,900	1,077.00	6,354,300	
穴吹興産	1,500	1,960.00	2,940,000	
サンフロンティア不動産	5,900	1,080.00	6,372,000	
ＦＪネクストホールディングス	4,200	997.00	4,187,400	
グランディハウス	6,100	572.00	3,489,200	
東武鉄道	42,100	2,923.00	123,058,300	
相鉄ホールディングス	13,800	2,237.00	30,870,600	
東急	108,600	1,583.00	171,913,800	
京浜急行電鉄	55,300	1,270.00	70,231,000	
小田急電鉄	64,000	2,127.00	136,128,000	
京王電鉄	22,300	5,280.00	117,744,000	
京成電鉄	30,000	3,400.00	102,000,000	
富士急行	5,100	4,070.00	20,757,000	
新京成電鉄	1,500	2,033.00	3,049,500	
東日本旅客鉄道	75,800	7,173.00	543,713,400	
西日本旅客鉄道	52,200	5,091.00	265,750,200	
東海旅客鉄道	35,800	15,930.00	570,294,000	
西武ホールディングス	56,200	1,233.00	69,294,600	
鴻池運輸	6,900	1,163.00	8,024,700	
西日本鉄道	11,900	2,656.00	31,606,400	
ハマキョウレックス	3,000	2,899.00	8,697,000	
サカイ引越センター	2,000	4,475.00	8,950,000	
近鉄グループホールディングス	40,800	3,580.00	146,064,000	
阪急阪神ホールディングス	51,000	3,510.00	179,010,000	

南海電気鉄道	18,200	2,384.00	43,388,800	
京阪ホールディングス	18,200	3,065.00	55,783,000	
神戸電鉄	1,000	3,410.00	3,410,000	
名古屋鉄道	33,500	2,130.00	71,355,000	
山陽電気鉄道	3,100	1,996.00	6,187,600	
アルプス物流	2,900	1,053.00	3,053,700	
トランコム	1,100	7,220.00	7,942,000	
ヤマトホールディングス	57,100	2,186.00	124,820,600	
山九	10,700	3,990.00	42,693,000	
日新	3,300	1,716.00	5,662,800	
丸全昭和運輸	3,300	3,190.00	10,527,000	
センコーグループホールディングス	20,400	940.00	19,176,000	
トナミホールディングス	1,000	3,810.00	3,810,000	
ニッコンホールディングス	13,700	2,179.00	29,852,300	
日本石油輸送	500	2,641.00	1,320,500	
福山通運	6,700	4,100.00	27,470,000	
セイノーホールディングス	27,800	1,217.00	33,832,600	
神奈川中央交通	1,000	3,570.00	3,570,000	
日立物流	7,900	5,950.00	47,005,000	
丸和運輸機関	8,600	1,051.00	9,038,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	4,100	1,246.00	5,108,600	
日本郵船	34,100	10,190.00	347,479,000	
商船三井	22,600	9,160.00	207,016,000	
川崎汽船	12,600	7,620.00	96,012,000	
ＮＳユナイテッド海運	2,200	4,145.00	9,119,000	
明治海運	4,900	919.00	4,503,100	
飯野海運	18,900	863.00	16,310,700	
九州旅客鉄道	31,500	2,576.00	81,144,000	
ＳＧホールディングス	77,000	2,517.00	193,809,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	14,100	7,330.00	103,353,000	
日本航空	93,500	2,365.00	221,127,500	
ＡＮＡホールディングス	103,600	2,612.50	270,655,000	
パスコ	700	1,310.00	917,000	
ＴＲＥホールディングス	5,600	1,529.00	8,562,400	
人・夢・技術グループ	1,600	1,889.00	3,022,400	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,000	2,815.00	2,815,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,900	3,730.00	7,087,000	
国際紙パルプ商事	9,300	363.00	3,375,900	
ナルミヤ・インターナショナル	3,100	1,023.00	3,171,300	
ブックオフグループホールディングス	2,900	1,030.00	2,987,000	
三菱倉庫	13,000	2,764.00	35,932,000	
三井倉庫ホールディングス	4,400	2,340.00	10,296,000	
住友倉庫	14,400	2,134.00	30,729,600	
澁澤倉庫	2,400	2,223.00	5,335,200	
ヤマタネ	2,000	1,625.00	3,250,000	
東陽倉庫	9,200	322.00	2,962,400	
乾汽船	2,800	2,616.00	7,324,800	
日本トランスシティ	9,000	617.00	5,553,000	

中央倉庫	3,000	980.00	2,940,000	
安田倉庫	3,300	981.00	3,237,300	
東洋埠頭	2,100	1,516.00	3,183,600	
上組	22,400	2,192.00	49,100,800	
近鉄エクスプレス	7,700	2,949.00	22,707,300	
東海運	9,700	308.00	2,987,600	
エーアイテイー	2,600	1,407.00	3,658,200	
内外トランスライン	1,600	1,885.00	3,016,000	
日本コンセプト	1,800	1,456.00	2,620,800	
ＴＢＳホールディングス	25,700	1,889.00	48,547,300	
日本テレビホールディングス	35,300	1,328.00	46,878,400	
朝日放送グループホールディングス	4,200	758.00	3,183,600	
テレビ朝日ホールディングス	10,200	1,567.00	15,983,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	35,800	444.00	15,895,200	
テレビ東京ホールディングス	3,000	2,120.00	6,360,000	
日本ＢＳ放送	2,600	1,065.00	2,769,000	
ビジョン	7,200	1,154.00	8,308,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,000	2,324.00	9,296,000	
コネクシオ	3,000	1,391.00	4,173,000	
日本通信	35,100	173.00	6,072,300	
日本電信電話	441,900	3,330.00	1,471,527,000	
ＫＤＤＩ	308,000	3,793.00	1,168,244,000	
ソフトバンク	639,800	1,472.00	941,785,600	
光通信	5,000	14,190.00	70,950,000	
エムティーアイ	4,800	474.00	2,275,200	
GMOインターネット	15,000	2,463.00	36,945,000	
ファイバーゲート	2,500	1,292.00	3,230,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	10,500	287.00	3,013,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	23,100	2,509.00	57,957,900	
学研ホールディングス	6,000	1,001.00	6,006,000	
ゼンリン	6,900	1,074.00	7,410,600	
インプレスホールディングス	13,500	202.00	2,727,000	
東京電力ホールディングス	322,200	367.00	118,247,400	
中部電力	131,700	1,136.00	149,611,200	
関西電力	163,100	1,160.00	189,196,000	
中国電力	67,300	905.00	60,906,500	
北陸電力	39,400	558.00	21,985,200	
東北電力	100,800	739.00	74,491,200	
四国電力	38,800	814.00	31,583,200	
九州電力	88,700	845.00	74,951,500	
北海道電力	37,400	506.00	18,924,400	
沖縄電力	9,100	1,417.00	12,894,700	
電源開発	36,700	1,852.00	67,968,400	
エフオン	2,600	536.00	1,393,600	
イーレックス	6,300	1,664.00	10,483,200	
レノバ	8,400	1,347.00	11,314,800	
東京瓦斯	82,500	2,323.00	191,647,500	
大阪瓦斯	78,000	2,111.00	164,658,000	

東邦瓦斯	19,800	2,992.00	59,241,600	
北海道瓦斯	2,100	1,511.00	3,173,100	
広島ガス	8,200	349.00	2,861,800	
西部ガスホールディングス	4,800	2,237.00	10,737,600	
静岡ガス	11,200	845.00	9,464,000	
メタウォーター	4,500	2,042.00	9,189,000	
アイネット	2,200	1,265.00	2,783,000	
松竹	2,800	11,680.00	32,704,000	
東宝	24,900	4,775.00	118,897,500	
エイチ・アイ・エス	9,100	2,034.00	18,509,400	
東映	1,400	17,120.00	23,968,000	
ラックランド	1,200	2,820.00	3,384,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	112,500	2,133.00	239,962,500	
共立メンテナンス	7,300	4,395.00	32,083,500	
イチネンホールディングス	4,200	1,301.00	5,464,200	
建設技術研究所	2,500	2,320.00	5,800,000	
スペース	3,200	945.00	3,024,000	
アインホールディングス	6,200	6,470.00	40,114,000	
ピー・シー・エー	2,500	1,420.00	3,550,000	
東京テアトル	2,400	1,237.00	2,968,800	
タナベ経営	4,400	642.00	2,824,800	
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	1,501.00	2,251,500	
ナガワ	1,300	9,680.00	12,584,000	
東京都競馬	3,100	4,050.00	12,555,000	
カナモト	7,200	2,308.00	16,617,600	
ＤＴＳ	8,100	2,726.00	22,080,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	19,700	5,540.00	109,138,000	
シーイーシー	4,500	1,090.00	4,905,000	
カプコン	39,800	2,819.00	112,196,200	
西尾レントオール	3,800	2,811.00	10,681,800	
アイ・エス・ビー	2,900	980.00	2,842,000	
日本空港ビルデング	16,200	5,550.00	89,910,000	
トランス・コスモス	5,200	3,155.00	16,406,000	
乃村工藝社	17,600	946.00	16,649,600	
ジャステック	2,900	1,047.00	3,036,300	
ＳＣＳＫ	29,200	1,913.00	55,859,600	
藤田観光	1,800	2,399.00	4,318,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	2,600	1,505.00	3,913,000	
日本管財	4,400	2,800.00	12,320,000	
トーカイ	3,600	1,870.00	6,732,000	
セコム	40,500	8,744.00	354,132,000	
日本システムウエア	1,600	2,088.00	3,340,800	
セントラル警備保障	2,000	2,360.00	4,720,000	
アイネス	3,800	1,526.00	5,798,800	
丹青社	8,400	727.00	6,106,800	
メイテック	5,000	6,950.00	34,750,000	
ＴＫＣ	7,100	3,040.00	21,584,000	
富士ソフト	4,500	5,530.00	24,885,000	
応用地質	4,600	2,066.00	9,503,600	

船井総研ホールディングス	8,400	2,182.00	18,328,800	
ＮＳＤ	13,600	2,137.00	29,063,200	
進学会ホールディングス	10,700	365.00	3,905,500	
丸紅建材リース	1,700	1,760.00	2,992,000	
コナミホールディングス	15,300	6,820.00	104,346,000	
学究社	1,900	1,644.00	3,123,600	
ベネッセホールディングス	13,700	2,358.00	32,304,600	
イオンディライト	5,100	3,040.00	15,504,000	
ナック	3,100	985.00	3,053,500	
福井コンピュータホールディングス	1,900	3,040.00	5,776,000	
ダイセキ	7,500	4,420.00	33,150,000	
ステップ	1,600	1,846.00	2,953,600	
日鉄物産	3,000	5,330.00	15,990,000	
泉州電業	1,200	6,260.00	7,512,000	
元気寿司	1,200	2,600.00	3,120,000	
トラスコ中山	8,800	2,533.00	22,290,400	
ヤマダホールディングス	155,000	406.00	62,930,000	
オートバックスセブン	14,300	1,429.00	20,434,700	
モリト	4,100	731.00	2,997,100	
アークランドサカモト	6,600	1,544.00	10,190,400	
ニトリホールディングス	16,800	16,525.00	277,620,000	
グルメ杵屋	3,400	1,044.00	3,549,600	
愛眼	17,000	185.00	3,145,000	
吉野家ホールディングス	14,800	2,395.00	35,446,000	
加藤産業	6,100	3,125.00	19,062,500	
イノテック	2,600	1,429.00	3,715,400	
イエローハット	7,400	1,628.00	12,047,200	
松屋フーズホールディングス	2,000	3,650.00	7,300,000	
ＪＢＣＣホールディングス	2,900	1,446.00	4,193,400	
ＪＫホールディングス	3,400	1,059.00	3,600,600	
サガミホールディングス	6,500	1,221.00	7,936,500	
日伝	3,500	2,235.00	7,822,500	
関西フードマーケット	3,200	1,108.00	3,545,600	
ミロク情報サービス	3,700	1,396.00	5,165,200	
北沢産業	12,500	231.00	2,887,500	
杉本商事	2,000	2,156.00	4,312,000	
因幡電機産業	11,300	2,621.00	29,617,300	
王将フードサービス	2,800	6,040.00	16,912,000	
プレナス	4,700	1,996.00	9,381,200	
ミニストップ	3,100	1,434.00	4,445,400	
アークス	8,100	2,192.00	17,755,200	
バローホールディングス	9,400	2,194.00	20,623,600	
東テク	1,400	2,435.00	3,409,000	
ミスミグループ本社	53,200	3,605.00	191,786,000	
ベルク	1,900	5,310.00	10,089,000	
タキヒヨー	1,900	1,275.00	2,422,500	
ファーストリテイリング	5,700	64,410.00	367,137,000	
ソフトバンクグループ	253,300	5,160.00	1,307,028,000	
蔵王産業	1,500	1,889.00	2,833,500	
スズケン	16,600	3,605.00	59,843,000	

サンドラッグ	15,900	3,200.00	50,880,000	
サックスバー　ホールディングス	5,700	511.00	2,912,700	
ジェコス	3,600	828.00	2,980,800	
ヤマザワ	1,800	1,660.00	2,988,000	
やまや	1,200	2,564.00	3,076,800	
ベルーナ	9,100	727.00	6,615,700	
合計	47,173,100		112,497,641,670	

（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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	2,278,472,998円
Ⅱ　負債総額	14,611,670円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,263,861,328円
Ⅳ　発行済数量	1,391,349,147口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6271円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	116,211,098,702円
Ⅱ　負債総額	480,308,579円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	115,730,790,123円
Ⅳ　発行済数量	54,533,059,104口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1222円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2022年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後1年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年2月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	431	66,731
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	141	25,376
単位型公社債投資信託	0	0
合計	572	92,108

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

３【委託会社等の経理状況】

１．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962
当期変動額										
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	①　満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②　その他有価証券 時価のあるもの …決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 時価のないもの …移動平均法に基づく原価法によっております。 ③　関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①　賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。 ②　退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。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。 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。 ③　役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

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

①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

①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

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

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
①現金・預金	28,674,230	28,674,230	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
③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
①その他未払金	3,591,122	3,591,122	―
負債計	3,591,122	3,591,122	―
①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△で示しております。

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
①現金・預金	40,822,894	40,822,894	－
②有価証券			
満期保有目的の債券	－	－	－
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	15,018,123	15,023,675	5,551
その他有価証券	22,039,919	22,039,919	－
資産計	77,880,937	77,886,489	5,551
①その他未払金	4,839,326	4,839,326	－
負債計	4,839,326	4,839,326	－
①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

①現金・預金

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

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

負　債

①その他未払金

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

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

（注）投資信託受益証券であります。

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）
①現金・預金	40,822,894	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	―	15,020,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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		8,418,909
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		2,340,315
負債合計		10,759,224
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		51,534,686
利益剰余金合計		52,214,493
株主資本合計		70,496,333
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		917,831
純資産合計		71,414,165
負債・純資産合計		82,173,390

(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									
	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	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	①満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②その他有価証券 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。 ③関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 ②退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当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。 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。 ③役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

５．収益及び費用の計上基準	**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。** **①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。** **②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。** **③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。**
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	**外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。**
７．ヘッジ会計の方法	**①ヘッジ会計の方法** **繰延ヘッジ処理によっております。** **②ヘッジ手段とヘッジ対象** **ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。** **ヘッジ手段・・・為替予約** **ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券** **③ヘッジ方針** **ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。** **④ヘッジ有効性評価の方法** **ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。**
８．連結納税制度	**日本生命保険相互会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日　企業会計基準委員会　実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。**

（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
①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	－	－	－
②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	－
③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△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	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③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	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③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	5,929,426千円
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。

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

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

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

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

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

5【その他】

① 定款の変更等

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。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

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
岡三証券株式会社	5,000	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。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、損害保険業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,400,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

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」の運用に関する投資助言を行います。

３【資本関係】

（１）日本生命保険相互会社（販売会社）は、委託会社の株式を108,448株（持株比率100%）保有しています。

（２）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5月20日	**有価証券報告書**
	有価証券届出書
2021年11月19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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年3月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政　印

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣニッセイ国内株式インデックスの2021年2月23日から2022年2月21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、ＤＣニッセイ国内株式インデックスの2022年2月21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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。