

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月18日提出
【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
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型） ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	継続募集額 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

上記ファンドの愛称として、ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)を「かいましジャパン(安定型)」、ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)を「かいましジャパン(積極型)」ということがあります。

以下、上記のそれぞれをまたは総称して、「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります。また、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)を「安定型」、ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)を「積極型」ということがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます)。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

委託会社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

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

なお、委託会社へは後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5)【申込手数料】

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

手数料率は変更となる場合があります。

申込手数料につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2022年11月19日（土）～ 2023年5月19日（金）

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(9) 【払込期日】

取得申込者は、各販売会社が定める期日（詳しくは販売会社にお問合せください）までに、申込代金を各販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を経由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

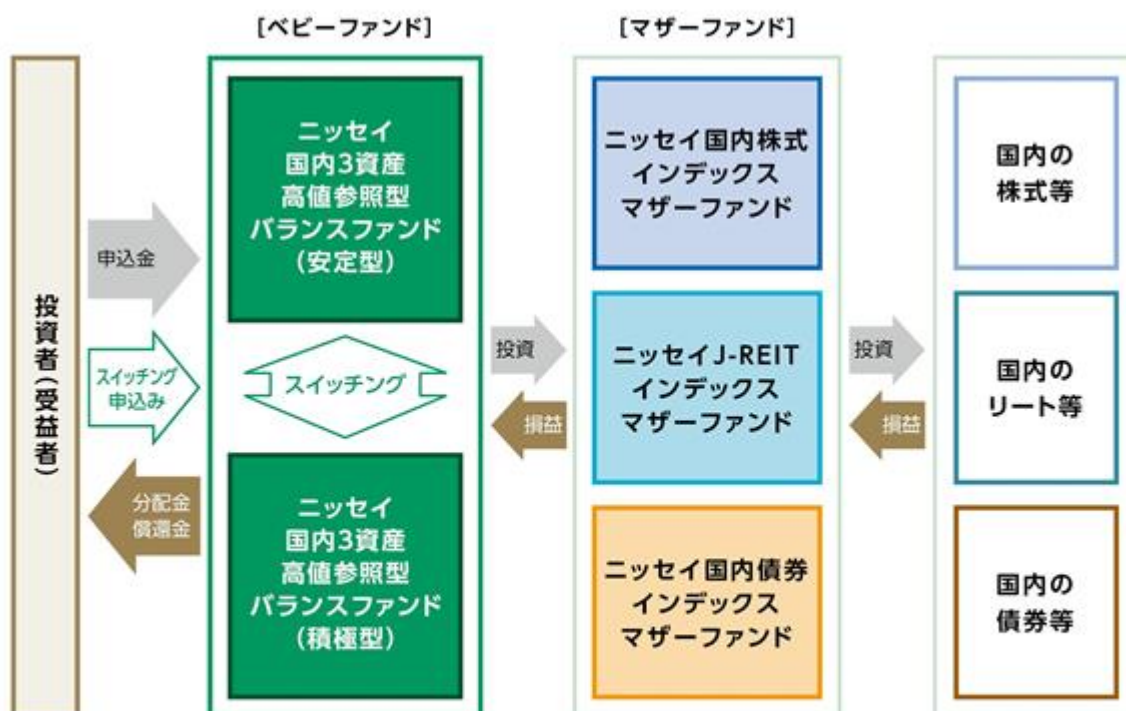
ファンドは、安定した収益の確保および信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



•「安定型」と「積極型」との間でスイッチングが可能です。

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

ファンドの特色

1 国内の株式・リート・債券に投資します。

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

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

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

3 「安定型」と「積極型」の2つのファンドから選択いただけます。

- 各資産の組入比率は、以下の範囲をめどに調整します。

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

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

〈資産配分変更プロセス〉



「買い増し」:

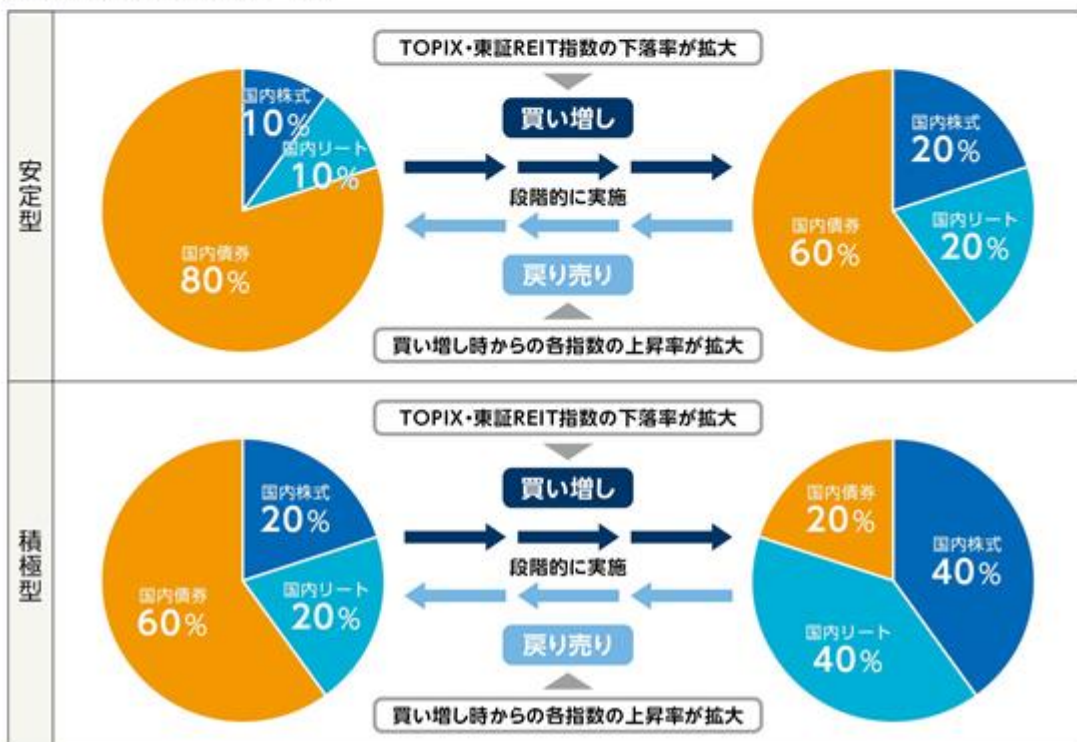
2020年10月1日(当ファンドの設定日)以降のTOPIX・東証REIT指数の最高値(日次、終値)から各月末の終値までの下落率を参照し、それぞれ下落率の水準に応じて段階的に国内株式・国内リートの組入比率を引き上げ

「戻り売り」:

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

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

〈資産配分変更のイメージ〉



・上記はイメージであり、実際の資産配分とは異なります。

〈各指数について〉**●TOPIX(東証株価指数)**

TOPIX(東証株価指数)とは、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株式会社JPX総研が算出する株価指数です。

TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、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準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。

●東証REIT指数

東証REIT指数とは、東証市場に上場する不動産投資信託(Real Estate Investment Trust)全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。

東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、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準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。

●NOMURA-BPI総合

日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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

ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

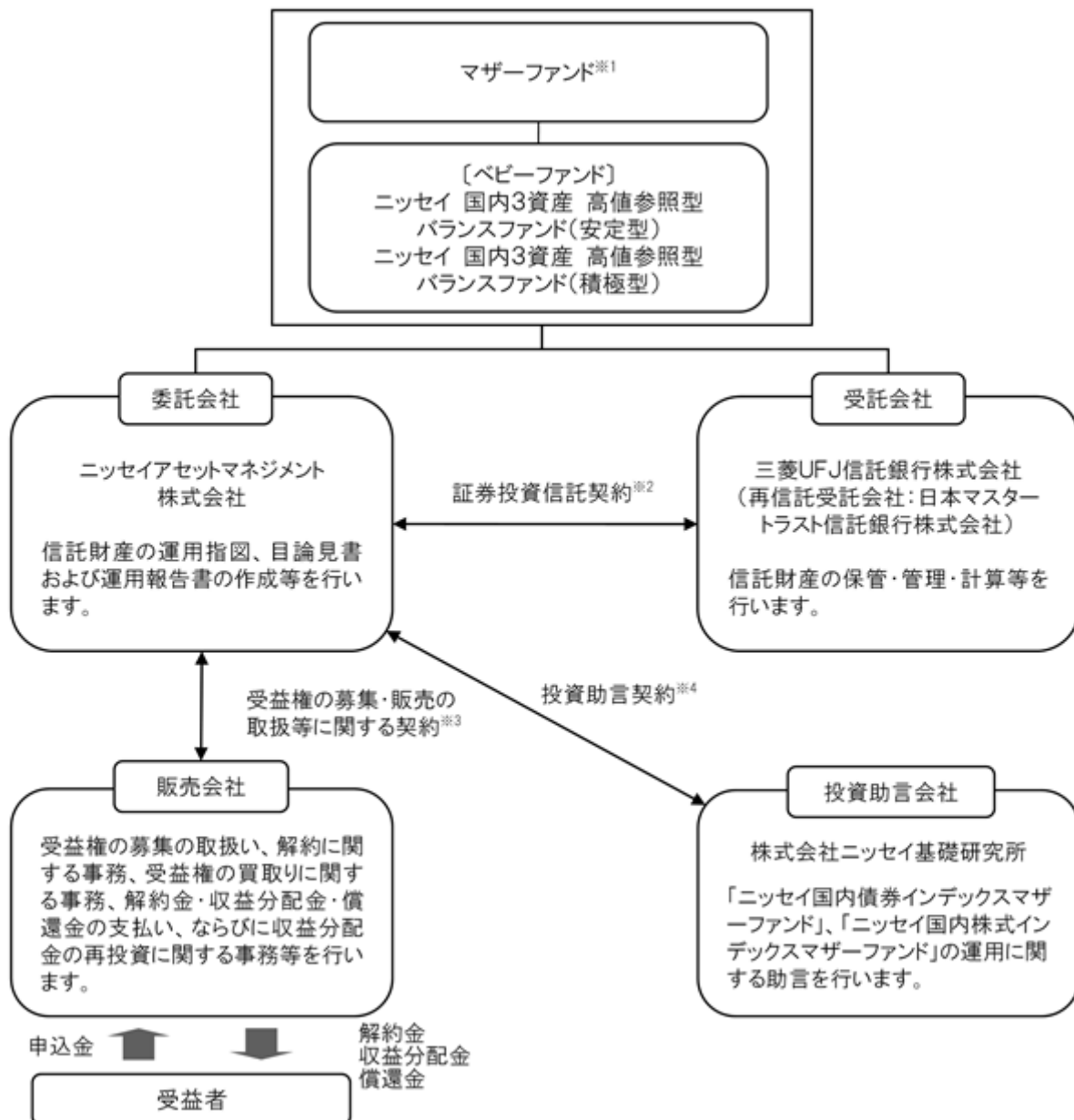
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 不動産投信・債券) 資産配分変更型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2020年10月1日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2022年8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】

「安定型」

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

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

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

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

各マザーファンドへの投資比率のレンジは概ね以下の割合とします。

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

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

マザーファンド	インデックス
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

「積極型」

（「安定型」のと同規定）

ファンド設定当初の各マザーファンドへの投資比率は以下の割合とします。

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

（「安定型」のと同規定）

各マザーファンドへの投資比率のレンジは概ね以下の割合とします。

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

(「安定型」のと同規定)

(「安定型」のと同規定)

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りです。

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

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

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

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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

金融商品

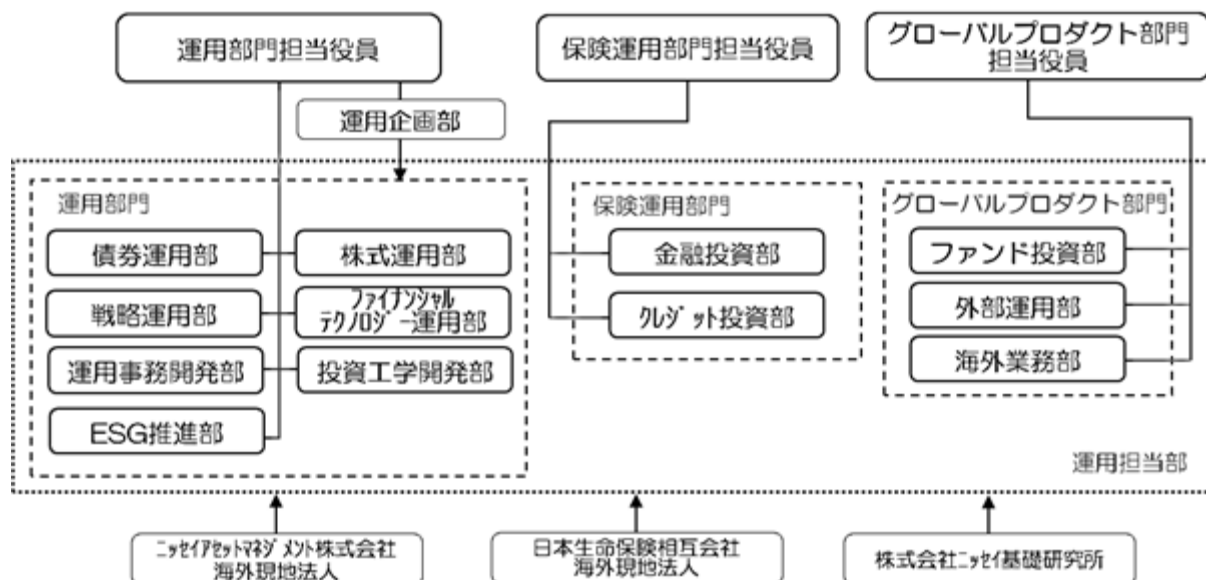
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

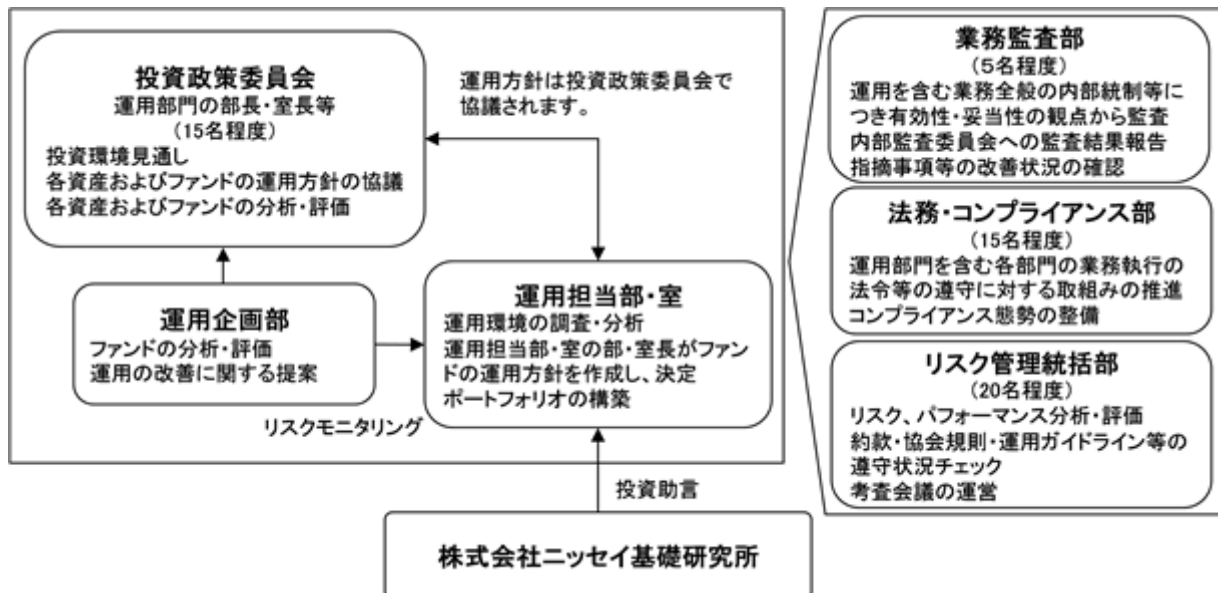
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

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

2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。

3. 留保益の運用方針

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

分配時期

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

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

投資対象資産は、本邦通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

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

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

金利先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

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

有価証券の空売り

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

有価証券の借入れ

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

資金の借入れ

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

3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

J-REITの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・流動性リスク

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

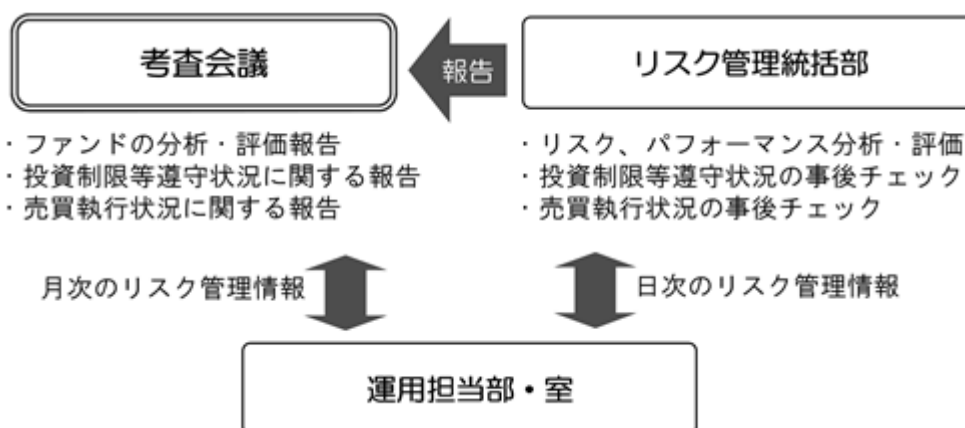
委託会社は2022年2月21日現在、各ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の100%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・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ある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、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け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。

●ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)

①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



●ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の年間騰落率のデータが5年分に満たないため、実在するデータのみの記載となっています。したがって、**グラフ②**においては、**代表的な資産クラスとの比較対象期間が異なりますのでご注意ください。**

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に於けるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または高標は、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高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・ディバースィファイドは、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】

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

手数料率は変更となる場合があります。

分配金再投資コースで収益分配金を再投資する場合、手数料はかかりません。

償還乗換優遇および換金乗換優遇を受けられる場合があります。

スイッチングの際の申込手数料は、販売会社が定めるものとします。

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

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

・表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

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

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

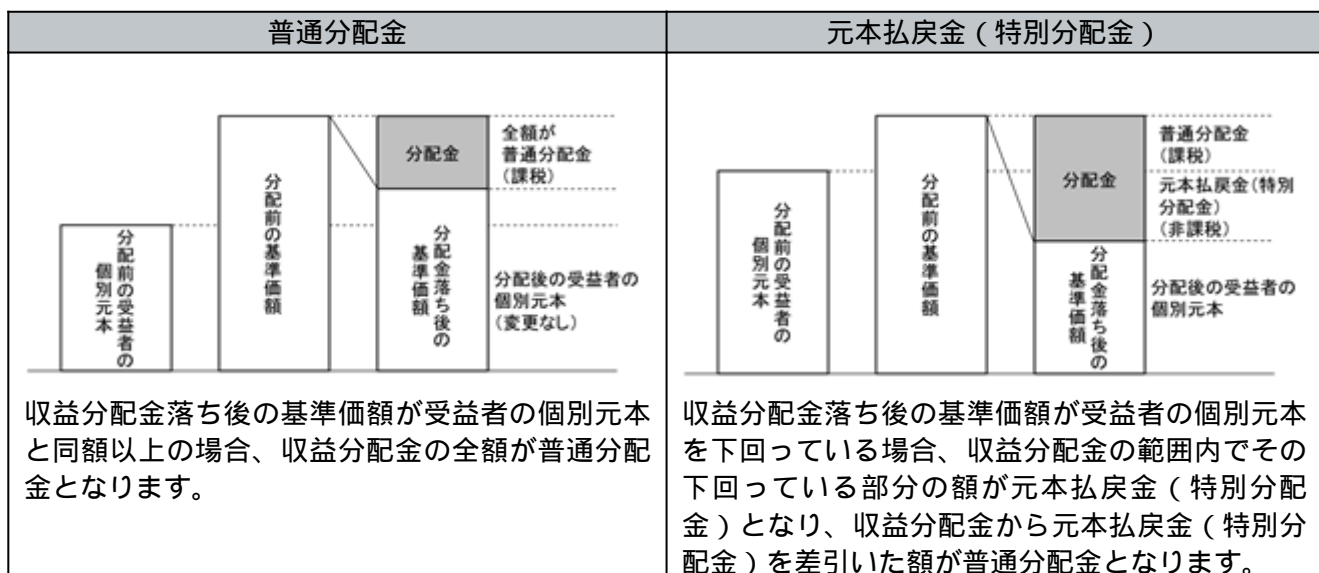
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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



投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

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)

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,026,984	100.00
内 日本	1,026,984	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	18	0.00
純資産総額	1,026,966	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,092,943	100.00
内 日本	1,092,943	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	23	0.00
純資産総額	1,092,920	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)

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	58,663,556,570	98.93
内 日本	58,663,556,570	98.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	633,439,463	1.07
純資産総額	59,296,996,033	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	190,819,700,990	97.89
内 日本	190,819,700,990	97.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,116,960,716	2.11
純資産総額	194,936,661,706	100.00

その他資産の投資状況

2022年8月31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)	3,767,040,000	1.93
内 日本	3,767,040,000	1.93

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	32,266,738,200	98.18
内 日本	32,266,738,200	98.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	597,203,943	1.82
純資産総額	32,863,942,143	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

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)

2022年8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	509,598	1.3504 688,169	1.3372 681,434	- -	66.35
2	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	87,906	1.8048 158,657	1.9786 173,930	- -	16.94
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	76,695	2.1471 164,679	2.2377 171,620	- -	16.71

(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8月31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。

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)

2022年8月31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J-REITインデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	186,202	1.8050 336,112	1.9786 368,419	- -	33.71
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	162,434	2.1474 348,812	2.2377 363,478	- -	33.26
3	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	270,002	1.3501 364,534	1.3372 361,046	- -	33.03

（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8月31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）

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	4,078,000,000	99.80 4,070,135,990	99.40 4,053,695,120	0.1 2030/3/20	6.84
2	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,795,000,000	100.33 3,807,717,890	100.64 3,819,288,000	0.1 2026/3/20	6.44
3	第152回 利付国債(20年) 日本	国債証券	3,447,000,000	110.49 3,808,689,310	109.49 3,774,223,710	1.2 2035/3/20	6.36
4	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,430,000,000	101.24 3,472,638,890	101.26 3,473,355,200	0.4 2025/3/20	5.86
5	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,206,000,000	100.23 3,213,619,590	100.30 3,215,746,240	0.1 2028/3/20	5.42
6	第354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,186,000,000	100.01 3,186,514,230	100.03 3,187,019,520	0.1 2029/3/20	5.37
7	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,080,000,000	100.50 3,095,680,920	100.54 3,096,816,800	0.1 2027/3/20	5.22
8	第94回 利付国債(20年) 日本	国債証券	2,708,000,000	110.06 2,980,623,660	109.65 2,969,322,000	2.1 2027/3/20	5.01
9	第4回 利付国債(40年) 日本	国債証券	2,262,000,000	133.62 3,022,572,970	125.25 2,833,335,960	2.2 2051/3/20	4.78
10	第362回 利付国債(10年) 日本	国債証券	2,852,000,000	99.17 2,828,526,970	99.07 2,825,647,520	0.1 2031/3/20	4.77
11	第143回 利付国債(20年) 日本	国債証券	2,456,000,000	114.01 2,800,099,830	113.64 2,790,998,400	1.6 2033/3/20	4.71
12	第434回 利付国債(2年) 日本	国債証券	2,027,000,000	100.14 2,030,007,640	100.16 2,030,324,280	0.005 2024/3/1	3.42

13	第38回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,688,000,000	121.34 2,048,237,400	117.23 1,978,893,040	1.8 2043/3/20	3.34
14	第70回 利付国債(30年) 日本	国債証券	2,014,000,000	93.57 1,884,555,220	88.80 1,788,452,140	0.7 2051/3/20	3.02
15	第141回 利付国債(5年) 日本	国債証券	1,635,000,000	100.40 1,641,540,000	100.40 1,641,540,000	0.1 2024/9/20	2.77
16	第30回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,242,000,000	128.29 1,593,443,160	125.11 1,553,977,980	2.3 2039/3/20	2.62
17	第134回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,225,000,000	115.65 1,416,747,320	114.99 1,408,627,500	1.8 2032/3/20	2.38
18	第176回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,448,000,000	95.28 1,379,704,360	94.69 1,371,183,600	0.5 2041/3/20	2.31
19	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,288,000,000	101.49 1,307,294,240	101.49 1,307,307,120	0.4 2025/9/20	2.20
20	第160回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,254,000,000	102.55 1,286,097,380	102.02 1,279,330,800	0.7 2037/3/20	2.16
21	第46回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,055,000,000	113.34 1,195,747,050	110.93 1,170,353,700	1.5 2045/3/20	1.97
22	第72回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,103,000,000	105.38 1,162,359,040	104.50 1,152,657,060	2.1 2024/9/20	1.94
23	第433回 利付国債(2年) 日本	国債証券	1,075,000,000	100.10 1,076,110,200	100.16 1,076,752,250	0.005 2024/2/1	1.82
24	第34回 利付国債(30年) 日本	国債証券	865,000,000	128.04 1,107,613,500	123.91 1,071,838,800	2.2 2041/3/20	1.81
25	第333回 利付国債(10年) 日本	国債証券	973,000,000	101.27 985,422,560	101.08 983,557,050	0.6 2024/3/20	1.66
26	第12回 利付国債(40年) 日本	国債証券	1,015,000,000	86.25 875,463,660	79.00 801,890,600	0.5 2059/3/20	1.35
27	第168回 利付国債(20年) 日本	国債証券	816,000,000	96.99 791,479,800	95.48 779,116,800	0.4 2039/3/20	1.31
28	第18回 利付国債(30年) 日本	国債証券	440,000,000	124.41 547,431,930	122.92 540,852,400	2.3 2035/3/20	0.91
29	第8回 利付国債(40年) 日本	国債証券	445,000,000	114.09 507,706,970	104.92 466,920,700	1.4 2055/3/20	0.79

30	第125回 利付国債（20年） 日本	国債証券	142,000,000	118.21 167,866,500	116.85 165,936,940	2.2 2031/3/20	0.28
----	-----------------------	------	-------------	-----------------------	-----------------------	------------------	------

（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8月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	98.93
	小計		98.93
合計（対純資産総額比）			98.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2022年8月31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	3,464,100	2,148.19 7,441,558,415	2,101.50 7,279,806,150	- -	3.73
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	476,000	11,647.42 5,544,172,577	11,135.00 5,300,260,000	- -	2.72
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	68,900	50,574.94 3,484,613,648	52,840.00 3,640,676,000	- -	1.87
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,386,800	741.09 3,251,035,806	721.10 3,163,321,480	- -	1.62
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	835,800	3,612.54 3,019,365,613	3,769.00 3,150,130,200	- -	1.62
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	365,500	6,254.18 2,285,903,073	6,996.00 2,557,038,000	- -	1.31
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	447,100	5,143.93 2,299,853,169	5,562.00 2,486,770,200	- -	1.28
8	任天堂 日本	株式 その他製品	42,900	58,435.11 2,506,866,375	56,990.00 2,444,871,000	- -	1.25
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	520,100	4,469.58 2,324,629,607	4,483.00 2,331,608,300	- -	1.20
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	543,600	4,091.66 2,224,228,815	4,277.00 2,324,977,200	- -	1.19
11	第一三共 日本	株式 医薬品	551,200	2,837.92 1,564,265,381	4,197.00 2,313,386,400	- -	1.19
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	597,300	3,588.72 2,143,544,885	3,850.00 2,299,605,000	- -	1.18
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	490,700	4,161.86 2,042,229,493	4,564.00 2,239,554,800	- -	1.15

14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	48,200	53,647.01 2,585,785,901	44,160.00 2,128,512,000	- -	1.09
15	HOYA 日本	株式 精密機器	146,700	13,966.57 2,048,896,970	14,250.00 2,090,475,000	- -	1.07
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	555,600	3,507.75 1,948,906,003	3,724.00 2,069,054,400	- -	1.06
17	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	486,400	4,160.85 2,023,840,837	4,194.00 2,039,961,600	- -	1.05
18	ダイキン工業 日本	株式 機械	83,000	20,851.38 1,730,664,705	24,485.00 2,032,255,000	- -	1.04
19	信越化学工業 日本	株式 化学	118,000	17,209.86 2,030,763,654	16,315.00 1,925,170,000	- -	0.99
20	三井物産 日本	株式 卸売業	542,400	3,096.15 1,679,356,516	3,266.00 1,771,478,400	- -	0.91
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,129,400	1,480.90 1,672,529,574	1,529.50 1,727,417,300	- -	0.89
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	448,700	3,779.66 1,695,937,272	3,843.00 1,724,354,100	- -	0.88
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	208,600	7,174.85 1,496,674,885	7,792.00 1,625,411,200	- -	0.83
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	77,200	20,130.05 1,554,040,102	20,850.00 1,609,620,000	- -	0.83
25	日本電産 日本	株式 電気機器	168,800	9,228.79 1,557,820,083	9,324.00 1,573,891,200	- -	0.81
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	207,300	7,934.89 1,644,902,715	7,554.00 1,565,944,200	- -	0.80
27	ファナック 日本	株式 電気機器	66,700	21,146.78 1,410,490,645	22,535.00 1,503,084,500	- -	0.77
28	S M C 日本	株式 機械	22,300	65,362.77 1,457,589,867	66,600.00 1,485,180,000	- -	0.76
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	898,600	1,569.30 1,410,174,850	1,593.50 1,431,919,100	- -	0.73
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	251,000	5,514.84 1,384,225,245	5,533.00 1,388,783,000	- -	0.71

(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8月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	電気機器	17.12
		情報・通信業	8.86
		輸送用機器	7.88
		化学	6.03
		卸売業	5.64
		サービス業	5.30
		機械	5.25
		医薬品	5.21

	銀行業	5.10
	小売業	4.31
	食料品	3.30
	陸運業	3.04
	精密機器	2.79
	その他製品	2.36
	保険業	2.16
	建設業	2.14
	不動産業	1.90
	電気・ガス業	1.25
	その他金融業	1.13
	鉄鋼	0.80
	非鉄金属	0.73
	ゴム製品	0.72
	証券、商品先物取引業	0.71
	ガラス・土石製品	0.71
	海運業	0.67
	金属製品	0.59
	石油・石炭製品	0.53
	繊維製品	0.46
	空運業	0.44
	鉱業	0.31
	パルプ・紙	0.18
	倉庫・運輸関連業	0.16
	水産・農林業	0.10
	小計	97.89
合計（対純資産総額比）		97.89

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,330	674,633.26 2,246,528,756	694,000.00 2,311,020,000	- -	7.03
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,855	629,153.71 1,796,233,846	645,000.00 1,841,475,000	- -	5.60
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	4,678	344,509.88 1,611,617,241	350,500.00 1,639,639,000	- -	4.99
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,404	101,441.91 1,461,169,296	110,600.00 1,593,082,400	- -	4.85
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	9,232	164,313.26 1,516,940,073	170,200.00 1,571,286,400	- -	4.78
6	GLP投資法人 日本	投資証券	8,791	168,004.12 1,476,924,254	169,900.00 1,493,590,900	- -	4.54
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,303	308,683.13 1,328,263,542	322,000.00 1,385,566,000	- -	4.22
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,688	184,178.65 1,047,608,211	191,500.00 1,089,252,000	- -	3.31

9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,854	340,961.60 973,104,429	368,000.00 1,050,272,000	- -	3.20
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,426	141,146.02 907,004,361	148,200.00 952,333,200	- -	2.90
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,952	384,665.73 750,867,515	412,500.00 805,200,000	- -	2.45
12	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,266	182,571.57 778,850,350	183,800.00 784,090,800	- -	2.39
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,675	76,023.89 659,507,298	84,400.00 732,170,000	- -	2.23
14	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	986	636,912.17 627,995,405	683,000.00 673,438,000	- -	2.05
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,507	403,877.89 608,643,994	432,500.00 651,777,500	- -	1.98
16	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,925	309,764.27 596,296,234	330,500.00 636,212,500	- -	1.94
17	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,206	65,241.44 600,612,752	68,800.00 633,372,800	- -	1.93
18	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	1,128	531,944.80 600,033,740	545,000.00 614,760,000	- -	1.87
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	839	658,726.00 552,671,122	720,000.00 604,080,000	- -	1.84
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,495	173,784.61 607,377,230	172,100.00 601,489,500	- -	1.83
21	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,059	500,069.52 529,573,624	533,000.00 564,447,000	- -	1.72
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,565	41,750.67 524,597,193	42,900.00 539,038,500	- -	1.64
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,357	146,845.89 492,961,669	156,400.00 525,034,800	- -	1.60
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,160	146,781.64 463,829,984	157,200.00 496,752,000	- -	1.51
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	3,862	114,384.37 441,752,468	124,300.00 480,046,600	- -	1.46
26	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	2,047	207,475.36 424,702,070	226,100.00 462,826,700	- -	1.41
27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,328	324,680.73 431,176,010	341,500.00 453,512,000	- -	1.38

28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,671	155,405.55	166,000.00	-	1.35
				415,088,238	443,386,000	-	
29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	881	450,937.28	478,500.00	-	1.28
				397,275,745	421,558,500	-	
30	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	597	712,547.07	704,000.00	-	1.28
				425,390,601	420,288,000	-	

(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8月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	国内		98.18
	小計		98.18
合計(対純資産総額比)			98.18

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

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

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

(参考)

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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

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

（参考）

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物 0 409月	買建	192	3,610,780,600	3,767,040,000	1.93

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)

直近日(2022年8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 (2021年2月22日)	1,026,248	1,026,248	1.0262	1.0262
第2計算期間末 (2022年2月21日)	1,013,962	1,013,962	1.0140	1.0140
2021年8月末日	1,046,533	-	1.0465	-
9月末日	1,046,210	-	1.0462	-
10月末日	1,045,048	-	1.0450	-
11月末日	1,035,461	-	1.0355	-
12月末日	1,042,469	-	1.0425	-
2022年1月末日	1,022,309	-	1.0223	-
2月末日	1,012,321	-	1.0123	-
3月末日	1,028,631	-	1.0286	-
4月末日	1,020,341	-	1.0203	-
5月末日	1,023,104	-	1.0231	-
6月末日	1,009,663	-	1.0097	-
7月末日	1,024,995	-	1.0250	-
8月末日	1,026,966	-	1.0270	-

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)

直近日(2022年8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 (2021年2月22日)	1,063,116	1,063,116	1.0631	1.0631
第2計算期間末 (2022年2月21日)	1,052,312	1,052,312	1.0523	1.0523
2021年8月末日	1,097,955	-	1.0980	-
9月末日	1,101,460	-	1.1015	-
10月末日	1,100,629	-	1.1006	-
11月末日	1,078,359	-	1.0784	-
12月末日	1,096,166	-	1.0962	-
2022年1月末日	1,062,047	-	1.0620	-
2月末日	1,047,016	-	1.0470	-
3月末日	1,083,946	-	1.0839	-
4月末日	1,069,692	-	1.0697	-
5月末日	1,077,637	-	1.0776	-
6月末日	1,060,263	-	1.0603	-
7月末日	1,085,942	-	1.0859	-
8月末日	1,092,920	-	1.0929	-

【分配の推移】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
2022年2月22日～2022年8月21日	-

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
2022年2月22日～2022年8月21日	-

【収益率の推移】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）

	収益率（％）
第1計算期間	2.6
第2計算期間	1.2
2022年2月22日～2022年8月21日	1.9

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しています（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。）。

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）

	収益率（％）
第1計算期間	6.3
第2計算期間	1.0
2022年2月22日～2022年8月21日	4.5

（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】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）

	設定口数	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	0	0	1,000,000
2022年2月22日～ 2022年8月21日	0	0	1,000,000

（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。

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

	設定口数	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	0	0	1,000,000
2022年2月22日 ~ 2022年8月21日	0	0	1,000,000

(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8月末現在

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)

●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,270円
純資産総額	102万円

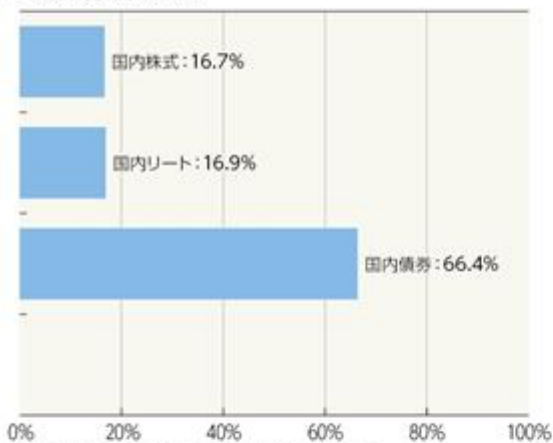
●分配の推移 1万円当り(税引前)

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。

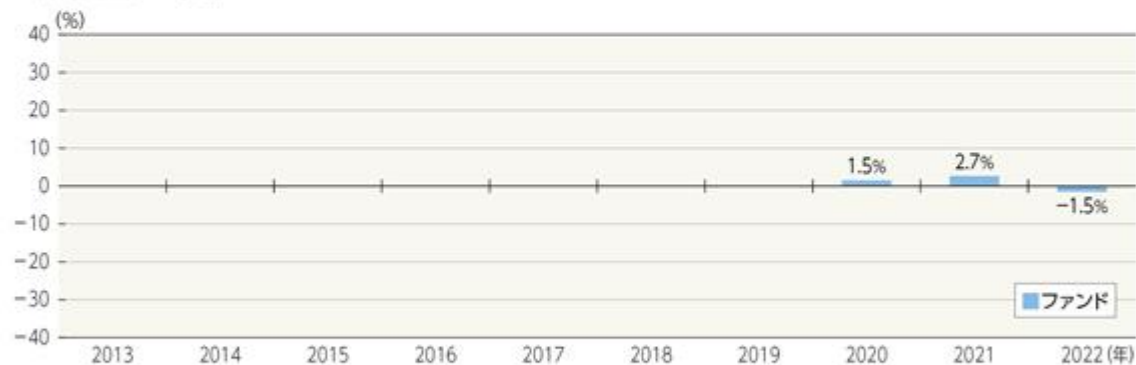
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2020年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2022年8月末現在

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)

●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,929円
純資産総額	109万円

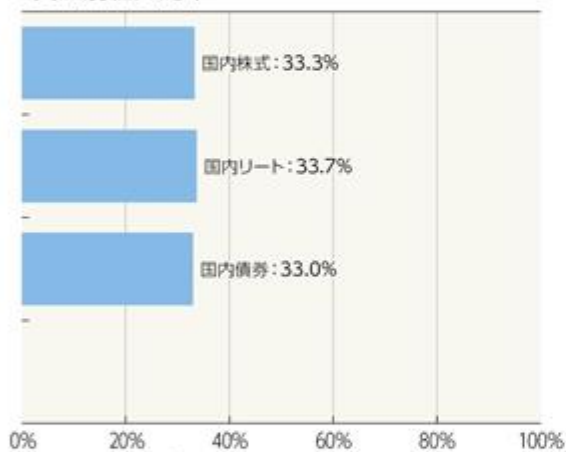
●分配の推移 1万口当り(税引前)

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。

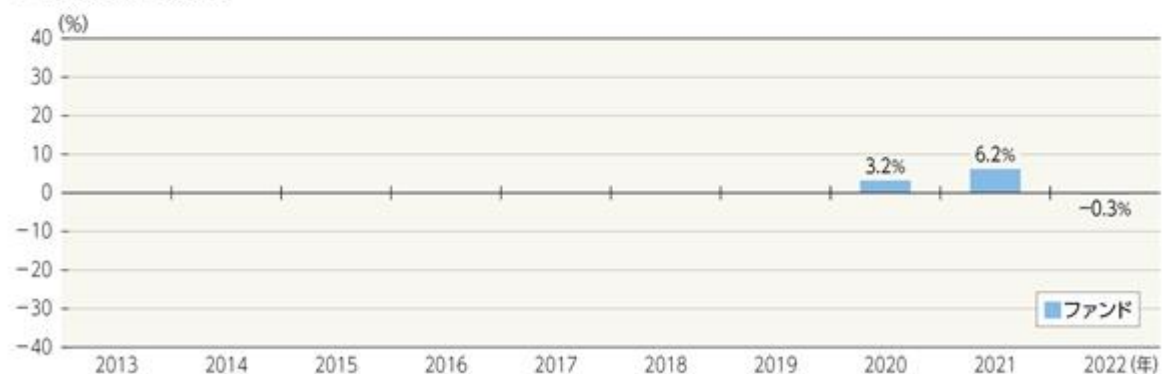
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

・2020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。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2022年8月末現在

3.運用実績

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.8%
2	ソニーグループ	2.8%
3	キーエンス	1.9%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.7%
5	日本電信電話	1.7%

・比率は対組入株式評価額比です。

2. ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.7%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.1%
4	日本都市ファンド投資法人	4.9%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.9%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

3. ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第358回 利付国債(10年)	2030/03/20	0.100%	6.9%
2	第342回 利付国債(10年)	2026/03/20	0.100%	6.5%
3	第152回 利付国債(20年)	2035/03/20	1.200%	6.4%
4	第338回 利付国債(10年)	2025/03/20	0.400%	5.9%
5	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	5.5%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	情報・通信業	9.1%
3	輸送用機器	8.0%
4	化学	6.2%
5	卸売業	5.8%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.2%
短期金融資産等	1.8%

・比率は対純資産総額比です。

組入比率

種別	比率
債券	98.9%
債券先物	-
現金、その他	1.1%

・比率は対純資産総額比です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付を行います。

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、申込みの受付を中止することおよび既に受付けた申込みの受付を取消することがあります（スイッチングの場合も含みます）。

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

販売価額

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

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

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

手数料率は変更となる場合があります。

分配金再投資コースで収益分配金を再投資する場合、手数料はかかりません。

償還乗換優遇および換金乗換優遇を受けられる場合があります。

スイッチングの際の申込手数料は、販売会社が定めるものとします。

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

その他

1. ファンドの取得申込者は、販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
2. 定期引出契約とは、分配金再投資コースにおいて、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。
3. 償還乗換優遇とは、償還金の支払いを受けた販売会社で、取得申込みを行う場合に申込手数料の無料または割引等の優遇を受けられることです。それらの措置は販売会社が独自に定めることができます。
4. 換金乗換優遇とは、解約（買取）金の支払いを受けた販売会社で、取得申込みを行う場合に申込手数料の割引等の優遇を受けられることです。それらの措置は販売会社が独自に定めることができます。
5. スwitchingとは、保有しているファンドの換金と同時に乗換えるファンドを購入する取引です。

保有しているファンドの換金の際に税金が差引かれます。税金についての詳細は「第1ファンドの状況 4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご確認ください。

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

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

2【換金(解約)手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

<買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年2月21日から翌年2月20日までとします。

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

(5) 【その他】

繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
 - ・ 受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合
 - ・ この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
 - ・ やむを得ない事情が発生したとき
2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 前記2.から4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記2.から4.までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
6. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更等 2. 」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
9. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。

約款の変更等

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

3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1.から7.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（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。

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（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】

【ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2021年2月22日現在	第2期 2022年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	47	18
コール・ローン	2,427	3,221
親投資信託受益証券	1,026,302	1,014,016
未収入金	54	54
流動資産合計	1,028,830	1,017,309
資産合計	1,028,830	1,017,309
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	51	17
未払委託者報酬	2,531	3,330
流動負債合計	2,582	3,347
負債合計	2,582	3,347
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,248	13,962
（分配準備積立金）	26,248	32,158
元本等合計	1,026,248	1,013,962
純資産合計	1,026,248	1,013,962
負債純資産合計	1,028,830	1,017,309

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2020年10月1日 至 2021年2月22日	第2期 自 2021年2月23日 至 2022年2月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	28,830	5,717
営業収益合計	28,830	5,717
営業費用		
受託者報酬	51	17
委託者報酬	2,531	6,552
営業費用合計	2,582	6,569
営業利益又は営業損失（ ）	26,248	12,286
経常利益又は経常損失（ ）	26,248	12,286
当期純利益又は当期純損失（ ）	26,248	12,286
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	26,248
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,248	13,962

(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2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1期	第2期
	2021年2月22日現在	2022年2月21日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日	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(3,693円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(22,555円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は26,248円(1万口当たり262.48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(5,910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(0円)及び分配準備積立金(26,248円)より分配対象収益は32,158円(1万口当たり321.58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1期	第2期
	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日	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1期 2021年2月22日現在	第2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1期 2021年2月22日現在	第2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	25,299	7,434
合計	25,299	7,434

(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1期 2021年2月22日現在	第2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)	1,0262円 (10,262円)	1,0140円 (10,140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	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	500,042	675,306	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	80,115	172,103	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	92,370	166,607	
親投資信託受益証券 合計		672,527	1,014,016	
合計			1,014,016	

(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。

【ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2021年2月22日現在	第2期 2022年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	55	23
コール・ローン	2,838	4,027
親投資信託受益証券	1,063,182	1,052,378
未収入金	66	66
流動資産合計	1,066,141	1,056,494
資産合計	1,066,141	1,056,494
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	26	89
未払委託者報酬	2,999	4,093
流動負債合計	3,025	4,182
負債合計	3,025	4,182
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	63,116	52,312
（分配準備積立金）	63,116	73,325
元本等合計	1,063,116	1,052,312
純資産合計	1,063,116	1,052,312
負債純資産合計	1,066,141	1,056,494

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2020年10月1日 至 2021年2月22日	第2期 自 2021年2月23日 至 2022年2月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	66,141	2,621
営業収益合計	66,141	2,621
営業費用		
受託者報酬	26	158
委託者報酬	2,999	8,025
営業費用合計	3,025	8,183
営業利益又は営業損失（ ）	63,116	10,804
経常利益又は経常損失（ ）	63,116	10,804
当期純利益又は当期純損失（ ）	63,116	10,804
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	63,116
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	63,116	52,312

(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2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1期	第2期
	2021年2月22日現在	2022年2月21日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日	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(4,928円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(58,188円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は63,116円(1万口当たり631.16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(10,209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(0円)及び分配準備積立金(63,116円)より分配対象収益は73,325円(1万口当たり733.25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1期	第2期
	自 2020年10月1日 至 2021年2月22日	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1期 2021年2月22日現在	第2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1期 2021年2月22日現在	第2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	59,601	5,549
合計	59,601	5,549

(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1期 2021年2月22日現在	第2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)	1.0631円 (10,631円)	1.0523円 (10,523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	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	259,182	350,025	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	166,146	356,914	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	191,517	345,439	
親投資信託受益証券 合計		616,845	1,052,378	
合計			1,052,378	

(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）

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）」、「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）」は、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

ニッセイ国内債券インデックス 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	1,920,622
コール・ローン	343,558,554
国債証券	55,205,871,920
未収利息	143,789,776
前払費用	33,801,840
流動資産合計	55,728,942,712
資産合計	
55,728,942,712	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	75,711,856
その他未払費用	615
流動負債合計	75,712,471
負債合計	
75,712,471	
純資産の部	
元本等	
元本	41,209,892,650
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,443,337,591
元本等合計	55,653,230,241
純資産合計	55,653,230,241
負債純資産合計	55,728,942,712

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	35,069,978,508円
同期中追加設定元本額	14,239,332,079円
同期中一部解約元本額	8,099,417,937円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	1,686,962,749円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,674,854,691円
ニッセイ日本バランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	3,090,575円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	7,607,937,736円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	11,323,415,905円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,148,227,474円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	21,899,977円
ニッセイインデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	30,909,274円
ニッセイインデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	14,343,345円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	6,283,015,079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）	3,412,324,433円
ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド	2,152,188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）	500,042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）	259,182円
計	41,209,892,650円
2. 受益権の総数	41,209,892,650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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	914,381,450
合計	914,381,450

(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)

	2022年2月21日現在
1口当たり純資産額	1.3505円
(1万口当たり純資産額)	(13,505円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第427回 利付国債(2年)	1,428,000,000	1,429,128,120	
	第428回 利付国債(2年)	3,470,000,000	3,472,637,200	
	第137回 利付国債(5年)	1,190,000,000	1,192,808,400	
	第147回 利付国債(5年)	3,349,000,000	3,346,923,620	
	第4回 利付国債(40年)	2,834,000,000	3,801,159,180	
	第5回 利付国債(40年)	2,000,000	2,594,320	
	第8回 利付国債(40年)	572,000,000	656,598,800	
	第11回 利付国債(40年)	60,000,000	58,365,600	
	第12回 利付国債(40年)	708,000,000	619,797,360	
	第328回 利付国債(10年)	382,000,000	384,719,840	
	第330回 利付国債(10年)	143,000,000	144,904,760	
	第333回 利付国債(10年)	908,000,000	919,658,720	
	第335回 利付国債(10年)	518,000,000	524,734,000	
	第338回 利付国債(10年)	1,613,000,000	1,632,549,560	
	第342回 利付国債(10年)	4,198,000,000	4,211,643,500	
	第346回 利付国債(10年)	611,000,000	612,698,580	
	第350回 利付国債(10年)	3,279,000,000	3,286,902,390	
	第354回 利付国債(10年)	1,661,000,000	1,663,325,400	
	第358回 利付国債(10年)	4,197,000,000	4,190,284,800	
	第18回 利付国債(30年)	984,000,000	1,226,132,880	
	第30回 利付国債(30年)	47,000,000	60,211,700	
	第34回 利付国債(30年)	84,000,000	107,459,520	
	第38回 利付国債(30年)	2,363,000,000	2,874,613,130	
	第70回 利付国債(30年)	742,000,000	709,433,620	
	第72回 利付国債(20年)	3,007,000,000	3,170,009,470	
	第100回 利付国債(20年)	1,798,000,000	2,031,362,420	
	第117回 利付国債(20年)	388,000,000	449,769,600	
第125回 利付国債(20年)	131,000,000	154,963,830		
第134回 利付国債(20年)	2,963,000,000	3,429,316,940		
第143回 利付国債(20年)	306,000,000	350,125,200		
第152回 利付国債(20年)	3,750,000,000	4,145,812,500		

	第160回 利付国債(20年)	1,808,000,000	1,866,524,960	
	第168回 利付国債(20年)	2,550,000,000	2,478,702,000	
国債証券	合計	52,044,000,000	55,205,871,920	
合計			55,205,871,920	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ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）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
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	
I N P E X	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	
飛鳥建設	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	
銭高組	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	
浅沼組	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	
N I P P O	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	
N E C ネットズエスアイ	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	
大気社	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	
ニッポン	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	
D M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	
L I F U L L	12,600	239.00	3,011,400	

ミクシィ	9,400	2,240.00	21,056,000	
ジェイエ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	
総合警備保障	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	
麒麟ホールディングス	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	
キャンドウ	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	
J P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	
キューピー	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	

S R E ホールディングス	1,000	3,590.00	3,590,000	
A D 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	
ジー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	
D C M 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	
M o n o t a R O	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	
Z O Z O	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	
H a m e e	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	
B E E N O S	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	
日本フェルト	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	
パ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	
クラウドシ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	
オブティム	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NZ	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	
g u m i	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	2,300	1,258.00	2,893,400	
P R T I M E S	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	
U b i c o m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・バック	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	
東亜合成	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
高压ガス工業	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
J S R	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
K H 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
C L 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
T A C	13,400	226.00	3,028,400
C E 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	
トピラシステムズ	3,900	780.00	3,042,000	
Sansan	15,000	982.00	14,730,000	
ギフトィ	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
合同製鉄	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
東京製鉄	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
アールスティ	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
文化シャッター	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
日本フィルコン	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
I B J	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
F U J I	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
D M G 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
S M N	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
S M C	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
T O W A	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
西島製作所	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
橋本チエイン	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
C K D	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
S A N K Y O	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
J U K I	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
T P R	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
I D E C	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
E I Z O	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
T D K	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
S M K	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
T O A	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
エスベック	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
オブテックスグループ	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
K O A	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
I H I	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
日本車輛製造	1,600	2,105.00	3,368,000
三菱ロジスネクスト	5,700	937.00	5,340,900
近畿車輛	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
F P G	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
トビー工業	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
カップ・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	
メディカ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	
S P K	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	
ハビネット	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	
V T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	
I D O M	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	
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	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
前田工織	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	
N I S S H A	8,800	1,356.00	11,932,800	
藤森工業	3,900	4,005.00	15,619,500	
T A K A R A & C O M P A N Y	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	
J S P	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ANDARD	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	
M U T O H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	
キャ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
S R S 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
S O M P O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
M S & A D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
N E C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
A V A N T I A	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J S A T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йд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
D T S	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
カブコン	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
S C S K	29,200	1,913.00	55,859,600
藤田観光	1,800	2,399.00	4,318,200
K N T - C T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
T K C	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	
JBC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	
サックスパー 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。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,853,863
コール・ローン	331,616,634
投資証券	29,661,510,150
未収配当金	194,984,359
流動資産合計	30,189,965,006
資産合計	30,189,965,006
負債の部	
流動負債	
未払解約金	71,465,480
その他未払費用	357
流動負債合計	71,465,837
負債合計	71,465,837
純資産の部	
元本等	
元本	16,697,963,669
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,420,535,500
元本等合計	30,118,499,169
純資産合計	30,118,499,169
負債純資産合計	30,189,965,006

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	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	16,717,528,982円
同期中追加設定元本額	6,666,226,812円
同期中一部解約元本額	6,685,792,125円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,368,745,606円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,231,428,126円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	8,170,302,178円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,742,834,706円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,619,252,564円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,391,691,592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)	116,339,375円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	11,853,026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)	5,083,711円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	7,822,416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)	31,799,906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)	92,370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)	191,517円
FWニッセイ国内リートインデックス	526,576円
計	16,697,963,669円
2. 受益権の総数	16,697,963,669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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	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 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）は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	2,477,581,596
合計	2,477,581,596

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年11月13日から2022年2月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	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）	1.8037円 (18,037円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	C R E ロジスティクスファンド 投資法人	1,096	211,966,400	
	G L P 投資法人	9,169	1,603,658,100	
	N T T 都市開発リート投資法人	2,714	402,214,800	
	O n e リート投資法人	491	143,715,700	
	S O S I L A 物流リート投資法人	1,317	194,652,600	
	いちごオフィスリート投資法人	2,320	194,416,000	
	いちごホテルリート投資法人	469	38,411,100	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	1,509	593,791,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,831	912,997,500	
	イオンリート投資法人	3,329	480,707,600	
	インヴィンシブル投資法人	12,461	501,555,250	
	エスコンジャパンリート投資法人	570	77,064,000	
	オリックス不動産投資法人	5,641	942,611,100	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,966	219,798,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	876	597,432,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,934	369,780,800	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,130	299,450,000	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	1,317	404,977,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	641	74,932,900	

サンケイリアルエステート投資法人	897	100,822,800	
ザイマックス・リート投資法人	411	49,237,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,673	523,849,200	
ジャパンエクセレント投資法人	2,627	335,467,900	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,831	1,724,079,000	
スターアジア不動産投資法人	2,926	172,341,400	
スターツプロシード投資法人	441	96,975,900	
タカラレーベン不動産投資法人	1,116	129,790,800	
トーセイ・リート投資法人	592	75,480,000	
ヒューリックリート投資法人	2,641	427,842,000	
フロンティア不動産投資法人	992	476,656,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	694	98,201,000	
マリモ地方創生リート投資法人	332	41,666,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,373	856,531,200	
ラサールロジポート投資法人	3,466	594,419,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,104	164,606,400	
阪急阪神リート投資法人	1,279	187,117,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,115	599,870,000	
三菱地所物流リート投資法人	719	319,595,500	
産業ファンド投資法人	4,019	672,780,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	664	84,328,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,023	279,983,200	
森ヒルズリート投資法人	3,329	461,399,400	
星野リゾート・リート投資法人	474	309,996,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,594	659,159,800	
大江戸温泉リート投資法人	457	31,578,700	
大和ハウスリート投資法人	4,251	1,349,692,500	
大和証券オフィス投資法人	599	410,914,000	
大和証券リビング投資法人	3,825	405,450,000	
投資法人みらい	3,429	164,934,900	
東海道リート投資法人	217	24,087,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,898	347,144,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	978	598,536,000	
日本ビルファンド投資法人	3,301	2,145,650,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,935	721,755,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,632	1,563,300,000	
日本リート投資法人	874	326,002,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,850	555,000,000	
日本都市ファンド投資法人	14,284	1,375,549,200	

	福岡リート投資法人	1,464	235,264,800	
	平和不動産リート投資法人	1,834	257,493,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,155	1,442,828,000	
投資証券	合計	165,096	29,661,510,150	
合計			29,661,510,150	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

中間財務諸表

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の中間財務諸表について、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。

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の中間財務諸表について、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。

【ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2022年2月21日現在	第3期中間計算期間 2022年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	18	27
コール・ローン	3,221	3,123
親投資信託受益証券	1,014,016	1,033,014
未収入金	54	54
流動資産合計	1,017,309	1,036,218
資産合計	1,017,309	1,036,218
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	17	24
未払委託者報酬	3,330	3,234
流動負債合計	3,347	3,258
負債合計	3,347	3,258
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,962	32,960
（分配準備積立金）	32,158	32,158
元本等合計	1,013,962	1,032,960
純資産合計	1,013,962	1,032,960
負債純資産合計	1,017,309	1,036,218

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2021年2月23日 至 2021年8月22日	第3期中間計算期間 自 2022年2月22日 至 2022年8月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	17,097	22,256
営業収益合計	17,097	22,256
営業費用		
受託者報酬	-	24
委託者報酬	3,258	3,234
営業費用合計	3,258	3,258
営業利益又は営業損失（ ）	13,839	18,998
経常利益又は経常損失（ ）	13,839	18,998
中間純利益又は中間純損失（ ）	13,839	18,998
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	26,248	13,962
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	40,087	32,960

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年2月22日	至 2022年8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. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 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、前計算期間末日が休業日のため、2022年2月22日から2022年8月21日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	2022年2月21日現在	2022年8月21日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2022年2月21日現在	第3期中間計算期間 2022年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 2022年2月21日現在	第3期中間計算期間 2022年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,0140円 (10,140円)	1,0330円 (10,330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）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2022年2月21日現在	第3期中間計算期間 2022年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23	33
コール・ローン	4,027	3,801
親投資信託受益証券	1,052,378	1,099,672
未収入金	66	69
流動資産合計	1,056,494	1,103,575
資産合計	1,056,494	1,103,575
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	89	34
未払委託者報酬	4,093	3,938
流動負債合計	4,182	3,972
負債合計	4,182	3,972
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	52,312	99,603
（分配準備積立金）	73,325	73,325
元本等合計	1,052,312	1,099,603
純資産合計	1,052,312	1,099,603
負債純資産合計	1,056,494	1,103,575

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2021年2月23日 至 2021年8月22日	第3期中間計算期間 自 2022年2月22日 至 2022年8月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	24,370	51,263
営業収益合計	24,370	51,263
営業費用		
受託者報酬	69	34
委託者報酬	3,976	3,938
営業費用合計	4,045	3,972
営業利益又は営業損失()	20,325	47,291
経常利益又は経常損失()	20,325	47,291
中間純利益又は中間純損失()	20,325	47,291
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	-	-
期首剰余金又は期首欠損金()	63,116	52,312
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	83,441	99,603

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自	至
	2022年2月22日	2022年8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. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 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、前計算期間末日が休業日のため、2022年2月22日から2022年8月21日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	2022年2月21日現在	2022年8月21日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2022年2月21日現在	第3期中間計算期間 2022年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 2022年2月21日現在	第3期中間計算期間 2022年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0523円 (10,523円)	1.0996円 (10,996円)

（参考）

「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）」、「ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）」は、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」- R E I Tインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年8月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,533,937
コール・ローン	527,368,592
国債証券	58,666,895,710
未収利息	174,359,944
前払費用	22,917,932
流動資産合計	59,396,076,115
資産合計	
59,396,076,115	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	83,185,897
未払利息	432
その他未払費用	716
流動負債合計	83,187,045
負債合計	
83,187,045	
純資産の部	
元本等	
元本	44,116,046,230
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,196,842,840
元本等合計	59,312,889,070
純資産合計	
59,312,889,070	
負債純資産合計	
59,396,076,115	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2022年2月22日 至 2022年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法による評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年8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	41,209,892,650円
同期中追加設定元本額	6,939,110,428円
同期中一部解約元本額	4,032,956,848円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックス S A（適格機関投資家限定）	1,673,674,182円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,638,553,307円
ニッセイ日本バランス（成長型） S A（適格機関投資家限定）	3,188,339円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	8,220,312,924円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	12,322,601,319円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,488,509,193円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型） S A（適格機関投資家限定）	17,700,162円
ニッセイインデックスバランス（標準型） S A（適格機関投資家限定）	29,372,954円
ニッセイインデックスバランス（成長型） S A（適格機関投資家限定）	13,460,696円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	6,404,650,564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）	4,299,931,318円
ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド	3,311,471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）	509,722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）	270,079円
計	44,116,046,230円
2. 受益権の総数	44,116,046,230口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3445円 (13,445円)

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8月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	31,016,546
コール・ローン	3,607,714,768
株式	193,872,388,670
派生商品評価勘定	220,579,400
未収配当金	275,663,574
差入委託証拠金	158,400,000
流動資産合計	198,165,762,958
資産合計	198,165,762,958
負債の部	
流動負債	
前受金	209,165,000
未払解約金	466,800,684
未払利息	2,966
その他未払費用	4,927
流動負債合計	675,973,577
負債合計	675,973,577
純資産の部	
元本等	
元本	86,883,437,938
剰余金	
剰余金又は欠損金()	110,606,351,443
元本等合計	197,489,789,381
純資産合計	197,489,789,381
負債純資産合計	198,165,762,958

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月22日 至 2022年8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8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	54,493,461,224円
同期中追加設定元本額	43,380,372,821円
同期中一部解約元本額	10,990,396,107円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,708,935,935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)	3,384,722,528円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,546,003円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,208,021,544円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,489,935,691円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,657,269,612円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	3,890,616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)	15,174,479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)	15,152,073円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,205,262,641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	22,409,121,597円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,602,440,385円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	250,961,350円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	234,461,457円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	292,240,517円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	556,173,911円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	52,713,669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)	116,032,516円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	8,418,303円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	11,821,939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)	4,927,754円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	7,731,996円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	28,675,101円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	181,627,591円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	123,664,270円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	270,847,891円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	225,421,832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)	33,778,649,577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)	23,767,154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)	76,709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)	162,478円
FWニッセイ国内株インデックス	3,237,513円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	8,351,306円
計	86,883,437,938円
2. 受益権の総数	86,883,437,938口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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）は短時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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年8月21日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	3,610,675,000	-	3,831,360,000	220,685,000	
合計	3,610,675,000	-	3,831,360,000	220,685,000	

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年8月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2730円 (22,730円)

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年8月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,631,116
コール・ローン	422,356,235
投資証券	32,344,806,500
未収配当金	197,656,716
流動資産合計	32,968,450,567
資産合計	
32,968,450,567	
負債の部	
流動負債	
未払金	130,469,929
未払解約金	124,302,577
未払利息	346
その他未払費用	434
流動負債合計	254,773,286
負債合計	
254,773,286	
純資産の部	
元本等	
元本	16,589,529,907
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,124,147,374
元本等合計	32,713,677,281
純資産合計	
32,713,677,281	
負債純資産合計	
32,968,450,567	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月22日 至 2022年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年8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	16,697,963,669円
同期中追加設定元本額	2,464,492,408円
同期中一部解約元本額	2,572,926,170円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド（適格機関投資家限定）	748,516,439円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,179,698,129円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	8,405,850,429円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02（適格機関投資家限定）	1,715,122,853円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,761,651,513円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,587,209,814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）	130,844,509円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	13,277,648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）	5,533,958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）	8,772,094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）	32,197,894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）	87,928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）	186,250円
FWニッセイ国内リートインデックス	580,449円
計	16,589,529,907円
2. 受益権の総数	16,589,529,907口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
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。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年8月21日現在
1口当たり純資産額	1.9719円
(1万口当たり純資産額)	(19,719円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）

2022年8月31日現在

資産総額	1,027,128円
負債総額	162円
純資産総額（ - ）	1,026,966円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0270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）

2022年8月31日現在

資産総額	1,093,124円
負債総額	204円
純資産総額（ - ）	1,092,920円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0929円

（参考）

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

資産総額	72,676,522,308円
負債総額	13,379,526,275円
純資産総額（ - ）	59,296,996,033円
発行済数量	44,343,837,444口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3372円

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

資産総額	195,388,641,388円
負債総額	451,979,682円
純資産総額（ - ）	194,936,661,706円
発行済数量	87,113,863,632口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2377円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2022年8月31日現在

資産総額	32,972,574,660円
負債総額	108,632,517円
純資産総額（ - ）	32,863,942,143円
発行済数量	16,609,353,029口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9786円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限

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

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

2022年8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。

最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後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。

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8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	421	72,866
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	142	24,845
単位型公社債投資信託	0	0
合計	563	97,712

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

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

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．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27期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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せん。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		40,822,894		38,492,350
有価証券		-		6,249,635
前払費用		718,688		763,755
未収委託者報酬		5,412,597		6,157,565
未収運用受託報酬		2,425,363		3,219,400
未収投資助言報酬		216,401		265,131
その他		38,899		8,403
流動資産合計		49,634,844		55,156,243
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	130,411	1	150,311
車両	1	1,454	1	968
器具備品	1	125,816	1	103,050
有形固定資産合計		257,681		254,330
無形固定資産				
ソフトウェア		1,225,315		1,840,943
ソフトウェア仮勘定		359,445		577,731
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,592,774		2,426,688
投資その他の資産				
投資有価証券		37,058,043		30,679,401
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		237,055		10,629
差入保証金		382,751		374,819
繰延税金資産		1,200,554		1,413,142
その他		15,154		10,305
投資その他の資産合計		38,959,781		32,554,521
固定資産合計		40,810,238		35,235,540
資産合計		90,445,083		90,391,783

負債の部

流動負債

預り金		47,039		51,241
未払収益分配金		5,643		8,706
未払手数料	2	1,911,775	2	2,315,345
未払運用委託報酬	2	1,871,193	2	1,728,950
未払投資助言報酬	2	1,147,828	2	828,040
その他未払金	2	4,839,326	2	4,619,477
未払費用	2	132,085	2	134,086
未払法人税等		1,042,946		611,046
未払消費税等		904,947		349,108
賞与引当金		1,123,336		1,227,440
その他		82,891		93,579
流動負債合計		13,109,013		11,967,023

固定負債

退職給付引当金		2,155,971		2,423,289
役員退職慰労引当金		27,450		16,750
固定負債合計		2,183,421		2,440,039

負債合計

		15,292,435		14,407,063
--	--	------------	--	------------

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		55,045,550		56,866,270
利益剰余金合計		55,725,357		57,546,077
株主資本合計		74,007,197		75,827,917

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		1,242,655		348,871
繰延ヘッジ損益		97,204		192,067
評価・換算差額等合計		1,145,450		156,803

純資産合計

		75,152,647		75,984,720
--	--	------------	--	------------

負債・純資産合計

		90,445,083		90,391,783
--	--	------------	--	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,838,624	29,144,394
運用受託報酬	18,630,497	17,750,312
投資助言報酬	878,199	1,032,738
営業収益計	46,347,320	47,927,445
営業費用		
支払手数料	10,412,572	11,524,989
広告宣伝費	17,988	62,919
公告費	-	125
調査費	8,251,721	8,730,925
支払運用委託報酬	2,916,886	3,825,413
支払投資助言報酬	3,866,188	3,083,142
委託調査費	129,355	125,430
調査費	1,339,290	1,696,938
委託計算費	256,942	277,534
営業雑経費	760,920	846,156
通信費	64,179	59,759
印刷費	176,812	173,841
協会費	40,454	38,262
その他営業雑経費	479,472	574,292
営業費用計	19,700,144	21,442,649
一般管理費		
役員報酬	126,093	150,830
給料・手当	4,103,410	4,699,931
賞与引当金繰入額	1,120,241	1,184,037
賞与	280,494	369,403
福利厚生費	797,392	925,165
退職給付費用	359,252	431,379
役員退職慰労引当金繰入額	7,150	8,950
その他人件費	166,126	162,879
不動産賃借料	716,925	766,098
その他不動産経費	32,816	36,278
交際費	6,766	12,883
旅費交通費	8,778	17,654
固定資産減価償却費	477,830	552,239
租税公課	395,649	385,352
業務委託費	315,850	349,177
器具備品費	357,066	484,762
保険料	45,818	46,907
寄付金	30,000	5,126
諸経費	226,790	247,185
一般管理費計	9,574,455	10,836,244
営業利益	17,072,720	15,648,550
営業外収益		
受取利息	289	2,029
有価証券利息	4,705	3,452
受取配当金	1 74,260	1 83,809
金融派生商品収益	40,753	-

為替差益	-	27,680
団体定期保険配当金	8,833	13,992
その他営業外収益	5,810	5,963
営業外収益計	134,653	136,927
営業外費用		
為替差損	32,651	-
金融派生商品費用	24,611	-
控除対象外消費税	3,018	20,188
その他営業外費用	4,203	404
営業外費用計	64,485	20,592
経常利益	17,142,888	15,764,885
特別利益		
投資有価証券売却益	3,376	18,927
投資有価証券償還益	20,904	510,138
特別利益計	24,280	529,065
特別損失		
投資有価証券売却損	49,202	7,280
投資有価証券償還損	105,236	50,697
固定資産除却損	2 870	2 132
事故損失賠償金	3 12,614	3 9,883
特別損失計	167,924	67,993
税引前当期純利益	16,999,244	16,225,956
法人税、住民税及び事業税	5,395,622	4,940,051
法人税等調整額	196,661	24,895
法人税等合計	5,198,960	4,964,946
当期純利益	11,800,283	11,261,009

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,500,048	5,500,048	5,500,048
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	11,800,283	11,800,283	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	6,300,235	6,300,235	6,300,235
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	512,183	63,949	448,234	68,155,196
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
当期純利益	-	-	-	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	730,471	33,255	697,216	697,216
当期変動額合計	730,471	33,255	697,216	6,997,451
当期末残高	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647

当事業年度(自2021年4月1日 至2022年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,440,289	9,440,289	9,440,289
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	11,261,009	11,261,009	11,261,009
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,820,719	1,820,719	1,820,719
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,440,289
当期純利益	-	-	-	11,261,009
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	893,783	94,862	988,646	988,646
当期変動額合計	893,783	94,862	988,646	832,073
当期末残高	348,871	192,067	156,803	75,984,720

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>

5．収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p>投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、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。また、成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。</p> <p>投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、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おります。</p>
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、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。</p>
7．ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定は、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について、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
8．消費税等の会計処理	<p>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。</p>

9. 連結納税	<p>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。</p>
---------	--

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当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、当会計期間に係る財務諸表への影響はありません。また、利益剰余金の当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、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。

(未適用の会計基準等)

- ・「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 2021年6月17日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第31号)の2021年6月17日の改正は、2019年7月4日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、「時価の算定に関する会計基準」公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の運用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

- ・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取り扱いを明らかにすることを目的として企業会計基準委員会から公表されたものです。

(2) 適用年月日

2023年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の運用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物附属設備	318,792千円	329,011千円
車両	5,275	5,760
器具備品	447,285	494,576
計	771,352	829,348

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、その金額は前事業年度および当事業年度においてそれぞれ4,960,571千円、5,317,615千円であります。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
受取配当金	9,823千円	42,069千円

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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
器具備品	870	132
計	870	132

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2020年4月1日 至2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2021年6月30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	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

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

2022年6月30日開催の定時株主総会において、以下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	9,008,883千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	83,071円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022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、以下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金融商品または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。

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
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
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。

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,319,017	17,308,937	10,080
その他有価証券	19,610,019	19,610,019	-
資産計	75,421,387	75,411,306	10,080
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	73,870	73,870	-
デリバティブ取引計	73,870	73,870	-

() 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) 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 (2021年3月31日)
関係会社株式	66,222

市場価格のない株式等

(単位:千円)

区分	当事業年度 (2022年3月31日)
関係会社株式	66,222

3. 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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

当事業年度（2022年3月31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	-	73,870	-	73,870
合計	-	73,870	-	73,870

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

なお、投資信託の時価は上記に含めておりません。投資信託の貸借対照表計上額は19,610,019千円であります。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

当事業年度（2022年3月31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	-	17,308,937	-	17,308,937
合計	-	17,308,937	-	17,308,937

(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。

4. 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(2021年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	40,822,894	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	-	15,020,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	2,802,653	17,140,145	2,093,118	-
合計	43,625,547	32,160,145	2,093,118	-

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2022年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	38,492,350	-	-	-
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	6,250,000	11,070,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	6,108,860	12,060,309	1,121,260	101,009
合計	50,851,210	23,130,309	1,121,260	101,009

(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(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

当事業年度(2022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	4,899,207	4,900,290	1,082
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	4,899,207	4,900,290	1,082
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	12,419,810	12,408,647	11,163
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,419,810	12,408,647	11,163
合計		17,319,017	17,308,937	10,080

2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	14,512,369	12,884,500	1,627,869
	小計	14,512,369	12,884,500	1,627,869
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,527,550	7,711,000	183,449
	小計	7,527,550	7,711,000	183,449
	合計	22,039,919	20,595,500	1,444,419

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式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。

当事業年度(2022年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	10,012,022	9,238,000	774,022
	小計	10,012,022	9,238,000	774,022
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	9,597,996	10,017,000	419,003
	小計	9,597,996	10,017,000	419,003
	合計	19,610,019	19,255,000	355,019

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には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

当事業年度（自2021年4月1日 至2022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	72,646	18,927	7,280
合計	72,646	18,927	7,280

(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（2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2022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（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。

当事業年度（2022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	1,264,288	-	73,870
合計			1,264,288	-	73,870

(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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,833,391 千円	2,049,929 千円
勤務費用	247,178	296,556
利息費用	5,766	5,724
数理計算上の差異の発生額	28,155	26,217
退職給付の支払額	65,497	58,809
その他	936	4,869
退職給付債務の期末残高	2,049,929	2,324,488

(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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	117,355 千円	134,197 千円
退職給付費用	19,053	19,557
退職給付の支払額	1,275	1,342
その他	936	4,869
退職給付引当金の期末残高	134,197	147,543

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,184,126 千円	2,472,031 千円
未認識数理計算上の差異	28,155	48,741
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,155,971	2,423,289
退職給付引当金	2,155,971	2,423,289
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,155,971	2,423,289

(4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	19,053 千円	19,557 千円
勤務費用	247,178	296,556
利息費用	5,766	5,724
数理計算上の差異の当期費用処理額	-	5,631
確定給付制度に係る退職給付費用	271,997	327,469

(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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
割引率	0.28 %	0.35 %

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64,693千円、当事業年度において68,995千円であり、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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	343,965 千円	375,842 千円
未払事業税	216,469	134,561
退職給付引当金	660,158	742,011
税務上の繰延資産償却超過額	2,848	1,565
役員退職慰労引当金	8,405	5,128
投資有価証券評価差額	156,971	140,574
減価償却超過額	-	38,704
その他	96,541	128,909
小計	1,485,360	1,567,297
評価性引当額	10	1,808
繰延税金資産合計	1,485,350	1,565,488
繰延税金負債		
特別分配金否認	4,093	6,396
投資有価証券評価差額	280,701	145,949
繰延税金負債合計	284,795	152,345
繰延税金資産(は負債)の純額	1,200,554	1,413,142

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。

当事業年度（自2021年4月1日 至2022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

（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	6,500,632

[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。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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。

(単位：千円)

区分	第27期事業年度 (自 2021年4月 1日 至2022年3月31日)
営業収益	
投資信託委託業務	29,144,394
投資運用業務(注)	17,750,312
投資助言業務	1,032,738
計	47,927,445

(注) 成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の「5. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りでございます。

（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

当事業年度（自2021年4月1日 至2022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	6,521,634	未収運用受託報酬	1,657,146
								投資助言報酬の受取	120,504	未収投資助言報酬	11,837
								連結納税	3,919,311	その他未払金	3,919,311

（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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
1 株当たり純資産額	692,983円25銭	700,655円80銭
1 株当たり当期純利益金額	108,810円52銭	103,837円87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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	11,800,283千円	11,261,009千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	11,800,283千円	11,261,009千円
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。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2022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

2022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：2022年3月末現在)

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

(3) 投資助言会社（参考情報）

a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

b. 資本金の額

2022年3月末現在、450百万円

c. 事業の内容

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

(3) 投資助言会社（参考情報）

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

3【資本関係】

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

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
 - ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
コールセンター 0120-762-506
(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2022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 大竹 新

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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

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 公認会計士 百瀬和政印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）の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、ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）の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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

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 公認会計士 百瀬和政印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）の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、ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）の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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）の2022年2月22日から2022年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（安定型）の2022年8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中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）の2022年2月22日から2022年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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 国内3資産 高値参照型 バランスファンド（積極型）の2022年8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中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の損益の状況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、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、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。

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な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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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