

【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】	2023年8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・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債 券）
【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 上限1兆円
【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・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）
上記ファンドの愛称として「ファンドパック日本」ということがあります。
（以下「ファンド」または「ベビーファンド」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】

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】

ありません。

（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：2023年8月19日から2024年2月20日まで

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經由して、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。

(1 0) 【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/>

(1 1) 【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

(1 2) 【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

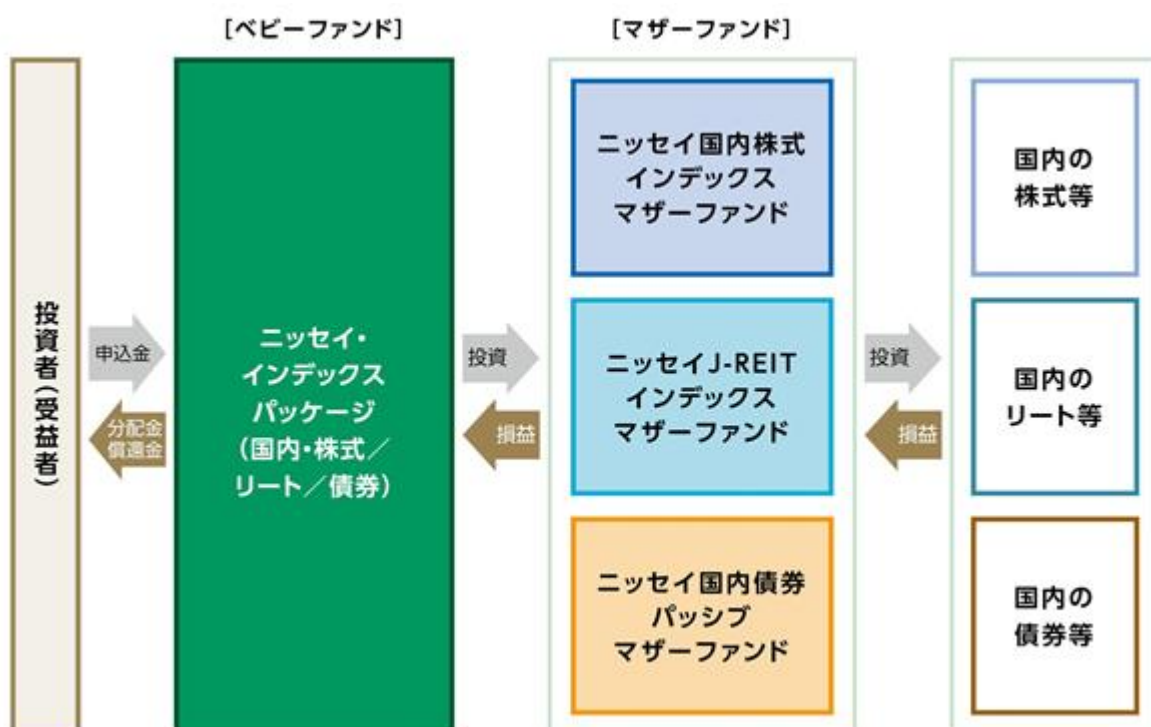
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

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

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

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

〈各マザーファンドの運用プロセス〉

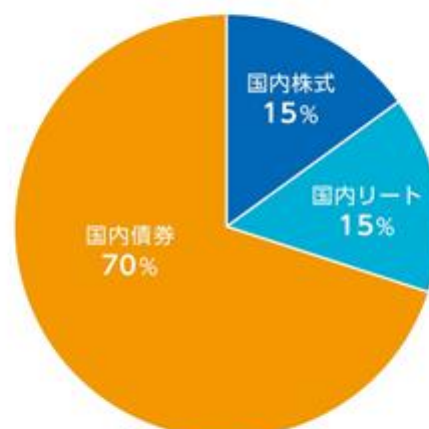


2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

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

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

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

〈各指数について〉**●TOPIX(東証株価指数)**

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

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

●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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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

ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 資産複合 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

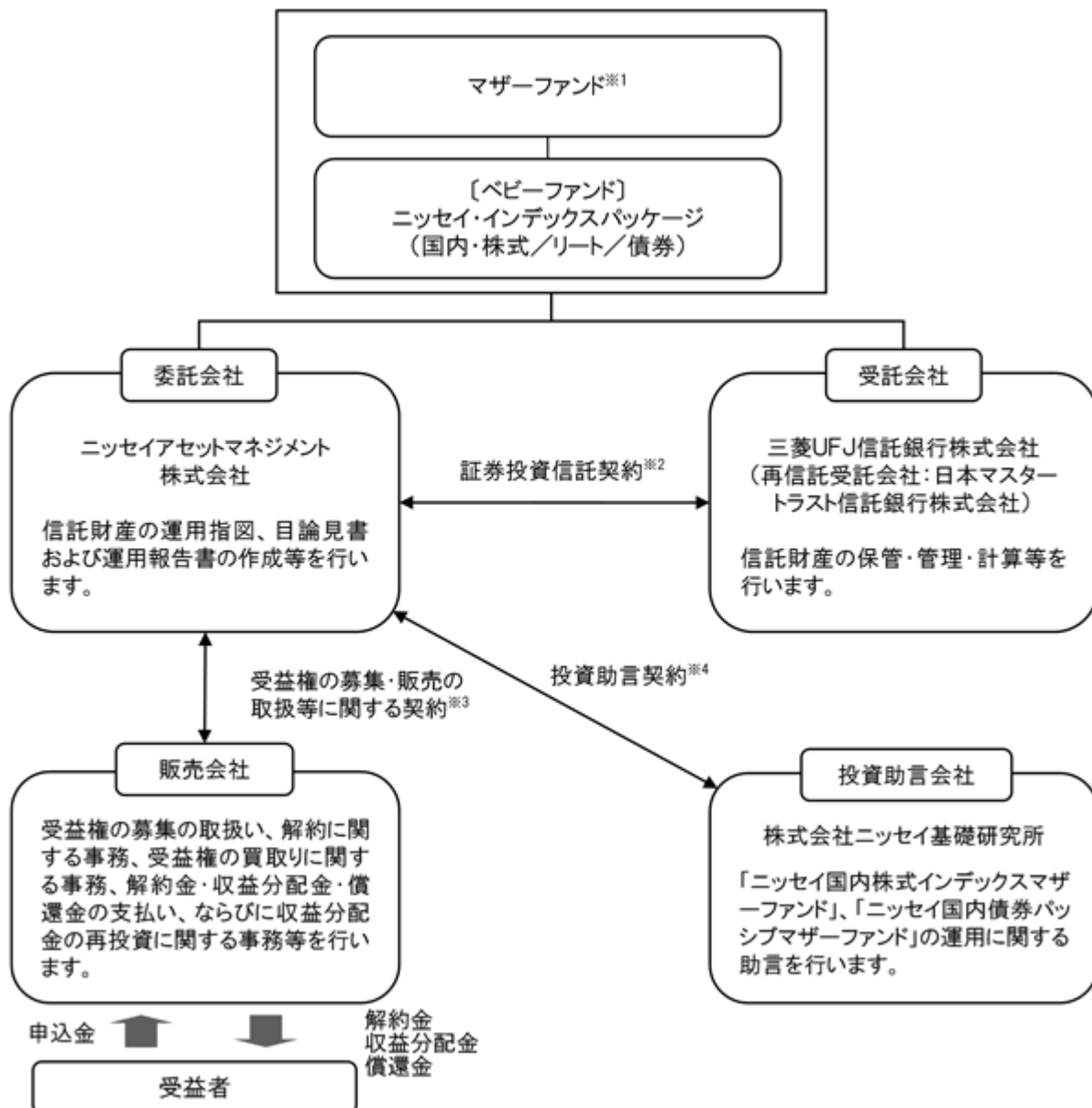
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 不動産投信・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主た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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年11月17日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2023年5月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
- ・設立年月日：1995年4月4日
- ・資本金の額：100億円
- ・沿革
 - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
 - 1995年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
 - 1998年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
 - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。
- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

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

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

b 投資態度

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

不動産投資信託証券への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます）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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、

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

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

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

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

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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

金融商品

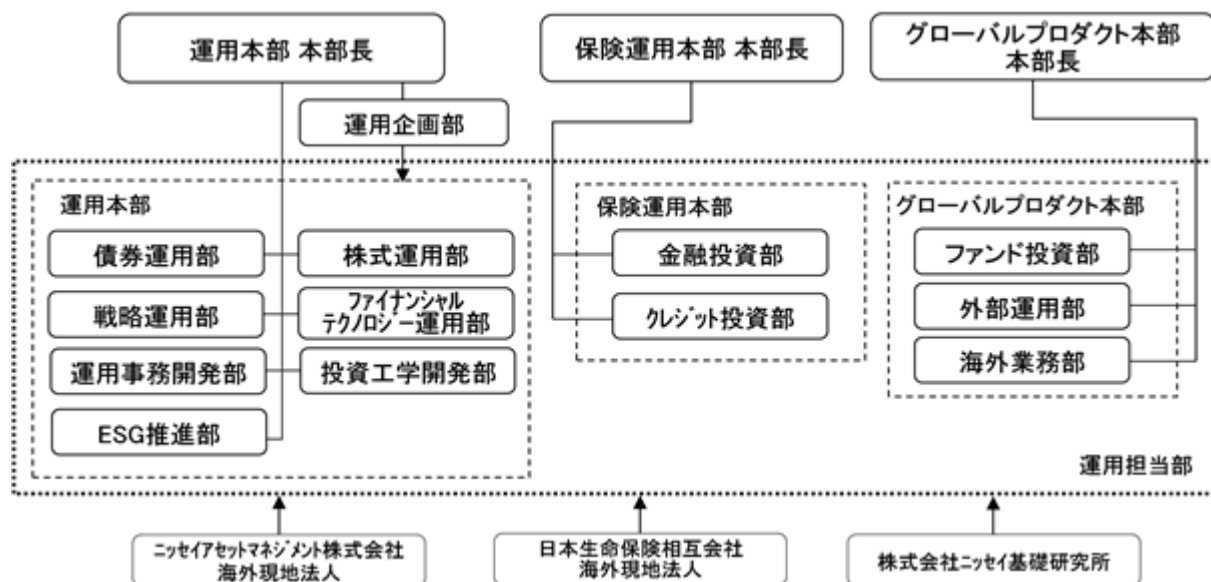
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

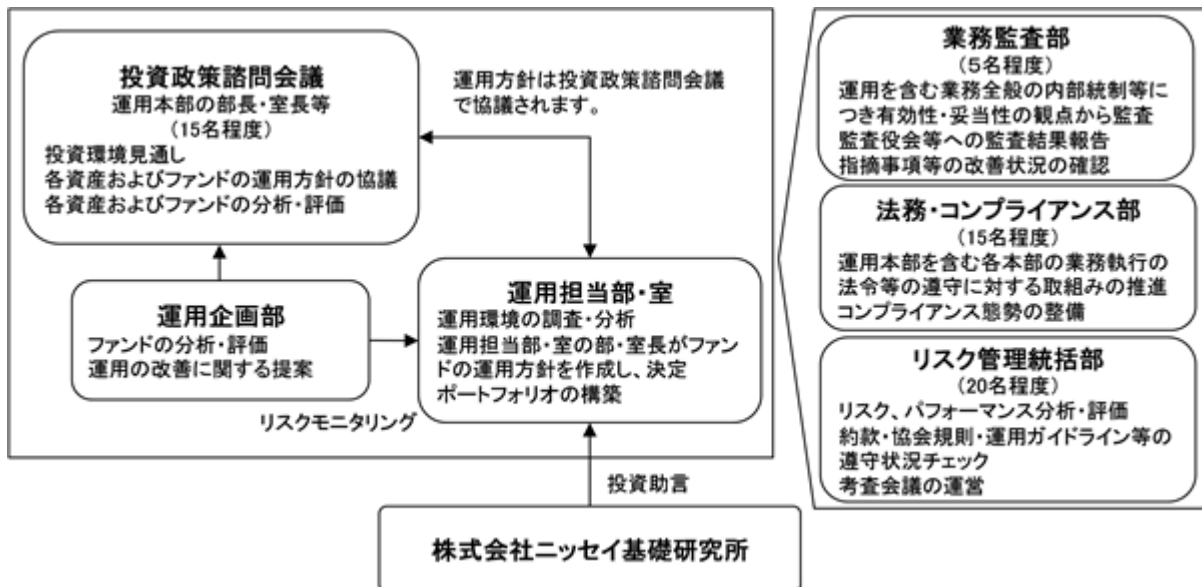
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
2. 分配対象額についての分配方針
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。
3. 留保益の運用方針
留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。

分配時期

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

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

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

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りま

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

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

金利先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

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

有価証券の空売り

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

有価証券の借入れ

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

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

3【投資リスク】

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

(1) 投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・株式投資リスク

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

- ・債券投資リスク

- 金利変動リスク

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

- 信用リスク

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

- ・不動産投資信託（リート）投資リスク

- 保有不動産に関するリスク

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

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

- 金利変動リスク

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

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

- 信用リスク

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

- J - R E I Tの税制に関するリスク

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

- リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

- ・流動性リスク

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

- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

- ・収益分配金に関する留意点

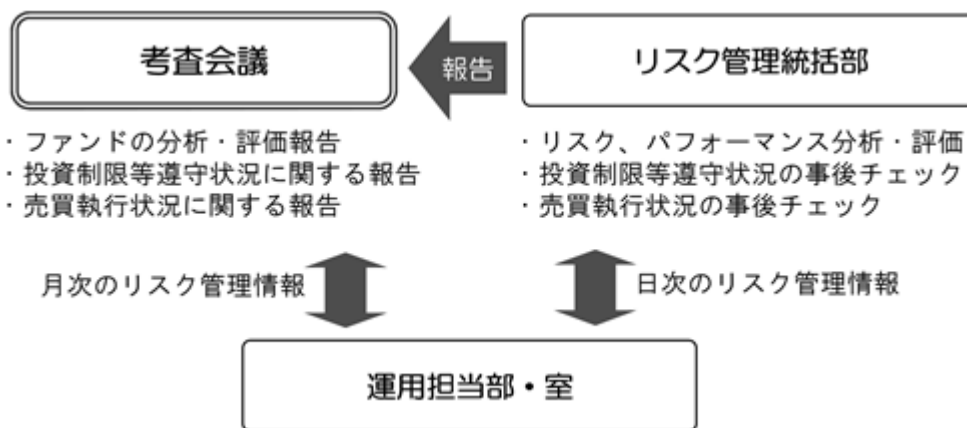
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

- ・短期金融資産の運用に関する留意点
 コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点
 ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・流動性に関する留意点
 ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短時間で手当てする必要が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



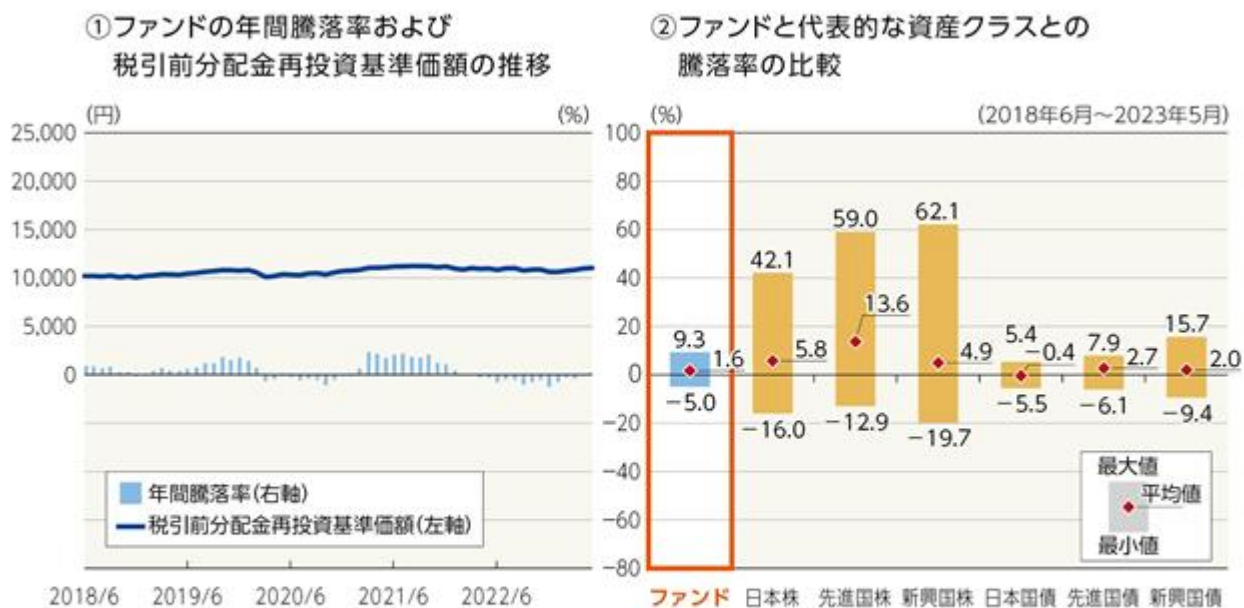
1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
 - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
 - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

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。



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … 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商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、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】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

- 分配時：分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。
外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

- 解約請求・償還・買取請求時：解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の対象です。

NISA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。

ご利用になれるのは、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となります。

ただし、2024年1月1日の税法の改正により、以降は一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。対象は税法上の要件を満たしたファンドを購入した場合に限られ、当ファンドは2024年1月1日以降、NISA（つみたて投資枠（特定累積投資勘定）および成長投資枠（特定非課税管理勘定））の対象となります。

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年5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	145,471,895	100.00
内 日本	145,471,895	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,282	0.00
純資産総額	145,470,613	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	169,764,823,660	96.90
内 日本	169,764,823,660	96.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,422,918,178	3.10
純資産総額	175,187,741,838	100.00

その他資産の投資状況

2023年5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）	5,421,300,000	3.09
内 日本	5,421,300,000	3.09

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	51,556,171,010	78.11
内 日本	51,556,171,010	78.11
地方債証券	3,692,861,508	5.59
内 日本	3,692,861,508	5.59
特殊債券	5,085,785,003	7.71
内 日本	5,085,785,003	7.71
社債券	5,125,885,300	7.77
内 日本	4,825,839,600	7.31
内 スウェーデン	200,689,000	0.30
内 フランス	99,356,700	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	545,164,724	0.83
純資産総額	66,005,867,545	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	32,167,272,500	98.64
内 日本	32,167,272,500	98.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	443,270,765	1.36
純資産総額	32,610,543,265	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】

2023年5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	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	106,223,739	0.9466 100,551,903	0.9537 101,305,579	- -	69.64
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	8,942,612	2.2775 20,367,020	2.4892 22,259,949	- -	15.30
3	ニッセイJ-REITイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	11,644,890	1.9027 22,157,887	1.8812 21,906,367	- -	15.06

（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

2023年5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）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年5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	3,058,700	1,902.21 5,818,311,025	1,908.50 5,837,528,950	- -	3.33
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	394,000	11,442.29 4,508,264,553	13,160.00 5,185,040,000	- -	2.96
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,700	58,272.60 3,245,784,321	67,800.00 3,776,460,000	- -	2.16
4	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	3,435,800	998.09 3,429,257,788	932.50 3,203,883,500	- -	1.83

5	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	715,800	3,972.19 2,843,296,011	3,955.00 2,830,989,000	- -	1.62
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	117,900	15,163.30 1,787,753,257	19,315.00 2,277,238,500	- -	1.30
7	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	400,900	5,997.39 2,404,355,468	5,678.00 2,276,310,200	- -	1.30
8	第一三共 日本	株式 医薬品	486,700	4,278.94 2,082,564,199	4,540.00 2,209,618,000	- -	1.26
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	273,600	7,050.88 1,929,120,844	8,046.00 2,201,385,600	- -	1.26
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	494,400	4,263.49 2,107,874,355	4,421.00 2,185,742,400	- -	1.25
11	HOYA 日本	株式 精密機器	119,000	13,413.31 1,596,184,414	17,565.00 2,090,235,000	- -	1.19
12	任天堂 日本	株式 その他製 品	351,700	5,463.19 1,921,404,670	5,936.00 2,087,691,200	- -	1.19
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	364,500	4,674.91 1,704,006,720	5,586.00 2,036,097,000	- -	1.16
14	信越化学工業 日本	株式 化学	463,800	3,842.30 1,782,061,861	4,297.00 1,992,948,600	- -	1.14
15	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	431,700	4,039.29 1,743,763,869	4,291.00 1,852,424,700	- -	1.06
16	三井物産 日本	株式 卸売業	418,300	3,907.76 1,634,618,464	4,404.00 1,842,193,200	- -	1.05
17	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービ ス業	423,900	3,808.36 1,614,366,019	4,290.00 1,818,531,000	- -	1.04
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	452,800	3,460.11 1,566,739,125	4,005.00 1,813,464,000	- -	1.04
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	67,200	23,351.46 1,569,218,377	26,560.00 1,784,832,000	- -	1.02
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	363,200	4,109.01 1,492,393,458	4,721.00 1,714,667,200	- -	0.98
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	542,300	2,865.49 1,553,960,461	3,144.00 1,704,991,200	- -	0.97
22	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	793,400	2,143.98 1,701,041,475	2,053.00 1,628,850,200	- -	0.93
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービ ス業	303,000	4,296.18 1,301,744,336	5,227.00 1,583,781,000	- -	0.90
24	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	275,600	5,727.26 1,578,433,125	5,475.00 1,508,910,000	- -	0.86

25	村田製作所 日本	株式 電気機器	168,900	7,404.75 1,250,662,576	8,199.00 1,384,811,100	- -	0.79
26	S M C 日本	株式 機械	18,200	66,940.00 1,218,308,000	75,080.00 1,366,456,000	- -	0.78
27	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	897,500	1,532.45 1,375,375,510	1,485.50 1,333,236,250	- -	0.76
28	ファナック 日本	株式 電気機器	273,400	4,540.47 1,241,365,488	4,798.00 1,311,773,200	- -	0.75
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	203,100	6,133.23 1,245,660,399	5,845.00 1,187,119,500	- -	0.68
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	527,700	1,885.97 995,231,183	2,207.50 1,164,897,750	- -	0.66

(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

2023年5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	18.14
		情報・通信業	8.05
		輸送用機器	7.13
		卸売業	6.10
		化学	5.90
		銀行業	5.81
		医薬品	5.32
		機械	5.31
		サービス業	4.82
		小売業	4.28
		食料品	3.44
		陸運業	2.92
		精密機器	2.61
		その他製品	2.28
		保険業	2.20
		建設業	1.96
		不動産業	1.78
		電気・ガス業	1.25
		その他金融業	1.08
		鉄鋼	0.80
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.66
		証券、商品先物取引業	0.66
		非鉄金属	0.64
		海運業	0.53
		金属製品	0.52
空運業	0.48		
繊維製品	0.42		
石油・石炭製品	0.41		
鉱業	0.28		
パルプ・紙	0.16		
倉庫・運輸関連業	0.14		
水産・農林業	0.08		
	小計		96.90
合計(対純資産総額比)			96.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2023年5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350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	602,000,000	99.45 598,707,060	100.11 602,716,380	0.1 2028/3/20	0.91
2	第364回 利付国債(10年) 日本	国債証券	584,000,000	96.73 564,903,200	98.10 572,909,840	0.1 2031/9/20	0.87
3	第365回 利付国債(10年) 日本	国債証券	562,000,000	96.63 543,105,560	97.96 550,557,680	0.1 2031/12/20	0.83
4	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	540,000,000	100.11 540,621,180	100.41 542,257,200	0.1 2027/3/20	0.82
5	第368回 利付国債(10年) 日本	国債証券	535,000,000	101.61 543,613,500	98.38 526,343,700	0.2 2032/9/20	0.80
6	第349回 利付国債(10年) 日本	国債証券	519,000,000	99.60 516,943,640	100.22 520,178,130	0.1 2027/12/20	0.79
7	第360回 利付国債(10年) 日本	国債証券	522,000,000	97.59 509,445,900	98.92 516,383,280	0.1 2030/9/20	0.78
8	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	506,000,000	100.89 510,548,940	100.85 510,331,360	0.4 2025/3/20	0.77
9	第361回 利付国債(10年) 日本	国債証券	514,000,000	97.37 500,482,460	98.70 507,343,700	0.1 2030/12/20	0.77
10	第359回 利付国債(10年) 日本	国債証券	508,000,000	97.91 497,403,120	99.13 503,590,560	0.1 2030/6/20	0.76
11	第363回 利付国債(10年) 日本	国債証券	499,000,000	96.89 483,526,010	98.31 490,571,890	0.1 2031/6/20	0.74
12	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	480,000,000	100.30 481,452,360	100.43 482,083,200	0.1 2026/3/20	0.73
13	第357回 利付国債(10年) 日本	国債証券	477,000,000	98.44 469,562,970	99.48 474,524,370	0.1 2029/12/20	0.72
14	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	472,000,000	100.07 472,354,000	100.44 474,095,680	0.1 2026/12/20	0.72
15	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	458,000,000	101.07 462,914,340	101.07 462,914,340	0.4 2025/9/20	0.70

16	第341回 利付国債（10年） 日本	国債証券	455,000,000	100.87 458,958,500	100.92 459,186,000	0.3 2025/12/20	0.70
17	第362回 利付国債（10年） 日本	国債証券	466,000,000	97.14 452,672,400	98.51 459,070,580	0.1 2031/3/20	0.70
18	第149回 利付国債（5年） 日本	国債証券	456,000,000	99.82 455,197,440	100.14 456,674,880	0.005 2026/9/20	0.69
19	第144回 利付国債（5年） 日本	国債証券	424,000,000	100.30 425,297,440	100.34 425,479,760	0.1 2025/6/20	0.64
20	第358回 利付国債（10年） 日本	国債証券	428,000,000	98.28 420,668,360	99.32 425,128,120	0.1 2030/3/20	0.64
21	第351回 利付国債（10年） 日本	国債証券	423,000,000	99.32 420,123,600	100.02 423,105,750	0.1 2028/6/20	0.64
22	第150回 利付国債（5年） 日本	国債証券	421,000,000	99.81 420,206,550	100.10 421,446,260	0.005 2026/12/20	0.64
23	第153回 利付国債（5年） 日本	国債証券	408,000,000	99.46 405,833,520	100.00 408,000,000	0.005 2027/6/20	0.62
24	第5回 電通グループ 日本	社債券	400,000,000	99.49 397,994,800	100.04 400,160,400	0.32 2027/7/8	0.61
25	第25回 首都高速道路 日本	社債券	400,000,000	99.81 399,254,000	99.94 399,790,800	0.03 2024/9/20	0.61
26	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	377,000,000	100.98 380,724,760	100.96 380,638,050	0.4 2025/6/20	0.58
27	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	380,000,000	98.59 374,657,200	99.59 378,457,200	0.1 2029/9/20	0.57
28	第352回 利付国債（10年） 日本	国債証券	370,000,000	99.15 366,873,500	99.94 369,803,900	0.1 2028/9/20	0.56
29	第143回 利付国債（5年） 日本	国債証券	367,000,000	100.29 368,075,310	100.31 368,156,050	0.1 2025/3/20	0.56
30	第156回 利付国債（5年） 日本	国債証券	365,000,000	100.53 366,934,500	100.65 367,401,700	0.2 2027/12/20	0.56

（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

2023年5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	78.11
		特殊債券	7.71
		社債券	7.31
		地方債証券	5.59
	小計	98.72	
	外国	社債券	0.45
	小計	0.45	
合計（対純資産総額比）			99.17

(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

2023年5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	3,540	546,948.44 1,936,197,483	558,000.00 1,975,320,000	- -	6.06
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	3,112	528,990.29 1,646,217,811	530,000.00 1,649,360,000	- -	5.06
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	9,814	158,956.42 1,559,998,351	163,900.00 1,608,514,600	- -	4.93
4	GLP投資法人 日本	投資証券	10,232	152,392.51 1,559,280,220	147,800.00 1,512,289,600	- -	4.64
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	15,313	98,289.30 1,505,104,173	98,600.00 1,509,861,800	- -	4.63
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	5,116	312,887.36 1,600,731,778	292,200.00 1,494,895,200	- -	4.58
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,575	288,468.43 1,319,743,107	292,500.00 1,338,187,500	- -	4.10
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,047	174,038.69 1,052,412,007	186,600.00 1,128,370,200	- -	3.46
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	3,034	351,443.19 1,066,278,644	358,000.00 1,086,172,000	- -	3.33
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	6,789	149,074.97 1,012,070,007	148,000.00 1,004,772,000	- -	3.08
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	13,358	56,708.94 757,518,104	59,300.00 792,129,400	- -	2.43
12	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	9,787	77,703.98 760,488,890	79,100.00 774,151,700	- -	2.37
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	2,076	345,973.62 718,241,241	359,000.00 745,284,000	- -	2.29
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,631	154,592.63 715,918,482	160,100.00 741,423,100	- -	2.27

15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	9,120	77,931.22 710,732,786	79,500.00 725,040,000	- -	2.22
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,048	649,952.47 681,150,190	678,000.00 710,544,000	- -	2.18
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,046	319,445.97 653,586,466	326,500.00 668,019,000	- -	2.05
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,602	396,597.35 635,348,959	393,500.00 630,387,000	- -	1.93
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,715	162,085.25 602,146,716	167,900.00 623,748,500	- -	1.91
20	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	1,199	509,856.78 611,318,283	502,000.00 601,898,000	- -	1.85
21	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,484	155,707.13 542,483,645	160,600.00 559,530,400	- -	1.72
22	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,766	301,497.04 532,443,778	316,000.00 558,056,000	- -	1.71
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,126	484,486.63 545,531,947	493,000.00 555,118,000	- -	1.70
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,569	150,569.71 537,383,325	154,100.00 549,982,900	- -	1.69
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,205	113,494.63 477,244,931	119,100.00 500,815,500	- -	1.54
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,451	340,392.52 493,909,558	338,500.00 491,163,500	- -	1.51
27	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	2,226	210,977.75 469,636,485	213,800.00 475,918,800	- -	1.46
28	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	1,043	420,523.69 438,606,215	434,500.00 453,183,500	- -	1.39
29	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,839	153,353.78 435,371,384	158,700.00 450,549,300	- -	1.38
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	5,649	70,492.00 398,209,326	71,900.00 406,163,100	- -	1.25

(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

2023年5月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
投資証券	国内		98.64
	小計		98.64
合計（対純資産総額比）			98.64

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年5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 0 506月	買建	255	5,148,620,250	5,421,300,000	3.09

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2023年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	10,125,048	10,125,048	1.0114	1.0114
第2計算期間末 (2019年11月20日)	34,551,025	34,551,025	1.0807	1.0807
第3計算期間末 (2020年11月20日)	60,232,978	60,232,978	1.0555	1.0555
第4計算期間末 (2021年11月22日)	90,328,858	90,328,858	1.1222	1.1222
第5計算期間末 (2022年11月21日)	126,773,131	126,773,131	1.0887	1.0887
2022年5月末日	104,695,651	-	1.0968	-
6月末日	106,670,031	-	1.0834	-
7月末日	111,253,551	-	1.0991	-
8月末日	115,320,346	-	1.1009	-
9月末日	116,123,915	-	1.0765	-
10月末日	122,225,717	-	1.0861	-
11月末日	126,274,323	-	1.0868	-
12月末日	127,406,554	-	1.0633	-
2023年1月末日	131,408,267	-	1.0629	-
2月末日	136,042,500	-	1.0749	-
3月末日	139,117,496	-	1.0835	-
4月末日	142,880,693	-	1.0976	-
5月末日	145,470,613	-	1.1036	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2022年11月22日～2023年5月21日	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.1
第2計算期間	6.9
第3計算期間	2.3
第4計算期間	6.3
第5計算期間	3.0
2022年11月22日～2023年5月21日	1.6

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	11,339,331	1,327,996	10,011,335
第2計算期間	36,243,654	14,283,311	31,971,678
第3計算期間	61,535,982	36,443,305	57,064,355
第4計算期間	37,861,170	14,434,176	80,491,349
第5計算期間	49,748,629	13,794,112	116,445,866
2022年11月22日～ 2023年5月21日	23,982,016	8,658,490	131,769,392

（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

2023年5月末現在

● 基準価額・純資産の推移



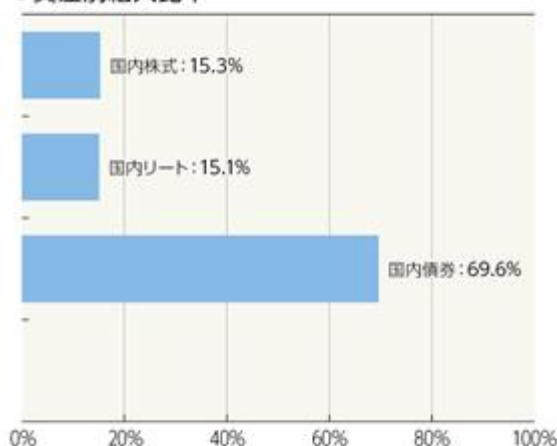
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

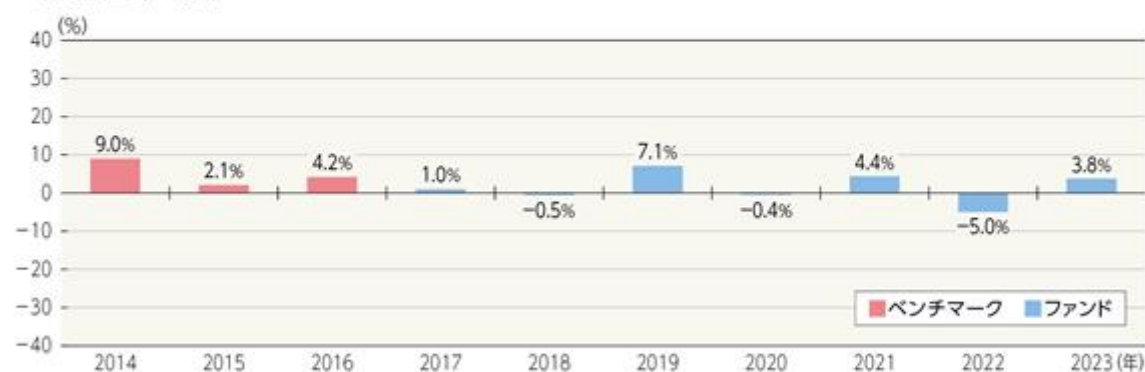
2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

● 資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

● 年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算しております。

・2017年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2016年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2023年5月末現在

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.4%
2	ソニーグループ	3.1%
3	キーエンス	2.2%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.9%
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	6.1%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.1%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.0%
4	GLP投資法人	4.7%
5	日本都市ファンド投資法人	4.7%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

3. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	0.9%
2	第364回 利付国債(10年)	2031/09/20	0.100%	0.9%
3	第365回 利付国債(10年)	2031/12/20	0.100%	0.8%
4	第346回 利付国債(10年)	2027/03/20	0.100%	0.8%
5	第368回 利付国債(10年)	2032/09/20	0.200%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	18.7%
2	情報・通信業	8.3%
3	輸送用機器	7.4%
4	卸売業	6.3%
5	化学	6.1%

・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	98.6%
短期金融資産等	1.4%

・比率は対純資産総額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.2%
債券先物	-
現金、その他	0.8%

・比率は対純資産総額比です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額**< 解約請求の場合 >**

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限です。

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

繰上償還

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

・受益権の口数が30億口を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2021年11月23日から2022年11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・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	852	502
コール・ローン	128,733	178,146
親投資信託受益証券	90,331,240	126,776,473
未収入金	32,800	68,637
流動資産合計	90,493,625	127,023,758
資産合計	90,493,625	127,023,758
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,419	65,313
未払受託者報酬	10,098	13,931
未払委託者報酬	119,736	165,118
その他未払費用	4,514	6,265
流動負債合計	164,767	250,627
負債合計	164,767	250,627
純資産の部		
元本等		
元本	80,491,349	116,445,866
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,837,509	10,327,265
（分配準備積立金）	4,404,020	3,813,861
元本等合計	90,328,858	126,773,131
純資産合計	90,328,858	126,773,131
負債純資産合計	90,493,625	127,023,758

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2020年11月21日 至 2021年11月22日	第5期 自 2021年11月23日 至 2022年11月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,417,247	2,536,647
営業収益合計	4,417,247	2,536,647
営業費用		
受託者報酬	18,078	25,328
委託者報酬	214,528	300,386
その他費用	8,068	11,376
営業費用合計	240,674	337,090
営業利益又は営業損失（ ）	4,176,573	2,873,737
経常利益又は経常損失（ ）	4,176,573	2,873,737
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,176,573	2,873,737
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（ ）	542,954	334,370
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,168,623	9,837,509
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,940,484	4,646,420
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	3,940,484	4,646,420
剰余金減少額又は欠損金増加額	905,217	1,617,297
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	905,217	1,617,297
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（ ）	9,837,509	10,327,265

(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5期	
	自 2021年11月23日	至 2022年11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11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11月23日から2022年11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4期	第5期
	2021年11月22日現在	2022年11月21日現在
1. 期首元本額	57,064,355円	80,491,349円
期中追加設定元本額	37,861,170円	49,748,629円
期中一部解約元本額	14,434,176円	13,794,112円
2. 受益権の総数	80,491,349口	116,445,866口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日	自 2021年11月23日 至 2022年11月21日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,633,619円)、収益調整金(5,433,489円)及び分配準備積立金(770,401円)より分配対象収益は9,837,509円(1万口当たり1,222.18円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(6,513,404円)及び分配準備積立金(3,813,861円)より分配対象収益は10,327,265円(1万口当たり886.87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4期	第5期
	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日	自 2021年11月23日 至 2022年11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4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11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	3,300,072	2,119,686
合計	3,300,072	2,119,686

(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4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
1口当たり純資産額	1.1222円	1.0887円
(1万口当たり純資産額)	(11,222円)	(10,887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11月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	8,540,841	19,405,644	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	9,889,734	19,011,035	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	93,226,202	88,359,794	
親投資信託受益証券 合計		111,656,777	126,776,473	
合計			126,776,473	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」-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11月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,809,068
コール・ローン	3,128,100,093
株式	178,028,052,710
派生商品評価勘定	198,688,550
未収配当金	1,960,191,980
差入委託証拠金	200,760,000
流動資産合計	183,524,602,401
資産合計	183,524,602,401
負債の部	
流動負債	
前受金	184,480,000
未払解約金	339,220,374
その他未払費用	2,385
流動負債合計	523,702,759
負債合計	523,702,759
純資産の部	
元本等	
元本	80,542,683,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	102,458,216,287
元本等合計	183,000,899,642
純資産合計	183,000,899,642
負債純資産合計	183,524,602,401

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11月23日 至 2022年11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11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	52,189,089,554円
同期中追加設定元本額	53,578,722,618円
同期中一部解約元本額	25,225,128,817円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,647,990,989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）	3,349,734,369円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	3,514,277円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,246,582,867円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,615,340,400円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	5,805,672,508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）	3,847,143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）	14,180,476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）	13,439,604円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,596,291,071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	23,007,925,392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）	2,827,035,617円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	279,595,998円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	242,992,825円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	316,645,650円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	602,883,319円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	54,988,614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）	119,743,668円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	8,500,988円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	12,231,335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）	5,223,340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)	8,540,841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)	28,951,780円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	202,230,381円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	134,140,616円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	292,921,259円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	239,679,546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)	25,806,417,013円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型パス ケット)	25,168,812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)	76,777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)	162,630円
FWニッセイ国内株インデックス	18,998,657円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	11,034,593円
計	80,542,683,355円
2. 受益権の総数	80,542,683,355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11月23日 至 2022年11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11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11月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	7,099,260,096	
合計	7,099,260,096	

(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(2022年2月22日から2022年11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)

株式関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	4,517,845,000	-		198,820,000
合計	4,517,845,000	-		198,820,000

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2721円 (22,721円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年11月21日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	3,640.00	12,012,000	
日本水産	87,500	517.00	45,237,500	
マルハニチロ	13,500	2,440.00	32,940,000	
雪国まいたけ	7,500	1,018.00	7,635,000	
カネコ種苗	3,400	1,421.00	4,831,400	
サカタのタネ	11,100	4,715.00	52,336,500	
ホクト	7,800	1,904.00	14,851,200	
ショーボンドホールディングス	11,900	6,070.00	72,233,000	
ミライト・ワン	30,400	1,517.00	46,116,800	
タマホーム	6,200	2,489.00	15,431,800	
ファーストコーポレーション	1,300	720.00	936,000	
住石ホールディングス	14,000	201.00	2,814,000	
日鉄鉱業	3,500	3,150.00	11,025,000	
三井松島ホールディングス	4,000	2,963.00	11,852,000	
I N P E X	323,800	1,506.00	487,642,800	
石油資源開発	10,100	4,105.00	41,460,500	
K & O エナジーグループ	4,000	2,219.00	8,876,000	
安藤・間	50,700	860.00	43,602,000	
東急建設	24,900	648.00	16,135,200	
コムシスホールディングス	29,600	2,489.00	73,674,400	
ピーアールホールディングス	14,000	335.00	4,690,000	
高松コンストラクショングループ	5,700	1,943.00	11,075,100	
東建コーポレーション	2,800	8,090.00	22,652,000	
ソネック	4,800	940.00	4,512,000	
ヤマウラ	4,900	1,003.00	4,914,700	
オリエンタル白石	31,500	276.00	8,694,000	
大成建設	61,000	4,020.00	245,220,000	
大林組	219,000	1,007.00	220,533,000	
清水建設	184,100	728.00	134,024,800	
飛鳥建設	6,800	1,018.00	6,922,400	
長谷工コーポレーション	63,200	1,505.00	95,116,000	
松井建設	8,700	567.00	4,932,900	
銭高組	1,500	2,672.00	4,008,000	
鹿島建設	135,800	1,523.00	206,823,400	
不動テトラ	4,200	1,510.00	6,342,000	
鉄建建設	4,400	1,785.00	7,854,000	

西松建設	10,400	3,795.00	39,468,000
三井住友建設	49,400	417.00	20,599,800
大豊建設	2,500	4,250.00	10,625,000
佐田建設	10,800	429.00	4,633,200
ナカノフード建設	15,100	319.00	4,816,900
奥村組	9,900	2,890.00	28,611,000
東鉄工業	8,400	2,554.00	21,453,600
浅沼組	4,900	2,858.00	14,004,200
戸田建設	75,300	705.00	53,086,500
熊谷組	10,600	2,497.00	26,468,200
植木組	3,500	1,272.00	4,452,000
矢作建設工業	8,300	734.00	6,092,200
ピーエス三菱	7,900	598.00	4,724,200
日本ハウスホールディングス	12,100	433.00	5,239,300
大東建託	22,500	15,340.00	345,150,000
新日本建設	8,600	758.00	6,518,800
東亜道路工業	1,200	5,860.00	7,032,000
日本道路	1,200	6,170.00	7,404,000
東亜建設工業	5,300	2,291.00	12,142,300
日本国土開発	18,400	580.00	10,672,000
若築建設	2,700	2,749.00	7,422,300
東洋建設	19,800	832.00	16,473,600
五洋建設	86,800	649.00	56,333,200
世紀東急工業	8,100	792.00	6,415,200
福田組	2,300	4,765.00	10,959,500
住友林業	47,000	2,332.00	109,604,000
日本基礎技術	8,100	530.00	4,293,000
バコーボレーション	10,600	382.00	4,049,200
大和ハウス工業	171,200	3,160.00	540,992,000
ライト工業	11,700	1,957.00	22,896,900
積水ハウス	191,900	2,501.50	480,037,850
日特建設	5,800	905.00	5,249,000
北陸電気工事	7,200	669.00	4,816,800
ユアテック	13,500	716.00	9,666,000
日本リーテック	6,600	732.00	4,831,200
四電工	2,900	1,727.00	5,008,300
中電工	9,500	2,057.00	19,541,500
関電工	33,600	880.00	29,568,000
きんでん	43,100	1,475.00	63,572,500
東京エネシス	6,000	937.00	5,622,000
トーエネック	2,000	3,390.00	6,780,000
住友電設	5,800	2,475.00	14,355,000
日本電設工業	10,100	1,653.00	16,695,300
エクシオグループ	30,000	2,107.00	63,210,000
新日本空調	3,400	1,931.00	6,565,400
日本工営	4,600	3,345.00	15,387,000
九電工	14,900	3,290.00	49,021,000
三機工業	13,600	1,536.00	20,889,600
日揮ホールディングス	60,600	1,865.00	113,019,000
中外炉工業	3,100	1,568.00	4,860,800

ヤマト	6,200	690.00	4,278,000
太平電業	3,800	3,140.00	11,932,000
高砂熱学工業	14,800	1,783.00	26,388,400
三晃金属工業	1,700	2,933.00	4,986,100
N E C ネットエスアイ	20,900	1,692.00	35,362,800
朝日工業社	2,500	1,956.00	4,890,000
明星工業	10,500	715.00	7,507,500
大気社	7,400	3,500.00	25,900,000
ダイダン	4,000	2,158.00	8,632,000
日比谷総合設備	5,300	1,915.00	10,149,500
ニッポン	16,600	1,600.00	26,560,000
日清製粉グループ本社	56,900	1,617.00	92,007,300
日東富士製粉	1,100	4,415.00	4,856,500
昭和産業	5,400	2,435.00	13,149,000
中部飼料	8,500	1,037.00	8,814,500
フィード・ワン	9,000	676.00	6,084,000
日本甜菜製糖	3,600	1,623.00	5,842,800
D M 三井製糖ホールディングス	6,100	1,957.00	11,937,700
塩水港精糖	23,200	200.00	4,640,000
日新製糖	3,200	1,693.00	5,417,600
L I F U L L	28,900	249.00	7,196,100
M I X I	14,600	2,450.00	35,770,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,488.00	14,430,400
日本M&Aセンターホールディングス	110,100	1,854.00	204,125,400
メンバーズ	2,300	2,141.00	4,924,300
U T グループ	9,400	2,827.00	26,573,800
アイティメディア	2,900	1,804.00	5,231,600
E・Jホールディングス	4,100	1,343.00	5,506,300
夢真ビーネックスグループ	23,400	1,903.00	44,530,200
コシダカホールディングス	19,200	1,078.00	20,697,600
アルトナー	1,300	1,000.00	1,300,000
パソナグループ	7,800	2,042.00	15,927,600
C D S	2,700	1,849.00	4,992,300
リンクアンドモチベーション	18,500	736.00	13,616,000
エス・エム・エス	24,400	3,710.00	90,524,000
サニーサイドアップグループ	7,000	589.00	4,123,000
パーソルホールディングス	71,900	3,015.00	216,778,500
クックパッド	23,900	207.00	4,947,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,700	625.00	4,812,500
森永製菓	12,700	3,705.00	47,053,500
中村屋	1,600	3,115.00	4,984,000
江崎グリコ	17,600	3,585.00	63,096,000
名糖産業	3,000	1,631.00	4,893,000
井村屋グループ	3,400	2,240.00	7,616,000
不二家	4,200	2,676.00	11,239,200
山崎製パン	41,200	1,564.00	64,436,800
モロゾフ	2,000	3,630.00	7,260,000
亀田製菓	3,900	4,305.00	16,789,500
寿スピリッツ	6,500	7,750.00	50,375,000
カルビー	28,100	2,877.00	80,843,700

森永乳業	11,200	4,420.00	49,504,000
六甲バター	4,500	1,428.00	6,426,000
ヤクルト本社	43,900	8,300.00	364,370,000
明治ホールディングス	38,100	6,680.00	254,508,000
雪印メグミルク	14,900	1,751.00	26,089,900
プリマハム	8,300	2,058.00	17,081,400
日本ハム	24,000	3,715.00	89,160,000
林兼産業	7,000	478.00	3,346,000
丸大食品	6,200	1,426.00	8,841,200
S Foods	6,800	2,903.00	19,740,400
柿安本店	2,400	2,195.00	5,268,000
伊藤ハム米久ホールディングス	47,800	679.00	32,456,200
学情	3,200	1,514.00	4,844,800
スタジオアリス	3,200	2,096.00	6,707,200
クロスキャット	3,600	1,416.00	5,097,600
シミックホールディングス	3,500	1,727.00	6,044,500
システナ	105,300	434.00	45,700,200
N J S	2,300	2,041.00	4,694,300
デジタルアーツ	4,000	6,480.00	25,920,000
日鉄ソリューションズ	10,700	3,490.00	37,343,000
総合警備保障	23,800	3,730.00	88,774,000
キューブシステム	4,900	1,020.00	4,998,000
いちご	70,800	317.00	22,443,600
日本駐車場開発	73,200	251.00	18,373,200
コア	3,300	1,452.00	4,791,600
カカクコム	47,900	2,295.00	109,930,500
アイロムグループ	2,300	2,204.00	5,069,200
セントケア・ホールディング	5,800	838.00	4,860,400
ルネサンス	5,100	908.00	4,630,800
ディップ	11,200	3,935.00	44,072,000
S B Sホールディングス	5,600	2,976.00	16,665,600
デジタルホールディングス	5,000	1,170.00	5,850,000
新日本科学	6,800	2,552.00	17,353,600
ベネフィット・ワン	29,700	2,105.00	62,518,500
エムスリー	126,800	4,416.00	559,948,800
アウトソーシング	38,200	1,023.00	39,078,600
ウェルネット	7,700	638.00	4,912,600
ワールドホールディングス	2,900	2,894.00	8,392,600
ディー・エヌ・エー	27,400	1,898.00	52,005,200
博報堂D Yホールディングス	81,900	1,331.00	109,008,900
ぐるなび	11,800	395.00	4,661,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	843.00	4,720,800
ファンコミュニケーションズ	12,600	441.00	5,556,600
ライク	2,400	2,046.00	4,910,400
ビジネス・ブレークスルー	11,700	396.00	4,633,200
エスプール	18,400	909.00	16,725,600
W D Bホールディングス	3,300	2,521.00	8,319,300
手間いらず	1,100	5,130.00	5,643,000
アドウェイズ	8,800	564.00	4,963,200
バリューコマース	4,800	2,111.00	10,132,800

インフォマート	66,600	444.00	29,570,400
サッポロホールディングス	20,200	3,515.00	71,003,000
アサヒグループホールディングス	142,100	4,304.00	611,598,400
麒麟ホールディングス	277,500	2,184.00	606,060,000
宝ホールディングス	42,000	1,052.00	44,184,000
オエノンホールディングス	18,400	282.00	5,188,800
養命酒製造	2,700	1,795.00	4,846,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	48,200	1,458.00	70,275,600
サントリー食品インターナショナル	43,300	4,635.00	200,695,500
ダイトーグループホールディングス	3,500	4,680.00	16,380,000
伊藤園	22,900	5,500.00	125,950,000
キーコーヒー	6,900	2,060.00	14,214,000
日清オイリオグループ	8,700	3,275.00	28,492,500
不二製油グループ本社	14,300	2,088.00	29,858,400
J - オイルミルズ	6,300	1,557.00	9,809,100
ローソン	16,400	5,020.00	82,328,000
サンエー	5,000	4,255.00	21,275,000
カワチ薬品	5,200	2,153.00	11,195,600
エービーシー・マート	9,600	7,050.00	67,680,000
ハードオフコーポレーション	2,800	1,324.00	3,707,200
高千穂交易	2,400	2,232.00	5,356,800
アスクル	15,900	1,636.00	26,012,400
ゲオホールディングス	6,900	1,822.00	12,571,800
アダストリア	8,000	2,011.00	16,088,000
伊藤忠食品	1,500	5,130.00	7,695,000
くら寿司	7,700	3,445.00	26,526,500
キャンドウ	2,300	2,217.00	5,099,100
エレマテック	5,900	1,521.00	8,973,900
パルグループホールディングス	6,500	2,282.00	14,833,000
エディオン	26,200	1,252.00	32,802,400
あらた	5,100	4,010.00	20,451,000
サーラコーポレーション	13,900	746.00	10,369,400
トーマンデバイス	1,000	5,670.00	5,670,000
ハローズ	3,000	2,919.00	8,757,000
J Pホールディングス	18,500	272.00	5,032,000
フジオフードグループ本社	5,500	1,411.00	7,760,500
あみやき亭	1,700	2,908.00	4,943,600
東京エレクトロン デバイス	2,400	6,880.00	16,512,000
円谷フィールズホールディングス	5,700	2,084.00	11,878,800
双日	70,100	2,417.00	169,431,700
アルフレッサ ホールディングス	66,300	1,667.00	110,522,100
大黒天物産	2,400	5,090.00	12,216,000
ハニーズホールディングス	5,900	1,233.00	7,274,700
ファーマライズホールディングス	7,000	652.00	4,564,000
キッコーマン	40,700	7,700.00	313,390,000
味の素	150,500	4,221.00	635,260,500
ブルドックソース	2,900	1,717.00	4,979,300
キュービー	33,000	2,487.00	82,071,000
ハウス食品グループ本社	18,800	2,740.00	51,512,000

カゴメ	28,600	3,040.00	86,944,000
アリアケジャパン	5,400	4,745.00	25,623,000
エバラ食品工業	1,700	3,145.00	5,346,500
ニチレイ	28,200	2,779.00	78,367,800
横浜冷凍	18,000	970.00	17,460,000
東洋水産	31,100	5,610.00	174,471,000
イトアンドホールディングス	2,600	2,253.00	5,857,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,000	488.00	4,880,000
日清食品ホールディングス	21,900	10,470.00	229,293,000
永谷園ホールディングス	3,000	2,024.00	6,072,000
一正蒲鉾	6,100	741.00	4,520,100
フジッコ	6,300	1,914.00	12,058,200
ロック・フィールド	7,500	1,501.00	11,257,500
日本たばこ産業	404,800	2,795.00	1,131,416,000
ケンコーマヨネーズ	4,200	1,636.00	6,871,200
わらべや日洋ホールディングス	4,500	1,784.00	8,028,000
なとり	3,900	2,070.00	8,073,000
ファーマフーズ	9,500	1,332.00	12,654,000
北の達人コーポレーション	26,400	303.00	7,999,200
ユーグレナ	39,600	871.00	34,491,600
紀文食品	5,400	935.00	5,049,000
ピククルスホールディングス	4,600	1,056.00	4,857,600
S R Eホールディングス	3,000	4,565.00	13,695,000
A Dワークスグループ	20,200	167.00	3,373,400
片倉工業	5,800	1,855.00	10,759,000
グンゼ	4,700	3,835.00	18,024,500
ヒューリック	143,500	1,143.00	164,020,500
アルペン	5,400	2,015.00	10,881,000
ラクーンホールディングス	6,200	1,325.00	8,215,000
クオールホールディングス	9,100	1,163.00	10,583,300
アルコニックス	8,700	1,322.00	11,501,400
神戸物産	51,100	3,470.00	177,317,000
ソリトンシステムズ	4,700	1,148.00	5,395,600
ジinzホールディングス	3,900	4,245.00	16,555,500
ビックカメラ	43,900	1,192.00	52,328,800
D C Mホールディングス	40,300	1,201.00	48,400,300
ハイパー	4,500	480.00	2,160,000
Monotaro	93,700	2,404.00	225,254,800
東京一番フーズ	8,200	579.00	4,747,800
あいホールディングス	10,600	2,190.00	23,214,000
ディービーエクス	4,700	989.00	4,648,300
アークランドサービスホールディングス	5,400	2,216.00	11,966,400
J.フロントリテイリング	82,100	1,123.00	92,198,300
ドトール・日レスホールディングス	11,700	1,675.00	19,597,500
マツキヨココカラ&カンパニー	40,100	5,790.00	232,179,000
ブロンコビリー	3,500	2,534.00	8,869,000
Z O Z O	43,700	3,125.00	136,562,500
トレジャー・ファクトリー	700	2,239.00	1,567,300
物語コーポレーション	3,700	7,080.00	26,196,000

三越伊勢丹ホールディングス	111,200	1,233.00	137,109,600
東洋紡	27,000	1,031.00	27,837,000
ユニチカ	18,900	257.00	4,857,300
富士紡ホールディングス	2,500	3,300.00	8,250,000
日清紡ホールディングス	51,300	1,009.00	51,761,700
倉敷紡績	4,700	2,125.00	9,987,500
ダイワボウホールディングス	27,000	2,216.00	59,832,000
日東紡績	7,500	2,133.00	15,997,500
トヨタ紡織	26,300	1,975.00	51,942,500
マクニカホールディングス	16,200	3,430.00	55,566,000
H a m e e	5,800	885.00	5,133,000
ラクト・ジャパン	2,500	2,061.00	5,152,500
ウエルシアホールディングス	34,300	3,130.00	107,359,000
クリエイトSDホールディングス	10,900	3,310.00	36,079,000
グリムス	2,700	1,863.00	5,030,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,700	795.00	7,711,500
八洲電機	5,300	1,024.00	5,427,200
メディアスホールディングス	6,900	744.00	5,133,600
レスターホールディングス	6,300	2,195.00	13,828,500
ジュテックホールディングス	4,500	1,182.00	5,319,000
丸善CHIホールディングス	12,700	337.00	4,279,900
OCHIホールディングス	3,900	1,247.00	4,863,300
TOKAIホールディングス	32,600	889.00	28,981,400
ミサワ	8,000	601.00	4,808,000
ティーライフ	3,400	1,298.00	4,413,200
C o m i n i x	6,600	733.00	4,837,800
三洋貿易	6,800	1,114.00	7,575,200
シュッピン	4,900	1,354.00	6,634,600
オイシックス・ラ・大地	8,900	1,936.00	17,230,400
ウイン・パートナーズ	5,000	982.00	4,910,000
ネクステージ	15,100	2,927.00	44,197,700
ジョイフル本田	21,300	1,905.00	40,576,500
鳥貴族ホールディングス	2,400	2,306.00	5,534,400
ホットランド	5,000	1,503.00	7,515,000
すかいらくホールディングス	90,300	1,622.00	146,466,600
SFPホールディングス	3,600	1,686.00	6,069,600
綿半ホールディングス	5,100	1,341.00	6,839,100
日本毛織	18,200	1,003.00	18,254,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,500	1,115.00	23,972,500
三栄建築設計	3,300	1,525.00	5,032,500
野村不動産ホールディングス	38,400	3,225.00	123,840,000
三重交通グループホールディングス	13,200	496.00	6,547,200
サムティ	9,800	2,404.00	23,559,200
ディア・ライフ	9,300	610.00	5,673,000
コーセーアールイー	7,200	713.00	5,133,600
地主	4,700	2,015.00	9,470,500
プレサンスコーポレーション	8,100	1,588.00	12,862,800
ハウスコム	4,000	1,119.00	4,476,000

JPMC	4,800	1,042.00	5,001,600
サンセイランディック	5,700	854.00	4,867,800
エストラスト	8,700	574.00	4,993,800
フージャースホールディングス	9,500	757.00	7,191,500
オープンハウスグループ	22,500	5,870.00	132,075,000
東急不動産ホールディングス	184,900	723.00	133,682,700
飯田グループホールディングス	53,900	2,209.00	119,065,100
ムゲンエステート	10,100	486.00	4,908,600
帝国繊維	7,000	1,644.00	11,508,000
日本コークス工業	56,500	83.00	4,689,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,400	1,683.00	5,722,200
B E E N O S	3,700	3,200.00	11,840,000
あさひ	5,500	1,328.00	7,304,000
日本調剤	4,500	1,230.00	5,535,000
コスモス薬品	7,500	14,710.00	110,325,000
シップヘルスケアホールディングス	23,700	2,784.00	65,980,800
ソフトクリエイティブホールディングス	2,600	3,485.00	9,061,000
セブン&アイ・ホールディングス	227,700	5,578.00	1,270,110,600
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	49,700	955.00	47,463,500
明治電機工業	4,700	1,032.00	4,850,400
ツルハホールディングス	16,200	9,410.00	152,442,000
サンマルクホールディングス	5,300	1,694.00	8,978,200
フェリシモ	4,400	1,002.00	4,408,800
トリドールホールディングス	16,400	2,753.00	45,149,200
帝人	60,100	1,292.00	77,649,200
東レ	419,100	737.60	309,128,160
クラレ	99,400	1,076.00	106,954,400
旭化成	390,600	1,015.50	396,654,300
T O K Y O B A S E	14,000	314.00	4,396,000
稲葉製作所	3,800	1,380.00	5,244,000
宮地エンジニアリンググループ	1,800	3,370.00	6,066,000
トーカロ	17,700	1,228.00	21,735,600
アルファ	4,700	943.00	4,432,100
S U M C O	122,700	2,061.00	252,884,700
川田テクノロジーズ	1,500	3,410.00	5,115,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,100	8,890.00	18,669,000
A n d D o ホールディングス	5,600	852.00	4,771,200
シーアールイー	3,400	1,479.00	5,028,600
ケイアイスター不動産	3,000	4,845.00	14,535,000
グッドコムアセット	7,000	726.00	5,082,000
ジェイ・エス・ビー	1,500	4,270.00	6,405,000
ロードスターキャピタル	3,100	1,730.00	5,363,000
日本フエルト	11,500	401.00	4,611,500
イチカワ	3,500	1,302.00	4,557,000
芦森工業	4,100	1,185.00	4,858,500
アツギ	10,200	373.00	3,804,600
J M ホールディングス	5,600	1,733.00	9,704,800
コメダホールディングス	16,200	2,424.00	39,268,800
アレンザホールディングス	5,100	976.00	4,977,600

バロックジャパンリミテッド	6,100	793.00	4,837,300	
クスリのアオキホールディングス	6,600	7,710.00	50,886,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	37,900	2,590.00	98,161,000	
アセンテック	9,400	538.00	5,057,200	
セーレン	12,100	2,587.00	31,302,700	
ソトー	5,800	813.00	4,715,400	
東海染工	1,600	1,128.00	1,804,800	
小松マテーレ	9,100	793.00	7,216,300	
ワコールホールディングス	12,000	2,400.00	28,800,000	
ホギメディカル	8,400	3,485.00	29,274,000	
T S Iホールディングス	22,400	471.00	10,550,400	
マツオカコーポレーション	5,300	1,046.00	5,543,800	
ワールド	8,000	1,315.00	10,520,000	
T I S	70,400	3,995.00	281,248,000	
グリー	33,600	806.00	27,081,600	
コーエーテクモホールディングス	39,200	2,415.00	94,668,000	
三菱総合研究所	3,100	5,060.00	15,686,000	
A G S	6,400	636.00	4,070,400	
ファインデックス	8,000	588.00	4,704,000	
ブレインパッド	6,200	929.00	5,759,800	
K L a b	12,300	502.00	6,174,600	
ポルトゥウィンホールディングス	10,700	938.00	10,036,600	
ネクソン	161,800	2,781.00	449,965,800	
アイスタイル	20,000	503.00	10,060,000	
エムアップホールディングス	7,700	1,367.00	10,525,900	
エイチーム	6,400	804.00	5,145,600	
エニグモ	8,900	602.00	5,357,800	
コロプラ	24,300	690.00	16,767,000	
ブロードリーフ	36,600	500.00	18,300,000	
クロス・マーケティンググループ	5,600	784.00	4,390,400	
デジタルハーツホールディングス	3,900	1,918.00	7,480,200	
システム情報	5,500	906.00	4,983,000	
メディアドゥ	2,500	1,935.00	4,837,500	
じげん	18,300	352.00	6,441,600	
ビィキューブ	7,500	804.00	6,030,000	
サイバーリンクス	3,700	1,108.00	4,099,600	
フィックスターズ	7,100	1,114.00	7,909,400	
CARTA HOLDINGS	3,000	1,697.00	5,091,000	
オブティム	5,400	1,178.00	6,361,200	
セレス	4,800	983.00	4,718,400	
S H I F T	4,600	27,330.00	125,718,000	
特種東海製紙	3,100	2,864.00	8,878,400	
ティーガイア	6,500	1,669.00	10,848,500	
テクマトリックス	11,400	1,661.00	18,935,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,200	2,141.00	41,107,200	
GMOペイメントゲートウェイ	14,300	12,690.00	181,467,000	
インターネットイニシアティブ	34,900	2,375.00	82,887,500	
さくらインターネット	9,200	530.00	4,876,000	

GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	4,310.00	8,189,000	
SRAホールディングス	3,200	3,230.00	10,336,000	
朝日ネット	8,300	581.00	4,822,300	
eBASE	8,800	615.00	5,412,000	
アバントグループ	7,900	1,421.00	11,225,900	
アドソル日進	3,400	1,457.00	4,953,800	
フリービット	4,500	1,180.00	5,310,000	
コムチュア	8,300	2,532.00	21,015,600	
サイバーコム	600	1,517.00	910,200	
アステリア	6,100	824.00	5,026,400	
アイル	3,500	1,890.00	6,615,000	
王子ホールディングス	260,600	529.00	137,857,400	
日本製紙	32,600	961.00	31,328,600	
三菱製紙	8,100	278.00	2,251,800	
北越コーポレーション	39,500	794.00	31,363,000	
大王製紙	27,600	1,092.00	30,139,200	
阿波製紙	14,800	302.00	4,469,600	
マークラインズ	3,400	2,725.00	9,265,000	
メディカル・データ・ビジョン	9,300	1,025.00	9,532,500	
gumi	10,200	783.00	7,986,600	
テラスカイ	2,700	2,337.00	6,309,900	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,300	1,874.00	6,184,200	
PR TIMES	2,100	2,430.00	5,103,000	
ラクス	29,600	1,912.00	56,595,200	
ランドコンピュータ	5,500	878.00	4,829,000	
ダブルスタンダード	2,500	2,254.00	5,635,000	
オープンドア	4,400	1,800.00	7,920,000	
アカツキ	3,000	2,204.00	6,612,000	
Ubicomホールディングス	2,300	2,046.00	4,705,800	
カナミックネットワーク	9,000	674.00	6,066,000	
ノムラシステムコーポレーション	39,000	125.00	4,875,000	
レンゴー	57,000	890.00	50,730,000	
トーモク	3,600	1,625.00	5,850,000	
ザ・バック	4,600	2,504.00	11,518,400	
チェンジ	15,300	2,000.00	30,600,000	
シンクロ・フード	200	569.00	113,800	
オークネット	3,300	1,861.00	6,141,300	
キャピタル・アセット・プランニング	7,600	600.00	4,560,000	
マクロミル	14,200	1,100.00	15,620,000	
ビーグリー	3,500	1,313.00	4,595,500	
オロ	3,100	1,683.00	5,217,300	
ユーザーローカル	3,100	1,579.00	4,894,900	
マネーフォワード	15,100	5,020.00	75,802,000	
昭和電工	60,400	2,179.00	131,611,600	
住友化学	464,000	492.00	228,288,000	
住友精化	2,600	4,010.00	10,426,000	
日産化学	29,700	6,570.00	195,129,000	
ラサ工業	2,400	2,221.00	5,330,400	

クレハ	5,300	10,030.00	53,159,000
多木化学	2,400	5,550.00	13,320,000
テイカ	4,200	1,296.00	5,443,200
石原産業	11,300	1,062.00	12,000,600
片倉コープアグリ	3,900	1,473.00	5,744,700
日本曹達	6,700	4,265.00	28,575,500
東ソー	83,500	1,610.00	134,435,000
トクヤマ	20,200	1,839.00	37,147,800
セントラル硝子	10,000	3,755.00	37,550,000
東亜合成	32,200	1,146.00	36,901,200
大阪ソーダ	3,700	4,150.00	15,355,000
関東電化工業	12,100	986.00	11,930,600
デンカ	22,700	3,320.00	75,364,000
イビデン	36,200	5,570.00	201,634,000
信越化学工業	107,000	17,450.00	1,867,150,000
日本カーバイド工業	3,500	1,292.00	4,522,000
電算システムホールディングス	3,000	2,390.00	7,170,000
堺化学工業	4,800	1,895.00	9,096,000
第一稀元素化学工業	5,700	1,233.00	7,028,100
エア・ウォーター	59,000	1,601.00	94,459,000
日本酸素ホールディングス	60,700	2,287.00	138,820,900
日本化学工業	2,600	1,824.00	4,742,400
日本パーカライジング	31,000	996.00	30,876,000
高圧ガス工業	9,100	662.00	6,024,200
四国化成工業	7,400	1,324.00	9,797,600
ステラ ケミファ	3,700	2,625.00	9,712,500
保土谷化学工業	1,800	3,030.00	5,454,000
日本触媒	9,500	5,450.00	51,775,000
大日精化工業	4,300	1,719.00	7,391,700
カネカ	14,300	3,440.00	49,192,000
協和キリン	75,700	3,270.00	247,539,000
三菱瓦斯化学	46,700	1,942.00	90,691,400
三井化学	52,600	3,095.00	162,797,000
J S R	58,400	2,749.00	160,541,600
東京応化工業	10,900	6,770.00	73,793,000
大阪有機化学工業	4,700	2,139.00	10,053,300
三菱ケミカルグループ	422,100	719.00	303,489,900
K Hネオケム	10,400	2,839.00	29,525,600
ダイセル	92,000	983.00	90,436,000
住友ベークライト	9,300	4,230.00	39,339,000
積水化学工業	129,900	1,924.00	249,927,600
日本ゼオン	37,500	1,358.00	50,925,000
アイカ工業	15,800	3,270.00	51,666,000
U B E	32,200	2,007.00	64,625,400
積水樹脂	9,100	1,801.00	16,389,100
タキロンシーアイ	13,700	515.00	7,055,500
旭有機材	4,200	2,692.00	11,306,400
ニチパン	3,900	1,771.00	6,906,900
リケンテクノス	13,500	502.00	6,777,000
大倉工業	2,900	1,958.00	5,678,200

積水化成品工業	12,500	392.00	4,900,000
群栄化学工業	2,000	2,417.00	4,834,000
ダイキョーニシカワ	13,800	608.00	8,390,400
森六ホールディングス	3,200	1,760.00	5,632,000
恵和	2,000	3,515.00	7,030,000
日本化薬	47,800	1,196.00	57,168,800
カーリットホールディングス	7,200	693.00	4,989,600
CLホールディングス	5,700	838.00	4,776,600
プレステージ・インターナショナル	27,000	722.00	19,494,000
プロトコーポレーション	7,800	1,217.00	9,492,600
アミューズ	3,500	1,710.00	5,985,000
野村総合研究所	128,500	3,355.00	431,117,500
ドリームインキュベータ	2,100	2,789.00	5,856,900
サイバネットシステム	5,200	1,016.00	5,283,200
クイック	4,900	2,035.00	9,971,500
TAC	22,800	203.00	4,628,400
CEホールディングス	9,700	520.00	5,044,000
電通グループ	67,300	4,435.00	298,475,500
インテージホールディングス	8,500	1,455.00	12,367,500
ぴあ	2,200	3,315.00	7,293,000
イオンファンタジー	2,800	2,885.00	8,078,000
ソースネクスト	31,800	260.00	8,268,000
シーティーエス	7,100	833.00	5,914,300
インフォコム	8,100	2,045.00	16,564,500
メディカルシステムネットワーク	11,800	399.00	4,708,200
日本精化	3,600	2,224.00	8,006,400
扶桑化学工業	5,800	3,625.00	21,025,000
トリケミカル研究所	8,300	2,420.00	20,086,000
シンプレクス・ホールディングス	10,500	2,355.00	24,727,500
HEROZ	4,400	1,210.00	5,324,000
ラクスル	8,800	3,045.00	26,796,000
メルカリ	28,200	2,872.00	80,990,400
IPS	2,000	3,115.00	6,230,000
FIG	12,000	419.00	5,028,000
ADEKA	21,800	2,219.00	48,374,200
日油	19,300	5,620.00	108,466,000
ミヨシ油脂	3,300	1,012.00	3,339,600
新日本理化	5,800	265.00	1,537,000
ハリマ化成グループ	5,800	823.00	4,773,400
イーソル	7,600	814.00	6,186,400
アルテリア・ネットワークス	5,800	1,265.00	7,337,000
ウイングアーク1st	6,400	2,297.00	14,700,800
サーバーワークス	1,900	2,746.00	5,217,400
トピラシステムズ	4,900	1,161.00	5,688,900
Sansan	23,400	1,695.00	39,663,000
ギフトィ	6,700	2,137.00	14,317,900
花王	152,300	5,530.00	842,219,000
第一工業製薬	2,600	2,012.00	5,231,200
石原ケミカル	3,900	1,238.00	4,828,200
日華化学	5,500	881.00	4,845,500

三洋化成工業	3,800	4,325.00	16,435,000
ベース	2,100	3,800.00	7,980,000
J M D C	10,300	5,250.00	54,075,000
武田薬品工業	554,200	3,958.00	2,193,523,600
アステラス製薬	600,200	2,104.50	1,263,120,900
住友ファーマ	46,500	1,073.00	49,894,500
塩野義製薬	80,000	6,978.00	558,240,000
わかもと製薬	5,400	232.00	1,252,800
日本新薬	14,800	8,520.00	126,096,000
中外製薬	196,000	3,512.00	688,352,000
科研製薬	10,700	3,945.00	42,211,500
エーザイ	76,200	8,943.00	681,456,600
理研ビタミン	5,300	1,817.00	9,630,100
ロート製薬	30,300	4,325.00	131,047,500
小野薬品工業	120,800	3,505.00	423,404,000
久光製薬	13,900	3,830.00	53,237,000
有機合成薬品工業	15,800	299.00	4,724,200
持田製薬	7,500	3,275.00	24,562,500
参天製薬	121,600	1,122.00	136,435,200
扶桑薬品工業	2,400	2,109.00	5,061,600
ツムラ	19,700	2,987.00	58,843,900
日医工	18,300	58.00	1,061,400
テルモ	195,100	3,949.00	770,449,900
H . U . グループホールディングス	18,800	2,790.00	52,452,000
キッセイ薬品工業	9,700	2,513.00	24,376,100
生化学工業	11,900	949.00	11,293,100
栄研化学	10,200	1,944.00	19,828,800
鳥居薬品	3,400	2,950.00	10,030,000
J C R ファーマ	21,200	1,955.00	41,446,000
東和薬品	9,600	2,094.00	20,102,400
富士製薬工業	4,500	1,032.00	4,644,000
ゼリア新薬工業	8,700	2,214.00	19,261,800
第一三共	545,600	4,615.00	2,517,944,000
キョーリン製薬ホールディングス	13,600	1,842.00	25,051,200
大幸薬品	11,400	538.00	6,133,200
ダイト	4,700	2,578.00	12,116,600
大塚ホールディングス	143,300	4,652.00	666,631,600
大正製薬ホールディングス	13,900	5,500.00	76,450,000
ペプチドリーム	30,400	1,808.00	54,963,200
大日本塗料	7,600	766.00	5,821,600
日本ペイントホールディングス	276,800	1,093.00	302,542,400
関西ペイント	57,300	1,878.00	107,609,400
中国塗料	11,600	1,037.00	12,029,200
藤倉化成	12,300	403.00	4,956,900
太陽ホールディングス	9,500	2,554.00	24,263,000
D I C	24,400	2,470.00	60,268,000
サカタインクス	13,900	1,087.00	15,109,300
東洋インキ S C ホールディングス	12,200	1,860.00	22,692,000
T & K T O K A	5,600	912.00	5,107,200
アルプス技研	5,600	2,120.00	11,872,000

日本空調サービス	6,900	699.00	4,823,100
オリエンタルランド	67,900	19,640.00	1,333,556,000
フォーカスシステムズ	4,800	1,012.00	4,857,600
ダスキン	14,300	2,968.00	42,442,400
パーク24	47,900	2,005.00	96,039,500
明光ネットワークジャパン	8,400	615.00	5,166,000
ファルコホールディングス	2,900	1,784.00	5,173,600
クレスコ	4,800	1,761.00	8,452,800
フジ・メディア・ホールディングス	60,200	1,050.00	63,210,000
秀英予備校	11,100	434.00	4,817,400
ラウンドワン	53,700	567.00	30,447,900
リゾートトラスト	25,300	2,335.00	59,075,500
オービック	20,900	21,800.00	455,620,000
ジャストシステム	9,000	3,315.00	29,835,000
TDCソフト	5,300	1,493.00	7,912,900
Zホールディングス	891,300	359.50	320,422,350
ビー・エム・エル	8,000	3,480.00	27,840,000
トレンドマイクロ	36,200	7,160.00	259,192,000
りらいあコミュニケーションズ	10,600	1,017.00	10,780,200
IDホールディングス	5,300	918.00	4,865,400
リソー教育	29,200	323.00	9,431,600
日本オラクル	12,000	8,580.00	102,960,000
早稲田アカデミー	4,300	1,121.00	4,820,300
アルファシステムズ	2,000	4,385.00	8,770,000
フューチャー	15,600	1,647.00	25,693,200
CAC Holdings	3,800	1,504.00	5,715,200
SBテクノロジー	2,700	2,002.00	5,405,400
トーセ	6,200	770.00	4,774,000
ユー・エス・エス	66,000	2,160.00	142,560,000
オービックビジネスコンサルタント	12,300	4,275.00	52,582,500
伊藤忠テクノソリューションズ	33,600	3,285.00	110,376,000
アイティフォー	8,200	781.00	6,404,200
東京個別指導学院	9,300	536.00	4,984,800
東計電算	900	5,860.00	5,274,000
サイバーエージェント	153,600	1,227.00	188,467,200
楽天グループ	296,900	657.00	195,063,300
エクスネット	4,800	1,010.00	4,848,000
クリーク・アンド・リバー社	3,800	2,047.00	7,778,600
モーニングスター	10,700	442.00	4,729,400
テー・オー・ダブリュー	15,700	297.00	4,662,900
大塚商会	35,500	4,675.00	165,962,500
サイボウズ	8,600	2,126.00	18,283,600
山田コンサルティンググループ	4,200	1,153.00	4,842,600
セントラルスポーツ	2,400	2,429.00	5,829,600
電通国際情報サービス	7,600	4,700.00	35,720,000
ACCESS	7,400	801.00	5,927,400
デジタルガレージ	11,100	4,105.00	45,565,500
イーエムシステムズ	10,400	961.00	9,994,400
ウェザーニューズ	2,200	7,800.00	17,160,000
CIJ	6,000	930.00	5,580,000

日本エンタープライズ	30,300	144.00	4,363,200	
WOWOW	4,000	1,262.00	5,048,000	
スカラ	6,600	748.00	4,936,800	
フルキャストホールディングス	6,100	2,901.00	17,696,100	
エン・ジャパン	11,600	2,328.00	27,004,800	
あすか製薬ホールディングス	6,500	1,203.00	7,819,500	
サワイグループホールディングス	14,300	4,210.00	60,203,000	
富士フイルムホールディングス	120,200	7,335.00	881,667,000	
コニカミノルタ	140,900	557.00	78,481,300	
資生堂	130,800	5,784.00	756,547,200	
ライオン	75,100	1,475.00	110,772,500	
高砂香料工業	4,200	2,875.00	12,075,000	
マンダム	13,500	1,380.00	18,630,000	
ミルボン	9,300	5,650.00	52,545,000	
ファンケル	27,400	2,649.00	72,582,600	
コーセー	12,700	14,590.00	185,293,000	
コタ	5,200	1,648.00	8,569,600	
シーボン	2,900	1,588.00	4,605,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	32,100	1,779.00	57,105,900	
ノエビアホールディングス	5,600	5,710.00	31,976,000	
アジュバンホールディングス	5,000	927.00	4,635,000	
新日本製薬	3,600	1,410.00	5,076,000	
エステー	4,800	1,536.00	7,372,800	
アグロ カネショウ	3,600	1,489.00	5,360,400	
コニシ	10,500	1,789.00	18,784,500	
長谷川香料	13,000	2,943.00	38,259,000	
星光PMC	8,900	529.00	4,708,100	
小林製薬	19,200	8,640.00	165,888,000	
荒川化学工業	5,300	975.00	5,167,500	
メック	5,200	2,470.00	12,844,000	
日本高純度化学	2,100	2,462.00	5,170,200	
タカラバイオ	16,900	1,811.00	30,605,900	
JCU	7,100	3,260.00	23,146,000	
新田ゼラチン	500	1,034.00	517,000	
OATアグリオ	2,800	1,675.00	4,690,000	
デクセリアルズ	18,100	3,285.00	59,458,500	
アース製薬	5,700	5,440.00	31,008,000	
北興化学工業	6,300	913.00	5,751,900	
大成ラミック	2,000	3,060.00	6,120,000	
クミアイ化学工業	24,900	930.00	23,157,000	
日本農薬	11,500	718.00	8,257,000	
ニチレキ	7,400	1,260.00	9,324,000	
ユシロ化学工業	6,000	793.00	4,758,000	
富士石油	15,800	272.00	4,297,600	
MORESCO	900	1,100.00	990,000	
出光興産	69,600	3,150.00	219,240,000	
ENEOSホールディングス	1,131,500	463.50	524,450,250	
コスモエネルギーホールディングス	23,800	3,860.00	91,868,000	
テスホールディングス	6,600	1,096.00	7,233,600	
インフロニア・ホールディングス	64,200	1,045.00	67,089,000	

横浜ゴム	35,600	2,137.00	76,077,200
TOYO TIRE	36,000	1,533.00	55,188,000
ブリヂストン	200,000	5,283.00	1,056,600,000
住友ゴム工業	61,400	1,153.00	70,794,200
藤倉コンポジット	2,600	875.00	2,275,000
オカモト	3,500	3,780.00	13,230,000
アキレス	4,100	1,378.00	5,649,800
フコク	4,800	1,047.00	5,025,600
ニッタ	6,400	2,936.00	18,790,400
住友理工	12,100	610.00	7,381,000
三ツ星ベルト	9,100	3,485.00	31,713,500
バンドー化学	9,900	1,012.00	10,018,800
A G C	63,700	4,550.00	289,835,000
日本板硝子	31,900	550.00	17,545,000
有沢製作所	10,200	1,282.00	13,076,400
日本電気硝子	25,600	2,591.00	66,329,600
オハラ	3,900	1,295.00	5,050,500
住友大阪セメント	8,800	3,200.00	28,160,000
太平洋セメント	39,900	2,102.00	83,869,800
日本ヒューム	7,800	648.00	5,054,400
日本コンクリート工業	20,300	233.00	4,729,900
三谷セキサン	2,600	4,110.00	10,686,000
アジアパイルホールディングス	9,800	512.00	5,017,600
東海カーボン	52,500	1,058.00	55,545,000
日本カーボン	3,600	4,345.00	15,642,000
東洋炭素	3,900	3,810.00	14,859,000
ノリタケカンパニーリミテド	3,100	4,025.00	12,477,500
T O T O	41,300	4,705.00	194,316,500
日本碍子	74,100	1,754.00	129,971,400
日本特殊陶業	47,700	2,654.00	126,595,800
M A R U W A	2,300	18,360.00	42,228,000
品川リフラクトリーズ	1,800	3,990.00	7,182,000
黒崎播磨	1,300	4,995.00	6,493,500
ヨータイ	4,200	1,368.00	5,745,600
ニッカトー	5,200	497.00	2,584,400
フジインコーポレーテッド	5,000	6,920.00	34,600,000
クニミネ工業	3,100	825.00	2,557,500
ニチアス	15,800	2,419.00	38,220,200
日本製鉄	288,500	2,228.00	642,778,000
神戸製鋼所	129,600	611.00	79,185,600
中山製鋼所	13,300	774.00	10,294,200
合同製鐵	3,200	1,928.00	6,169,600
J F E ホールディングス	172,200	1,494.00	257,266,800
東京製鐵	18,100	1,381.00	24,996,100
共英製鋼	7,300	1,327.00	9,687,100
大和工業	10,600	4,795.00	50,827,000
東京鐵鋼	3,400	1,402.00	4,766,800
大阪製鐵	4,400	1,160.00	5,104,000
淀川製鋼所	7,300	2,560.00	18,688,000
丸一鋼管	19,600	2,884.00	56,526,400

大同特殊鋼	8,100	4,355.00	35,275,500
日本高周波鋼業	15,200	319.00	4,848,800
日本冶金工業	4,700	4,070.00	19,129,000
山陽特殊製鋼	6,400	2,277.00	14,572,800
愛知製鋼	3,700	2,332.00	8,628,400
日立金属	60,100	2,171.00	130,477,100
大平洋金属	4,600	1,920.00	8,832,000
新日本電工	41,200	450.00	18,540,000
栗本鐵工所	3,100	1,770.00	5,487,000
日本製鋼所	17,400	3,015.00	52,461,000
三菱製鋼	5,000	997.00	4,985,000
日亜鋼業	18,500	237.00	4,384,500
日本精線	1,200	4,310.00	5,172,000
エンビプロ・ホールディングス	300	752.00	225,600
大紀アルミニウム工業所	9,200	1,346.00	12,383,200
日本軽金属ホールディングス	17,400	1,548.00	26,935,200
三井金属鉱業	18,700	3,140.00	58,718,000
東邦亜鉛	3,800	2,125.00	8,075,000
三菱マテリアル	43,000	2,142.00	92,106,000
住友金属鉱山	74,700	4,542.00	339,287,400
DOWAホールディングス	14,500	4,455.00	64,597,500
古河機械金属	9,400	1,265.00	11,891,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,500	3,820.00	36,290,000
東邦チタニウム	11,700	2,685.00	31,414,500
UACJ	9,000	2,213.00	19,917,000
CKサンエツ	1,600	4,050.00	6,480,000
古河電気工業	21,500	2,535.00	54,502,500
住友電気工業	222,500	1,611.50	358,558,750
フジクラ	69,100	1,123.00	77,599,300
昭和電線ホールディングス	7,200	1,645.00	11,844,000
東京特殊電線	1,200	5,640.00	6,768,000
タツタ電線	13,200	434.00	5,728,800
平河ヒューテック	4,300	1,113.00	4,785,900
いよぎんホールディングス	73,200	654.00	47,872,800
しずおかフィナンシャルグループ	139,000	941.00	130,799,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	51,800	913.00	47,293,400
リョービ	6,900	1,232.00	8,500,800
アーレスティ	7,800	388.00	3,026,400
アサヒホールディングス	26,100	2,009.00	52,434,900
東洋製罐グループホールディングス	42,600	1,580.00	67,308,000
ホッカンホールディングス	3,700	1,321.00	4,887,700
コロナ	5,700	848.00	4,833,600
横河ブリッジホールディングス	8,500	1,893.00	16,090,500
三和ホールディングス	59,300	1,267.00	75,133,100
文化シャッター	18,500	1,130.00	20,905,000
三協立山	8,800	570.00	5,016,000
アルインコ	5,000	996.00	4,980,000
LIXIL	93,900	2,118.00	198,880,200
日本フィルコン	9,800	479.00	4,694,200
ノーリツ	9,500	1,493.00	14,183,500

長府製作所	6,500	1,990.00	12,935,000
リンナイ	11,700	10,170.00	118,989,000
ユニプレス	11,200	883.00	9,889,600
ダイニチ工業	7,200	666.00	4,795,200
日東精工	9,300	516.00	4,798,800
三洋工業	2,900	1,716.00	4,976,400
岡部	10,400	713.00	7,415,200
ジーテクト	7,200	1,508.00	10,857,600
東プレ	11,400	1,245.00	14,193,000
高周波熱錬	10,500	671.00	7,045,500
東京製綱	5,400	881.00	4,757,400
サンコール	2,500	635.00	1,587,500
モリテックスチール	7,200	244.00	1,756,800
パイオラックス	8,900	1,746.00	15,539,400
エイチワン	7,900	653.00	5,158,700
日本発条	57,000	907.00	51,699,000
三浦工業	26,300	3,335.00	87,710,500
タクマ	19,400	1,289.00	25,006,600
テクノプロ・ホールディングス	43,000	3,830.00	164,690,000
インターワークス	12,900	371.00	4,785,900
アイ・アールジャパンホールディングス	3,300	1,834.00	6,052,200
Keeper 技研	4,600	4,055.00	18,653,000
三機サービス	4,800	927.00	4,449,600
イー・ガーディアン	2,400	2,823.00	6,775,200
リブセンス	1,800	299.00	538,200
ジャパンマテリアル	19,600	2,507.00	49,137,200
ベクトル	10,100	1,191.00	12,029,100
ウチヤマホールディングス	15,900	274.00	4,356,600
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,105.00	5,856,500
キャリアリンク	2,400	3,055.00	7,332,000
IBJ	5,000	985.00	4,925,000
アサンテ	3,200	1,594.00	5,100,800
バリューHR	5,600	1,520.00	8,512,000
M&Aキャピタルパートナーズ	5,900	4,915.00	28,998,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,087.00	5,108,900
シグマクシス・ホールディングス	9,700	1,297.00	12,580,900
ウィルグループ	5,300	1,340.00	7,102,000
メドピア	5,000	1,717.00	8,585,000
リクルートホールディングス	475,200	4,430.00	2,105,136,000
エラン	8,500	1,011.00	8,593,500
ツガミ	14,000	1,118.00	15,652,000
オークマ	6,300	5,150.00	32,445,000
芝浦機械	7,000	2,620.00	18,340,000
アマダ	100,600	1,109.00	111,565,400
アイダエンジニアリング	13,000	813.00	10,569,000
TAKISAWA	4,000	1,087.00	4,348,000
FUJI	27,400	2,095.00	57,403,000
牧野フライス製作所	7,000	4,495.00	31,465,000

オーエスジー	30,100	1,984.00	59,718,400
ダイジェット工業	5,300	839.00	4,446,700
旭ダイヤモンド工業	18,200	721.00	13,122,200
D M G 森精機	38,200	1,843.00	70,402,600
ソディック	17,400	772.00	13,432,800
ディスコ	10,100	40,500.00	409,050,000
日東工器	3,100	1,547.00	4,795,700
日進工具	5,300	1,097.00	5,814,100
パンチ工業	10,500	424.00	4,452,000
日本郵政	841,300	1,058.00	890,095,400
ベルシステム24ホールディングス	8,600	1,308.00	11,248,800
鎌倉新書	7,300	769.00	5,613,700
S M N	8,300	458.00	3,801,400
エアトリ	4,100	2,573.00	10,549,300
アトラエ	5,000	1,485.00	7,425,000
ストライク	3,200	4,265.00	13,648,000
ソラスト	17,700	815.00	14,425,500
インソース	8,000	3,255.00	26,040,000
豊田自動織機	45,700	7,690.00	351,433,000
東洋機械金属	7,200	546.00	3,931,200
エンシュウ	5,600	720.00	4,032,000
島精機製作所	10,000	2,024.00	20,240,000
オプトラン	9,300	2,624.00	24,403,200
N C ホールディングス	2,200	2,084.00	4,584,800
イワキ	4,200	1,284.00	5,392,800
フリー	6,600	1,149.00	7,583,400
ヤマシンフィルタ	15,000	493.00	7,395,000
日阪製作所	6,100	825.00	5,032,500
やまびこ	10,300	1,140.00	11,742,000
野村マイクロ・サイエンス	2,100	4,770.00	10,017,000
平田機工	3,000	5,600.00	16,800,000
ペガサスミシン製造	7,000	939.00	6,573,000
マルマエ	3,000	1,888.00	5,664,000
タツモ	3,500	1,810.00	6,335,000
ナブテスコ	39,600	3,330.00	131,868,000
三井海洋開発	7,900	1,576.00	12,450,400
レオン自動機	6,600	1,118.00	7,378,800
S M C	20,500	64,240.00	1,316,920,000
ホソカワミクロン	4,800	2,870.00	13,776,000
ユニオンツール	2,800	3,645.00	10,206,000
オイレス工業	8,800	1,489.00	13,103,200
日精エー・エス・ビー機械	2,900	4,005.00	11,614,500
サトーホールディングス	9,000	1,939.00	17,451,000
技研製作所	6,600	3,345.00	22,077,000
日本エアーテック	4,300	1,159.00	4,983,700
カワタ	4,900	830.00	4,067,000
日精樹脂工業	5,000	938.00	4,690,000
小松製作所	295,500	3,098.00	915,459,000
住友重機械工業	37,300	2,860.00	106,678,000
日立建機	25,100	3,095.00	77,684,500

日工	9,300	618.00	5,747,400
巴工業	2,700	2,451.00	6,617,700
井関農機	5,900	1,245.00	7,345,500
T O W A	6,400	2,027.00	12,972,800
北川鉄工所	3,800	1,160.00	4,408,000
シンニッタン	14,800	219.00	3,241,200
ローツェ	3,300	8,530.00	28,149,000
タカキタ	9,600	469.00	4,502,400
クボタ	333,700	2,055.00	685,753,500
荏原実業	3,100	2,190.00	6,789,000
三菱化工機	2,300	2,123.00	4,882,900
月島機械	8,500	986.00	8,381,000
帝国電機製作所	4,800	2,368.00	11,366,400
新東工業	12,700	676.00	8,585,200
澁谷工業	5,900	2,483.00	14,649,700
アイチコーポレーション	8,900	810.00	7,209,000
小森コーポレーション	14,600	828.00	12,088,800
鶴見製作所	4,800	2,053.00	9,854,400
荏原製作所	25,800	5,030.00	129,774,000
石井鐵工所	1,700	2,480.00	4,216,000
西島製作所	5,400	1,397.00	7,543,800
北越工業	6,300	1,160.00	7,308,000
ダイキン工業	75,300	22,580.00	1,700,274,000
オルガノ	8,700	2,874.00	25,003,800
トーヨーカネツ	2,400	2,440.00	5,856,000
栗田工業	35,300	6,060.00	213,918,000
椿本チエイン	8,900	3,170.00	28,213,000
大同工業	3,900	764.00	2,979,600
日機装	15,600	1,008.00	15,724,800
木村化工機	6,700	683.00	4,576,100
レイズネクスト	8,900	1,228.00	10,929,200
アネスト岩田	10,700	917.00	9,811,900
ダイフク	32,500	7,070.00	229,775,000
サムコ	2,100	3,710.00	7,791,000
加藤製作所	6,000	777.00	4,662,000
タダノ	33,300	924.00	30,769,200
フジテック	23,100	3,055.00	70,570,500
C K D	17,400	2,062.00	35,878,800
キトー	5,400	2,718.00	14,677,200
平和	21,000	2,389.00	50,169,000
理想科学工業	5,600	2,274.00	12,734,400
S A N K Y O	12,400	4,775.00	59,210,000
日本金銭機械	6,900	864.00	5,961,600
マースグループホールディングス	3,700	1,966.00	7,274,200
フクシマガリレイ	4,600	4,240.00	19,504,000
ダイコク電機	3,500	1,449.00	5,071,500
竹内製作所	11,400	3,050.00	34,770,000
アマノ	17,900	2,498.00	44,714,200
J U K I	9,800	663.00	6,497,400
ジャノメ	7,600	633.00	4,810,800

ブラザー工業	84,300	2,197.00	185,207,100	
マックス	7,800	2,018.00	15,740,400	
モリタホールディングス	11,000	1,232.00	13,552,000	
グローリー	16,300	2,202.00	35,892,600	
新晃工業	6,400	1,548.00	9,907,200	
大和冷機工業	9,700	1,245.00	12,076,500	
セガサミーホールディングス	50,700	1,802.00	91,361,400	
リケン	2,500	2,276.00	5,690,000	
T P R	7,400	1,231.00	9,109,400	
ツバキ・ナカシマ	15,500	1,032.00	15,996,000	
ホシザキ	40,600	4,605.00	186,963,000	
大豊工業	6,700	711.00	4,763,700	
日本精工	115,900	769.00	89,127,100	
N T N	124,300	283.00	35,176,900	
ジェイテクト	56,100	1,012.00	56,773,200	
不二越	4,700	4,045.00	19,011,500	
ミネベアミツミ	109,700	2,214.00	242,875,800	
日本トムソン	15,400	597.00	9,193,800	
T H K	36,400	2,689.00	97,879,600	
ユーシン精機	7,100	684.00	4,856,400	
前澤給装工業	5,300	919.00	4,870,700	
イーグル工業	7,000	1,108.00	7,756,000	
日本ピラー工業	5,800	2,748.00	15,938,400	
キッツ	23,200	851.00	19,743,200	
日立製作所	316,700	7,297.00	2,310,959,900	
東芝	121,400	4,882.00	592,674,800	
三菱電機	651,800	1,392.00	907,305,600	
富士電機	38,300	5,870.00	224,821,000	
東洋電機製造	5,300	860.00	4,558,000	
安川電機	74,700	4,405.00	329,053,500	
シンフォニア テクノロジー	7,000	1,447.00	10,129,000	
明電舎	9,600	2,033.00	19,516,800	
オリジン	1,600	1,311.00	2,097,600	
山洋電気	2,700	6,090.00	16,443,000	
デンヨー	4,800	1,464.00	7,027,200	
P H C ホールディングス	8,800	1,645.00	14,476,000	
ベイカレント・コンサルティング	50,800	4,360.00	221,488,000	
Orchestra Holdings	1,900	2,326.00	4,419,400	
アイモバイル	4,000	1,272.00	5,088,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	22,800	1,677.00	38,235,600	
G A M E W I T H	10,800	377.00	4,071,600	
ウェルビー	5,700	909.00	5,181,300	
ミダックホールディングス	3,900	3,190.00	12,441,000	
キュービーネットホールディングス	3,600	1,418.00	5,104,800	
R P A ホールディングス	17,300	290.00	5,017,000	
三櫻工業	9,500	656.00	6,232,000	
マキタ	78,500	3,050.00	239,425,000	
東芝テック	9,400	3,695.00	34,733,000	

芝浦メカトロニクス	1,200	11,520.00	13,824,000	
マブチモーター	15,700	4,155.00	65,233,500	
日本電産	153,200	8,680.00	1,329,776,000	
トレックス・セミコンダクター	3,000	2,962.00	8,886,000	
東光高岳	3,800	1,867.00	7,094,600	
ダブル・スコープ	20,600	1,800.00	37,080,000	
ダイヘン	5,700	4,130.00	23,541,000	
ヤーマン	12,300	1,308.00	16,088,400	
JVCケンウッド	57,400	382.00	21,926,800	
I - P E X	3,600	1,310.00	4,716,000	
日新電機	15,100	1,397.00	21,094,700	
大崎電気工業	15,000	526.00	7,890,000	
オムロン	57,800	7,060.00	408,068,000	
日東工業	8,500	2,255.00	19,167,500	
I D E C	9,300	3,155.00	29,341,500	
不二電機工業	4,100	1,120.00	4,592,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20,700	2,156.00	44,629,200	
サクサホールディングス	3,800	1,376.00	5,228,800	
メルコホールディングス	1,700	3,155.00	5,363,500	
日本電気	89,200	4,865.00	433,958,000	
富士通	62,800	18,530.00	1,163,684,000	
沖電気工業	28,500	742.00	21,147,000	
岩崎通信機	6,000	782.00	4,692,000	
電気興業	3,000	2,121.00	6,363,000	
サンケン電気	5,900	7,110.00	41,949,000	
アイホン	3,800	1,853.00	7,041,400	
ルネサスエレクトロニクス	411,300	1,384.50	569,444,850	
セイコーエプソン	84,000	2,150.00	180,600,000	
ワコム	50,000	652.00	32,600,000	
アルバック	15,000	6,000.00	90,000,000	
E I Z O	4,600	3,830.00	17,618,000	
ジャパンディスプレイ	242,200	47.00	11,383,400	
日本信号	14,400	1,036.00	14,918,400	
京三製作所	13,200	414.00	5,464,800	
能美防災	8,500	1,612.00	13,702,000	
ホーチキ	4,700	1,359.00	6,387,300	
星和電機	10,400	449.00	4,669,600	
エレコム	15,100	1,494.00	22,559,400	
パナソニック ホールディングス	745,000	1,261.50	939,817,500	
シャープ	75,900	978.00	74,230,200	
アンリツ	44,400	1,511.00	67,088,400	
富士通ゼネラル	17,900	3,215.00	57,548,500	
ソニーグループ	441,700	11,255.00	4,971,333,500	
T D K	99,900	4,945.00	494,005,500	
帝国通信工業	3,200	1,428.00	4,569,600	
タムラ製作所	27,100	806.00	21,842,600	
アルプスアルパイン	56,300	1,331.00	74,935,300	
池上通信機	8,000	531.00	4,248,000	
日本電波工業	7,600	1,660.00	12,616,000	
メイコー	6,900	3,155.00	21,769,500	

ローランド ディー・ジー・	3,500	3,160.00	11,060,000	
フォスター電機	6,000	971.00	5,826,000	
S M K	1,800	2,715.00	4,887,000	
ヨコオ	5,000	2,478.00	12,390,000	
ホシデン	15,100	1,796.00	27,119,600	
ヒロセ電機	10,400	18,440.00	191,776,000	
日本航空電子工業	12,900	2,424.00	31,269,600	
T O A	7,300	767.00	5,599,100	
マクセル	13,700	1,395.00	19,111,500	
古野電気	8,200	1,017.00	8,339,400	
スミダコーポレーション	5,800	1,429.00	8,288,200	
アイコム	2,400	2,641.00	6,338,400	
リオン	2,600	1,982.00	5,153,200	
横河電機	69,000	2,498.00	172,362,000	
新電元工業	2,400	3,400.00	8,160,000	
アズビル	43,600	4,075.00	177,670,000	
東亜ディーケーケー	5,400	853.00	4,606,200	
日本光電工業	28,800	3,230.00	93,024,000	
共和電業	11,800	346.00	4,082,800	
日本電子材料	4,100	1,538.00	6,305,800	
堀場製作所	13,900	6,450.00	89,655,000	
アドバンテスト	49,200	9,120.00	448,704,000	
小野測器	11,300	385.00	4,350,500	
エスベック	5,000	2,067.00	10,335,000	
キーエンス	62,500	58,760.00	3,672,500,000	
日置電機	3,300	6,890.00	22,737,000	
シスメックス	53,900	8,454.00	455,670,600	
日本マイクロニクス	10,300	1,479.00	15,233,700	
メガチップス	5,100	2,541.00	12,959,100	
O B A R A G R O U P	2,900	3,595.00	10,425,500	
澤藤電機	3,300	1,300.00	4,290,000	
デンソー	128,800	7,604.00	979,395,200	
原田工業	5,500	812.00	4,466,000	
コーセル	8,300	861.00	7,146,300	
イリソ電子工業	5,700	5,080.00	28,956,000	
オブテックスグループ	11,500	2,077.00	23,885,500	
千代田インテグレ	2,500	2,400.00	6,000,000	
レーザーテック	30,800	25,135.00	774,158,000	
スタンレー電気	44,400	2,880.00	127,872,000	
岩崎電気	2,000	2,528.00	5,056,000	
ウシオ電機	32,600	1,776.00	57,897,600	
岡谷電機産業	100	267.00	26,700	
日本セラミック	6,400	2,632.00	16,844,800	
遠藤照明	6,300	744.00	4,687,200	
古河電池	4,600	1,087.00	5,000,200	
山一電機	5,400	1,910.00	10,314,000	
図研	5,400	3,195.00	17,253,000	
日本電子	15,600	5,020.00	78,312,000	
カシオ計算機	46,500	1,360.00	63,240,000	
ファナック	61,300	20,515.00	1,257,569,500	

日本シイエムケイ	13,300	595.00	7,913,500
エンプラス	1,800	4,440.00	7,992,000
大真空	7,600	857.00	6,513,200
ローム	28,900	10,790.00	311,831,000
浜松ホトニクス	50,100	7,190.00	360,219,000
三井ハイテック	6,500	8,230.00	53,495,000
新光電気工業	22,100	4,005.00	88,510,500
京セラ	97,000	7,019.00	680,843,000
太陽誘電	30,400	4,395.00	133,608,000
村田製作所	189,400	7,640.00	1,447,016,000
双葉電子工業	11,900	585.00	6,961,500
日東電工	45,500	8,640.00	393,120,000
北陸電気工業	4,300	1,274.00	5,478,200
東海理化電機製作所	17,600	1,599.00	28,142,400
ニチコン	12,800	1,429.00	18,291,200
日本ケミコン	6,200	1,824.00	11,308,800
K O A	9,500	2,251.00	21,384,500
三井E & Sホールディングス	28,500	422.00	12,027,000
日立造船	51,700	873.00	45,134,100
三菱重工業	110,300	5,196.00	573,118,800
川崎重工業	47,100	2,860.00	134,706,000
I H I	39,700	3,400.00	134,980,000
名村造船所	16,000	498.00	7,968,000
マネジメントソリューションズ	3,500	3,855.00	13,492,500
プロレド・パートナーズ	9,400	528.00	4,963,200
and factory	11,700	389.00	4,551,300
カーブスホールディングス	19,700	900.00	17,730,000
フォーラムエンジニアリング	5,700	852.00	4,856,400
日本車輛製造	2,500	1,965.00	4,912,500
三菱ロジスネクスト	10,000	884.00	8,840,000
フルサト・マルカホールディングス	6,600	3,575.00	23,595,000
ヤマエグループホールディングス	3,700	1,444.00	5,342,800
F P G	25,000	1,076.00	26,900,000
島根銀行	9,900	418.00	4,138,200
じもとホールディングス	8,400	399.00	3,351,600
全国保証	16,100	5,060.00	81,466,000
めぶきフィナンシャルグループ	305,200	297.00	90,644,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,000	1,268.00	6,340,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	2,204.00	17,411,600
九州フィナンシャルグループ	108,200	380.00	41,116,000
かんぽ生命保険	74,700	2,197.00	164,115,900
ゆうちょ銀行	175,100	1,026.00	179,652,600
富山第一銀行	15,300	404.00	6,181,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	339,000	466.00	157,974,000
ジェイリース	2,100	2,986.00	6,270,600
西日本フィナンシャルホールディングス	38,900	828.00	32,209,200
イントラスト	4,200	755.00	3,171,000

アルヒ	12,600	1,060.00	13,356,000
プレミアグループ	10,300	1,789.00	18,426,700
日産自動車	887,100	497.70	441,509,670
いすゞ自動車	181,500	1,796.00	325,974,000
トヨタ自動車	3,428,900	2,003.00	6,868,086,700
日野自動車	80,500	632.00	50,876,000
三菱自動車工業	243,600	591.00	143,967,600
エフテック	9,000	520.00	4,680,000
武蔵精密工業	15,300	1,792.00	27,417,600
日産車体	11,000	825.00	9,075,000
新明和工業	19,600	1,019.00	19,972,400
極東開発工業	11,000	1,359.00	14,949,000
トビー工業	5,100	1,696.00	8,649,600
ティラド	1,700	2,531.00	4,302,700
曙ブレーキ工業	38,200	163.00	6,226,600
タチエス	9,900	1,132.00	11,206,800
NOK	24,300	1,291.00	31,371,300
フタバ産業	16,700	361.00	6,028,700
KYB	6,000	3,530.00	21,180,000
大同メタル工業	12,200	486.00	5,929,200
プレス工業	27,900	427.00	11,913,300
ミクニ	13,600	355.00	4,828,000
太平洋工業	14,300	1,063.00	15,200,900
アイシン	48,200	3,820.00	184,124,000
マツダ	206,600	1,105.00	228,293,000
今仙電機製作所	2,500	541.00	1,352,500
本田技研工業	507,600	3,348.00	1,699,444,800
スズキ	114,700	5,048.00	579,005,600
SUBARU	197,600	2,310.00	456,456,000
ヤマハ発動機	98,100	3,395.00	333,049,500
小糸製作所	75,100	2,230.00	167,473,000
エクセディ	10,200	1,672.00	17,054,400
ミツバ	11,700	522.00	6,107,400
豊田合成	18,200	2,335.00	42,497,000
愛三工業	10,300	709.00	7,302,700
盟和産業	4,800	928.00	4,454,400
ヨロズ	5,900	809.00	4,773,100
エフ・シー・シー	11,100	1,429.00	15,861,900
シマノ	25,500	23,040.00	587,520,000
テイ・エス テック	28,600	1,689.00	48,305,400
三十三フィナンシャルグループ	5,500	1,440.00	7,920,000
第四北越フィナンシャルグループ	9,700	2,542.00	24,657,400
ひろぎんホールディングス	80,200	614.00	49,242,800
マーキュリアホールディングス	5,000	621.00	3,105,000
おきなわフィナンシャルグループ	5,900	2,043.00	12,053,700
ダイレクトマーケティングミックス	7,300	1,500.00	10,950,000
ポピンズ	3,200	1,662.00	5,318,400
LITALICO	5,000	2,418.00	12,090,000
十六フィナンシャルグループ	8,000	2,460.00	19,680,000
北國フィナンシャルホールディングス	5,200	4,220.00	21,944,000

ネットプロテクションズホールディングス	20,300	502.00	10,190,600	
プロクレアホールディングス	7,500	2,073.00	15,547,500	
あいちフィナンシャルグループ	8,600	2,095.00	18,017,000	
ジャムコ	3,400	1,596.00	5,426,400	
小野建	6,100	1,459.00	8,899,900	
はるやまホールディングス	11,000	438.00	4,818,000	
南陽	2,700	1,806.00	4,876,200	
ノジマ	21,600	1,313.00	28,360,800	
佐鳥電機	4,100	1,392.00	5,707,200	
カッパ・クリエイト	10,400	1,406.00	14,622,400	
伯東	3,800	3,685.00	14,003,000	
コンドーテック	5,100	991.00	5,054,100	
中山福	14,500	329.00	4,770,500	
ライトオン	6,600	635.00	4,191,000	
ナガイレーベン	8,300	2,048.00	16,998,400	
三菱食品	6,100	3,305.00	20,160,500	
良品計画	85,200	1,451.00	123,625,200	
松田産業	5,000	2,286.00	11,430,000	
第一興商	12,800	4,010.00	51,328,000	
メディバルホールディングス	68,500	1,792.00	122,752,000	
アドヴァングループ	6,300	895.00	5,638,500	
S P K	3,400	1,403.00	4,770,200	
萩原電気ホールディングス	2,500	2,583.00	6,457,500	
アルビス	2,200	2,315.00	5,093,000	
アズワン	9,700	6,320.00	61,304,000	
スズデン	2,300	2,373.00	5,457,900	
シモジマ	4,700	990.00	4,653,000	
ドウシシャ	7,000	1,529.00	10,703,000	
小津産業	2,600	1,459.00	3,793,400	
コナカ	14,200	335.00	4,757,000	
高速	3,400	1,760.00	5,984,000	
ハウス オブ ローゼ	2,900	1,603.00	4,648,700	
G - 7ホールディングス	8,200	1,541.00	12,636,200	
イオン北海道	9,800	1,208.00	11,838,400	
コジマ	12,700	615.00	7,810,500	
ヒマラヤ	4,900	929.00	4,552,100	
コーナン商事	8,900	3,305.00	29,414,500	
ネットワンシステムズ	23,300	3,575.00	83,297,500	
エコス	2,700	1,835.00	4,954,500	
ワタミ	8,000	1,053.00	8,424,000	
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	148,200	2,417.00	358,199,400	
丸文	5,900	919.00	5,422,100	
西松屋チェーン	14,600	1,378.00	20,118,800	
ゼンショーホールディングス	36,200	3,565.00	129,053,000	
ハビネット	5,600	1,833.00	10,264,800	
橋本総業ホールディングス	4,900	994.00	4,870,600	
日本ライフライン	19,400	954.00	18,507,600	
サイゼリヤ	11,000	2,920.00	32,120,000	

VTホールディングス	25,100	496.00	12,449,600
アルゴグラフィックス	5,700	3,645.00	20,776,500
魚力	2,300	2,155.00	4,956,500
IDOM	20,000	735.00	14,700,000
日本エム・ディ・エム	4,800	1,032.00	4,953,600
フジ・コーポレーション	3,900	1,269.00	4,949,100
ユナイテッドアローズ	7,100	1,905.00	13,525,500
進和	4,400	2,015.00	8,866,000
ダイترون	2,600	2,424.00	6,302,400
ハイデイ日高	9,800	1,959.00	19,198,200
シークス	9,400	1,329.00	12,492,600
コロワイド	30,400	1,841.00	55,966,400
ピーシーデボコーポレーション	18,300	297.00	5,435,100
田中商事	8,300	549.00	4,556,700
オーハシテクニカ	3,400	1,436.00	4,882,400
壱番屋	5,200	4,615.00	23,998,000
白銅	2,400	2,494.00	5,985,600
スギホールディングス	13,300	6,320.00	84,056,000
薬王堂ホールディングス	3,700	2,566.00	9,494,200
島津製作所	76,100	4,190.00	318,859,000
JMS	9,600	501.00	4,809,600
長野計器	4,500	1,166.00	5,247,000
ブイ・テクノロジー	3,100	2,859.00	8,862,900
スター精密	11,900	1,690.00	20,111,000
東京計器	4,800	1,164.00	5,587,200
愛知時計電機	3,600	1,383.00	4,978,800
インターアクション	3,800	1,538.00	5,844,400
オーバル	6,800	538.00	3,658,400
東京精密	13,700	4,420.00	60,554,000
マニー	27,500	2,228.00	61,270,000
ニコン	97,100	1,321.00	128,269,100
トプコン	32,900	1,614.00	53,100,600
オリンパス	390,400	2,733.00	1,066,963,200
理研計器	3,900	5,070.00	19,773,000
SCREENホールディングス	10,700	8,970.00	95,979,000
キヤノン電子	6,900	1,588.00	10,957,200
タムロン	4,700	3,190.00	14,993,000
HOYA	134,900	14,300.00	1,929,070,000
シード	2,600	491.00	1,276,600
ノーリツ鋼機	5,900	2,570.00	15,163,000
A&Dホロンホールディングス	9,100	1,024.00	9,318,400
朝日インテック	82,500	2,503.00	206,497,500
キヤノン	342,600	3,180.00	1,089,468,000
リコー	163,700	1,057.00	173,030,900
シチズン時計	68,700	592.00	40,670,400
リズム	1,200	1,742.00	2,090,400
メニコン	21,400	2,830.00	60,562,000
KYORITSU	25,700	129.00	3,315,300
スノーピーク	10,700	2,167.00	23,186,900
パラマウントベッドホールディングス	14,400	2,586.00	37,238,400

トランザクション	4,800	1,181.00	5,668,800
粧美堂	2,200	355.00	781,000
ニホンフラッシュ	5,900	975.00	5,752,500
前田工織	6,800	3,400.00	23,120,000
永大産業	18,700	224.00	4,188,800
アートネイチャー	6,400	752.00	4,812,800
パンダイナムコホールディングス	57,000	8,855.00	504,735,000
アイフィスジャパン	7,000	618.00	4,326,000
SHOEI	6,600	5,800.00	38,280,000
フランスベッドホールディングス	7,700	918.00	7,068,600
マーベラス	10,200	684.00	6,976,800
パイロットコーポレーション	9,800	4,945.00	48,461,000
エイベックス	10,600	1,545.00	16,377,000
フジシールインターナショナル	12,600	1,816.00	22,881,600
タカラトミー	28,800	1,207.00	34,761,600
広済堂ホールディングス	4,200	1,913.00	8,034,600
レック	8,900	818.00	7,280,200
プロネクス	5,200	959.00	4,986,800
大建工業	3,800	2,113.00	8,029,400
きもと	5,500	234.00	1,287,000
凸版印刷	81,700	2,109.00	172,305,300
大日本印刷	74,100	2,802.00	207,628,200
共同印刷	1,900	2,896.00	5,502,400
NISSHA	11,900	1,752.00	20,848,800
藤森工業	4,900	3,220.00	15,778,000
TAKARA & COMPANY	4,300	2,105.00	9,051,500
前澤化成工業	4,000	1,387.00	5,548,000
未来工業	3,300	1,477.00	4,874,100
アシックス	57,600	3,085.00	177,696,000
ツツミ	2,500	1,968.00	4,920,000
JSP	4,400	1,482.00	6,520,800
ニチハ	7,800	2,908.00	22,682,400
ローランド	4,600	3,985.00	18,331,000
エフピコ	11,800	3,795.00	44,781,000
小松ウオール工業	2,700	1,860.00	5,022,000
ヤマハ	39,400	5,340.00	210,396,000
河合楽器製作所	1,800	2,568.00	4,622,400
ピジョン	39,800	2,037.00	81,072,600
天馬	5,300	2,143.00	11,357,900
兼松サステック	3,000	1,561.00	4,683,000
キングジム	5,500	907.00	4,988,500
象印マホービン	18,600	1,591.00	29,592,600
リンテック	12,500	2,270.00	28,375,000
信越ポリマー	11,600	1,273.00	14,766,800
東リ	23,200	202.00	4,686,400
イトーキ	12,800	483.00	6,182,400
任天堂	394,200	5,887.00	2,320,655,400
三菱鉛筆	8,900	1,416.00	12,602,400
松風	2,800	2,366.00	6,624,800
タカラスタンダード	12,100	1,288.00	15,584,800

コクヨ	30,100	1,813.00	54,571,300
ナカバヤシ	9,300	496.00	4,612,800
ニフコ	22,600	3,620.00	81,812,000
グロープライド	5,000	2,545.00	12,725,000
オカムラ	18,800	1,460.00	27,448,000
バルカー	5,200	2,722.00	14,154,400
MUTOHホールディングス	2,400	1,766.00	4,238,400
伊藤忠商事	407,100	4,210.00	1,713,891,000
丸紅	521,600	1,494.50	779,531,200
スクロール	9,800	719.00	7,046,200
ヨンドシーホールディングス	5,700	1,744.00	9,940,800
長瀬産業	31,100	2,013.00	62,604,300
蝶理	3,500	1,955.00	6,842,500
豊田通商	57,900	5,120.00	296,448,000
オンワードホールディングス	40,600	316.00	12,829,600
三共生興	10,200	498.00	5,079,600
兼松	25,700	1,520.00	39,064,000
美津濃	6,200	2,840.00	17,608,000
三井物産	483,400	3,843.00	1,857,706,200
日本紙パルプ商事	3,500	5,020.00	17,570,000
東京エレクトロン	44,100	44,750.00	1,973,475,000
カメイ	7,000	1,169.00	8,183,000
OUGホールディングス	1,700	2,425.00	4,122,500
スターゼン	5,000	2,044.00	10,220,000
セイコーグループ	9,700	3,025.00	29,342,500
山善	17,800	1,040.00	18,512,000
椿本興業	1,300	3,800.00	4,940,000
住友商事	409,200	2,197.00	899,012,400
BIPROGY	23,000	3,185.00	73,255,000
内田洋行	2,900	4,625.00	13,412,500
三菱商事	413,100	4,445.00	1,836,229,500
第一実業	2,300	4,265.00	9,809,500
キヤノンマーケティングジャパン	15,300	3,180.00	48,654,000
西華産業	2,900	1,545.00	4,480,500
佐藤商事	4,600	1,179.00	5,423,400
菱洋エレクトロ	5,600	2,361.00	13,221,600
東京産業	6,200	787.00	4,879,400
ユアサ商事	5,900	3,630.00	21,417,000
神鋼商事	1,700	4,340.00	7,378,000
阪和興業	11,900	3,650.00	43,435,000
正栄食品工業	4,400	4,345.00	19,118,000
カナデン	5,300	1,105.00	5,856,500
菱電商事	5,300	1,712.00	9,073,600
ニプロ	52,100	1,027.00	53,506,700
岩谷産業	15,000	5,650.00	84,750,000
ナイス	2,900	1,354.00	3,926,600
極東貿易	3,900	1,334.00	5,202,600
アステナホールディングス	11,700	424.00	4,960,800
兼松エレクトロニクス	4,000	4,520.00	18,080,000
三愛オブリ	18,200	1,227.00	22,331,400

稲畑産業	13,500	2,389.00	32,251,500
G S Iクレオス	3,800	1,465.00	5,567,000
明和産業	8,800	715.00	6,292,000
クワザワホールディングス	10,600	420.00	4,452,000
ゴールドウイン	11,100	9,500.00	105,450,000
ユニ・チャーム	130,500	5,088.00	663,984,000
デサント	10,800	3,430.00	37,044,000
ワキタ	12,100	1,198.00	14,495,800
ヤマトインターナショナル	17,500	249.00	4,357,500
東邦ホールディングス	16,400	2,068.00	33,915,200
サンゲツ	16,600	2,022.00	33,565,200
ミツウロコグループホールディングス	8,500	1,040.00	8,840,000
シナネンホールディングス	2,100	3,840.00	8,064,000
伊藤忠エネクス	16,400	1,028.00	16,859,200
サンリオ	18,700	4,345.00	81,251,500
サンワ テクノス	3,400	1,498.00	5,093,200
リョーサン	7,000	2,909.00	20,363,000
新光商事	8,900	1,132.00	10,074,800
トーヨー	2,900	1,697.00	4,921,300
三信電気	2,700	2,208.00	5,961,600
東陽テクニカ	7,300	1,357.00	9,906,100
モスフードサービス	9,700	3,145.00	30,506,500
加賀電子	5,400	4,280.00	23,112,000
三益半導体工業	5,800	2,608.00	15,126,400
都築電気	3,600	1,323.00	4,762,800
立花エレテック	4,800	1,763.00	8,462,400
木曽路	10,000	2,155.00	21,550,000
S R Sホールディングス	10,900	853.00	9,297,700
千趣会	12,200	402.00	4,904,400
リテールパートナーズ	9,800	1,252.00	12,269,600
ケーヨー	10,600	910.00	9,646,000
上新電機	5,900	1,925.00	11,357,500
日本瓦斯	35,400	2,151.00	76,145,400
ロイヤルホールディングス	12,700	2,400.00	30,480,000
東天紅	5,400	805.00	4,347,000
いなげや	6,400	1,214.00	7,769,600
チヨダ	6,600	773.00	5,101,800
ライフコーポレーション	5,800	2,460.00	14,268,000
リンガーハット	8,500	2,235.00	18,997,500
MrMaxHD	9,300	670.00	6,231,000
AOKIホールディングス	12,300	670.00	8,241,000
オークワ	10,600	922.00	9,773,200
コメリ	10,200	2,637.00	26,897,400
青山商事	14,100	977.00	13,775,700
しまむら	7,800	12,330.00	96,174,000
高島屋	49,800	1,702.00	84,759,600
松屋	11,200	971.00	10,875,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	32,200	1,196.00	38,511,200
近鉄百貨店	2,100	2,438.00	5,119,800
丸井グループ	48,700	2,311.00	112,545,700

クレディセゾン	39,000	1,712.00	66,768,000
アクシアル リテイリング	4,500	3,455.00	15,547,500
イオン	224,000	2,787.50	624,400,000
イズミ	10,000	3,110.00	31,100,000
平和堂	11,000	1,988.00	21,868,000
フジ	10,100	1,901.00	19,200,100
ヤオコー	7,500	6,800.00	51,000,000
ゼビオホールディングス	9,000	967.00	8,703,000
ケーズホールディングス	52,500	1,120.00	58,800,000
PALTAC	10,400	4,400.00	45,760,000
三谷産業	16,100	310.00	4,991,000
日産東京販売ホールディングス	4,800	281.00	1,348,800
新生銀行	18,100	2,183.00	39,512,300
あおぞら銀行	38,700	2,573.00	99,575,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,032,100	719.70	2,901,902,370
りそなホールディングス	784,900	629.40	494,016,060
三井住友トラスト・ホールディングス	113,900	4,251.00	484,188,900
三井住友フィナンシャルグループ	449,400	4,579.00	2,057,802,600
千葉銀行	171,400	810.00	138,834,000
群馬銀行	119,300	423.00	50,463,900
武蔵野銀行	7,900	1,772.00	13,998,800
千葉興業銀行	11,400	347.00	3,955,800
筑波銀行	27,000	187.00	5,049,000
七十七銀行	19,700	1,805.00	35,558,500
秋田銀行	4,100	1,556.00	6,379,600
山形銀行	6,800	1,086.00	7,384,800
岩手銀行	4,200	1,841.00	7,732,200
東邦銀行	48,600	203.00	9,865,800
ふくおかフィナンシャルグループ	49,100	2,530.00	124,223,000
スルガ銀行	54,200	416.00	22,547,200
八十二銀行	126,200	498.00	62,847,600
山梨中央銀行	6,300	987.00	6,218,100
大垣共立銀行	11,700	1,748.00	20,451,600
福井銀行	5,500	1,387.00	7,628,500
清水銀行	3,400	1,498.00	5,093,200
富山銀行	1,100	1,640.00	1,804,000
滋賀銀行	10,200	2,518.00	25,683,600
南都銀行	9,300	2,149.00	19,985,700
百五銀行	57,900	329.00	19,049,100
京都銀行	19,500	5,600.00	109,200,000
紀陽銀行	22,000	1,427.00	31,394,000
ほくほくフィナンシャルグループ	39,100	878.00	34,329,800
山陰合同銀行	38,500	696.00	26,796,000
百十四銀行	5,600	1,694.00	9,486,400
四国銀行	9,800	857.00	8,398,600
阿波銀行	9,100	1,926.00	17,526,600
大分銀行	3,700	1,856.00	6,867,200
宮崎銀行	4,000	2,212.00	8,848,000
佐賀銀行	3,600	1,517.00	5,461,200
琉球銀行	14,100	778.00	10,969,800

セブン銀行	220,300	258.00	56,837,400	
みずほフィナンシャルグループ	889,400	1,630.00	1,449,722,000	
山口フィナンシャルグループ	67,900	776.00	52,690,400	
芙蓉総合リース	5,700	8,550.00	48,735,000	
みずほリース	9,200	3,245.00	29,854,000	
東京センチュリー	11,500	4,830.00	55,545,000	
SBIホールディングス	89,000	2,619.00	233,091,000	
日本証券金融	24,700	994.00	24,551,800	
アイフル	101,900	396.00	40,352,400	
長野銀行	3,700	1,188.00	4,395,600	
名古屋銀行	4,100	3,010.00	12,341,000	
北洋銀行	93,200	229.00	21,342,800	
大光銀行	3,600	1,154.00	4,154,400	
愛媛銀行	8,300	822.00	6,822,600	
京葉銀行	28,600	509.00	14,557,400	
栃木銀行	28,200	292.00	8,234,400	
北日本銀行	2,600	1,872.00	4,867,200	
東和銀行	11,300	525.00	5,932,500	
リコーリース	5,800	3,605.00	20,909,000	
イオンフィナンシャルサービス	35,300	1,445.00	51,008,500	
アコム	109,800	316.00	34,696,800	
ジャックス	6,600	3,740.00	24,684,000	
オリエントコーポレーション	16,100	1,190.00	19,159,000	
オリックス	411,400	2,162.00	889,446,800	
三菱HCキャピタル	239,800	636.00	152,512,800	
ジャフコ グループ	20,500	2,288.00	46,904,000	
九州リースサービス	3,400	653.00	2,220,200	
トモニホールディングス	49,700	325.00	16,152,500	
大和証券グループ本社	439,800	598.00	263,000,400	
野村ホールディングス	1,132,600	490.00	554,974,000	
岡三証券グループ	54,000	373.00	20,142,000	
丸三証券	20,500	410.00	8,405,000	
東洋証券	20,400	270.00	5,508,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	66,900	350.00	23,415,000	
光世証券	5,100	368.00	1,876,800	
水戸証券	22,100	222.00	4,906,200	
いちよし証券	11,300	613.00	6,926,900	
松井証券	36,300	777.00	28,205,100	
SOMPOホールディングス	105,600	5,631.00	594,633,600	
日本取引所グループ	172,800	1,957.00	338,169,600	
マネックスグループ	68,700	447.00	30,708,900	
極東証券	7,900	613.00	4,842,700	
岩井コスモホールディングス	7,000	1,257.00	8,799,000	
アイザワ証券グループ	8,900	658.00	5,856,200	
フィデアホールディングス	6,400	1,302.00	8,332,800	
池田泉州ホールディングス	78,700	216.00	16,999,200	
アニコム ホールディングス	20,900	684.00	14,295,600	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	138,700	3,963.00	549,668,100	

スパークス・グループ	6,900	1,645.00	11,350,500
第一生命ホールディングス	313,100	2,369.00	741,733,900
東京海上ホールディングス	619,300	2,791.00	1,728,466,300
イー・ギャランティ	9,900	2,459.00	24,344,100
アサックス	8,000	598.00	4,784,000
NECキャピタルソリューション	3,000	2,070.00	6,210,000
T&Dホールディングス	165,100	1,520.00	250,952,000
アドバンスクリエイト	2,900	1,073.00	3,111,700
三井不動産	267,300	2,671.00	713,958,300
三菱地所	389,900	1,908.00	743,929,200
平和不動産	10,000	4,030.00	40,300,000
東京建物	58,600	1,924.00	112,746,400
京阪神ビルディング	7,900	1,317.00	10,404,300
住友不動産	111,200	3,659.00	406,880,800
テーオーシー	11,100	709.00	7,869,900
東京楽天地	1,100	4,240.00	4,664,000
レオパレス21	69,200	303.00	20,967,600
スターツコーポレーション	8,800	2,881.00	25,352,800
フジ住宅	8,600	619.00	5,323,400
空港施設	9,100	539.00	4,904,900
ゴールドクレスト	5,800	1,780.00	10,324,000
リログループ	35,700	2,277.00	81,288,900
エスリード	2,900	1,860.00	5,394,000
日神グループホールディングス	11,300	425.00	4,802,500
日本エスコン	13,800	836.00	11,536,800
MIRARTHホールディングス	31,100	390.00	12,129,000
AVANTIA	5,800	794.00	4,605,200
イオンモール	31,900	1,693.00	54,006,700
ファースト住建	4,300	1,017.00	4,373,100
カチタス	16,500	3,280.00	54,120,000
東祥	4,500	1,195.00	5,377,500
トーセイ	10,200	1,481.00	15,106,200
穴吹興産	2,300	1,988.00	4,572,400
サンフロンティア不動産	10,200	1,138.00	11,607,600
FJネクストホールディングス	6,500	959.00	6,233,500
グランディハウス	8,700	543.00	4,724,100
東武鉄道	68,600	3,215.00	220,549,000
相鉄ホールディングス	20,600	2,147.00	44,228,200
東急	175,100	1,654.00	289,615,400
京浜急行電鉄	70,800	1,407.00	99,615,600
小田急電鉄	94,700	1,750.00	165,725,000
京王電鉄	33,000	4,935.00	162,855,000
京成電鉄	40,300	3,685.00	148,505,500
富士急行	7,700	4,860.00	37,422,000
東日本旅客鉄道	105,900	7,750.00	820,725,000
西日本旅客鉄道	79,800	5,652.00	451,029,600
東海旅客鉄道	48,100	16,365.00	787,156,500
西武ホールディングス	75,500	1,313.00	99,131,500
鴻池運輸	10,600	1,536.00	16,281,600
西日本鉄道	16,700	2,740.00	45,758,000

ハマキョウレックス	4,900	3,460.00	16,954,000
サカイ引越センター	3,000	4,585.00	13,755,000
近鉄グループホールディングス	62,300	4,670.00	290,941,000
阪急阪神ホールディングス	83,100	4,160.00	345,696,000
南海電気鉄道	29,800	2,902.00	86,479,600
京阪ホールディングス	25,800	3,445.00	88,881,000
神戸電鉄	1,700	3,235.00	5,499,500
名古屋鉄道	68,900	2,191.00	150,959,900
山陽電気鉄道	4,700	2,223.00	10,448,100
アルプス物流	5,000	1,137.00	5,685,000
トランコム	1,800	7,780.00	14,004,000
ヤマトホールディングス	79,800	2,288.00	182,582,400
山九	15,900	4,885.00	77,671,500
日新	4,700	2,026.00	9,522,200
丸全昭和運輸	3,900	3,200.00	12,480,000
センコーグループホールディングス	33,000	1,004.00	33,132,000
トナミホールディングス	1,400	3,735.00	5,229,000
ニッコンホールディングス	20,000	2,427.00	48,540,000
日本石油輸送	1,300	2,222.00	2,888,600
福山通運	5,200	3,400.00	17,680,000
セイノーホールディングス	38,800	1,184.00	45,939,200
神奈川中央交通	1,800	3,350.00	6,030,000
日立物流	13,700	8,900.00	121,930,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	15,000	1,481.00	22,215,000
C & F ロジホールディングス	6,000	1,222.00	7,332,000
日本郵船	166,800	2,743.00	457,532,400
商船三井	109,900	3,080.00	338,492,000
川崎汽船	53,100	2,522.00	133,918,200
N S ユナイテッド海運	3,400	3,580.00	12,172,000
明治海運	6,200	692.00	4,290,400
飯野海運	22,900	863.00	19,762,700
共栄タンカー	600	915.00	549,000
九州旅客鉄道	44,100	2,889.00	127,404,900
S G ホールディングス	119,600	2,044.00	244,462,400
N I P P O N E X P R E S S ホール ディングス	23,300	7,850.00	182,905,000
日本航空	153,100	2,637.00	403,724,700
A N A ホールディングス	169,600	2,863.00	485,564,800
パスコ	1,200	1,288.00	1,545,600
T R E ホールディングス	13,500	1,537.00	20,749,500
人・夢・技術グループ	2,900	2,064.00	5,985,600
西本W i s m e t t a c ホールディ ングス	1,700	3,695.00	6,281,500
G e n k y D r u g S t o r e s	3,300	3,625.00	11,962,500
K P P グループホールディングス	15,400	1,017.00	15,661,800
ナルミヤ・インターナショナル	5,600	839.00	4,698,400
ブックオフグループホールディングス	3,900	1,322.00	5,155,800
ギフトホールディングス	1,400	3,750.00	5,250,000
三菱倉庫	13,400	3,220.00	43,148,000
三井倉庫ホールディングス	5,800	3,555.00	20,619,000

住友倉庫	17,100	2,006.00	34,302,600
澁澤倉庫	2,500	2,055.00	5,137,500
ヤマタネ	2,900	1,667.00	4,834,300
東陽倉庫	16,500	249.00	4,108,500
乾汽船	8,000	1,745.00	13,960,000
日本トランスシティ	12,500	499.00	6,237,500
中央倉庫	5,200	928.00	4,825,600
安田倉庫	5,200	926.00	4,815,200
東洋埠頭	3,800	1,262.00	4,795,600
上組	31,000	2,762.00	85,622,000
キューソー流通システム	4,200	1,055.00	4,431,000
東海運	13,300	280.00	3,724,000
エーアイテイー	3,900	1,434.00	5,592,600
日本コンセプト	2,700	1,775.00	4,792,500
TBSホールディングス	32,100	1,523.00	48,888,300
日本テレビホールディングス	55,400	1,059.00	58,668,600
朝日放送グループホールディングス	7,800	621.00	4,843,800
テレビ朝日ホールディングス	15,200	1,345.00	20,444,000
スカパーJ S A Tホールディングス	55,600	496.00	27,577,600
テレビ東京ホールディングス	4,500	1,829.00	8,230,500
日本BS放送	4,800	920.00	4,416,000
ビジョン	8,200	1,408.00	11,545,600
USEN-NEXT HOLDINGS	5,600	2,306.00	12,913,600
コネクシオ	4,400	1,169.00	5,143,600
日本通信	57,800	226.00	13,062,800
日本電信電話	802,500	3,843.00	3,084,007,500
KDDI	484,000	4,098.00	1,983,432,000
ソフトバンク	1,006,100	1,477.00	1,486,009,700
光通信	7,400	20,010.00	148,074,000
エムティーアイ	9,400	509.00	4,784,600
GMOインターネットグループ	23,300	2,571.00	59,904,300
アイドママーケティングコミュニケーション	16,400	283.00	4,641,200
KADOKAWA	33,100	2,538.00	84,007,800
学研ホールディングス	10,400	972.00	10,108,800
ゼンリン	10,700	875.00	9,362,500
インプレスホールディングス	22,700	212.00	4,812,400
東京電力ホールディングス	562,900	464.00	261,185,600
中部電力	230,100	1,263.00	290,616,300
関西電力	241,100	1,157.00	278,952,700
中国電力	99,400	719.00	71,468,600
北陸電力	58,900	517.00	30,451,300
東北電力	152,700	629.00	96,048,300
四国電力	53,300	721.00	38,429,300
九州電力	143,900	728.00	104,759,200
北海道電力	60,300	446.00	26,893,800
沖縄電力	14,600	1,022.00	14,921,200
電源開発	47,000	2,073.00	97,431,000
エフオン	7,600	586.00	4,453,600

イーレックス	11,100	2,437.00	27,050,700
レノバ	16,600	2,733.00	45,367,800
東京瓦斯	132,000	2,491.00	328,812,000
大阪瓦斯	126,500	2,084.00	263,626,000
東邦瓦斯	24,600	2,669.00	65,657,400
北海道瓦斯	3,700	1,660.00	6,142,000
広島ガス	7,900	340.00	2,686,000
西部ガスホールディングス	5,900	1,650.00	9,735,000
静岡ガス	14,200	987.00	14,015,400
メタウォーター	7,800	1,849.00	14,422,200
アイネット	3,800	1,314.00	4,993,200
松竹	3,600	11,900.00	42,840,000
東宝	39,200	5,300.00	207,760,000
エイチ・アイ・エス	16,800	1,966.00	33,028,800
東映	1,700	17,930.00	30,481,000
ラックランド	2,000	2,955.00	5,910,000
エヌ・ティ・ティ・データ	196,500	2,092.00	411,078,000
共立メンテナンス	11,000	5,620.00	61,820,000
イチネンホールディングス	6,800	1,234.00	8,391,200
建設技術研究所	3,300	3,135.00	10,345,500
スペース	5,600	895.00	5,012,000
アインホールディングス	9,100	7,050.00	64,155,000
燦ホールディングス	2,800	1,753.00	4,908,400
ピー・シー・エー	4,300	1,265.00	5,439,500
東京テアトル	4,000	1,128.00	4,512,000
タナベコンサルティンググループ	7,000	650.00	4,550,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,700	1,965.00	5,305,500
ナガワ	1,700	7,420.00	12,614,000
東京都競馬	5,400	3,910.00	21,114,000
カナモト	11,800	2,237.00	26,396,600
D T S	13,800	3,435.00	47,403,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	6,370.00	200,655,000
シーイーシー	8,800	1,492.00	13,129,600
カブコン	62,200	4,400.00	273,680,000
西尾レントオール	6,000	3,010.00	18,060,000
アイ・エス・ピー	3,600	1,326.00	4,773,600
日本空港ビルデング	21,800	6,180.00	134,724,000
トランス・コスモス	8,000	3,330.00	26,640,000
乃村工藝社	28,000	1,028.00	28,784,000
ジャステック	3,800	1,267.00	4,814,600
S C S K	51,100	2,156.00	110,171,600
藤田観光	2,900	2,889.00	8,378,100
K N T - C Tホールディングス	3,800	1,615.00	6,137,000
日本管財	6,700	2,551.00	17,091,700
トーカイ	5,700	1,876.00	10,693,200
セコム	65,400	8,259.00	540,138,600
N S W	2,400	2,193.00	5,263,200
セントラル警備保障	3,500	2,407.00	8,424,500
アイネス	4,400	1,442.00	6,344,800

丹青社	12,400	791.00	9,808,400	
メイテック	25,600	2,505.00	64,128,000	
TKC	11,200	3,700.00	41,440,000	
富士ソフト	7,100	8,250.00	58,575,000	
応用地質	6,200	2,083.00	12,914,600	
船井総研ホールディングス	13,500	2,773.00	37,435,500	
NSD	22,300	2,545.00	56,753,500	
進学会ホールディングス	14,600	306.00	4,467,600	
丸紅建材リース	2,500	1,747.00	4,367,500	
コナミグループ	26,800	6,770.00	181,436,000	
学究社	2,900	1,780.00	5,162,000	
ベネッセホールディングス	24,000	1,990.00	47,760,000	
イオンディライト	7,100	2,965.00	21,051,500	
ナック	5,200	930.00	4,836,000	
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,982.00	13,120,800	
ダイセキ	13,100	4,690.00	61,439,000	
ステップ	2,600	1,831.00	4,760,600	
日鉄物産	4,500	5,150.00	23,175,000	
泉州電業	3,300	2,665.00	8,794,500	
元気寿司	2,100	3,150.00	6,615,000	
トラスコ中山	13,900	2,058.00	28,606,200	
ヤマダホールディングス	270,900	468.00	126,781,200	
オートバックスセブン	23,000	1,435.00	33,005,000	
モリト	6,400	766.00	4,902,400	
アーケランズ	9,700	1,492.00	14,472,400	
ニトリホールディングス	26,700	15,545.00	415,051,500	
グルメ杵屋	5,400	1,016.00	5,486,400	
愛眼	27,500	175.00	4,812,500	
吉野家ホールディングス	25,900	2,359.00	61,098,100	
加藤産業	8,000	3,520.00	28,160,000	
イノテック	4,200	1,306.00	5,485,200	
イエローハット	11,700	1,714.00	20,053,800	
松屋フーズホールディングス	3,100	4,050.00	12,555,000	
JBCホールディングス	4,600	1,864.00	8,574,400	
JKホールディングス	5,200	1,018.00	5,293,600	
サガミホールディングス	10,600	1,231.00	13,048,600	
日伝	3,900	1,712.00	6,676,800	
関西フードマーケット	6,000	1,376.00	8,256,000	
ミロク情報サービス	5,700	1,435.00	8,179,500	
北沢産業	23,800	196.00	4,664,800	
杉本商事	2,900	2,062.00	5,979,800	
因幡電機産業	17,100	2,717.00	46,460,700	
王将フードサービス	4,400	6,070.00	26,708,000	
プレナス	7,300	2,638.00	19,257,400	
ミニストップ	4,800	1,436.00	6,892,800	
アークス	12,100	2,104.00	25,458,400	
バローホールディングス	12,600	1,808.00	22,780,800	
東テク	2,200	3,355.00	7,381,000	
ミスミグループ本社	99,700	3,480.00	346,956,000	
ベルク	3,300	5,680.00	18,744,000	

大 庄	4,100	1,053.00	4,317,300	
ファーストリテイリング	9,900	82,160.00	813,384,000	
ソフトバンクグループ	362,100	6,077.00	2,200,481,700	
蔵王産業	2,600	1,746.00	4,539,600	
スズケン	24,100	3,695.00	89,049,500	
サンドラッグ	25,100	3,720.00	93,372,000	
サックスパー ホールディングス	6,500	734.00	4,771,000	
ジェコス	5,900	797.00	4,702,300	
ヤマザワ	3,400	1,210.00	4,114,000	
やまや	1,900	2,490.00	4,731,000	
ベルーナ	15,900	703.00	11,177,700	
合計	73,257,200		178,028,052,710	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年11月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,398,511
コール・ローン	496,611,273
国債証券	52,618,675,550
地方債証券	4,333,529,644
特殊債券	5,773,708,231
社債券	5,537,825,000
未収利息	157,844,667
前払費用	3,520,782
流動資産合計	68,923,113,658
資産合計	68,923,113,658
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,152,178
その他未払費用	423
流動負債合計	7,152,601
負債合計	7,152,601
純資産の部	
元本等	
元本	72,708,390,073
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,792,429,016
元本等合計	68,915,961,057
純資産合計	68,915,961,057
負債純資産合計	68,923,113,658

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11月23日 至 2022年11月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年11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	79,850,448,372円
同期中追加設定元本額	9,861,892,221円
同期中一部解約元本額	17,003,950,520円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	54,298,319,506円
DCニッセイ日本債券インデックス	4,112,198,577円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	159,373,606円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	6,811,731,377円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	302,657,411円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	1,551,148,326円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	2,381,628,621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）	278,338,957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）	30,542,852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）	93,226,202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）	67,716,133円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	82,050,748円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	100,507,526円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	370,873,708円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	2,043,192,356円
FWニッセイ国内債インデックス	21,154,230円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	3,729,937円
計	72,708,390,073円
2. 受益権の総数	72,708,390,073口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,792,429,016円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月23日 至 2022年11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11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11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		1,812,242,230
地方債証券		73,976,566
特殊債券		76,550,979
社債券		30,847,800
合計		1,993,617,575

（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（2022年3月11日から2022年11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11月21日現在	
1口当たり純資産額	0.9478円
（1万口当たり純資産額）	（9,478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11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431回 利付国債（2年）	130,000,000	130,132,600	
	第432回 利付国債（2年）	138,000,000	138,136,620	
	第433回 利付国債（2年）	140,000,000	140,133,000	
	第434回 利付国債（2年）	140,000,000	140,133,000	
	第435回 利付国債（2年）	319,000,000	319,303,050	
	第436回 利付国債（2年）	156,000,000	156,156,000	
	第437回 利付国債（2年）	350,000,000	350,290,500	
	第438回 利付国債（2年）	350,000,000	350,252,000	
	第439回 利付国債（2年）	200,000,000	200,134,000	
	第440回 利付国債（2年）	175,000,000	175,108,500	
	第441回 利付国債（2年）	400,000,000	400,332,000	
	第138回 利付国債（5年）	59,000,000	59,120,360	
	第139回 利付国債（5年）	67,000,000	67,146,060	
	第140回 利付国債（5年）	371,000,000	371,845,880	
	第141回 利付国債（5年）	377,000,000	377,893,490	
	第142回 利付国債（5年）	405,000,000	405,963,900	
	第143回 利付国債（5年）	243,000,000	243,619,650	

第144回 利付国債(5年)	445,000,000	446,259,350	
第145回 利付国債(5年)	290,000,000	290,901,900	
第146回 利付国債(5年)	80,000,000	80,270,400	
第149回 利付国債(5年)	456,000,000	455,822,160	
第150回 利付国債(5年)	200,000,000	199,754,000	
第153回 利付国債(5年)	408,000,000	406,882,080	
第1回 利付国債(40年)	95,000,000	117,596,700	
第2回 利付国債(40年)	115,000,000	137,044,350	
第3回 利付国債(40年)	107,000,000	128,224,520	
第4回 利付国債(40年)	157,000,000	186,249,100	
第5回 利付国債(40年)	159,000,000	181,089,870	
第6回 利付国債(40年)	167,000,000	184,970,870	
第7回 利付国債(40年)	183,000,000	193,687,200	
第8回 利付国債(40年)	184,000,000	180,583,120	
第9回 利付国債(40年)	232,000,000	166,425,200	
第10回 利付国債(40年)	211,000,000	178,077,670	
第11回 利付国債(40年)	174,000,000	141,467,220	
第12回 利付国債(40年)	106,000,000	76,745,060	
第13回 利付国債(40年)	170,000,000	122,160,300	
第14回 利付国債(40年)	236,000,000	181,233,840	
第15回 利付国債(40年)	106,000,000	89,141,760	
第332回 利付国債(10年)	83,000,000	83,616,690	
第333回 利付国債(10年)	89,000,000	89,783,200	
第334回 利付国債(10年)	522,000,000	527,303,520	
第335回 利付国債(10年)	152,000,000	153,472,880	
第336回 利付国債(10年)	205,000,000	207,191,450	
第337回 利付国債(10年)	348,000,000	350,275,920	
第338回 利付国債(10年)	239,000,000	241,275,280	
第339回 利付国債(10年)	347,000,000	350,664,320	
第340回 利付国債(10年)	470,000,000	475,447,300	
第341回 利付国債(10年)	493,000,000	497,703,220	
第342回 利付国債(10年)	423,000,000	424,476,270	
第343回 利付国債(10年)	341,000,000	342,217,370	
第344回 利付国債(10年)	334,000,000	335,085,500	
第345回 利付国債(10年)	472,000,000	473,246,080	
第346回 利付国債(10年)	328,000,000	328,777,360	

第347回 利付国債(10年)	272,000,000	272,432,480	
第348回 利付国債(10年)	338,000,000	338,324,480	
第349回 利付国債(10年)	494,000,000	494,247,000	
第350回 利付国債(10年)	637,000,000	637,165,620	
第351回 利付国債(10年)	564,000,000	564,000,000	
第352回 利付国債(10年)	370,000,000	369,892,700	
第353回 利付国債(10年)	353,000,000	352,784,670	
第354回 利付国債(10年)	333,000,000	332,683,650	
第355回 利付国債(10年)	339,000,000	338,444,040	
第356回 利付国債(10年)	380,000,000	379,099,400	
第357回 利付国債(10年)	384,000,000	382,652,160	
第358回 利付国債(10年)	384,000,000	382,053,120	
第359回 利付国債(10年)	337,000,000	334,731,990	
第360回 利付国債(10年)	297,000,000	294,710,130	
第361回 利付国債(10年)	467,000,000	462,918,420	
第362回 利付国債(10年)	466,000,000	461,614,940	
第363回 利付国債(10年)	480,000,000	475,152,000	
第364回 利付国債(10年)	549,000,000	543,059,820	
第365回 利付国債(10年)	474,000,000	469,146,240	
第366回 利付国債(10年)	244,000,000	244,222,040	
第367回 利付国債(10年)	189,000,000	188,467,020	
第368回 利付国債(10年)	226,000,000	225,129,900	
第1回 利付国債(30年)	6,000,000	7,086,480	
第2回 利付国債(30年)	66,000,000	76,645,140	
第3回 利付国債(30年)	81,000,000	93,759,930	
第4回 利付国債(30年)	40,000,000	48,536,000	
第5回 利付国債(30年)	52,000,000	60,682,440	
第6回 利付国債(30年)	39,000,000	46,560,150	
第7回 利付国債(30年)	31,000,000	36,908,290	

第8回 利付国債(30年)	63,000,000	72,209,340	
第9回 利付国債(30年)	62,000,000	68,603,000	
第10回 利付国債(30年)	21,000,000	22,602,930	
第11回 利付国債(30年)	25,000,000	28,441,750	
第12回 利付国債(30年)	73,000,000	86,146,570	
第13回 利付国債(30年)	14,000,000	16,384,480	
第14回 利付国債(30年)	35,000,000	42,536,550	
第15回 利付国債(30年)	74,000,000	90,889,760	
第16回 利付国債(30年)	53,000,000	65,164,030	
第17回 利付国債(30年)	54,000,000	65,872,440	
第18回 利付国債(30年)	63,000,000	76,207,320	
第19回 利付国債(30年)	52,000,000	62,962,120	
第20回 利付国債(30年)	59,000,000	72,959,990	
第21回 利付国債(30年)	60,000,000	72,764,400	
第22回 利付国債(30年)	72,000,000	89,262,000	
第23回 利付国債(30年)	73,000,000	90,638,260	
第24回 利付国債(30年)	42,000,000	52,221,960	
第25回 利付国債(30年)	51,000,000	62,052,210	
第26回 利付国債(30年)	108,000,000	132,939,360	
第27回 利付国債(30年)	132,000,000	164,469,360	
第28回 利付国債(30年)	177,000,000	220,480,050	
第29回 利付国債(30年)	209,000,000	257,241,380	
第30回 利付国債(30年)	226,000,000	274,745,940	
第31回 利付国債(30年)	193,000,000	231,526,660	
第32回 利付国債(30年)	242,000,000	294,095,340	
第33回 利付国債(30年)	273,000,000	318,399,900	
第34回 利付国債(30年)	252,000,000	302,102,640	
第35回 利付国債(30年)	281,000,000	327,598,230	
第36回 利付国債(30年)	271,000,000	316,164,860	
第37回 利付国債(30年)	289,000,000	331,760,440	
第38回 利付国債(30年)	191,000,000	215,715,400	
第39回 利付国債(30年)	175,000,000	200,676,000	
第40回 利付国債(30年)	145,000,000	163,584,650	
第41回 利付国債(30年)	150,000,000	166,251,000	
第42回 利付国債(30年)	163,000,000	180,514,350	
第43回 利付国債(30年)	156,000,000	172,621,800	
第44回 利付国債(30年)	165,000,000	182,424,000	
第45回 利付国債(30年)	180,000,000	191,766,600	
第46回 利付国債(30年)	216,000,000	229,836,960	
第47回 利付国債(30年)	201,000,000	217,600,590	
第48回 利付国債(30年)	223,000,000	232,238,890	
第49回 利付国債(30年)	220,000,000	228,778,000	
第50回 利付国債(30年)	222,000,000	203,591,760	
第51回 利付国債(30年)	155,000,000	125,894,100	
第52回 利付国債(30年)	202,000,000	171,663,640	
第53回 利付国債(30年)	185,000,000	160,370,950	
第54回 利付国債(30年)	223,000,000	202,020,160	
第55回 利付国債(30年)	181,000,000	163,533,500	
第56回 利付国債(30年)	188,000,000	169,243,240	
第57回 利付国債(30年)	188,000,000	168,628,480	

第58回	利付国債(30年)	233,000,000	208,225,110	
第59回	利付国債(30年)	178,000,000	154,680,220	
第60回	利付国債(30年)	184,000,000	167,340,640	
第61回	利付国債(30年)	162,000,000	139,669,920	
第62回	利付国債(30年)	160,000,000	130,419,200	
第63回	利付国債(30年)	132,000,000	104,113,680	
第64回	利付国債(30年)	134,000,000	105,298,540	
第65回	利付国債(30年)	122,000,000	96,065,240	
第66回	利付国債(30年)	125,000,000	98,446,250	
第67回	利付国債(30年)	192,000,000	157,829,760	
第68回	利付国債(30年)	159,000,000	130,138,320	
第69回	利付国債(30年)	198,000,000	166,213,080	
第70回	利付国債(30年)	190,000,000	158,993,900	
第71回	利付国債(30年)	155,000,000	129,291,700	
第72回	利付国債(30年)	153,000,000	127,340,370	
第73回	利付国債(30年)	81,000,000	67,334,490	
第74回	利付国債(30年)	191,000,000	171,900,000	
第75回	利付国債(30年)	148,000,000	143,702,080	
第76回	利付国債(30年)	67,000,000	66,371,540	
第68回	利付国債(20年)	27,000,000	27,809,730	
第69回	利付国債(20年)	74,000,000	76,121,580	
第70回	利付国債(20年)	249,000,000	258,596,460	
第71回	利付国債(20年)	151,000,000	156,343,890	
第72回	利付国債(20年)	136,000,000	141,295,840	
第73回	利付国債(20年)	105,000,000	109,394,250	
第74回	利付国債(20年)	64,000,000	66,811,520	
第75回	利付国債(20年)	50,000,000	52,451,500	
第76回	利付国債(20年)	68,000,000	71,017,840	
第77回	利付国債(20年)	52,000,000	54,428,400	
第78回	利付国債(20年)	77,000,000	80,788,400	
第79回	利付国債(20年)	64,000,000	67,313,280	
第80回	利付国債(20年)	77,000,000	81,184,950	
第81回	利付国債(20年)	121,000,000	127,877,640	
第82回	利付国債(20年)	135,000,000	143,055,450	
第83回	利付国債(20年)	106,000,000	112,882,580	
第84回	利付国債(20年)	152,000,000	161,402,720	
第85回	利付国債(20年)	115,000,000	123,045,400	
第86回	利付国債(20年)	122,000,000	131,346,420	
第87回	利付国債(20年)	101,000,000	108,402,290	
第88回	利付国債(20年)	158,000,000	170,992,340	
第89回	利付国債(20年)	103,000,000	111,100,950	
第90回	利付国債(20年)	260,000,000	281,730,800	
第91回	利付国債(20年)	185,000,000	201,169,000	
第92回	利付国債(20年)	336,000,000	364,244,160	
第93回	利付国債(20年)	219,000,000	237,472,650	
第94回	利付国債(20年)	267,000,000	290,674,890	
第95回	利付国債(20年)	229,000,000	252,346,550	
第96回	利付国債(20年)	134,000,000	146,439,220	
第97回	利付国債(20年)	196,000,000	215,980,240	
第98回	利付国債(20年)	139,000,000	152,501,070	

第99回 利付国債(20年)	257,000,000	283,175,450	
第100回 利付国債(20年)	189,000,000	210,126,420	
第101回 利付国債(20年)	118,000,000	132,440,840	
第102回 利付国債(20年)	119,000,000	134,211,770	
第103回 利付国債(20年)	112,000,000	125,695,360	
第104回 利付国債(20年)	98,000,000	108,896,620	
第105回 利付国債(20年)	88,000,000	98,196,560	
第106回 利付国債(20年)	53,000,000	59,447,980	
第107回 利付国債(20年)	74,000,000	82,914,040	
第108回 利付国債(20年)	99,000,000	109,729,620	
第109回 利付国債(20年)	79,000,000	87,879,600	
第110回 利付国債(20年)	103,000,000	115,870,880	
第111回 利付国債(20年)	79,000,000	89,719,510	
第112回 利付国債(20年)	126,000,000	142,275,420	
第113回 利付国債(20年)	300,000,000	340,110,000	
第114回 利付国債(20年)	201,000,000	228,605,340	
第115回 利付国債(20年)	120,000,000	137,322,000	
第116回 利付国債(20年)	138,000,000	158,377,080	
第117回 利付国債(20年)	210,000,000	239,488,200	
第118回 利付国債(20年)	134,000,000	152,225,340	
第119回 利付国債(20年)	121,000,000	135,648,260	
第120回 利付国債(20年)	150,000,000	165,918,000	
第121回 利付国債(20年)	206,000,000	233,167,280	
第122回 利付国債(20年)	149,000,000	167,501,330	
第123回 利付国債(20年)	201,000,000	231,445,470	
第124回 利付国債(20年)	128,000,000	146,370,560	

第125回 利付国債(20年)	133,000,000	154,777,420	
第126回 利付国債(20年)	123,000,000	141,125,280	
第127回 利付国債(20年)	119,000,000	135,561,230	
第128回 利付国債(20年)	232,000,000	265,138,880	
第129回 利付国債(20年)	122,000,000	138,398,020	
第130回 利付国債(20年)	189,000,000	215,044,200	
第131回 利付国債(20年)	124,000,000	140,012,120	
第132回 利付国債(20年)	131,000,000	148,385,010	
第133回 利付国債(20年)	156,000,000	178,092,720	
第134回 利付国債(20年)	157,000,000	179,416,460	
第135回 利付国債(20年)	114,000,000	129,236,100	
第136回 利付国債(20年)	118,000,000	132,694,540	
第137回 利付国債(20年)	101,000,000	114,534,000	
第138回 利付国債(20年)	110,000,000	122,685,200	
第139回 利付国債(20年)	114,000,000	128,211,240	
第140回 利付国債(20年)	104,000,000	118,067,040	
第141回 利付国債(20年)	173,000,000	196,592,010	
第142回 利付国債(20年)	119,000,000	136,391,850	
第143回 利付国債(20年)	173,000,000	194,932,940	
第144回 利付国債(20年)	123,000,000	137,366,400	
第145回 利付国債(20年)	246,000,000	279,866,820	
第146回 利付国債(20年)	194,000,000	220,744,840	
第147回 利付国債(20年)	214,000,000	241,237,920	
第148回 利付国債(20年)	184,000,000	205,367,920	
第149回 利付国債(20年)	199,000,000	221,988,480	

第150回 利付国債(20年)	216,000,000	238,373,280	
第151回 利付国債(20年)	216,000,000	233,219,520	
第152回 利付国債(20年)	198,000,000	213,592,500	
第153回 利付国債(20年)	234,000,000	254,940,660	
第154回 利付国債(20年)	220,000,000	236,706,800	
第155回 利付国債(20年)	211,000,000	221,501,470	
第156回 利付国債(20年)	180,000,000	174,909,600	
第157回 利付国債(20年)	182,000,000	171,567,760	
第158回 利付国債(20年)	192,000,000	187,987,200	
第159回 利付国債(20年)	163,000,000	161,220,040	
第160回 利付国債(20年)	176,000,000	176,000,000	
第161回 利付国債(20年)	180,000,000	176,916,600	
第162回 利付国債(20年)	244,000,000	238,956,520	
第163回 利付国債(20年)	237,000,000	231,243,270	
第164回 利付国債(20年)	285,000,000	272,955,900	
第165回 利付国債(20年)	242,000,000	230,824,440	
第166回 利付国債(20年)	230,000,000	225,342,500	
第167回 利付国債(20年)	252,000,000	238,512,960	
第168回 利付国債(20年)	219,000,000	203,124,690	
第169回 利付国債(20年)	245,000,000	222,511,450	
第170回 利付国債(20年)	219,000,000	198,059,220	
第171回 利付国債(20年)	234,000,000	210,721,680	
第172回 利付国債(20年)	217,000,000	198,066,750	
第173回 利付国債(20年)	277,000,000	251,779,150	
第174回 利付国債(20年)	273,000,000	247,095,030	

	第175回 利付国債(20年)	264,000,000	242,491,920	
	第176回 利付国債(20年)	261,000,000	238,940,280	
	第177回 利付国債(20年)	254,000,000	227,451,920	
	第178回 利付国債(20年)	264,000,000	240,229,440	
	第179回 利付国債(20年)	268,000,000	243,218,040	
	第180回 利付国債(20年)	258,000,000	247,042,740	
	第181回 利付国債(20年)	211,000,000	205,359,970	
	第182回 利付国債(20年)	45,000,000	45,257,400	
国債証券 合計		51,394,000,000	52,618,675,550	
地方債証券	第730回 東京都公募公債	300,000,000	302,375,400	
	第34回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	97,185,900	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	302,091,900	
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	105,278,500	
	第448回 大阪府公募公債(10年)	38,000,000	37,178,554	
	第455回 大阪府公募公債(10年)	180,000,000	176,873,940	
	第7回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	112,521,900	
	第11回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	111,526,600	
	第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	108,923,700	
	平成29年度第5回 京都府公募公債(20年)	100,000,000	96,427,200	
	第15回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	111,326,900	
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	109,907,300	
	平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	104,706,400	
	令和4年度第3回 愛知県公募公債	200,000,000	198,349,600	
	平成20年度第1回 福岡県公募公債	100,000,000	111,606,000	
	平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	111,553,400	
	令和4年度第1回 千葉県公募公債	300,000,000	297,637,500	

第133回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	302,638,500	
第22回 大阪市公募公債(2 0年)	100,000,000	94,394,600	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	121,717,900	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	312,615,300	
第25回 横浜市公募公債(2 0年)	100,000,000	112,349,300	
第26回 横浜市公募公債(2 0年)	100,000,000	112,658,200	
第31回 横浜市公募公債(2 0年)	100,000,000	105,746,700	
第9回 川崎市公募公債(20 年)	100,000,000	113,610,300	
第4回 川崎市公募公債(30 年)	100,000,000	116,033,400	
平成26年度第2回 北九州市 公募公債	150,000,000	151,047,150	
平成30年度第5回 広島市公 募公債	200,000,000	199,301,400	
平成29年度第1回 仙台市公 募公債(20年)	100,000,000	95,946,200	
地方債証券 合計	4,168,000,000	4,333,529,644	
特殊債券			
第9回 新関西国際空港	300,000,000	315,207,600	
第16回 日本高速道路保有・ 債務返済機構債券	100,000,000	124,167,000	
第174回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,541,800	
第205回 政保道路機構債券	100,000,000	110,991,700	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	110,655,700	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	504,888,000	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	108,371,500	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	180,979,024	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	93,923,900	
第293回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,375,600	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	96,846,100	
第319回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,544,700	
第17回 地方公共団体金融機 構債券(20年)	200,000,000	224,653,400	
第36回 地方公共団体金融機 構債券(20年)	100,000,000	109,956,300	
第1回 地方公共団体金融機構 債券(30年)	100,000,000	110,185,700	
第72回 政保地方公共団体金 融機構債券	200,000,000	202,227,600	
第83回 政保地方公共団体金 融機構債券	103,000,000	102,840,865	
第116回 政保地方公共団体 金融機構債券	138,000,000	137,243,898	

第120回 政保地方公共団体 金融機構債券	100,000,000	98,718,300	
第136回 地方公共団体金融 機構債券	200,000,000	195,746,200	
第16回 公営企業債券	200,000,000	211,840,200	
第97回 都市再生債券	100,000,000	104,533,000	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	199,127,400	
第59回 一般担保住宅金融支 援機構債券	200,000,000	224,084,000	
第143回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	105,167,800	
第37回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	20,526,000	21,484,564	
第42回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	51,002,000	53,281,789	
第46回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	59,268,000	62,237,326	
第54回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	49,384,000	51,487,758	
第55回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	55,254,000	57,613,345	
第60回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	57,796,000	60,130,958	
第61回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	29,150,000	30,228,550	
第62回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	259,984,000	269,317,425	
第63回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	161,260,000	166,307,438	
第73回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	114,024,000	118,630,569	
第78回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	98,967,000	101,916,216	
第109回 貸付債権担保住宅 金融支援機構債券	207,633,000	203,895,606	
い第845号 利付工商債券	200,000,000	200,175,400	
い第854号 利付工商債券	200,000,000	199,370,800	
い第862号 利付工商債券	100,000,000	99,759,200	
第353回 利付しんきん中金 債券	100,000,000	100,054,000	
特殊債券 合計	5,584,248,000	5,773,708,231	
社債券			
第29回 フランス相互信用連 合銀行(BCF)円貨社債 (2019)	100,000,000	99,037,700	
第13回 クレディ・アグリコ ル	100,000,000	99,594,500	
第5回 スヴェンスカ・ハンデ ルスバンケン	200,000,000	200,782,600	
第25回 首都高速道路債券	400,000,000	398,730,800	
第38回 成田国際空港	200,000,000	195,314,800	
第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	100,668,600	

第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	201,258,400	
第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	201,791,000	
第13回 日本たばこ産業	100,000,000	99,551,500	
第14回 森ヒルズリート投資 法人無担保投資法人債	100,000,000	100,965,700	
第5回 電通グループ	400,000,000	398,690,800	
第1回 オリックス銀行	200,000,000	199,564,800	
第19回 豊田通商	100,000,000	102,335,500	
第1回 三井住友トラスト・ ホールディングス劣後特約付	100,000,000	100,581,100	
第29回 三菱東京UFJ銀行 劣後特約付	100,000,000	105,239,200	
第1回 三井住友フィナンシャル グループ劣後特約付	100,000,000	100,590,200	
第8回 三菱UFJ信託銀行劣 後特約付	100,000,000	104,751,600	
第16回 NTTファイナンス	200,000,000	199,456,800	
第18回 NTTファイナンス	100,000,000	98,946,600	
第96回 トヨタファイナンス	100,000,000	99,509,400	
第2回 三菱HCキャピタル	100,000,000	98,810,200	
第40回 三菱UFJリース	300,000,000	298,883,700	
第6回 三井住友海上火災保険	100,000,000	99,858,100	
第66回 三井不動産	100,000,000	100,061,300	
第132回 三菱地所	100,000,000	99,316,200	
第7回 野村不動産オフィス ファンド投資法人	200,000,000	223,155,800	
第106回 東日本旅客鉄道	100,000,000	101,919,600	
第3回 東日本旅客鉄道サステ ナビリティボンド	100,000,000	97,753,100	
第27回 KDDI	200,000,000	199,892,000	
第510回 関西電力	100,000,000	99,748,600	
第381回 中国電力	200,000,000	202,516,200	
第306回 北陸電力	100,000,000	101,185,800	
第429回 九州電力	200,000,000	202,472,000	
第451回 九州電力	100,000,000	99,639,000	
第331回 北海道電力	100,000,000	100,223,800	
第352回 北海道電力	100,000,000	100,314,100	
第13回 電源開発	100,000,000	104,713,900	
社債券 合計	5,500,000,000	5,537,825,000	
合計		68,263,738,425	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年11月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,003,501
コール・ローン	356,343,047
投資証券	32,056,508,100
未収配当金	218,346,409
流動資産合計	32,632,201,057
資産合計	32,632,201,057
負債の部	
流動負債	
未払解約金	53,924,162
その他未払費用	200
流動負債合計	53,924,362
負債合計	53,924,362
純資産の部	
元本等	
元本	16,947,494,605
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,630,782,090
元本等合計	32,578,276,695
純資産合計	32,578,276,695
負債純資産合計	32,632,201,057

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11月23日 至 2022年11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11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	16,553,467,034円
同期中追加設定元本額	5,171,239,275円
同期中一部解約元本額	4,777,211,704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)	737,966,460円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,182,678,261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	8,610,732,108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)	1,691,808,658円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,867,707,755円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,653,722,454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)	137,767,601円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	14,165,377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)	6,048,555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)	9,889,734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)	33,525,524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)	87,397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)	185,176円
FWニッセイ国内リートインデックス	1,209,545円
計	16,947,494,605円
2. 受益権の総数	16,947,494,605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11月23日 至 2022年11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11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11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	283,682,900	
合計	283,682,900	

（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（2022年11月15日から2022年11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11月21日現在
1口当たり純資産額	1.9223円
（1万口当たり純資産額）	（19,223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11月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	1,130	232,441,000	
	GLP投資法人	9,416	1,456,655,200	
	NTT都市開発リート投資法人	2,804	407,140,800	
	Oneリート投資法人	509	126,995,500	
	SOSILA物流リート投資法人	1,364	191,505,600	
	いちごオフィスリート投資法人	2,390	207,213,000	
	いちごホテルリート投資法人	483	49,266,000	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	1,540	663,740,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,917	1,007,823,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,272	188,383,200	
	イオンリート投資法人	3,229	516,962,900	
	インヴィンシブル投資法人	12,840	598,986,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	593	68,610,100	
	オリックス不動産投資法人	5,813	1,084,705,800	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,999	217,491,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,714	577,618,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,092	451,872,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,268	338,302,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,357	433,561,500	

サムティ・レジデンシャル投資法人	758	91,490,600	
サンケイリアルエステート投資法人	935	87,983,500	
ザイマックス・リート投資法人	473	57,091,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,408	700,896,000	
ジャパンエクセレント投資法人	2,676	363,936,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,917	1,773,536,000	
スターアジア不動産投資法人	3,642	202,859,400	
スターツプロシード投資法人	454	106,871,600	
タカラレーベン不動産投資法人	1,278	128,311,200	
トーセイ・リート投資法人	647	87,215,600	
ヒューリックリート投資法人	2,729	469,115,100	
フロンティア不動産投資法人	1,082	570,214,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	719	138,910,800	
マリモ地方創生リート投資法人	364	49,504,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,567	1,008,691,200	
ラサールロジポート投資法人	3,571	597,785,400	
阪急阪神リート投資法人	1,318	202,444,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,152	581,760,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,002	460,419,000	
産業ファンド投資法人	4,359	693,081,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	684	95,212,800	
森トラスト総合リート投資法人	2,085	300,240,000	
森ヒルズリート投資法人	3,430	550,515,000	
星野リゾート・リート投資法人	510	351,900,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,865	713,632,500	
大江戸温泉リート投資法人	471	31,462,800	
大和ハウスリート投資法人	4,397	1,358,673,000	
大和証券オフィス投資法人	610	414,800,000	
大和証券リビング投資法人	4,042	483,423,200	
投資法人みらい	3,544	169,226,000	
東海道リート投資法人	354	43,081,800	
東急リアル・エステート投資法人	1,956	407,239,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,007	638,438,000	
日本ビルファンド投資法人	3,403	2,157,502,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,995	779,047,500	
日本プロロジスリート投資法人	4,780	1,582,180,000	
日本リート投資法人	948	349,338,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,967	651,077,000	
日本都市ファンド投資法人	14,719	1,595,539,600	

	福岡リート投資法人	1,509	259,698,900	
	平和不動産リート投資法人	1,994	316,846,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,434	1,616,044,200	
投資証券	合計	173,485	32,056,508,100	
合計			32,056,508,100	

(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

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11月22日から2023年5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・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2022年11月21日現在	第6期中間計算期間 2023年5月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	502	94,432
コール・ローン	178,146	199,562
親投資信託受益証券	126,776,473	145,652,518
未収入金	68,637	443,218
流動資産合計	127,023,758	146,389,730
資産合計	127,023,758	146,389,730
負債の部		
流動負債		
未払解約金	65,313	478,436
未払受託者報酬	13,931	16,138
未払委託者報酬	165,118	191,272
その他未払費用	6,265	7,266
流動負債合計	250,627	693,112
負債合計	250,627	693,112
純資産の部		
元本等		
元本	116,445,866	131,769,392
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	10,327,265	13,927,226
(分配準備積立金)	3,813,861	3,560,186
元本等合計	126,773,131	145,696,618
純資産合計	126,773,131	145,696,618
負債純資産合計	127,023,758	146,389,730

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2021年11月23日 至 2022年5月22日	第6期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,412,774	2,686,205
営業収益合計	2,412,774	2,686,205
営業費用		
受託者報酬	11,535	16,138
委託者報酬	136,898	191,272
その他費用	5,173	7,266
営業費用合計	153,606	214,676
営業利益又は営業損失（ ）	2,566,380	2,471,529
経常利益又は経常損失（ ）	2,566,380	2,471,529
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,566,380	2,471,529
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（ ）	144,877	45,821
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,837,509	10,327,265
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,135,335	1,836,193
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	2,135,335	1,836,193
剰余金減少額又は欠損金増加額	757,800	753,582
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	757,800	753,582
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（ ）	8,793,541	13,927,226

(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6期中間計算期間	
	自 2022年11月22日	至 2023年5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11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11月22日から2023年5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5期	第6期中間計算期間
	2022年11月21日現在	2023年5月21日現在
1. 期首元本額	80,491,349円	116,445,866円
期中追加設定元本額	49,748,629円	23,982,016円
期中一部解約元本額	13,794,112円	8,658,490円
2. 受益権の総数	116,445,866口	131,769,392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5期 2022年11月21日現在	第6期中間計算期間 2023年5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5期 2022年11月21日現在	第6期中間計算期間 2023年5月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0887円 (10,887円)	1.1057円 (11,057円)

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ」-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、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。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2023年5月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	116,643,811
コール・ローン	3,131,908,283
株式	172,245,591,650
派生商品評価勘定	372,067,950
未収配当金	2,280,285,118
差入委託証拠金	190,575,000
流動資産合計	178,337,071,812
資産合計	178,337,071,812
負債の部	
流動負債	
前受金	353,715,000
未払解約金	705,160,062
未払利息	8,158
その他未払費用	2,127
流動負債合計	1,058,885,347
負債合計	1,058,885,347
純資産の部	
元本等	
元本	70,192,868,437
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	107,085,318,028
元本等合計	177,278,186,465
純資産合計	177,278,186,465
負債純資産合計	178,337,071,812

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11月22日 至 2023年5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	2023年5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	80,542,683,355円
同期中追加設定元本額	8,480,758,351円
同期中一部解約元本額	18,830,573,269円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,466,396,101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)	3,193,008,214円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,389,534円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,169,086,879円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,591,420,168円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,925,191,420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)	2,873,834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)	13,223,381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)	11,668,250円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,984,392,998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	23,711,641,744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)	3,142,941,231円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	307,920,743円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	241,068,125円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	361,204,044円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	589,239,260円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	46,492,596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)	125,119,059円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,509,890円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	13,005,115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)	4,936,874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)	8,937,755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)	28,547,370円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	230,461,613円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	154,195,025円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	312,842,442円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	204,353,744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)	14,249,950,636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)	24,228,833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)	57,178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)	121,699円
FWニッセイ国内株インデックス	41,766,061円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	23,676,621円
計	70,192,868,437円
2. 受益権の総数	70,192,868,437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	2023年5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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年5月21日現在			評価損益（円）
	契約額等（円）	うち		
		1年超	時価（円）	
市場取引 先物取引 買建	4,630,110,000	-	5,002,305,000	372,195,000
合計	4,630,110,000	-	5,002,305,000	372,195,000

（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）

	2023年5月21日現在
1口当たり純資産額	2.5256円
（1万口当たり純資産額）	（25,256円）

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年5月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	17,197,670
コール・ローン	461,760,669
国債証券	51,307,132,880
地方債証券	3,698,251,194
特殊債券	5,081,641,727
社債券	5,122,596,700
未収利息	142,319,217
前払費用	3,913,231
流動資産合計	65,834,813,288
資産合計	65,834,813,288
負債の部	
流動負債	
未払解約金	54,885,088
未払利息	1,202
その他未払費用	369
流動負債合計	54,886,659
負債合計	54,886,659
純資産の部	
元本等	
元本	68,898,275,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,118,349,138
元本等合計	65,779,926,629
純資産合計	65,779,926,629
負債純資産合計	65,834,813,288

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11月22日 至 2023年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</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	2023年5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	72,708,390,073円
同期中追加設定元本額	4,312,900,846円
同期中一部解約元本額	8,123,015,152円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	48,729,984,033円
DCニッセイ日本債券インデックス	4,500,867,912円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	202,201,716円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	7,365,873,518円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	386,185,499円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	2,140,071,428円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,834,245,972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)	316,588,315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)	31,425,826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)	106,162,470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)	72,668,251円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	107,512,947円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	134,259,499円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	480,641,084円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	2,445,208,418円
FWニッセイ国内債インデックス	35,673,157円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	8,705,722円
計	68,898,275,767円
2. 受益権の総数	68,898,275,767口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,118,349,138円であります。

(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	2023年5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)

	2023年5月21日現在
1口当たり純資産額	0.9547円
(1万口当たり純資産額)	(9,547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)

2023年5月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	17,837,350
コール・ローン	478,936,213
投資証券	31,784,158,250
未収配当金	253,145,154
流動資産合計	32,534,076,967
資産合計	
32,534,076,967	
負債の部	
流動負債	
未払金	172,161,292
未払解約金	124,198,202
未払利息	1,246
その他未払費用	248
流動負債合計	296,360,988
負債合計	
296,360,988	
純資産の部	
元本等	
元本	17,269,065,113
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,968,650,866
元本等合計	32,237,715,979
純資産合計	
32,237,715,979	
負債純資産合計	
32,534,076,967	

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11月22日 至 2023年5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	2023年5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	16,947,494,605円
同期中追加設定元本額	2,448,248,331円
同期中一部解約元本額	2,126,677,823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）	726,008,389円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,151,697,389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	8,833,923,627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）	1,663,639,907円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,948,903,390円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,706,550,194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）	161,988,006円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	16,936,325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）	6,434,759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）	11,638,105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）	37,171,762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）	110,139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）	234,462円
FWニッセイ国内リートインデックス	3,828,659円
計	17,269,065,113円
2. 受益権の総数	17,269,065,113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	2023年5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)

	2023年5月21日現在
1口当たり純資産額	1.8668円
(1万口当たり純資産額)	(18,668円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年5月31日現在

資産総額	146,219,984円
負債総額	749,371円
純資産総額（ - ）	145,470,613円
発行済数量	131,815,406口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1036円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	175,866,573,974円
負債総額	678,832,136円
純資産総額（ - ）	175,187,741,838円
発行済数量	70,380,184,613口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4892円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	67,384,560,826円
負債総額	1,378,693,281円
純資産総額（ - ）	66,005,867,545円
発行済数量	69,211,138,441口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9537円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	32,751,082,552円
負債総額	140,539,287円
純資産総額（ - ）	32,610,543,265円
発行済数量	17,335,283,234口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8812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

2023年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

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、取締役のなか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。

2023年5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	414	69,997
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	116	20,002
単位型公社債投資信託	0	0
合計	530	90,000

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28期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		38,492,350		31,522,565
有価証券		6,249,635		5,099,877
前払費用		763,755		595,955
未収委託者報酬		6,157,565		5,813,921
未収運用受託報酬		3,219,400		3,456,007
未収投資助言報酬		265,131		259,830
その他		8,403		18,700
流動資産合計		55,156,243		46,766,858
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	150,311	1	150,182
車両	1	968	1	482
器具備品	1	103,050	1	92,889
有形固定資産合計		254,330		243,554
無形固定資産				
ソフトウェア		1,840,943		1,803,047
ソフトウェア仮勘定		577,731		1,198,151
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		2,426,688		3,009,212
投資その他の資産				
投資有価証券		30,679,401		37,635,584
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		10,629		11,881
差入保証金		374,819		367,613
繰延税金資産		1,413,142		1,600,306
その他		10,305		10,037
投資その他の資産合計		32,554,521		39,691,645
固定資産合計		35,235,540		42,944,413
資産合計		90,391,783		89,711,272

負債の部

流動負債

預り金		51,241		53,649
未払収益分配金		8,706		7,080
未払手数料	2	2,315,345	2	2,148,508
未払運用委託報酬	2	1,728,950	2	1,868,264
未払投資助言報酬	2	828,040	2	801,755
その他未払金	2	4,619,477	2	2,880,396
未払費用	2	134,086	2	122,649
未払法人税等		611,046		1,689,458
未払消費税等		349,108		321,144
賞与引当金		1,227,440		1,047,233
その他		93,579		46,054
流動負債合計		11,967,023		10,986,194

固定負債

退職給付引当金		2,423,289		2,402,314
役員退職慰労引当金		16,750		16,150
固定負債合計		2,440,039		2,418,464

負債合計

		14,407,063		13,404,658
--	--	------------	--	------------

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		56,866,270		57,905,876

利益剰余金合計		57,546,077		58,585,683
---------	--	------------	--	------------

株主資本合計		75,827,917		76,867,523
--------	--	------------	--	------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		348,871		254,732
繰延ヘッジ損益		192,067		306,177
評価・換算差額等合計		156,803		560,910

純資産合計		75,984,720		76,306,613
-------	--	------------	--	------------

負債・純資産合計		90,391,783		89,711,272
----------	--	------------	--	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,144,394	27,807,455
運用受託報酬	17,750,312	18,365,703
投資助言報酬	1,032,738	1,146,302
その他営業収益	-	4,497
営業収益計	47,927,445	47,323,959
営業費用		
支払手数料	11,524,989	10,826,133
広告宣伝費	62,919	34,423
公告費	125	125
調査費	8,730,925	9,426,129
支払運用委託報酬	3,825,413	3,994,350
支払投資助言報酬	3,083,142	3,279,321
委託調査費	125,430	143,143
調査費	1,696,938	2,009,314
委託計算費	277,534	278,897
営業雑経費	846,156	876,260
通信費	59,759	60,541
印刷費	173,841	166,600
協会費	38,262	37,646
その他営業雑経費	574,292	611,472
営業費用計	21,442,649	21,441,969
一般管理費		
役員報酬	150,830	114,167
給料・手当	4,699,931	5,179,604
賞与引当金繰入額	1,184,037	1,033,669
賞与	369,403	357,187
福利厚生費	925,165	988,302
退職給付費用	431,379	411,161
役員退職慰労引当金繰入額	8,950	5,850
役員退職慰労金	-	2,550
その他人件費	162,879	214,336
不動産賃借料	766,098	803,805
その他不動産経費	36,278	35,247
交際費	12,883	27,169
旅費交通費	17,654	133,750
固定資産減価償却費	552,239	663,401
租税公課	385,352	367,046
業務委託費	349,177	438,018
器具備品費	484,762	769,903
保険料	46,907	49,248
寄付金	5,126	10,762
諸経費	247,185	279,825
一般管理費計	10,836,244	11,885,008
営業利益	15,648,550	13,996,981
営業外収益		
受取利息	2,029	950
有価証券利息	3,452	15,666

受取配当金	1	83,809	1	191,353
為替差益		27,680		22,628
その他営業外収益		19,955		20,449
営業外収益計		136,927		251,049
営業外費用				
控除対象外消費税		20,188		5,712
その他営業外費用		404		314
営業外費用計		20,592		6,026
経常利益		15,764,885		14,242,004
特別利益				
投資有価証券売却益		18,927		97,919
投資有価証券償還益		510,138		45,181
特別利益計		529,065		143,100
特別損失				
投資有価証券売却損		7,280		73,703
投資有価証券償還損		50,697		71,887
固定資産除却損	2	132	2	1,757
事故損失賠償金	3	9,883	3	2,015
特別損失計		67,993		149,364
税引前当期純利益		16,225,956		14,235,739
法人税、住民税及び事業税		4,940,051		4,112,329
法人税等調整額		24,895		74,919
法人税等合計		4,964,946		4,187,249
当期純利益		11,261,009		10,048,489

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	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

当事業年度(自2022年4月1日 至2023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				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	56,866,270	57,546,077	75,827,917	
当期変動額											
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,008,883	9,008,883	9,008,883	
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,048,489	10,048,489	10,048,489	
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,039,606	1,039,606	1,039,606	
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523	

	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	348,871	192,067	156,803	75,984,720
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,008,883
当期純利益	-	-	-	10,048,489
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	603,603	114,109	717,713	717,713
当期変動額合計	603,603	114,109	717,713	321,892
当期末残高	254,732	306,177	560,910	76,306,613

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023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るものであります。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定は、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るものであります。</p>
8．グループ通算制度の適用	<p>当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算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。</p>

（会計方針の変更）

「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。以下「時価算定基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計基準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。

（未適用の会計基準等）

- ・ 「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」（企業会計基準第27号 2022年10月28日）
- ・ 「包括利益の表示に関する会計基準」（企業会計基準第25号 2022年10月28日）
- ・ 「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2022年10月28日）

（1）概要

その他の包括利益に対して課税される場合の法人税等の計上区分及びグループ法人税制が適用される場合の子会社株式等の売却に係る税効果の取扱いを定めるものです。

（2）適用予定日

2025年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」等の適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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物附属設備	329,011千円	340,233千円
車両	5,760	6,246
器具備品	494,576	516,937
計	829,348	863,417

- 2．前事業年度において、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5,317,615千円、2,706,850千円であります。

（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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
受取配当金	42,069千円	174,180千円

- 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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
器具備品	132	1,749
ソフトウェア	-	8
計	132	1,757

- 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

当事業年度（自2022年4月1日 至2023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

2022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	9,008,883千円
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

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

2023年6月26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	8,038,816千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	74,126円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月26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（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	36,929,036	36,918,956	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。

当事業年度(2023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	23,445,768	23,460,731	14,962
その他有価証券	19,289,693	19,289,693	-
資産計	42,735,461	42,750,424	14,962
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	24,321	24,321	-
デリバティブ取引計	24,321	24,321	-

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

(注1) 市場価格のない株式等

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位:千円)

区分	当事業年度 (2023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

前事業年度（2022年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	19,610,019	-	19,610,019
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	73,870	-	73,870
合計	-	19,536,149	-	19,536,149

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

当事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	19,289,693	-	19,289,693
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	24,321	-	24,321
合計	-	19,265,372	-	19,265,372

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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	-	23,460,731	-	23,460,731
合計	-	23,460,731	-	23,460,731

(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(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。

当事業年度(2023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	31,522,565	-	-	-
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	5,100,000	18,340,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	3,029,947	15,086,454	997,574	175,716
合計	39,652,513	33,426,454	997,574	175,716

(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（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

当事業年度（2023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	13,455,768	13,484,645	28,876
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	13,455,768	13,484,645	28,876
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	9,990,000	9,976,086	13,914
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	9,990,000	9,976,086	13,914
合計		23,445,768	23,460,731	14,962

2. その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（2023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）	6,778,610	6,336,999	441,610
	小計	6,778,610	6,336,999	441,610
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）	12,511,082	13,413,000	901,917
	小計	12,511,082	13,413,000	901,917
	合計	19,289,693	19,749,999	460,306

（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

当事業年度(自2022年4月1日 至2023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	325,215	97,919	73,703
合計	325,215	97,919	73,703

(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（2022年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2023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（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 〇 で示しております。

当事業年度（2023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	1,129,663	-	24,321
合計			1,129,663	-	24,321

(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 〇 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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,049,929 千円	2,324,488 千円
勤務費用	296,556	261,043
利息費用	5,724	7,886
数理計算上の差異の発生額	26,217	51,020
退職給付の支払額	58,809	318,533
その他	4,869	2,382
退職給付債務の期末残高	2,324,488	2,226,246

（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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	134,197 千円	147,543 千円
退職給付費用	19,557	18,835
退職給付の支払額	1,342	1,081
その他	4,869	2,382
退職給付引当金の期末残高	147,543	162,914

（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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,472,031 千円	2,389,160 千円
未認識数理計算上の差異	48,741	13,153
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,423,289	2,402,314
退職給付引当金	2,423,289	2,402,314
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,423,289	2,402,314

(4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	19,557 千円	18,835 千円
勤務費用	296,556	261,043
利息費用	5,724	7,886
数理計算上の差異の当期費用処理額	5,631	10,874
確定給付制度に係る退職給付費用	327,469	298,639

(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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.35 %	0.66 %

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68,995千円、当事業年度において75,867千円であり、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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	375,842 千円	320,663 千円
未払事業税	134,561	113,779
退職給付引当金	742,011	735,588
税務上の繰延資産償却超過額	1,565	2,055
役員退職慰労引当金	5,128	4,945
投資有価証券評価差額	140,574	314,276
減価償却超過額	38,704	48,992
その他	128,909	180,561
小計	1,567,297	1,720,862
評価性引当額	1,808	12,818
繰延税金資産合計	1,565,488	1,708,043
繰延税金負債		
特別分配金否認	6,396	10,817
投資有価証券評価差額	145,949	96,919
繰延税金負債合計	152,345	107,737
繰延税金資産(は負債)の純額	1,413,142	1,600,306

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。

3 . 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度からグループ通算制度を適用しております。「グループ通算制度を適用する場合の会計処理およ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）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(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

当事業年度（自2022年4月1日 至2023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	5,921,322

[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	前事業年度 （自 2021年4月 1日 至2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月 1日 至2023年3月31日）
営業収益		
投資信託委託業務	29,144,394	27,807,455
投資運用業務（注）	17,750,312	18,365,703
投資助言業務	1,032,738	1,146,302
その他営業収益	-	4,497
計	47,927,445	47,323,959

（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
								連結納税に伴う支払	3,919,311	その他未払金	3,919,311

当事業年度（自2022年4月1日 至2023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	5,922,395	未収運用受託報酬	1,446,614
								投資助言報酬の受取	118,702	未収投資助言報酬	10,996
								グループ通算に伴う支払	2,065,951	その他未払金	2,065,951

（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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
1 株当たり純資産額	700,655円80銭	703,623円97銭
1 株当たり当期純利益金額	103,837円87銭	92,657円21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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
当期純利益	11,261,009千円	10,048,489千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	11,261,009千円	10,048,489千円
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

2023年3月23日に開催された臨時株主総会において、定款に関し以下の変更が決議されました。

<変更前>

(略)

(株主総会の招集及び議長)

第10条 株主総会は、社長が招集し、議長となる。社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が株主総会を招集し、議長となる。

(略)

(役付取締役)

第19条 取締役会は、その決議によって、取締役の中から社長1名を選定する。

2. 取締役会は、前項のほかに必要に応じて会長1名、副社長、専務取締役及び常務取締役各若干名を選定することができる。

(取締役会)

第20条 取締役会は、社長が招集し、その議長となる。

2. 社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が取締役会を招集し、議長となる。

(略)

<変更後>

(略)

(株主総会の招集及び議長)

第10条 株主総会は、取締役社長が招集し、議長となる。取締役社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が株主総会を招集し、議長となる。

（略）

（役付取締役）

第19条 取締役会は、その決議によって、取締役の中から取締役社長 1名を選定する。

2．取締役会は、前項のほかに必要なに応じて取締役会長 1名を選定することができる。

（取締役会）

第20条 取締役会は、取締役社長が招集し、その議長となる。

2．取締役社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が取締役会を招集し、議長となる。

（略）

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
2023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
2023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：2023年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	
光世証券株式会社	12,000	
楽天証券株式会社	19,495	
内藤証券株式会社	3,002	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	

(3) 投資助言会社（参考情報）

- a. 名称
株式会社ニッセイ基礎研究所
- b. 資本金の額
2023年3月末現在、450百万円
- c. 事業の内容
「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

3【資本関係】

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

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

第3【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

2023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2022年4月1日から2023年3月31日までの第28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2023年3月31日現在の財政状態並びに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

2023年2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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）の2021年11月23日から2022年11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・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）の2022年11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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

2023年8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・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）の2022年11月22日から2023年5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・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）の2023年5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11月22日から2023年5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、継続企業的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。継続企業的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。