

【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】	2026年8月20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】	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：2026年8月21日から2027年2月19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経由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払込まれます。

（ 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

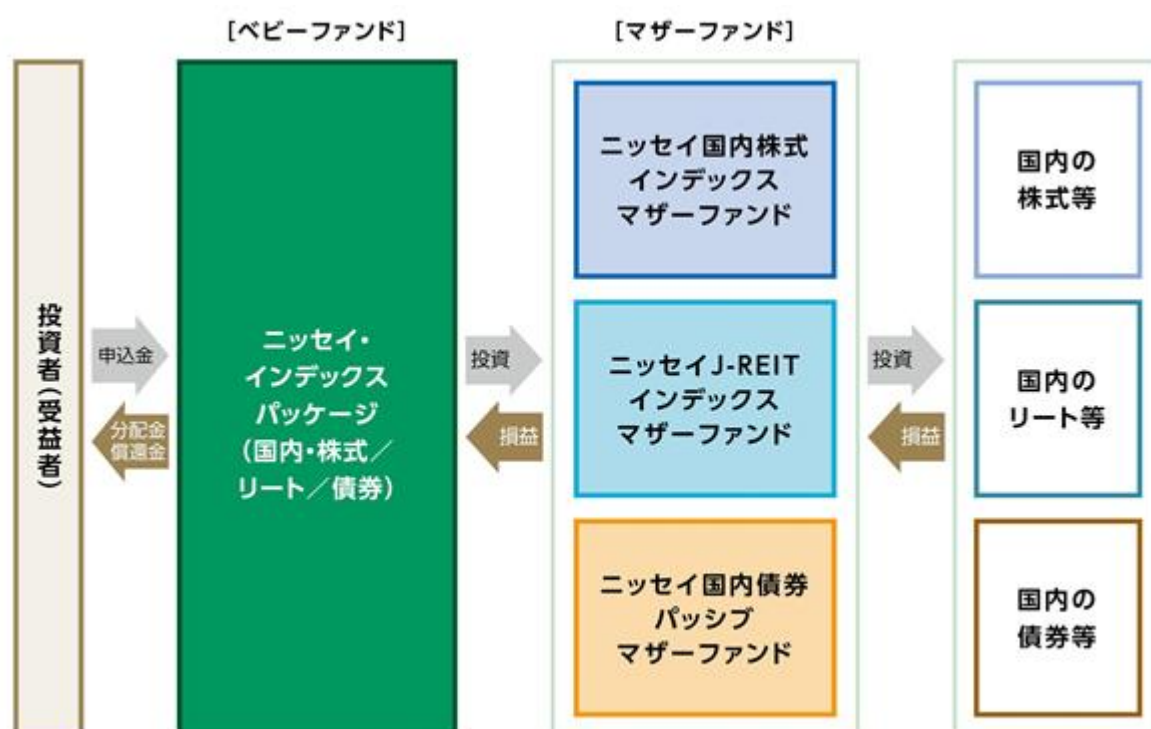
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

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

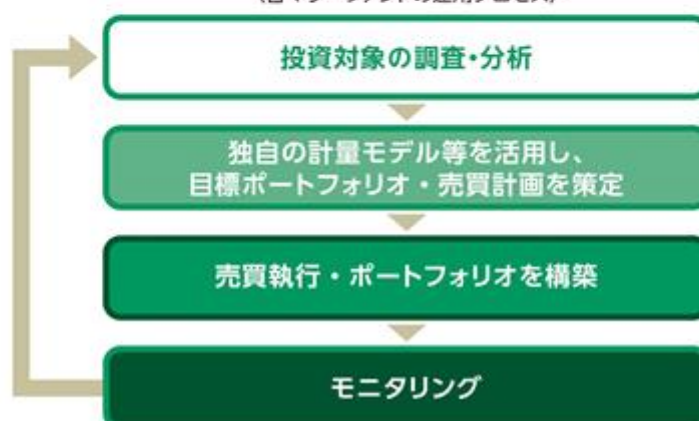
1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

- 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〉

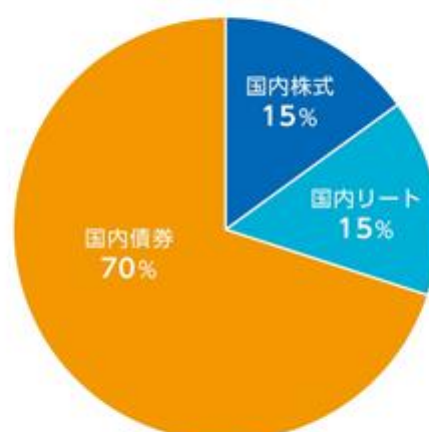


2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

- 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入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングがずれること、売買時のコストや運用管理費用(信託報酬)等の費用を負担することなどから、基準価額と合成ベンチマークの動きは完全に一致するものではありません。

〈各指数について〉**●TOPIX（東証株価指数）**

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
	海 外	債 券	
追 加 型		不動産投信	特 殊 型
	内 外	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）
資産複合 （ ） 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 （ ）	アフリカ		
		中近東 （中東）		
		エマー ジング		

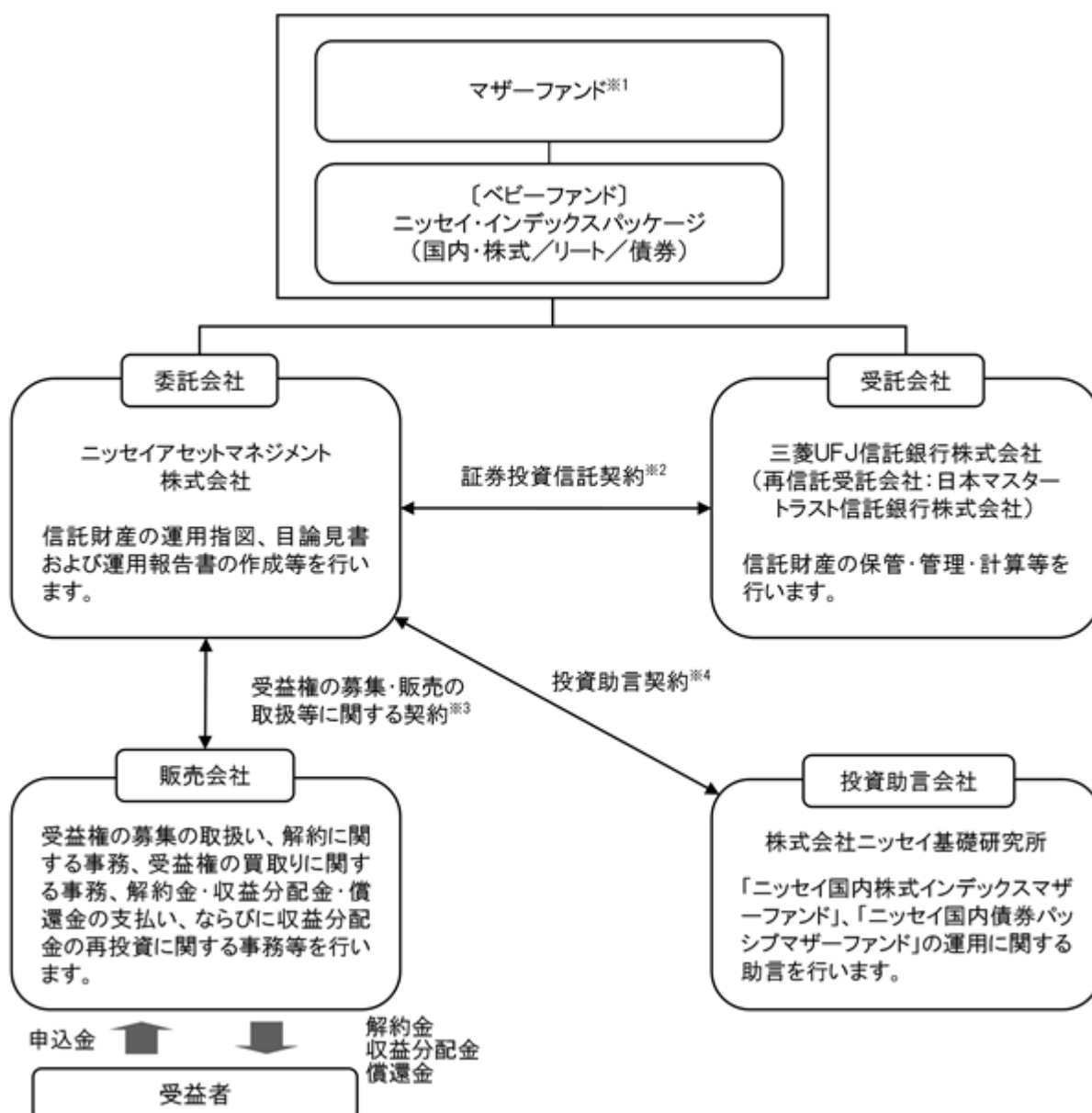
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式・ 不動産投信・債券） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主た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 資産運用業協会ホームページ（<https://www.imaj.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（2026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、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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みます）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みます）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。

対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

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。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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です。

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

デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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 - R E I T 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 金利先渡し取引」に定めるものに限りま

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 U F J 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書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、 1. から 11. までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます）
14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りま
17. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

金融商品

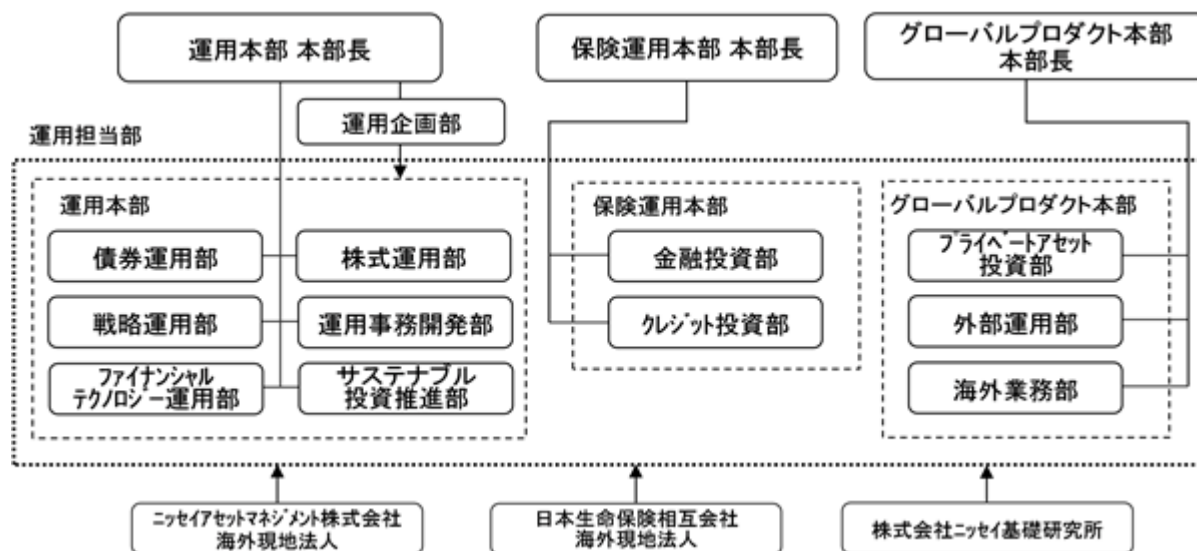
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

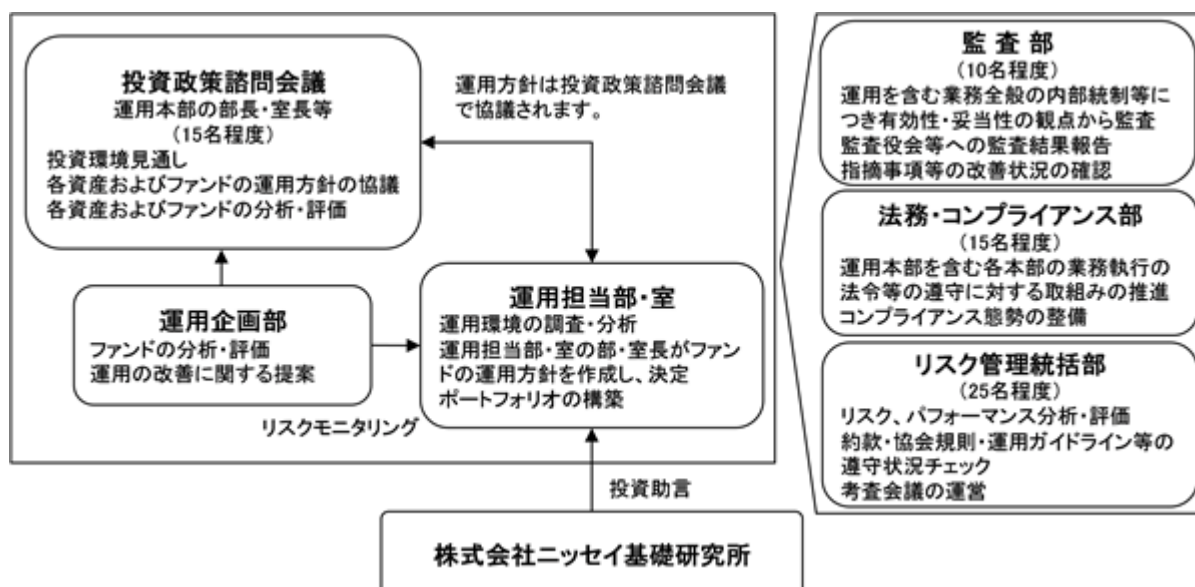
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

- 上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
 2. 分配対象額についての分配方針
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。
 3. 留保益の運用方針
留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
- 分配時期
毎決算日とし、決算日は11月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。
- 支払方法
- < 分配金受取コースの場合 >
税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。
 - < 分配金再投資コースの場合 >
税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

- 将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】**a 約款に定める主な投資制限**

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

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

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、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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たときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

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たときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

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たときは、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たときは、担保の提供を行うものとします。
2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
- 4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。
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、リートの経営や財務状況が悪化した場合、リ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

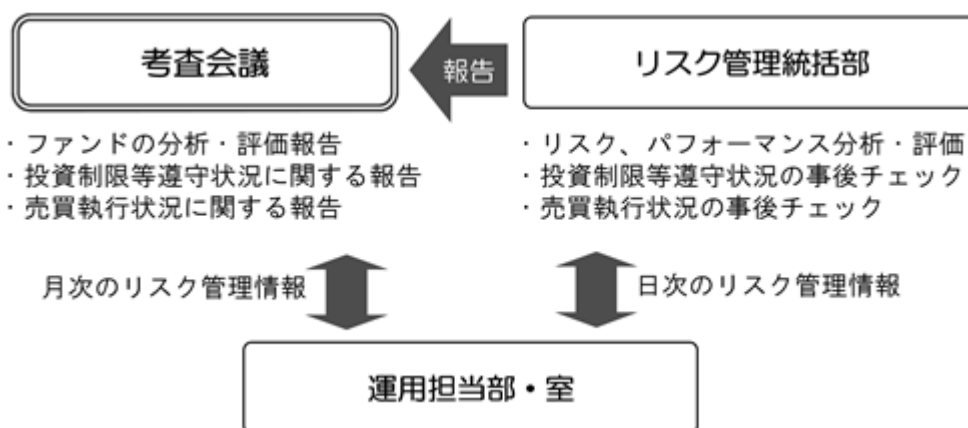
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にもとない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・流動性に関する留意点

ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。

これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受付けを中止する、また既に受付けた換金の申込みの受付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

（２）投資リスク管理体制



１．リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。

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

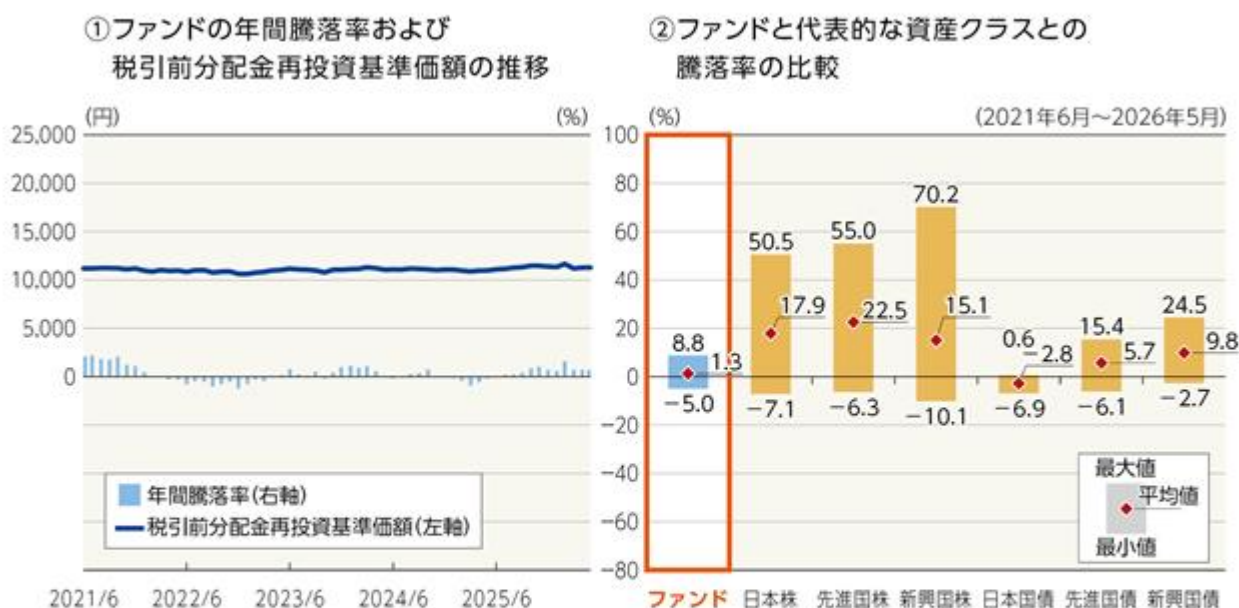
２．運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

- 上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

<流動性リスクに関する管理体制>

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

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



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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

1 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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

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年0.0011%（税抜0.001%）の率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

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、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率で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、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率で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。

- 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>

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」は少額上場株式等に関する非課税制度であり、NISAをご利用の場合、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。

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。

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、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象となります。ただし、販売会社により取扱いが異なる場合があります。

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

15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収 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。

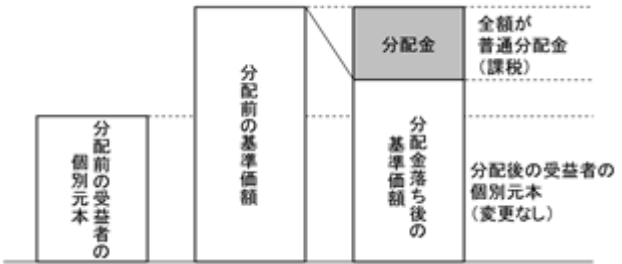
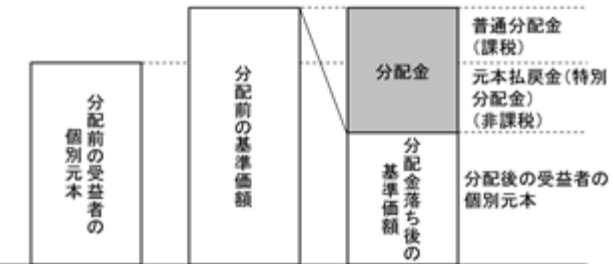
個別元本

- ・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）
 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。	 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。

- 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。

(参考情報) ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.31%	0.31%	0.00%

・対象期間:2024年11月21日～2025年11月20日

・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。なお、前記「ファンドの費用」に記載の監査費用は、②その他費用の比率に含めています。

・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2026年5月29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	329,340,784	100.00
内 日本	329,340,784	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,793	0.00
純資産総額	329,337,991	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

2026年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	451,638,353,050	97.09
内 日本	451,638,353,050	97.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,532,871,924	2.91
純資産総額	465,171,224,974	100.00

その他資産の投資状況

2026年5月29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）	14,104,720,000	3.03
内 日本	14,104,720,000	3.03

（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

2026年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	64,977,910,430	84.13
内 日本	64,977,910,430	84.13
地方債証券	3,058,837,492	3.96
内 日本	3,058,837,492	3.96
特殊債券	4,190,798,029	5.43
内 日本	4,190,798,029	5.43
社債券	4,255,955,400	5.51
内 日本	4,255,955,400	5.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	754,168,234	0.98
純資産総額	77,237,669,585	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

2026年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	37,812,615,900	96.84
内 日本	37,812,615,900	96.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,235,161,338	3.16
純資産総額	39,047,777,238	100.00

その他資産の投資状況

2026年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	1,241,660,000	3.18
内 日本	1,241,660,000	3.18

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2026年5月29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	275,446,010	0.8605 237,036,284	0.8314 229,005,812	- -	69.54
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	10,578,976	4.1831 44,252,984	4.9608 52,480,184	- -	15.94
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	22,954,139	2.2296 51,180,409	2.0848 47,854,788	- -	14.53

（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

2026年5月29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

2026年5月29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	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	5,068,600	2,935.09 14,876,812,100	2,999.00 15,200,731,400	- -	3.27
2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	4,336,700	3,611.85 15,663,525,200	3,042.00 13,192,241,400	- -	2.84
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,568,200	4,363.05 6,842,145,800	7,491.00 11,747,386,200	- -	2.53
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,075,500	4,927.85 10,227,768,200	5,166.00 10,722,033,000	- -	2.30

5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,751,500	5,945.42 10,413,410,200	5,819.00 10,191,978,500	- -	2.19
6	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,814,100	3,333.42 9,380,592,200	3,444.00 9,691,760,400	- -	2.08
7	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	171,300	43,912.13 7,522,148,000	52,420.00 8,979,546,000	- -	1.93
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,117,800	7,150.01 7,992,284,728	7,195.00 8,042,571,000	- -	1.73
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,584,700	5,004.88 7,931,246,128	5,065.00 8,026,505,500	- -	1.73
10	村田製作所 日本	株式 電気機器	778,500	3,749.97 2,919,354,000	9,625.00 7,493,062,500	- -	1.61
11	キーエンス 日本	株式 電気機器	81,600	61,650.03 5,030,643,000	80,110.00 6,536,976,000	- -	1.41
12	三井物産 日本	株式 卸売業	1,223,500	5,521.06 6,755,027,430	5,290.00 6,472,315,000	- -	1.39
13	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	245,600	25,520.73 6,267,892,517	26,170.00 6,427,352,000	- -	1.38
14	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	584,000	6,335.28 3,699,809,088	10,570.00 6,172,880,000	- -	1.33
15	三菱電機 日本	株式 電気機器	902,500	5,848.26 5,278,055,900	6,558.00 5,918,595,000	- -	1.27
16	三菱重工業 日本	株式 機械	1,543,800	4,936.56 7,621,076,600	3,806.00 5,875,702,800	- -	1.26
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	826,000	6,519.30 5,384,947,500	7,111.00 5,873,686,000	- -	1.26
18	信越化学工業 日本	株式 化学	726,700	5,799.94 4,214,819,900	7,758.00 5,637,738,600	- -	1.21
19	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	2,901,000	2,182.27 6,330,786,300	1,935.50 5,614,885,500	- -	1.21
20	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	58,200	67,071.47 3,903,560,000	82,330.00 4,791,606,000	- -	1.03
21	HOYA 日本	株式 精密機器	154,900	27,554.72 4,268,226,500	27,080.00 4,194,692,000	- -	0.90
22	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	728,200	5,774.06 4,204,675,000	5,118.00 3,726,927,600	- -	0.80
23	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	290,700	9,777.58 2,842,344,100	12,585.00 3,658,459,500	- -	0.79
24	任天堂 日本	株式 その他製品	510,600	8,571.45 4,376,582,900	7,148.00 3,649,768,800	- -	0.78
25	住友商事 日本	株式 卸売業	510,300	6,361.16 3,246,102,104	7,099.00 3,622,619,700	- -	0.78
26	パナソニックホールディングス 日本	株式 電気機器	973,400	2,533.34 2,465,960,550	3,700.00 3,601,580,000	- -	0.77

27	ルネサスエレクトロニクス 日本	株式 電気機器	798,900	2,911.82 2,326,256,700	4,500.00 3,595,050,000	- -	0.77
28	丸紅 日本	株式 卸売業	658,600	5,708.50 3,759,620,700	5,196.00 3,422,085,600	- -	0.74
29	N T T 日本	株式 情報・通 信業	22,465,100	151.12 3,395,106,150	149.50 3,358,532,450	- -	0.72
30	キオクシアホールディング ス 日本	株式 電気機器	50,000	21,362.01 1,068,100,500	65,850.00 3,292,500,000	- -	0.71

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2026年5月29日現在

2020年03月25日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	国内	電気機器	21.12
		銀行業	10.52
		卸売業	7.51
		情報・通信業	6.67
		機械	5.92
		輸送用機器	5.15
		化学	4.76
		小売業	3.76
		医薬品	3.19
		サービス業	3.17
		保険業	3.12
		非鉄金属	2.76
		食料品	2.53
		建設業	2.09
		精密機器	1.84
		その他製品	1.80
		陸運業	1.75
		不動産業	1.62
		その他金融業	1.18
		電気・ガス業	1.17
		ガラス・土石製品	0.84
		証券、商品先物取引業	0.84
		鉄鋼	0.63
		ゴム製品	0.52
		海運業	0.48
		金属製品	0.48
		石油・石炭製品	0.47
		鉱業	0.34
		繊維製品	0.30
		空運業	0.25
		倉庫・運輸関連業	0.12
		パルプ・紙	0.12
	水産・農林業	0.07	
	小計		97.09
合 計（対純資産総額比）			97.09

（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

2026年5月29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376回 利付国債(10年) 日本	国債証券	768,000,000	90.87 697,886,800	88.63 680,686,080	0.9 2034/9/20	0.88
2	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	693,000,000	97.75 677,462,940	97.82 677,892,600	0.1 2028/3/20	0.88
3	第378回 利付国債(10年) 日本	国債証券	741,000,000	94.30 698,786,340	91.43 677,555,580	1.4 2035/3/20	0.88
4	第375回 利付国債(10年) 日本	国債証券	740,000,000	92.83 687,012,500	90.64 670,780,400	1.1 2034/6/20	0.87
5	第377回 利付国債(10年) 日本	国債証券	739,000,000	92.76 685,546,050	90.36 667,767,790	1.2 2034/12/20	0.86
6	第381回 利付国債(10年) 日本	国債証券	693,000,000	98.26 681,001,080	95.84 664,191,990	2.1 2035/12/20	0.86
7	第380回 利付国債(10年) 日本	国債証券	711,000,000	96.20 683,983,170	92.94 660,831,840	1.7 2035/9/20	0.86
8	第379回 利付国債(10年) 日本	国債証券	716,000,000	94.84 679,125,700	91.77 657,080,360	1.5 2035/6/20	0.85
9	第183回 利付国債(5年) 日本	国債証券	624,000,000	99.45 620,621,660	98.92 617,316,960	1.6 2030/12/20	0.80
10	第359回 利付国債(10年) 日本	国債証券	655,000,000	93.97 615,542,800	93.56 612,831,100	0.1 2030/6/20	0.79
11	第178回 利付国債(5年) 日本	国債証券	603,000,000	97.93 590,517,900	97.41 587,406,420	1 2030/3/20	0.76
12	第353回 利付国債(10年) 日本	国債証券	605,000,000	96.66 584,823,250	96.61 584,526,800	0.1 2028/12/20	0.76
13	第365回 利付国債(10年) 日本	国債証券	646,000,000	91.10 588,518,920	90.07 581,884,500	0.1 2031/12/20	0.75
14	第356回 利付国債(10年) 日本	国債証券	606,000,000	95.34 577,760,400	95.21 577,015,020	0.1 2029/9/20	0.75
15	第373回 利付国債(10年) 日本	国債証券	647,000,000	90.42 585,043,280	88.23 570,886,920	0.6 2033/12/20	0.74

16	第483回 利付国債（2年） 日本	国債証券	550,000,000	100.04 550,245,500	100.09 550,539,000	1.4 2028/4/1	0.71
17	第374回 利付国債（10年） 日本	国債証券	582,000,000	91.37 531,796,470	89.04 518,265,180	0.8 2034/3/20	0.67
18	第355回 利付国債（10年） 日本	国債証券	538,000,000	95.80 515,441,660	95.71 514,962,840	0.1 2029/6/20	0.67
19	第358回 利付国債（10年） 日本	国債証券	545,000,000	94.43 514,670,750	94.15 513,139,300	0.1 2030/3/20	0.66
20	第360回 利付国債（10年） 日本	国債証券	543,000,000	93.54 507,960,210	93.00 505,011,720	0.1 2030/9/20	0.65
21	第484回 利付国債（2年） 日本	国債証券	500,000,000	100.06 500,315,000	100.06 500,325,000	1.4 2028/5/1	0.65
22	第481回 利付国債（2年） 日本	国債証券	500,000,000	99.96 499,800,000	99.99 499,955,000	1.3 2028/2/1	0.65
23	第482回 利付国債（2年） 日本	国債証券	500,000,000	99.90 499,520,000	99.95 499,785,000	1.3 2028/3/1	0.65
24	第382回 利付国債（10年） 日本	国債証券	487,000,000	98.08 477,690,220	98.01 477,337,920	2.4 2036/3/20	0.62
25	第354回 利付国債（10年） 日本	国債証券	467,000,000	96.16 449,076,870	96.19 449,249,330	0.1 2029/3/20	0.58
26	第147回 利付国債（20年） 日本	国債証券	468,000,000	97.58 456,708,720	95.15 445,339,440	1.6 2033/12/20	0.58
27	第364回 利付国債（10年） 日本	国債証券	483,000,000	91.61 442,490,790	90.69 438,047,190	0.1 2031/9/20	0.57
28	第371回 利付国債（10年） 日本	国債証券	493,000,000	90.03 443,877,480	88.12 434,446,390	0.4 2033/6/20	0.56
29	第372回 利付国債（10年） 日本	国債証券	473,000,000	92.29 436,569,540	90.16 426,494,640	0.8 2033/9/20	0.55
30	第349回 利付国債（10年） 日本	国債証券	434,000,000	98.07 425,623,800	98.21 426,261,780	0.1 2027/12/20	0.55

（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

2026年5月29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	84.13
		社債券	5.51
		特殊債券	5.43
		地方債証券	3.96
	小計		99.02
合 計（対純資産総額比）			99.02

（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

2026年5月29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	21,448	127,300.00 2,730,330,400	127,400.00 2,732,475,200	- -	7.00
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	18,650	116,600.00 2,174,590,000	114,300.00 2,131,695,000	- -	5.46
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	18,438	114,300.00 2,107,463,400	112,500.00 2,074,275,000	- -	5.31
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	11,315	157,300.00 1,779,849,500	152,600.00 1,726,669,000	- -	4.42
5	K D X 不動産投資法人 日本	投資証券	10,354	159,700.00 1,653,533,800	159,000.00 1,646,286,000	- -	4.22
6	G L P 投資法人 日本	投資証券	11,683	134,700.00 1,573,700,100	133,700.00 1,562,017,100	- -	4.00
7	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	18,279	88,900.00 1,625,003,100	85,300.00 1,559,198,700	- -	3.99
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	14,150	97,100.00 1,373,965,000	96,100.00 1,359,815,000	- -	3.48
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	11,055	122,900.00 1,358,659,500	120,600.00 1,333,233,000	- -	3.41
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	8,186	170,500.00 1,395,713,000	162,200.00 1,327,769,200	- -	3.40
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	19,601	60,500.00 1,185,860,500	61,300.00 1,201,541,300	- -	3.08
12	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	15,134	76,600.00 1,159,264,400	76,600.00 1,159,264,400	- -	2.97
13	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	7,311	159,200.00 1,163,911,200	154,000.00 1,125,894,000	- -	2.88
14	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	9,846	97,500.00 959,985,000	95,100.00 936,354,600	- -	2.40
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	6,481	142,900.00 926,134,900	140,200.00 908,636,200	- -	2.33

16	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	10,481	84,200.00 882,500,200	82,000.00 859,442,000	- -	2.20
17	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	7,841	109,700.00 860,157,700	107,900.00 846,043,900	- -	2.17
18	三井不動産アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,130	129,100.00 791,383,000	125,900.00 771,767,000	- -	1.98
19	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	5,482	137,400.00 753,226,800	130,800.00 717,045,600	- -	1.84
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	4,452	149,100.00 663,793,200	145,700.00 648,656,400	- -	1.66
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	7,039	93,400.00 657,442,600	91,900.00 646,884,100	- -	1.66
22	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	5,379	107,700.00 579,318,300	105,600.00 568,022,400	- -	1.45
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,110	131,300.00 539,643,000	129,500.00 532,245,000	- -	1.36
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	4,312	124,200.00 535,550,400	122,800.00 529,513,600	- -	1.36
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	5,199	105,000.00 545,895,000	101,400.00 527,178,600	- -	1.35
26	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,240	84,400.00 526,656,000	81,600.00 509,184,000	- -	1.30
27	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	6,844	73,400.00 502,349,600	74,000.00 506,456,000	- -	1.30
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	3,138	160,800.00 504,590,400	156,200.00 490,155,600	- -	1.26
29	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	3,575	134,800.00 481,910,000	132,300.00 472,972,500	- -	1.21
30	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,438	330,500.00 475,259,000	318,000.00 457,284,000	- -	1.17

（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。

種類別及び業種別投資比率

2026年5月29日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（％）
投資証券	国内		96.84
	小計		96.84
合 計（対純資産総額比）			96.84

（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

2026年5月29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 8 0 6 月	買建	356	13,207,720,800	14,104,720,000	3.03

（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

2026年5月29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 （％）
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物 0 8 0 6 月	買建	686	1,257,415,380	1,241,660,000	3.18

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2026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
第6計算期間末 (2023年11月20日)	185,998,651	185,998,651	1.1015	1.1015
第7計算期間末 (2024年11月20日)	242,299,157	242,299,157	1.1031	1.1031
第8計算期間末 (2025年11月20日)	299,274,792	299,274,792	1.1377	1.1377
2025年5月末日	268,243,605	-	1.0979	-
6月末日	275,609,558	-	1.1097	-
7月末日	275,055,390	-	1.1150	-
8月末日	280,595,961	-	1.1267	-
9月末日	282,285,806	-	1.1317	-
10月末日	295,722,249	-	1.1476	-
11月末日	300,692,764	-	1.1464	-
12月末日	303,572,505	-	1.1382	-
2026年1月末日	307,352,542	-	1.1336	-
2月末日	320,406,833	-	1.1659	-
3月末日	314,160,234	-	1.1189	-
4月末日	323,002,838	-	1.1276	-
5月末日	329,337,991	-	1.1280	-

【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2025年11月21日～2026年5月20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
第6計算期間	1.2
第7計算期間	0.1
第8計算期間	3.1
2025年11月21日～2026年5月20日	2.3

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じ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
第6計算期間	71,137,784	18,727,261	168,856,389
第7計算期間	96,420,288	45,617,325	219,659,352
第8計算期間	118,447,187	75,048,332	263,058,207
2025年11月21日～ 2026年5月20日	67,998,465	38,722,524	292,334,148

（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

2026年5月末現在

●基準価額・純資産の推移



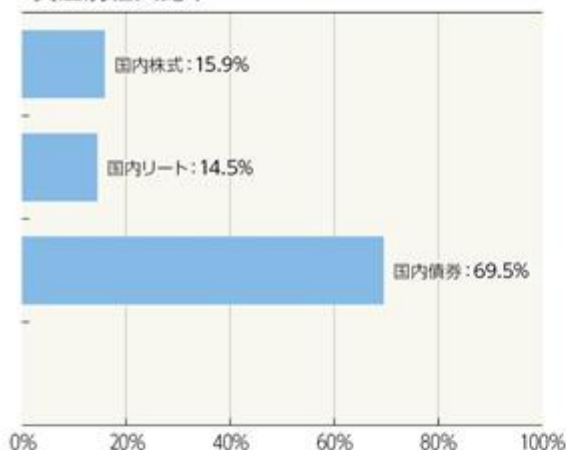
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

●分配の推移 1万口当り(税引前)

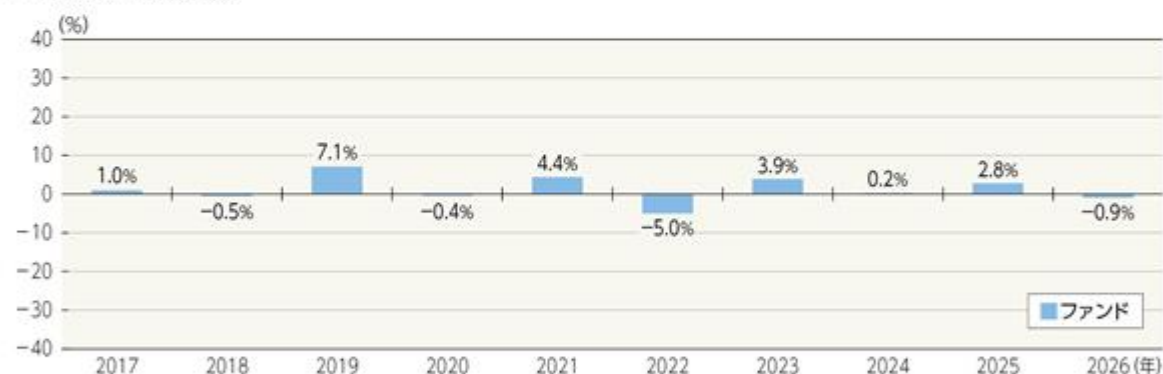
2021年11月	0円
2022年11月	0円
2023年11月	0円
2024年11月	0円
2025年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●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)を再投資したものと計算しております。

・2017年はファンド設定時から年末まで、2026年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2026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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.4%
2	トヨタ自動車	2.9%
3	ソフトバンクグループ	2.6%
4	日立製作所	2.4%
5	三井住友フィナンシャルグループ	2.3%

・比率は対組入株式評価額比です。

2. ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.7%
3	日本都市ファンド投資法人	5.6%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	4.5%
5	KDX不動産投資法人	4.4%

・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376回 利付国債(10年)	2034/09/20	0.900%	0.9%
2	第378回 利付国債(10年)	2035/03/20	1.400%	0.9%
3	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	0.9%
4	第375回 利付国債(10年)	2034/06/20	1.100%	0.9%
5	第377回 利付国債(10年)	2034/12/20	1.200%	0.9%

・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	21.7%
2	銀行業	10.9%
3	卸売業	7.8%
4	情報・通信業	6.9%
5	機械	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等	100.9%
短期金融資産等	-0.9%

・比率は対純資産総額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.4%
債券先物	-
現金、その他	0.6%

・比率は対純資産総額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

原則として午後3時30分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。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にご確認ください。

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ることがあります。

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30分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。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にご確認ください。

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

- 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人資産運用業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

- 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
- 委託会社は、前記１．により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- 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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
- 9．償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。
- 約款の変更等
- 1．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- 2．委託会社は、前記1．の事項（前記1．の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知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っても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知れている受益者に交付します。
- ・ 運用報告書（全体版）は、電磁的方法により提供します。ただし、受益者から書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行います。

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8期計算期間（2024年11月21日から2025年11月20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7期 2024年11月20日現在	第8期 2025年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,755	70,906
コール・ローン	342,278	354,748
親投資信託受益証券	242,301,283	299,277,341
未収入金	786,029	1,319,281
流動資産合計	243,439,345	301,022,276
資産合計	243,439,345	301,022,276
負債の部		
流動負債		
未払解約金	775,444	1,306,468
未払受託者報酬	27,450	34,243
未払委託者報酬	324,874	405,296
その他未払費用	12,420	1,477
流動負債合計	1,140,188	1,747,484
負債合計	1,140,188	1,747,484
純資産の部		
元本等		
元本	219,659,352	263,058,207
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）	22,639,805	36,216,585
（分配準備積立金）	2,621,729	9,650,679
元本等合計	242,299,157	299,274,792
純資産合計	242,299,157	299,274,792
負債純資産合計	243,439,345	301,022,276

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 2023年11月21日 至 2024年11月20日	第8期 自 2024年11月21日 至 2025年11月20日
営業収益		
受取利息	90	662
有価証券売買等損益	528,989	9,626,566
営業収益合計	529,079	9,627,228
営業費用		
受託者報酬	51,039	64,519
委託者報酬	604,224	763,585
その他費用	23,071	8,941
営業費用合計	678,334	837,045
営業利益又は営業損失（ ）	149,255	8,790,183
経常利益又は経常損失（ ）	149,255	8,790,183
当期純利益又は当期純損失（ ）	149,255	8,790,183
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（ ）	336,759	705,376
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,142,262	22,639,805
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,706,516	13,205,987
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	10,706,516	13,205,987
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,722,959	7,714,014
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,722,959	7,714,014
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（ ）	22,639,805	36,216,585

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第8期 自 2024年11月21日 至 2025年11月20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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第7期 2024年11月20日現在	第8期 2025年11月20日現在
1. 期首元本額	168,856,389円	219,659,352円
期中追加設定元本額	96,420,288円	118,447,187円
期中一部解約元本額	45,617,325円	75,048,332円
2. 受益権の総数	219,659,352口	263,058,207口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第7期 自 2023年11月21日 至 2024年11月20日	第8期 自 2024年11月21日 至 2025年11月20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（0円）、収益調整金（20,018,076円）及び分配準備積立金（2,621,729円）より分配対象収益は22,639,805円（1万口当たり1,030.68円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（563円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（7,727,898円）、収益調整金（26,565,906円）及び分配準備積立金（1,922,218円）より分配対象収益は36,216,585円（1万口当たり1,376.75円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第7期	第8期
	自 2023年11月21日 至 2024年11月20日	自 2024年11月21日 至 2025年11月20日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 2024年11月20日現在	第8期 2025年11月20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7期 2024年11月20日現在	第8期 2025年11月20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	823,351	7,280,105
合計	823,351	7,280,105

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 2024年11月20日現在	第8期 2025年11月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1031円 (11,031円)	1.1377円 (11,377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

2025年11月20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	11,166,464	45,657,438	
	ニッセイ J - R E I T インデックス マザーファンド	20,242,489	45,187,308	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	241,101,903	208,432,595	
親投資信託受益証券 合計		272,510,856	299,277,341	
合計			299,277,341	

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

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2025年11月20日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,232,972,782
コール・ローン	6,168,650,581
株式	353,999,076,250
派生商品評価勘定	466,102,300
未収入金	2,717,273
未収配当金	3,198,140,799
差入委託証拠金	606,141,854
流動資産合計	365,673,801,839
資産合計	365,673,801,839
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	204,400
前受金	261,605,000
未払解約金	796,920,703
流動負債合計	1,058,730,103
負債合計	1,058,730,103
純資産の部	
元本等	
元本	89,173,079,217
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	275,441,992,519
元本等合計	364,615,071,736
純資産合計	364,615,071,736
負債純資産合計	365,673,801,839

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年11月21日 至 2025年11月20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	2025年11月20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	78,725,847,548円
同期中追加設定元本額	29,867,594,489円
同期中一部解約元本額	19,420,362,820円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	4,706,221,504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）	2,751,407,120円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,877,356,545円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,285,896,206円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,928,755,729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）	1,500,756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）	6,016,524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）	5,768,710円
DCニッセイ国内株式インデックス	6,819,111,401円
ニッセイTOPIXインデックスファンド＜購入・換金手数料なし＞	25,851,924,189円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	5,944,494,525円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	535,501,664円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	249,355,293円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	632,120,701円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	676,388,010円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	17,343,420円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	121,364,103円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	18,220,168円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	17,039,102円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	5,083,003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）	11,166,464円

ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	28,922,151円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	451,866,998円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	336,939,270円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	557,070,552円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	174,156,538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）	22,613,959,347円
ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）＜購入・換金手数料なし＞	32,584,479円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	81,035,615円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	281,072,521円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	99,342,820円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	38,759,577円
ニッセイインデックスバランス（外国株式重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	6,416,448円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトＳＡ（適格機関投資家限定）	8,917,764円
計	89,173,079,217円
２． 受益権の総数	89,173,079,217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 2024年11月21日 至 2025年11月20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	2025年11月20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	2025年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	59,747,228,334
合計	59,747,228,334

（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（2025年2月21日から2025年11月20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	2025年11月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	10,200,175,000	-	10,666,250,000	466,075,000
合計	10,200,175,000	-	10,666,250,000	466,075,000

（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)

	2025年11月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0888円 (40,888円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2025年11月20日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	4,400	4,670.00	20,548,000	
ニッスイ	97,000	1,213.00	117,661,000	
マルハニチロ	17,100	3,672.00	62,791,200	
ユキグニファクトリー	9,000	1,018.00	9,162,000	
カネコ種苗	3,300	1,561.00	5,151,300	
サカタのタネ	12,800	3,925.00	50,240,000	
ホクト	9,400	1,975.00	18,565,000	
ショーボンドホールディングス	13,900	4,908.00	68,221,200	
ミライト・ワン	36,100	3,164.00	114,220,400	
タマホーム	6,700	3,690.00	24,723,000	
robot home	45,900	199.00	9,134,100	
住石ホールディングス	9,800	572.00	5,605,600	
日鉄鉱業	21,200	1,708.00	36,209,600	
三井松島ホールディングス	12,900	1,313.00	16,937,700	
I N P E X	355,500	3,135.00	1,114,492,500	
石油資源開発	65,300	1,376.00	89,852,800	
K & O エナジーグループ	4,800	3,490.00	16,752,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	15,200	2,899.00	44,064,800	
第一カッター興業	6,500	1,376.00	8,944,000	
安藤・間	56,200	1,804.50	101,412,900	
東急建設	33,200	1,131.00	37,549,200	
コムシスホールディングス	37,600	4,114.00	154,686,400	
ビーアールホールディングス	25,400	328.00	8,331,200	
高松コンストラクショングループ	7,900	3,785.00	29,901,500	
東建コーポレーション	2,300	14,270.00	32,821,000	
ヤマウラ	6,000	1,468.00	8,808,000	
オリエンタル白石	39,200	410.00	16,072,000	
大成建設	62,100	13,060.00	811,026,000	
大林組	239,500	2,976.50	712,871,750	
清水建設	202,400	2,539.50	513,994,800	
長谷工コーポレーション	67,900	2,844.50	193,141,550	
鹿島建設	164,200	5,611.00	921,326,200	
不動テトラ	4,200	2,440.00	10,248,000	
鉄建建設	4,700	3,825.00	17,977,500	
西松建設	11,800	5,540.00	65,372,000	
三井住友建設	18,400	596.00	10,966,400	
大豊建設	10,100	762.00	7,696,200	
奥村組	12,000	5,650.00	67,800,000	
東鉄工業	8,200	4,150.00	34,030,000	

浅沼組	29,700	963.00	28,601,100	
戸田建設	91,100	1,127.00	102,669,700	
熊谷組	44,000	1,500.00	66,000,000	
矢作建設工業	13,900	2,119.00	29,454,100	
ピーエス・コンストラクション	6,700	2,200.00	14,740,000	
日本ハウスホールディングス	28,000	309.00	8,652,000	
大東建託	126,500	2,904.00	367,356,000	
新日本建設	10,400	1,848.00	19,219,200	
東亜道路工業	11,400	1,592.00	18,148,800	
東亜建設工業	27,300	2,671.00	72,918,300	
日本国土開発	22,700	539.00	12,235,300	
若築建設	2,200	4,400.00	9,680,000	
五洋建設	105,000	1,572.00	165,060,000	
世紀東急工業	11,600	1,570.00	18,212,000	
福田組	2,500	7,450.00	18,625,000	
住友林業	192,100	1,519.50	291,895,950	
大和ハウス工業	204,900	5,198.00	1,065,070,200	
ライト工業	14,100	3,220.00	45,402,000	
積水ハウス	224,700	3,300.00	741,510,000	
日特建設	7,100	1,213.00	8,612,300	
ユアテック	15,600	2,580.00	40,248,000	
日本リーテック	5,800	2,065.00	11,977,000	
四電工	9,300	1,431.00	13,308,300	
中電工	9,800	4,330.00	42,434,000	
関電工	40,600	4,851.00	196,950,600	
きんでん	50,800	6,317.00	320,903,600	
東京エネシス	6,900	1,861.00	12,840,900	
トーエネック	14,300	1,811.00	25,897,300	
住友電設	6,000	9,730.00	58,380,000	
日本電設工業	13,900	3,040.00	42,256,000	
エクシオグループ	70,700	2,367.00	167,346,900	
新日本空調	9,600	2,943.00	28,252,800	
クラフティア	16,000	7,686.00	122,976,000	
三機工業	15,200	5,440.00	82,688,000	
日揮ホールディングス	80,700	1,872.00	151,070,400	
中外炉工業	2,000	4,400.00	8,800,000	
太平電業	14,700	2,154.00	31,663,800	
高砂熱学工業	39,700	4,392.00	174,362,400	
朝日工業社	7,700	2,931.00	22,568,700	
明星工業	12,500	1,614.00	20,175,000	
大気社	19,000	3,120.00	59,280,000	
ダイダン	14,300	6,840.00	97,812,000	
日比谷総合設備	5,400	4,575.00	24,705,000	
ニッポン	26,300	2,254.00	59,280,200	
日清製粉グループ本社	73,900	1,820.50	134,534,950	
日東富士製粉	1,300	6,850.00	8,905,000	
昭和産業	6,300	2,998.00	18,887,400	
中部飼料	9,400	1,742.00	16,374,800	
フィード・ワン	9,800	1,029.00	10,084,200	
日本甜菜製糖	3,900	3,540.00	13,806,000	

D M三井製糖	6,200	3,220.00	19,964,000	
ウェルネオシュガー	4,200	2,765.00	11,613,000	
M I X I	14,100	2,851.00	40,199,100	
ジェイエイシーリクルートメント	28,000	1,078.00	30,184,000	
日本M&Aセンターホールディングス	123,700	719.00	88,940,300	
メンバーズ	7,200	1,102.00	7,934,400	
U Tグループ	10,100	2,682.00	27,088,200	
アイティメディア	5,300	1,511.00	8,008,300	
E・Jホールディングス	5,100	1,649.00	8,409,900	
オープンアップグループ	25,900	1,768.00	45,791,200	
コシダカホールディングス	21,300	1,157.00	24,644,100	
パソナグループ	9,100	1,837.00	16,716,700	
リンクアンドモチベーション	18,500	479.00	8,861,500	
エス・エム・エス	29,700	1,300.00	38,610,000	
パーソルホールディングス	707,700	285.50	202,048,350	
森永製菓	29,200	2,641.50	77,131,800	
中村屋	2,800	3,030.00	8,484,000	
江崎グリコ	21,300	5,280.00	112,464,000	
m e i t o	4,000	2,204.00	8,816,000	
井村屋グループ	4,100	2,521.00	10,336,100	
不二家	5,100	2,606.00	13,290,600	
山崎製パン	49,800	3,175.00	158,115,000	
モロゾフ	7,200	1,518.00	10,929,600	
亀田製菓	4,700	3,925.00	18,447,500	
寿スピリッツ	39,600	1,719.50	68,092,200	
カルビー	34,000	2,896.50	98,481,000	
森永乳業	27,700	3,699.00	102,462,300	
六甲バター	7,200	1,216.00	8,755,200	
ヤクルト本社	103,100	2,584.50	266,461,950	
明治ホールディングス	103,600	3,159.00	327,272,400	
雪印メグミルク	20,000	2,954.00	59,080,000	
プリマハム	10,000	2,527.00	25,270,000	
日本ハム	28,000	6,879.00	192,612,000	
丸大食品	7,500	2,120.00	15,900,000	
S F o o d s	8,200	2,553.00	20,934,600	
柿安本店	200	2,607.00	521,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	13,000	5,570.00	72,410,000	
学情	4,800	1,556.00	7,468,800	
スタジオアリス	4,100	2,014.00	8,257,400	
クロスキャット	7,900	1,035.00	8,176,500	
システナ	108,200	494.00	53,450,800	
N J S	1,700	4,925.00	8,372,500	
デジタルアーツ	4,000	6,940.00	27,760,000	
日鉄ソリューションズ	20,700	3,583.00	74,168,100	
A L S O K	129,700	1,196.50	155,186,050	
キューブシステム	7,600	1,061.00	8,063,600	
いちご	62,900	399.00	25,097,100	
日本駐車場開発	88,500	271.00	23,983,500	
コア	4,000	2,021.00	8,084,000	
カカクコム	50,400	2,412.50	121,590,000	

セントケア・ホールディング	10,300	1,216.00	12,524,800	
ディップ	13,600	2,090.00	28,424,000	
S B S ホールディングス	6,700	3,540.00	23,718,000	
デジタルホールディングス	4,100	2,080.00	8,528,000	
新日本科学	8,200	1,631.00	13,374,200	
エムスリー	153,400	2,465.00	378,131,000	
ワールドホールディングス	3,600	2,587.00	9,313,200	
ディー・エヌ・エー	31,000	2,369.00	73,439,000	
博報堂D Yホールディングス	99,000	1,140.50	112,909,500	
ぐるなび	42,200	171.00	7,216,200	
ファンコミュニケーションズ	16,700	525.00	8,767,500	
ライク	5,700	1,493.00	8,510,100	
エスプール	30,000	286.00	8,580,000	
W D B ホールディングス	5,300	1,566.00	8,299,800	
アドウェイズ	29,700	283.00	8,405,100	
バリューコマース	12,100	674.00	8,155,400	
インフォマート	73,200	342.00	25,034,400	
サッポロホールディングス	22,200	8,025.00	178,155,000	
アサヒグループホールディングス	558,300	1,745.00	974,233,500	
麒麟ホールディングス	309,700	2,398.50	742,815,450	
シマダヤ	4,800	1,738.00	8,342,400	
宝ホールディングス	61,300	1,405.50	86,157,150	
オエノンホールディングス	22,300	517.00	11,529,100	
養命酒製造	2,400	4,660.00	11,184,000	
飛島ホールディングス	7,600	2,114.00	16,066,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	51,700	2,791.50	144,320,550	
ライフドリンク カンパニー	13,300	1,970.00	26,201,000	
サントリー食品インターナショナル	52,400	4,814.00	252,253,600	
ダイドーグループホールディングス	8,400	2,420.00	20,328,000	
伊藤園	24,100	3,161.00	76,180,100	
キーコーヒー	8,300	1,962.00	16,284,600	
日清オイリオグループ	10,500	5,120.00	53,760,000	
不二製油	14,800	3,383.00	50,068,400	
J - オイルミルズ	8,500	1,968.00	16,728,000	
インターメスティック	3,300	1,963.00	6,477,900	
サンエー	13,500	2,784.00	37,584,000	
カワチ薬品	6,200	2,991.00	18,544,200	
エービーシー・マート	42,000	2,626.00	110,292,000	
ハードオフコーポレーション	4,700	1,863.00	8,756,100	
高千穂交易	6,300	2,032.00	12,801,600	
アスクル	18,700	1,424.00	26,628,800	
ゲオホールディングス	9,000	1,673.00	15,057,000	
アンドエスティHD	11,000	2,812.00	30,932,000	
リガク・ホールディングス	45,400	901.00	40,905,400	
伊藤忠食品	1,800	10,040.00	18,072,000	
くら寿司	9,400	3,270.00	30,738,000	
キャンドウ	2,800	3,480.00	9,744,000	
パルグループホールディングス	31,400	2,066.00	64,872,400	
エディオン	38,000	1,994.00	75,772,000	

あらた	12,200	3,000.00	36,600,000	
サーラコーポレーション	16,800	1,105.00	18,564,000	
トーメンデバイス	1,200	12,040.00	14,448,000	
ハローズ	3,600	4,605.00	16,578,000	
J Pホールディングス	19,800	630.00	12,474,000	
フジオフードグループ本社	13,000	1,148.00	14,924,000	
あみやき亭	6,400	1,330.00	8,512,000	
東京エレクトロン デバイス	8,000	3,100.00	24,800,000	
円谷フィールズホールディングス	14,800	1,873.00	27,720,400	
双日	77,100	4,387.00	338,237,700	
アルフレッサ ホールディングス	75,600	2,275.00	171,990,000	
大黒天物産	2,900	6,000.00	17,400,000	
ハニーズホールディングス	7,100	1,520.00	10,792,000	
キッコーマン	246,400	1,390.00	342,496,000	
味の素	369,100	3,589.00	1,324,699,900	
ブルドックソース	4,400	1,905.00	8,382,000	
キュービー	40,000	4,290.00	171,600,000	
ハウス食品グループ本社	27,800	2,868.00	79,730,400	
カゴメ	39,800	2,631.50	104,733,700	
アリアケジャパン	8,300	5,130.00	42,579,000	
エバラ食品工業	3,400	2,492.00	8,472,800	
キオクシアホールディングス	45,700	11,335.00	518,009,500	
ニチレイ	65,300	1,896.00	123,808,800	
横浜冷凍	20,100	1,227.00	24,662,700	
東洋水産	34,400	10,735.00	369,284,000	
イートアンドホールディングス	4,200	1,929.00	8,101,800	
日清食品ホールディングス	84,000	2,870.00	241,080,000	
フジッコ	8,500	1,580.00	13,430,000	
ロック・フィールド	8,300	1,433.00	11,893,900	
日本たばこ産業	451,800	5,774.00	2,608,693,200	
ケンコーマヨネーズ	4,700	1,914.00	8,995,800	
わらべや日洋ホールディングス	5,000	3,270.00	16,350,000	
なとり	4,700	1,918.00	9,014,600	
ファーマフーズ	10,600	795.00	8,427,000	
北の達人コーポレーション	62,400	131.00	8,174,400	
ユーグレナ	50,100	421.00	21,092,100	
紀文食品	7,800	1,078.00	8,408,400	
スター・マイカ・ホールディングス	7,900	1,142.00	9,021,800	
S R Eホールディングス	3,700	2,993.00	11,074,100	
片倉工業	8,000	2,796.00	22,368,000	
グンゼ	11,700	3,965.00	46,390,500	
ヒューリック	216,800	1,646.00	356,852,800	
アルペン	7,700	2,309.00	17,779,300	
ラクーンホールディングス	12,000	623.00	7,476,000	
クオールホールディングス	9,900	2,235.00	22,126,500	
アルコニックス	12,300	2,198.00	27,035,400	
神戸物産	69,500	3,761.00	261,389,500	
ジンズホールディングス	5,400	6,090.00	32,886,000	
ビックカメラ	42,500	1,554.50	66,066,250	
D C Mホールディングス	41,400	1,497.00	61,975,800	

MonotaRO	113,300	2,200.50	249,316,650	
あい ホールディングス	14,400	2,602.00	37,468,800	
J・フロント リテイリング	91,700	2,131.50	195,458,550	
ドトール・日レスホールディングス	14,200	2,455.00	34,861,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	139,000	2,815.00	391,285,000	
ブロンコビリー	4,700	3,875.00	18,212,500	
ZOZO	125,900	1,279.00	161,026,100	
トレジャー・ファクトリー	5,500	1,631.00	8,970,500	
物語コーポレーション	15,500	4,160.00	64,480,000	
三越伊勢丹ホールディングス	128,900	2,304.50	297,050,050	
東洋紡	32,700	1,165.00	38,095,500	
富士紡ホールディングス	3,500	7,050.00	24,675,000	
日清紡ホールディングス	57,400	1,220.00	70,028,000	
倉敷紡績	5,600	7,030.00	39,368,000	
ダイワボウホールディングス	32,600	2,921.50	95,240,900	
シキボウ	8,500	1,018.00	8,653,000	
日東紡績	9,600	15,160.00	145,536,000	
トヨタ紡織	37,100	2,319.00	86,034,900	
マクニカホールディングス	55,600	2,246.00	124,877,600	
Hamee	6,300	522.00	3,288,600	
ラクト・ジャパン	3,400	3,610.00	12,274,000	
ウエルシアホールディングス	41,500	3,239.00	134,418,500	
クリエイトSDホールディングス	11,300	3,265.00	36,894,500	
グリムス	2,500	2,370.00	5,925,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,000	1,254.00	13,794,000	
八洲電機	6,000	2,706.00	16,236,000	
レスター	6,800	2,532.00	17,217,600	
TOKAIホールディングス	43,400	1,047.00	45,439,800	
三洋貿易	9,800	1,514.00	14,837,200	
シュッピン	8,800	1,217.00	10,709,600	
ビューティガレージ	6,100	1,378.00	8,405,800	
オイシックス・ラ・大地	11,800	1,499.00	17,688,200	
ウイン・パートナーズ	6,600	1,271.00	8,388,600	
ネクステージ	18,300	2,603.00	47,634,900	
ジョイフル本田	21,600	2,061.00	44,517,600	
エターナルホスピタリティグループ	3,300	3,175.00	10,477,500	
ホットランドホールディングス	6,100	2,090.00	12,749,000	
すかいらくホールディングス	109,200	3,523.00	384,711,600	
SFPホールディングス	4,500	2,012.00	9,054,000	
綿半ホールディングス	6,200	1,454.00	9,014,800	
日本毛織	19,400	1,645.00	31,913,000	
ヨシックスホールディングス	3,400	2,876.00	9,778,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39,400	862.00	33,962,800	
野村不動産ホールディングス	207,300	917.20	190,135,560	
三重交通グループホールディングス	18,200	521.00	9,482,200	
ディア・ライフ	11,400	1,136.00	12,950,400	
地主	6,100	2,937.00	17,915,700	
JPMC	6,700	1,259.00	8,435,300	

フージャースホールディングス	13,000	1,294.00	16,822,000	
オープンハウスグループ	23,900	8,624.00	206,113,600	
東急不動産ホールディングス	203,300	1,366.50	277,809,450	
飯田グループホールディングス	63,300	2,331.50	147,583,950	
帝国繊維	7,800	3,695.00	28,821,000	
日本コークス工業	93,800	113.00	10,599,400	
あさひ	6,700	1,320.00	8,844,000	
コスモス薬品	15,800	7,424.00	117,299,200	
シップヘルスケアホールディングス	29,300	2,499.50	73,235,350	
ソフトクリエイトホールディングス	6,200	2,122.00	13,156,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	882,500	2,123.50	1,873,988,750	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	120,200	755.00	90,751,000	
明治電機工業	4,000	2,323.00	9,292,000	
ツルハホールディングス	77,100	2,821.50	217,537,650	
サンマルクホールディングス	7,100	2,551.00	18,112,100	
トリドールホールディングス	22,500	4,428.00	99,630,000	
帝人	67,100	1,255.00	84,210,500	
東レ	552,800	1,000.50	553,076,400	
クラレ	100,900	1,516.50	153,014,850	
旭化成	501,300	1,299.50	651,439,350	
稲葉製作所	5,300	1,584.00	8,395,200	
宮地エンジニアリンググループ	10,200	1,925.00	19,635,000	
トーカロ	22,500	2,144.00	48,240,000	
SUMCO	148,300	1,184.00	175,587,200	
川田テクノロジーズ	6,000	3,915.00	23,490,000	
RS Technologies	5,300	3,700.00	19,610,000	
ケイアイスター不動産	3,100	5,500.00	17,050,000	
グッドコムアセット	7,800	1,241.00	9,679,800	
ジェイ・エス・ビー	3,100	3,640.00	11,284,000	
ロードスターキャピタル	4,200	2,803.00	11,772,600	
霞ヶ関キャピタル	6,100	7,980.00	48,678,000	
JMホールディングス	11,500	1,553.00	17,859,500	
コメダホールディングス	19,600	3,005.00	58,898,000	
アレンザホールディングス	8,000	1,063.00	8,504,000	
串カツ田中ホールディングス	4,000	2,139.00	8,556,000	
パロックジャパンリミテッド	11,400	752.00	8,572,800	
クスリのアオキホールディングス	20,800	3,916.00	81,452,800	
力の源ホールディングス	6,100	1,333.00	8,131,300	
FOOD & LIFE COMPANIES	45,900	6,628.00	304,225,200	
セーレン	16,400	3,020.00	49,528,000	
小松マテーレ	11,000	818.00	8,998,000	
ワコールホールディングス	14,800	4,939.00	73,097,200	
ホギメディカル	8,300	5,760.00	47,808,000	
TSIホールディングス	23,000	965.00	22,195,000	
ワールド	12,500	2,889.00	36,112,500	
TIS	80,000	5,152.00	412,160,000	
グリーホールディングス	25,400	395.00	10,033,000	
コーエーテクモホールディングス	47,500	2,084.00	98,990,000	

三菱総合研究所	3,600	4,910.00	17,676,000	
ファインデックス	10,400	845.00	8,788,000	
ブレインパッド	6,200	2,699.00	16,733,800	
ポールトゥウィンホールディングス	25,600	323.00	8,268,800	
ネクソン	186,500	3,670.00	684,455,000	
アイスタイル	28,900	446.00	12,889,400	
エムアップホールディングス	9,300	1,761.00	16,377,300	
エイチームホールディングス	7,600	1,097.00	8,337,200	
セルシス	10,200	1,618.00	16,503,600	
エニグモ	200	391.00	78,200	
コロプラ	25,700	435.00	11,179,500	
ブロードリーフ	27,600	715.00	19,734,000	
デジタルハーツホールディングス	9,000	949.00	8,541,000	
メディアドゥ	4,700	1,773.00	8,333,100	
じげん	21,700	489.00	10,611,300	
フィックスターズ	10,400	1,630.00	16,952,000	
北里コーポレーション	3,700	1,418.00	5,246,600	
オブティム	15,500	538.00	8,339,000	
セレス	3,900	2,083.00	8,123,700	
S H I F T	68,000	1,010.50	68,714,000	
特種東海製紙	13,200	1,445.00	19,074,000	
テクマトリックス	15,100	2,043.00	30,849,300	
プロシップ	6,000	1,698.00	10,188,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,600	2,383.00	41,940,800	
GMOペイメントゲートウェイ	15,100	9,566.00	144,446,600	
システムリサーチ	5,700	1,934.00	11,023,800	
インターネットイニシアティブ	41,400	2,816.50	116,603,100	
さくらインターネット	10,600	3,025.00	32,065,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	2,404.00	9,375,600	
S R Aホールディングス	4,300	5,090.00	21,887,000	
朝日ネット	12,000	684.00	8,208,000	
e B A S E	19,000	448.00	8,512,000	
アバントグループ	10,600	1,779.00	18,857,400	
アドソル日進	6,100	1,421.00	8,668,100	
コムチュア	10,000	1,570.00	15,700,000	
アイル	4,200	2,301.00	9,664,200	
王子ホールディングス	286,400	789.70	226,170,080	
日本製紙	42,700	1,053.00	44,963,100	
北越コーポレーション	42,500	826.00	35,105,000	
大王製紙	38,200	883.00	33,730,600	
マークライnz	4,500	1,693.00	7,618,500	
g u m i	18,800	384.00	7,219,200	
テラスカイ	4,200	2,033.00	8,538,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	2,569.00	11,303,600	
ネオジャパン	4,700	1,750.00	8,225,000	
P R T I M E S	2,800	2,810.00	7,868,000	
ラクス	71,300	1,222.50	87,164,250	

ダブルスタンダード	5,000	1,673.00	8,365,000	
オープンドア	22,500	319.00	7,177,500	
アカツキ	3,700	2,551.00	9,438,700	
Ubicomホールディングス	7,500	1,060.00	7,950,000	
カナミックネットワーク	17,600	512.00	9,011,200	
レンゴー	76,500	992.90	75,956,850	
トーモク	4,400	3,300.00	14,520,000	
ザ・バック	15,100	1,229.00	18,557,900	
チェンジホールディングス	14,600	1,076.00	15,709,600	
オークネット	7,000	1,891.00	13,237,000	
オロ	3,400	2,029.00	6,898,600	
ユーザーローカル	4,500	1,954.00	8,793,000	
PKSHA Technology	9,000	3,385.00	30,465,000	
マネーフォワード	17,200	4,051.00	69,677,200	
レゾナック・ホールディングス	73,100	6,129.00	448,029,900	
住友化学	608,600	469.20	285,555,120	
住友精化	3,200	5,320.00	17,024,000	
日産化学	38,600	5,106.00	197,091,600	
ラサ工業	2,500	5,110.00	12,775,000	
クレハ	11,300	3,790.00	42,827,000	
多木化学	2,900	3,525.00	10,222,500	
テイカ	6,500	1,294.00	8,411,000	
石原産業	12,500	2,604.00	32,550,000	
日本曹達	16,000	3,390.00	54,240,000	
東ソー	110,200	2,230.50	245,801,100	
トクヤマ	26,500	3,835.00	101,627,500	
セントラル硝子	9,500	3,190.00	30,305,000	
東亜合成	31,900	1,543.50	49,237,650	
大阪ソーダ	26,400	1,943.00	51,295,200	
関東電化工業	14,600	1,009.00	14,731,400	
デンカ	30,000	2,453.00	73,590,000	
イビデン	47,700	12,535.00	597,919,500	
信越化学工業	672,600	4,434.00	2,982,308,400	
日本カーバイド工業	1,900	2,404.00	4,567,600	
プラスアルファ・コンサルティング	9,700	2,223.00	21,563,100	
電算システムホールディングス	3,400	3,725.00	12,665,000	
堺化学工業	6,200	2,949.00	18,283,800	
第一稀元素化学工業	7,600	1,380.00	10,488,000	
エア・ウォーター	71,400	2,156.00	153,938,400	
日本酸素ホールディングス	85,600	4,779.00	409,082,400	
日本化学工業	3,000	2,498.00	7,494,000	
日本パーカライジング	37,400	1,341.00	50,153,400	
高圧ガス工業	11,000	1,025.00	11,275,000	
四国化成ホールディングス	8,600	2,766.00	23,787,600	
オリオンビール	12,100	1,499.00	18,137,900	
ステラ ケミファ	4,000	4,055.00	16,220,000	
保土谷化学工業	4,800	1,864.00	8,947,200	
日本触媒	48,500	1,805.50	87,566,750	
大日精化工業	5,100	3,825.00	19,507,500	
カネカ	18,600	4,159.00	77,357,400	

協和キリン	89,100	2,475.00	220,522,500	
ブルーゾーンホールディングス	9,500	8,525.00	80,987,500	
A P P I E R G R O U P	28,900	1,072.00	30,980,800	
三菱瓦斯化学	53,800	2,537.50	136,517,500	
三井化学	68,100	3,587.00	244,274,700	
東京応化工業	36,100	6,010.00	216,961,000	
大阪有機化学工業	6,300	3,800.00	23,940,000	
三菱ケミカルグループ	552,900	837.70	463,164,330	
K H ネオケム	12,600	2,339.00	29,471,400	
ビジョナル	9,100	9,987.00	90,881,700	
ダイセル	82,900	1,249.00	103,542,100	
住友ベークライト	26,500	5,083.00	134,699,500	
積水化学工業	161,700	2,546.50	411,769,050	
日本ゼオン	54,700	1,694.00	92,661,800	
アイカ工業	19,100	3,460.00	66,086,000	
U B E	39,000	2,375.00	92,625,000	
積水樹脂	9,000	2,049.00	18,441,000	
旭有機材	5,000	4,400.00	22,000,000	
ニチバン	4,700	1,945.00	9,141,500	
リケンテクノス	13,000	1,359.00	17,667,000	
大倉工業	3,900	4,760.00	18,564,000	
積水化成成品工業	23,700	352.00	8,342,400	
ダイキョーニシカワ	16,000	742.00	11,872,000	
森六	4,100	2,286.00	9,372,600	
恵和	7,200	1,168.00	8,409,600	
日本化薬	54,200	1,525.00	82,655,000	
カーリット	6,800	1,608.00	10,934,400	
プレステージ・インターナショナル	28,700	656.00	18,827,200	
ハイマックス	6,900	1,185.00	8,176,500	
野村総合研究所	147,700	6,152.00	908,650,400	
クイック	6,400	2,451.00	15,686,400	
日本システム技術	7,000	2,305.00	16,135,000	
電通グループ	75,100	3,465.00	260,221,500	
インテージホールディングス	5,700	1,706.00	9,724,200	
イオンファンタジー	3,400	2,822.00	9,594,800	
ソースネクスト	50,200	167.00	8,383,400	
メディカルシステムネットワーク	17,200	501.00	8,617,200	
日本精化	5,000	2,633.00	13,165,000	
扶桑化学工業	8,000	5,680.00	45,440,000	
トリケミカル研究所	9,200	2,690.00	24,748,000	
シンプレクス・ホールディングス	15,000	4,335.00	65,025,000	
ラクスル	15,100	1,102.00	16,640,200	
メルカリ	41,800	2,490.50	104,102,900	
A D E K A	29,300	3,537.00	103,634,100	
日油	86,800	2,914.50	252,978,600	
ハリマ化成グループ	9,500	845.00	8,027,500	
ボードルア	4,100	2,663.00	10,918,300	
N E	6,300	623.00	3,924,900	
ウイングアーク 1 s t	7,900	3,435.00	27,136,500	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	8,400	1,054.00	8,853,600	
S a n s a n	21,400	1,660.00	35,524,000	
ギフトィ	7,900	1,078.00	8,516,200	
花王	184,200	6,474.00	1,192,510,800	
第一工業製薬	3,000	7,930.00	23,790,000	
石原ケミカル	4,100	2,174.00	8,913,400	
三洋化成工業	4,700	4,445.00	20,891,500	
メドレー	9,200	2,680.00	24,656,000	
ベース	3,200	3,280.00	10,496,000	
J M D C	11,100	4,080.00	45,288,000	
武田薬品工業	673,900	4,451.00	2,999,528,900	
アステラス製薬	664,300	1,979.50	1,314,981,850	
住友ファーマ	67,400	2,702.00	182,114,800	
塩野義製薬	276,300	2,718.50	751,121,550	
日本新薬	19,800	3,624.00	71,755,200	
中外製薬	237,100	8,278.00	1,962,713,800	
科研製薬	11,200	3,695.00	41,384,000	
エーザイ	98,800	4,687.00	463,075,600	
理研ビタミン	6,500	2,869.00	18,648,500	
ロート製薬	80,000	2,482.00	198,560,000	
小野薬品工業	169,000	2,058.00	347,802,000	
久光製薬	17,000	4,113.00	69,921,000	
持田製薬	9,200	3,300.00	30,360,000	
参天製薬	135,200	1,580.50	213,683,600	
扶桑薬品工業	4,000	2,172.00	8,688,000	
ツムラ	26,000	3,785.00	98,410,000	
テルモ	501,700	2,389.00	1,198,561,300	
H . U . グループホールディングス	24,300	3,639.00	88,427,700	
キッセイ薬品工業	11,800	4,345.00	51,271,000	
生化学工業	6,000	663.00	3,978,000	
栄研化学	12,000	2,278.00	27,336,000	
J C R ファーマ	33,000	635.00	20,955,000	
東和薬品	10,200	3,000.00	30,600,000	
富士製薬工業	5,600	1,680.00	9,408,000	
ゼリア新薬工業	10,300	1,953.00	20,115,900	
ネクセラファーマ	33,200	856.00	28,419,200	
第一三共	695,400	3,627.00	2,522,215,800	
杏林製薬	15,200	1,430.00	21,736,000	
ダイト	10,200	1,254.00	12,790,800	
大塚ホールディングス	168,700	8,332.00	1,405,608,400	
ペプチドリーム	36,700	1,640.50	60,206,350	
大日本塗料	8,400	1,265.00	10,626,000	
日本ペイントホールディングス	401,600	976.20	392,041,920	
関西ペイント	60,300	2,349.50	141,674,850	
中国塗料	15,500	4,350.00	67,425,000	
藤倉化成	14,000	594.00	8,316,000	
太陽ホールディングス	18,100	8,736.00	158,121,600	
D I C	26,900	3,726.00	100,229,400	
サカタインクス	16,800	2,214.00	37,195,200	

artience	14,200	3,295.00	46,789,000	
アルプス技研	6,400	2,625.00	16,800,000	
日本空調サービス	8,300	1,233.00	10,233,900	
オリエンタルランド	457,500	2,985.00	1,365,637,500	
フォーカスシステムズ	5,300	1,707.00	9,047,100	
ダスキン	17,600	3,924.00	69,062,400	
パーク24	53,100	1,767.00	93,827,700	
明光ネットワークジャパン	11,900	715.00	8,508,500	
ファルコホールディングス	3,400	2,549.00	8,666,600	
クレスコ	13,000	1,491.00	19,383,000	
フジ・メディア・ホールディングス	59,500	3,469.00	206,405,500	
ラウンドワン	73,400	976.00	71,638,400	
リゾートトラスト	73,500	1,888.50	138,804,750	
オービック	140,600	4,968.00	698,500,800	
ジャストシステム	10,900	4,985.00	54,336,500	
TDCソフト	14,200	1,289.00	18,303,800	
LINEヤフー	1,166,000	418.70	488,204,200	
ビー・エム・エル	10,400	3,645.00	37,908,000	
トレンドマイクロ	43,800	7,850.00	343,830,000	
IDホールディングス	4,900	1,980.00	9,702,000	
日本オラクル	14,500	13,645.00	197,852,500	
早稲田アカデミー	3,800	2,350.00	8,930,000	
アルファシステムズ	2,400	4,110.00	9,864,000	
フューチャー	16,200	2,023.00	32,772,600	
CAC Holdings	4,600	2,054.00	9,448,400	
ユー・エス・エス	147,200	1,695.00	249,504,000	
オービックビジネスコンサルタント	12,800	8,607.00	110,169,600	
アイティフォー	7,900	1,633.00	12,900,700	
東計電算	2,200	4,105.00	9,031,000	
サイバーエージェント	157,400	1,352.50	212,883,500	
楽天グループ	612,000	929.50	568,854,000	
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,413.00	8,054,100	
SBIグローバルアセットマネジメント	14,500	603.00	8,743,500	
大塚商会	85,800	3,015.00	258,687,000	
サイボウズ	10,400	3,075.00	31,980,000	
山田コンサルティンググループ	4,800	1,710.00	8,208,000	
セントラルスポーツ	3,500	2,427.00	8,494,500	
パラカ	4,200	2,069.00	8,689,800	
電通総研	9,200	7,830.00	72,036,000	
デジタルガレージ	10,800	3,090.00	33,372,000	
イーエムシステムズ	10,300	787.00	8,106,100	
ウェザーニューズ	6,000	3,945.00	23,670,000	
CIJ	20,100	498.00	10,009,800	
ビジネスエンジニアリング	1,800	6,860.00	12,348,000	
WOWOW	5,800	1,458.00	8,456,400	
スカラ	21,400	385.00	8,239,000	
フルキャストホールディングス	6,000	1,652.00	9,912,000	
エン	12,600	1,419.00	17,879,400	
セルソース	16,800	507.00	8,517,600	

あすか製薬ホールディングス	7,300	2,032.00	14,833,600	
サワイグループホールディングス	39,100	1,900.00	74,290,000	
富士フイルムホールディングス	456,600	3,228.00	1,473,904,800	
コニカミノルタ	170,300	606.50	103,286,950	
資生堂	146,800	2,185.50	320,831,400	
ライオン	86,900	1,611.50	140,039,350	
高砂香料工業	28,500	1,447.00	41,239,500	
マンダム	16,400	2,336.00	38,310,400	
ミルボン	12,200	2,472.00	30,158,400	
コーセー	17,100	4,983.00	85,209,300	
コタ	8,400	1,196.00	10,046,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	38,800	1,305.00	50,634,000	
ノエビアホールディングス	6,800	4,540.00	30,872,000	
新日本製薬	4,300	2,069.00	8,896,700	
エスター	7,100	1,554.00	11,033,400	
コニシ	23,900	1,276.00	30,496,400	
長谷川香料	14,500	2,703.00	39,193,500	
小林製薬	19,800	5,276.00	104,464,800	
荒川化学工業	7,700	1,104.00	8,500,800	
メック	5,500	5,170.00	28,435,000	
日本高純度化学	2,700	3,065.00	8,275,500	
タカラバイオ	20,400	813.00	16,585,200	
J C U	8,200	4,325.00	35,465,000	
デクセリアルズ	64,800	2,955.50	191,516,400	
アース製薬	6,900	4,955.00	34,189,500	
北興化学工業	5,600	1,613.00	9,032,800	
大成ラミックグループ	3,200	2,611.00	8,355,200	
クミアイ化学工業	33,800	684.00	23,119,200	
日本農薬	11,600	863.00	10,010,800	
ニチレキグループ	8,100	2,427.00	19,658,700	
ユシロ	3,900	2,208.00	8,611,200	
J X 金属	216,300	1,707.00	369,224,100	
富士石油	14,700	476.00	6,997,200	
出光興産	327,500	1,138.00	372,695,000	
E N E O S ホールディングス	1,070,000	1,033.00	1,105,310,000	
コスモエネルギーホールディングス	41,900	3,990.00	167,181,000	
A N Y C O L O R	10,300	6,190.00	63,757,000	
テスホールディングス	23,700	337.00	7,986,900	
インフロニア・ホールディングス	77,600	1,882.50	146,082,000	
横浜ゴム	42,300	5,814.00	245,932,200	
T O Y O T I R E	47,900	4,213.00	201,802,700	
ブリヂストン	221,700	7,104.00	1,574,956,800	
住友ゴム工業	81,700	2,136.00	174,511,200	
藤倉コンポジット	7,300	1,781.00	13,001,300	
オカモト	4,000	5,210.00	20,840,000	
アキレス	6,800	1,242.00	8,445,600	
フコク	3,800	1,803.00	6,851,400	
ニッタ	7,400	3,960.00	29,304,000	
住友理工	17,600	2,593.00	45,636,800	
三ツ星ベルト	9,700	3,730.00	36,181,000	

バンドー化学	11,200	1,951.00	21,851,200	
A G C	73,700	5,186.00	382,208,200	
日本板硝子	40,900	454.00	18,568,600	
有沢製作所	13,300	1,615.00	21,479,500	
日本電気硝子	25,300	5,550.00	140,415,000	
オハラ	7,400	1,130.00	8,362,000	
住友大阪セメント	13,100	3,772.00	49,413,200	
太平洋セメント	46,700	3,680.00	171,856,000	
日本ヒューム	6,600	3,005.00	19,833,000	
日本コンクリート工業	2,800	323.00	904,400	
三谷セキサン	3,100	7,530.00	23,343,000	
アジアパイルホールディングス	11,800	1,435.00	16,933,000	
東海カーボン	76,200	988.70	75,338,940	
日本カーボン	4,300	4,410.00	18,963,000	
東洋炭素	6,500	4,760.00	30,940,000	
ノリタケ	7,900	5,050.00	39,895,000	
T O T O	47,000	3,834.00	180,198,000	
日本碍子	84,100	2,996.00	251,963,600	
日本特殊陶業	61,900	6,515.00	403,278,500	
M A R U W A	3,100	45,460.00	140,926,000	
品川リフラ	9,300	1,894.00	17,614,200	
黒崎播磨	6,200	4,145.00	25,699,000	
ヨータイ	4,800	1,725.00	8,280,000	
フジインコーポレーテッド	22,600	2,296.00	51,889,600	
ニチアス	21,100	5,934.00	125,207,400	
日本製鉄	2,124,300	619.40	1,315,791,420	
神戸製鋼所	156,700	1,914.50	300,002,150	
中山製鋼所	16,000	589.00	9,424,000	
合同製鉄	4,400	3,635.00	15,994,000	
J F E ホールディングス	252,800	1,827.50	461,992,000	
東京製鉄	21,800	1,409.00	30,716,200	
共英製鋼	8,900	2,291.00	20,389,900	
大和工業	14,700	9,914.00	145,735,800	
東京鐵鋼	3,200	5,560.00	17,792,000	
大阪製鉄	3,600	2,601.00	9,363,600	
ヨドコウ	44,900	1,270.00	57,023,000	
中部鋼鈹	7,100	2,065.00	14,661,500	
丸一鋼管	78,300	1,342.50	105,117,750	
モリ工業	8,800	991.00	8,720,800	
大同特殊鋼	55,200	1,496.00	82,579,200	
日本冶金工業	5,300	4,220.00	22,366,000	
愛知製鋼	14,600	2,864.00	41,814,400	
大平洋金属	6,600	2,340.00	15,444,000	
新日本電工	42,700	328.00	14,005,600	
栗本鐵工所	18,100	1,721.00	31,150,100	
日本製鋼所	23,100	9,779.00	225,894,900	
三菱製鋼	5,300	1,739.00	9,216,700	
日本精線	1,000	1,095.00	1,095,000	
エンビプロ・ホールディングス	17,400	528.00	9,187,200	
大紀アルミニウム工業所	11,100	1,082.00	12,010,200	

日本軽金属ホールディングス	22,800	2,349.00	53,557,200	
三井金属	19,500	20,850.00	406,575,000	
三菱マテリアル	52,000	3,063.00	159,276,000	
住友金属鉱山	106,800	4,945.00	528,126,000	
DOWAホールディングス	21,000	5,990.00	125,790,000	
古河機械金属	9,300	3,770.00	35,061,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,500	2,095.00	28,282,500	
東邦チタニウム	14,100	1,277.00	18,005,700	
UACJ	47,100	2,011.00	94,718,100	
CKサンエツ	2,100	3,835.00	8,053,500	
古河電気工業	26,000	9,895.00	257,270,000	
住友電気工業	269,000	6,388.00	1,718,372,000	
フジクラ	100,300	18,890.00	1,894,667,000	
SWCC	11,400	10,700.00	121,980,000	
平河ヒューテック	4,500	3,265.00	14,692,500	
いよぎんホールディングス	97,300	2,349.00	228,557,700	
しずおかフィナンシャルグループ	163,800	2,179.50	357,002,100	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	62,600	2,187.00	136,906,200	
楽天銀行	39,400	6,733.00	265,280,200	
京都フィナンシャルグループ	102,100	3,232.00	329,987,200	
リョービ	9,200	2,615.00	24,058,000	
AREホールディングス	31,500	2,782.00	87,633,000	
東洋製罐グループホールディングス	41,500	3,458.00	143,507,000	
ホッカンホールディングス	4,200	2,215.00	9,303,000	
コロナ	9,000	946.00	8,514,000	
横河ブリッジホールディングス	13,400	2,870.00	38,458,000	
三和ホールディングス	74,900	3,892.00	291,510,800	
文化シャッター	24,500	2,032.00	49,784,000	
三協立山	14,000	595.00	8,330,000	
アルインコ	8,200	1,052.00	8,626,400	
LIXIL	121,800	1,745.50	212,601,900	
ノーリツ	13,700	1,847.00	25,303,900	
長府製作所	7,700	1,970.00	15,169,000	
リンナイ	40,700	3,856.00	156,939,200	
ユニプレス	14,000	1,173.00	16,422,000	
日東精工	12,400	684.00	8,481,600	
岡部	13,900	914.00	12,704,600	
ジーテクト	9,900	1,848.00	18,295,200	
東プレ	13,700	2,231.00	30,564,700	
高周波熱錬	11,700	1,172.00	13,712,400	
サンコール	8,000	1,242.00	9,936,000	
パイオラックス	8,400	1,633.00	13,717,200	
エイチワン	8,000	1,241.00	9,928,000	
日本発条	58,800	2,364.00	139,003,200	
中央発條	5,100	3,420.00	17,442,000	
三浦工業	35,400	3,027.00	107,155,800	
タクマ	22,700	2,393.00	54,321,100	
テクノプロ・ホールディングス	11,800	4,848.00	57,206,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	10,300	802.00	8,260,600	

K e e P e r 技研	4,800	3,205.00	15,384,000	
イー・ガーディアン	4,800	1,650.00	7,920,000	
ジャパンマテリアル	23,800	1,646.00	39,174,800	
ベクトル	10,600	1,149.00	12,179,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,263.00	9,977,700	
キャリアリンク	3,600	2,465.00	8,874,000	
I B J	10,400	743.00	7,727,200	
アサンテ	5,200	1,601.00	8,325,200	
バリューHR	7,000	1,693.00	11,851,000	
M & Aキャピタルパートナーズ	6,300	3,230.00	20,349,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	8,400	1,003.00	8,425,200	
シグマックス・ホールディングス	22,600	767.00	17,334,200	
ウィルグループ	8,100	1,117.00	9,047,700	
リクルートホールディングス	574,100	7,639.00	4,385,549,900	
エラン	10,900	712.00	7,760,800	
ツガミ	16,300	2,674.00	43,586,200	
オークマ	13,300	3,375.00	44,887,500	
芝浦機械	9,100	4,235.00	38,538,500	
アマダ	111,200	1,789.00	198,936,800	
アイダエンジニアリング	14,400	1,156.00	16,646,400	
F U J I	30,400	3,284.00	99,833,600	
牧野フライス製作所	7,700	11,310.00	87,087,000	
オーエスジー	27,100	2,226.50	60,338,150	
旭ダイヤモンド工業	18,300	803.00	14,694,900	
D M G森精機	52,200	2,637.50	137,677,500	
ソディック	18,600	915.00	17,019,000	
ディスコ	36,700	47,270.00	1,734,809,000	
日東工器	4,900	1,570.00	7,693,000	
日進工具	11,000	850.00	9,350,000	
日本郵政	699,000	1,454.50	1,016,695,500	
ベルシステム24ホールディングス	10,500	1,336.00	14,028,000	
鎌倉新書	14,900	553.00	8,239,700	
エアトリ	9,600	743.00	7,132,800	
アトラエ	12,100	666.00	8,058,600	
ストライク	3,800	3,985.00	15,143,000	
ソラスト	18,700	529.00	9,892,300	
インソース	16,800	823.00	13,826,400	
豊田自動織機	64,400	17,160.00	1,105,104,000	
リケンNPR	8,800	3,210.00	28,248,000	
島精機製作所	12,100	968.00	11,712,800	
オプトラン	12,500	1,753.00	21,912,500	
イワキ	5,100	2,394.00	12,209,400	
フリーー	8,100	1,051.00	8,513,100	
ヤマシンフィルタ	15,800	628.00	9,922,400	
日阪製作所	8,900	1,422.00	12,655,800	
やまびこ	12,500	2,580.00	32,250,000	
野村マイクロ・サイエンス	13,800	3,170.00	43,746,000	
平田機工	10,900	2,133.00	23,249,700	
P E G A S U S	12,200	813.00	9,918,600	

タツモ	5,000	2,209.00	11,045,000	
ナブテスコ	44,400	3,272.00	145,276,800	
三井海洋開発	19,300	15,455.00	298,281,500	
レオン自動機	8,800	1,434.00	12,619,200	
S M C	21,600	51,900.00	1,121,040,000	
ホソカワミクロン	5,800	5,230.00	30,334,000	
ユニオンツール	3,400	8,300.00	28,220,000	
瑞光	8,800	991.00	8,720,800	
オイレス工業	9,400	2,070.00	19,458,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,000	6,260.00	18,780,000	
サトー	10,400	2,192.00	22,796,800	
技研製作所	7,200	1,660.00	11,952,000	
日本エアーテック	6,700	1,253.00	8,395,100	
日精樹脂工業	9,900	823.00	8,147,700	
ワイエイシイホールディングス	9,400	1,072.00	10,076,800	
小松製作所	375,900	5,014.00	1,884,762,600	
住友重機械工業	45,100	4,052.00	182,745,200	
日立建機	30,400	4,467.00	135,796,800	
日工	14,700	746.00	10,966,200	
巴工業	8,900	1,639.00	14,587,100	
井関農機	7,100	1,937.00	13,752,700	
T O W A	27,600	2,519.00	69,524,400	
北川鉄工所	5,200	1,760.00	9,152,000	
ローツェ	44,800	2,086.50	93,475,200	
クボタ	390,000	2,066.00	805,740,000	
荏原実業	4,000	4,210.00	16,840,000	
東洋エンジニアリング	10,900	2,635.00	28,721,500	
三菱化工機	8,000	3,190.00	25,520,000	
月島ホールディングス	11,200	2,596.00	29,075,200	
帝国電機製作所	5,200	2,943.00	15,303,600	
新東工業	15,400	988.00	15,215,200	
澁谷工業	7,200	3,220.00	23,184,000	
アイチコーポレーション	12,600	1,281.00	16,140,600	
小森コーポレーション	18,100	1,467.00	26,552,700	
鶴見製作所	10,800	2,113.00	22,820,400	
酒井重工業	4,100	2,033.00	8,335,300	
荏原製作所	156,600	3,862.00	604,789,200	
西島製作所	5,700	1,842.00	10,499,400	
A I R M A N	7,700	1,750.00	13,475,000	
ダイキン工業	99,300	19,610.00	1,947,273,000	
オルガノ	10,500	13,215.00	138,757,500	
トーヨーカネツ	3,200	4,425.00	14,160,000	
栗田工業	45,900	6,134.00	281,550,600	
椿本チエイン	33,000	2,104.00	69,432,000	
日機装	17,600	1,512.00	26,611,200	
木村化工機	7,900	1,122.00	8,863,800	
レイズネクスト	10,700	2,220.00	23,754,000	
アネスト岩田	14,100	1,508.00	21,262,800	
ダイフク	128,700	4,946.00	636,550,200	
タダノ	40,200	1,007.00	40,481,400	

フジテック	22,300	5,701.00	127,132,300	
C K D	23,000	2,578.00	59,294,000	
平和	22,500	1,970.00	44,325,000	
理想科学工業	12,200	1,190.00	14,518,000	
S A N K Y O	80,800	2,567.00	207,413,600	
日本金銭機械	9,200	970.00	8,924,000	
マースグループホールディングス	6,400	3,035.00	19,424,000	
ガリレイ	11,200	3,590.00	40,208,000	
ダイコク電機	3,800	2,943.00	11,183,400	
竹内製作所	13,800	6,370.00	87,906,000	
アマノ	20,100	3,972.00	79,837,200	
ジャノメ	7,700	1,112.00	8,562,400	
ブラザー工業	94,600	2,948.50	278,928,100	
マックス	10,500	6,260.00	65,730,000	
モリタホールディングス	11,900	2,473.00	29,428,700	
グローリー	20,000	3,808.00	76,160,000	
新晃工業	21,800	1,274.00	27,773,200	
大和冷機工業	11,700	1,505.00	17,608,500	
セガサミーホールディングス	62,500	2,602.00	162,625,000	
T P R	17,400	1,217.00	21,175,800	
ツバキ・ナカシマ	21,600	374.00	8,078,400	
ホシザキ	49,100	4,961.00	243,585,100	
日本精工	141,200	885.00	124,962,000	
N T N	180,400	355.00	64,042,000	
ジェイテクト	72,000	1,579.00	113,688,000	
不二越	5,600	3,900.00	21,840,000	
ミネベアミツミ	132,700	2,876.50	381,711,550	
日本トムソン	20,800	706.00	14,684,800	
T H K	40,400	3,873.00	156,469,200	
Y U S H I N	13,400	672.00	9,004,800	
前澤給装工業	1,800	1,451.00	2,611,800	
イーグル工業	8,400	2,601.00	21,848,400	
P I L L A R	7,100	4,505.00	31,985,500	
キッツ	27,200	1,617.00	43,982,400	
日立製作所	1,940,500	4,875.00	9,459,937,500	
三菱電機	835,400	4,256.00	3,555,462,400	
富士電機	54,800	10,870.00	595,676,000	
安川電機	82,800	3,873.00	320,684,400	
シンフォニア テクノロジー	8,400	9,200.00	77,280,000	
明電舎	14,100	5,820.00	82,062,000	
山洋電気	8,800	3,775.00	33,220,000	
デンヨー	5,600	3,105.00	17,388,000	
P H C ホールディングス	14,300	969.00	13,856,700	
K O K U S A I E L E C T R I C	87,400	4,221.00	368,915,400	
ソシオネクスト	66,000	2,184.50	144,177,000	
ベイカレント	57,000	6,756.00	385,092,000	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	11,000	1,175.00	12,925,000	
アイモバイル	14,600	552.00	8,059,200	

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,400	1,922.00	125,698,800	
ミダックホールディングス	2,700	1,859.00	5,019,300	
キュービーネットホールディングス	6,200	1,348.00	8,357,600	
三櫻工業	11,500	796.00	9,154,000	
マキタ	94,900	4,289.00	407,026,100	
東芝テック	9,800	2,670.00	26,166,000	
芝浦メカトロニクス	4,700	15,900.00	74,730,000	
マブチモーター	36,800	2,687.00	98,881,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	31,700	275.00	8,717,500	
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,565.00	8,920,500	
東光高岳	4,100	3,565.00	14,616,500	
ダイヘン	7,100	8,720.00	61,912,000	
ヤーマン	14,800	787.00	11,647,600	
JVCケンウッド	60,200	1,129.50	67,995,900	
ミマキエンジニアリング	6,300	1,527.00	9,620,100	
大崎電気工業	14,600	1,135.00	16,571,000	
オムロン	64,100	3,740.00	239,734,000	
日東工業	9,100	3,755.00	34,170,500	
I D E C	9,700	2,551.00	24,744,700	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	31,200	3,932.00	122,678,400	
テクノメディカ	4,500	1,917.00	8,626,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	15,600	619.00	9,656,400	
日本電気	500,800	5,980.00	2,994,784,000	
富士通	701,800	4,057.00	2,847,202,600	
沖電気工業	36,900	1,893.00	69,851,700	
サンケン電気	7,800	5,020.00	39,156,000	
アイホン	4,000	2,787.00	11,148,000	
ルネサスエレクトロニクス	739,500	1,847.00	1,365,856,500	
セイコーエプソン	94,900	1,871.50	177,605,350	
ワコム	45,700	794.00	36,285,800	
アルバック	16,700	6,679.00	111,539,300	
E I Z O	11,200	2,158.00	24,169,600	
日本信号	19,300	1,220.00	23,546,000	
京三製作所	17,700	537.00	9,504,900	
能美防災	10,300	3,460.00	35,638,000	
ホーチキ	6,000	3,985.00	23,910,000	
エレコム	18,200	1,780.00	32,396,000	
パナソニック ホールディングス	901,000	1,755.00	1,581,255,000	
シャープ	91,800	785.20	72,081,360	
アンリツ	49,900	2,264.50	112,998,550	
ソニーグループ	2,604,700	4,461.00	11,619,566,700	
T D K	658,700	2,490.50	1,640,492,350	
帝国通信工業	3,400	2,515.00	8,551,000	
タムラ製作所	30,400	630.00	19,152,000	
アルプスアルパイン	61,900	1,984.50	122,840,550	
日本電波工業	9,100	942.00	8,572,200	
鈴木	4,100	2,255.00	9,245,500	
メイコー	6,800	10,120.00	68,816,000	

日本トリム	1,800	4,875.00	8,775,000	
フォスター電機	7,100	2,525.00	17,927,500	
S M K	3,800	2,539.00	9,648,200	
ヨコオ	6,700	2,021.00	13,540,700	
ホシデン	15,300	2,518.00	38,525,400	
ヒロセ電機	11,100	17,675.00	196,192,500	
日本航空電子工業	17,900	2,405.00	43,049,500	
T O A	7,700	1,669.00	12,851,300	
マクセル	15,900	2,132.00	33,898,800	
古野電気	9,900	8,150.00	80,685,000	
スミダコーポレーション	13,100	1,182.00	15,484,200	
アイコム	2,900	2,692.00	7,806,800	
リオン	3,400	2,519.00	8,564,600	
横河電機	83,400	4,735.00	394,899,000	
新電元工業	3,200	3,015.00	9,648,000	
アズビル	183,400	1,444.00	264,829,600	
日本光電工業	62,800	1,511.50	94,922,200	
チノー	6,300	1,375.00	8,662,500	
日本電子材料	4,600	3,710.00	17,066,000	
堀場製作所	14,300	14,130.00	202,059,000	
アドバンテスト	238,000	20,835.00	4,958,730,000	
エスベック	7,400	3,305.00	24,457,000	
キーエンス	75,500	53,780.00	4,060,390,000	
日置電機	4,000	5,710.00	22,840,000	
シスメックス	195,500	1,497.00	292,663,500	
日本マイクロニクス	12,400	6,410.00	79,484,000	
メガチップス	5,200	7,620.00	39,624,000	
O B A R A G R O U P	4,100	3,865.00	15,846,500	
デンソー	739,800	2,019.00	1,493,656,200	
コーセル	9,300	1,169.00	10,871,700	
イリソ電子工業	6,200	3,205.00	19,871,000	
オブテックスグループ	12,800	2,440.00	31,232,000	
千代田インテグレ	2,700	3,070.00	8,289,000	
レーザーテック	29,300	27,955.00	819,081,500	
スタンレー電気	38,600	2,935.00	113,291,000	
ウシオ電機	31,300	2,323.50	72,725,550	
日本セラミック	6,200	3,695.00	22,909,000	
古河電池	5,600	1,393.00	7,800,800	
山一電機	7,400	6,100.00	45,140,000	
図研	6,300	4,555.00	28,696,500	
日本電子	17,500	4,643.00	81,252,500	
カシオ計算機	60,400	1,212.00	73,204,800	
ファナック	360,600	4,894.00	1,764,776,400	
日本シイエムケイ	24,200	490.00	11,858,000	
エンプラス	2,200	8,880.00	19,536,000	
大真空	14,800	542.00	8,021,600	
ローム	148,200	2,068.50	306,551,700	
浜松ホトニクス	126,200	1,524.00	192,328,800	
三井ハイテック	39,000	759.00	29,601,000	
京セラ	469,200	2,037.00	955,760,400	

太陽誘電	40,400	3,264.00	131,865,600	
村田製作所	720,600	3,078.00	2,218,006,800	
双葉電子工業	15,600	597.00	9,313,200	
日東電工	239,500	3,732.00	893,814,000	
東海理化電機製作所	20,200	2,859.00	57,751,800	
ニチコン	19,800	1,539.00	30,472,200	
日本ケミコン	9,500	1,357.00	12,891,500	
K O A	13,800	1,305.00	18,009,000	
三井 E & S	37,800	6,562.00	248,043,600	
カナデビア	62,500	939.00	58,687,500	
三菱重工業	1,428,900	4,120.00	5,887,068,000	
川崎重工業	56,900	10,235.00	582,371,500	
I H I	397,500	2,811.00	1,117,372,500	
名村造船所	23,500	4,715.00	110,802,500	
マネジメントソリューションズ	6,300	1,360.00	8,568,000	
プロレド・パートナーズ	15,600	540.00	8,424,000	
アンビスホールディングス	16,600	436.00	7,237,600	
カーブスホールディングス	21,200	744.00	15,772,800	
フォーラムエンジニアリング	9,000	1,708.00	15,372,000	
M a c b e e P l a n e t	4,600	1,758.00	8,086,800	
日本車輛製造	2,900	3,450.00	10,005,000	
三菱ロジスネクスト	12,100	1,529.00	18,500,900	
フルサト・マルカホールディングス	7,100	2,180.00	15,478,000	
ヤマエグループホールディングス	7,800	2,446.00	19,078,800	
F P G	23,700	2,301.00	54,533,700	
ライフネット生命保険	11,900	1,932.00	22,990,800	
全国保証	42,800	3,082.00	131,909,600	
めぶきフィナンシャルグループ	347,700	950.00	330,315,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,100	2,150.00	26,015,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,500	7,840.00	74,480,000	
九州フィナンシャルグループ	143,900	906.20	130,402,180	
かんぽ生命保険	84,000	4,208.00	353,472,000	
ゆうちょ銀行	807,800	1,750.50	1,414,053,900	
富山第一銀行	23,600	1,574.00	37,146,400	
横浜フィナンシャルグループ	387,800	1,210.00	469,238,000	
ジェイリース	3,900	1,421.00	5,541,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	45,500	2,822.50	128,423,750	
S B I アルヒ	10,500	831.00	8,725,500	
プレミアグループ	12,600	1,761.00	22,188,600	
日産自動車	1,153,600	356.60	411,373,760	
いすゞ自動車	201,500	2,273.50	458,110,250	
トヨタ自動車	4,014,000	3,044.00	12,218,616,000	
日野自動車	113,600	374.00	42,486,400	
三菱自動車工業	288,700	356.90	103,037,030	
武蔵精密工業	16,700	2,731.00	45,607,700	
日産車体	11,500	1,042.00	11,983,000	
新明和工業	21,700	1,829.00	39,689,300	
極東開発工業	12,500	2,752.00	34,400,000	

トピー工業	5,400	2,872.00	15,508,800	
ティラド	1,500	9,070.00	13,605,000	
曙ブレーキ工業	72,800	109.00	7,935,200	
タチエス	13,900	1,965.00	27,313,500	
N O K	29,300	2,582.00	75,652,600	
フタバ産業	20,200	960.00	19,392,000	
カヤバ	12,800	4,330.00	55,424,000	
市光工業	15,000	462.00	6,930,000	
大同メタル工業	14,800	956.00	14,148,800	
プレス工業	31,100	746.00	23,200,600	
太平洋工業	17,300	3,070.00	53,111,000	
アイシン	192,900	2,683.00	517,550,700	
マツダ	249,800	1,109.50	277,153,100	
本田技研工業	1,640,000	1,514.00	2,482,960,000	
スズキ	554,700	2,283.00	1,266,380,100	
S U B A R U	227,700	3,319.00	755,736,300	
ヤマハ発動機	373,700	1,092.50	408,267,250	
小糸製作所	78,200	2,201.00	172,118,200	
エクセディ	12,300	5,240.00	64,452,000	
ミツバ	14,300	889.00	12,712,700	
豊田合成	25,200	3,754.00	94,600,800	
愛三工業	12,500	2,036.00	25,450,000	
ヨロズ	4,100	935.00	3,833,500	
エフ・シー・シー	14,700	3,190.00	46,893,000	
シマノ	32,200	14,975.00	482,195,000	
テイ・エス テック	28,000	1,726.00	48,328,000	
三十三フィナンシャルグループ	7,200	3,840.00	27,648,000	
第四北越フィナンシャルグループ	70,100	1,495.00	104,799,500	
ひろぎんホールディングス	103,500	1,475.00	152,662,500	
おきなわフィナンシャルグループ	6,300	4,320.00	27,216,000	
ダイレクトマーケティングミックス	32,100	279.00	8,955,900	
L I T A L I C O	7,100	1,243.00	8,825,300	
十六フィナンシャルグループ	10,400	5,990.00	62,296,000	
C C I グループ	77,600	629.00	48,810,400	
ネットプロテクションズホールディングス	22,500	605.00	13,612,500	
プロクレアホールディングス	9,100	1,660.00	15,106,000	
F P パートナー	3,700	2,356.00	8,717,200	
あいちフィナンシャルグループ	15,300	4,205.00	64,336,500	
小野建	8,500	1,375.00	11,687,500	
ノジマ	78,200	1,136.00	88,835,200	
佐島電機	5,100	1,835.00	9,358,500	
カップ・クリエイト	12,600	1,514.00	19,076,400	
伯東	4,800	3,810.00	18,288,000	
コンドーテック	6,700	1,491.00	9,989,700	
ナガイレーベン	10,100	1,841.00	18,594,100	
良品計画	174,400	3,002.00	523,548,800	
松田産業	6,100	4,490.00	27,389,000	
第一興商	26,400	1,608.00	42,451,200	
メディパルホールディングス	86,700	2,596.50	225,116,550	

アドヴァングループ	10,100	872.00	8,807,200	
S P K	3,700	2,280.00	8,436,000	
萩原電気ホールディングス	3,400	3,420.00	11,628,000	
アルビス	3,100	2,689.00	8,335,900	
アズワン	25,500	2,418.00	61,659,000	
スズデン	5,100	1,652.00	8,425,200	
シモジマ	6,600	1,300.00	8,580,000	
ドウシシャ	9,500	2,950.00	28,025,000	
高速	5,300	2,868.00	15,200,400	
G - 7 ホールディングス	8,700	1,313.00	11,423,100	
イオン北海道	23,600	879.00	20,744,400	
コジマ	13,200	1,097.00	14,480,400	
コーナン商事	8,800	3,795.00	33,396,000	
ワタミ	9,600	946.00	9,081,600	
リックス	2,300	3,700.00	8,510,000	
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	807,400	908.80	733,765,120	
丸文	7,200	1,171.00	8,431,200	
西松屋チェーン	17,700	2,164.00	38,302,800	
ゼンショーホールディングス	40,800	8,537.00	348,309,600	
ハビネット	5,400	6,220.00	33,588,000	
橋本総業ホールディングス	7,100	1,214.00	8,619,400	
日本ライフライン	20,100	1,466.00	29,466,600	
サイゼリヤ	10,300	5,210.00	53,663,000	
タカショー	20,100	438.00	8,803,800	
V T ホールディングス	31,200	503.00	15,693,600	
アルゴグラフィックス	27,100	1,468.00	39,782,800	
魚力	3,700	2,339.00	8,654,300	
I D O M	24,100	1,211.00	29,185,100	
ユナイテッドアローズ	8,500	2,130.00	18,105,000	
進和	4,700	3,105.00	14,593,500	
ダイトロン	3,300	4,650.00	15,345,000	
ハイデイ日高	12,900	3,370.00	43,473,000	
シークス	12,800	1,249.00	15,987,200	
コロワイド	45,100	1,702.00	76,760,200	
オーハシテクニカ	4,100	2,237.00	9,171,700	
壺番屋	31,600	906.00	28,629,600	
白銅	3,800	2,203.00	8,371,400	
スギホールディングス	42,900	3,646.00	156,413,400	
薬王堂ホールディングス	4,500	2,116.00	9,522,000	
島津製作所	100,300	4,305.00	431,791,500	
J M S	19,600	428.00	8,388,800	
長野計器	4,900	2,327.00	11,402,300	
ブイ・テクノロジー	3,700	2,886.00	10,678,200	
スター精密	12,300	2,256.00	27,748,800	
東京計器	6,300	5,750.00	36,225,000	
愛知時計電機	3,600	2,585.00	9,306,000	
インターアクション	6,000	1,366.00	8,196,000	
東京精密	14,300	10,835.00	154,940,500	
マニー	30,200	1,351.00	40,800,200	

ニコン	94,200	1,736.00	163,531,200	
オリンパス	418,100	1,993.00	833,273,300	
理研計器	10,700	3,160.00	33,812,000	
S C R E E Nホールディングス	26,900	12,960.00	348,624,000	
キヤノン電子	8,300	2,644.00	21,945,200	
タムロン	38,600	1,030.00	39,758,000	
H O Y A	145,300	23,075.00	3,352,797,500	
ノーリツ鋼機	21,200	1,699.00	36,018,800	
A & Dホロンホールディングス	10,200	1,768.00	18,033,600	
朝日インテック	92,000	2,686.00	247,112,000	
キヤノン	338,900	4,450.00	1,508,105,000	
リコー	177,000	1,347.00	238,419,000	
シチズン時計	62,500	1,223.00	76,437,500	
メニコン	28,200	1,415.00	39,903,000	
パラマウントベッドホールディングス	16,300	3,510.00	57,213,000	
トランザクション	2,500	1,057.00	2,642,500	
ニホンフラッシュ	10,600	829.00	8,787,400	
前田工繊	15,400	1,950.00	30,030,000	
アートネイチャー	10,500	818.00	8,589,000	
フルヤ金属	6,500	3,165.00	20,572,500	
バンダイナムコホールディングス	201,900	4,437.00	895,830,300	
S H O E I	19,700	1,807.00	35,597,900	
フランスベッドホールディングス	10,800	1,319.00	14,245,200	
マーベラス	15,300	536.00	8,200,800	
パイロットコーポレーション	11,600	4,678.00	54,264,800	
萩原工業	5,000	1,558.00	7,790,000	
エイベックス	13,000	1,200.00	15,600,000	
フジシールインターナショナル	15,300	2,920.00	44,676,000	
タカラトミー	37,000	2,892.00	107,004,000	
広済堂ホールディングス	24,500	437.00	10,706,500	
三光合成	10,000	824.00	8,240,000	
プロネクス	7,800	1,183.00	9,227,400	
T O P P A Nホールディングス	91,500	3,994.00	365,451,000	
大日本印刷	162,900	2,508.00	408,553,200	
共同印刷	8,500	1,440.00	12,240,000	
N I S S H A	14,400	1,141.00	16,430,400	
Z A C R O S	23,900	1,083.00	25,883,700	
T A K A R A & C O M P A N Y	4,100	4,385.00	17,978,500	
前澤化成工業	4,900	2,090.00	10,241,000	
未来工業	3,600	3,325.00	11,970,000	
アシックス	290,300	3,661.00	1,062,788,300	
J S P	5,300	2,306.00	12,221,800	
ニチハ	9,500	2,855.00	27,122,500	
ローランド	6,000	3,450.00	20,700,000	
エフピコ	14,300	2,557.00	36,565,100	
小松ウオール工業	5,600	2,585.00	14,476,000	
ヤマハ	127,800	1,050.00	134,190,000	
クリナップ	11,000	784.00	8,624,000	
ピジョン	44,700	1,618.00	72,324,600	
キングジム	10,100	834.00	8,423,400	

象印マホービン	20,500	1,608.00	32,964,000	
リンテック	16,400	3,880.00	63,632,000	
信越ポリマー	16,300	1,887.00	30,758,100	
イトーキ	16,600	2,286.00	37,947,600	
任天堂	476,700	13,275.00	6,328,192,500	
三菱鉛筆	10,200	2,029.00	20,695,800	
松風	6,800	1,845.00	12,546,000	
タカラスタンダード	17,100	2,611.00	44,648,100	
コクヨ	156,900	893.90	140,252,910	
ナカバヤシ	14,900	545.00	8,120,500	
ニフコ	28,300	4,485.00	126,925,500	
グローブライト	7,500	2,117.00	15,877,500	
オカムラ	22,700	2,186.00	49,622,200	
バルカー	6,300	3,820.00	24,066,000	
伊藤忠商事	537,000	9,030.00	4,849,110,000	
丸紅	609,600	3,790.00	2,310,384,000	
スクロール	13,700	1,229.00	16,837,300	
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,735.00	13,186,000	
三陽商会	3,600	3,480.00	12,528,000	
長瀬産業	34,100	3,517.00	119,929,700	
蝶理	4,300	3,870.00	16,641,000	
豊田通商	239,900	4,760.00	1,141,924,000	
オンワードホールディングス	49,000	671.00	32,879,000	
三共生興	12,700	690.00	8,763,000	
兼松	33,400	3,217.00	107,447,800	
美津濃	20,300	2,791.00	56,657,300	
ルックホールディングス	3,100	2,685.00	8,323,500	
三井物産	1,148,700	4,026.00	4,624,666,200	
日本紙パルプ商事	42,400	716.00	30,358,400	
東京エレクトロン	159,800	32,500.00	5,193,500,000	
カメイ	7,500	2,767.00	20,752,500	
スターゼン	18,200	1,175.00	21,385,000	
セイコーグループ	10,500	6,880.00	72,240,000	
山善	24,200	1,450.00	35,090,000	
椿本興業	5,500	2,616.00	14,388,000	
住友商事	478,900	4,736.00	2,268,070,400	
B I P R O G Y	25,600	6,031.00	154,393,600	
内田洋行	2,900	10,400.00	30,160,000	
三菱商事	1,592,700	3,618.00	5,762,388,600	
第一実業	7,400	2,736.00	20,246,400	
キヤノンマーケティングジャパン	18,800	6,600.00	124,080,000	
西華産業	11,500	2,316.00	26,634,000	
佐藤商事	5,500	2,174.00	11,957,000	
東京産業	9,100	990.00	9,009,000	
ユアサ商事	6,900	5,100.00	35,190,000	
神鋼商事	6,000	2,323.00	13,938,000	
阪和興業	13,100	6,680.00	87,508,000	
正栄食品工業	5,300	4,000.00	21,200,000	
カナデン	6,400	2,056.00	13,158,400	
R Y O D E N	6,100	3,175.00	19,367,500	

ニプロ	62,900	1,473.00	92,651,700	
岩谷産業	79,400	1,669.50	132,558,300	
極東貿易	3,400	1,715.00	5,831,000	
アステナホールディングス	18,400	467.00	8,592,800	
三愛オブリ	18,600	2,045.00	38,037,000	
稲畑産業	18,200	3,520.00	64,064,000	
G S I クレオス	4,600	2,312.00	10,635,200	
明和産業	11,400	796.00	9,074,400	
ゴールドウイン	44,200	2,781.00	122,920,200	
ユニ・チャーム	473,300	920.20	435,530,660	
ワキタ	13,200	1,805.00	23,826,000	
東邦ホールディングス	22,700	4,551.00	103,307,700	
サンゲツ	20,100	3,065.00	61,606,500	
ミツウロコグループホールディングス	9,700	2,183.00	21,175,100	
シナネンホールディングス	1,700	6,520.00	11,084,000	
伊藤忠エネクス	19,800	1,815.00	35,937,000	
サンリオ	79,300	5,242.00	415,690,600	
サンワ テクノス	4,500	2,853.00	12,838,500	
新光商事	9,600	1,042.00	10,003,200	
トーホー	3,100	3,420.00	10,602,000	
三信電気	4,600	3,010.00	13,846,000	
東陽テクニカ	7,400	1,648.00	12,195,200	
モスフードサービス	11,700	4,030.00	47,151,000	
加賀電子	14,800	3,520.00	52,096,000	
都築電気	4,800	3,150.00	15,120,000	
ソーダニッカ	8,600	1,014.00	8,720,400	
立花エレテック	4,800	2,924.00	14,035,200	
木曽路	12,100	2,444.00	29,572,400	
S R S ホールディングス	13,200	1,198.00	15,813,600	
リテールパートナーズ	11,900	1,319.00	15,696,100	
上新電機	8,700	2,593.00	22,559,100	
日本瓦斯	38,200	2,986.00	114,065,200	
ロイヤルホールディングス	15,500	2,619.00	40,594,500	
チヨダ	8,700	987.00	8,586,900	
ライフコーポレーション	15,300	2,489.00	38,081,700	
リンガーハット	11,000	2,248.00	24,728,000	
M r M a x H D	11,000	780.00	8,580,000	
A O K I ホールディングス	17,100	1,655.00	28,300,500	
オークワ	10,600	845.00	8,957,000	
コメリ	10,800	3,315.00	35,802,000	
青山商事	17,100	2,361.00	40,373,100	
しまむら	18,800	10,830.00	203,604,000	
高島屋	115,800	1,610.50	186,495,900	
松屋	15,000	1,795.00	26,925,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	38,900	2,081.50	80,970,350	
近鉄百貨店	4,600	1,849.00	8,505,400	
丸井グループ	46,700	3,122.00	145,797,400	
クレディセゾン	41,900	3,716.00	155,700,400	
アクシアル リテイリング	21,800	1,081.00	23,565,800	
イオン	943,200	2,820.00	2,659,824,000	

イズミ	14,200	2,900.00	41,180,000	
平和堂	13,100	2,928.00	38,356,800	
フジ	12,300	2,016.00	24,796,800	
ゼビオホールディングス	9,500	1,050.00	9,975,000	
ケーズホールディングス	54,400	1,529.00	83,177,600	
P A L T A C	12,300	4,598.00	56,555,400	
あおぞら銀行	47,400	2,322.50	110,086,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,770,500	2,386.50	11,384,798,250	
りそなホールディングス	912,000	1,541.50	1,405,848,000	
三井住友トラストグループ	258,900	4,333.00	1,121,813,700	
三井住友フィナンシャルグループ	1,633,800	4,416.00	7,214,860,800	
千葉銀行	227,500	1,555.00	353,762,500	
群馬銀行	134,100	1,608.50	215,699,850	
武蔵野銀行	10,400	4,365.00	45,396,000	
千葉興業銀行	14,100	1,499.00	21,135,900	
筑波銀行	32,600	345.00	11,247,000	
七十七銀行	23,800	6,888.00	163,934,400	
秋田銀行	5,000	3,695.00	18,475,000	
山形銀行	9,600	1,707.00	16,387,200	
岩手銀行	4,700	4,615.00	21,690,500	
東邦銀行	85,600	467.00	39,975,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	59,400	4,585.00	272,349,000	
スルガ銀行	50,100	1,562.00	78,256,200	
八十二銀行	153,400	1,559.50	239,227,300	
山梨中央銀行	9,000	3,410.00	30,690,000	
大垣共立銀行	15,400	3,755.00	57,827,000	
福井銀行	7,200	2,154.00	15,508,800	
清水銀行	2,700	2,065.00	5,575,500	
滋賀銀行	11,200	6,170.00	69,104,000	
南都銀行	11,200	5,200.00	58,240,000	
百五銀行	70,000	982.00	68,740,000	
紀陽銀行	24,700	2,900.00	71,630,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	45,300	4,341.00	196,647,300	
山陰合同銀行	46,500	1,380.00	64,170,000	
百十四銀行	7,300	5,750.00	41,975,000	
四国銀行	11,700	1,502.00	17,573,400	
阿波銀行	11,000	3,830.00	42,130,000	
大分銀行	4,700	5,240.00	24,628,000	
宮崎銀行	4,400	5,110.00	22,484,000	
佐賀銀行	4,700	3,340.00	15,698,000	
琉球銀行	15,800	1,586.00	25,058,800	
セブン銀行	233,100	284.70	66,363,570	
みずほフィナンシャルグループ	1,054,600	5,159.00	5,440,681,400	
山口フィナンシャルグループ	72,900	1,771.50	129,142,350	
芙蓉総合リース	20,500	4,007.00	82,143,500	
みずほリース	55,900	1,277.00	71,384,300	
東京センチュリー	55,600	1,929.00	107,252,400	
S B I ホールディングス	130,600	6,340.00	828,004,000	
日本証券金融	27,300	1,827.00	49,877,100	
アイフル	123,200	486.00	59,875,200	

名古屋銀行	13,900	4,090.00	56,851,000	
北洋銀行	96,100	751.00	72,171,100	
愛媛銀行	10,900	1,240.00	13,516,000	
京葉銀行	33,400	1,415.00	47,261,000	
栃木銀行	40,200	610.00	24,522,000	
北日本銀行	2,400	4,125.00	9,900,000	
東和銀行	14,700	914.00	13,435,800	
リコーリース	7,100	5,650.00	40,115,000	
イオンフィナンシャルサービス	42,700	1,531.50	65,395,050	
アコム	132,700	452.00	59,980,400	
ジャックス	8,900	4,000.00	35,600,000	
オリエントコーポレーション	29,100	1,010.00	29,391,000	
オリックス	459,700	4,027.00	1,851,211,900	
三菱ＨＣキャピタル	372,800	1,210.00	451,088,000	
ジャフコ グループ	20,600	2,392.50	49,285,500	
トモニホールディングス	71,000	696.00	49,416,000	
大和証券グループ本社	531,800	1,256.00	667,940,800	
野村ホールディングス	1,250,600	1,124.00	1,405,674,400	
岡三証券グループ	58,800	702.00	41,277,600	
丸三証券	24,700	946.00	23,366,200	
東洋証券	22,900	591.00	13,533,900	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,300	613.00	54,127,900	
水戸証券	20,400	523.00	10,669,200	
いちよし証券	13,900	901.00	12,523,900	
松井証券	51,200	799.00	40,908,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	369,300	4,955.00	1,829,881,500	
日本取引所グループ	412,900	1,740.50	718,652,450	
マネックスグループ	78,800	725.00	57,130,000	
極東証券	10,200	1,594.00	16,258,800	
岩井コスモホールディングス	7,800	3,000.00	23,400,000	
アイザワ証券グループ	7,500	1,308.00	9,810,000	
フィデアホールディングス	7,700	1,658.00	12,766,600	
池田泉州ホールディングス	103,200	725.00	74,820,000	
アニコム ホールディングス	23,300	845.00	19,688,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	499,600	3,403.00	1,700,138,800	
ソニーフィナンシャルグループ	2,604,600	145.00	377,667,000	
スパークス・グループ	8,200	1,451.00	11,898,200	
第一生命ホールディングス	1,463,000	1,237.00	1,809,731,000	
東京海上ホールディングス	764,600	5,350.00	4,090,610,000	
イー・ギャランティ	12,200	1,674.00	20,422,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,700	3,860.00	14,282,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	184,300	3,351.00	617,589,300	
三井不動産	1,099,800	1,729.00	1,901,554,200	
三菱地所	459,200	3,355.00	1,540,616,000	
平和不動産	15,400	2,249.00	34,634,600	
東京建物	70,900	3,276.00	232,268,400	
京阪神ビルディング	11,000	1,792.00	19,712,000	
住友不動産	105,700	7,116.00	752,161,200	

テオーシー	13,200	834.00	11,008,800	
レオパレス 2 1	66,100	655.00	43,295,500	
スターツコーポレーション	13,700	4,655.00	63,773,500	
フジ住宅	7,600	785.00	5,966,000	
空港施設	10,500	1,014.00	10,647,000	
明和地所	7,900	1,095.00	8,650,500	
ゴールドクレスト	4,000	3,280.00	13,120,000	
リログループ	34,600	1,690.00	58,474,000	
エスリード	3,500	6,210.00	21,735,000	
日神グループホールディングス	14,200	709.00	10,067,800	
エスコン	16,700	1,010.00	16,867,000	
M I R A R T Hホールディングス	47,500	376.00	17,860,000	
カチタス	20,000	2,890.00	57,800,000	
東祥	11,100	798.00	8,857,800	
トーセイ	11,000	3,245.00	35,695,000	
サンフロンティア不動産	11,000	2,320.00	25,520,000	
F J ネクストホールディングス	6,800	1,448.00	9,846,400	
グランディハウス	14,900	581.00	8,656,900	
東武鉄道	79,500	2,540.50	201,969,750	
相鉄ホールディングス	29,100	2,671.50	77,740,650	
東急	194,100	1,758.00	341,227,800	
京浜急行電鉄	85,700	1,506.50	129,107,050	
小田急電鉄	114,500	1,718.00	196,711,000	
京王電鉄	33,800	3,860.00	130,468,000	
京成電鉄	131,400	1,233.00	162,016,200	
富士急行	9,300	2,024.00	18,823,200	
東日本旅客鉄道	416,400	3,818.00	1,589,815,200	
西日本旅客鉄道	180,100	3,076.00	553,987,600	
東海旅客鉄道	319,900	4,065.00	1,300,393,500	
東京地下鉄	120,200	1,564.50	188,052,900	
西武ホールディングス	82,200	4,770.00	392,094,000	
鴻池運輸	12,900	3,050.00	39,345,000	
西日本鉄道	21,800	2,573.50	56,102,300	
ハマキョウレックス	23,600	1,618.00	38,184,800	
サカイ引越センター	9,600	2,786.00	26,745,600	
近鉄グループホールディングス	80,800	2,800.00	226,240,000	
阪急阪神ホールディングス	100,000	3,854.00	385,400,000	
南海電気鉄道	36,000	2,802.50	100,890,000	
京阪ホールディングス	39,200	3,245.00	127,204,000	
神戸電鉄	3,400	2,408.00	8,187,200	
名古屋鉄道	83,300	1,582.50	131,822,250	
山陽電気鉄道	5,700	2,016.00	11,491,200	
ヤマトホールディングス	91,600	2,215.50	202,939,800	
山九	17,200	8,478.00	145,821,600	
丸全昭和運輸	4,700	6,710.00	31,537,000	
センコーグループホールディングス	54,600	1,839.00	100,409,400	
ニッコンホールディングス	32,100	3,513.00	112,767,300	
福山通運	8,100	3,950.00	31,995,000	
セイノーホールディングス	37,100	2,196.50	81,490,150	
神奈川中央交通	1,100	3,550.00	3,905,000	

A Z - C O M丸和ホールディングス	23,400	1,009.00	23,610,600	
日本郵船	159,300	4,947.00	788,057,100	
商船三井	143,400	4,410.00	632,394,000	
川崎汽船	162,400	2,084.00	338,441,600	
N S ユナイテッド海運	4,800	5,610.00	26,928,000	
飯野海運	27,700	1,324.00	36,674,800	
九州旅客鉄道	56,800	3,931.00	223,280,800	
S G ホールディングス	126,600	1,537.50	194,647,500	
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	81,100	3,198.00	259,357,800	
日本航空	172,800	2,917.00	504,057,600	
A N A ホールディングス	205,100	2,917.00	598,276,700	
T R E ホールディングス	17,800	1,501.00	26,717,800	
人・夢・技術グループ	5,100	1,619.00	8,256,900	
シルバーライフ	10,100	867.00	8,756,700	
G e n k y D r u g S t o r e s	7,000	4,910.00	34,370,000	
コア商事ホールディングス	10,900	786.00	8,567,400	
K P P グループホールディングス	20,900	712.00	14,880,800	
ブックオフグループホールディングス	6,300	1,369.00	8,624,700	
ギフトホールディングス	4,500	3,155.00	14,197,500	
三菱倉庫	85,600	1,097.50	93,946,000	
三井倉庫ホールディングス	23,300	3,900.00	90,870,000	
住友倉庫	22,000	3,285.00	72,270,000	
澁澤倉庫	12,000	1,126.00	13,512,000	
ヤマタネ	6,400	2,513.00	16,083,200	
乾汽船	9,600	1,395.00	13,392,000	
日本トランスシティ	19,000	1,065.00	20,235,000	
中央倉庫	4,000	1,309.00	5,236,000	
安田倉庫	5,100	2,156.00	10,995,600	
大栄環境	16,900	3,505.00	59,234,500	
日本管財ホールディングス	8,100	2,690.00	21,789,000	
上組	33,100	4,882.00	161,594,200	
キューソー流通システム	4,300	2,662.00	11,446,600	
エーアイティー	4,700	2,078.00	9,766,600	
T B S ホールディングス	37,400	5,535.00	207,009,000	
日本テレビホールディングス	67,000	3,805.00	254,935,000	
朝日放送グループホールディングス	11,900	785.00	9,341,500	
テレビ朝日ホールディングス	18,400	3,280.00	60,352,000	
スカパーJ S A T ホールディングス	50,400	1,767.00	89,056,800	
テレビ東京ホールディングス	4,700	4,885.00	22,959,500	
ビジョン	15,800	1,220.00	19,276,000	
U - N E X T H O L D I N G S	25,500	1,994.00	50,847,000	
日本通信	61,200	138.00	8,445,600	
N T T	20,793,500	152.60	3,173,088,100	
K D D I	1,064,300	2,675.00	2,847,002,500	
ソフトバンク	12,174,900	227.30	2,767,354,770	
光通信	7,500	41,580.00	311,850,000	
G M O インターネットグループ	24,500	3,472.00	85,064,000	
K A D O K A W A	42,100	3,169.00	133,414,900	
学研ホールディングス	13,900	1,071.00	14,886,900	

ゼンリン	11,300	1,022.00	11,548,600	
東京電力ホールディングス	680,700	834.00	567,703,800	
中部電力	278,200	2,307.00	641,807,400	
関西電力	409,300	2,570.00	1,051,901,000	
中国電力	131,200	989.90	129,874,880	
北陸電力	77,200	939.20	72,506,240	
東北電力	198,800	1,093.00	217,288,400	
四国電力	70,300	1,462.00	102,778,600	
九州電力	174,100	1,620.00	282,042,000	
北海道電力	85,100	1,122.00	95,482,200	
沖縄電力	19,300	1,044.00	20,149,200	
電源開発	56,900	2,977.00	169,391,300	
イーレックス	15,500	636.00	9,858,000	
レノバ	20,600	767.00	15,800,200	
東京瓦斯	136,200	6,060.00	825,372,000	
大阪瓦斯	134,800	5,212.00	702,577,600	
東邦瓦斯	27,700	4,724.00	130,854,800	
北海道瓦斯	22,500	739.00	16,627,500	
広島ガス	23,400	366.00	8,564,400	
西部ガスホールディングス	8,700	1,910.00	16,617,000	
静岡ガス	17,200	1,165.00	20,038,000	
メタウォーター	10,000	3,280.00	32,800,000	
M & A 総研ホールディングス	9,200	1,188.00	10,929,600	
アイネット	4,800	2,515.00	12,072,000	
松竹	4,300	12,420.00	53,406,000	
東宝	39,800	8,841.00	351,871,800	
エイチ・アイ・エス	22,500	1,228.00	27,630,000	
東映	12,500	5,500.00	68,750,000	
共立メンテナンス	29,400	2,683.50	78,894,900	
イチネンホールディングス	7,400	2,039.00	15,088,600	
建設技術研究所	8,000	3,015.00	24,120,000	
アインホールディングス	8,000	6,633.00	53,064,000	
燦ホールディングス	6,500	1,305.00	8,482,500	
ピー・シー・エー	5,000	1,779.00	8,895,000	
スバル興業	2,600	3,300.00	8,580,000	
ナガワ	2,100	6,010.00	12,621,000	
東京都競馬	5,700	5,180.00	29,526,000	
カナモト	10,900	3,515.00	38,313,500	
D T S	60,200	1,166.00	70,193,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	124,600	3,062.00	381,525,200	
シーイーシー	9,200	2,188.00	20,129,600	
カプコン	150,500	3,807.00	572,953,500	
ニシオホールディングス	6,400	4,250.00	27,200,000	
日本空港ビルデング	26,300	4,547.00	119,586,100	
トランス・コスモス	9,900	3,590.00	35,541,000	
乃村工藝社	33,900	1,133.00	38,408,700	
S C S K	61,900	5,682.00	351,715,800	
藤田観光	3,100	10,300.00	31,930,000	
トーカイ	6,100	2,309.00	14,084,900	

セコム	144,900	5,358.00	776,374,200	
N S W	3,400	2,428.00	8,255,200	
セントラル警備保障	3,800	2,575.00	9,785,000	
アイネス	5,900	1,720.00	10,148,000	
丹青社	16,400	1,326.00	21,746,400	
メイテックグループホールディングス	28,600	3,398.00	97,182,800	
T K C	11,800	4,040.00	47,672,000	
応用地質	7,000	2,684.00	18,788,000	
船井総研ホールディングス	15,500	2,340.00	36,270,000	
N S D	26,700	3,509.00	93,690,300	
コナミグループ	32,400	23,450.00	759,780,000	
学究社	3,700	2,294.00	8,487,800	
ナック	15,900	521.00	8,283,900	
福井コンピュータホールディングス	4,100	2,963.00	12,148,300	
ダイセキ	15,800	3,370.00	53,246,000	
ステップ	3,600	2,413.00	8,686,800	
泉州電業	5,100	4,490.00	22,899,000	
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	4,500	3,015.00	13,567,500	
トラスコ中山	16,800	2,291.00	38,488,800	
ヤマダホールディングス	245,700	462.50	113,636,250	
オートバックスセブン	27,800	1,568.00	43,590,400	
モリト	6,400	1,668.00	10,675,200	
アー克蘭ズ	23,800	1,840.00	43,792,000	
ニトリホールディングス	129,300	2,585.00	334,240,500	
ケーユーホールディングス	7,200	1,208.00	8,697,600	
吉野家ホールディングス	29,400	3,048.00	89,611,200	
加藤産業	9,900	5,960.00	59,004,000	
イノテック	5,000	1,980.00	9,900,000	
イエローハット	20,100	1,606.00	32,280,600	
松屋フーズホールディングス	3,800	6,100.00	23,180,000	
J B C Cホールディングス	20,100	1,411.00	28,361,100	
J Kホールディングス	6,800	1,189.00	8,085,200	
サガミホールディングス	12,800	1,777.00	22,745,600	
日伝	4,400	2,400.00	10,560,000	
ミロク情報サービス	6,400	1,826.00	11,686,400	
杉本商事	6,400	1,465.00	9,376,000	
因幡電機産業	20,900	4,661.00	97,414,900	
王将フードサービス	16,500	3,110.00	51,315,000	
ミニストップ	5,800	2,055.00	11,919,000	
アークス	13,400	3,310.00	44,354,000	
バローホールディングス	15,200	3,020.00	45,904,000	
東テク	8,900	3,375.00	30,037,500	
ミスミグループ本社	112,700	2,155.00	242,868,500	
ベルク	3,500	7,460.00	26,110,000	
大 庄	7,700	1,137.00	8,754,900	
ファーストリテイリング	53,900	54,620.00	2,944,018,000	
ソフトバンクグループ	373,600	19,180.00	7,165,648,000	
スズケン	26,500	5,753.00	152,454,500	
サンドラッグ	23,600	4,308.00	101,668,800	

サクスパー ホールディングス	10,900	761.00	8,294,900	
ジェコス	6,100	1,395.00	8,509,500	
ペルーナ	19,200	941.00	18,067,200	
合計	150,265,500		353,999,076,250	

（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）

2025年11月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	105,528,732
コール・ローン	527,967,759
国債証券	66,308,008,500
地方債証券	3,173,202,470
特殊債券	4,381,062,173
社債券	4,309,907,900
未収利息	213,463,275
前払費用	22,280,170
流動資産合計	79,041,420,979
資産合計	79,041,420,979
負債の部	
流動負債	
未払解約金	53,235,402
流動負債合計	53,235,402
負債合計	53,235,402
純資産の部	
元本等	
元本	91,373,867,238
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,385,681,661
元本等合計	78,988,185,577
純資産合計	78,988,185,577
負債純資産合計	79,041,420,979

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2024年11月21日 至 2025年11月20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	2025年11月20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	70,686,765,017円
同期中追加設定元本額	33,435,917,080円
同期中一部解約元本額	12,748,814,859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）	49,455,670,282円
DCニッセイ日本債券インデックス	7,310,452,099円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	714,763,899円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	13,839,928,469円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	1,348,484,488円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	7,124,092,330円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	583,019,783円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	558,218,679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）	59,611,402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）	241,101,903円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	135,670,370円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	445,668,770円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	584,672,867円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	1,909,614,335円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	6,801,519,524円
FWニッセイ国内債インデックス	47,994,165円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	187,522,486円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	25,861,387円
計	91,373,867,238円
2. 受益権の総数	91,373,867,238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12,385,681,661円です。

（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 2024年11月21日 至 2025年11月20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	2025年11月20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	2025年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,994,917,750
地方債証券	39,227,424
特殊債券	52,888,792
社債券	23,693,400
合計	2,110,727,366

（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（2025年3月11日から2025年11月20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）

	2025年11月20日現在
1口当たり純資産額	0.8645円
（1万口当たり純資産額）	(8,645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

2025年11月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第467回 利付国債（2年）	216,000,000	215,613,360	
	第468回 利付国債（2年）	225,000,000	224,527,500	
	第469回 利付国債（2年）	229,000,000	228,713,750	
	第470回 利付国債（2年）	224,000,000	223,941,760	
	第471回 利付国債（2年）	244,000,000	244,195,200	
	第472回 利付国債（2年）	315,000,000	314,303,850	
	第473回 利付国債（2年）	371,000,000	370,580,770	
	第474回 利付国債（2年）	242,000,000	241,269,160	
	第475回 利付国債（2年）	242,000,000	241,958,860	
	第476回 利付国債（2年）	226,000,000	225,900,560	
	第477回 利付国債（2年）	234,000,000	234,255,060	
	第150回 利付国債（5年）	397,000,000	393,685,050	
	第151回 利付国債（5年）	416,000,000	411,548,800	
	第152回 利付国債（5年）	130,000,000	128,771,500	
	第153回 利付国債（5年）	761,000,000	750,635,180	
	第154回 利付国債（5年）	596,000,000	587,095,760	
	第155回 利付国債（5年）	222,000,000	219,011,880	

第156回 利付国債（5年）	384,000,000	378,048,000	
第157回 利付国債（5年）	222,000,000	218,010,660	
第158回 利付国債（5年）	413,000,000	404,640,880	
第159回 利付国債（5年）	160,000,000	156,300,800	
第160回 利付国債（5年）	195,000,000	190,983,000	
第161回 利付国債（5年）	215,000,000	211,110,650	
第162回 利付国債（5年）	25,000,000	24,484,500	
第163回 利付国債（5年）	318,000,000	312,317,340	
第164回 利付国債（5年）	138,000,000	134,340,240	
第165回 利付国債（5年）	198,000,000	193,339,080	
第166回 利付国債（5年）	220,000,000	215,476,800	
第167回 利付国債（5年）	183,000,000	178,715,970	
第168回 利付国債（5年）	198,000,000	194,665,680	
第169回 利付国債（5年）	183,000,000	179,303,400	
第170回 利付国債（5年）	200,000,000	196,084,000	
第171回 利付国債（5年）	201,000,000	195,649,380	
第172回 利付国債（5年）	205,000,000	200,248,100	
第173回 利付国債（5年）	186,000,000	181,813,140	
第174回 利付国債（5年）	543,000,000	532,764,450	
第175回 利付国債（5年）	500,000,000	493,300,000	
第176回 利付国債（5年）	469,000,000	464,628,920	
第177回 利付国債（5年）	322,000,000	320,248,320	
第178回 利付国債（5年）	828,000,000	818,825,760	
第179回 利付国債（5年）	376,000,000	371,123,280	
第180回 利付国債（5年）	218,000,000	216,114,300	
第1回 利付国債（40年）	105,000,000	94,801,350	
第2回 利付国債（40年）	128,000,000	109,514,240	
第3回 利付国債（40年）	126,000,000	105,939,540	
第4回 利付国債（40年）	169,000,000	138,389,030	
第5回 利付国債（40年）	166,000,000	127,599,220	
第6回 利付国債（40年）	180,000,000	133,792,200	
第7回 利付国債（40年）	173,000,000	121,695,120	
第8回 利付国債（40年）	153,000,000	98,057,700	
第9回 利付国債（40年）	203,000,000	90,732,880	
第10回 利付国債（40年）	341,000,000	181,882,580	
第11回 利付国債（40年）	149,000,000	75,160,070	
第12回 利付国債（40年）	103,000,000	44,842,080	
第13回 利付国債（40年）	166,000,000	70,707,700	
第14回 利付国債（40年）	231,000,000	105,024,150	
第15回 利付国債（40年）	334,000,000	166,949,900	
第16回 利付国債（40年）	373,000,000	203,478,960	
第17回 利付国債（40年）	368,000,000	263,587,360	
第18回 利付国債（40年）	148,000,000	132,818,160	
第1回 クライメート・トラン ジション利付国債（5年）	36,000,000	35,147,160	
第2回 クライメート・トラン ジション利付国債（10年）	34,000,000	32,228,600	
第345回 利付国債（10 年）	489,000,000	485,410,740	

第346回 利付国債（10年）	458,000,000	453,671,900	
第347回 利付国債（10年）	640,000,000	632,224,000	
第348回 利付国債（10年）	630,000,000	620,587,800	
第349回 利付国債（10年）	571,000,000	560,984,660	
第350回 利付国債（10年）	776,000,000	760,293,760	
第351回 利付国債（10年）	349,000,000	340,931,120	
第352回 利付国債（10年）	228,000,000	222,015,000	
第353回 利付国債（10年）	605,000,000	587,152,500	
第354回 利付国債（10年）	260,000,000	251,373,200	
第355回 利付国債（10年）	563,000,000	542,123,960	
第356回 利付国債（10年）	508,000,000	487,177,080	
第357回 利付国債（10年）	225,000,000	214,872,750	
第358回 利付国債（10年）	246,000,000	234,005,040	
第359回 利付国債（10年）	601,000,000	569,219,120	
第360回 利付国債（10年）	543,000,000	512,103,300	
第361回 利付国債（10年）	373,000,000	350,668,490	
第362回 利付国債（10年）	384,000,000	359,523,840	
第363回 利付国債（10年）	410,000,000	382,124,100	
第364回 利付国債（10年）	483,000,000	447,943,860	
第365回 利付国債（10年）	398,000,000	367,262,460	
第366回 利付国債（10年）	426,000,000	393,658,080	
第367回 利付国債（10年）	136,000,000	125,076,480	
第368回 利付国債（10年）	413,000,000	377,861,960	
第369回 利付国債（10年）	452,000,000	420,649,280	
第370回 利付国債（10年）	466,000,000	431,818,900	

第 3 7 1 回 利付国債（ 1 0 年 ）	493,000,000	451,336,570	
第 3 7 2 回 利付国債（ 1 0 年 ）	473,000,000	444,809,200	
第 3 7 3 回 利付国債（ 1 0 年 ）	474,000,000	436,956,900	
第 3 7 4 回 利付国債（ 1 0 年 ）	579,000,000	540,398,070	
第 3 7 5 回 利付国債（ 1 0 年 ）	651,000,000	620,591,790	
第 3 7 6 回 利付国債（ 1 0 年 ）	664,000,000	619,883,840	
第 3 7 7 回 利付国債（ 1 0 年 ）	668,000,000	637,960,040	
第 3 7 8 回 利付国債（ 1 0 年 ）	676,000,000	654,929,080	
第 3 7 9 回 利付国債（ 1 0 年 ）	462,000,000	450,676,380	
第 3 8 0 回 利付国債（ 1 0 年 ）	6,000,000	5,942,400	
第 1 回 利付国債（ 3 0 年 ）	54,000,000	57,215,700	
第 2 回 利付国債（ 3 0 年 ）	66,000,000	69,117,840	
第 3 回 利付国債（ 3 0 年 ）	69,000,000	72,051,180	
第 4 回 利付国債（ 3 0 年 ）	76,000,000	81,782,080	
第 5 回 利付国債（ 3 0 年 ）	47,000,000	49,068,000	
第 6 回 利付国債（ 3 0 年 ）	48,000,000	50,683,680	
第 7 回 利付国債（ 3 0 年 ）	57,000,000	59,892,750	
第 8 回 利付国債（ 3 0 年 ）	115,000,000	117,037,800	
第 9 回 利付国債（ 3 0 年 ）	44,000,000	43,592,560	
第 1 0 回 利付国債（ 3 0 年 ）	53,000,000	51,312,480	
第 1 1 回 利付国債（ 3 0 年 ）	121,000,000	121,941,380	
第 1 2 回 利付国債（ 3 0 年 ）	121,000,000	125,296,710	
第 1 3 回 利付国債（ 3 0 年 ）	157,000,000	161,260,980	
第 1 4 回 利付国債（ 3 0 年 ）	187,000,000	197,700,140	
第 1 5 回 利付国債（ 3 0 年 ）	207,000,000	220,386,690	
第 1 6 回 利付国債（ 3 0 年 ）	179,000,000	190,432,730	
第 1 7 回 利付国債（ 3 0 年 ）	163,000,000	172,041,610	
第 1 8 回 利付国債（ 3 0 年 ）	175,000,000	183,009,750	
第 1 9 回 利付国債（ 3 0 年 ）	152,000,000	158,922,080	
第 2 0 回 利付国債（ 3 0 年 ）	159,000,000	168,859,590	
第 2 1 回 利付国債（ 3 0 年 ）	149,000,000	155,421,900	
第 2 2 回 利付国債（ 3 0 年 ）	164,000,000	173,843,280	
第 2 3 回 利付国債（ 3 0 年 ）	168,000,000	177,817,920	
第 2 4 回 利付国債（ 3 0 年 ）	138,000,000	145,828,740	
第 2 5 回 利付国債（ 3 0 年 ）	67,000,000	69,325,570	
第 2 6 回 利付国債（ 3 0 年 ）	123,000,000	128,194,290	
第 2 7 回 利付国債（ 3 0 年 ）	161,000,000	168,861,630	
第 2 8 回 利付国債（ 3 0 年 ）	201,000,000	209,693,250	
第 2 9 回 利付国債（ 3 0 年 ）	222,000,000	227,922,960	
第 3 0 回 利付国債（ 3 0 年 ）	244,000,000	246,259,440	

第 3 1 回	利付国債（ 3 0 年）	245,000,000	242,809,700	
第 3 2 回	利付国債（ 3 0 年）	284,000,000	282,932,160	
第 3 3 回	利付国債（ 3 0 年）	334,000,000	318,342,080	
第 3 4 回	利付国債（ 3 0 年）	274,000,000	265,626,560	
第 3 5 回	利付国債（ 3 0 年）	311,000,000	290,887,630	
第 3 6 回	利付国債（ 3 0 年）	319,000,000	296,382,900	
第 3 7 回	利付国債（ 3 0 年）	327,000,000	296,556,300	
第 3 8 回	利付国債（ 3 0 年）	221,000,000	195,788,320	
第 3 9 回	利付国債（ 3 0 年）	210,000,000	188,178,900	
第 4 0 回	利付国債（ 3 0 年）	177,000,000	155,303,340	
第 4 1 回	利付国債（ 3 0 年）	166,000,000	142,710,200	
第 4 2 回	利付国債（ 3 0 年）	182,000,000	155,584,520	
第 4 3 回	利付国債（ 3 0 年）	178,000,000	151,296,440	
第 4 4 回	利付国債（ 3 0 年）	190,000,000	160,760,900	
第 4 5 回	利付国債（ 3 0 年）	208,000,000	169,114,400	
第 4 6 回	利付国債（ 3 0 年）	248,000,000	200,527,840	
第 4 7 回	利付国債（ 3 0 年）	230,000,000	188,425,200	
第 4 8 回	利付国債（ 3 0 年）	236,000,000	185,250,560	
第 4 9 回	利付国債（ 3 0 年）	238,000,000	185,742,340	
第 5 0 回	利付国債（ 3 0 年）	241,000,000	164,892,200	
第 5 1 回	利付国債（ 3 0 年）	252,000,000	151,633,440	
第 5 2 回	利付国債（ 3 0 年）	251,000,000	157,439,750	
第 5 3 回	利付国債（ 3 0 年）	236,000,000	150,426,400	
第 5 4 回	利付国債（ 3 0 年）	243,000,000	161,303,400	
第 5 5 回	利付国債（ 3 0 年）	226,000,000	148,879,760	
第 5 6 回	利付国債（ 3 0 年）	233,000,000	152,321,420	
第 5 7 回	利付国債（ 3 0 年）	233,000,000	151,163,410	
第 5 8 回	利付国債（ 3 0 年）	289,000,000	186,075,540	
第 5 9 回	利付国債（ 3 0 年）	219,000,000	136,334,070	
第 6 0 回	利付国債（ 3 0 年）	201,000,000	130,700,250	
第 6 1 回	利付国債（ 3 0 年）	196,000,000	120,034,320	
第 6 2 回	利付国債（ 3 0 年）	195,000,000	111,967,050	
第 6 3 回	利付国債（ 3 0 年）	213,000,000	117,599,430	
第 6 4 回	利付国債（ 3 0 年）	217,000,000	118,649,090	
第 6 5 回	利付国債（ 3 0 年）	212,000,000	114,865,840	
第 6 6 回	利付国債（ 3 0 年）	196,000,000	105,116,760	
第 6 7 回	利付国債（ 3 0 年）	245,000,000	137,996,250	
第 6 8 回	利付国債（ 3 0 年）	247,000,000	137,581,470	
第 6 9 回	利付国債（ 3 0 年）	243,000,000	137,938,950	
第 7 0 回	利付国債（ 3 0 年）	260,000,000	145,992,600	
第 7 1 回	利付国債（ 3 0 年）	238,000,000	132,504,120	
第 7 2 回	利付国債（ 3 0 年）	241,000,000	133,193,470	
第 7 3 回	利付国債（ 3 0 年）	243,000,000	133,003,620	
第 7 4 回	利付国債（ 3 0 年）	236,000,000	140,266,600	
第 7 5 回	利付国債（ 3 0 年）	242,000,000	155,717,320	
第 7 6 回	利付国債（ 3 0 年）	231,000,000	152,092,710	
第 7 7 回	利付国債（ 3 0 年）	223,000,000	154,128,680	
第 7 8 回	利付国債（ 3 0 年）	231,000,000	150,912,300	
第 7 9 回	利付国債（ 3 0 年）	237,000,000	146,148,420	
第 8 0 回	利付国債（ 3 0 年）	219,000,000	157,940,610	

第 8 1 回 利付国債（ 3 0 年）	237,000,000	161,773,830	
第 8 2 回 利付国債（ 3 0 年）	235,000,000	168,694,750	
第 8 3 回 利付国債（ 3 0 年）	227,000,000	179,327,730	
第 8 4 回 利付国債（ 3 0 年）	223,000,000	171,788,050	
第 8 5 回 利付国債（ 3 0 年）	238,000,000	191,861,320	
第 8 6 回 利付国債（ 3 0 年）	212,000,000	174,834,280	
第 8 7 回 利付国債（ 3 0 年）	186,000,000	167,199,120	
第 8 8 回 利付国債（ 3 0 年）	72,000,000	70,126,560	
第 9 2 回 利付国債（ 2 0 年）	256,000,000	259,614,720	
第 9 3 回 利付国債（ 2 0 年）	67,000,000	68,041,180	
第 9 4 回 利付国債（ 2 0 年）	104,000,000	105,752,400	
第 9 5 回 利付国債（ 2 0 年）	228,000,000	233,075,280	
第 9 6 回 利付国債（ 2 0 年）	139,000,000	141,660,460	
第 9 7 回 利付国債（ 2 0 年）	171,000,000	174,953,520	
第 9 8 回 利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	132,771,600	
第 9 9 回 利付国債（ 2 0 年）	252,000,000	257,934,600	
第 1 0 0 回 利付国債（ 2 0 年）	181,000,000	186,062,570	
第 1 0 1 回 利付国債（ 2 0 年）	108,000,000	111,512,160	
第 1 0 2 回 利付国債（ 2 0 年）	128,000,000	132,519,680	
第 1 0 3 回 利付国債（ 2 0 年）	116,000,000	119,789,720	
第 1 0 4 回 利付国債（ 2 0 年）	98,000,000	100,708,720	
第 1 0 5 回 利付国債（ 2 0 年）	177,000,000	182,207,340	
第 1 0 6 回 利付国債（ 2 0 年）	112,000,000	115,603,040	
第 1 0 7 回 利付国債（ 2 0 年）	148,000,000	152,567,280	
第 1 0 8 回 利付国債（ 2 0 年）	213,000,000	218,269,620	
第 1 0 9 回 利付国債（ 2 0 年）	155,000,000	158,927,700	
第 1 1 0 回 利付国債（ 2 0 年）	185,000,000	190,905,200	
第 1 1 1 回 利付国債（ 2 0 年）	144,000,000	149,221,440	
第 1 1 2 回 利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	227,220,400	
第 1 1 3 回 利付国債（ 2 0 年）	365,000,000	377,234,800	
第 1 1 4 回 利付国債（ 2 0 年）	241,000,000	249,239,790	
第 1 1 5 回 利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	155,742,000	
第 1 1 6 回 利付国債（ 2 0 年）	189,000,000	196,448,490	

第117回 利付国債（20年）	321,000,000	332,263,890	
第118回 利付国債（20年）	153,000,000	157,798,080	
第119回 利付国債（20年）	140,000,000	143,147,200	
第120回 利付国債（20年）	181,000,000	183,463,410	
第121回 利付国債（20年）	228,000,000	234,162,840	
第122回 利付国債（20年）	69,000,000	70,551,810	
第123回 利付国債（20年）	235,000,000	243,955,850	
第124回 利付国債（20年）	131,000,000	135,368,850	
第125回 利付国債（20年）	144,000,000	150,305,760	
第126回 利付国債（20年）	126,000,000	130,231,080	
第127回 利付国債（20年）	121,000,000	124,430,350	
第128回 利付国債（20年）	219,000,000	225,188,940	
第129回 利付国債（20年）	125,000,000	127,851,250	
第130回 利付国債（20年）	187,000,000	191,185,060	
第131回 利付国債（20年）	93,000,000	94,554,030	
第132回 利付国債（20年）	101,000,000	102,581,660	
第133回 利付国債（20年）	173,000,000	176,728,150	
第134回 利付国債（20年）	148,000,000	151,044,360	
第135回 利付国債（20年）	86,000,000	87,245,280	
第136回 利付国債（20年）	70,000,000	70,587,300	
第137回 利付国債（20年）	105,000,000	106,416,450	
第138回 利付国債（20年）	112,000,000	112,099,680	
第139回 利付国債（20年）	125,000,000	125,898,750	
第140回 利付国債（20年）	286,000,000	289,363,360	
第141回 利付国債（20年）	170,000,000	171,844,500	

第142回 利付国債（20年）	184,000,000	187,232,880	
第143回 利付国債（20年）	286,000,000	286,749,320	
第144回 利付国債（20年）	148,000,000	147,366,560	
第145回 利付国債（20年）	396,000,000	399,080,880	
第146回 利付国債（20年）	321,000,000	323,006,250	
第147回 利付国債（20年）	409,000,000	407,830,260	
第148回 利付国債（20年）	388,000,000	383,177,160	
第149回 利付国債（20年）	410,000,000	403,858,200	
第150回 利付国債（20年）	436,000,000	424,812,240	
第151回 利付国債（20年）	407,000,000	388,697,210	
第152回 利付国債（20年）	386,000,000	367,356,200	
第153回 利付国債（20年）	392,000,000	375,524,240	
第154回 利付国債（20年）	398,000,000	376,324,920	
第155回 利付国債（20年）	408,000,000	376,934,880	
第156回 利付国債（20年）	262,000,000	226,315,600	
第157回 利付国債（20年）	255,000,000	213,988,350	
第158回 利付国債（20年）	375,000,000	323,197,500	
第159回 利付国債（20年）	187,000,000	162,005,580	
第160回 利付国債（20年）	164,000,000	142,794,800	
第161回 利付国債（20年）	166,000,000	141,948,260	
第162回 利付国債（20年）	174,000,000	147,795,600	
第163回 利付国債（20年）	168,000,000	141,738,240	
第164回 利付国債（20年）	323,000,000	267,162,990	
第165回 利付国債（20年）	281,000,000	230,754,390	
第166回 利付国債（20年）	301,000,000	252,039,340	

第167回 利付国債（20年）	331,000,000	267,726,040	
第168回 利付国債（20年）	303,000,000	239,754,810	
第169回 利付国債（20年）	319,000,000	246,606,140	
第170回 利付国債（20年）	287,000,000	219,962,540	
第171回 利付国債（20年）	293,000,000	222,624,330	
第172回 利付国債（20年）	294,000,000	225,074,640	
第173回 利付国債（20年）	359,000,000	272,481,000	
第174回 利付国債（20年）	364,000,000	273,888,160	
第175回 利付国債（20年）	341,000,000	258,665,550	
第176回 利付国債（20年）	310,000,000	233,287,400	
第177回 利付国債（20年）	315,000,000	231,115,500	
第178回 利付国債（20年）	317,000,000	234,709,970	
第179回 利付国債（20年）	338,000,000	248,362,400	
第180回 利付国債（20年）	312,000,000	239,934,240	
第181回 利付国債（20年）	328,000,000	254,839,600	
第182回 利付国債（20年）	304,000,000	242,795,680	
第183回 利付国債（20年）	310,000,000	258,806,600	
第184回 利付国債（20年）	309,000,000	243,875,160	
第185回 利付国債（20年）	312,000,000	244,760,880	
第186回 利付国債（20年）	316,000,000	264,002,200	
第187回 利付国債（20年）	249,000,000	199,966,920	
第188回 利付国債（20年）	248,000,000	208,421,680	
第189回 利付国債（20年）	245,000,000	215,288,850	
第190回 利付国債（20年）	249,000,000	214,334,220	
第191回 利付国債（20年）	256,000,000	227,000,320	

	第192回 利付国債（20年）	254,000,000	239,306,100	
	第193回 利付国債（20年）	206,000,000	196,445,720	
	第194回 利付国債（20年）	79,000,000	77,498,210	
国債証券 合計		74,038,000,000	66,308,008,500	
地方債証券	第14回 東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,815,600	
	第34回 東京都公募公債（20年）	100,000,000	85,046,300	
	第30回 神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	93,129,700	
	第448回 大阪府公募公債	38,000,000	36,156,430	
	第455回 大阪府公募公債	180,000,000	170,288,640	
	第7回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	101,735,300	
	第11回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	99,612,000	
	第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	96,875,700	
	平成29年度第5回 京都府公募公債（20年）	100,000,000	84,252,200	
	第15回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	100,051,700	
	第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	97,881,400	
	平成26年度第11回 愛知県公募公債（15年）	100,000,000	98,678,800	
	令和4年度第3回 愛知県公募公債	200,000,000	183,879,600	
	平成20年度第1回 福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,019,500	
	平成24年度第2回 福岡県公募公債（20年）	100,000,000	99,995,100	
	令和4年度第1回 千葉県公募公債	300,000,000	275,906,700	
	令和2年度第2回 大分県公募公債	200,000,000	187,671,400	
	第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	84,397,500	
	第1回 名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	105,435,000	
	第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	100,593,800	
	第26回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	100,699,700	
	第31回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	93,863,700	
	第9回 川崎市公募公債（20年）	100,000,000	103,337,600	

	第4回 川崎市公募公債（30年）	100,000,000	93,190,100	
	第10回 北九州市公募公債（20年）	100,000,000	103,182,900	
	平成30年度第5回 広島市公募公債	200,000,000	193,987,800	
	平成29年度第1回 仙台市公募公債	100,000,000	83,682,600	
	令和2年度第1回 山梨県公募公債（10年）	100,000,000	93,835,700	
地方債証券 合計		3,318,000,000	3,173,202,470	
特殊債券	第9回 新関西国際空港	300,000,000	299,617,200	
	第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,491,300	
	第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,284,400	
	第205回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,589,700	
	第212回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,081,800	
	第233回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,853,300	
	第278回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	83,605,400	
	第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	83,966,600	
	第316回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	84,017,300	
	第319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	84,432,200	
	第17回 地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	203,083,800	
	第31回 地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	99,511,200	
	第36回 地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	97,656,900	
	第1回 地方公共団体金融機構債券（30年）	100,000,000	84,361,800	
	第116回 政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	133,423,920	
	第120回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,607,100	
	第136回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	187,420,800	
	第72回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	97,520,400	
	第97回 都市再生債券	100,000,000	98,732,400	
	第33回 政保中部国際空港債券	100,000,000	98,204,500	
	第59回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	204,283,200	

	第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,949,300	
	第183回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,644,600	
	第37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,901,000	15,005,307	
	第42回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,386,000	38,067,396	
	第46回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,581,000	44,130,120	
	第54回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,802,000	36,669,512	
	第55回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,206,000	40,814,543	
	第60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,558,000	41,974,954	
	第61回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,546,000	21,153,862	
	第62回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,040,000	191,936,664	
	第63回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,340,000	115,437,582	
	第73回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,730,000	84,119,427	
	第78回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,634,000	72,215,858	
	第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,492,000	147,144,063	
	第175回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,478,000	134,460,765	
	第394回 利付信金中金債券	100,000,000	98,159,800	
	第402回 利付信金中金債券	200,000,000	195,395,600	
	第407回 利付信金中金債券	200,000,000	195,268,000	
	第66回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,198,400	
	第99回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	85,571,200	
特殊債券 合計		4,587,694,000	4,381,062,173	
社債券	第38回 成田国際空港	200,000,000	187,296,800	
	第13回 日本たばこ産業	100,000,000	97,328,600	
	第6回 日本プロロジスリート投資法人	300,000,000	275,180,100	
	第8回 クラレ	100,000,000	97,541,500	
	第12回 旭化成	300,000,000	285,972,300	
	第4回 日本酸素ホールディングス	200,000,000	195,418,200	
	第5回 電通グループ	400,000,000	394,511,200	
	第2回 アステラス製薬	100,000,000	98,344,500	
	第113回 丸紅	400,000,000	371,648,400	
	第24回 リソナホールディングス	300,000,000	295,633,500	

第2回 みずほリース	300,000,000	284,937,300	
第18回 NTTファイナンス	100,000,000	93,636,500	
第26回 NTTファイナンス （グリーンボンド）	100,000,000	91,168,500	
第78回 トヨタファイナンス	100,000,000	98,575,500	
第17回 三井住友ファイナンス &リース	100,000,000	98,097,800	
第132回 三菱地所	100,000,000	95,121,200	
第7回 野村不動産オフィス ファンド投資法人	200,000,000	206,373,200	
第106回 東日本旅客鉄道	100,000,000	91,144,000	
第3回 東日本旅客鉄道（サステナ ビリティボンド）	300,000,000	274,205,400	
第32回 東海旅客鉄道	200,000,000	204,125,600	
第8回 東京地下鉄	100,000,000	102,296,400	
第510回 関西電力	100,000,000	98,853,700	
第518回 関西電力	100,000,000	97,764,600	
第47回 大阪瓦斯（トランジ ションボンド）	100,000,000	91,874,800	
第8回 ファーストリテイリン グ	100,000,000	82,858,300	
社債券 合計	4,500,000,000	4,309,907,900	
合計		78,172,181,043	

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）

2025年11月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	194,327,611
コール・ローン	972,234,868
投資証券	40,347,676,500
派生商品評価勘定	39,031,730
未収入金	7,644,960
未収配当金	293,834,446
差入委託証拠金	54,492,772
流動資産合計	41,909,242,887
資産合計	41,909,242,887
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,366,460
前受金	37,833,500
未払金	209,029,792
未払解約金	134,588,403
流動負債合計	384,818,155
負債合計	384,818,155
純資産の部	
元本等	

元本	18,601,877,404
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,922,547,328
元本等合計	41,524,424,732
純資産合計	41,524,424,732
負債純資産合計	41,909,242,887

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年11月21日 至 2025年11月20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. 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	2025年11月20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	17,100,771,249円
同期中追加設定元本額	7,728,469,310円
同期中一部解約元本額	6,227,363,155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）	52,816,964円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	810,057,880円
ニッセイJリートインデックスファンド＜購入・換金手数料なし＞	9,374,111,964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）	1,515,944,246円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	3,774,044,773円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	2,723,235,626円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	218,718,698円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	31,506,270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）	9,401,378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）	20,242,489円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	53,490,776円
FWニッセイ国内リートインデックス	18,306,340円
計	18,601,877,404円
2. 受益権の総数	18,601,877,404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 2024年11月21日 至 2025年11月20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、不動産投信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、不動産投資信託証券の価格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	2025年11月20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	2025年11月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資証券		342,463,496
合計		342,463,496

（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（2025年11月13日から2025年11月20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）

不動産投信関連

種類	2025年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,141,967,500	-	1,177,698,000	35,730,500
合計	1,141,967,500	-	1,177,698,000	35,730,500

（注）不動産投信指数先物取引

１．時価の算定方法

不動産投信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．不動産投信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）

	2025年11月20日現在
1口当たり純資産額	2.2323円
（1万口当たり純資産額）	(22,323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

2025年11月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	C R E ロジスティクスファンド 投資法人	1,477	237,944,700	
	G L P 投資法人	11,454	1,643,649,000	
	K D X 不動産投資法人	10,150	1,785,385,000	
	N T T 都市開発リート投資法人	3,505	485,793,000	
	O n e リート投資法人	1,720	155,488,000	
	S O S I L A 物流リート投資法人	1,737	214,519,500	
	いちごオフィスリート投資法人	2,540	248,412,000	
	いちごホテルリート投資法人	576	73,612,800	
	アクティビア・プロパティーズ 投資法人	5,374	766,869,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,168	1,204,224,000	
	イオンリート投資法人	4,227	567,263,400	
	インヴィンシブル投資法人	19,215	1,241,289,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	770	96,558,000	
	オリックス不動産投資法人	13,872	1,459,334,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,443	336,401,100	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	1,765	582,450,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	964	113,752,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,115	112,392,000	
	ザイマックス・リート投資法人	565	66,105,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	12,809	1,081,079,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,919	432,012,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	17,878	2,377,774,000	
	スターアジア不動産投資法人	6,415	397,088,500	
	スターツプロシード投資法人	582	118,844,400	
	タカラレーベン不動産投資法人	2,289	214,937,100	
	トーセイ・リート投資法人	757	111,960,300	
	ヒューリックリート投資法人	3,076	532,455,600	
	フロンティア不動産投資法人	6,118	564,079,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	903	106,915,200	
	マリモ地方創生リート投資法人	637	72,299,500	

ユナイテッド・アーバン投資法人	7,696	1,406,059,200	
ラサールロジポート投資法人	4,513	689,586,400	
霞ヶ関ホテルリート投資法人	433	44,815,500	
阪急阪神リート投資法人	1,660	289,670,000	
三井不動産アコモデーション ファンド投資法人	6,010	792,719,000	
三井不動産ロジスティクスパー ク投資法人	7,686	906,948,000	
三菱地所物流リート投資法人	3,545	454,823,500	
産業ファンド投資法人	6,373	941,292,100	
森トラストリート投資法人	6,710	523,380,000	
森ヒルズリート投資法人	4,029	593,068,800	
星野リゾート・リート投資法人	1,399	348,071,200	
積水ハウス・リート投資法人	10,398	823,521,600	
大和ハウスリート投資法人	10,959	1,509,054,300	
大和証券オフィス投資法人	1,422	541,782,000	
大和証券リビング投資法人	5,097	582,077,400	
投資法人みらい	4,793	238,691,400	
東海道リート投資法人	717	83,100,300	
東急リアル・エステート投資法 人	2,295	462,442,500	
日本ビルファンド投資法人	20,650	3,016,965,000	
日本プライムリアルティ投資法 人	9,414	982,821,600	
日本プロロジスリート投資法人	17,919	1,668,258,900	
日本ホテル&レジデンシャル投 資法人	743	59,885,800	
日本リート投資法人	4,444	448,844,000	
日本ロジスティクスファンド投 資法人	6,901	706,662,400	
日本都市ファンド投資法人	18,075	2,178,037,500	
福岡リート投資法人	1,965	371,974,500	
平和不動産リート投資法人	2,673	420,997,500	
野村不動産マスターファンド投 資法人	11,092	1,861,237,600	
投資証券 合計	324,631	40,347,676,500	
合計		40,347,676,500	

（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

「（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。

中間財務諸表

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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（2025年11月21日から2026年5月20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8期 2025年11月20日現在	第9期中間計算期間 2026年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	70,906	13,040
コール・ローン	354,748	455,111
親投資信託受益証券	299,277,341	324,893,294
未収入金	1,319,281	727,305
流動資産合計	301,022,276	326,088,750
資産合計	301,022,276	326,088,750
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,306,468	713,366
未払受託者報酬	34,243	37,665
未払委託者報酬	405,296	445,577
その他未払費用	1,477	1,629
流動負債合計	1,747,484	1,198,237
負債合計	1,747,484	1,198,237
純資産の部		
元本等		
元本	263,058,207	292,334,148
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（　）	36,216,585	32,556,365
（分配準備積立金）	9,650,679	8,378,136
元本等合計	299,274,792	324,890,513
純資産合計	299,274,792	324,890,513
負債純資産合計	301,022,276	326,088,750

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自 2024年11月21日 至 2025年5月20日	第9期中間計算期間 自 2025年11月21日 至 2026年5月20日
営業収益		
受取利息	295	660
有価証券売買等損益	3,164,513	7,286,728
営業収益合計	3,164,218	7,286,068
営業費用		
受託者報酬	30,276	37,665
委託者報酬	358,289	445,577
その他費用	7,464	1,629
営業費用合計	396,029	484,871
営業利益又は営業損失（ ）	3,560,247	7,770,939
経常利益又は経常損失（ ）	3,560,247	7,770,939
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,560,247	7,770,939
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（ ）	171,248	92,536
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	22,639,805	36,216,585
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,180,259	9,550,415
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	5,180,259	9,550,415
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,027,496	5,347,160
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,027,496	5,347,160
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（ ）	21,403,569	32,556,365

（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9期中間計算期間 自 2025年11月21日 至 2026年5月20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。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第8期 2025年11月20日現在	第9期中間計算期間 2026年5月20日現在
1. 期首元本額	219,659,352円	263,058,207円
期中追加設定元本額	118,447,187円	67,998,465円
期中一部解約元本額	75,048,332円	38,722,524円
2. 受益権の総数	263,058,207口	292,334,148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8期 2025年11月20日現在	第9期中間計算期間 2026年5月20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す。	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す。
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8期 2025年11月20日現在	第9期中間計算期間 2026年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1377円 (11,377円)	1.1114円 (11,114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」- R E I Tインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2026年5月20日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	336,882,557
コール・ローン	11,757,441,441
株式	428,514,946,480
派生商品評価勘定	549,451,300
未収入金	9,451,080
未収配当金	4,222,220,295
差入委託証拠金	996,860,831
流動資産合計	446,387,253,984
資産合計	446,387,253,984
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,883,000
前受金	831,747,000
未払解約金	688,956,725
流動負債合計	1,563,586,725
負債合計	1,563,586,725
純資産の部	
元本等	
元本	93,593,281,742
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	351,230,385,517
元本等合計	444,823,667,259
純資産合計	444,823,667,259
負債純資産合計	446,387,253,984

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年11月21日 至 2026年5月20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	2026年5月20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	89,173,079,217円
同期中追加設定元本額	13,569,311,138円
同期中一部解約元本額	9,149,108,613円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	4,611,267,238円
ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）	2,759,963,198円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,795,334,545円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,145,131,383円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	7,036,946,350円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	1,314,499円
ニッセイインデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	8,075,798円
ニッセイインデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	5,084,140円
DCニッセイ国内株式インデックス	9,822,566,124円
ニッセイTOPIXインデックスファンド＜購入・換金手数料なし＞	26,476,064,327円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	6,178,929,071円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	551,967,918円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	225,240,839円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	653,066,036円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	620,418,176円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	116,360,257円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	19,558,816円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	17,652,824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）	5,039,587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）	10,592,472円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	29,139,388円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	468,420,703円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	366,480,844円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	590,630,798円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	150,032,566円
ニッセイ国内株式市場連動S Aファンド（適格機関投資家限定）	23,111,611,843円
ニッセイ世界株式ファンド（GDP型バスケット）＜購入・換金手数料なし＞	33,253,141円
FWニッセイ国内株インデックス	90,190,213円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	329,009,252円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	168,092,335円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	55,011,574円
ニッセイインデックスバランス（外国株式重視型）S A（適格機関投資家限定）	12,061,805円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトS A（適格機関投資家限定）	18,260,760円
ニッセイ国内株式インデックス（特金専用）（適格機関投資家限定）	110,512,922円
計	93,593,281,742円
2. 受益権の総数	93,593,281,742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	2026年5月20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	2026年5月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	15,922,263,000	-	16,429,070,000	506,807,000
合計	15,922,263,000	-	16,429,070,000	506,807,000

（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）

	2026年5月20日現在
1口当たり純資産額	4.7527円
（1万口当たり純資産額）	（47,527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）

2026年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	16,314,812
コール・ローン	569,398,573
国債証券	64,461,220,780
地方債証券	3,033,016,572
特殊債券	4,160,999,997
社債券	4,237,833,700
未収利息	242,458,679
前払費用	13,264,081
流動資産合計	76,734,507,194
資産合計	
76,734,507,194	
負債の部	
流動負債	
未払金	368,547,440
未払解約金	115,820,519
流動負債合計	484,367,959
負債合計	
484,367,959	
純資産の部	
元本等	
元本	92,704,501,527
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,454,362,292
元本等合計	76,250,139,235
純資産合計	76,250,139,235
負債純資産合計	76,734,507,194

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年11月21日 至 2026年5月20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	2026年5月20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	91,373,867,238円
同期中追加設定元本額	10,608,735,039円
同期中一部解約元本額	9,278,100,750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）	48,296,049,467円
DCニッセイ日本債券インデックス	7,578,984,572円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	978,596,624円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	15,075,586,868円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	1,860,620,709円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	7,949,000,649円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	645,703,981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）	70,378,899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）	275,825,741円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	162,780,667円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	615,569,303円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	836,169,321円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	2,396,141,842円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	5,585,371,923円
FWニッセイ国内債インデックス	50,792,084円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	282,330,243円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	43,428,085円
ニッセイ国内債券インデックス（特金専用）（適格機関投資家限定）	1,170,549円
計	92,704,501,527円
2. 受益権の総数	92,704,501,527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16,454,362,292円です。

（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	2026年5月20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）

	2026年5月20日現在
1口当たり純資産額	0.8225円
（1万口当たり純資産額）	(8,225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）

	2026年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	22,121,050
コール・ローン	772,040,408
投資証券	37,745,684,400
未収配当金	365,174,355
前払金	61,960,000
差入委託証拠金	45,156,943
流動資産合計	39,012,137,156
資産合計	39,012,137,156
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	74,739,580
未払解約金	173,080,591
流動負債合計	247,820,171
負債合計	247,820,171
純資産の部	
元本等	
元本	18,687,021,121
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	20,077,295,864
元本等合計	38,764,316,985
純資産合計	38,764,316,985
負債純資産合計	39,012,137,156

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年11月21日 至 2026年5月20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. 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	2026年5月20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	18,601,877,404円
同期中追加設定元本額	3,176,102,646円
同期中一部解約元本額	3,090,958,929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）	166,349,738円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	782,916,539円
ニッセイJリートインデックスファンド＜購入・換金手数料なし＞	9,450,100,916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）	1,487,432,310円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	3,741,766,925円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	2,646,285,274円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	251,201,102円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	38,419,649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）	10,951,468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）	22,986,783円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	63,345,516円
FWニッセイ国内リートインデックス	25,264,901円
計	18,687,021,121円
2. 受益権の総数	18,687,021,121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	2026年5月20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）

不動産投信関連

種類	2026年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	1,115,943,000	-	1,041,267,000	74,676,000
合計	1,115,943,000	-	1,041,267,000	74,676,000

（注）不動産投信指数先物取引

1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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）

	2026年5月20日現在
1口当たり純資産額	2.0744円
（1万口当たり純資産額）	（20,744円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2026年5月29日現在

資産総額	330,031,974円
負債総額	693,983円
純資産総額（ - ）	329,337,991円
発行済数量	291,957,006口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1280円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2026年5月29日現在

資産総額	471,999,828,156円
負債総額	6,828,603,182円
純資産総額（ - ）	465,171,224,974円
発行済数量	93,768,797,741口
1口当たり純資産額（ / ）	4.9608円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2026年5月29日現在

資産総額	79,557,991,111円
負債総額	2,320,321,526円
純資産総額（ - ）	77,237,669,585円
発行済数量	92,904,076,897口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8314円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2026年5月29日現在

資産総額	39,339,552,001円
負債総額	291,774,763円
純資産総額（ - ）	39,047,777,238円
発行済数量	18,729,351,761口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0848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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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

2026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。

2026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	401	95,986
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	139	19,530
単位型公社債投資信託	0	0
合計	540	115,516

- 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31期事業年度（自2025年4月1日 至 2026年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2025年3月31日)		当事業年度 (2026年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		22,854,185		28,020,875
有価証券		8,572,194		9,852,298
前払費用		658,467		652,908
未収委託者報酬		7,296,469		8,383,760
未収運用受託報酬		7,995,592		12,147,819
未収投資助言報酬		283,590		314,308
その他		44,991		54,414
流動資産合計		47,705,492		59,426,385
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	150,025	1	369,295
車両	1	0	1	0
器具備品	1	66,448	1	111,772
有形固定資産合計		216,474		481,067
無形固定資産				
ソフトウェア		3,280,169		3,504,032
ソフトウェア仮勘定		849,779		644,444
その他		8,013		540
無形固定資産合計		4,137,963		4,149,017
投資その他の資産				
投資有価証券		45,045,217		43,104,360
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		10,950		1,259
差入保証金		355,422		540,497
繰延税金資産		1,773,861		1,802,229
その他		34,973		30,536
投資その他の資産合計		47,286,649		45,545,106
固定資産合計		51,641,087		50,175,190
資産合計		99,346,580		109,601,575

負債の部

流動負債

預り金	63,906	66,817
未払収益分配金	6,131	2,745
未払手数料	2,657,754	3,066,717
未払運用委託報酬	4,710,021	10,176,381
未払投資助言報酬	968,972	1,147,842
その他未払金	1,016,371	1,275,441
未払費用	196,870	218,644
未払法人税等	4,057,802	5,059,428
未払消費税等	701,846	1,253,474
賞与引当金	1,395,185	1,557,662
その他	24,296	36,970
流動負債合計	15,799,159	23,862,126

固定負債

長期未払金	11,975	13,619
退職給付引当金	2,576,216	2,656,245
資産除去債務	-	239,806
その他	-	22,141

固定負債合計	2,588,191	2,931,812
--------	-----------	-----------

負債合計	18,387,350	26,793,938
------	------------	------------

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	62,659,698	64,235,360
---------	------------	------------

利益剰余金合計	63,339,505	64,915,167
---------	------------	------------

株主資本合計	81,621,345	83,197,007
--------	------------	------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	400,087	191,078
--------------	---------	---------

繰延ヘッジ損益	262,029	198,291
---------	---------	---------

評価・換算差額等合計	662,116	389,369
------------	---------	---------

純資産合計	80,959,229	82,807,637
-------	------------	------------

負債・純資産合計	99,346,580	109,601,575
----------	------------	-------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	31,456,939	32,105,384
運用受託報酬	26,331,034	35,422,867
投資助言報酬	1,238,881	1,252,739
その他営業収益	10,956	42,217
営業収益計	59,037,813	68,823,209
営業費用		
支払手数料	11,805,264	12,408,706
広告宣伝費	80,550	85,839
公告費	625	-
調査費	16,210,069	22,394,854
支払運用委託報酬	9,615,456	15,294,098
支払投資助言報酬	3,870,774	4,308,431
委託調査費	168,932	154,417
調査費	2,554,905	2,637,907
委託計算費	301,022	301,300
営業雑経費	1,216,684	1,398,756
通信費	68,975	65,608
印刷費	163,162	160,610
協会費	37,581	36,127
その他営業雑経費	946,964	1,136,410
営業費用計	29,614,216	36,589,457
一般管理費		
役員報酬	289,676	321,290
給料・手当	5,718,948	6,026,361
賞与引当金繰入額	1,394,643	1,553,691
賞与	339,838	264,953
福利厚生費	1,179,383	1,198,393
退職給付費用	476,160	457,111
役員退職慰労引当金繰入額	1,937	-
役員退職慰労金	575	-
その他人件費	191,598	174,977
不動産賃借料	800,728	821,272
その他不動産経費	33,242	33,935
交際費	29,941	37,232
旅費交通費	173,926	243,186
固定資産減価償却費	976,601	1,220,226
租税公課	390,131	430,855
業務委託費	461,373	430,107
器具備品費	998,175	1,013,203
保険料	45,554	51,164
寄付金	10,171	1,997
諸経費	428,756	491,252
一般管理費計	13,941,364	14,771,215
営業利益	15,482,231	17,462,537

営業外収益				
受取利息		4,078	21,388	
有価証券利息		98,927	124,809	
受取配当金	1	41,227	1	55,180
その他営業外収益		38,594		26,633
営業外収益計		182,828		228,013
営業外費用				
為替差損		20,890		25,514
金融派生商品費用		136,943		150,784
控除対象外消費税		14,014		10,959
その他営業外費用		952		1,060
営業外費用計		172,801		188,319
経常利益		15,492,258		17,502,230
特別利益				
投資有価証券売却益		182,453		200,899
投資有価証券償還益		277		25,578
特別利益計		182,731		226,478
特別損失				
投資有価証券売却損		187,500		68,029
投資有価証券償還損		397,772		145,313
固定資産売却損		211		-
固定資産除却損	2	773	2	10,003
事故損失賠償金		-	3	46
特別損失計		586,258		223,393
税引前当期純利益		15,088,731		17,505,315
法人税、住民税及び事業税		4,513,024		5,459,991
法人税等調整額		46,562		152,710
法人税等合計		4,466,462		5,307,281
当期純利益		10,622,269		12,198,034

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2024年4月1日 至2025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	60,488,508	61,168,315	79,450,155
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	46,146	46,146	46,146
遡及処理後当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,534,655	61,214,462	79,496,302
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	8,497,226	8,497,226	8,497,226
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,622,269	10,622,269	10,622,269
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,125,043	2,125,043	2,125,043
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	62,659,698	63,339,505	81,621,345

	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	484,519	329,920	814,439	78,635,715
会計方針の変更による累積的影響額	46,146	-	46,146	-
遡及処理後当期首残高	530,666	329,920	860,586	78,635,715
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	8,497,226
当期純利益	-	-	-	10,622,269
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	130,578	67,891	198,470	198,470
当期変動額合計	130,578	67,891	198,470	2,323,513
当期末残高	400,087	262,029	662,116	80,959,229

当事業年度(自2025年4月1日 至2026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	62,659,698	63,339,505	81,621,345
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	10,622,373	10,622,373	10,622,373
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	12,198,034	12,198,034	12,198,034
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,575,661	1,575,661	1,575,661
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	64,235,360	64,915,167	83,197,007

	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	400,087	262,029	662,116	80,959,229
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	10,622,373
当期純利益	-	-	-	12,198,034
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	209,008	63,738	272,746	272,746
当期変動額合計	209,008	63,738	272,746	1,848,408
当期末残高	191,078	198,291	389,369	82,807,637

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
1．有価証券の評価基準及び評価方法	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。 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。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	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。 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	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。 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。 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。

5．収益及び費用の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 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。 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。 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。
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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。
7．ヘッジ会計の方法	ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 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。 ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
8．グループ通算制度の適用	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。

（未適用の会計基準等）

- ・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）

1．概要

2016年1月に国際会計基準審議会（IASB）より国際財務報告基準（IFRS）第16号「リース」（以下「IFRS第16号」という。）が公表され、同年2月に米国財務会計基準審議会（FASB）よりFASB Accounting Standards Codification（FASBによる会計基準のコード化体系）のTopic 842「リース」（以下「Topic 842」という。）が公表されました。IFRS第16号及びTopic 842では、借手の会計処理に関して、主に費用配分の方法が異なるものの、原資産の引渡しによりリースの借手に支配が移転した使用权部分に係る資産（使用权資産）と当該移転に伴う負債（リース負債）を計上する使用权モデルにより、オペレーティング・リースも含むすべてのリースについて資産及び負債を計上することとされています。IFRS第16号及びTopic 842の公表により、我が国の会計基準とは、特に負債の認識において違いが生じることとなり、国際的な比較において議論となる可能性があります。

こうした状況への対応として、2024年9月13日に企業会計基準委員会により、リースに関する会計基準、企業会計基準適用指針、実務対応報告及び移管指針が公表されました。

2．適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

3．当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準の適用指針」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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
建物附属設備	363,224千円	375,299千円
車両	6,729	6,729
器具備品	472,611	453,372
計	842,565	835,400

（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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
受取配当金	20,664千円	37,343千円

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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
器具備品	773	2,241
ソフトウェア	-	288
電信加入権	-	71
電話加入権	-	7,402
計	773	10,003

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2024年4月1日 至2025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

2024年6月26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	8,497,226千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	78,353円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月26日

当事業年度（自2025年4月1日 至2026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

2025年6月27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	10,622,373千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	97,949円
基準日	2025年3月31日
効力発生日	2025年6月27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

2026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	12,198,122千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	112,479円
基準日	2026年3月31日
効力発生日	2026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、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（2025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	32,793,713	32,360,235	433,478
その他有価証券	20,823,699	20,823,699	-
資産計	53,617,412	53,183,934	433,478
デリバティブ取引（ ）			
ヘッジ会計が適用されて いるもの	14,098	14,098	-
デリバティブ取引計	14,098	14,098	-

（ ）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（2026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	33,358,659	32,810,304	548,355
その他有価証券	19,597,999	19,597,999	-
資産計	52,956,658	52,408,303	548,355
デリバティブ取引（ ）			
ヘッジ会計が適用されて いるもの	22,141	22,141	-
デリバティブ取引計	22,141	22,141	-

（ ）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 (2025年3月31日)
関係会社株式	66,222

（単位：千円）

区分	当事業年度 (2026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（2025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	-	20,823,699	-	20,823,699
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	14,098	-	14,098
合計	-	20,837,797	-	20,837,797

（ ）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（2026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	64,980	19,533,019	-	19,597,999
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	22,141	-	22,141
合計	64,980	19,510,878	-	19,575,878

（ ）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。

(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（2025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	-	32,360,235	-	32,360,235
合計	-	32,360,235	-	32,360,235

当事業年度（2026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	-	32,810,304	-	32,810,304
合計	-	32,810,304	-	32,810,304

（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

上場投資信託、地方債は相場価格を用いて評価しております。上場投資信託は、市場での取引頻度が高く、活発な市場における相場価格と認められるため、その時価をレベル1の時価に分類しております。一方、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。

市場における取引価格が存在しない投資信託について、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額を時価とし、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(2025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	22,854,185	-	-	-
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	8,570,000	24,280,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	-	-	-	-
その他（注）	2,735,734	16,137,863	1,020,217	-
合計	34,159,920	40,417,863	1,020,217	-

（注）投資信託受益証券であります。

当事業年度(2026年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	28,020,875	-	-	-
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	9,860,000	23,120,000	650,000	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	-	-	-	-
その他（注）	5,814,354	12,837,842	255,752	619,184
合計	43,695,230	35,957,842	905,752	619,184

（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（2025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	497,111	498,590	1,478
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	497,111	498,590	1,478
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	32,296,601	31,861,645	434,956
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	32,296,601	31,861,645	434,956
合計		32,793,713	32,360,235	433,478

当事業年度（2026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	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
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	33,358,659	32,810,304	548,355
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	33,358,659	32,810,304	548,355
合計		33,358,659	32,810,304	548,355

２．その他有価証券

前事業年度（2025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）	6,931,654	6,338,965	592,688
	小計	6,931,654	6,338,965	592,688
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）	13,892,045	15,089,000	1,196,954
	小計	13,892,045	15,089,000	1,196,954
合計		20,823,699	21,427,965	604,265

（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（2026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）	8,399,152	7,576,965	822,187
	小計	8,399,152	7,576,965	822,187
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）	11,198,847	12,308,000	1,109,153
	小計	11,198,847	12,308,000	1,109,153
合計		19,597,999	19,884,965	286,965

（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2024年4月1日 至2025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	3,365,754	-	93,425
(3)その他	5,959,412	182,453	94,075
合計	9,325,167	182,453	187,500

当事業年度（自2025年4月1日 至2026年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	2,288,869	200,899	68,029
合計	2,288,869	200,899	68,029

（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（2025年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2026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（2025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	668,354	-	14,098
合計			668,354	-	14,098

（注１） 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

当事業年度（2026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	471,646	-	22,141
合計			471,646	-	22,141

（注１） 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制適用者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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,284,401 千円	2,298,329 千円
勤務費用	311,827	309,291
利息費用	19,553	34,628
数理計算上の差異の発生額	67,081	134,771
退職給付の支払額	251,223	206,370
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	129,905
その他	851	-
退職給付債務の期末残高	2,298,329	2,431,013

（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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	160,035千円	183,469千円
退職給付費用	17,740	26,564
退職給付の支払額	805	30,860
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	167,172
その他	6,498	-
退職給付引当金の期末残高	183,469	12,000

(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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,481,798千円	2,443,012千円
未認識数理計算上の差異	94,417	213,232
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,576,216	2,656,245
退職給付引当金	2,576,216	2,656,245
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,576,216	2,656,245

(4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	17,740千円	26,564千円
勤務費用	311,827	309,291
利息費用	19,553	34,628
数理計算上の差異の当期費用処理額	2,539	15,956
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	-	37,267
確定給付制度に係る退職給付費用	346,581	317,260

(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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
割引率	1.55 %	2.35 %

3 . 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において84,597千円、当事業年度において86,974千円であり、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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	427,205 千円	490,975 千円
未払事業税	138,469	188,429
退職給付引当金	810,802	837,248
税務上の繰延資産償却超過額	1,670	573
投資有価証券評価差額	414,969	380,173
減価償却超過額	1,121	1,109
資産除去債務	26,147	104,281
その他	153,734	140,267
小計	1,974,120	2,143,058
評価性引当額	7,558	1,106
繰延税金資産合計	1,966,562	2,141,952
繰延税金負債		
特別分配金否認	21,837	26,040
投資有価証券評価差額	170,863	238,095
資産除去債務に対応する除去費用	-	75,586
繰延税金負債合計	192,701	339,723
繰延税金資産（は負債）の純額	1,773,861	1,802,229

- 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、日本生命保険相互会社を通算親会社として、グループ通算制度を適用しております。

これにより、法人税および地方法人税の会計処理またはこれらに関する税効果会計の会計処理は、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（企業会計基準委員会実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従っております。

（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2024年4月1日 至2025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	6,804,755

当事業年度（自2025年4月1日 至2026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	7,527,222

[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 2024年4月1日 至2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至2026年3月31日）
営業収益		
投資信託委託業務	31,456,939	32,105,384
投資運用業務（注）	26,331,034	35,422,867
投資助言業務	1,238,881	1,252,739
その他営業収益	10,956	42,217
計	59,037,813	68,823,209

（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2024年4月1日 至2025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	50,000	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	6,751,148	未収運用受託報酬	1,728,378
								投資助言報酬の受取	117,115	未収投資助言報酬	10,644
								グループ通算に伴う支払	117,888	その他未払金	117,888

当事業年度（自2025年4月1日 至2026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	50,000	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	7,411,895	未収運用受託報酬	2,010,021
								投資助言報酬の受取	115,327	未収投資助言報酬	10,324
								グループ通算に伴う支払	125,161	その他未払金	125,161

- （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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
１株当たり純資産額	746,525円79銭	763,569円98銭
１株当たり当期純利益金額	97,948円4銭	112,478円19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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
当期純利益	10,622,269千円	12,198,034千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	10,622,269千円	12,198,034千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第 2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

（ 1 ）受託会社

a . 名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

b . 資本金の額

2026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

2026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：2026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
安藤証券株式会社	2,280	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。
三菱UFJ eスマート証券株式会社	7,196	
株式会社SBI証券	54,323	
光世証券株式会社	12,000	
株式会社スマートプラス ¹	300	
楽天証券株式会社	19,495	
内藤証券株式会社	3,002	
moomoo証券株式会社	6,808	
SMB C日興証券株式会社	135,000	
マネックス証券株式会社	13,195	
松井証券株式会社	11,945	
日本生命保険相互会社 ²	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。
ニッセイアセットマネジメント株式会社 ³	10,000	金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。

- 1 ニッセイアセットマネジメント株式会社と協働で業務を行うにあたり、ファンドの募集の取扱いおよび契約締結行為等を行います。
- 2 株式会社スマートプラスとニッセイアセットマネジメント株式会社が協働で業務を行うにあたり、ファンドの募集の取扱いを行います（契約締結行為等はいりません）。
- 3 株式会社スマートプラスと協働で業務を行うにあたり、ファンドの募集を行います（契約締結行為等はいりません）。

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 【資本関係】

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

- 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

2026年5月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山口 圭 介

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鈴木 健 嗣

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2025年4月1日から2026年3月31日までの第31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2026年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定（社会的影響度の高い事業体の財務諸表監査に適用される規定を含む。）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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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．上記の監査報告書の原本は当社（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

2026年2月18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2024年11月21日から2025年11月20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2025年11月20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

2026年8月18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2025年11月21日から2026年5月20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2026年5月20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（2025年11月21日から2026年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

1．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。