

## 【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】	2018年5月21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 西 啓介
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型） DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）
【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】	継続募集額 各ファンドにつき以下を上限とします。 DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） 1兆円 DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型） 1兆円 DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型） 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】

- DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）
- DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）
- DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」または「DCニッセイワールドセレクトファンド」といいます。また、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）を「債券重視型」、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）を「標準型」、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）を「株式重視型」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。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：2018年5月22日（火）～ 2018年11月21日（水）

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

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

## ( 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

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

## ( 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】

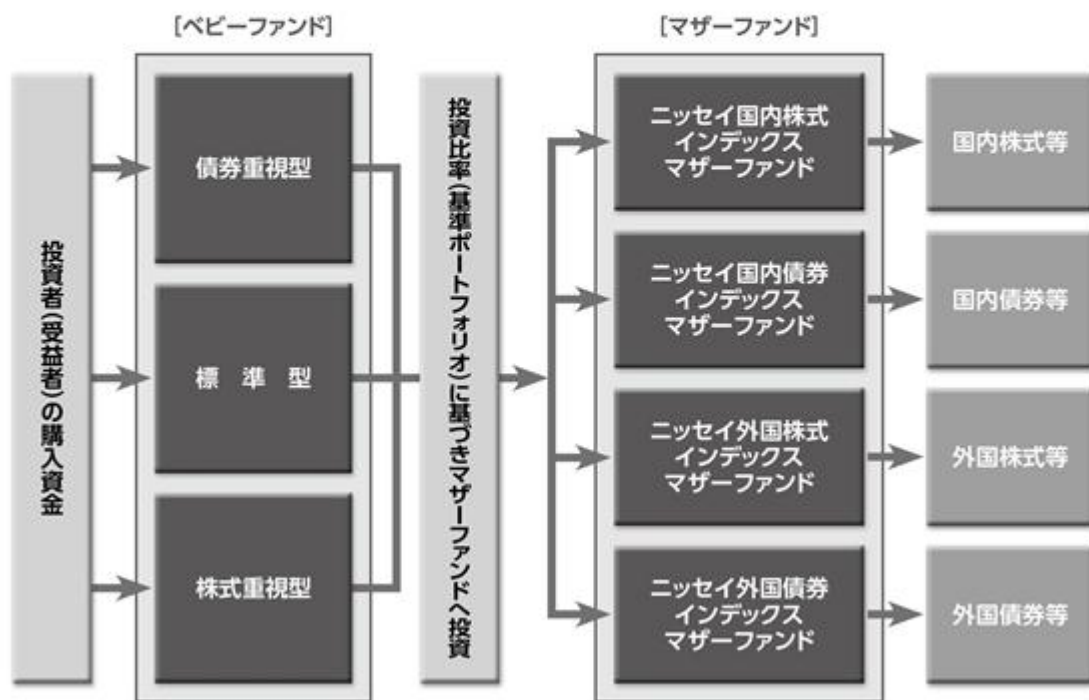
###### 基本方針

ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標に運用を行います。

###### ファンドの特色

#### ■ マザーファンドを通じて、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券に投資します。

- 各ファンドは「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。



- 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。

## 2 主要投資対象とする4つのマザーファンドを通じて、バランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることをめざします。

### ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド(以下「国内株式インデックス」ということがあります)

国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)<sup>\*1</sup>(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド(以下「国内債券インデックス」ということがあります)

国内の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合<sup>\*2</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(以下「外国株式インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)<sup>\*3</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド(以下「外国債券インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)<sup>\*4</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

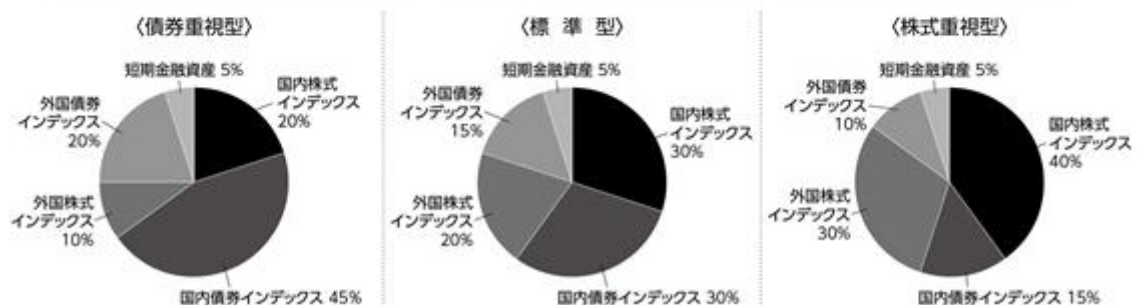
※1 TOPIX(東証株価指数)は、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの高標または商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの高標もしくは使用の停止を行うことができます。

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

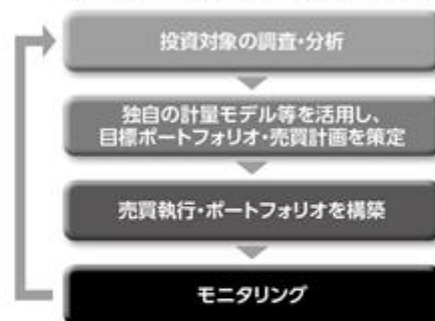
※3 MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

※4 FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

●運用にあたっては、以下の各マザーファンドへの投資比率(基準ポートフォリオ)を基本とします。



### 〈各マザーファンドの運用プロセス〉



●基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、ファンドの購入または換金等にともなう資金フローの影響により、一時的に基準ポートフォリオの配分から乖離する場合があります。

### <MSCI 指数にかかる免責条項等>

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売または宣伝するものではありません。MSCI 指数は、MSCI Inc. が独占的に所有しています。MSCI Inc. およびMSCI 指数は、MSCI Inc. およびその関係会社のサービスマークであり、ニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます）は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc. とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI 指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc. により決定、作成および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI 指数の決定、作成あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc. は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI 指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI 指数またはそれに含まれるいかなるデータの獨創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約に基づき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI 指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI 指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI 指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc. の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc. に問合せることなく、当ファンドを保証、推奨、売買または宣伝するためにいかなるMSCI Inc. のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc. の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc. との関係は一切主張することはできません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

### 信託金の上限

各ファンドにつき、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 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 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)
単 位 型	国 内	株 式
追 加 型	海 外	債 券
	内 外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本含む)		
債券 一般	年2回	日 本	ファミリー ファンド	あ り ( )
公債	年4回	北 米		
社債	年6回 (隔月)	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア		
不動産投信	日 々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・債券) 資産配分固定型))	日 々	中 南 米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
資産複合 ( )	その他 ( )	アフリカ		
資産配分固定型		中近東 (中東)		
資産配分変更型		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。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の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。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・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、主として株式および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。
グローバル (日本含む)	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を含む世界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。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

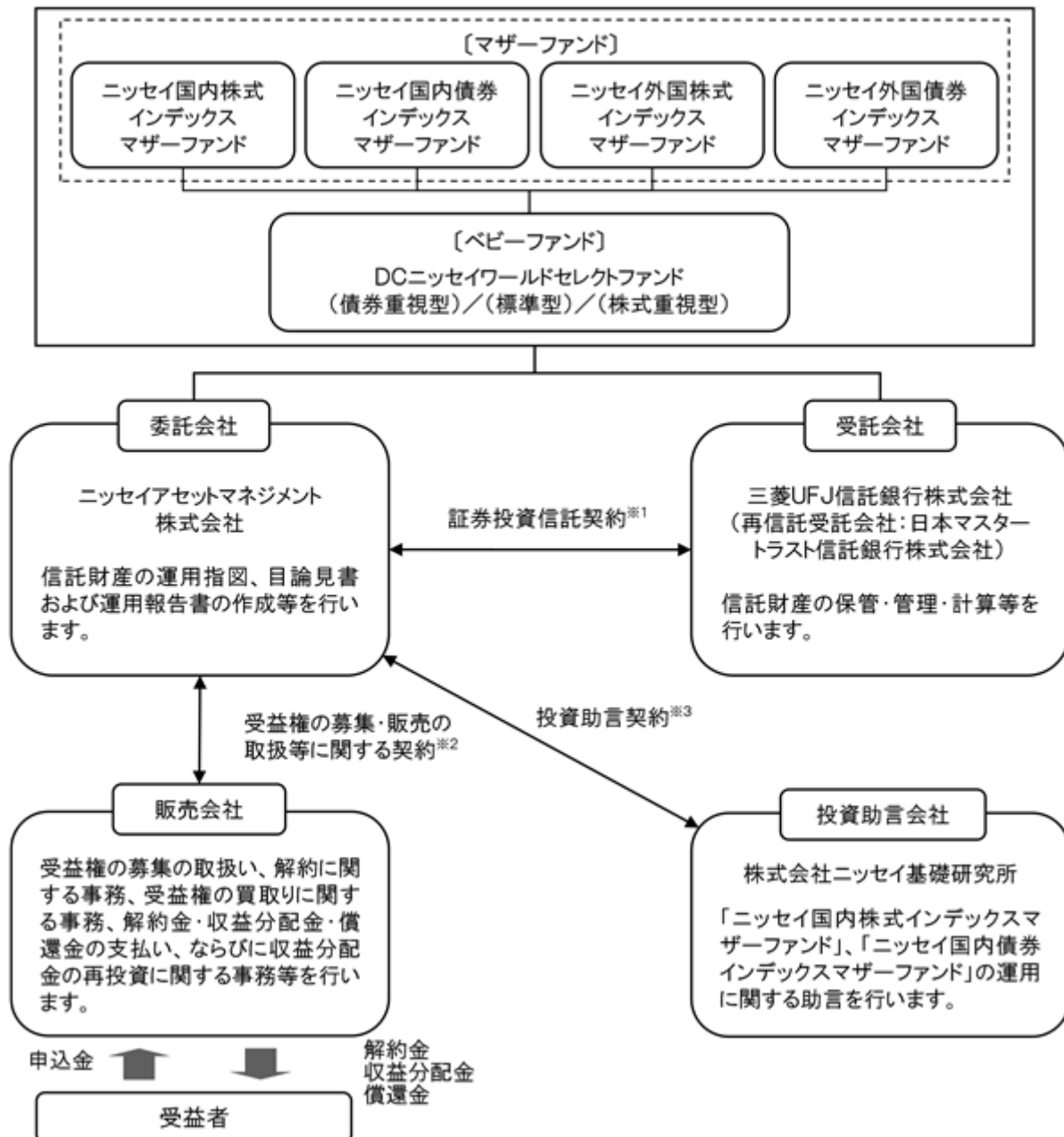
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、  
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

- 2003年1月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始
- 2014年3月7日 ファンドの仕組みをファンド・オブ・ファンズ方式から、ファミリーファンド方式へ変更し、購入・換金の際に適用される基準価額を購入・換金申込受付日の翌々営業日から翌営業日へ変更、換金代金の支払開始日を換金申込受付日から起算して、原則として6営業日目から5営業日目へと短縮する変更、および実質的な運用管理費用(信託報酬)の料率(年率)を引下げ



## (3) 【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

## 委託会社の概況（2018年3月25日現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 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
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 西 啓介
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 1995年4月4日
7. 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。

## 8. 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】

下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	債券重視型	標準型	株式重視型
国内株式インデックス	20%	30%	40%
国内債券インデックス	45%	30%	15%
外国株式インデックス	10%	20%	30%
外国債券インデックス	20%	15%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

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。

## （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。

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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

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

## ニッセイ外国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、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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）および外国為替予約取引は、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、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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%以内とします。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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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割合には、制限を設けません。

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）および外国為替予約取引は、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、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。また、各マザーファンドはそれぞれ下記の指数の動き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  
...TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド  
...NOMURA-BPI総合
- ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド  
...MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
- ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド  
...FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権(イ. およびニ. に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ. 約束手形(イ. に掲げるものを除きます)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

## イ. 為替手形

## 有価証券

主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」(以下「マザーファンド」といいます)のほか、次の1. から22. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます)に投資します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます)の新株引受権証券を除きます)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます)

14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの  
 なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品

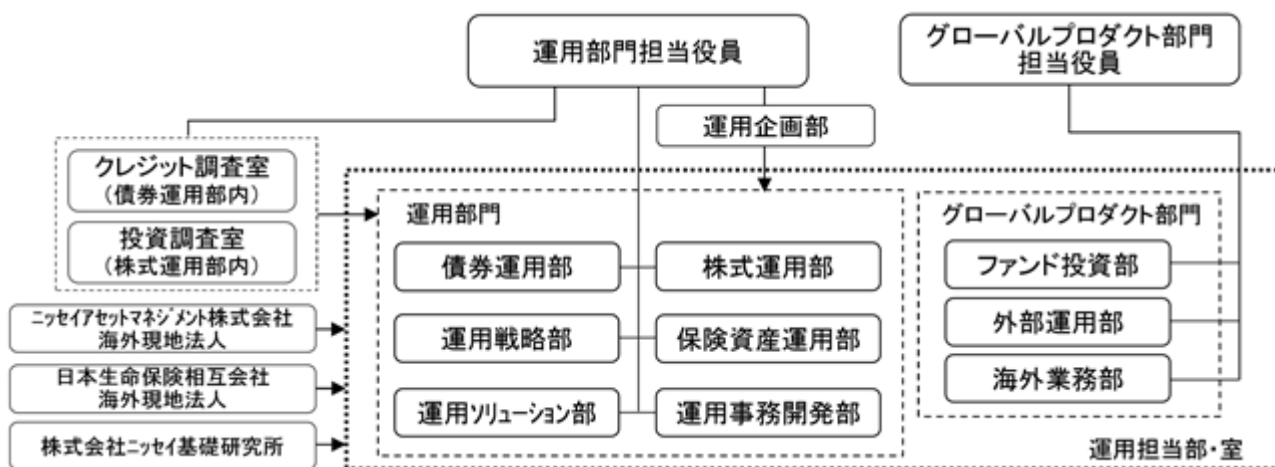
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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 の1.から4.までに掲げる金融商品により運用することができます。

### （3）【運用体制】

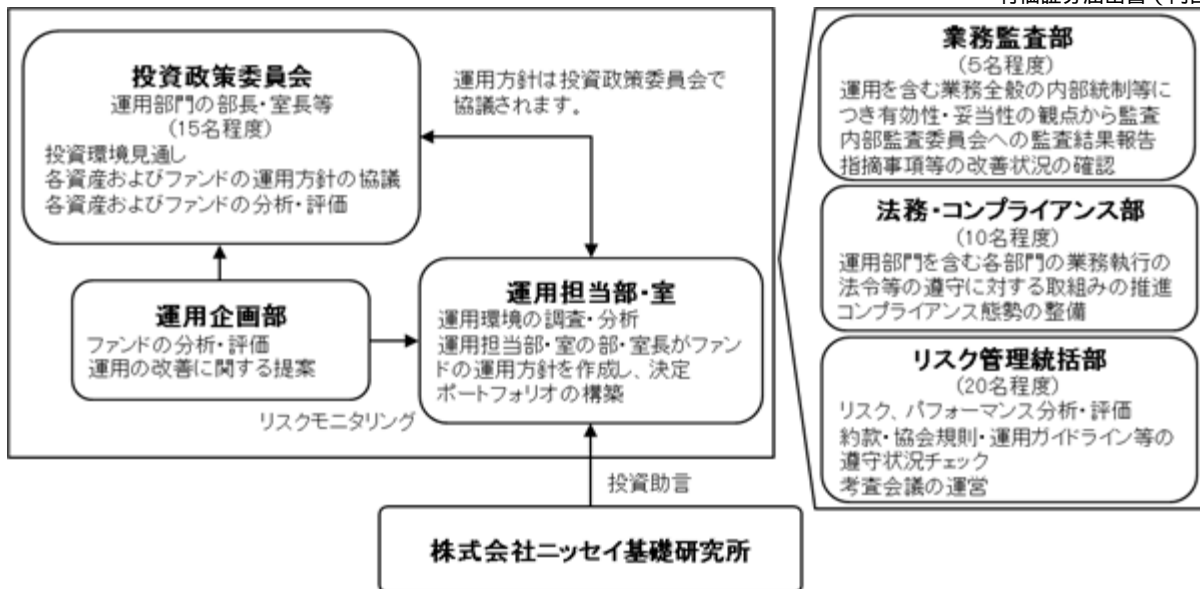
#### 委託会社の組織体制



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

#### 内部管理体制および意思決定を監督する組織





< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
2. 分配対象額についての分配方針  
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
3. 留保益の運用方針  
特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配時期

毎決算日とし、決算日は2月21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。

確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

## 株式への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以下
標準型	信託財産の純資産総額の65%以下
株式重視型	信託財産の純資産総額の85%以下

## 外貨建資産への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以下
標準型	信託財産の純資産総額の50%以下
株式重視型	信託財産の純資産総額の55%以下

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）および外国為替予約取引は、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、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

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。

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において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。

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

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「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。

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. 国内の証券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。以下同じ）、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。以下同じ）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。以下同じ）ならびに外国の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. 国内の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことができます。

3. 国内の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. 異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます)を行うことができます。

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

1. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

2. 金利先渡取引および為替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. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、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. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

#### 有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

#### 有価証券の空売り

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

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

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

#### 有価証券の借入れ

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

#### 外国為替予約等

1. 外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
2. 前記1.の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。
3. 前記2.の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとしします。
4. 予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとしします。
5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 資金の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用ならびに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します。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。

#### c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

##### 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（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・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。

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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。

##### ・為替変動リスク

原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。

##### ・流動性リスク

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

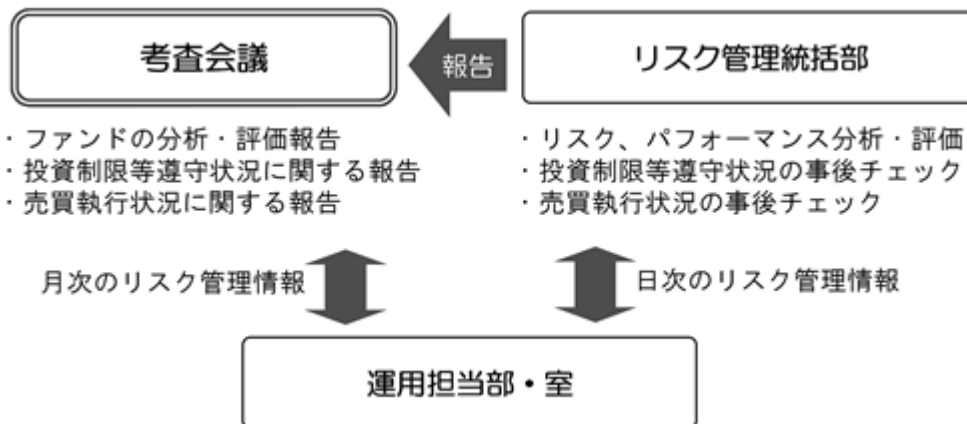
##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2018年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に17.2%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

(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。

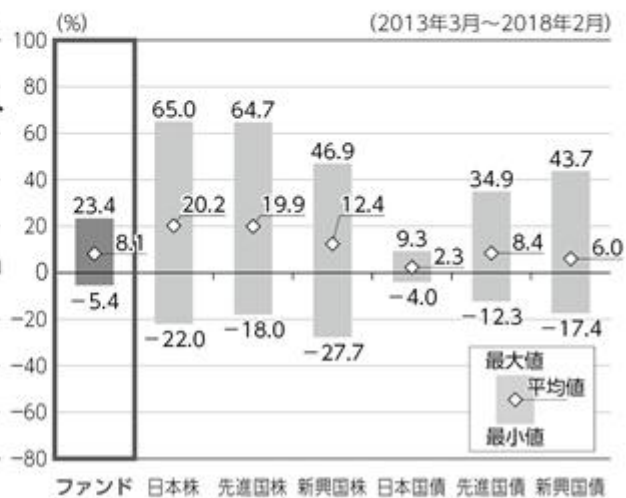
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ●DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

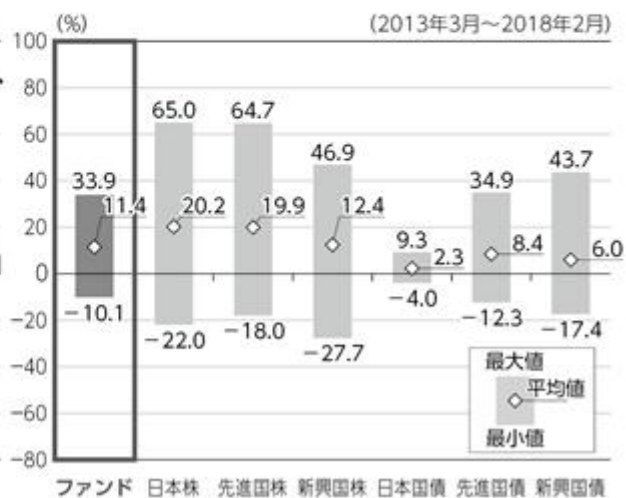


### ●DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

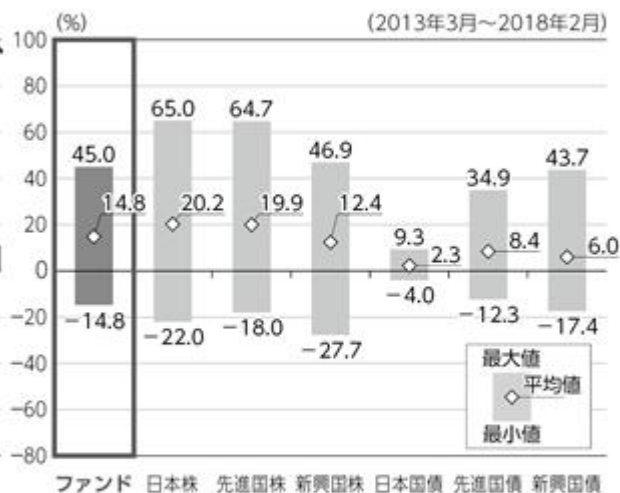


## ●DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

### <代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の高標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

ファンド	信託報酬率	配分（税抜）		
		委託会社	販売会社	受託会社
債券重視型	0.1944%（税抜 0.18%）	0.08%	0.07%	0.03%
標準型	0.2160%（税抜 0.20%）	0.09%	0.08%	0.03%
株式重視型	0.2376%（税抜 0.22%）	0.10%	0.09%	0.03%

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。

##### (4)【その他の手数料等】

###### 証券取引の手数料等

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

###### 監査費用

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

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00216%（税抜0.002%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00540%（税抜0.005%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00756%（税抜0.007%）
10億円以下 の部分	年 0.01080%（税抜0.010%）

###### 信託事務の諸費用

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

###### 借入金の利息

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

###### 信託財産留保額

ありません。

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

## &lt;ご参考&gt;

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

課税対象

分 配 時 : 分配時の「普通分配金」に対して課税されます。  
「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。

解約請求・償還時 : 個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額の差益に対して課税されます。  
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。

買 取 請 求 時 : 買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

分 配 時 : 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。  
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。

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

## 税率（個人）

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

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

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

## &lt; 少額投資非課税制度について &gt;

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

## 法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して以下の税率により源泉徴収されます。

益金不算入制度の適用はありません。

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	7,720,516,994	95.08
内 日本	7,720,516,994	95.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	399,705,852	4.92
純資産総額	8,120,222,846	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合計の比率であります。

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	19,511,895,024	95.21
内 日本	19,511,895,024	95.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	980,837,064	4.79
純資産総額	20,492,732,088	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合計の比率であります。

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	10,451,723,541	95.31
内 日本	10,451,723,541	95.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	514,698,034	4.69
純資産総額	10,966,421,575	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合計の比率であります。

## (参考情報)

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	50,101,358,720	97.57
内 日本	50,101,358,720	97.57
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,246,360,458	2.43
純資産総額	51,347,719,178	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合計の比率であります。

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,255,280,000	2.44
内 日本	1,255,280,000	2.44

(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合計の比率であります。

その他資産として、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	29,336,060,480	98.72
内 日本	29,336,060,480	98.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	381,217,738	1.28
純資産総額	29,717,278,218	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合計の比率であります。

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	113,483,014,531	94.48
内 アメリカ	71,113,613,230	59.21
内 イギリス	7,481,398,220	6.23
内 フランス	4,599,725,067	3.83
内 ドイツ	4,438,148,173	3.70
内 カナダ	4,264,360,935	3.55
内 スイス	4,143,246,790	3.45
内 オーストラリア	2,894,133,785	2.41
内 オランダ	2,788,486,994	2.32
内 アイルランド	1,642,791,900	1.37
内 スペイン	1,511,326,152	1.26
内 香港	1,335,153,190	1.11
内 スウェーデン	1,305,991,484	1.09
内 イタリア	936,723,787	0.78
内 シンガポール	932,470,901	0.78
内 デンマーク	863,377,902	0.72
内 ベルギー	520,390,590	0.43
内 フィンランド	479,439,059	0.40
内 ジャージー	442,666,112	0.37
内 バミューダ	332,499,211	0.28
内 ノルウェー	320,330,775	0.27
内 オランダ領キュラソー	289,161,099	0.24
内 ケイマン諸島	216,850,084	0.18
内 イスラエル	173,248,616	0.14
内 オーストリア	122,988,272	0.10
内 ルクセンブルグ	108,157,923	0.09
内 ニューージーランド	78,104,445	0.07
内 ポルトガル	69,345,007	0.06
内 イギリス領バージン諸島	29,926,082	0.02
内 パプアニューギニア	26,755,342	0.02
内 マン島	16,560,379	0.01
内 モーリシャス	5,643,025	0.00
投資証券	2,544,352,267	2.12
内 アメリカ	1,914,878,700	1.59
内 オーストラリア	256,599,301	0.21

内 フランス	148,054,595	0.12
内 イギリス	96,015,929	0.08
内 香港	60,033,245	0.05
内 シンガポール	48,255,223	0.04
内 カナダ	20,515,274	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,083,656,694	3.40
純資産総額	120,111,023,492	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合計の比率であります。

#### その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3,912,705,586	3.26
内 アメリカ	2,905,740,888	2.42
内 ドイツ	725,085,696	0.60
内 イギリス	281,879,002	0.23

(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合計の比率であります。

その他資産として、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

(参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	14,613,458,440	98.83
内 アメリカ	6,155,726,754	41.63
内 フランス	1,530,263,907	10.35
内 イタリア	1,485,065,222	10.04
内 イギリス	1,055,311,271	7.14
内 ドイツ	1,055,246,284	7.14
内 スペイン	882,563,916	5.97
内 ベルギー	381,244,185	2.58
内 オーストラリア	325,226,550	2.20
内 カナダ	314,844,436	2.13
内 オランダ	314,816,574	2.13
内 オーストリア	235,358,616	1.59
内 アイルランド	122,308,842	0.83
内 メキシコ	115,580,418	0.78
内 ポーランド	97,588,018	0.66
内 南アフリカ	96,871,712	0.66
内 フィンランド	93,967,472	0.64
内 デンマーク	87,968,501	0.59
内 マレーシア	69,462,427	0.47
内 スウェーデン	68,558,703	0.46
内 シンガポール	55,102,128	0.37
内 ノルウェー	45,135,999	0.31
内 スイス	25,246,505	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	172,619,454	1.17
純資産総額	14,786,077,894	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合計の比率であります。



## (2) 【投資資産】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」

## 【投資有価証券の主要銘柄】

(2018年2月28日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,696,754,075	1.3510 3,643,340,056	1.3527 3,647,899,237	- -	44.92%
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	907,588,558	1.8069 1,639,923,699	1.8140 1,646,365,644	- -	20.27%
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,217,537,365	1.3131 1,598,834,829	1.3069 1,591,199,582	- -	19.60%
4	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	498,152,199	1.6673 830,602,136	1.6763 835,052,531	- -	10.28%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	95.08
	小計		95.08
合計(対純資産総額比)			95.08

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種別及び各業種の評価金額の比率であります。

## 【投資不動産物件】

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。

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」

## 投資有価証券の主要銘柄

（2018年2月28日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式イン デックス マザーファン ド 日本	親投資信託 受益証券	3,435,204,816	1.8068 6,206,904,770	1.8140 6,231,461,536	- -	30.41%
2	ニッセイ国内債券イン デックス マザーファン ド 日本	親投資信託 受益証券	4,505,845,945	1.3510 6,087,428,859	1.3527 6,095,057,809	- -	29.74%
3	ニッセイ外国株式イン デックス マザーファン ド 日本	親投資信託 受益証券	2,500,733,288	1.6673 4,169,532,354	1.6763 4,191,979,210	- -	20.46%
4	ニッセイ外国債券イン デックス マザーファン ド 日本	親投資信託 受益証券	2,290,455,635	1.3131 3,007,764,113	1.3069 2,993,396,469	- -	14.61%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	95.21
	小計		95.21
合 計（対純資産総額比）			95.21

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 投資不動産物件

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。

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」

## 投資有価証券の主要銘柄

（2018年2月28日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,438,251,082	1.8068 4,405,562,933	1.8140 4,422,987,462	- -	40.33%
2	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,996,158,675	1.6673 3,328,238,466	1.6763 3,346,160,786	- -	30.51%
3	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,198,492,499	1.3510 1,619,172,280	1.3527 1,621,200,803	- -	14.78%
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	812,131,372	1.3131 1,066,467,204	1.3069 1,061,374,490	- -	9.68%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	95.31
	小計		95.31
合計（対純資産総額比）			95.31

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 投資不動産物件

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。

## （参考情報）

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

（2018年2月28日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	240,800	7,291.00 1,755,672,800	7,235.00 1,742,188,000	- -	3.39%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,380,500	784.60 1,083,140,300	762.30 1,052,355,150	- -	2.05%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	88,000	8,922.00 785,136,000	8,895.00 782,760,000	- -	1.52%
4	ソニー 日本	株式 電気機器	132,300	5,296.00 700,660,800	5,442.00 719,976,600	- -	1.40%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	139,500	4,795.00 668,902,500	4,982.00 694,989,000	- -	1.35%
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	147,900	4,773.00 705,926,700	4,686.00 693,059,400	- -	1.35%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	178,300	3,785.00 674,865,500	3,885.00 692,695,500	- -	1.35%

8	キーエンス 日本	株式 電気機器	9,700	62,880.00 609,936,000	65,270.00 633,119,000	- -	1.23%
9	任天堂 日本	株式 その他製品	12,200	46,960.00 572,912,000	49,080.00 598,776,000	- -	1.17%
10	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,655,000	201.60 535,248,000	199.40 529,407,000	- -	1.03%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	18,800	27,465.00 516,342,000	27,310.00 513,428,000	- -	1.00%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	175,100	2,639.50 462,176,450	2,635.50 461,476,050	- -	0.90%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	73,000	5,910.00 431,430,000	6,112.00 446,176,000	- -	0.87%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	106,700	3,953.00 421,785,100	4,096.00 437,043,200	- -	0.85%
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	136,900	3,054.00 418,092,600	3,016.00 412,890,400	- -	0.80%
16	日本電産 日本	株式 電気機器	23,800	16,255.00 386,869,000	17,260.00 410,788,000	- -	0.80%
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	143,900	2,733.00 393,278,700	2,745.00 395,005,500	- -	0.77%
18	信越化学工業 日本	株式 化学	34,600	11,320.00 391,672,000	11,375.00 393,575,000	- -	0.77%
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	476,000	830.20 395,175,200	818.00 389,368,000	- -	0.76%
20	花王 日本	株式 化学	48,700	7,889.00 384,194,300	7,852.00 382,392,400	- -	0.74%
21	パナソニック 日本	株式 電気機器	226,300	1,651.50 373,734,450	1,677.50 379,618,250	- -	0.74%
22	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	146,000	2,651.50 387,119,000	2,592.00 378,432,000	- -	0.74%
23	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	123,100	3,140.00 386,534,000	3,048.00 375,208,800	- -	0.73%
24	小松製作所 日本	株式 機械	95,700	4,006.00 383,374,200	3,916.00 374,761,200	- -	0.73%
25	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	73,600	5,038.00 370,796,800	4,966.00 365,497,600	- -	0.71%
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	81,800	4,500.00 368,100,000	4,461.00 364,909,800	- -	0.71%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	198,100	1,829.50 362,423,950	1,817.00 359,947,700	- -	0.70%
28	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	35,600	10,375.00 369,350,000	10,060.00 358,136,000	- -	0.70%
29	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	17,700	20,110.00 355,947,000	19,950.00 353,115,000	- -	0.69%
30	ダイキン工業 日本	株式 機械	27,000	12,690.00 342,630,000	12,650.00 341,550,000	- -	0.67%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	13.74
		輸送用機器	8.79
		情報・通信業	7.11
		銀行業	7.09
		化学	7.09
		機械	5.50
		卸売業	4.67
		小売業	4.59
		医薬品	4.53
		サービス業	4.13
		食料品	4.09
		陸運業	3.79
		建設業	3.03
		不動産業	2.27
		その他製品	2.19
		保険業	2.13
		精密機器	1.62
		電気・ガス業	1.48
		その他金融業	1.18
		鉄鋼	1.10
		証券、商品先物取引業	0.98
		ガラス・土石製品	0.96
		非鉄金属	0.93
		ゴム製品	0.90
		繊維製品	0.68
		金属製品	0.67
		石油・石炭製品	0.65
		空運業	0.59
		鉱業	0.31
		パルプ・紙	0.27
海運業	0.21		
倉庫・運輸関連業	0.18		
水産・農林業	0.10		
	小計		97.57
合 計（対純資産総額比）			97.57

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

投資不動産物件  
該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	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 3003月	買建	71	1,253,179,180	1,255,280,000	2.44%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

（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取引所の発表する清算値段で評価しております。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	第152回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,957,000,000	112.78 2,207,122,840	113.12 2,213,934,530	1.200000 2035/3/20	7.45%
2	第125回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,632,000,000	125.55 2,049,073,920	125.75 2,052,305,280	2.200000 2031/3/20	6.91%
3	第321回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,945,000,000	104.53 2,033,169,160	104.57 2,034,042,100	1.000000 2022/3/20	6.84%
4	第310回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,925,000,000	102.89 1,980,689,980	102.93 1,981,479,500	1.000000 2020/9/20	6.67%
5	第303回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,654,000,000	102.43 1,694,203,950	102.41 1,693,911,020	1.400000 2019/9/20	5.70%
6	第333回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,611,000,000	104.02 1,675,778,310	104.13 1,677,582,630	0.600000 2024/3/20	5.65%
7	第94回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,377,000,000	119.09 1,639,958,940	118.84 1,636,454,340	2.100000 2027/3/20	5.51%
8	第38回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,071,000,000	125.33 1,342,287,080	126.13 1,350,863,010	1.800000 2043/3/20	4.55%
9	第55回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,101,000,000	108.63 1,196,060,340	108.65 1,196,280,540	2.000000 2022/3/21	4.03%
10	第100回 利付国債(20年) 日本	国債証券	929,000,000	121.30 1,126,878,310	121.43 1,128,149,730	2.200000 2028/3/20	3.80%
11	第54回 利付国債(30年) 日本	国債証券	908,000,000	100.85 915,793,440	101.43 921,020,720	0.800000 2047/3/20	3.10%
12	第85回 利付国債(20年) 日本	国債証券	772,000,000	116.95 902,883,460	117.09 903,950,240	2.100000 2026/3/20	3.04%
13	第30回 利付国債(30年) 日本	国債証券	665,000,000	133.42 887,244,700	133.89 890,421,700	2.300000 2039/3/20	3.00%
14	第385回 利付国債(2年) 日本	国債証券	752,000,000	100.53 755,985,600	100.53 755,985,600	0.100000 2020/2/15	2.54%
15	第69回 利付国債(20年) 日本	国債証券	625,000,000	113.25 707,818,750	113.25 707,818,750	2.100000 2024/3/20	2.38%
16	第328回 利付国債(10年) 日本	国債証券	658,000,000	103.54 681,294,220	103.57 681,543,240	0.600000 2023/3/20	2.29%
17	第88回 利付国債(20年) 日本	国債証券	512,000,000	119.04 609,505,280	119.19 610,263,040	2.300000 2026/6/20	2.05%

18	第49回 利付国債(20年) 日本	国債証券	507,000,000	106.85 541,754,850	106.85 541,754,850	2.100000 2021/3/22	1.82%
19	第306回 利付国債(10年) 日本	国債証券	473,000,000	103.16 487,975,180	103.17 488,017,750	1.400000 2020/3/20	1.64%
20	第334回 利付国債(10年) 日本	国債証券	465,000,000	104.15 484,300,740	104.27 484,869,450	0.600000 2024/6/20	1.63%
21	第26回 利付国債(30年) 日本	国債証券	345,000,000	134.39 463,674,210	134.21 463,034,850	2.400000 2037/3/20	1.56%
22	第8回 利付国債(40年) 日本	国債証券	381,000,000	116.17 442,619,780	117.31 446,966,340	1.400000 2055/3/20	1.50%
23	第131回 利付国債(5年) 日本	国債証券	433,000,000	100.83 436,628,540	100.89 436,875,350	0.100000 2022/3/20	1.47%
24	第322回 利付国債(10年) 日本	国債証券	378,000,000	104.13 393,611,400	104.17 393,766,380	0.900000 2022/3/20	1.33%
25	第143回 利付国債(20年) 日本	国債証券	313,000,000	119.22 373,178,180	119.23 373,202,420	1.600000 2033/3/20	1.26%
26	第110回 利付国債(20年) 日本	国債証券	302,000,000	121.91 368,185,480	121.92 368,207,460	2.100000 2029/3/20	1.24%
27	第18回 利付国債(30年) 日本	国債証券	260,000,000	130.78 340,028,000	131.16 341,021,200	2.300000 2035/3/20	1.15%
28	第133回 利付国債(20年) 日本	国債証券	228,000,000	121.03 275,959,800	121.24 276,440,880	1.800000 2031/12/20	0.93%
29	第121回 利付国債(5年) 日本	国債証券	271,000,000	100.37 272,024,380	100.38 272,054,190	0.100000 2019/9/20	0.92%
30	第123回 利付国債(5年) 日本	国債証券	253,000,000	100.46 254,181,510	100.50 254,272,590	0.100000 2020/3/20	0.86%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	98.72
	小計		98.72
合計(対純資産総額比)			98.72

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

#### 投資不動産物件

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。

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	149,560	18,307.89 2,738,128,893	19,153.73 2,864,632,501	- -	2.38%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	211,861	8,925.95 1,891,061,914	10,114.25 2,142,815,966	- -	1.78%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	11,823	123,306.38 1,457,851,363	162,341.29 1,919,361,102	- -	1.60%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	68,656	19,228.29 1,320,137,793	19,483.36 1,337,649,577	- -	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	101,849	10,687.77 1,088,539,161	12,600.94 1,283,393,463	- -	1.07%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	77,705	14,845.70 1,153,585,183	14,137.40 1,098,547,280	- -	0.91%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	9,065	110,332.53 1,000,164,440	120,070.79 1,088,441,777	- -	0.91%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	8,628	112,023.15 966,535,812	119,987.04 1,035,248,256	- -	0.86%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	122,637	8,655.64 1,061,501,929	8,321.17 1,020,483,938	- -	0.85%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	290,064	2,908.57 843,673,802	3,471.27 1,006,891,070	- -	0.84%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	136,482	5,899.63 805,193,827	6,357.37 867,667,623	- -	0.72%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	36,671	19,732.71 723,618,330	22,511.19 825,508,002	- -	0.69%
13	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバ コ	90,079	9,613.90 866,011,179	8,678.41 781,742,962	- -	0.65%
14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製 造装置	136,000	4,795.96 652,251,603	5,358.83 728,801,791	- -	0.61%
15	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	178,093	3,740.82 666,214,120	3,958.73 705,022,440	- -	0.59%
16	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	52,977	11,896.10 630,219,784	13,246.23 701,745,892	- -	0.58%
17	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	144,848	3,913.35 566,841,967	4,835.94 700,476,932	- -	0.58%
18	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	27,994	22,768.61 637,384,482	24,965.67 698,889,033	- -	0.58%



19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	172,132	3,811.95 656,160,202	3,951.21 680,130,712	- -	0.57%
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	34,138	18,289.28 624,359,714	19,861.30 678,025,148	- -	0.56%
21	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	54,869	12,425.46 681,772,672	12,198.30 669,308,835	- -	0.56%
22	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	78,833	7,718.07 608,438,668	8,200.92 646,503,173	- -	0.54%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソ ナル用品	73,788	9,496.64 700,738,522	8,647.57 638,087,618	- -	0.53%
24	BOEING CO アメリカ	株式 資本財	16,262	28,864.11 469,388,317	39,151.39 636,680,014	- -	0.53%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	581,735	1,098.49 639,033,795	1,073.47 624,479,677	- -	0.52%
26	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	118,426	4,957.54 587,102,769	5,158.05 610,847,797	- -	0.51%
27	NOVARTIS AG スイス	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	64,384	9,523.26 613,145,712	9,126.51 587,601,245	- -	0.49%
28	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	46,159	10,177.27 469,772,900	12,697.57 586,107,419	- -	0.49%
29	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	117,282	4,913.04 576,211,248	4,683.47 549,287,830	- -	0.46%
30	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア	136,342	3,937.59 536,858,963	3,936.18 536,667,226	- -	0.45%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	10.53
		銀行	9.69
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.73
		資本財	7.40
		エネルギー	6.16
		素材	4.90
		食品・飲料・タバコ	4.89
		各種金融	4.61
		小売	4.23
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.11
		ヘルスケア機器・サービス	4.09
		保険	3.95
		半導体・半導体製造装置	3.00
		公益事業	2.79
		電気通信サービス	2.30
		メディア	2.19
		運輸	1.92
		家庭用品・パーソナル用品	1.81
		消費者サービス	1.78
		耐久消費財・アパレル	1.70
		食品・生活必需品小売り	1.59
自動車・自動車部品	1.53		
商業・専門サービス	0.96		
不動産	0.60		
	小計		94.48
投資証券	外国	投資証券	2.12
	小計		2.12
合計（対純資産総額比）			96.60

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

株式（外国）の業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & P及びMSCI Inc.に帰属します。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	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	シカゴ商品取引所	S & P 500 EMIN I FUTURE 2018 03	買建	197	2,892,583,232	2,905,740,888	2.42%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 201803	買建	160	716,127,148	725,085,696	0.60%
	ICE-EU	FTSE 100 INDE X FUTURE 2018 03	買建	26	279,563,681	281,879,002	0.23%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

（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取引所の発表する清算値段で評価しております。

(参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	128,844,000	97.74 125,944,988	95.46 123,004,789	1.625000 2022/11/15	0.83%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	124,549,200	100.09 124,668,477	98.07 122,150,382	2.000000 2021/11/15	0.83%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	120,254,400	102.19 122,893,221	100.57 120,944,660	2.625000 2020/11/15	0.82%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	122,401,800	98.31 120,342,937	97.01 118,748,106	1.375000 2021/1/31	0.80%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	123,475,500	97.99 120,998,721	95.80 118,294,468	1.625000 2022/8/15	0.80%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	117,033,300	99.04 115,915,138	98.40 115,163,107	1.250000 2019/10/31	0.78%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	117,033,300	98.59 115,388,209	98.17 114,892,760	0.875000 2019/7/31	0.78%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	115,959,600	99.93 115,888,746	97.84 113,458,351	2.000000 2022/2/15	0.77%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	114,885,900	100.51 115,476,735	98.66 113,355,619	2.125000 2021/8/15	0.77%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	110,591,100	98.80 109,272,478	96.62 106,858,650	1.750000 2022/5/15	0.72%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	104,148,900	103.90 108,211,931	101.94 106,170,430	3.125000 2021/5/15	0.72%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	108,443,700	98.87 107,222,108	96.86 105,041,821	2.000000 2023/2/15	0.71%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	102,001,500	104.07 106,160,852	102.51 104,562,757	3.500000 2020/5/15	0.71%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	102,001,500	102.07 104,119,405	100.60 102,622,689	2.625000 2020/8/15	0.69%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	100,927,800	102.04 102,990,764	101.13 102,078,376	3.125000 2019/5/15	0.69%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	97,706,700	99.16 96,891,579	98.33 96,079,883	1.375000 2020/1/31	0.65%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	95,559,300	100.72 96,247,412	97.40 93,084,314	2.375000 2024/8/15	0.63%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	92,338,200	101.55 93,769,774	98.33 90,800,768	2.500000 2024/5/15	0.61%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	91,264,500	99.85 91,131,801	99.47 90,782,623	1.625000 2019/3/31	0.61%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	93,411,900	99.68 93,120,959	96.43 90,079,897	2.250000 2024/11/15	0.61%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	91,264,500	98.64 90,031,301	98.12 89,553,290	1.000000 2019/9/30	0.61%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	89,117,100	99.49 88,668,100	98.86 88,103,838	1.625000 2019/12/31	0.60%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	89,117,100	99.17 88,383,677	98.46 87,751,826	1.375000 2019/12/15	0.59%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	88,043,400	99.77 87,848,695	99.14 87,289,748	1.625000 2019/8/31	0.59%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	88,043,400	99.10 87,257,655	98.86 87,045,868	1.000000 2019/3/15	0.59%

26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	86,969,700	102.98 89,562,352	100.04 87,007,096	2.750000 2023/11/15	0.59%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	82,674,900	101.32 83,769,515	100.62 83,194,098	2.750000 2019/2/15	0.56%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	83,748,600	99.72 83,514,941	98.56 82,550,995	1.875000 2020/12/15	0.56%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	80,527,500	100.46 80,904,315	98.56 79,372,735	2.125000 2021/9/30	0.54%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	79,453,800	101.38 80,551,830	99.88 79,360,044	2.375000 2020/12/31	0.54%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	外国	国債証券	98.83
	小計		98.83
合計(対純資産総額比)			98.83

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

#### 投資不動産物件

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。

## (3) 【運用実績】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」

## 【純資産の推移】

2018年2月28日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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6計算期間末 (2009年2月23日)	1,837,832,308	1,837,832,308	1.0431	1.0431
第7計算期間末 (2010年2月22日)	2,226,476,366	2,226,476,366	1.1509	1.1509
第8計算期間末 (2011年2月21日)	2,468,732,723	2,468,732,723	1.1802	1.1802
第9計算期間末 (2012年2月21日)	2,562,790,233	2,562,790,233	1.1636	1.1636
第10計算期間末 (2013年2月21日)	3,001,737,472	3,001,737,472	1.3114	1.3114
第11計算期間末 (2014年2月21日)	3,385,973,341	3,385,973,341	1.4672	1.4672
第12計算期間末 (2015年2月23日)	3,980,051,806	3,980,051,806	1.6341	1.6341
第13計算期間末 (2016年2月22日)	3,885,525,955	3,885,525,955	1.5825	1.5825
第14計算期間末 (2017年2月21日)	4,330,175,126	4,330,175,126	1.6728	1.6728
第15計算期間末 (2018年2月21日)	8,063,626,857	8,063,626,857	1.7587	1.7587
2017年2月末日	4,343,357,240	-	1.6711	-
3月末日	4,426,640,311	-	1.6697	-
4月末日	4,490,506,935	-	1.6811	-
5月末日	4,580,468,306	-	1.6953	-
6月末日	4,726,834,585	-	1.7113	-
7月末日	4,762,979,292	-	1.7139	-
8月末日	4,880,392,282	-	1.7218	-
9月末日	4,980,759,448	-	1.7453	-
10月末日	5,139,823,276	-	1.7684	-
11月末日	5,324,916,503	-	1.7767	-
12月末日	8,011,836,804	-	1.7922	-
2018年1月末日	8,168,441,007	-	1.7877	-
2月末日	8,120,222,846	-	1.7604	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	18.0
第7計算期間	10.3
第8計算期間	2.5
第9計算期間	1.4
第10計算期間	12.7
第11計算期間	11.9
第12計算期間	11.4
第13計算期間	3.2
第14計算期間	5.7
第15計算期間	5.1

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

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)」

## 純資産の推移

2018年2月28日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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6計算期間末 (2009年2月23日)	5,244,908,506	5,244,908,506	1.0030	1.0030
第7計算期間末 (2010年2月22日)	6,824,522,532	6,824,522,532	1.1685	1.1685
第8計算期間末 (2011年2月21日)	7,926,206,447	7,926,206,447	1.2272	1.2272
第9計算期間末 (2012年2月21日)	7,963,099,330	7,963,099,330	1.1781	1.1781
第10計算期間末 (2013年2月21日)	9,660,248,526	9,660,248,526	1.3772	1.3772
第11計算期間末 (2014年2月21日)	11,279,655,180	11,279,655,180	1.6089	1.6089
第12計算期間末 (2015年2月23日)	13,482,628,252	13,482,628,252	1.8574	1.8574
第13計算期間末 (2016年2月22日)	12,635,415,827	12,635,415,827	1.7401	1.7401
第14計算期間末 (2017年2月21日)	14,588,527,021	14,588,527,021	1.9186	1.9186
第15計算期間末 (2018年2月21日)	20,339,334,655	20,339,334,655	2.0634	2.0634
2017年2月末日	14,565,690,635	-	1.9119	-
3月末日	14,780,539,536	-	1.9113	-
4月末日	14,941,725,769	-	1.9260	-
5月末日	15,574,444,896	-	1.9490	-
6月末日	16,138,247,999	-	1.9752	-
7月末日	16,271,450,992	-	1.9805	-
8月末日	16,599,153,916	-	1.9857	-
9月末日	17,026,085,316	-	2.0307	-
10月末日	17,537,456,179	-	2.0734	-
11月末日	17,982,286,093	-	2.0868	-
12月末日	20,423,707,096	-	2.1133	-
2018年1月末日	20,928,026,451	-	2.1159	-
2月末日	20,492,732,088	-	2.0674	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## 収益率の推移

	収益率(%)
第6計算期間	27.4
第7計算期間	16.5
第8計算期間	5.0
第9計算期間	4.0
第10計算期間	16.9
第11計算期間	16.8
第12計算期間	15.4
第13計算期間	6.3
第14計算期間	10.3
第15計算期間	7.5

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



## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)」

## 純資産の推移

2018年2月28日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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6計算期間末 (2009年2月23日)	2,565,505,965	2,565,505,965	0.9552	0.9552
第7計算期間末 (2010年2月22日)	3,635,729,715	3,635,729,715	1.1734	1.1734
第8計算期間末 (2011年2月21日)	4,343,954,086	4,343,954,086	1.2613	1.2613
第9計算期間末 (2012年2月21日)	4,217,589,091	4,217,589,091	1.1770	1.1770
第10計算期間末 (2013年2月21日)	5,347,012,544	5,347,012,544	1.4248	1.4248
第11計算期間末 (2014年2月21日)	6,450,070,317	6,450,070,317	1.7349	1.7349
第12計算期間末 (2015年2月23日)	7,804,670,283	7,804,670,283	2.0739	2.0739
第13計算期間末 (2016年2月22日)	7,049,086,725	7,049,086,725	1.8772	1.8772
第14計算期間末 (2017年2月21日)	8,327,982,509	8,327,982,509	2.1564	2.1564
第15計算期間末 (2018年2月21日)	10,879,143,991	10,879,143,991	2.3709	2.3709
2017年2月末日	8,282,679,711	-	2.1435	-
3月末日	8,395,303,233	-	2.1439	-
4月末日	8,458,683,909	-	2.1622	-
5月末日	8,642,008,344	-	2.1956	-
6月末日	8,910,720,986	-	2.2337	-
7月末日	9,031,008,543	-	2.2422	-
8月末日	9,180,500,789	-	2.2438	-
9月末日	9,462,718,885	-	2.3148	-
10月末日	9,839,118,693	-	2.3813	-
11月末日	10,086,744,168	-	2.4009	-
12月末日	10,942,726,286	-	2.4407	-
2018年1月末日	11,294,976,602	-	2.4526	-
2月末日	10,966,421,575	-	2.3778	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## 収益率の推移

	収益率(%)
第6計算期間	35.9
第7計算期間	22.8
第8計算期間	7.5
第9計算期間	6.7
第10計算期間	21.1
第11計算期間	21.8
第12計算期間	19.5
第13計算期間	9.5
第14計算期間	14.9
第15計算期間	9.9

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第6計算期間	512,581,327	327,540,966	1,761,886,602
第7計算期間	367,240,452	194,490,691	1,934,636,363
第8計算期間	333,709,523	176,563,674	2,091,782,212
第9計算期間	387,759,923	277,103,043	2,202,439,092
第10計算期間	319,638,084	233,074,514	2,289,002,662
第11計算期間	433,711,623	414,973,021	2,307,741,264
第12計算期間	400,729,347	272,919,476	2,435,551,135
第13計算期間	470,047,100	450,270,647	2,455,327,588
第14計算期間	410,584,996	277,359,669	2,588,552,915
第15計算期間	2,361,820,149	365,488,159	4,584,884,905

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第6計算期間	1,260,534,424	727,669,423	5,229,010,382
第7計算期間	1,066,340,314	454,795,045	5,840,555,651
第8計算期間	987,847,202	369,377,163	6,459,025,690
第9計算期間	1,099,851,674	799,681,966	6,759,195,398
第10計算期間	877,467,094	622,057,085	7,014,605,407
第11計算期間	1,017,362,567	1,021,084,150	7,010,883,824
第12計算期間	937,661,500	689,801,801	7,258,743,523
第13計算期間	943,466,343	940,757,157	7,261,452,709
第14計算期間	928,099,553	585,769,447	7,603,782,815
第15計算期間	3,154,753,330	901,476,667	9,857,059,478

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第6計算期間	700,741,378	393,780,964	2,685,850,032
第7計算期間	732,174,234	319,548,038	3,098,476,228
第8計算期間	629,814,287	284,208,303	3,444,082,212
第9計算期間	647,867,405	508,663,783	3,583,285,834
第10計算期間	616,265,141	446,761,756	3,752,789,219
第11計算期間	756,063,221	791,114,819	3,717,737,621
第12計算期間	620,216,297	574,658,447	3,763,295,471
第13計算期間	684,049,192	692,168,947	3,755,175,716
第14計算期間	586,496,868	479,619,455	3,862,053,129
第15計算期間	1,365,271,724	638,735,089	4,588,589,764

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;



### 3.運用実績

2018年2月末現在

#### DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

##### ● 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。

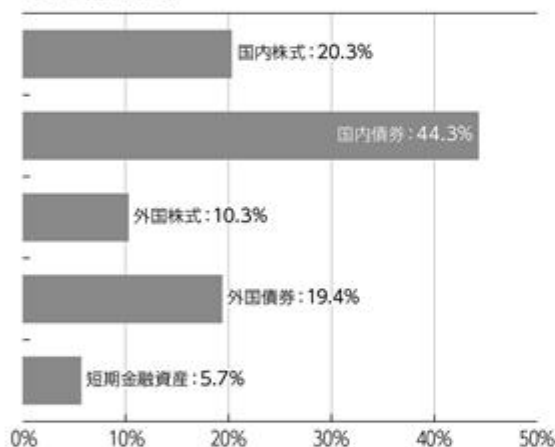
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	17,604円
純資産総額	81億円

##### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

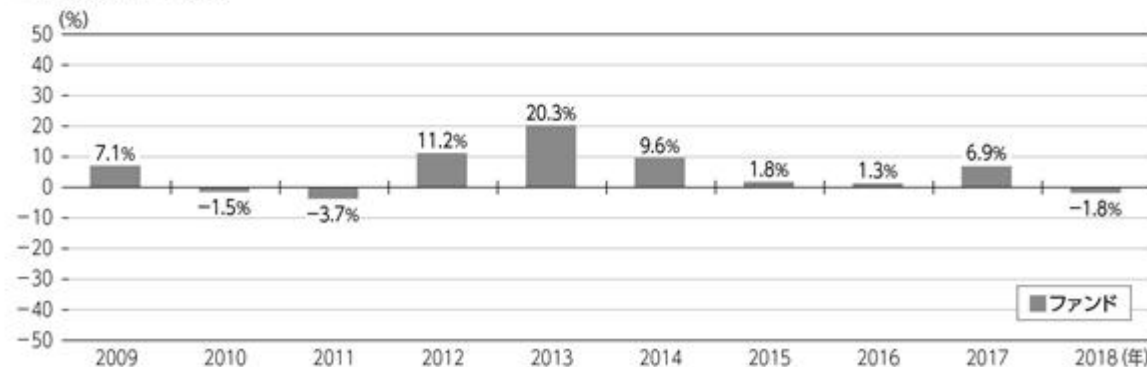
2014年 2月	0円
2015年 2月	0円
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

##### ● 資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

##### ● 年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2018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。

最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2018年2月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

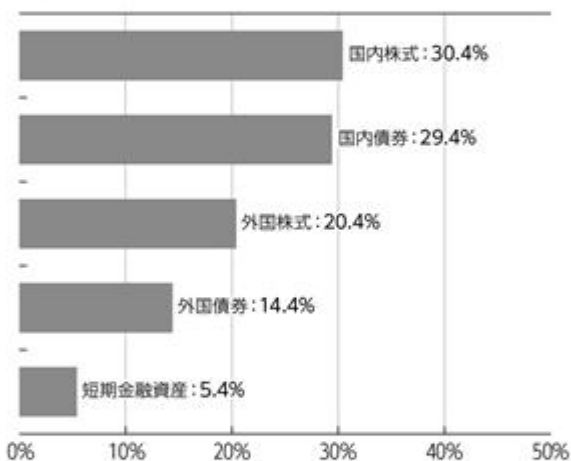
## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

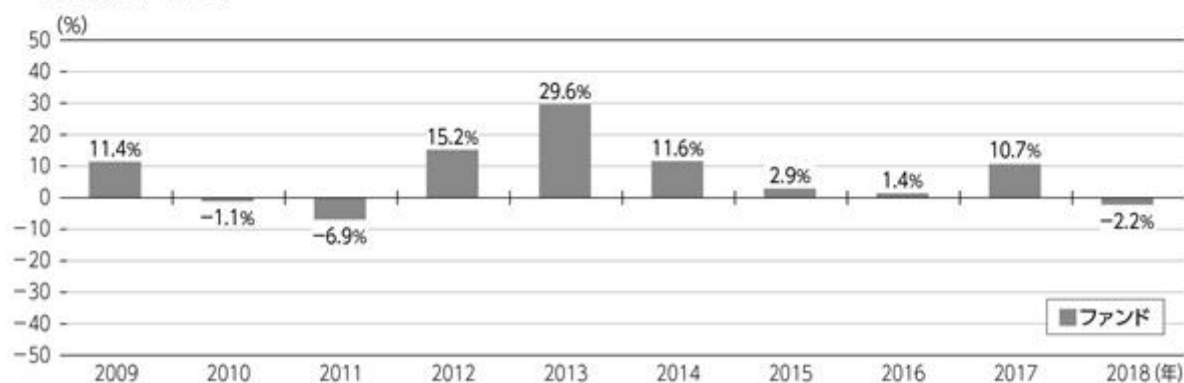
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2018年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

基準価額	20,674円
純資産総額	204億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2014年 2月	0円
2015年 2月	0円
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## 3.運用実績

2018年2月末現在

## DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

## ●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。

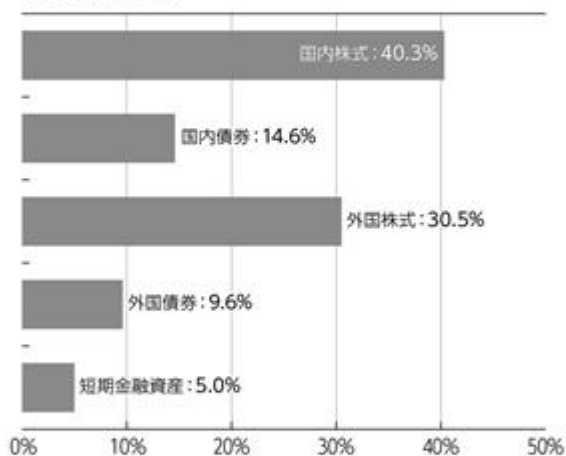
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	23,778円
純資産総額	109億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

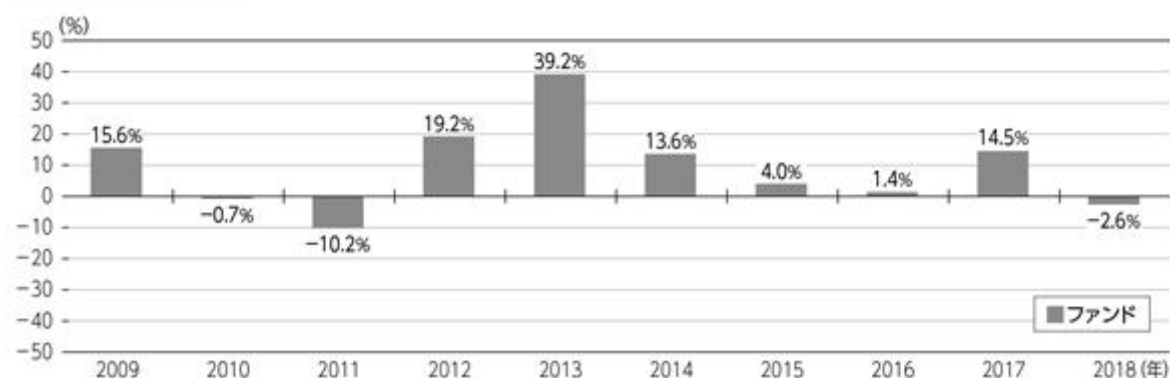
2014年 2月	0円
2015年 2月	0円
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2018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。

最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

#### 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）

取得申込受付日の翌営業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

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

証券取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することがあります。

#### 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：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

**< 買取請求の場合 >**

買取価額：買取請求受付日の翌営業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、買取請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該買取りに関して当該買取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する金額を差引いた額とします。

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

換金手数料はありません。

**信託財産留保額**

ありません。

**支払開始日**

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

**その他**

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）



### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券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。
外国株式	証券取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

#### (5)【その他】

繰上償還

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

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記3.から5.までの規定は、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3.の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用をしません。
7. 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。
8. 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 4. 」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。
9. 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。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 」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、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。
10. 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

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ができます。この場合、あらかじめ変更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。
2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 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5.の規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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 」に規定する約款の変更を行う場合において、「 繰上償還 3. 」または「 約款の変更 3. 」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社および販売会社の協議により決定します。

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

### (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) 反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」の項をご参照ください。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2017年2月22日から2018年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2017年2月22日から2018年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2017年2月22日から2018年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,172,237	10,511,890
コール・ローン	217,661,838	392,913,336
親投資信託受益証券	4,113,574,494	7,666,359,976
未収入金	2,652,197	4,125,847
流動資産合計	4,337,060,766	8,073,911,049
資産合計	4,337,060,766	8,073,911,049
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,695,861	4,165,199
未払受託者報酬	669,501	980,660
未払委託者報酬	3,347,675	4,903,502
その他未払費用	172,603	234,831
流動負債合計	6,885,640	10,284,192
負債合計	6,885,640	10,284,192
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,588,552,915	4,584,884,905
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,741,622,211	3,478,741,952
純資産合計	4,330,175,126	8,063,626,857
負債純資産合計	4,337,060,766	8,073,911,049

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 (自2016年2月23日 至2017年2月21日)	第15期 (自2017年2月22日 至2018年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	3,233	3,110
有価証券売買等損益	234,786,508	192,934,631
営業収益合計	234,789,741	192,937,741
<b>営業費用</b>		
支払利息	119,637	188,229
受託者報酬	1,312,241	1,714,902
委託者報酬	6,561,539	8,574,965
その他費用	346,777	433,047
営業費用合計	8,340,194	10,911,143
営業利益又は営業損失( )	226,449,547	182,026,598
経常利益又は経常損失( )	226,449,547	182,026,598
当期純利益又は当期純損失( )	226,449,547	182,026,598
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	11,597,053	19,860,563
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,430,198,367	1,741,622,211
剰余金増加額又は欠損金減少額	258,741,186	1,825,453,408
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	258,741,186	1,825,453,408
剰余金減少額又は欠損金増加額	162,169,836	250,499,702
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	162,169,836	250,499,702
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( )	1,741,622,211	3,478,741,952

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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14期 ( 2017年2月21日現在 )	第15期 ( 2018年2月21日現在 )
1 . 受益権総口数	2,588,552,915口	4,584,884,905口
2 . 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.6728円 (16,728円)	1.7587円 (17,587円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第14期 ( 自2016年2月23日 至2017年2月21日 )	第15期 ( 自2017年2月22日 至2018年2月21日 )
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(95,370,991円)、収益調整金(1,001,694,869円)及び分配準備積立金(656,028,472円)より分配対象収益は1,753,094,332円(1口当たり0.677249円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(162,243,143円)、収益調整金(2,650,933,050円)及び分配準備積立金(665,740,627円)より分配対象収益は3,478,916,820円(1口当たり0.758780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）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 (自2016年2月23日 至2017年2月21日)	第15期 (自2017年2月22日 至2018年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	192,403,004	146,780,972
合計	192,403,004	146,780,972

(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。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
期首元本額	2,455,327,588円	2,588,552,915円
期中追加設定元本額	410,584,996円	2,361,820,149円
期中一部解約元本額	277,359,669円	365,488,159円

## (4) 【附属明細表】(2018年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	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	902,241,656	1,630,170,224	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	2,680,521,884	3,621,385,065	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	495,246,552	825,724,576	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	1,210,082,327	1,589,080,111	
親投資信託受益証券 合計		5,288,092,419	7,666,359,976	
合計		5,288,092,419	7,666,359,976	

## 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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	10,686,148	25,936,642
コール・ローン	733,225,907	969,459,597
親投資信託受益証券	13,859,840,144	19,364,151,817
未収入金	5,592,295	5,099,193
流動資産合計	14,609,344,494	20,364,647,249
資産合計	14,609,344,494	20,364,647,249
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,534,081	4,877,799
未払受託者報酬	2,235,170	2,999,726
未払委託者報酬	12,666,164	16,998,647
その他未払費用	382,058	436,422
流動負債合計	20,817,473	25,312,594
負債合計	20,817,473	25,312,594
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,603,782,815	9,857,059,478
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,984,744,206	10,482,275,177
純資産合計	14,588,527,021	20,339,334,655
負債純資産合計	14,609,344,494	20,364,647,249

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 (自2016年2月23日 至2017年2月21日)	第15期 (自2017年2月22日 至2018年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	10,691	10,498
有価証券売買等損益	1,364,341,894	1,150,826,168
営業収益合計	1,364,352,585	1,150,836,666
<b>営業費用</b>		
支払利息	395,379	598,166
受託者報酬	4,336,755	5,475,882
委託者報酬	24,575,343	31,030,352
その他費用	779,939	867,076
営業費用合計	30,087,416	37,971,476
営業利益又は営業損失( )	1,334,265,169	1,112,865,190
経常利益又は経常損失( )	1,334,265,169	1,112,865,190
当期純利益又は当期純損失( )	1,334,265,169	1,112,865,190
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( )	47,389,472	78,896,635
期首剰余金又は期首欠損金( )	5,373,963,118	6,984,744,206
剰余金増加額又は欠損金減少額	759,135,328	3,300,931,038
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	759,135,328	3,300,931,038
剰余金減少額又は欠損金増加額	435,229,937	837,368,622
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	435,229,937	837,368,622
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( )	6,984,744,206	10,482,275,177

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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14期 ( 2017年2月21日現在 )	第15期 ( 2018年2月21日現在 )
1 . 受益権総口数	7,603,782,815口	9,857,059,478口
2 . 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.9186円 ( 19,186円 )	2.0634円 ( 20,634円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第14期 ( 自2016年2月23日 至2017年2月21日 )	第15期 ( 自2017年2月22日 至2018年2月21日 )
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(479,900,291円)、収益調整金(3,699,358,325円)及び分配準備積立金(3,096,891,122円)より分配対象収益は7,276,149,738円(1口当たり0.956912円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,034,194,031円)、収益調整金(6,235,905,489円)及び分配準備積立金(3,212,733,055円)より分配対象収益は10,482,832,575円(1口当たり1.063485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）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 (自2016年2月23日 至2017年2月21日)	第15期 (自2017年2月22日 至2018年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,194,566,952	973,876,613
合計	1,194,566,952	973,876,613

(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。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
期首元本額	7,261,452,709円	7,603,782,815円
期中追加設定元本額	928,099,553円	3,154,753,330円
期中一部解約元本額	585,769,447円	901,476,667円

## (4)【附属明細表】(2018年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	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	3,416,510,058	6,172,950,372	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	4,480,747,675	6,053,490,108	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	2,487,198,234	4,146,905,615	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	2,277,494,458	2,990,805,722	
親投資信託受益証券 合計		12,661,950,425	19,364,151,817	
合計		12,661,950,425	19,364,151,817	

## 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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。



## 【DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	6,104,834	13,660,766
コール・ローン	418,880,827	510,612,003
親投資信託受益証券	7,912,623,165	10,367,190,248
未収入金	4,943,741	2,348,597
流動資産合計	8,342,552,567	10,893,811,614
資産合計	8,342,552,567	10,893,811,614
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,981,669	2,183,215
未払受託者報酬	1,268,999	1,655,764
未払委託者報酬	8,037,238	10,486,821
その他未払費用	282,152	341,823
流動負債合計	14,570,058	14,667,623
負債合計	14,570,058	14,667,623
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,862,053,129	4,588,589,764
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,465,929,380	6,290,554,227
純資産合計	8,327,982,509	10,879,143,991
負債純資産合計	8,342,552,567	10,893,811,614

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 (自2016年2月23日 至2017年2月21日)	第15期 (自2017年2月22日 至2018年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,997	5,846
有価証券売買等損益	1,097,857,393	854,945,828
営業収益合計	1,097,863,390	854,951,674
<b>営業費用</b>		
支払利息	222,406	330,383
受託者報酬	2,442,263	3,046,180
委託者報酬	15,468,102	19,292,998
その他費用	562,525	662,821
営業費用合計	18,695,296	23,332,382
営業利益又は営業損失( )	1,079,168,094	831,619,292
経常利益又は経常損失( )	1,079,168,094	831,619,292
当期純利益又は当期純損失( )	1,079,168,094	831,619,292
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( )	66,491,079	84,163,911
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,293,911,009	4,465,929,380
剰余金増加額又は欠損金減少額	582,816,046	1,825,501,355
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	582,816,046	1,825,501,355
剰余金減少額又は欠損金増加額	423,474,690	748,331,889
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	423,474,690	748,331,889
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( )	4,465,929,380	6,290,554,227

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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14期 ( 2017年2月21日現在 )	第15期 ( 2018年2月21日現在 )
1 . 受益権総口数	3,862,053,129口	4,588,589,764口
2 . 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	2.1564円 ( 21,564円 )	2.3709円 ( 23,709円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第14期 ( 自2016年2月23日 至2017年2月21日 )	第15期 ( 自2017年2月22日 至2018年2月21日 )
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(344,997,525円)、収益調整金(2,731,898,968円)及び分配準備積立金(1,774,523,509円)より分配対象収益は4,851,420,002円(1口当たり1.256176円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(747,581,755円)、収益調整金(3,947,937,327円)及び分配準備積立金(1,816,079,811円)より分配対象収益は6,511,598,893円(1口当たり1.419085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）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 (自2016年2月23日 至2017年2月21日)	第15期 (自2017年2月22日 至2018年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	974,903,734	722,570,877
合計	974,903,734	722,570,877

(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。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第14期 (2017年2月21日現在)	第15期 (2018年2月21日現在)
期首元本額	3,755,175,716円	3,862,053,129円
期中追加設定元本額	586,496,868円	1,365,271,724円
期中一部解約元本額	479,619,455円	638,735,089円

## (4) 【附属明細表】(2018年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	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	2,426,134,995	4,383,540,708	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	1,192,400,971	1,610,933,711	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	1,986,286,663	3,311,735,753	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	807,934,874	1,060,980,076	
親投資信託受益証券 合計		6,412,757,503	10,367,190,248	
合計		6,412,757,503	10,367,190,248	

## 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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型））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、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンド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。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

（参考）

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型））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、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンド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。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

（参考）

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型））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、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンド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。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、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」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	13,610,177	58,384,850
コール・ローン	933,857,005	2,182,308,482
株式	40,287,740,190	49,912,570,510
派生商品評価勘定	15,177,600	12,928,800
未収入金	-	36,702,090
未収配当金	66,042,813	66,199,765
差入委託証拠金	36,900,000	33,210,000
流動資産合計	41,353,327,785	52,302,304,497
資産合計	41,353,327,785	52,302,304,497
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,652,960
前受金	10,110,000	10,575,000
未払金	-	1,310,006,690
未払解約金	69,117,741	66,428,452
その他未払費用	1,109	4,169
流動負債合計	79,228,850	1,389,667,271
負債合計	79,228,850	1,389,667,271
純資産の部		
元本等		
元本	26,406,163,727	28,178,885,286
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,867,935,208	22,733,751,940
純資産合計	41,274,098,935	50,912,637,226
負債純資産合計	41,353,327,785	52,302,304,497



## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、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	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
1. 受益権総口数	26,406,163,727口	28,178,885,286口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5630円 (15,630円)	1.8068円 (18,068円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 2016年2月23日 至 2017年2月21日）	（自 2017年2月22日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、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。	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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (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。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	222,295,030	24,555,600
合計	222,295,030	24,555,600

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 株式関連

種類	(2017年2月21日 現在)				(2018年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	918,090,000	-	933,300,000	15,210,000	941,445,000	-	951,750,000	10,305,000
合計	918,090,000	-	933,300,000	15,210,000	941,445,000	-	951,750,000	10,305,000

## (注) 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。

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	26,708,202,183円	26,406,163,727円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	10,057,847,879円	12,502,363,018円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,359,886,335円	10,729,641,459円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,815,906,431円	7,166,753,242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)	6,331,048,173円	5,442,163,554円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	14,519,352円	3,462,634円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	6,437,094円	4,114,792円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	555,001,549円	902,241,656円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,800,614,924円	3,416,510,058円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,128,574,309円	2,426,134,995円
ニッセイ/パナゴラ・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)	46,182,585円	15,427,793円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	225,365,853円	52,427,695円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	217,770,428円	65,691,986円
ニッセイ厚生年金型バランス運用(現物型)DB(適格機関投資家限定)	1,897,634,169円	-円
DCニッセイ国内株式インデックス	33,239,386円	69,513,538円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	4,117,578,365円	8,325,872,380円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	215,958,251円	269,192,835円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	332,858円	3,727,551円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	-円	760,570円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	-円	273,300円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	-円	417,228円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	-円	647,891円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	-円	6,943,387円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	-円	3,535,483円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	-円	543,295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)	-円	587,583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)	-円	249,893円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	-円	1,691,947円
計	26,406,163,727円	28,178,885,286円

## 附属明細表(2018年2月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	900	3,915.00	3,523,500	
日本水産	25,000	544.00	13,600,000	
マルハニチロ	4,200	3,310.00	13,902,000	
カネコ種苗	900	1,604.00	1,443,600	
サカタのタネ	3,300	3,710.00	12,243,000	
ホクト	2,300	2,084.00	4,793,200	
ショーボンドホールディングス	2,100	7,640.00	16,044,000	
ミライト・ホールディングス	6,800	1,670.00	11,356,000	
タマホーム	1,700	1,183.00	2,011,100	
ベステラ	800	1,871.00	1,496,800	
インベスターズクラウド	1,900	2,134.00	4,054,600	
住石ホールディングス	7,000	157.00	1,099,000	
日鉄鉱業	600	7,210.00	4,326,000	
三井松島産業	1,100	1,508.00	1,658,800	
国際石油開発帝石	107,900	1,319.00	142,320,100	
日本海洋掘削	800	2,286.00	1,828,800	
石油資源開発	3,500	2,585.00	9,047,500	
K&Oエナジーグループ	1,300	1,700.00	2,210,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,200	1,188.00	1,425,600	
安藤・間	17,100	795.00	13,594,500	
東急建設	8,500	1,250.00	10,625,000	
コムシスホールディングス	7,800	2,817.00	21,972,600	
ミサワホーム	1,900	898.00	1,706,200	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,948.00	4,127,200	
東建コーポレーション	800	12,020.00	9,616,000	
ソネック	1,800	779.00	1,402,200	
ヤマウラ	1,400	959.00	1,342,600	
大成建設	22,100	5,410.00	119,561,000	
大林組	66,600	1,199.00	79,853,400	
清水建設	67,900	1,015.00	68,918,500	
飛鳥建設	20,200	187.00	3,777,400	
長谷工コーポレーション	25,900	1,572.00	40,714,800	
松井建設	2,400	842.00	2,020,800	
銭高組	300	5,710.00	1,713,000	
鹿島建設	98,000	1,033.00	101,234,000	
不動テトラ	16,800	194.00	3,259,200	
大末建設	700	1,065.00	745,500	
鉄建建設	1,300	3,155.00	4,101,500	
西松建設	5,100	2,759.00	14,070,900	
三井住友建設	16,000	638.00	10,208,000	
大豊建設	8,000	634.00	5,072,000	
前田建設工業	15,800	1,272.00	20,097,600	
佐田建設	2,900	486.00	1,409,400	
ナカノフドー建設	2,200	634.00	1,394,800	
奥村組	3,700	4,740.00	17,538,000	
東鉄工業	2,700	3,280.00	8,856,000	
浅沼組	8,000	463.00	3,704,000	
戸田建設	26,000	824.00	21,424,000	
熊谷組	3,500	3,240.00	11,340,000	
青木あすなろ建設	1,500	1,019.00	1,528,500	
北野建設	5,000	451.00	2,255,000	
植木組	500	2,707.00	1,353,500	
三井ホーム	3,000	686.00	2,058,000	
矢作建設工業	3,000	850.00	2,550,000	

ピーエス三菱	2,600	869.00	2,259,400
日本ハウスホールディングス	4,200	644.00	2,704,800
大東建託	8,000	17,675.00	141,400,000
新日本建設	2,600	1,040.00	2,704,000
N I P P O	5,100	2,540.00	12,954,000
東亜道路工業	400	4,235.00	1,694,000
前田道路	7,000	2,379.00	16,653,000
日本道路	600	5,890.00	3,534,000
東亜建設工業	1,800	2,268.00	4,082,400
若築建設	1,200	1,724.00	2,068,800
東洋建設	7,000	550.00	3,850,000
五洋建設	26,400	784.00	20,697,600
世紀東急工業	3,000	711.00	2,133,000
福田組	700	6,710.00	4,697,000
日本ドライケミカル	600	2,522.00	1,513,200
住友林業	14,200	1,847.00	26,227,400
日本基礎技術	3,400	406.00	1,380,400
日成ビルド工業	3,300	1,276.00	4,210,800
巴コーポレーション	2,800	580.00	1,624,000
大和ハウス工業	65,600	3,942.00	258,595,200
ライト工業	4,300	1,176.00	5,056,800
積水ハウス	72,200	1,883.50	135,988,700
日特建設	2,200	662.00	1,456,400
北陸電気工事	1,200	1,150.00	1,380,000
ユアテック	3,500	862.00	3,017,000
四電工	500	2,777.00	1,388,500
中電工	2,900	3,010.00	8,729,000
関電工	8,800	1,222.00	10,753,600
きんでん	14,800	1,744.00	25,811,200
東京エネシス	2,500	1,203.00	3,007,500
トーエネック	600	3,150.00	1,890,000
住友電設	1,800	2,316.00	4,168,800
日本電設工業	3,400	2,191.00	7,449,400
協和エクシオ	8,000	2,864.00	22,912,000
新日本空調	1,700	1,625.00	2,762,500
日本工営	1,300	2,963.00	3,851,900
N D S	300	4,540.00	1,362,000
九電工	4,400	5,020.00	22,088,000
三機工業	4,700	1,189.00	5,588,300
日揮	19,100	2,410.00	46,031,000
中外炉工業	700	2,346.00	1,642,200
ヤマト	1,800	833.00	1,499,400
太平電業	1,500	2,633.00	3,949,500
高砂熱学工業	6,100	1,969.00	12,010,900
三晃金属工業	300	4,175.00	1,252,500
N E C ネットズエスアイ	2,100	2,763.00	5,802,300
朝日工業社	500	3,525.00	1,762,500
明星工業	4,000	776.00	3,104,000
大気社	2,900	3,735.00	10,831,500
ダイダン	1,500	2,423.00	3,634,500
日比谷総合設備	2,500	2,061.00	5,152,500
東芝プラントシステム	4,800	2,136.00	10,252,800
日本製粉	6,600	1,645.00	10,857,000
日清製粉グループ本社	24,300	2,112.00	51,321,600
昭和産業	1,800	2,760.00	4,968,000
鳥越製粉	1,800	978.00	1,760,400
中部飼料	2,400	2,025.00	4,860,000
フィード・ワン	13,400	238.00	3,189,200
東洋精糖	1,100	1,225.00	1,347,500
日本甜菜製糖	1,100	2,378.00	2,615,800

三井製糖	1,600	4,265.00	6,824,000
塩水港精糖	5,100	283.00	1,443,300
日新製糖	900	2,201.00	1,980,900
L I F U L L	6,600	1,081.00	7,134,600
ジェイエイシーリクルートメント	1,500	2,239.00	3,358,500
日本M&Aセンター	6,500	6,850.00	44,525,000
メンバーズ	1,700	865.00	1,470,500
タケエイ	2,000	1,256.00	2,512,000
トラスト・テック	800	3,250.00	2,600,000
コシダカホールディングス	1,000	6,670.00	6,670,000
パソナグループ	1,800	2,368.00	4,262,400
C D S	1,100	1,366.00	1,502,600
リンクアンドモチベーション	3,500	1,101.00	3,853,500
G C A	2,200	939.00	2,065,800
エス・エム・エス	3,700	4,350.00	16,095,000
パーソルホールディングス	17,500	2,793.00	48,877,500
リニカル	1,200	1,467.00	1,760,400
クックパッド	5,900	606.00	3,575,400
アイ・ケイ・ケイ	1,900	754.00	1,432,600
森永製菓	4,700	5,100.00	23,970,000
中村屋	500	4,785.00	2,392,500
江崎グリコ	5,600	5,220.00	29,232,000
名糖産業	1,000	1,589.00	1,589,000
井村屋グループ	800	4,105.00	3,284,000
不二家	1,300	2,523.00	3,279,900
山崎製パン	16,300	2,080.00	33,904,000
モロゾフ	300	6,800.00	2,040,000
亀田製菓	1,200	5,150.00	6,180,000
寿スピリッツ	1,900	6,190.00	11,761,000
カルビー	9,100	3,675.00	33,442,500
森永乳業	4,000	4,385.00	17,540,000
六甲バター	1,000	2,317.00	2,317,000
ヤクルト本社	11,900	7,900.00	94,010,000
明治ホールディングス	13,100	7,940.00	104,014,000
雪印メグミルク	4,800	2,803.00	13,454,400
プリマハム	14,000	668.00	9,352,000
日本ハム	17,000	2,439.00	41,463,000
丸大食品	11,000	498.00	5,478,000
S F o o d s	1,400	4,295.00	6,013,000
伊藤ハム米久ホールディングス	12,800	923.00	11,814,400
学情	900	1,624.00	1,461,600
スタジオアリス	1,000	2,707.00	2,707,000
シミックホールディングス	1,000	2,695.00	2,695,000
システナ	1,600	4,495.00	7,192,000
N J S	900	1,646.00	1,481,400
デジタルアーツ	1,000	3,845.00	3,845,000
新日鉄住金ソリューションズ	3,100	2,906.00	9,008,600
総合警備保障	7,500	5,210.00	39,075,000
いちご	27,900	455.00	12,694,500
日本駐車場開発	23,500	185.00	4,347,500
コア	1,000	1,309.00	1,309,000
カカクコム	14,500	1,933.00	28,028,500
アイロムグループ	600	3,005.00	1,803,000
セントケア・ホールディング	1,900	731.00	1,388,900
ルネサンス	900	1,776.00	1,598,400
ディップ	2,700	3,345.00	9,031,500
S B S ホールディングス	2,000	1,299.00	2,598,000
オプトホールディング	1,300	1,163.00	1,511,900
新日本科学	2,700	535.00	1,444,500
ツクイ	4,500	851.00	3,829,500

エムスリー	19,900	4,370.00	86,963,000
ツカダ・グローバルホールディング	2,300	618.00	1,421,400
アウトソーシング	5,600	2,068.00	11,580,800
ウェルネット	1,900	1,152.00	2,188,800
ワールドホールディングス	600	3,905.00	2,343,000
ディー・エヌ・エー	10,200	1,923.00	19,614,600
博報堂DYホールディングス	26,300	1,577.00	41,475,100
ぐるなび	3,000	1,445.00	4,335,000
エスアールジータカミヤ	2,200	670.00	1,474,000
ジャパンベストレスキューシステム	2,300	844.00	1,941,200
ファンコミュニケーションズ	5,300	749.00	3,969,700
ライク	700	2,014.00	1,409,800
ビジネス・ブレークスルー	3,000	484.00	1,452,000
WDBホールディングス	900	4,260.00	3,834,000
バリューコマース	1,700	1,354.00	2,301,800
インフォマート	9,600	901.00	8,649,600
サッポロホールディングス	7,300	3,205.00	23,396,500
アサヒグループホールディングス	41,600	5,505.00	229,008,000
麒麟ホールディングス	95,600	2,788.50	266,580,600
宝ホールディングス	14,900	1,335.00	19,891,500
オエノンホールディングス	5,700	407.00	2,319,900
養命酒製造	600	2,304.00	1,382,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホー ルディングス	14,000	4,005.00	56,070,000
サントリー食品インターナショナル	15,200	5,000.00	76,000,000
ダイドーグループホールディングス	1,000	6,590.00	6,590,000
伊藤園	6,600	4,560.00	30,096,000
キーコーヒー	2,000	2,123.00	4,246,000
日清オイリオグループ	2,300	3,015.00	6,934,500
不二製油グループ本社	5,400	3,190.00	17,226,000
かどや製油	200	6,680.00	1,336,000
J-オイルミルズ	1,000	3,700.00	3,700,000
ローソン	4,900	7,280.00	35,672,000
サンエー	1,500	5,500.00	8,250,000
カワチ薬品	1,500	2,615.00	3,922,500
エービーシー・マート	3,600	6,860.00	24,696,000
ハードオフコーポレーション	1,200	1,166.00	1,399,200
高千穂交易	1,300	1,275.00	1,657,500
アスクル	1,700	3,965.00	6,740,500
ゲオホールディングス	3,600	2,061.00	7,419,600
アダストリア	3,000	2,241.00	6,723,000
ジーフット	1,800	791.00	1,423,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,900	732.00	1,390,800
伊藤忠食品	500	5,880.00	2,940,000
くらコーポレーション	1,100	6,550.00	7,205,000
キャンドゥ	900	1,750.00	1,575,000
エレマテック	900	2,357.00	2,121,300
パルグループホールディングス	1,000	3,090.00	3,090,000
JALUX	600	3,105.00	1,863,000
エディオン	7,600	1,339.00	10,176,400
あらた	1,000	5,050.00	5,050,000
サーラコーポレーション	3,400	680.00	2,312,000
トーメンデバイス	500	2,898.00	1,449,000
ハローズ	700	2,534.00	1,773,800
J Pホールディングス	5,900	328.00	1,935,200
あみやき亭	400	5,270.00	2,108,000
東京エレクトロン デバイス	700	2,153.00	1,507,100
ひらまつ	2,700	549.00	1,482,300
フィールズ	1,500	1,132.00	1,698,000
双日	115,500	344.00	39,732,000



アルフレッサ ホールディングス	21,700	2,374.00	51,515,800
大黒天物産	500	5,290.00	2,645,000
ハニーズホールディングス	1,900	1,024.00	1,945,600
ファーマライズホールディングス	2,300	620.00	1,426,000
キッコーマン	15,500	4,270.00	66,185,000
味の素	45,700	1,968.00	89,937,600
キュービー	11,100	2,978.00	33,055,800
ハウス食品グループ本社	7,600	3,705.00	28,158,000
カゴメ	8,000	3,690.00	29,520,000
焼津水産化学工業	1,200	1,190.00	1,428,000
アリアケジャパン	1,800	8,230.00	14,814,000
ピエトロ	800	1,669.00	1,335,200
エバラ食品工業	700	2,142.00	1,499,400
ニチレイ	9,500	2,681.00	25,469,500
横浜冷凍	4,700	1,104.00	5,188,800
東洋水産	10,900	4,200.00	45,780,000
日清食品ホールディングス	8,700	7,480.00	65,076,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,562.00	3,124,000
一正蒲鉾	1,200	1,257.00	1,508,400
フジッコ	2,200	2,340.00	5,148,000
ロック・フィールド	2,100	2,154.00	4,523,400
日本たばこ産業	123,100	3,106.00	382,348,600
ケンコーマヨネーズ	1,300	3,635.00	4,725,500
わらべや日洋ホールディングス	1,300	2,577.00	3,350,100
なとり	1,100	1,942.00	2,136,200
ピクルスコーポレーション	800	1,822.00	1,457,600
北の達人コーポレーション	5,700	740.00	4,218,000
ユーグレナ	7,700	972.00	7,484,400
片倉工業	2,400	1,369.00	3,285,600
グンゼ	1,500	5,860.00	8,790,000
ヒューリック	40,800	1,204.00	49,123,200
ラサ商事	1,500	934.00	1,401,000
アルペン	1,500	2,503.00	3,754,500
クオール	2,200	2,281.00	5,018,200
アルコニックス	2,100	2,422.00	5,086,200
神戸物産	1,300	4,220.00	5,486,000
ジーンズ	1,300	5,240.00	6,812,000
ビックカメラ	11,300	1,646.00	18,599,800
D C Mホールディングス	10,500	1,080.00	11,340,000
ペッパーフードサービス	1,000	4,770.00	4,770,000
MonotaRO	6,900	3,540.00	24,426,000
DDホールディングス	400	3,745.00	1,498,000
あい ホールディングス	3,100	3,015.00	9,346,500
ディー・ブイエックス	1,100	1,251.00	1,376,100
きちり	1,900	745.00	1,415,500
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,244.00	3,590,400
J . フロント リテイリング	23,300	1,947.00	45,365,100
ドトール・日レスホールディングス	3,400	2,579.00	8,768,600
マツモトキヨシホールディングス	8,100	4,480.00	36,288,000
ブロンコビリー	1,000	3,335.00	3,335,000
スタートトゥデイ	19,200	2,967.00	56,966,400
物語コーポレーション	600	10,050.00	6,030,000
ココカラファイン	2,000	7,000.00	14,000,000
三越伊勢丹ホールディングス	36,500	1,266.00	46,209,000
東洋紡	7,700	2,069.00	15,931,300
ユニチカ	6,000	706.00	4,236,000
富士紡ホールディングス	1,200	4,310.00	5,172,000
日清紡ホールディングス	12,100	1,623.00	19,638,300
倉敷紡績	21,000	344.00	7,224,000
ダイワボウホールディングス	1,700	4,320.00	7,344,000

シキボウ	1,000	1,400.00	1,400,000
日東紡績	2,900	2,550.00	7,395,000
トヨタ紡織	5,800	2,299.00	13,334,200
マクニカ・富士エレホールディングス	3,600	2,916.00	10,497,600
H a m e e	700	1,890.00	1,323,000
ウエルシアホールディングス	5,200	4,730.00	24,596,000
クリエイトSDホールディングス	2,900	2,701.00	7,832,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,700	1,030.00	3,811,000
八洲電機	1,600	867.00	1,387,200
U K C ホールディングス	1,300	2,305.00	2,996,500
ジューテックホールディングス	1,100	1,267.00	1,393,700
大光	1,500	928.00	1,392,000
O C H I ホールディングス	1,000	1,450.00	1,450,000
T O K A I ホールディングス	10,300	1,172.00	12,071,600
三洋貿易	1,100	2,353.00	2,588,300
チムニー	600	2,889.00	1,733,400
シュッピン	1,200	1,263.00	1,515,600
ビューティガレージ	600	2,238.00	1,342,800
ウイン・パートナーズ	1,400	1,706.00	2,388,400
ネクステージ	2,100	1,105.00	2,320,500
ジョイフル本田	2,900	3,485.00	10,106,500
鳥貴族	700	2,991.00	2,093,700
キリン堂ホールディングス	700	1,896.00	1,327,200
ホットランド	1,100	1,297.00	1,426,700
すかいらーく	12,100	1,470.00	17,787,000
綿半ホールディングス	700	3,910.00	2,737,000
日本毛織	5,900	1,087.00	6,413,300
ダイドーリミテッド	3,000	472.00	1,416,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,500	1,130.00	7,345,000
三栄建築設計	800	2,149.00	1,719,200
スター・マイカ	700	1,885.00	1,319,500
野村不動産ホールディングス	13,000	2,658.00	34,554,000
三重交通グループホールディングス	4,000	522.00	2,088,000
サムティ	1,700	1,867.00	3,173,900
日本商業開発	1,100	1,910.00	2,101,000
プレサンスコーポレーション	2,700	1,657.00	4,473,900
ユニゾホールディングス	2,300	2,963.00	6,814,900
T H E グローバル社	1,500	915.00	1,372,500
日本管理センター	1,300	1,769.00	2,299,700
サンセイランディック	1,000	1,413.00	1,413,000
フージャースホールディングス	4,700	778.00	3,656,600
オープンハウス	3,200	6,670.00	21,344,000
東急不動産ホールディングス	47,300	816.00	38,596,800
飯田グループホールディングス	16,300	1,990.00	32,437,000
ムゲンエステート	1,200	1,321.00	1,585,200
帝国繊維	2,200	2,016.00	4,435,200
ブックオフコーポレーション	1,700	845.00	1,436,500
日本コークス工業	16,800	112.00	1,881,600
あさひ	1,500	1,316.00	1,974,000
日本調剤	700	3,425.00	2,397,500
コスモス薬品	1,000	19,820.00	19,820,000
シップヘルスケアホールディングス	4,100	3,800.00	15,580,000
ソフトクリエイトホールディングス	900	1,492.00	1,342,800
セブン&アイ・ホールディングス	81,800	4,488.00	367,118,400
薬王堂	800	3,530.00	2,824,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5,200	1,250.00	6,500,000
ツルハホールディングス	4,200	15,470.00	64,974,000

サンマルクホールディングス	1,400	3,175.00	4,445,000
フェリシモ	1,100	1,234.00	1,357,400
トリドールホールディングス	2,400	3,640.00	8,736,000
帝人	17,000	2,167.00	36,839,000
東レ	150,500	1,100.00	165,550,000
クラレ	34,900	1,892.00	66,030,800
旭化成	129,400	1,351.50	174,884,100
サカイオーベックス	500	2,813.00	1,406,500
TOKYO BASE	400	4,270.00	1,708,000
稲葉製作所	1,100	1,341.00	1,475,100
宮地エンジニアリンググループ	600	2,433.00	1,459,800
トーカロ	1,400	5,630.00	7,882,000
アルファ	700	1,870.00	1,309,000
SUMCO	18,000	2,755.00	49,590,000
川田テクノロジーズ	400	6,050.00	2,420,000
RS Technologies	300	7,210.00	2,163,000
ハウスドゥ	500	2,895.00	1,447,500
シーアールイー	900	1,652.00	1,486,800
ケイアイスター不動産	700	2,837.00	1,985,900
住江織物	500	2,948.00	1,474,000
日本フェルト	2,700	523.00	1,412,100
イチカワ	4,000	379.00	1,516,000
芦森工業	600	2,400.00	1,440,000
アツギ	1,400	1,199.00	1,678,600
コメダホールディングス	3,600	2,162.00	7,783,200
サツドラホールディングス	700	1,973.00	1,381,100
パロックジャパンリミテッド	1,600	908.00	1,452,800
クスリのアオキホールディングス	1,500	5,960.00	8,940,000
共和レザー	1,400	985.00	1,379,000
スシログローバルホールディングス	1,900	4,535.00	8,616,500
LIXILビバ	1,900	2,154.00	4,092,600
セーレン	4,800	2,074.00	9,955,200
ソトー	1,300	1,078.00	1,401,400
東海染工	900	1,550.00	1,395,000
小松精練	3,200	957.00	3,062,400
ワコールホールディングス	5,700	3,155.00	17,983,500
ホギメディカル	1,300	8,400.00	10,920,000
クラウドシアホールディングス	2,500	564.00	1,410,000
T S Iホールディングス	7,800	752.00	5,865,600
マツオカコーポレーション	400	3,735.00	1,494,000
T I S	6,500	3,900.00	25,350,000
電算システム	700	1,937.00	1,355,900
グリー	10,400	666.00	6,926,400
コーエーテクモホールディングス	3,300	2,254.00	7,438,200
三菱総合研究所	800	3,540.00	2,832,000
ポルテージ	1,500	982.00	1,473,000
電算	600	2,562.00	1,537,200
ファインデックス	2,000	732.00	1,464,000
ヒト・コミュニケーションズ	700	1,940.00	1,358,000
K L a b	3,800	1,626.00	6,178,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,400	2,327.00	3,257,800
ネクソン	21,700	3,850.00	83,545,000
アイスタイル	4,900	1,528.00	7,487,200
エムアップ	1,300	1,131.00	1,470,300
エイチーム	1,300	2,661.00	3,459,300
テクノスジャパン	1,800	940.00	1,692,000
コロプラ	6,300	990.00	6,237,000
モバイルクリエイト	3,900	372.00	1,450,800
ブロードリーフ	4,800	1,262.00	6,057,600

ハーツユニテッドグループ	1,000	1,567.00	1,567,000
メディアドゥホールディングス	700	1,960.00	1,372,000
サイバーリンクス	1,100	1,325.00	1,457,500
フィックスターズ	400	7,850.00	3,140,000
VOYAGE GROUP	1,100	1,248.00	1,372,800
オブティム	600	2,414.00	1,448,400
特種東海製紙	1,100	4,200.00	4,620,000
ティーガイア	1,900	2,984.00	5,669,600
豆蔵ホールディングス	1,400	1,224.00	1,713,600
テクマトリックス	1,100	1,870.00	2,057,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52,700	367.00	19,340,900
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	9,140.00	12,796,000
ザッパラス	3,600	391.00	1,407,600
インターネットイニシアティブ	3,200	2,344.00	7,500,800
さくらインターネット	2,300	764.00	1,757,200
GMOクラウド	600	2,303.00	1,381,800
SRAホールディングス	1,000	3,420.00	3,420,000
朝日ネット	2,700	517.00	1,395,900
フリービット	1,500	908.00	1,362,000
コムチュア	1,000	3,650.00	3,650,000
サイバーコム	1,100	1,324.00	1,456,400
王子ホールディングス	87,000	714.00	62,118,000
日本製紙	9,300	2,155.00	20,041,500
三菱製紙	3,000	702.00	2,106,000
北越紀州製紙	11,600	703.00	8,154,800
中越パルプ工業	800	1,956.00	1,564,800
大王製紙	8,300	1,530.00	12,699,000
阿波製紙	2,200	656.00	1,443,200
メディカル・データ・ビジョン	700	2,835.00	1,984,500
gumi	2,200	1,097.00	2,413,400
モバイルファクトリー	1,100	1,286.00	1,414,600
PCIホールディングス	400	3,190.00	1,276,000
パイブドHD	1,000	1,438.00	1,438,000
オープンドア	800	2,177.00	1,741,600
アカツキ	400	6,220.00	2,488,000
LINE	5,900	4,495.00	26,520,500
レンゴー	20,100	916.00	18,411,600
トーモク	1,200	2,084.00	2,500,800
ザ・バック	1,500	3,705.00	5,557,500
シンクロ・フード	300	5,020.00	1,506,000
AOI TYO HOLDINGS	1,600	1,260.00	2,016,000
マクロミル	1,800	2,907.00	5,232,600
昭和電工	13,800	5,210.00	71,898,000
住友化学	153,000	673.00	102,969,000
住友精化	900	5,500.00	4,950,000
日産化学工業	12,100	4,050.00	49,005,000
ラサ工業	700	2,453.00	1,717,100
クレハ	1,800	7,660.00	13,788,000
多木化学	300	4,380.00	1,314,000
テイカ	1,600	2,802.00	4,483,200
石原産業	3,700	1,490.00	5,513,000
片倉コープアグリ	1,100	1,244.00	1,368,400
日東エフシー	100	796.00	79,600
日本曹達	14,000	664.00	9,296,000
東ソー	30,000	2,276.00	68,280,000
トクヤマ	6,000	3,140.00	18,840,000
セントラル硝子	4,200	2,448.00	10,281,600
東亜合成	12,200	1,222.00	14,908,400
大阪ソーダ	1,900	2,811.00	5,340,900

関東電化工業	5,000	1,230.00	6,150,000
デンカ	7,600	3,915.00	29,754,000
イビデン	12,100	1,791.00	21,671,100
信越化学工業	34,600	11,390.00	394,094,000
日本カーバイド工業	700	2,286.00	1,600,200
堺化学工業	1,400	3,105.00	4,347,000
エア・ウォーター	17,100	2,147.00	36,713,700
大陽日酸	16,000	1,577.00	25,232,000
日本化学工業	800	3,260.00	2,608,000
日本パーカラライジング	10,600	1,911.00	20,256,600
高压ガス工業	3,100	882.00	2,734,200
四国化成工業	3,000	1,507.00	4,521,000
戸田工業	400	3,695.00	1,478,000
ステラ ケミファ	1,100	2,699.00	2,968,900
保土谷化学工業	700	4,960.00	3,472,000
日本触媒	3,300	7,480.00	24,684,000
大日精化工業	1,600	4,655.00	7,448,000
カネカ	28,000	1,081.00	30,268,000
協和発酵キリン	24,800	2,267.00	56,221,600
三菱瓦斯化学	17,100	2,648.00	45,280,800
三井化学	18,900	3,315.00	62,653,500
J S R	20,900	2,400.00	50,160,000
東京応化工業	3,600	4,025.00	14,490,000
大阪有機化学工業	1,300	1,559.00	2,026,700
三菱ケミカルホールディングス	139,000	1,104.00	153,456,000
K Hネオケム	3,200	3,050.00	9,760,000
ダイセル	28,000	1,213.00	33,964,000
住友ベークライト	17,000	901.00	15,317,000
積水化学工業	43,100	1,973.00	85,036,300
日本ゼオン	17,500	1,592.00	27,860,000
アイカ工業	5,800	4,115.00	23,867,000
宇部興産	10,500	3,420.00	35,910,000
積水樹脂	3,200	2,466.00	7,891,200
タキロンシーアイ	4,200	714.00	2,998,800
旭有機材	1,200	2,113.00	2,535,600
日立化成	10,300	2,386.00	24,575,800
ニチバン	1,000	3,240.00	3,240,000
リケンテクノス	4,500	524.00	2,358,000
大倉工業	5,000	573.00	2,865,000
積水化成品工業	2,600	1,168.00	3,036,800
群栄化学工業	500	3,500.00	1,750,000
ミライアル	700	2,052.00	1,436,400
ダイキョーニシカワ	4,100	1,880.00	7,708,000
森六ホールディングス	800	3,030.00	2,424,000
日本化薬	13,500	1,376.00	18,576,000
カーリットホールディングス	1,900	1,181.00	2,243,900
E P Sホールディングス	2,800	2,385.00	6,678,000
プレステージ・インターナショナル	3,900	1,421.00	5,541,900
アミューズ	1,300	3,905.00	5,076,500
野村総合研究所	13,000	4,650.00	60,450,000
ドリームインキュベータ	600	2,800.00	1,680,000
サイバネットシステム	1,900	758.00	1,440,200
クイック	1,200	2,110.00	2,532,000
T A C	4,400	318.00	1,399,200
C Eホールディングス	1,600	890.00	1,424,000
ケネディクス	25,100	707.00	17,745,700
電通	23,100	4,970.00	114,807,000
インテージホールディングス	2,200	1,200.00	2,640,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,500	1,002.00	1,503,000
東邦システムサイエンス	1,700	811.00	1,378,700

ぴあ	600	5,540.00	3,324,000
イオンファンタジー	600	5,000.00	3,000,000
ソースネクスト	2,700	677.00	1,827,900
シーティーエス	1,900	804.00	1,527,600
ネクシィーズグループ	800	1,720.00	1,376,000
メディカルシステムネットワーク	2,400	581.00	1,394,400
日本精化	1,700	1,250.00	2,125,000
扶桑化学工業	1,500	2,875.00	4,312,500
A D E K A	8,900	1,947.00	17,328,300
日油	8,000	2,954.00	23,632,000
ミヨシ油脂	1,000	1,422.00	1,422,000
新日本理化	5,700	262.00	1,493,400
ハリマ化成グループ	1,600	892.00	1,427,200
花王	48,700	7,895.00	384,486,500
第一工業製薬	4,000	800.00	3,200,000
ニイタカ	500	1,842.00	921,000
三洋化成工業	1,300	5,420.00	7,046,000
武田薬品工業	73,000	5,923.00	432,379,000
アステラス製薬	203,600	1,508.50	307,130,600
大日本住友製薬	14,700	1,599.00	23,505,300
塩野義製薬	28,300	5,530.00	156,499,000
田辺三菱製薬	24,200	2,252.00	54,498,400
わかもと製薬	5,000	276.00	1,380,000
あすか製薬	2,300	2,167.00	4,984,100
日本新薬	5,200	6,180.00	32,136,000
バイオフェルミン製薬	500	2,875.00	1,437,500
中外製薬	20,700	5,470.00	113,229,000
科研製薬	3,600	6,070.00	21,852,000
エーザイ	23,700	5,610.00	132,957,000
理研ビタミン	800	4,035.00	3,228,000
ロート製薬	10,900	3,005.00	32,754,500
小野薬品工業	46,800	3,003.00	140,540,400
久光製薬	5,900	7,390.00	43,601,000
有機合成薬品工業	4,800	296.00	1,420,800
持田製薬	1,400	7,730.00	10,822,000
参天製薬	37,500	1,723.00	64,612,500
扶桑薬品工業	700	2,788.00	1,951,600
ツムラ	7,100	3,555.00	25,240,500
日医工	5,200	1,698.00	8,829,600
テルモ	30,400	5,520.00	167,808,000
みらかホールディングス	5,600	4,205.00	23,548,000
キッセイ薬品工業	3,700	2,869.00	10,615,300
生化学工業	3,800	2,136.00	8,116,800
栄研化学	1,600	5,060.00	8,096,000
鳥居薬品	1,200	2,815.00	3,378,000
J C R ファーマ	1,400	5,360.00	7,504,000
東和薬品	1,000	6,970.00	6,970,000
富士製薬工業	700	4,605.00	3,223,500
沢井製薬	4,000	4,995.00	19,980,000
ゼリア新薬工業	4,200	2,110.00	8,862,000
第一三共	56,700	3,867.00	219,258,900
キョーリン製薬ホールディングス	5,500	2,066.00	11,363,000
大幸薬品	1,000	2,093.00	2,093,000
ダイト	1,200	3,470.00	4,164,000
大塚ホールディングス	41,200	4,989.00	205,546,800
大正製薬ホールディングス	4,400	9,930.00	43,692,000
ペプチドリーム	8,900	4,710.00	41,919,000
大日本塗料	2,400	1,582.00	3,796,800
日本ペイントホールディングス	16,000	3,750.00	60,000,000
関西ペイント	21,800	2,632.00	57,377,600

中国塗料	5,900	1,113.00	6,566,700
日本特殊塗料	1,300	2,058.00	2,675,400
藤倉化成	2,600	673.00	1,749,800
太陽ホールディングス	1,600	4,875.00	7,800,000
D I C	8,200	3,895.00	31,939,000
サカタイクス	4,200	1,387.00	5,825,400
東洋インキ S C ホールディングス	21,000	668.00	14,028,000
T & K T O K A	1,400	1,379.00	1,930,600
アルプス技研	1,700	2,272.00	3,862,400
日本空調サービス	2,000	772.00	1,544,000
オリエンタルランド	22,400	10,740.00	240,576,000
フォーカスシステムズ	1,500	947.00	1,420,500
ダスキン	5,100	2,668.00	13,606,800
パーク 2 4	10,800	2,555.00	27,594,000
明光ネットワークジャパン	2,400	1,285.00	3,084,000
ファルコホールディングス	1,000	1,741.00	1,741,000
クレスコ	400	3,835.00	1,534,000
フジ・メディア・ホールディングス	20,400	1,839.00	37,515,600
秀英予備校	2,900	492.00	1,426,800
ラウンドワン	5,900	1,845.00	10,885,500
リゾートトラスト	8,000	2,431.00	19,448,000
オービック	6,100	8,660.00	52,826,000
ジャストシステム	3,200	2,462.00	7,878,400
T D C ソフト	1,200	1,169.00	1,402,800
ヤフー	140,200	512.00	71,782,400
ビー・エム・エル	2,400	2,661.00	6,386,400
ワタベウエディング	2,300	607.00	1,396,100
トレンドマイクロ	9,500	6,160.00	58,520,000
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,312.00	3,936,000
リソー教育	3,200	822.00	2,630,400
日本オラクル	3,100	8,430.00	26,133,000
早稲田アカデミー	800	1,718.00	1,374,400
アルファシステムズ	600	2,327.00	1,396,200
フューチャー	2,600	1,246.00	3,239,600
C A C H o l d i n g s	1,500	1,121.00	1,681,500
ソフトバンク・テクノロジー	800	1,974.00	1,579,200
トーセ	700	2,030.00	1,421,000
ユー・エス・エス	23,100	2,209.00	51,027,900
オービックビジネスコンサルタント	1,000	6,380.00	6,380,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,400	4,350.00	19,140,000
アイティフォー	2,400	751.00	1,802,400
東計電算	400	3,360.00	1,344,000
サイバーエージェント	12,400	4,525.00	56,110,000
楽天	97,100	924.60	89,778,660
エクスネット	1,600	887.00	1,419,200
クリーク・アンド・リバー社	1,400	979.00	1,370,600
テー・オー・ダブリュー	1,800	921.00	1,657,800
大塚商会	5,800	9,600.00	55,680,000
総合メディカル	800	6,130.00	4,904,000
サイボウズ	2,600	547.00	1,422,200
セントラルスポーツ	700	3,950.00	2,765,000
パラカ	600	2,427.00	1,456,200
電通国際情報サービス	1,200	2,696.00	3,235,200
デジタルガレージ	3,500	3,215.00	11,252,500
イーエムシステムズ	700	2,511.00	1,757,700
ウェザーニューズ	700	3,250.00	2,275,000
C I J	2,000	689.00	1,378,000
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,749.00	1,399,200
日本エンタープライズ	6,200	227.00	1,407,400
WOWOW	900	3,365.00	3,028,500

スカラ	1,600	911.00	1,457,600
フルキャストホールディングス	1,700	2,547.00	4,329,900
富士フィルムホールディングス	41,200	4,358.00	179,549,600
コニカミノルタ	46,400	977.00	45,332,800
資生堂	36,900	6,289.00	232,064,100
ライオン	27,600	2,105.00	58,098,000
高砂香料工業	1,200	3,215.00	3,858,000
マンダム	3,900	3,770.00	14,703,000
ミルボン	2,600	4,360.00	11,336,000
ファンケル	4,800	3,430.00	16,464,000
コーセー	3,400	20,310.00	69,054,000
コタ	900	1,961.00	1,764,900
シーズ・ホールディングス	2,700	6,060.00	16,362,000
シーボン	400	3,410.00	1,364,000
ポーラ・オルビスホールディングス	8,500	4,515.00	38,377,500
ノエビアホールディングス	1,300	8,010.00	10,413,000
アジュバンコスメジャパン	1,300	1,103.00	1,433,900
エステー	1,400	2,366.00	3,312,400
アグロ カネショウ	800	2,273.00	1,818,400
コニシ	3,300	1,854.00	6,118,200
長谷川香料	2,600	2,012.00	5,231,200
星光PMC	1,300	1,082.00	1,406,600
小林製薬	5,600	7,020.00	39,312,000
荒川化学工業	1,800	1,933.00	3,479,400
メック	1,400	1,695.00	2,373,000
日本高純度化学	600	2,583.00	1,549,800
タカラバイオ	5,200	1,985.00	10,322,000
JCU	1,200	4,810.00	5,772,000
デクセリアルズ	5,100	1,403.00	7,155,300
アース製薬	1,500	5,180.00	7,770,000
北興化学工業	2,000	770.00	1,540,000
大成ラミック	600	3,140.00	1,884,000
クミアイ化学工業	9,000	659.00	5,931,000
日本農薬	5,200	617.00	3,208,400
昭和シェル石油	18,500	1,387.00	25,659,500
富士興産	2,200	630.00	1,386,000
ニチレキ	2,500	1,402.00	3,505,000
ユシロ化学工業	1,100	1,907.00	2,097,700
ビービー・カストロール	800	1,746.00	1,396,800
富士石油	4,900	446.00	2,185,400
MORESCO	700	1,950.00	1,365,000
出光興産	16,600	4,010.00	66,566,000
JXTGホールディングス	316,200	657.50	207,901,500
コスモエネルギーホールディングス	5,800	3,860.00	22,388,000
横浜ゴム	11,500	2,685.00	30,877,500
東洋ゴム工業	11,700	1,957.00	22,896,900
ブリヂストン	70,000	4,789.00	335,230,000
住友ゴム工業	20,400	2,127.00	43,390,800
藤倉ゴム工業	1,700	826.00	1,404,200
オカモト	7,000	1,115.00	7,805,000
アキレス	1,500	2,172.00	3,258,000
フコク	900	1,052.00	946,800
ニッタ	2,000	4,145.00	8,290,000
クリエートメディック	1,200	1,151.00	1,381,200
住友理工	3,800	1,073.00	4,077,400
三ツ星ベルト	5,000	1,177.00	5,885,000
バンドー化学	3,800	1,226.00	4,658,800
旭硝子	20,300	4,495.00	91,248,500
日本板硝子	10,000	886.00	8,860,000
有沢製作所	3,300	967.00	3,191,100



日本山村硝子	8,000	184.00	1,472,000
日本電気硝子	8,600	3,360.00	28,896,000
オハラ	800	3,060.00	2,448,000
住友大阪セメント	39,000	487.00	18,993,000
太平洋セメント	12,500	4,030.00	50,375,000
日本ヒューム	2,000	810.00	1,620,000
日本コンクリート工業	4,300	459.00	1,973,700
三谷セキサン	1,000	2,550.00	2,550,000
アジアパイルホールディングス	2,500	670.00	1,675,000
東海カーボン	18,000	1,983.00	35,694,000
日本カーボン	1,000	6,370.00	6,370,000
東洋炭素	1,300	3,605.00	4,686,500
ノリタケカンパニーリミテド	1,200	5,390.00	6,468,000
TOTO	15,200	5,800.00	88,160,000
日本碍子	24,200	2,024.00	48,980,800
日本特殊陶業	17,000	2,700.00	45,900,000
MARUWA	700	8,570.00	5,999,000
品川リフラクトリーズ	500	3,105.00	1,552,500
黒崎播磨	400	5,080.00	2,032,000
ヨータイ	500	915.00	457,500
東京窯業	3,100	454.00	1,407,400
ニッカトー	1,300	1,109.00	1,441,700
フジインコーポレーテッド	1,800	2,592.00	4,665,600
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,241.00	1,365,100
ニチアス	11,000	1,435.00	15,785,000
新日鐵住金	87,700	2,577.00	226,002,900
神戸製鋼所	35,900	1,212.00	43,510,800
中山製鋼所	2,700	711.00	1,919,700
合同製鐵	1,100	2,015.00	2,216,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	52,900	2,539.00	134,313,100
日新製鋼	5,400	1,548.00	8,359,200
東京製鐵	10,500	863.00	9,061,500
共英製鋼	2,200	1,922.00	4,228,400
大和工業	4,200	3,135.00	13,167,000
東京鐵鋼	800	1,715.00	1,372,000
大阪製鐵	1,300	2,139.00	2,780,700
淀川製鋼所	2,900	3,100.00	8,990,000
東洋鋼鈹	5,000	713.00	3,565,000
丸一鋼管	6,900	3,355.00	23,149,500
モリ工業	600	3,845.00	2,307,000
大同特殊鋼	3,500	5,900.00	20,650,000
日本高周波鋼業	1,700	804.00	1,366,800
日本冶金工業	16,200	337.00	5,459,400
山陽特殊製鋼	2,300	2,405.00	5,531,500
愛知製鋼	1,100	4,720.00	5,192,000
日立金属	21,100	1,427.00	30,109,700
日本金属	500	2,720.00	1,360,000
大平洋金属	1,200	3,220.00	3,864,000
新日本電工	11,700	383.00	4,481,100
栗本鐵工所	1,000	2,126.00	2,126,000
日本製鋼所	6,400	3,410.00	21,824,000
三菱製鋼	1,400	2,661.00	3,725,400
日亜鋼業	3,900	358.00	1,396,200
日本精線	300	4,965.00	1,489,500
大紀アルミニウム工業所	3,200	809.00	2,588,800
日本軽金属ホールディングス	57,200	289.00	16,530,800
三井金属鉱業	5,300	5,120.00	27,136,000
東邦亜鉛	1,100	5,880.00	6,468,000
三菱マテリアル	12,900	3,360.00	43,344,000
住友金属鉱山	25,000	5,020.00	125,500,000

DOWAホールディングス	5,000	3,955.00	19,775,000
古河機械金属	3,200	2,305.00	7,376,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	2,861.00	5,722,000
東邦チタニウム	3,500	1,526.00	5,341,000
UACJ	3,000	2,590.00	7,770,000
古河電気工業	6,500	5,870.00	38,155,000
住友電気工業	73,300	1,684.00	123,437,200
フジクラ	23,700	769.00	18,225,300
昭和電線ホールディングス	2,500	1,002.00	2,505,000
東京特殊電線	300	3,195.00	958,500
タツタ電線	3,900	715.00	2,788,500
カナレ電気	600	2,194.00	1,316,400
平河ヒューテック	1,200	1,208.00	1,449,600
リョービ	2,400	2,878.00	6,907,200
アーレスティ	2,400	971.00	2,330,400
アサヒホールディングス	3,400	2,040.00	6,936,000
東洋製罐グループホールディングス	13,400	1,558.00	20,877,200
ホッカンホールディングス	5,000	384.00	1,920,000
コロナ	1,100	1,354.00	1,489,400
横河ブリッジホールディングス	3,600	2,590.00	9,324,000
OSJBホールディングス	9,800	310.00	3,038,000
高田機工	300	4,520.00	1,356,000
三和ホールディングス	18,800	1,464.00	27,523,200
文化シャッター	5,800	996.00	5,776,800
三協立山	2,700	1,551.00	4,187,700
アルインコ	1,400	1,151.00	1,611,400
LIXILグループ	28,900	2,665.00	77,018,500
日本フィルコン	2,200	657.00	1,445,400
ノーリツ	4,400	1,971.00	8,672,400
長府製作所	2,200	2,454.00	5,398,800
リンナイ	3,500	9,770.00	34,195,000
ユニプレス	3,800	2,578.00	9,796,400
ダイニチ工業	1,600	875.00	1,400,000
日東精工	2,700	614.00	1,657,800
三洋工業	500	2,139.00	1,069,500
岡部	4,000	997.00	3,988,000
ジーテクト	2,200	2,144.00	4,716,800
東プレ	3,700	3,180.00	11,766,000
高周波熱錬	3,800	1,092.00	4,149,600
東京製綱	1,400	2,030.00	2,842,000
サンコール	1,800	796.00	1,432,800
モリテックスチール	1,500	1,033.00	1,549,500
パイオラックス	2,900	2,950.00	8,555,000
エイチワン	1,400	1,443.00	2,020,200
日本発条	19,500	1,067.00	20,806,500
三浦工業	8,500	3,035.00	25,797,500
タクマ	6,600	1,311.00	8,652,600
テクノプロ・ホールディングス	3,400	6,230.00	21,182,000
インターワークス	1,300	1,134.00	1,474,200
Keeper 技研	1,000	1,383.00	1,383,000
ファーストロジック	1,500	932.00	1,398,000
Gunosy	900	2,599.00	2,339,100
イー・ガーディアン	1,000	3,225.00	3,225,000
リブセンス	2,600	552.00	1,435,200
ジャパンマテリアル	1,700	4,255.00	7,233,500
ベクトル	2,300	2,097.00	4,823,100
ウチヤマホールディングス	2,300	669.00	1,538,700
キャリアリンク	2,400	571.00	1,370,400
IBJ	1,500	1,141.00	1,711,500
アサンテ	500	1,890.00	945,000

N・フィールド	1,100	2,104.00	2,314,400
M&Aキャピタルパートナーズ	400	8,010.00	3,204,000
E R Iホールディングス	1,500	962.00	1,443,000
アビスト	300	4,905.00	1,471,500
ウィルグループ	900	1,640.00	1,476,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	498.00	1,444,200
日本ビューホテル	900	1,507.00	1,356,300
リクルートホールディングス	146,000	2,660.00	388,360,000
ツガミ	5,000	1,535.00	7,675,000
オークマ	2,300	6,630.00	15,249,000
東芝機械	11,000	772.00	8,492,000
アマダホールディングス	30,200	1,428.00	43,125,600
アイダエンジニアリング	5,000	1,438.00	7,190,000
滝澤鉄工所	600	2,168.00	1,300,800
富士機械製造	5,900	2,186.00	12,897,400
牧野フライス製作所	10,000	1,089.00	10,890,000
オーエスジー	9,000	2,501.00	22,509,000
ダイジェット工業	700	2,152.00	1,506,400
旭ダイヤモンド工業	5,800	1,283.00	7,441,400
D M G森精機	10,800	2,166.00	23,392,800
ソディック	4,300	1,425.00	6,127,500
ディスコ	2,700	24,260.00	65,502,000
日東工器	1,200	2,887.00	3,464,400
日進工具	500	3,355.00	1,677,500
パンチ工業	1,600	1,267.00	2,027,200
土木管理総合試験所	2,300	612.00	1,407,600
日本郵政	107,400	1,299.00	139,512,600
ベルシステム24ホールディングス	3,200	1,496.00	4,787,200
一蔵	1,300	1,067.00	1,387,100
ソラスト	1,100	2,753.00	3,028,300
豊田自動織機	16,000	6,810.00	108,960,000
豊和工業	1,100	1,671.00	1,838,100
OKK	1,200	1,171.00	1,405,200
石川製作所	500	3,120.00	1,560,000
東洋機械金属	1,500	949.00	1,423,500
津田駒工業	5,000	268.00	1,340,000
島精機製作所	2,500	6,830.00	17,075,000
オプトラ	1,400	3,860.00	5,404,000
NCホールディングス	1,800	761.00	1,369,800
フリー	1,400	1,051.00	1,471,400
ヤマシンフィルタ	2,700	1,354.00	3,655,800
日阪製作所	2,800	1,094.00	3,063,200
やまびこ	3,800	1,680.00	6,384,000
平田機工	500	10,330.00	5,165,000
ペガサスミシン製造	1,900	751.00	1,426,900
ナブテスコ	10,800	4,495.00	48,546,000
三井海洋開発	2,100	2,689.00	5,646,900
レオン自動機	1,700	2,332.00	3,964,400
S M C	6,200	46,400.00	287,680,000
新川	1,600	1,148.00	1,836,800
ホソカワミクロン	700	7,750.00	5,425,000
ユニオンツール	900	3,965.00	3,568,500
オイレス工業	2,500	2,363.00	5,907,500
日精エー・エス・ピー機械	700	7,770.00	5,439,000
サトーホールディングス	2,600	3,575.00	9,295,000
技研製作所	1,000	2,836.00	2,836,000
日本エアテック	1,400	980.00	1,372,000
日精樹脂工業	1,600	1,739.00	2,782,400
オカダアイヨン	800	1,655.00	1,324,000
小松製作所	95,700	3,999.00	382,704,300

住友重機械工業	11,300	4,295.00	48,533,500
日立建機	9,300	4,545.00	42,268,500
日工	500	2,462.00	1,231,000
巴工業	800	1,960.00	1,568,000
井関農機	2,000	2,205.00	4,410,000
TOWA	1,500	1,638.00	2,457,000
丸山製作所	800	1,807.00	1,445,600
北川鉄工所	900	2,809.00	2,528,100
シンニッタ	700	840.00	588,000
ローツェ	1,000	2,374.00	2,374,000
タカキタ	1,600	821.00	1,313,600
クボタ	106,300	1,979.50	210,420,850
荏原実業	700	2,184.00	1,528,800
東洋エンジニアリング	2,600	1,005.00	2,613,000
三菱化工機	700	2,223.00	1,556,100
月島機械	3,900	1,436.00	5,600,400
帝国電機製作所	1,400	1,653.00	2,314,200
新東工業	4,700	1,227.00	5,766,900
澁谷工業	1,700	4,380.00	7,446,000
アイチコーポレーション	3,400	731.00	2,485,400
小森コーポレーション	5,000	1,400.00	7,000,000
鶴見製作所	1,700	1,943.00	3,303,100
酒井重工業	400	4,515.00	1,806,000
荏原製作所	8,100	3,970.00	32,157,000
石井鐵工所	700	2,024.00	1,416,800
西島製作所	2,000	999.00	1,998,000
北越工業	2,200	1,175.00	2,585,000
千代田化工建設	14,400	1,065.00	15,336,000
ダイキン工業	27,000	12,775.00	344,925,000
オルガノ	700	3,290.00	2,303,000
トーヨーカネツ	800	3,515.00	2,812,000
栗田工業	10,700	3,210.00	34,347,000
椿本チエイン	12,000	898.00	10,776,000
日機装	6,900	1,220.00	8,418,000
木村化工機	2,400	505.00	1,212,000
新興プランテック	4,300	1,023.00	4,398,900
アネスト岩田	3,300	1,133.00	3,738,900
ダイフク	10,100	6,890.00	69,589,000
サムコ	1,100	1,260.00	1,386,000
加藤製作所	900	2,606.00	2,345,400
油研工業	500	3,055.00	1,527,500
タダノ	9,600	1,704.00	16,358,400
フジテック	6,300	1,424.00	8,971,200
CKD	5,500	2,688.00	14,784,000
キトー	1,500	2,085.00	3,127,500
平和	6,100	2,116.00	12,907,600
理想科学工業	2,000	2,171.00	4,342,000
SANKYO	5,000	3,920.00	19,600,000
日本金銭機械	1,800	1,299.00	2,338,200
マースエンジニアリング	1,300	2,447.00	3,181,100
福島工業	1,200	4,825.00	5,790,000
ダイコク電機	900	1,713.00	1,541,700
竹内製作所	3,300	2,482.00	8,190,600
アマノ	6,100	2,926.00	17,848,600
JUKI	2,900	1,686.00	4,889,400
サンデンホールディングス	2,400	1,650.00	3,960,000
蛇の目マシン工業	1,800	772.00	1,389,600
ブラザー工業	24,200	2,650.00	64,130,000
マックス	3,000	1,502.00	4,506,000
モリタホールディングス	3,200	1,992.00	6,374,400

グローリー	5,900	4,020.00	23,718,000
新晃工業	2,000	1,999.00	3,998,000
大和冷機工業	3,200	1,225.00	3,920,000
セガサミーホールディングス	19,700	1,572.00	30,968,400
日本ピストンリング	700	2,384.00	1,668,800
リケン	900	6,080.00	5,472,000
T P R	2,200	3,035.00	6,677,000
ツバキ・ナカシマ	2,000	3,070.00	6,140,000
ホシザキ	6,200	9,800.00	60,760,000
大豊工業	1,600	1,571.00	2,513,600
日本精工	40,700	1,622.00	66,015,400
N T N	45,900	481.00	22,077,900
ジェイテクト	21,100	1,702.00	35,912,200
不二越	18,000	676.00	12,168,000
ミネベアミツミ	36,800	2,439.00	89,755,200
日本トムソン	6,300	782.00	4,926,600
T H K	12,400	4,695.00	58,218,000
ユーシン精機	900	3,585.00	3,226,500
前澤給装工業	800	1,909.00	1,527,200
イーグル工業	2,400	1,965.00	4,716,000
日本ピラー工業	2,000	1,707.00	3,414,000
キッツ	8,800	881.00	7,752,800
日立製作所	476,000	822.70	391,605,200
三菱電機	198,100	1,827.50	362,027,750
富士電機	60,000	815.00	48,900,000
東洋電機製造	800	1,706.00	1,364,800
安川電機	23,000	4,975.00	114,425,000
シンフォニア テクノロジー	13,000	370.00	4,810,000
明電舎	17,000	414.00	7,038,000
オリジン電気	800	1,900.00	1,520,000
山洋電気	1,000	8,190.00	8,190,000
デンヨー	1,800	1,834.00	3,301,200
三櫻工業	2,500	769.00	1,922,500
マキタ	25,800	5,060.00	130,548,000
東芝テック	14,000	651.00	9,114,000
芝浦メカトロニクス	3,000	495.00	1,485,000
マブチモーター	5,500	5,370.00	29,535,000
日本電産	23,800	16,410.00	390,558,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	2,852.00	1,996,400
東光高岳	1,000	1,625.00	1,625,000
ダブル・スコープ	2,900	1,537.00	4,457,300
ダイヘン	11,000	836.00	9,196,000
ヤーマン	2,900	1,733.00	5,025,700
J V C ケンウッド	14,500	365.00	5,292,500
ミマキエンジニアリング	1,800	918.00	1,652,400
第一精工	900	2,827.00	2,544,300
日新電機	4,600	1,074.00	4,940,400
大崎電気工業	4,200	793.00	3,330,600
オムロン	21,100	6,270.00	132,297,000
日東工業	3,200	1,868.00	5,977,600
I D E C	2,500	2,865.00	7,162,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,000	600.00	21,600,000
メルコホールディングス	1,000	3,595.00	3,595,000
日本電気	25,600	3,225.00	82,560,000
富士通	204,000	642.30	131,029,200
沖電気工業	8,000	1,456.00	11,648,000
岩崎通信機	1,800	771.00	1,387,800
電気興業	1,100	3,290.00	3,619,000
サンケン電気	12,000	862.00	10,344,000
アイホン	1,100	1,705.00	1,875,500

ルネサスエレクトロニクス	10,300	1,181.00	12,164,300
セイコーエプソン	29,500	2,073.00	61,153,500
ワコム	15,400	552.00	8,500,800
アルバック	4,600	6,420.00	29,532,000
E I Z O	1,800	5,180.00	9,324,000
ジャパンディスプレイ	40,700	218.00	8,872,600
日本信号	5,500	1,077.00	5,923,500
京三製作所	5,000	773.00	3,865,000
能美防災	2,600	2,331.00	6,060,600
ホーチキ	1,400	2,014.00	2,819,600
エレコム	1,700	2,354.00	4,001,800
パナソニック	226,300	1,647.50	372,829,250
シャープ	13,800	3,565.00	49,197,000
アンリツ	14,400	1,350.00	19,440,000
富士通ゼネラル	6,000	2,059.00	12,354,000
ソニー	132,300	5,378.00	711,509,400
T D K	10,400	9,410.00	97,864,000
帝国通信工業	1,000	1,378.00	1,378,000
タムラ製作所	7,600	810.00	6,156,000
アルプス電気	17,100	2,775.00	47,452,500
池上通信機	9,000	166.00	1,494,000
パイオニア	33,100	199.00	6,586,900
日本電波工業	2,000	703.00	1,406,000
鈴木	1,100	1,289.00	1,417,900
日本トリム	400	6,040.00	2,416,000
ローランド ディー・ジー	1,000	2,688.00	2,688,000
フォスター電機	2,300	2,942.00	6,766,600
クラリオン	10,000	339.00	3,390,000
S M K	6,000	464.00	2,784,000
ヨコオ	1,300	2,255.00	2,931,500
ホシデン	5,000	1,530.00	7,650,000
ヒロセ電機	3,200	15,370.00	49,184,000
日本航空電子工業	5,000	1,585.00	7,925,000
T O A	2,100	1,427.00	2,996,700
マクセルホールディングス	3,900	2,118.00	8,260,200
古野電気	2,400	745.00	1,788,000
ユニデンホールディングス	5,000	301.00	1,505,000
アルパイン	4,700	2,133.00	10,025,100
スミダコーポレーション	2,000	1,616.00	3,232,000
アイコム	1,100	2,765.00	3,041,500
リオン	800	2,974.00	2,379,200
本多通信工業	1,500	1,244.00	1,866,000
船井電機	2,000	772.00	1,544,000
横河電機	19,800	2,255.00	44,649,000
新電元工業	700	8,330.00	5,831,000
アズビル	5,900	4,720.00	27,848,000
東亜ディーケーケー	1,300	1,141.00	1,483,300
日本光電工業	8,300	2,974.00	24,684,200
チノー	800	1,634.00	1,307,200
共和電業	3,100	452.00	1,401,200
日本電子材料	2,000	730.00	1,460,000
堀場製作所	3,900	7,740.00	30,186,000
アドバンテスト	11,000	2,233.00	24,563,000
小野測器	1,700	802.00	1,363,400
エスベック	1,800	2,621.00	4,717,800
キーエンス	9,700	63,900.00	619,830,000
日置電機	1,000	3,535.00	3,535,000
シスメックス	15,400	8,680.00	133,672,000
日本マイクロニクス	3,400	1,103.00	3,750,200
メガチップス	1,600	3,760.00	6,016,000

OBARA GROUP	1,200	6,580.00	7,896,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,600	1,179.00	1,886,400
澤藤電機	700	2,201.00	1,540,700
デンソー	44,000	6,251.00	275,044,000
コーセル	2,700	1,633.00	4,409,100
イリソ電子工業	1,700	6,950.00	11,815,000
新日本無線	1,600	878.00	1,404,800
オブテックグループ	1,600	5,870.00	9,392,000
千代田インテグレ	1,000	2,425.00	2,425,000
アイ・オー・データ機器	1,300	1,123.00	1,459,900
レーザーテック	4,100	4,395.00	18,019,500
スタンレー電気	15,200	4,155.00	63,156,000
岩崎電気	900	1,653.00	1,487,700
ウシオ電機	12,000	1,470.00	17,640,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	1,008.00	1,713,600
日本セラミック	2,000	2,947.00	5,894,000
遠藤照明	1,300	1,150.00	1,495,000
古河電池	1,400	1,050.00	1,470,000
山一電機	1,400	1,869.00	2,616,600
図研	1,300	1,774.00	2,306,200
日本電子	7,000	835.00	5,845,000
カシオ計算機	15,900	1,513.00	24,056,700
ファナック	18,800	27,575.00	518,410,000
日本シイエムケイ	3,500	967.00	3,384,500
エンプラス	900	3,670.00	3,303,000
大真空	1,000	1,367.00	1,367,000
ローム	8,900	11,070.00	98,523,000
浜松ホトニクス	14,400	4,210.00	60,624,000
三井ハイテック	2,600	2,041.00	5,306,600
新光電気工業	7,500	892.00	6,690,000
京セラ	32,500	6,249.00	203,092,500
協栄産業	700	1,997.00	1,397,900
太陽誘電	8,900	1,789.00	15,922,100
村田製作所	20,800	15,040.00	312,832,000
ユーシン	3,000	753.00	2,259,000
双葉電子工業	3,200	2,225.00	7,120,000
日東電工	15,000	8,505.00	127,575,000
北陸電気工業	800	1,669.00	1,335,200
東海理化電機製作所	5,200	2,305.00	11,986,000
ニチコン	6,200	1,338.00	8,295,600
日本ケミコン	1,600	2,819.00	4,510,400
KOA	2,700	2,328.00	6,285,600
三井造船	7,200	1,984.00	14,284,800
日立造船	15,700	553.00	8,682,100
三菱重工業	33,200	4,377.00	145,316,400
川崎重工業	15,400	4,020.00	61,908,000
IHI	15,200	3,520.00	53,504,000
名村造船所	5,900	638.00	3,764,200
日本車輛製造	7,000	306.00	2,142,000
三菱ロジスネクスト	2,400	929.00	2,229,600
近畿車輛	500	2,689.00	1,344,500
FPG	6,800	1,419.00	9,649,200
島根銀行	1,000	1,403.00	1,403,000
じもとホールディングス	13,200	187.00	2,468,400
全国保証	5,600	4,795.00	26,852,000
めぶきフィナンシャルグループ	101,500	441.00	44,761,500
東京TYフィナンシャルグループ	2,600	2,783.00	7,235,800
九州フィナンシャルグループ	32,100	611.00	19,613,100
かんぽ生命保険	7,400	2,744.00	20,305,600
ゆうちょ銀行	55,400	1,461.00	80,939,400

富山第一銀行	5,000	509.00	2,545,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	118,800	617.00	73,299,600
西日本フィナンシャルホールディングス	13,300	1,328.00	17,662,400
アルヒ	1,700	1,469.00	2,497,300
日産自動車	233,700	1,121.50	262,094,550
いすゞ自動車	57,400	1,748.50	100,363,900
トヨタ自動車	240,800	7,300.00	1,757,840,000
日野自動車	28,300	1,441.00	40,780,300
三菱自動車工業	73,300	838.00	61,425,400
エフテック	1,300	1,315.00	1,709,500
レシップホールディングス	900	897.00	807,300
武蔵精密工業	2,100	3,735.00	7,843,500
日産車体	7,700	1,022.00	7,869,400
新明和工業	8,600	948.00	8,152,800
極東開発工業	3,700	1,688.00	6,245,600
日信工業	4,000	1,870.00	7,480,000
トピー工業	1,600	3,235.00	5,176,000
ティラド	700	4,075.00	2,852,500
曙ブレーキ工業	9,200	308.00	2,833,600
タチエス	3,400	1,894.00	6,439,600
NOK	10,600	2,280.00	24,168,000
フタバ産業	6,100	947.00	5,776,700
KYB	2,100	5,570.00	11,697,000
市光工業	3,000	1,148.00	3,444,000
大同メタル工業	2,500	1,315.00	3,287,500
プレス工業	10,500	672.00	7,056,000
ミクニ	2,500	699.00	1,747,500
太平洋工業	4,100	1,490.00	6,109,000
ケーヒン	4,600	2,148.00	9,880,800
河西工業	2,400	1,462.00	3,508,800
アイシン精機	16,300	6,190.00	100,897,000
マツダ	62,200	1,498.50	93,206,700
今仙電機製作所	1,800	1,193.00	2,147,400
本田技研工業	178,300	3,847.00	685,920,100
スズキ	39,300	5,996.00	235,642,800
SUBARU	61,500	3,729.00	229,333,500
安永	1,000	2,528.00	2,528,000
ヤマハ発動機	28,000	3,440.00	96,320,000
ショーワ	5,100	1,704.00	8,690,400
小糸製作所	11,900	7,530.00	89,607,000
TBK	2,600	541.00	1,406,600
エクセディ	2,400	3,415.00	8,196,000
ミツバ	3,600	1,368.00	4,924,800
豊田合成	7,200	2,611.00	18,799,200
愛三工業	3,500	1,246.00	4,361,000
盟和産業	1,000	1,368.00	1,368,000
ヨロズ	2,000	1,889.00	3,778,000
エフ・シー・シー	3,200	3,120.00	9,984,000
新家工業	600	2,490.00	1,494,000
シマノ	8,000	15,670.00	125,360,000
テイ・エス テック	4,600	4,210.00	19,366,000
ジャムコ	1,000	2,515.00	2,515,000
小野建	1,700	1,947.00	3,309,900
ノジマ	3,400	2,548.00	8,663,200
佐鳥電機	1,400	1,080.00	1,512,000
カッパ・クリエイト	2,400	1,276.00	3,062,400
エコートレーディング	1,900	743.00	1,411,700
伯東	1,200	1,632.00	1,958,400
コンドーテック	1,500	982.00	1,473,000



ライトオン	1,600	910.00	1,456,000
ナガイレーベン	2,600	2,762.00	7,181,200
三菱食品	2,100	3,095.00	6,499,500
良品計画	2,600	36,000.00	93,600,000
三城ホールディングス	800	530.00	424,000
松田産業	1,400	1,958.00	2,741,200
第一興商	2,900	5,530.00	16,037,000
メディバルホールディングス	19,600	2,142.00	41,983,200
アドヴァン	2,000	1,086.00	2,172,000
萩原電気	700	3,490.00	2,443,000
アルビス	400	3,005.00	1,202,000
アズワン	1,500	6,980.00	10,470,000
尾家産業	1,100	1,303.00	1,433,300
シモジマ	1,200	1,123.00	1,347,600
ドウシシャ	2,100	2,440.00	5,124,000
小津産業	600	2,224.00	1,334,400
コナカ	2,500	585.00	1,462,500
高速	1,200	1,226.00	1,471,200
ハウス オブ ローゼ	800	1,780.00	1,424,000
G-7ホールディングス	600	2,436.00	1,461,600
イオン北海道	2,000	821.00	1,642,000
コジマ	4,000	357.00	1,428,000
ヒマラヤ	1,100	1,276.00	1,403,600
コーナン商事	2,800	2,606.00	7,296,800
ネットワークシステムズ	7,900	1,590.00	12,561,000
エコス	1,100	1,304.00	1,434,400
ワタミ	2,300	1,345.00	3,093,500
マルシェ	1,700	815.00	1,385,500
ドンキホーテホールディングス	12,600	5,940.00	74,844,000
丸文	1,700	1,061.00	1,803,700
西松屋チェーン	4,300	1,229.00	5,284,700
ゼンショーホールディングス	10,100	2,240.00	22,624,000
ハビネット	1,300	1,711.00	2,224,300
幸楽苑ホールディングス	1,200	1,885.00	2,262,000
橋本総業ホールディングス	800	1,864.00	1,491,200
日本ライフライン	5,600	3,445.00	19,292,000
サイゼリヤ	2,900	3,070.00	8,903,000
エクセル	800	2,798.00	2,238,400
V Tホールディングス	6,600	570.00	3,762,000
マルカキカイ	700	2,145.00	1,501,500
アルゴグラフィックス	900	3,485.00	3,136,500
魚力	1,200	1,191.00	1,429,200
I D O M	5,900	716.00	4,224,400
日本エム・ディ・エム	1,400	983.00	1,376,200
ユナイテッドアローズ	2,400	4,175.00	10,020,000
進和	1,200	2,275.00	2,730,000
ダイトロン	900	2,408.00	2,167,200
ハイデイ日高	2,100	3,370.00	7,077,000
シークス	1,200	4,805.00	5,766,000
京都きもの友禅	1,800	784.00	1,411,200
コロワイド	6,500	2,465.00	16,022,500
ピーシーデポコーポレーション	2,900	778.00	2,256,200
田中商事	1,800	800.00	1,440,000
オーハシテクニカ	1,100	1,793.00	1,972,300
壱番屋	1,400	4,580.00	6,412,000
白銅	700	2,476.00	1,733,200
トップカルチャー	2,900	492.00	1,426,800
P L A N T	1,000	1,393.00	1,393,000
スギホールディングス	4,300	5,820.00	25,026,000
島津製作所	23,700	2,681.00	63,539,700

JMS	100	629.00	62,900
長野計器	1,600	1,236.00	1,977,600
バイ・テクノロジー	500	25,100.00	12,550,000
スター精密	3,200	2,161.00	6,915,200
東京計器	1,300	1,222.00	1,588,600
オーバル	4,900	297.00	1,455,300
東京精密	3,600	4,450.00	16,020,000
マニー	2,400	3,990.00	9,576,000
ニコン	34,500	2,183.00	75,313,500
トプコン	10,600	2,368.00	25,100,800
オリンパス	29,500	4,185.00	123,457,500
理研計器	1,900	2,277.00	4,326,300
SCREENホールディングス	3,700	9,630.00	35,631,000
キヤノン電子	1,800	2,574.00	4,633,200
タムロン	1,600	2,461.00	3,937,600
HOYA	40,300	5,535.00	223,060,500
シード	300	4,620.00	1,386,000
ノーリツ鋼機	2,000	2,442.00	4,884,000
エー・アンド・デイ	2,100	691.00	1,451,100
キヤノン	106,700	4,002.00	427,013,400
リコー	59,600	1,198.00	71,400,800
シチズン時計	23,600	836.00	19,729,600
リズム時計工業	800	2,216.00	1,772,800
大研医器	1,900	751.00	1,426,900
メニコン	2,700	2,568.00	6,933,600
スノーピーク	1,200	1,187.00	1,424,400
パラマウントベッドホールディングス	2,100	5,720.00	12,012,000
SHOBI	3,600	413.00	1,486,800
ニホンフラッシュ	900	2,698.00	2,428,200
前田工織	2,000	2,018.00	4,036,000
永大産業	3,000	569.00	1,707,000
アートネイチャー	2,100	774.00	1,625,400
バンダイナムコホールディングス	20,500	3,575.00	73,287,500
SHOEI	900	4,490.00	4,041,000
フランスベッドホールディングス	2,300	1,038.00	2,387,400
マーベラス	3,300	925.00	3,052,500
パイロットコーポレーション	3,500	5,510.00	19,285,000
萩原工業	1,100	1,780.00	1,958,000
エイベックス	3,600	1,622.00	5,839,200
トッパン・フォームズ	4,200	1,232.00	5,174,400
フジシールインターナショナル	4,400	3,525.00	15,510,000
タカラトミー	8,300	1,129.00	9,370,700
廣済堂	2,700	521.00	1,406,700
アーク	11,300	126.00	1,423,800
レック	1,200	3,130.00	3,756,000
タカノ	1,500	966.00	1,449,000
プロネクス	1,900	1,309.00	2,487,100
ホクシン	7,300	193.00	1,408,900
ウッドワン	1,000	1,456.00	1,456,000
大建工業	1,500	2,703.00	4,054,500
凸版印刷	56,000	934.00	52,304,000
大日本印刷	25,900	2,255.00	58,404,500
図書印刷	1,500	1,003.00	1,504,500
共同印刷	600	3,145.00	1,887,000
NISHA	4,100	2,986.00	12,242,600
藤森工業	1,700	3,655.00	6,213,500
宝印刷	1,000	1,833.00	1,833,000
前澤化成工業	1,400	1,165.00	1,631,000
アシックス	19,700	1,658.00	32,662,600
ツツミ	700	2,125.00	1,487,500

JSP	1,200	3,295.00	3,954,000
ニチハ	3,000	4,340.00	13,020,000
エフピコ	1,600	5,890.00	9,424,000
小松ウオール工業	700	2,591.00	1,813,700
ヤマハ	13,300	4,715.00	62,709,500
河合楽器製作所	700	3,845.00	2,691,500
クリナップ	1,800	846.00	1,522,800
ビジョン	12,000	4,285.00	51,420,000
天馬	1,500	2,200.00	3,300,000
キングジム	1,600	986.00	1,577,600
リンテック	4,700	3,065.00	14,405,500
信越ポリマー	4,100	1,238.00	5,075,800
東リ	4,900	385.00	1,886,500
イトーキ	4,100	719.00	2,947,900
任天堂	12,200	47,770.00	582,794,000
三菱鉛筆	3,300	2,453.00	8,094,900
松風	1,000	1,436.00	1,436,000
タカラスタANDARD	4,100	1,836.00	7,527,600
コクヨ	9,500	1,980.00	18,810,000
ニフコ	3,600	7,600.00	27,360,000
立川ブラインド工業	1,000	1,447.00	1,447,000
グローブライド	900	2,339.00	2,105,100
岡村製作所	6,900	1,475.00	10,177,500
日本バルカー工業	1,600	3,175.00	5,080,000
MUTOHホールディングス	600	2,539.00	1,523,400
伊藤忠商事	143,200	2,038.50	291,913,200
丸紅	160,400	807.10	129,458,840
スクロール	3,100	459.00	1,422,900
ヨンドシーホールディングス	2,000	2,691.00	5,382,000
三陽商会	1,100	2,384.00	2,622,400
長瀬産業	11,800	1,831.00	21,605,800
蝶理	1,200	1,907.00	2,288,400
豊田通商	21,800	4,090.00	89,162,000
オンワードホールディングス	12,400	912.00	11,308,800
三共生興	3,300	514.00	1,696,200
兼松	8,300	1,432.00	11,885,600
美津濃	2,000	3,185.00	6,370,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,200	8,060.00	49,972,000
三井物産	165,800	1,922.50	318,750,500
日本紙パルプ商事	1,000	4,295.00	4,295,000
東京エレクトロン	13,200	20,635.00	272,382,000
日立ハイテクノロジーズ	6,800	5,080.00	34,544,000
カメイ	2,500	1,647.00	4,117,500
東都水産	700	1,987.00	1,390,900
OUGホールディングス	500	2,704.00	1,352,000
スターゼン	800	5,170.00	4,136,000
セイコーホールディングス	3,100	2,897.00	8,980,700
山善	7,600	1,206.00	9,165,600
椿本興業	400	3,305.00	1,322,000
住友商事	123,100	1,828.50	225,088,350
日本ユニシス	5,400	2,222.00	11,998,800
内田洋行	900	3,200.00	2,880,000
三菱商事	136,900	2,976.00	407,414,400
第一実業	900	3,230.00	2,907,000
キヤノンマーケティングジャパン	5,600	2,934.00	16,430,400
西華産業	1,200	2,674.00	3,208,800
佐藤商事	1,700	1,151.00	1,956,700
菱洋エレクトロ	1,800	1,875.00	3,375,000
東京産業	2,400	599.00	1,437,600

ユアサ商事	1,900	3,765.00	7,153,500
神鋼商事	400	3,705.00	1,482,000
小林産業	4,000	350.00	1,400,000
阪和興業	3,600	4,950.00	17,820,000
正栄食品工業	1,100	4,045.00	4,449,500
カナデン	1,900	1,344.00	2,553,600
菱電商事	1,400	1,861.00	2,605,400
ニプロ	13,700	1,587.00	21,741,900
フルサト工業	1,100	1,778.00	1,955,800
岩谷産業	4,300	4,130.00	17,759,000
すてきナイスグループ	1,000	1,446.00	1,446,000
昭光通商	12,000	122.00	1,464,000
極東貿易	3,000	465.00	1,395,000
イワキ	3,000	415.00	1,245,000
兼松エレクトロニクス	1,200	3,230.00	3,876,000
三愛石油	5,200	1,475.00	7,670,000
稲畑産業	4,700	1,577.00	7,411,900
明和産業	2,800	505.00	1,414,000
ゴールドウイン	600	11,830.00	7,098,000
ユニ・チャーム	42,000	3,008.00	126,336,000
デサント	4,700	1,748.00	8,215,600
キング	100	674.00	67,400
ワキタ	4,200	1,281.00	5,380,200
ヤマトインターナショナル	2,900	480.00	1,392,000
東邦ホールディングス	5,800	2,573.00	14,923,400
サンゲツ	6,600	2,253.00	14,869,800
ミツウロコグループホールディングス	2,800	770.00	2,156,000
シナネンホールディングス	900	2,722.00	2,449,800
伊藤忠エネクス	4,300	1,020.00	4,386,000
サンリオ	5,500	1,972.00	10,846,000
サンワテクノス	1,200	2,153.00	2,583,600
リョーサン	2,500	3,945.00	9,862,500
新光商事	2,100	1,945.00	4,084,500
トーヨー	900	2,518.00	2,266,200
三信電気	1,800	1,932.00	3,477,600
東陽テクニカ	2,200	967.00	2,127,400
モスフードサービス	2,600	3,240.00	8,424,000
加賀電子	1,800	2,752.00	4,953,600
三益半導体工業	1,500	1,977.00	2,965,500
ソーダニッカ	2,000	695.00	1,390,000
立花エレテック	1,300	2,196.00	2,854,800
木曽路	2,400	2,739.00	6,573,600
SRSホールディングス	2,300	956.00	2,198,800
千趣会	3,500	623.00	2,180,500
タカキュー	6,200	222.00	1,376,400
ケーヨー	3,600	626.00	2,253,600
上新電機	2,300	3,880.00	8,924,000
日本瓦斯	3,600	4,505.00	16,218,000
ロイヤルホールディングス	3,500	2,857.00	9,999,500
東天紅	700	1,890.00	1,323,000
いなげや	2,200	1,815.00	3,993,000
島忠	4,700	3,525.00	16,567,500
チヨダ	2,300	2,738.00	6,297,400
ライフコーポレーション	1,500	2,885.00	4,327,500
リンガーハット	2,400	2,451.00	5,882,400
MrMaxHD	2,400	760.00	1,824,000
テンアライド	2,900	478.00	1,386,200
AOKIホールディングス	3,900	1,697.00	6,618,300
オークワ	3,000	1,114.00	3,342,000
コメリ	3,000	3,070.00	9,210,000

青山商事	3,700	4,435.00	16,409,500
しまむら	2,300	13,040.00	29,992,000
はせがわ	2,900	487.00	1,412,300
高島屋	31,000	1,099.00	34,069,000
松屋	3,900	1,563.00	6,095,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,200	2,083.00	19,163,600
近鉄百貨店	700	4,020.00	2,814,000
パルコ	1,900	1,478.00	2,808,200
丸井グループ	18,700	2,012.00	37,624,400
クレディセゾン	14,800	1,892.00	28,001,600
アクシアル リテイリング	1,600	4,310.00	6,896,000
イオン	75,100	1,865.50	140,099,050
イズミ	3,500	7,180.00	25,130,000
平和堂	4,000	2,446.00	9,784,000
フジ	2,300	2,283.00	5,250,900
ヤオコー	2,200	5,850.00	12,870,000
ゼビオホールディングス	2,700	2,194.00	5,923,800
ケーズホールディングス	8,300	3,045.00	25,273,500
PALTAC	2,700	5,330.00	14,391,000
三谷産業	3,200	443.00	1,417,600
Olympicグループ	2,400	599.00	1,437,600
新生銀行	16,900	1,683.00	28,442,700
あおぞら銀行	11,600	4,435.00	51,446,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,380,500	769.10	1,061,742,550
りそなホールディングス	214,400	618.90	132,692,160
三井住友トラスト・ホールディングス	38,400	4,358.00	167,347,200
三井住友フィナンシャルグループ	147,900	4,717.00	697,644,300
第四銀行	2,400	4,915.00	11,796,000
北越銀行	2,000	2,401.00	4,802,000
千葉銀行	70,000	882.00	61,740,000
群馬銀行	39,700	654.00	25,963,800
武蔵野銀行	3,100	3,605.00	11,175,500
千葉興業銀行	5,400	505.00	2,727,000
筑波銀行	8,100	368.00	2,980,800
七十七銀行	6,100	2,683.00	16,366,300
青森銀行	1,500	3,375.00	5,062,500
秋田銀行	1,300	2,906.00	3,777,800
山形銀行	2,200	2,392.00	5,262,400
岩手銀行	1,400	4,325.00	6,055,000
東邦銀行	17,500	394.00	6,895,000
東北銀行	1,000	1,473.00	1,473,000
みちのく銀行	1,300	1,800.00	2,340,000
ふくおかフィナンシャルグループ	79,000	562.00	44,398,000
静岡銀行	52,000	1,094.00	56,888,000
十六銀行	2,600	2,918.00	7,586,800
スルガ銀行	20,000	1,880.00	37,600,000
八十二銀行	35,400	640.00	22,656,000
山梨中央銀行	12,000	434.00	5,208,000
大垣共立銀行	3,100	2,802.00	8,686,200
福井銀行	1,700	2,606.00	4,430,200
北國銀行	2,200	4,405.00	9,691,000
清水銀行	700	2,991.00	2,093,700
富山銀行	400	3,930.00	1,572,000
滋賀銀行	18,000	562.00	10,116,000
南都銀行	2,300	3,000.00	6,900,000
百五銀行	18,800	532.00	10,001,600
京都銀行	7,500	5,980.00	44,850,000
紀陽銀行	7,400	1,768.00	13,083,200
三重銀行	900	2,338.00	2,104,200
ほくほくフィナンシャルグループ	13,000	1,551.00	20,163,000

広島銀行	28,800	844.00	24,307,200
山陰合同銀行	11,600	1,036.00	12,017,600
中国銀行	13,500	1,343.00	18,130,500
鳥取銀行	800	1,745.00	1,396,000
伊予銀行	27,900	866.00	24,161,400
百十四銀行	21,000	359.00	7,539,000
四国銀行	3,000	1,538.00	4,614,000
阿波銀行	16,000	669.00	10,704,000
大分銀行	1,100	4,120.00	4,532,000
宮崎銀行	1,300	3,465.00	4,504,500
佐賀銀行	1,200	2,541.00	3,049,200
十八銀行	12,000	282.00	3,384,000
沖縄銀行	1,900	4,355.00	8,274,500
琉球銀行	3,800	1,629.00	6,190,200
セブン銀行	73,300	378.00	27,707,400
みずほフィナンシャルグループ	2,655,000	199.40	529,407,000
山口フィナンシャルグループ	19,000	1,284.00	24,396,000
アクリーティブ	4,000	340.00	1,360,000
芙蓉総合リース	2,200	7,180.00	15,796,000
興銀リース	3,700	2,781.00	10,289,700
東京センチュリー	3,900	6,070.00	23,673,000
SBIホールディングス	22,100	2,498.00	55,205,800
日本証券金融	8,000	669.00	5,352,000
アイフル	32,800	374.00	12,267,200
長野銀行	700	1,892.00	1,324,400
名古屋銀行	1,600	4,000.00	6,400,000
北洋銀行	29,500	371.00	10,944,500
愛知銀行	700	5,390.00	3,773,000
第三銀行	1,100	1,660.00	1,826,000
中京銀行	900	2,318.00	2,086,200
大光銀行	700	2,370.00	1,659,000
愛媛銀行	2,700	1,274.00	3,439,800
みなと銀行	1,800	2,103.00	3,785,400
京葉銀行	17,000	496.00	8,432,000
関西アーバン銀行	2,700	1,419.00	3,831,300
栃木銀行	10,100	426.00	4,302,600
北日本銀行	600	3,010.00	1,806,000
東和銀行	3,400	1,392.00	4,732,800
福島銀行	1,800	803.00	1,445,400
リコーリース	1,500	3,605.00	5,407,500
イオンフィナンシャルサービス	13,900	2,536.00	35,250,400
アコム	39,300	479.00	18,824,700
ジャックス	2,400	2,526.00	6,062,400
オリエントコーポレーション	42,300	172.00	7,275,600
日立キャピタル	5,400	2,825.00	15,255,000
アプラスフィナンシャル	13,200	108.00	1,425,600
オリックス	130,300	1,919.50	250,110,850
三菱UFJリース	49,600	672.00	33,331,200
ジャフコ	2,800	5,510.00	15,428,000
トモニホールディングス	16,100	486.00	7,824,600
大和証券グループ本社	167,000	717.60	119,839,200
野村ホールディングス	336,200	653.00	219,538,600
岡三証券グループ	17,000	686.00	11,662,000
丸三証券	6,200	1,032.00	6,398,400
東洋証券	7,000	307.00	2,149,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,600	783.00	16,912,800
光世証券	1,000	1,401.00	1,401,000
水戸証券	6,100	387.00	2,360,700
いちよし証券	4,100	1,276.00	5,231,600

松井証券	9,600	1,065.00	10,224,000
S O M P Oホールディングス	38,300	4,070.00	155,881,000
だいがく証券ビジネス	2,100	673.00	1,413,300
日本取引所グループ	57,400	1,861.00	106,821,400
マネックスグループ	20,700	382.00	7,907,400
カブドットコム証券	12,500	376.00	4,700,000
極東証券	2,600	1,565.00	4,069,000
岩井コスモホールディングス	2,000	1,375.00	2,750,000
藍澤証券	3,700	802.00	2,967,400
フィデアホールディングス	19,000	198.00	3,762,000
池田泉州ホールディングス	20,700	423.00	8,756,100
アニコム ホールディングス	1,400	3,480.00	4,872,000
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	51,100	3,361.00	171,747,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	16,100	1,966.00	31,652,600
マネーパートナーズグループ	1,800	389.00	700,200
第一生命ホールディングス	110,500	2,142.00	236,691,000
東京海上ホールディングス	73,600	4,982.00	366,675,200
イー・ギャランティ	500	4,110.00	2,055,000
N E Cキャピタルソリューション	800	2,120.00	1,696,000
T & Dホールディングス	60,400	1,776.00	107,270,400
アドバンスクリエイト	700	1,967.00	1,376,900
三井不動産	97,600	2,578.50	251,661,600
三菱地所	145,400	1,896.50	275,751,100
平和不動産	3,400	2,026.00	6,888,400
東京建物	21,400	1,707.00	36,529,800
ダイビル	5,000	1,354.00	6,770,000
京阪神ビルディング	3,200	869.00	2,780,800
住友不動産	47,000	3,932.00	184,804,000
大京	3,100	2,231.00	6,916,100
テーオーシー	6,700	846.00	5,668,200
東京楽天地	300	5,120.00	1,536,000
レオパレス 2 1	23,300	806.00	18,779,800
スターツコーポレーション	2,700	2,868.00	7,743,600
フジ住宅	2,500	879.00	2,197,500
空港施設	2,200	633.00	1,392,600
明和地所	1,700	811.00	1,378,700
ゴールドクレスト	1,500	2,214.00	3,321,000
リログループ	10,300	2,993.00	30,827,900
日本エスリード	800	2,195.00	1,756,000
日神不動産	2,600	803.00	2,087,800
日本エスコン	3,500	1,058.00	3,703,000
タカラレーベン	9,200	488.00	4,489,600
サンヨーハウジング名古屋	1,100	1,245.00	1,369,500
イオンモール	12,600	2,220.00	27,972,000
ファースト住建	800	1,748.00	1,398,400
カチタス	2,000	3,220.00	6,440,000
東祥	1,200	3,875.00	4,650,000
トーセイ	2,400	1,351.00	3,242,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	12,100	1,313.00	15,887,300
サンフロンティア不動産	2,400	1,241.00	2,978,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,600	862.00	1,379,200
ランドビジネス	4,300	333.00	1,431,900
グランディハウス	2,900	478.00	1,386,200
東武鉄道	21,200	3,335.00	70,702,000
相鉄ホールディングス	6,300	2,879.00	18,137,700
東京急行電鉄	53,800	1,736.00	93,396,800
京浜急行電鉄	27,100	1,963.00	53,197,300
小田急電鉄	29,500	2,233.00	65,873,500
京王電鉄	11,100	4,740.00	52,614,000

京成電鉄	13,800	3,535.00	48,783,000
富士急行	2,700	2,862.00	7,727,400
新京成電鉄	300	2,272.00	681,600
東日本旅客鉄道	35,600	10,310.00	367,036,000
西日本旅客鉄道	17,900	7,545.00	135,055,500
東海旅客鉄道	17,700	20,010.00	354,177,000
西武ホールディングス	25,300	1,881.00	47,589,300
鴻池運輸	2,800	1,935.00	5,418,000
西日本鉄道	5,500	2,911.00	16,010,500
ハマキョウレックス	1,400	3,500.00	4,900,000
サカイ引越センター	1,000	5,420.00	5,420,000
近鉄グループホールディングス	18,800	4,185.00	78,678,000
阪急阪神ホールディングス	25,000	3,995.00	99,875,000
南海電気鉄道	8,900	2,756.00	24,528,400
京阪ホールディングス	8,400	3,395.00	28,518,000
神戸電鉄	400	3,955.00	1,582,000
名古屋鉄道	14,600	2,749.00	40,135,400
山陽電気鉄道	1,400	2,787.00	3,901,800
トランコム	500	7,120.00	3,560,000
日本通運	7,400	7,120.00	52,688,000
ヤマトホールディングス	32,900	2,707.00	89,060,300
山九	4,800	5,230.00	25,104,000
日新	1,600	2,793.00	4,468,800
丸運	4,000	352.00	1,408,000
丸全昭和運輸	7,000	519.00	3,633,000
センコーグループホールディングス	11,300	742.00	8,384,600
トナミホールディングス	500	5,340.00	2,670,000
ニッコンホールディングス	7,100	2,739.00	19,446,900
福山通運	2,700	4,585.00	12,379,500
セイノーホールディングス	14,100	1,779.00	25,083,900
神奈川中央交通	500	3,690.00	1,845,000
日立物流	4,100	2,639.00	10,819,900
丸和運輸機関	1,000	3,745.00	3,745,000
C & F ロジホールディングス	2,100	1,580.00	3,318,000
日本郵船	15,700	2,322.00	36,455,400
商船三井	11,900	3,395.00	40,400,500
川崎汽船	8,700	2,638.00	22,950,600
N S ユナイテッド海運	900	2,288.00	2,059,200
飯野海運	9,600	567.00	5,443,200
九州旅客鉄道	15,700	3,355.00	52,673,500
S G ホールディングス	13,300	2,290.00	30,457,000
日本航空	34,800	4,031.00	140,278,800
A N A ホールディングス	36,800	4,334.00	159,491,200
パスコ	2,000	337.00	674,000
西本W i s m e t t a c ホールディングス	400	4,290.00	1,716,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,490.00	1,341,000
Genky Drug Stores	800	3,360.00	2,688,000
三菱倉庫	6,500	2,521.00	16,386,500
三井倉庫ホールディングス	11,000	357.00	3,927,000
住友倉庫	13,000	734.00	9,542,000
澁澤倉庫	1,000	1,888.00	1,888,000
ヤマタネ	1,000	1,974.00	1,974,000
東陽倉庫	4,000	348.00	1,392,000
乾汽船	1,700	825.00	1,402,500
日本トランスシティ	5,000	439.00	2,195,000
ケイヒン	800	1,744.00	1,395,200
中央倉庫	1,300	1,094.00	1,422,200
安田倉庫	1,700	982.00	1,669,400
東洋埠頭	800	1,756.00	1,404,800



宇徳	3,000	509.00	1,527,000
上組	11,800	2,364.00	27,895,200
キムラユニティー	1,300	1,126.00	1,463,800
キューソー流通システム	500	2,575.00	1,287,500
近鉄エクスプレス	3,500	2,105.00	7,367,500
エーアイテイー	1,300	1,150.00	1,495,000
日本コンセプト	300	1,516.00	454,800
東京放送ホールディングス	11,700	2,325.00	27,202,500
日本テレビホールディングス	17,900	2,020.00	36,158,000
朝日放送	1,900	892.00	1,694,800
テレビ朝日ホールディングス	5,300	2,269.00	12,025,700
スカパーJ S A Tホールディングス	14,800	490.00	7,252,000
テレビ東京ホールディングス	1,600	2,667.00	4,267,200
日本BS放送	1,000	1,352.00	1,352,000
ビジョン	500	2,789.00	1,394,500
USEN-NEXT HOLDINGS	1,400	1,034.00	1,447,600
ワイヤレスゲート	1,200	1,153.00	1,383,600
コネクシオ	1,400	2,311.00	3,235,400
日本通信	17,500	119.00	2,082,500
日本電信電話	139,500	4,754.00	663,183,000
KDDI	175,100	2,623.50	459,374,850
光通信	2,300	15,500.00	35,650,000
NTTドコモ	143,900	2,701.50	388,745,850
エムティーアイ	2,600	641.00	1,666,600
GMOインターネット	7,100	1,872.00	13,291,200
カドカワ	5,700	1,197.00	6,822,900
学研ホールディングス	700	5,090.00	3,563,000
ゼンリン	2,300	3,495.00	8,038,500
昭文社	1,800	769.00	1,384,200
インプレスホールディングス	6,000	232.00	1,392,000
東京電力ホールディングス	158,200	412.00	65,178,400
中部電力	60,600	1,433.00	86,839,800
関西電力	80,800	1,292.50	104,434,000
中国電力	27,400	1,249.00	34,222,600
北陸電力	19,400	842.00	16,334,800
東北電力	46,400	1,391.00	64,542,400
四国電力	17,800	1,223.00	21,769,400
九州電力	43,800	1,216.00	53,260,800
北海道電力	19,900	647.00	12,875,300
沖縄電力	3,200	2,894.00	9,260,800
電源開発	15,800	2,795.00	44,161,000
エフオン	1,100	1,168.00	1,284,800
イーレックス	3,100	801.00	2,483,100
東京瓦斯	42,300	2,683.50	113,512,050
大阪瓦斯	38,400	2,157.00	82,828,800
東邦瓦斯	9,800	3,255.00	31,899,000
北海道瓦斯	5,000	298.00	1,490,000
広島ガス	4,100	406.00	1,664,600
西部瓦斯	2,400	2,839.00	6,813,600
静岡ガス	5,600	916.00	5,129,600
メタウォーター	1,100	3,100.00	3,410,000
アイネット	1,100	1,590.00	1,749,000
松竹	1,300	15,330.00	19,929,000
東宝	12,800	3,495.00	44,736,000
エイチ・アイ・エス	3,000	4,010.00	12,030,000
東映	700	11,550.00	8,085,000
ラックランド	700	2,124.00	1,486,800
エヌ・ティ・ティ・データ	60,400	1,113.00	67,225,200
共立メンテナンス	3,400	4,605.00	15,657,000
イチネンホールディングス	2,100	1,545.00	3,244,500

建設技術研究所	1,300	1,322.00	1,718,600
スペース	1,200	1,385.00	1,662,000
アインホールディングス	2,600	6,800.00	17,680,000
燦ホールディングス	500	2,645.00	1,322,500
東京テアトル	1,000	1,467.00	1,467,000
ビジネスブレイン太田昭和	800	1,958.00	1,566,400
ナガワ	400	4,295.00	1,718,000
よみうりランド	400	4,740.00	1,896,000
東京都競馬	1,400	3,745.00	5,243,000
常磐興産	800	1,898.00	1,518,400
カナモト	2,900	3,390.00	9,831,000
東京ドーム	7,700	991.00	7,630,700
D T S	2,000	3,820.00	7,640,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,000	4,440.00	39,960,000
シーイーシー	1,200	3,245.00	3,894,000
カブコン	4,200	4,470.00	18,774,000
西尾レントオール	1,700	3,330.00	5,661,000
アイ・エス・ビー	1,100	1,345.00	1,479,500
日本空港ビルデング	5,700	4,030.00	22,971,000
トランス・コスモス	2,100	2,921.00	6,134,100
乃村工藝社	4,400	2,171.00	9,552,400
ジャステック	1,100	1,310.00	1,441,000
S C S K	4,500	4,275.00	19,237,500
藤田観光	800	3,230.00	2,584,000
K N T - C Tホールディングス	1,200	1,797.00	2,156,400
日本管財	2,000	2,123.00	4,246,000
トーカイ	1,800	2,695.00	4,851,000
白洋舎	400	3,360.00	1,344,000
セコム	20,100	7,889.00	158,568,900
日本システムウエア	600	2,587.00	1,552,200
セントラル警備保障	900	2,517.00	2,265,300
アイネス	2,500	1,075.00	2,687,500
丹青社	3,900	1,057.00	4,122,300
メイテック	2,200	6,140.00	13,508,000
T K C	1,800	4,615.00	8,307,000
富士ソフト	2,700	4,010.00	10,827,000
応用地質	2,100	1,452.00	3,049,200
船井総研ホールディングス	3,900	2,152.00	8,392,800
N S D	3,200	2,174.00	6,956,800
進学会ホールディングス	2,400	598.00	1,435,200
丸紅建材リース	6,000	233.00	1,398,000
コナミホールディングス	7,900	5,740.00	45,346,000
いであ	1,300	1,118.00	1,453,400
学究社	900	1,637.00	1,473,300
ベネッセホールディングス	6,900	3,975.00	27,427,500
イオンディライト	2,300	3,820.00	8,786,000
ナック	1,500	952.00	1,428,000
福井コンピュータホールディングス	600	2,462.00	1,477,200
ニチイ学館	3,600	1,220.00	4,392,000
ダイセキ	3,200	3,100.00	9,920,000
ステップ	800	1,813.00	1,450,400
日鉄住金物産	1,500	6,140.00	9,210,000
泉州電業	600	2,888.00	1,732,800
元気寿司	500	2,762.00	1,381,000
トラスコ中山	4,100	2,857.00	11,713,700
ヤマダ電機	65,400	675.00	44,145,000
オートバックスセブン	7,800	2,105.00	16,419,000
モリト	1,600	958.00	1,532,800
アークランドサカモト	3,300	1,779.00	5,870,700

ニトリホールディングス	7,700	17,540.00	135,058,000
グルメ杵屋	1,000	1,158.00	1,158,000
愛眼	2,900	475.00	1,377,500
吉野家ホールディングス	6,400	1,972.00	12,620,800
加藤産業	3,100	3,715.00	11,516,500
イノテック	1,700	1,267.00	2,153,900
イエローハット	1,800	3,285.00	5,913,000
松屋フーズ	900	3,920.00	3,528,000
JBC Cホールディングス	1,500	1,076.00	1,614,000
JKホールディングス	2,000	888.00	1,776,000
サガミチェーン	2,600	1,383.00	3,595,800
日伝	1,600	2,182.00	3,491,200
関西スーパーマーケット	1,500	1,136.00	1,704,000
ミロク情報サービス	1,700	3,255.00	5,533,500
北沢産業	5,000	284.00	1,420,000
杉本商事	1,100	1,847.00	2,031,700
因幡電機産業	2,600	5,000.00	13,000,000
王将フードサービス	1,400	5,040.00	7,056,000
プレナス	2,200	2,121.00	4,666,200
ミニストップ	1,400	2,176.00	3,046,400
アークス	3,700	2,617.00	9,682,900
パローホールディングス	4,500	2,968.00	13,356,000
バイテックホールディングス	900	1,680.00	1,512,000
東テク	600	2,428.00	1,456,800
ミスミグループ本社	22,700	3,150.00	71,505,000
藤久	800	1,670.00	1,336,000
ベルク	900	6,130.00	5,517,000
大 庄	1,000	1,727.00	1,727,000
タキヒヨー	600	2,301.00	1,380,600
ファーストリテイリング	3,300	42,940.00	141,702,000
ソフトバンクグループ	88,000	8,873.00	780,824,000
蔵王産業	800	1,873.00	1,498,400
スズケン	8,900	4,305.00	38,314,500
サンドラッグ	8,300	4,895.00	40,628,500
サックスパー ホールディングス	1,800	1,151.00	2,071,800
ジェコス	1,300	1,259.00	1,636,700
ルネサスイーストン	1,900	740.00	1,406,000
ペルーナ	4,800	1,279.00	6,139,200
合計	23,939,100		49,912,570,510

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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,600,610	5,688,514
コール・ローン	247,054,430	212,625,234
国債証券	28,743,836,790	29,279,432,146
未収利息	104,558,699	116,245,476
前払費用	4,958,929	20,615,604
流動資産合計	29,104,009,458	29,634,606,974
資産合計	29,104,009,458	29,634,606,974
負債の部		
流動負債		
未払解約金	139,598,817	42,075,563
その他未払費用	358	469
流動負債合計	139,599,175	42,076,032
負債合計	139,599,175	42,076,032
純資産の部		
元本等		
元本	21,663,216,336	21,904,812,960
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,301,193,947	7,687,717,982
純資産合計	28,964,410,283	29,592,530,942
負債純資産合計	29,104,009,458	29,634,606,974

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2017年2月21日現在）	（2018年2月21日現在）
1. 受益権総口数	21,663,216,336口	21,904,812,960口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3370円 (13,370円)	1.3510円 (13,510円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 2016年2月23日 至 2017年2月21日）	（自 2017年2月22日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,554,380	14,995,950
合計	1,554,380	14,995,950

(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。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	18,912,024,491円	21,663,216,336円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	11,716,936,730円	8,146,421,065円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	8,965,744,885円	7,904,824,441円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券インデックス S A (適格機関投資家限定)	1,431,394,708円	1,453,847,947円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,213,856,650円	7,180,129,249円
ニッセイ日本バランス(標準型) S A (適格機関投資家限定)	16,344,307円	4,587,911円
ニッセイ日本バランス(成長型) S A (適格機関投資家限定)	3,900,385円	2,935,985円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,456,203,801円	2,680,521,884円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,265,859,451円	4,480,747,675円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	930,819,366円	1,192,400,971円
ニッセイ/パナゴラ・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)	143,598,250円	56,486,393円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型) S A (適格機関投資家限定)	297,207,416円	82,197,490円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型) S A (適格機関投資家限定)	132,975,984円	46,261,010円
ニッセイ厚生年金型バランス運用(現物型) DB (適格機関投資家限定)	2,923,997,739円	- 円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	3,602,521,350円	4,334,071,926円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	244,536,929円	390,624,519円
計	21,663,216,336円	21,904,812,960円



## 附属明細表(2018年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第373回 利付国債(2年)	152,000,000	152,384,226	
	第378回 利付国債(2年)	713,000,000	715,524,020	
	第121回 利付国債(5年)	271,000,000	272,024,380	
	第123回 利付国債(5年)	253,000,000	254,206,810	
	第125回 利付国債(5年)	64,000,000	64,362,880	
	第131回 利付国債(5年)	433,000,000	436,715,140	
	第4回 利付国債(40年)	118,000,000	165,085,540	
	第8回 利付国債(40年)	376,000,000	437,994,880	
	第303回 利付国債(10年)	2,148,000,000	2,200,131,960	
	第306回 利付国債(10年)	473,000,000	488,008,290	
	第310回 利付国債(10年)	2,052,000,000	2,111,569,560	
	第321回 利付国債(10年)	2,107,000,000	2,203,015,990	
	第322回 利付国債(10年)	378,000,000	393,679,440	
	第328回 利付国債(10年)	729,000,000	754,996,140	
	第333回 利付国債(10年)	1,611,000,000	1,676,261,610	
	第334回 利付国債(10年)	646,000,000	673,048,020	
	第338回 利付国債(10年)	138,000,000	142,353,900	
	第342回 利付国債(10年)	1,523,000,000	1,535,899,810	
	第346回 利付国債(10年)	126,000,000	126,739,620	
	第18回 利付国債(30年)	260,000,000	340,288,000	
	第26回 利付国債(30年)	47,000,000	62,929,240	
	第30回 利付国債(30年)	717,000,000	958,428,240	
	第33回 利付国債(30年)	171,000,000	219,904,290	
	第38回 利付国債(30年)	1,214,000,000	1,523,145,100	
	第54回 利付国債(30年)	724,000,000	730,892,480	
	第49回 利付国債(20年)	507,000,000	541,805,550	
	第55回 利付国債(20年)	1,101,000,000	1,196,247,510	
	第68回 利付国債(20年)	97,000,000	110,385,030	
	第76回 利付国債(20年)	122,000,000	138,776,220	
	第85回 利付国債(20年)	746,000,000	872,752,860	
	第88回 利付国債(20年)	512,000,000	609,725,440	
	第94回 利付国債(20年)	78,000,000	92,601,600	
	第100回 利付国債(20年)	1,153,000,000	1,399,234,680	
	第108回 利付国債(20年)	181,000,000	215,994,540	
	第110回 利付国債(20年)	14,000,000	17,055,780	
	第125回 利付国債(20年)	1,632,000,000	2,050,297,920	
	第126回 利付国債(20年)	377,000,000	464,011,600	
	第133回 利付国債(20年)	228,000,000	276,135,360	
	第143回 利付国債(20年)	6,000,000	7,139,940	
	第146回 利付国債(20年)	359,000,000	433,129,910	
第152回 利付国債(20年)	1,962,000,000	2,214,548,640		
国債証券 合計		26,519,000,000	29,279,432,146	
合計		26,519,000,000	29,279,432,146	

## 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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,272,188,626	2,506,798,630
金銭信託	14,297,378	25,199,972
コール・ローン	981,009,069	941,924,381
株式	68,008,375,861	112,897,598,099
投資証券	1,732,967,961	2,567,665,403
派生商品評価勘定	56,061,353	29,048,909
未収入金	596,026	28,614
未収配当金	100,462,967	152,728,671
差入委託証拠金	713,182,031	1,187,028,384
流動資産合計	72,879,141,272	120,308,021,063
資産合計	72,879,141,272	120,308,021,063
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	319,466	69,682,443
未払金	-	2,031,088,863
未払解約金	233,992,520	79,401,209
その他未払費用	1,142	6,700
流動負債合計	234,313,128	2,180,179,215
負債合計	234,313,128	2,180,179,215
純資産の部		
元本等		
元本	48,732,895,288	70,849,080,074
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	23,911,932,856	47,278,761,774
純資産合計	72,644,828,144	118,127,841,848
負債純資産合計	72,879,141,272	120,308,021,063

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、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。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2017年2月21日現在）	（2018年2月21日現在）
1. 受益権総口数	48,732,895,288口	70,849,080,074口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4907円 (14,907円)	1.6673円 (16,673円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 2016年2月23日 至 2017年2月21日）	（自 2017年2月22日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。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、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (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。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,892,128,362	2,983,569,311
投資証券	97,253,740	239,515,875
合計	4,989,382,102	2,744,053,436

(デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	(2017年2月21日 現在)				(2018年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	2,221,179,076	-	2,244,277,310	23,098,234
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,658,732,021	-	1,678,456,780	19,724,759
イギリス・ポンド	-	-	-	-	161,391,769	-	162,841,000	1,449,231
ユーロ	-	-	-	-	401,055,286	-	402,979,530	1,924,244
買 建	382,925,050	-	384,811,200	1,886,150	3,573,870,368	-	3,562,222,609	11,647,759
アメリカ・ドル	233,684,370	-	234,779,400	1,095,030	2,559,463,683	-	2,550,444,542	9,019,141
イギリス・ポンド	78,532,720	-	79,172,800	640,080	308,075,691	-	307,170,500	905,191
シンガポール・ドル	-	-	-	-	15,145,615	-	15,208,463	62,848
ユーロ	70,707,960	-	70,859,000	151,040	653,973,880	-	652,171,350	1,802,530
香港・ドル	-	-	-	-	37,211,499	-	37,227,754	16,255
合計	382,925,050	-	384,811,200	1,886,150	5,795,049,444	-	5,806,499,919	34,745,993

## (注) 1. 時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	(2017年2月21日 現在)				(2018年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	2,618,145,073	-	2,672,000,810	53,855,737	2,542,378,757	-	2,536,491,218	5,887,539
合計	2,618,145,073	-	2,672,000,810	53,855,737	2,542,378,757	-	2,536,491,218	5,887,539

## (注) 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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (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。



(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	39,165,529,544円	48,732,895,288円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	29,482,977,047円	37,920,852,583円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	19,915,611,303円	15,804,667,797円
元本の内訳		
ファンド名		
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	293,238,621円	495,246,552円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	1,972,920,724円	2,487,198,234円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,686,859,297円	1,986,286,663円
ニッセイ外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	12,261,760,498円	11,998,588,461円
ニッセイ厚生年金型バランス運用DB(適格機関投資家限定)	1,813,409,159円	-円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	28,401,997,926円	47,177,054,577円
DCニッセイ外国株式インデックス	2,076,213,892円	6,391,706,768円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	226,235,517円	293,662,765円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	259,654円	3,038,935円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	-円	833,478円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	-円	222,445円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	-円	337,631円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	-円	500,567円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	-円	7,561,367円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	-円	3,797,240円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	-円	587,649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)	-円	635,751円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	-円	1,820,991円
計	48,732,895,288円	70,849,080,074円

附属明細表(2018年2月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	17,273	235.07	4,060,364.11	
	ABBOTT LABORATORIES	50,296	59.12	2,973,499.52	
	ABBVIE INC	46,159	117.98	5,445,838.82	
	ACCENTURE PLC	17,878	161.44	2,886,224.32	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	20,766	70.84	1,471,063.44	
	ACUITY BRANDS INC	1,197	148.81	178,125.57	
	ADOBE SYSTEMS INC	14,292	202.98	2,900,990.16	
	ADVANCE AUTO PARTS	2,092	105.35	220,392.20	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	23,295	12.02	280,005.90	
	AERCAP HOLDINGS NV	3,964	51.58	204,463.12	
	AES CORP	19,054	10.40	198,161.60	
	AETNA INC	9,602	178.03	1,709,444.06	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,614	187.30	302,302.20	
	AFLAC INC	11,404	88.92	1,014,043.68	

AGCO CORP	1,807	66.40	119,984.80	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,298	71.08	660,901.84	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,296	162.91	1,025,681.36	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,967	66.77	331,646.59	
ALBEMARLE CORP	3,197	114.58	366,312.26	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,460	118.85	767,771.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,206	255.45	563,522.70	
ALKERMES PLC	4,439	64.75	287,425.25	
ALLEGHANY CORP	442	589.09	260,377.78	
ALLEGION PLC	2,726	85.66	233,509.16	
ALLERGAN PLC	9,680	160.59	1,554,511.20	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,455	244.57	355,849.35	
ALLIANT ENERGY CORP	6,782	39.14	265,447.48	
ALLSTATE CORP	10,446	93.65	978,267.90	
ALLY FINANCIAL INC	12,983	28.70	372,612.10	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,558	120.83	309,083.14	
ALPHABET INC-CL A	8,628	1,103.59	9,521,774.52	
ALPHABET INC-CL C	9,065	1,102.46	9,993,799.90	
ALTRIA GROUP INC	55,521	64.19	3,563,892.99	
AMAZON.COM INC	11,823	1,468.35	17,360,302.05	
AMERCO	216	354.50	76,572.00	
AMEREN CORPORATION	7,079	55.08	389,911.32	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,576	51.72	184,950.72	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	14,272	66.37	947,232.64	
AMERICAN EXPRESS CO	21,750	97.19	2,113,882.50	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,093	111.81	234,018.33	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	26,088	60.04	1,566,323.52	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,214	79.85	416,337.90	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,333	158.76	687,907.08	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,758	99.94	475,514.52	
AMERITRADE HOLDING CORP	7,364	56.04	412,678.56	
AMETEK INC	6,668	75.72	504,900.96	
AMGEN INC	21,112	182.98	3,863,073.76	
AMPHENOL CORP-CL A	8,850	90.36	799,686.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	16,203	59.25	960,027.75	
ANALOG DEVICES INC	10,636	88.41	940,328.76	
ANDEAVOR	4,324	94.18	407,234.32	
ANSYS INC	2,450	167.81	411,134.50	
ANTERO RESOURCES CORP	6,270	18.56	116,371.20	
ANTHEM INC	7,600	232.22	1,764,872.00	
AON PLC	7,592	140.72	1,068,346.24	
APACHE CORP	10,961	38.30	419,806.30	
APPLE INC	149,560	171.85	25,701,886.00	
APPLIED MATERIALS INC	30,877	56.66	1,749,490.82	
APTIV PLC	7,732	92.34	713,972.88	
ARAMARK	7,080	41.42	293,253.60	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,786	88.71	335,856.06	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	16,243	42.57	691,464.51	
ARCONIC INC	11,515	24.86	286,262.90	
ARISTA NETWORKS INC	1,370	249.65	342,020.50	

ARROW ELECTRONICS INC	2,500	81.95	204,875.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,208	69.31	360,966.48
ASSURANT INC	1,524	88.58	134,995.92
AT&T INC	178,093	36.77	6,548,479.61
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	3,019	48.45	146,270.55
ATMOS ENERGY CORP	3,113	82.07	255,483.91
AUTODESK INC	5,731	114.27	654,881.37
AUTOLIV INC	2,518	144.78	364,556.04
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	12,857	115.41	1,483,826.37
AUTONATION INC	1,800	51.98	93,564.00
AUTOZONE INC	812	713.23	579,142.76
AVERY DENNISON CORP	2,558	117.08	299,490.64
AVNET INC	3,474	42.23	146,707.02
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,249	30.99	193,656.51
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,300	50.80	116,840.00
BAKER HUGHES A GE CO	11,719	26.44	309,850.36
BALL CORP	9,717	39.21	381,003.57
BANK OF AMERICA CORP	290,064	31.93	9,261,743.52
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,856	56.42	1,684,475.52
BAXTER INTERNATIONAL INC	14,200	67.04	951,968.00
BB&T CORPORATION	23,302	54.60	1,272,289.20
BECTON DICKINSON & CO	7,659	219.82	1,683,601.38
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	36,671	203.05	7,446,046.55
BEST BUY CO INC	7,928	71.92	570,181.76
BIOGEN INC	6,119	287.45	1,758,906.55
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,079	83.85	425,874.15
BLACKROCK INC	3,488	542.60	1,892,588.80
BOEING CO	16,262	353.35	5,746,177.70
BORGWARNER INC	6,103	52.26	318,942.78
BOSTON SCIENTIFIC CORP	39,753	26.83	1,066,572.99
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,370	57.66	136,654.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	47,475	67.35	3,197,441.25
BROADCOM LTD	11,768	249.62	2,937,528.16
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3,386	98.59	333,825.74
BROWN-FORMAN CORP -CL B	5,914	68.31	403,985.34
BUNGE LIMITED	4,058	76.07	308,692.06
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,219	89.97	379,583.43
CA Inc	9,100	35.06	319,046.00
CABOT OIL & GAS CORP	13,377	23.92	319,977.84
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	8,108	40.17	325,698.36
CAMPBELL SOUP CO	5,245	46.08	241,689.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,982	98.46	1,376,667.72
CARDINAL HEALTH INC	9,157	68.84	630,367.88
CARMAX INC	5,318	63.31	336,682.58
CARNIVAL CORP	10,021	69.45	695,958.45
CATERPILLAR INC	17,126	155.56	2,664,120.56
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,918	110.78	323,256.04
CBRE GROUP INC	8,794	44.90	394,850.60
CBS CORP-CL B	10,098	56.25	568,012.50

CDK GLOBAL INC	3,688	69.06	254,693.28	
CDW CORP/DE	4,495	70.91	318,740.45	
CELANESE CORP-SERIES A	3,975	102.38	406,960.50	
CELGENE CORP	22,652	93.85	2,125,890.20	
CENTENE CORP	4,995	100.26	500,798.70	
CENTERPOINT ENERGY INC	12,000	26.73	320,760.00	
CENTURYLINK INC	27,935	18.47	515,959.45	
CERNER CORP	8,640	63.00	544,320.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,780	41.82	283,539.60	
CHARLES SCHWAB CORP	34,868	52.34	1,824,991.12	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	5,621	358.77	2,016,646.17	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	3,768	102.21	385,127.28	
CHEMOURS CO/THE - W/I	5,342	50.08	267,527.36	
CHENIERE ENERGY INC	5,906	58.03	342,725.18	
CHEVRON CORP	54,869	110.98	6,089,361.62	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	726	317.57	230,555.82	
CHUBB LTD	13,444	145.44	1,955,295.36	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,204	48.38	348,529.52	
CIGNA CORP	7,287	192.60	1,403,476.20	
CIMAREX ENERGY CO	2,731	98.37	268,648.47	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,467	75.69	338,107.23	
CINTAS CORP	2,595	166.65	432,456.75	
CISCO SYSTEMS INC	144,848	44.06	6,382,002.88	
CIT GROUP INC	3,853	53.84	207,445.52	
CITIGROUP INC	78,833	76.46	6,027,571.18	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,446	46.09	665,816.14	
CITRIX SYSTEMS INC	4,375	91.78	401,537.50	
CLOROX CO	3,737	128.78	481,250.86	
CME GROUP INC	9,810	163.35	1,602,463.50	
CMS ENERGY CORP	8,290	43.36	359,454.40	
COCA-COLA CO	117,282	43.99	5,159,235.18	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,346	38.51	244,384.46	
COGNEX CORP	5,010	56.44	282,764.40	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	17,089	81.54	1,393,437.06	
COLGATE-PALMOLIVE CO	24,243	70.03	1,697,737.29	
COMCAST CORP	136,342	39.47	5,381,418.74	
COMERICA INC	5,084	97.20	494,164.80	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	5,538	38.78	214,763.64	
CONAGRA BRANDS INC	12,003	36.08	433,068.24	
CONCHO RESOURCES INC	4,277	147.15	629,360.55	
CONOCOPHILLIPS	35,137	54.84	1,926,913.08	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,005	76.36	687,621.80	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,979	217.33	1,082,086.07	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,639	54.73	144,432.47	
COOPER COS INC/THE	1,414	230.37	325,743.18	
CORNING INC	26,104	29.65	773,983.60	
COSTAR GROUP INC	1,037	351.84	364,858.08	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,687	188.12	2,386,678.44	
COTY INC-CL A	14,096	21.19	298,694.24	
CROWN HOLDINGS INC	3,888	50.58	196,655.04	
CSX CORP	26,632	54.59	1,453,840.88	

CUMMINS INC	4,595	166.82	766,537.90
CVS HEALTH CORP	29,411	70.66	2,078,181.26
DANAHER CORP	18,093	96.85	1,752,307.05
DARDEN RESTAURANTS INC	3,590	94.90	340,691.00
DAVITA INC	4,446	72.77	323,535.42
DEERE & CO	7,925	164.77	1,305,802.25
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,866	69.82	409,564.12
DELTA AIR LINES INC	5,388	52.47	282,708.36
DENTSPLY SIRONA INC	6,629	58.15	385,476.35
DEVON ENERGY CORPORATION	14,409	34.65	499,271.85
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,541	122.81	312,060.21
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,776	79.63	858,092.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS- A	4,102	24.31	99,719.62
DISCOVERY COMMUNICATIONS- C	6,236	23.04	143,677.44
DISH NETWORK CORP	6,634	44.57	295,677.38
DOLLAR GENERAL CORP	7,897	94.56	746,740.32
DOLLAR TREE INC	6,854	106.81	732,075.74
DOMINION ENERGY INC	18,667	74.75	1,395,358.25
DOMINO'S PIZZA INC	1,400	221.49	310,086.00
DOVER CORP	4,507	100.21	451,646.47
DOWDUPONT INC	67,522	71.62	4,835,925.64
DR HORTON INC	10,298	45.16	465,057.68
DR PEPPER SNAPPLE GROUP- W/I	5,269	116.06	611,520.14
DTE ENERGY COMPANY	5,229	103.20	539,632.80
DUKE ENERGY CORP	20,304	75.69	1,536,809.76
DXC TECHNOLOGY CO	8,254	100.67	830,930.18
E*TRADE FINANCIAL	7,925	52.01	412,179.25
EAST WEST BANCORP INC	4,128	66.38	274,016.64
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,189	100.29	420,114.81
EATON CORP PLC	12,846	81.71	1,049,646.66
EATON VANCE CORP	3,277	55.84	182,987.68
EBAY INC	29,439	43.39	1,277,358.21
ECOLAB INC	7,552	131.72	994,749.44
EDISON INTERNATIONAL	9,470	60.31	571,135.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,118	134.32	821,769.76
ELECTRONIC ARTS INC	8,935	126.34	1,128,847.90
ELI LILLY & CO	28,688	77.55	2,224,754.40
EMERSON ELECTRIC CO	18,500	71.07	1,314,795.00
ENTERGY CORP	5,213	75.43	393,216.59
ENVISION HEALTHCARE CORP	3,444	37.39	128,771.16
EOG RESOURCES INC	16,652	107.96	1,797,749.92
EQT CORP	7,288	51.40	374,603.20
EQUIFAX INC	3,483	115.55	402,460.65
ESTEE LAUDER COS INC	6,471	139.35	901,733.85
EVEREST RE GROUP LTD	1,168	243.26	284,127.68
EVERSOURCE ENERGY	9,227	58.17	536,734.59
EXELON CORP	27,835	37.68	1,048,822.80
EXPEDIA INC	3,616	104.10	376,425.60
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	5,506	61.93	340,986.58
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	16,709	76.05	1,270,719.45
EXXON MOBIL CORP	122,637	75.75	9,289,752.75

F5 NETWORKS INC	1,851	143.04	264,767.04
FACEBOOK INC-A	68,656	176.01	12,084,142.56
FASTENAL CO	8,316	54.24	451,059.84
FEDEX CORP	7,456	240.98	1,796,746.88
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	9,639	97.32	938,067.48
FIFTH THIRD BANCORP	21,229	33.21	705,015.09
FIRST DATA CORP- CLASS A	12,612	15.82	199,521.84
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,559	95.29	434,427.11
FIRSTENERGY CORP	12,936	32.80	424,300.80
FISERV INC	6,111	141.71	865,989.81
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,662	199.45	530,935.90
FLEX LTD	15,446	17.91	276,637.86
FLIR SYSTEMS INC	3,903	48.82	190,544.46
FLOWSERVE CORP	3,713	43.70	162,258.10
FLUOR CORP	3,959	58.04	229,780.36
FMC CORP	3,876	83.55	323,839.80
FNF GROUP	7,455	38.38	286,122.90
FORD MOTOR CO	107,261	10.63	1,140,184.43
FORTINET INC	4,251	49.06	208,554.06
FORTIVE CORP	9,038	75.85	685,532.30
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	4,448	63.83	283,915.84
FRANKLIN RESOURCES INC	9,561	38.86	371,540.46
FREEPORT-MCMORAN INC	39,752	18.43	732,629.36
GAP INC	6,644	31.61	210,016.84
GARMIN LTD	3,454	64.86	224,026.44
GARTNER INC	2,646	115.97	306,856.62
GENERAL DYNAMICS CORP	7,356	221.83	1,631,781.48
GENERAL ELECTRIC CO	250,646	14.74	3,694,522.04
GENERAL MILLS INC	16,689	55.95	933,749.55
GENERAL MOTORS CO	37,949	40.77	1,547,180.73
GENUINE PARTS CO	4,230	94.67	400,454.10
GILEAD SCIENCES INC	37,770	80.94	3,057,103.80
GLOBAL PAYMENTS INC	4,432	114.73	508,483.36
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,645	264.89	2,819,754.05
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	7,140	29.48	210,487.20
H&R BLOCK INC	5,912	27.17	160,629.04
HALLIBURTON CO	25,144	47.16	1,185,791.04
HANESBRANDS INC	10,407	19.93	207,411.51
HARLEY-DAVIDSON INC	4,958	46.64	231,241.12
HARRIS CORP	3,509	157.01	550,948.09
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	10,489	53.82	564,517.98
HASBRO INC	3,260	97.77	318,730.20
HCA HEALTHCARE INC	8,399	101.00	848,299.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,787	36.16	209,257.92
HELMERICH & PAYNE	3,049	64.51	196,690.99
HENRY SCHEIN INC	4,572	67.97	310,758.84
HERSHEY CO/THE	4,176	99.90	417,182.40
HESS CORP	8,252	45.84	378,271.68
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	46,799	16.52	773,119.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,658	84.31	477,025.98
HOLLYFRONTIER CORP	4,829	45.98	222,037.42
HOLOGIC INC	8,134	38.87	316,168.58
HOME DEPOT INC	34,138	186.71	6,373,905.98

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,903	154.34	3,226,169.02	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,300	7.00	240,100.00	
HORMEL FOODS CORP	8,359	33.80	282,534.20	
HP INC	48,727	21.39	1,042,270.53	
HUMANA INC	4,183	267.33	1,118,241.39	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,366	15.90	498,719.40	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,310	266.11	348,604.10	
IAC/INTERACTIVECORP	2,144	149.83	321,235.52	
IDEX CORP	2,217	136.83	303,352.11	
IDEX LABORATORIES INC	2,540	183.16	465,226.40	
IHS MARKIT LTD	11,544	46.60	537,950.40	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	8,963	161.34	1,446,090.42	
ILLUMINA INC	4,229	226.57	958,164.53	
INCYTE CORP	5,067	85.51	433,279.17	
INGERSOLL-RAND PLC	7,331	90.04	660,083.24	
INGREDION INC	2,068	129.25	267,289.00	
INTEL CORP	136,000	46.32	6,299,520.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	17,005	72.86	1,238,984.30	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	25,618	155.16	3,974,888.88	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	2,286	142.38	325,480.68	
INTERNATIONAL PAPER CO	11,365	58.00	659,170.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,475	24.70	283,432.50	
INTUIT INC	7,042	173.57	1,222,279.94	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,236	421.76	1,364,815.36	
INVESCO LTD	11,741	33.21	389,918.61	
IPG PHOTONICS CORP	1,070	239.09	255,826.30	
IQVIA HOLDINGS INC	4,080	100.26	409,060.80	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,240	121.01	271,062.40	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,393	62.47	211,960.71	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,300	62.59	394,317.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,500	38.08	247,520.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,742	144.78	252,206.76	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	2,646	118.20	312,757.20	
JM SMUCKER CO	3,272	123.87	405,302.64	
JOHNSON & JOHNSON	77,705	130.87	10,169,253.35	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	26,982	37.87	1,021,808.34	
JONES LANG LASALLE INC	1,283	159.44	204,561.52	
JPMORGAN CHASE & CO	101,849	114.71	11,683,098.79	
JUNIPER NETWORKS INC	11,055	26.23	289,972.65	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,149	107.35	338,045.15	
KELLOGG CO	7,497	69.68	522,390.96	
KEYCORP	31,348	20.95	656,740.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,240	114.45	1,171,968.00	
KINDER MORGAN INC	58,191	17.00	989,247.00	
KLA-TENCOR CORP	4,542	110.55	502,118.10	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,004	47.76	191,231.04	
KOHL'S CORP	4,911	64.37	316,121.07	
KRAFT HEINZ CO/THE	17,614	68.69	1,209,905.66	
KROGER CO	25,940	27.49	713,090.60	
L BRANDS INC	7,055	47.41	334,477.55	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,254	210.98	475,548.92	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	2,948	174.41	514,160.68	
LAM RESEARCH CORP	4,698	193.44	908,781.12	
LAS VEGAS SANDS CORP	11,420	75.04	856,956.80	
LEAR CORP	1,969	189.70	373,519.30	
LEGGETT & PLATT INC	3,744	44.37	166,121.28	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,145	66.23	274,523.35	
LENNAR CORP-CL A	5,892	59.15	348,511.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,087	203.16	220,834.92	
LEUCADIA NATIONAL CORP	9,304	25.10	233,530.40	
LIBERTY BROADBAND-C	3,127	91.12	284,932.24	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,737	32.34	185,534.58	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	16,507	31.46	519,310.22	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	12,187	27.84	339,286.08	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	2,553	42.02	107,277.06	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	5,197	41.58	216,091.26	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	5,770	35.18	202,988.60	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,373	78.03	497,285.19	
LIVE NATION INC	4,195	46.86	196,577.70	
LKQ CORP	8,963	41.46	371,605.98	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,511	358.69	2,694,120.59	
LOEWS CORP	8,255	49.89	411,841.95	
LOWE'S COS INC	24,230	95.65	2,317,599.50	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,886	80.58	232,553.88	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,722	108.59	1,055,711.98	
M&T BANK CORP	3,929	190.64	749,024.56	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	2,389	64.37	153,779.93	
MACY'S INC	8,630	25.65	221,359.50	
MANPOWER GROUP	1,922	121.76	234,022.72	
MARATHON OIL CORP	24,477	15.85	387,960.45	
MARATHON PETROLEUM CORP	14,643	66.25	970,098.75	
MARKEL CORP	405	1,108.00	448,740.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	9,150	140.44	1,285,026.00	
MARSH & MCLENNAN COS INC	14,829	83.51	1,238,369.79	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,821	214.09	389,857.89	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	11,602	23.20	269,166.40	
MASCO CORP	9,278	42.52	394,500.56	
MASTERCARD INC-CLASS A	27,349	175.35	4,795,647.15	
MATTEL INC	9,745	16.47	160,500.15	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,149	62.12	506,215.88	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,455	104.60	361,393.00	
MCDONALD'S CORP	23,440	157.16	3,683,830.40	
MCKESSON CORP	6,082	148.85	905,305.70	
MEDTRONIC PLC	39,319	81.61	3,208,823.59	



MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	7,025	28.13	197,613.25	
MERCADOLIBRE INC	1,220	375.78	458,451.60	
MERCK & CO INC	78,939	54.98	4,340,066.22	
METLIFE INC	26,086	46.89	1,223,172.54	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	745	624.22	465,043.90	
MGM MIRAGE	13,316	34.71	462,198.36	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,381	63.97	280,252.57	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,740	84.86	571,956.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	30,613	44.90	1,374,523.70	
MICROSOFT CORP	211,861	92.72	19,643,751.92	
MIDDLEBY CORP	1,634	133.72	218,498.48	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,831	247.07	452,385.17	
MOLSON COORS BREWING CO - B	5,464	79.75	435,754.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	43,618	43.76	1,908,723.68	
MONSANTO CO	12,725	120.31	1,530,944.75	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,517	64.60	743,998.20	
MOODY'S CORP	4,984	168.13	837,959.92	
MORGAN STANLEY	39,900	55.06	2,196,894.00	
MOSAIC CO/THE	9,633	26.76	257,779.08	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,759	105.75	503,264.25	
MSCI INC	2,629	144.38	379,575.02	
MYLAN NV	13,189	41.34	545,233.26	
NASDAQ INC	3,354	78.80	264,295.20	
NATIONAL-OILWELL INC	10,932	35.38	386,774.16	
NETAPP INC	7,802	58.08	453,140.16	
NETFLIX INC	12,504	278.55	3,482,989.20	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	13,746	14.09	193,681.14	
NEWELL BRANDS INC	14,205	27.39	389,074.95	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,647	25.73	145,297.31	
NEWMONT MINING CORP	15,288	38.39	586,906.32	
NEWS CORP - CLASS A	10,977	15.95	175,083.15	
NEXTERA ENERGY INC	13,610	153.81	2,093,354.10	
NIELSEN HOLDINGS PLC	10,333	33.11	342,125.63	
NIKE INC	37,996	67.49	2,564,350.04	
NISOURCE INC	9,624	23.02	221,544.48	
NOBLE ENERGY INC	13,308	29.12	387,528.96	
NORDSTROM INC	3,535	50.49	178,482.15	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,443	140.03	1,182,273.29	
NORTHERN TRUST CORP	6,262	104.72	655,756.64	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,786	350.36	1,676,822.96	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,264	58.95	310,312.80	
NUCOR CORP	9,226	67.56	623,308.56	
NVIDIA CORP	17,369	249.08	4,326,270.52	
NVR INC	102	3,194.63	325,852.26	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,028	125.56	1,259,115.68	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,547	252.38	642,811.86	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,055	67.99	1,499,519.45	
OGE ENERGY CORP	5,742	31.21	179,207.82	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,866	135.23	252,339.18	
OMNICOM GROUP	6,742	78.36	528,303.12	
ONEOK INC	11,005	57.02	627,505.10	
ORACLE CORP	89,800	49.89	4,480,122.00	

OWENS CORNING	3,211	87.23	280,095.53	
PACCAR INC	10,144	68.99	699,834.56	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,733	118.86	324,844.38	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,669	162.92	434,833.48	
PARKER HANNIFIN CORP	3,853	181.61	699,743.33	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,313	23.29	147,029.77	
PAYCHEX INC	9,341	65.41	610,994.81	
PAYPAL HOLDINGS INC	33,074	77.06	2,548,682.44	
PENTAIR PLC	4,985	70.59	351,891.15	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	9,472	19.62	185,840.64	
PEPSICO INC	41,271	109.48	4,518,349.08	
PERRIGO CO PLC	3,720	87.04	323,788.80	
PFIZER INC	172,132	36.01	6,198,473.32	
PG&E CORP	14,855	40.01	594,348.55	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,986	102.85	4,626,810.10	
PHILLIPS 66	12,496	90.99	1,137,011.04	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,265	77.20	252,058.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,906	178.25	874,494.50	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,052	21.96	88,981.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,840	159.13	2,202,359.20	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,693	115.43	195,422.99	
PPG INDUSTRIES INC	7,420	115.40	856,268.00	
PPL CORPORATION	19,944	30.83	614,873.52	
PRAXAIR INC	8,284	153.60	1,272,422.40	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,421	1,894.62	2,692,255.02	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,319	62.70	521,601.30	
PROCTER & GAMBLE CO	73,788	81.34	6,001,915.92	
PROGRESSIVE CORP	16,858	56.54	953,151.32	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,323	108.48	1,336,799.04	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,671	49.29	723,133.59	
PULTE GROUP INC	7,880	29.47	232,223.60	
PVH CORP	2,246	146.68	329,443.28	
QORVO INC	3,680	80.17	295,025.60	
QUALCOMM INC	42,723	63.99	2,733,844.77	
QUEST DIAGNOSTICS	3,941	102.26	403,006.66	
RALPH LAUREN CORP	1,566	105.39	165,040.74	
RANGE RESOURCES CORP	6,989	13.08	91,416.12	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,744	92.23	345,309.12	
RAYTHEON CO	8,392	216.54	1,817,203.68	
RED HAT INC	5,143	144.32	742,237.76	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,266	323.04	732,008.64	
REGIONS FINANCIAL CORP	34,425	19.40	667,845.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,857	155.39	288,559.23	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,131	130.89	148,036.59	
REPUBLIC SERVICES INC	6,831	64.86	443,058.66	
RESMED INC	4,116	92.83	382,088.28	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	3,556	56.32	200,273.92	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,710	184.67	685,125.70	
ROCKWELL COLLINS INC.	4,691	135.26	634,504.66	

ROLLINS INC	2,781	49.95	138,910.95
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,962	276.74	819,703.88
ROSS STORES INC	11,245	77.98	876,885.10
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,967	131.56	653,458.52
S&P GLOBAL INC	7,451	187.90	1,400,042.90
SABRE CORP	5,993	23.11	138,498.23
SALESFORCE.COM INC	19,793	114.35	2,263,329.55
SCANA CORP	3,893	36.94	143,807.42
SCHLUMBERGER LTD	40,250	65.61	2,640,802.50
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,485	88.16	219,077.60
SEAGATE TECHNOLOGY	8,338	52.12	434,576.56
SEALED AIR CORP	5,559	42.07	233,867.13
SEATTLE GENETICS INC	2,839	54.16	153,760.24
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,872	72.73	281,610.56
SEMPRA ENERGY	6,942	107.54	746,542.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,964	53.50	265,574.00
SERVICENOW INC	4,930	156.76	772,826.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,435	396.67	965,891.45
SIGNATURE BANK	1,550	151.08	234,174.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	48,121	6.11	294,019.31
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,311	106.41	565,143.51
SMITH (A.O.) CORP	4,216	65.44	275,895.04
SNAP-ON INC	1,662	160.94	267,482.28
SOUTHERN CO	29,037	43.47	1,262,238.39
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,456	57.73	257,244.88
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	730	101.90	74,387.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	3,416	90.66	309,694.56
SPLUNK INC	4,017	93.68	376,312.56
SPRINT CORP	23,178	5.45	126,320.10
SQUARE INC - A	7,289	44.93	327,494.77
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,973	50.45	250,887.85
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,427	159.21	704,822.67
STARBUCKS CORP	41,747	55.97	2,336,579.59
STATE STREET CORP	10,808	103.79	1,121,762.32
STEEL DYNAMICS INC	6,925	48.86	338,355.50
STERICYCLE INC	2,425	75.22	182,408.50
STRYKER CORP	9,746	158.74	1,547,080.04
SUNTRUST BANKS INC	13,806	71.52	987,405.12
SVB FINANCIAL GROUP	1,517	249.41	378,354.97
SYMANTEC CORP	17,759	27.02	479,848.18
SYNCHRONY FINANCIAL	22,995	36.56	840,697.20
SYNOPSIS INC	4,332	89.76	388,840.32
SYSCO CORP	14,524	58.88	855,173.12
T ROWE PRICE GROUP INC	6,921	109.91	760,687.11
T-MOBILE US INC	8,585	60.51	519,478.35
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,064	107.48	329,318.72
TAPESTRY INC	8,176	49.41	403,976.16
TARGA RESOURCES CORP	6,234	47.75	297,673.50
TARGET CORP	14,984	72.86	1,091,734.24
TE CONNECTIVITY LTD	10,220	102.51	1,047,652.20
TECHNIPFMC PLC	12,722	29.38	373,772.36

TELEFLEX INC	1,306	269.07	351,405.42
TESARO INC	1,029	62.30	64,106.70
TESLA, INC.	3,868	334.77	1,294,890.36
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	26,420	19.98	527,871.60
TEXAS INSTRUMENTS INC	28,637	105.29	3,015,189.73
TEXTRON INC	7,646	60.06	459,218.76
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,588	207.84	2,408,449.92
TIFFANY & CO	3,593	100.70	361,815.10
TIME WARNER INC	22,572	95.07	2,145,920.04
TJX COS INC	18,396	76.37	1,404,902.52
TOLL BROTHERS INC	4,432	46.78	207,328.96
TORCHMARK CORP	3,174	86.38	274,170.12
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,812	87.01	418,692.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,653	67.22	245,554.66
TRANSDIGM GROUP INC	1,509	298.75	450,813.75
TRANSUNION	4,482	58.23	260,986.86
TRAVELERS COS INC/THE	7,943	139.07	1,104,633.01
TRIMBLE INC	7,320	38.96	285,187.20
TRIPADVISOR INC	3,199	42.65	136,437.35
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	12,928	36.61	473,294.08
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	30,387	37.13	1,128,269.31
TWITTER INC	18,169	32.84	596,669.96
TYSON FOODS INC-CL A	8,358	76.13	636,294.54
UGI CORP	5,096	43.22	220,249.12
ULTA BEAUTY INC	1,704	201.13	342,725.52
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,160	17.14	88,442.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	5,101	15.41	78,606.41
UNION PACIFIC CORP	23,328	130.23	3,038,005.44
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,222	66.59	147,962.98
UNITED PARCEL SERVICE INC	20,215	104.71	2,116,712.65
UNITED RENTALS INC	2,451	172.25	422,184.75
UNITED TECHNOLOGIES CORP	21,944	126.46	2,775,038.24
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,220	134.96	164,651.20
UNITEDHEALTH GROUP INC	27,994	226.66	6,345,120.04
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	2,557	117.18	299,629.26
UNUM GROUP	6,474	52.34	338,849.16
US BANCORP	48,315	54.91	2,652,976.65
VAIL RESORTS INC	1,151	216.00	248,616.00
VALERO ENERGY CORP	12,764	91.58	1,168,927.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,656	120.17	319,171.52
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,097	60.34	186,872.98
VERISIGN INC	2,641	116.34	307,253.94
VERISK ANALYTICS INC	4,535	97.04	440,076.40
VERIZON COMMUNICATIONS INC	118,426	48.92	5,793,399.92
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,301	160.98	1,175,314.98
VF CORP	9,688	73.57	712,746.16
VIACOM INC-CLASS B	10,246	33.98	348,159.08
VISA INC-CLASS A SHARES	52,977	122.01	6,463,723.77
VISTRA ENERGY CORP	7,478	18.88	141,184.64

VMWARE INC-CLASS A	2,052	123.60	253,627.20	
VOYA FINANCIAL INC	5,159	50.44	260,219.96	
VULCAN MATERIALS CO	3,835	124.47	477,342.45	
WABCO HOLDINGS INC	1,447	140.71	203,607.37	
WABTEC CORP	2,450	80.00	196,000.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26,311	70.91	1,865,713.01	
WALMART INC	43,209	94.11	4,066,398.99	
WALT DISNEY CO	44,735	105.98	4,741,015.30	
WASTE CONNECTIONS INC	7,645	70.47	538,743.15	
WASTE MANAGEMENT INC	12,748	84.87	1,081,922.76	
WATERS CORP	2,313	203.87	471,551.31	
WEC ENERGY GROUP INC	9,193	60.90	559,853.70	
WELLS FARGO & CO	136,482	59.95	8,182,095.90	
WESTAR ENERGY INC	4,192	49.65	208,132.80	
WESTERN DIGITAL CORP	8,536	86.46	738,022.56	
WESTERN UNION CO	13,417	20.25	271,694.25	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	7,342	65.11	478,037.62	
WEYERHAEUSER CO	21,764	34.94	760,434.16	
WHIRLPOOL CORP	2,113	168.50	356,040.50	
WILLIAMS COS INC	23,949	29.09	696,676.41	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,692	159.65	589,427.80	
WORKDAY INC-CLASS A	3,880	126.02	488,957.60	
WORLDPAY INC	4,716	75.94	358,133.04	
WR BERKLEY CORP	2,725	68.73	187,289.25	
WR GRACE & CO	1,961	67.26	131,896.86	
WW GRAINGER INC	1,584	263.61	417,558.24	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,972	120.77	358,928.44	
WYNN RESORTS LTD	2,372	164.92	391,190.24	
XCEL ENERGY INC	14,791	44.12	652,578.92	
XEROX CORP	6,136	31.03	190,400.08	
XILINX INC	7,181	69.19	496,853.39	
XL GROUP LTD	7,475	43.00	321,425.00	
XYLEM INC	5,192	74.73	387,998.16	
YUM! BRANDS INC	9,482	78.08	740,354.56	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,504	37.23	204,913.92	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	3,019	47.42	143,160.98	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,854	118.72	694,986.88	
ZIONS BANCORPORATION	5,790	54.97	318,276.30	
ZOETIS INC	14,196	80.35	1,140,648.60	
アメリカ・ドル 小計	8,865,176		690,120,175.50 (74,215,523,674)	
イギリス・ポンド				
3I GROUP PLC	27,687	9.17	253,945.16	
ADMIRAL GROUP PLC	5,685	18.94	107,702.32	
ANGLO AMERICAN PLC	38,487	17.39	669,596.82	
ANTOFAGASTA PLC	10,979	8.93	98,086.38	
ASHTREAD GROUP PLC	14,485	20.65	299,115.25	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,305	26.51	273,185.55	
ASTRAZENECA PLC	36,649	47.22	1,730,565.78	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI	28,163	3.64	102,710.46	
AVIVA PLC	116,467	5.00	582,800.86	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,780	6.46	43,812.36	
BAE SYSTEMS PLC	92,213	5.95	549,405.05	
BARCLAYS PLC	493,204	2.01	991,340.04	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	29,157	5.62	163,920.65	

BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	3,656	38.49	140,719.44	
BHP BILLITON PLC	61,035	14.90	909,665.64	
BP PLC	572,105	4.75	2,717,498.75	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	66,384	44.93	2,982,633.12	
BT GROUP PLC	245,898	2.30	567,532.58	
BUNZL PLC	9,772	20.00	195,440.00	
BURBERRY GROUP PLC	12,489	15.60	194,890.84	
CAPITA PLC	18,578	1.80	33,514.71	
CARNIVAL PLC	5,407	48.70	263,320.90	
CENTRICA PLC	162,739	1.30	212,699.87	
COBHAM PLC	68,288	1.24	84,950.27	
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,182	24.64	127,684.48	
COMPASS GROUP PLC	45,698	15.52	709,232.96	
CONVATEC GROUP PLC	38,982	2.14	83,733.33	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,755	44.66	167,698.30	
DCC PLC	2,596	66.85	173,542.60	
DIAGEO PLC	72,926	24.93	1,818,045.18	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	39,002	3.88	151,327.76	
EASYJET PLC	4,666	16.75	78,178.83	
EXPERIAN PLC	27,003	15.59	420,976.77	
FERGUSON PLC	7,336	52.36	384,112.96	
FRESNILLO PLC	6,249	13.40	83,767.84	
G4S PLC	44,388	2.60	115,675.12	
GKN PLC	48,611	4.18	203,485.64	
GLAXOSMITHKLINE PLC	142,517	13.25	1,888,350.25	
GLENORE PLC	353,553	3.84	1,359,057.73	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,396	17.02	125,916.90	
HSBC HOLDINGS PLC	581,735	7.37	4,287,386.95	
IMI PLC	7,723	12.63	97,541.49	
IMPERIAL BRANDS PLC	27,781	26.75	743,280.65	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,224	45.68	238,632.32	
INTERTEK GROUP PLC	4,689	49.73	233,183.97	
INVESTEC PLC	18,998	6.19	117,711.60	
ITV PLC	106,049	1.71	181,661.93	
JOHNSON MATTHEY PLC	5,494	31.71	174,214.74	
KINGFISHER PLC	62,807	3.61	226,984.49	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	171,964	2.57	441,947.48	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,082,584	0.67	1,411,991.95	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,047	40.05	362,332.35	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	45,871	3.00	137,796.48	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	10,399	5.88	61,146.12	
MEGGITT PLC	21,959	4.80	105,403.20	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	19,550	3.53	69,050.60	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	12,599	20.66	260,295.34	
MONDI PLC/WI	10,601	19.17	203,221.17	
MORRISON WM SUPERMARKETS	63,101	2.23	140,904.53	
NATIONAL GRID PLC	99,611	7.48	745,090.28	
NEXT PLC	4,247	49.92	212,010.24	
OLD MUTUAL PLC	142,513	2.48	354,572.34	
PEARSON PLC	23,915	6.96	166,591.89	
PERSIMMON PLC	8,924	24.65	219,976.60	

PRUDENTIAL PLC	74,873	18.44	1,380,658.12		
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,697	61.50	165,865.50		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	19,335	59.28	1,146,178.80		
RELX PLC	31,013	14.93	463,024.09		
RIO TINTO PLC	35,588	39.90	1,420,139.14		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	48,042	8.40	403,841.05		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	103,389	2.74	284,216.36		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	130,101	22.56	2,935,078.56		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	108,915	22.81	2,484,351.15		
ROYAL MAIL PLC	27,455	5.56	152,869.44		
RSA INSURANCE GROUP PLC	29,516	6.12	180,637.92		
SAGE GROUP PLC	31,399	7.02	220,672.17		
SAINSBURY (J) PLC	46,055	2.54	117,209.97		
SCHRODERS PLC	3,477	34.77	120,895.29		
SEVERN TRENT PLC	6,953	17.11	119,000.59		
SHIRE PLC	26,285	30.72	807,606.62		
SKY PLC	30,186	11.06	333,857.16		
SMITH & NEPHEW PLC	25,333	12.69	321,475.77		
SMITHS GROUP PLC	11,241	15.96	179,406.36		
SSE PLC	29,166	12.13	353,783.58		
ST JAMES'S PLACE PLC	15,381	11.33	174,343.63		
STANDARD CHARTERED PLC	95,404	8.20	782,503.60		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	77,150	3.81	294,558.70		
TAYLOR WIMPEY PLC	94,497	1.91	180,489.27		
TESCO PLC	237,367	2.06	490,162.85		
TRAVIS PERKINS PLC	7,082	14.17	100,387.35		
TUI AG-DI	12,645	15.42	195,049.12		
UNILEVER PLC	36,558	37.44	1,368,731.52		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,073	6.64	133,365.01		
VODAFONE GROUP PLC	777,374	2.03	1,578,069.22		
WEIR GROUP PLC/THE	6,370	20.36	129,693.20		
WHITBREAD PLC	5,259	39.18	206,047.62		
WOOD GROUP (JOHN) PLC	19,013	6.27	119,325.58		
WORLDPAY INC-CLASS A	3,741	54.76	204,857.16		
WPP PLC	36,964	14.00	517,496.00		
イギリス・ポンド 小計	8,799,754		53,318,615.63 (8,029,250,328)		
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	1,112	168.30	187,149.60	
	BANK HAPOLIM BM	29,972	24.39	731,017.08	
	BANK LEUMI LE- ISRAEL	40,867	20.47	836,547.49	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	57,724	5.24	302,473.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	644	515.80	332,175.20	
	FRUTAROM	1,078	312.40	336,767.20	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	13,776	14.81	204,022.56	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,848	63.21	243,232.08	
NICE LTD	1,707	324.30	553,580.10		
イスラエル・シュケル 小計	150,728		3,726,965.07 (114,492,366)		
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	20,093	22.68	455,709.24	
	ALUMINA LTD	74,197	2.32	172,137.04	

AMCOR LTD	35,557	14.16	503,487.12
AMP LTD	89,619	5.37	481,254.03
ARISTOCRAT LEISURE LTD	16,424	24.23	397,953.52
ASX LTD	6,351	56.88	361,244.88
AURIZON HOLDINGS LTD	66,818	4.57	305,358.26
AUSNET SERVICES	73,701	1.68	123,817.68
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	86,148	27.98	2,410,421.04
BANK OF QUEENSLAND LTD	12,681	12.37	156,863.97
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	15,066	11.14	167,835.24
BHP BILLITON LTD	93,865	31.30	2,937,974.50
BLUESCOPE STEEL LTD	16,390	16.00	262,240.00
BORAL LTD	35,486	7.77	275,726.22
BRAMBLES LTD	47,874	9.64	461,505.36
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,065	33.63	271,225.95
CHALLENGER LTD	17,714	12.33	218,413.62
CIMIC GROUP LIMITED	3,063	45.74	140,101.62
COCA-COLA AMATIL LIMITED	17,873	8.69	155,316.37
COCHLEAR LTD	1,799	176.20	316,983.80
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	50,704	74.26	3,765,279.04
COMPUTERSHARE LIMITED	14,356	17.92	257,259.52
CROWN RESORTS LTD	11,787	12.50	147,337.50
CSL LIMITED	13,244	156.00	2,066,064.00
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,856	42.50	78,880.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,694	48.30	81,820.20
FORTECUE METALS GROUP LTD	45,444	5.36	243,579.84
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	17,554	4.38	76,886.52
HEALTHSCOPE LTD	52,703	1.88	99,345.15
INCITEC PIVOT LTD	51,633	3.67	189,493.11
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	72,874	7.73	563,316.02
JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	13,646	23.00	313,858.00
MACQUARIE GROUP LTD	9,631	103.35	995,363.85
MEDIBANK PRIVATE LTD	83,796	3.20	268,147.20
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,048	29.30	2,316,106.40
NEWCREST MINING LIMITED	22,800	22.36	509,808.00
OIL SEARCH LTD	42,359	7.55	319,810.45
ORICA LTD	11,737	18.96	222,533.52
ORIGIN ENERGY LIMITED	52,180	9.22	481,099.60
QBE INSURANCE GROUP LTD	41,118	10.53	432,972.54
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	4,400	68.69	302,236.00
REA GROUP LTD	1,809	78.00	141,102.00
RIO TINTO LTD	12,570	81.60	1,025,712.00
SANTOS LTD	55,039	5.18	285,102.02
SEEK LTD	10,406	19.68	204,790.08
SONIC HEALTHCARE LTD	12,341	24.08	297,171.28
SOUTH32 LTD	152,921	3.21	490,876.41
SUNCORP GROUP LTD	39,577	13.46	532,706.42
TABCORP HOLDINGS LTD	59,585	4.72	281,241.20
TELSTRA CORP LTD	129,363	3.44	445,008.72



	TPG TELECOM LTD	12,220	6.18	75,519.60	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	22,403	17.60	394,292.80	
	WESFARMERS LIMITED	33,469	40.76	1,364,196.44	
	WESTPAC BANKING CORP	99,514	30.11	2,996,366.54	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	24,527	29.10	713,735.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,725	1.53	4,169.25	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	38,354	27.39	1,050,516.06	
オーストラリア・ドル	小計	2,140,171		34,609,272.44 (2,936,942,859)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	6,675	52.70	351,772.50	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	12,203	62.47	762,321.41	
	ALTAGAS LTD	5,025	26.45	132,911.25	
	ARC RESOURCES LTD	9,974	12.90	128,664.60	
	ATCO LTD -CL 'I'	2,315	43.24	100,100.60	
	BANK OF MONTREAL	18,738	97.62	1,829,203.56	
	BANK OF NOVA SCOTIA	34,641	77.10	2,670,821.10	
	BARRICK GOLD CORP	33,575	16.22	544,586.50	
	BCE INC	4,919	55.80	274,480.20	
	BLACKBERRY LTD	14,345	15.31	219,621.95	
	BOMBARDIER INC	55,244	3.92	216,556.48	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	24,531	50.80	1,246,174.80	
	CAE INC	7,804	23.26	181,521.04	
	CAMECO CORP	11,073	11.48	127,118.04	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	12,574	114.85	1,444,123.90	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	22,064	95.33	2,103,361.12	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	31,614	39.52	1,249,385.28	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,325	230.17	995,485.25	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,885	177.80	335,153.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,904	35.00	136,640.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,043	57.31	231,704.33	
	CENOVUS ENERGY INC	30,199	9.40	283,870.60	
	CGI GROUP INC	6,127	74.17	454,439.59	
	CI FINANCIAL CORP	7,408	28.39	210,313.12	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	588	840.00	493,920.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	15,339	9.09	139,431.51	
	DOLLARAMA INC	3,111	157.00	488,427.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	10,948	4.40	48,171.20	
	EMERA INC	1,809	41.43	74,946.87	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,854	23.35	113,340.90	
	ENBRIDGE INC	47,779	43.06	2,057,363.74	
	ENCANA CORP	28,226	13.75	388,107.50	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	817	645.43	527,316.31	
	FINNING INTERNATIONAL INC	4,829	33.59	162,206.11	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,671	19.70	92,018.70	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,939	20.59	410,544.01	
	FORTIS INC	12,401	41.71	517,245.71	
	FRANCO-NEVADA CORP	5,343	91.42	488,457.06	
	GEORGE WESTON LTD	1,489	104.81	156,062.09	

GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,464	38.63	249,704.32		
GOLDCORP INC	24,929	16.60	413,821.40		
GREAT-WEST LIFECO INC	7,140	33.61	239,975.40		
HUSKY ENERGY INC	9,976	16.56	165,202.56		
HYDRO ONE LTD	9,057	20.89	189,200.73		
IGM FINANCIAL INC	2,458	39.12	96,156.96		
IMPERIAL OIL LTD	8,717	34.26	298,644.42		
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,050	57.07	174,063.50		
INTACT FINANCIAL CORP	4,087	97.10	396,847.70		
INTER PIPELINE LTD	10,914	22.41	244,582.74		
JEAN COUTU GROUP INC- CLASS A	2,168	24.27	52,617.36		
KEYERA CORP	5,401	33.61	181,527.61		
KINROSS GOLD CORP	35,118	4.79	168,215.22		
LINAMAR CORP	1,383	70.06	96,892.98		
LOBLAW COS LTD	6,320	65.76	415,603.20		
LUNDIN MINING CORP	18,522	8.62	159,659.64		
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,160	68.66	697,585.60		
MANULIFE FINANCIAL CORP	57,292	24.68	1,413,966.56		
METHANEX CORP	2,454	72.46	177,816.84		
METRO INC	6,488	39.78	258,092.64		
NATIONAL BANK OF CANADA	9,834	61.69	606,659.46		
NUTRIEN LTD	18,307	56.92	1,042,034.44		
ONEX CORPORATION	2,435	90.27	219,807.45		
OPEN TEXT CORP	7,749	44.24	342,815.76		
PEMBINA PIPELINE CORP	14,677	41.28	605,866.56		
POWER CORP OF CANADA	10,405	30.01	312,254.05		
POWER FINANCIAL CORP	5,649	32.98	186,304.02		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,106	29.04	177,318.24		
RESTAURANT BRANDS INTERN	6,523	74.90	488,572.70		
ROGERS COMMUNICATIONS INC	10,853	57.68	626,001.04		
ROYAL BANK OF CANADA	42,178	100.49	4,238,467.22		
SAPUTO INC	6,106	40.83	249,307.98		
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	6,920	15.69	108,574.80		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12,578	25.26	317,720.28		
SHOPIFY INC - CLASS A	2,356	180.68	425,682.08		
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,051	53.17	268,561.67		
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,803	53.75	956,911.25		
SUNCOR ENERGY INC	48,062	43.84	2,107,038.08		
TECK RESOURCES LTD-CL B	16,441	36.64	602,398.24		
THOMSON REUTERS CORP	8,361	50.28	420,391.08		
TORONTO-DOMINION BANK	53,359	72.49	3,867,993.91		
TOURMALINE OIL CORP	6,499	19.30	125,430.70		
TRANSCANADA CORP	25,356	56.89	1,442,502.84		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	28,315	3.58	101,367.70		
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	9,409	23.48	220,923.32		
VERMILION ENERGY INC	3,284	42.51	139,602.84		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,940	86.80	168,392.00		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,706	24.43	310,407.58		
カナダ・ドル 小計	1,158,708		49,157,373.60 (4,179,851,477)		
シンガポール・ ドル	CAPITALAND LTD	73,600	3.56	262,016.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,300	12.51	141,363.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	65,200	2.04	133,008.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	51,800	28.66	1,484,588.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	171,700	1.29	221,493.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	193,400	0.35	68,657.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,900	37.90	109,910.00	
	KEPPEL CORP LTD	42,200	8.09	341,398.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	90,800	12.83	1,164,964.00	
	SATS LTD	22,800	5.18	118,104.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	27,700	3.28	90,856.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,200	11.20	192,640.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,900	7.54	172,666.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	46,400	2.65	122,960.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	43,900	3.36	147,504.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	242,800	3.38	820,664.00	
	STARHUB LTD	20,600	2.58	53,148.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	38,500	27.22	1,047,970.00	
	UOL Group Limited	13,500	8.33	112,455.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,400	3.05	135,420.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	61,700	1.45	89,465.00	
シンガポール・ドル	小計	1,305,300		7,031,249.00 (573,468,669)	
スイス・フラン	ABB LTD	53,313	23.74	1,265,650.62	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,683	75.24	352,348.92	
	BALOISE HOLDING AG	1,370	149.60	204,952.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	63	1,895.00	119,385.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	30	5,640.00	169,200.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	67,500.00	202,500.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	15,129	84.82	1,283,241.78	
	CLARIANT AG	6,634	23.82	158,021.88	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	70,186	17.55	1,231,764.30	
	DUFREY AG-REG	1,003	138.05	138,464.15	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	236	625.50	147,618.00	
	GEBERIT AG-REG	1,076	428.30	460,850.80	
	GIVAUDAN-REG	268	2,156.00	577,808.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,512	61.74	402,050.88	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,711	164.30	281,117.30	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	13,175	55.34	729,104.50	
	LONZA GROUP AG	2,162	246.90	533,797.80	
	NESTLE SA	90,079	75.20	6,773,940.80	
	NOVARTIS AG	64,384	80.46	5,180,336.64	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,136	82.15	93,322.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	503	683.50	343,800.50	
	ROCHE HOLDING AG	20,342	223.90	4,554,573.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	602	219.20	131,958.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,150	225.00	258,750.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	155	2,408.00	373,240.00	
	SIKA AG-BEARER	61	7,755.00	473,055.00	

	SONOVA HOLDING AG-REG	1,523	145.25	221,215.75	
	STRAUMANN HOLDING AG	295	664.50	196,027.50	
	SWATCH GROUP AG	912	410.60	374,467.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	930	342.60	318,618.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,072	88.25	182,854.00	
	SWISS RE AG	9,033	96.38	870,600.54	
	SWISSCOM AG	784	510.40	400,153.60	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,480	78.35	115,958.00	
	UBS GROUP AG	106,031	17.98	1,906,967.53	
	VIFOR PHARMA AG	1,390	135.10	187,789.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,369	310.80	1,357,885.20	
スイス・フラン	小計	484,785		32,573,389.79 (3,743,333,954)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	8,468	201.70	1,707,995.60	
	ASSA ABLOY AB	29,205	180.80	5,280,264.00	
	ATLAS COPCO AB	11,300	314.00	3,548,200.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,543	353.60	6,910,404.80	
	BOLIDEN AB	7,841	287.70	2,255,855.70	
	ELECTROLUX AB	6,917	266.00	1,839,922.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	17,663	226.00	3,991,838.00	
	GETINGE AB-B SHS	6,499	102.00	662,898.00	
	HENNES & MAURITZ AB	27,522	140.90	3,877,849.80	
	HEXAGON AB-B SHS	7,594	488.80	3,711,947.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,206	87.70	1,070,466.20	
	ICA GRUPPEN AB	2,249	298.20	670,651.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,722	201.50	951,483.00	
	INVESTOR AB	13,203	368.20	4,861,344.60	
	KINNEVIK AB - B	6,627	292.30	1,937,072.10	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,087	621.50	675,570.50	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,525	191.60	1,058,590.00	
	NORDEA BANK AB	88,278	94.72	8,361,692.16	
	SANDVIK AB	32,898	150.80	4,961,018.40	
	SECURITAS AB	9,095	141.30	1,285,123.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,479	98.40	4,376,733.60	
	SKANSKA AB-B SHS	9,689	162.95	1,578,822.55	
	SKF AB	11,057	174.95	1,934,422.15	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	44,681	116.30	5,196,400.30	
	SWEDBANK AB - A SHARES	26,440	206.40	5,457,216.00	
	SWEDISH MATCH AB	5,312	336.80	1,789,081.60	
	TELE2 AB	11,084	97.84	1,084,458.56	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	89,504	54.74	4,899,448.96	
	TELIA CO AB	78,504	37.45	2,939,974.80	
	VOLVO AB	45,262	158.20	7,160,448.40	
スウェーデン・クローナ	小計	684,454		96,037,194.28 (1,275,373,941)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	98	10,030.00	982,940.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	201	10,565.00	2,123,565.00	
	CARLSBERG AS-B	3,090	729.60	2,254,464.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,899	517.60	1,500,522.40	
	COLOPLAST-B	3,435	518.80	1,782,078.00	
	DANSKE BANK A/S	21,706	245.00	5,317,970.00	
	DSV A/S	5,671	482.00	2,733,422.00	
	GENMAB A/S	1,685	1,050.00	1,769,250.00	
	H LUNDBECK A/S	1,937	321.10	621,970.70	

	ISS A/S	4,757	222.10	1,056,529.70	
	NOVO-NORDISK A/S	53,968	309.55	16,705,794.40	
	NOVOZYMES A/S	6,537	321.10	2,099,030.70	
	ORSTED A/S	5,486	366.10	2,008,424.60	
	PANDORA A/S	3,101	622.00	1,928,822.00	
	TDC A/S	23,875	49.35	1,178,231.25	
	TRYGVESTA AS	3,043	145.10	441,539.30	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,227	447.00	2,783,469.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,249	195.10	633,879.90	
デンマーク・クローネ 小計		150,965		47,921,902.95 (853,489,092)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,521	6.50	191,886.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,237	12.98	210,756.26	
	FLETCHER BUILDING LTD	19,315	6.86	132,500.90	
	MERCURY NZ LTD	20,019	3.27	65,462.13	
	MERIDIAN ENERGY LTD	35,135	2.84	99,959.07	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,300	10.58	119,554.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	54,863	3.45	189,551.66	
ニュージーランド・ドル 小計		186,390		1,009,670.52 (79,743,777)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	28,307	156.30	4,424,384.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,569	143.90	801,379.10	
	MARINE HARVEST	11,835	150.50	1,781,167.50	
	NORSK HYDRO ASA	38,531	56.26	2,167,754.06	
	ORKLA ASA	23,648	84.56	1,999,674.88	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,543	201.50	512,414.50	
	STATOIL ASA	33,336	177.70	5,923,807.20	
	TELENOR ASA	22,051	176.50	3,892,001.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,139	353.20	1,815,094.80	
ノルウェー・クローネ 小計		170,959		23,317,677.64 (319,918,536)	
ユーロ	1 AND 1 DRILLISCH AG	1,615	64.50	104,167.50	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	20,912	19.40	405,692.80	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	12,215	25.27	308,673.05	
	ACCOR	5,383	45.45	244,657.35	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,927	29.13	201,783.51	
	ADIDAS AG	5,456	181.80	991,900.80	
	ADP	955	164.50	157,097.50	
	AEGON NV	50,656	5.62	284,686.72	
	AENA SME SA	2,062	166.90	344,147.80	
	AGEAS	5,396	41.85	225,822.60	
	AIB GROUP PLC	23,462	5.32	124,817.84	
	AIR LIQUIDE	12,381	102.10	1,264,100.10	
	AIRBUS SE	16,849	96.99	1,634,184.51	
	AKZO NOBEL NV	7,287	78.98	575,527.26	
	ALLIANZ SE	12,983	191.74	2,489,360.42	
	ALSTOM RGPT	4,386	33.64	147,545.04	
	ALTICE NV - A-W/I	15,420	7.84	120,892.80	
	AMADEUS IT GROUP SA	12,683	59.50	754,638.50	
	AMUNDI SA	1,717	69.28	118,953.76	
	ANDRITZ AG	2,072	48.46	100,409.12	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	22,089	85.40	1,886,400.60	
	ARCELORMITTAL	19,190	28.83	553,343.65	

ARKEMA	1,978	102.45	202,646.10
ASML HOLDING NV	11,248	159.25	1,791,244.00
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	36,076	15.42	556,472.30
ATLANTIA SPA	13,712	25.68	352,124.16
ATOS SE	2,743	121.75	333,960.25
AXA	55,961	25.40	1,421,409.40
AXEL SPRINGER SE	1,433	72.90	104,465.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	192,627	7.02	1,353,397.30
BANCO DE SABADELL SA	153,867	1.82	280,961.14
BANCO SANTANDER SA	467,298	5.67	2,653,785.34
BANK OF IRELAND GROUP PLC	26,730	7.77	207,692.10
BANKIA SA	28,368	3.98	113,159.95
BANKINTER SA	18,779	8.91	167,320.89
BASF SE	26,550	87.09	2,312,239.50
BAYER AG	23,931	98.54	2,358,160.74
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,582	86.63	830,088.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,550	74.35	115,242.50
BEIERSDORF AG	2,883	91.56	263,967.48
BIOMERIEUX	1,161	71.00	82,431.00
BNP PARIBAS	32,479	65.08	2,113,733.32
BOLLORE	27,683	4.58	126,898.87
BOSKALIS WESTMINSTER	2,481	31.19	77,382.39
BOUYGUES	6,207	42.69	264,976.83
BRENTAG AG	4,453	52.18	232,357.54
BUREAU VERITAS SA	7,680	21.72	166,809.60
CAIXABANK	103,615	4.04	419,433.52
CAPGEMINI SA	4,655	103.60	482,258.00
CARREFOUR SA	16,774	19.25	322,899.50
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,537	46.01	70,717.37
CIE DE SAINT-GOBAIN	14,589	44.26	645,709.14
CNH INDUSTRIAL NV	29,804	11.67	347,812.68
CNP ASSURANCES	4,952	19.92	98,643.84
COLRUYT NV	1,598	44.35	70,871.30
COMMERZBANK AG	30,791	12.96	399,112.94
CONTINENTAL AG	3,176	227.80	723,492.80
COVESTRO AG	3,505	93.52	327,787.60
CREDIT AGRICOLE SA	32,990	13.86	457,406.35
CRH PLC	24,557	28.38	696,927.66
DAIMLER AG	27,854	70.38	1,960,364.52
DANONE	17,507	64.51	1,129,376.57
DASSAULT AVIATION SA	70	1,387.00	97,090.00
DASSAULT SYSTEMES SA	3,779	103.50	391,126.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,702	6.23	104,053.46
DEUTSCHE BANK AG	49,686	13.34	663,208.72
DEUTSCHE BOERSE AG	5,563	104.85	583,280.55
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	6,949	27.12	188,456.88
DEUTSCHE POST AG	28,500	37.37	1,065,045.00
DEUTSCHE TELEKOM AG	97,381	13.24	1,289,811.34
DEUTSCHE WOHNEN SE	10,264	33.82	347,128.48
E.ON SE	63,806	8.23	525,378.60
EDENRED	6,393	27.40	175,168.20
EDF	16,439	10.43	171,458.77
EIFFAGE	2,182	92.20	201,180.40
ELISA OYJ	4,348	35.15	152,832.20

ENAGAS SA	6,334	20.51	129,910.34
ENDESA SA	8,950	17.29	154,745.50
ENEL SPA	236,234	4.77	1,126,836.18
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	69,309	2.70	187,411.53
ENGIE	52,986	12.61	668,418.39
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	73,352	13.70	1,005,509.21
ERSTE GROUP BANK AG	8,743	38.83	339,490.69
ESSILOR INTERNATIONA	6,016	109.15	656,646.40
EURAZEO	1,244	79.95	99,457.80
EUROFINS SCIENTIFIC	321	486.20	156,070.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	5,066	18.80	95,266.13
EVONIK INDUSTRIES AG	4,570	30.51	139,430.70
EXOR NV	3,095	60.58	187,495.10
FAURECIA	2,167	69.26	150,086.42
FERRARI NV	3,577	104.50	373,796.50
FERROVIAL S.A.	14,260	17.64	251,617.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	31,154	18.04	562,018.16
FORTUM OYJ	12,905	17.91	231,193.07
FRAPORT AG	1,330	89.80	119,434.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	6,236	86.24	537,792.64
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,044	63.30	762,385.20
FUCHS PETROLUB AG -PFD	1,888	45.68	86,243.84
GALP ENERGIA SGPS SA	14,415	14.67	211,540.12
GAS NATURAL SDG SA	9,931	18.34	182,134.54
GEA GROUP AG	5,268	38.43	202,449.24
GETLINK SE - REGR	14,471	10.63	153,899.08
GRIFOLS SA	8,611	23.87	205,544.57
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,287	92.50	211,547.50
HANNOVER RUECK SE	1,656	111.30	184,312.80
HEIDELBERGCEMENT AG	4,303	83.52	359,386.56
HEINEKEN HOLDING NV	3,351	80.90	271,095.90
HEINEKEN NV	7,494	85.00	636,990.00
HENKEL AG & CO KGAA	3,024	97.30	294,235.20
HENKEL KGAA-VORZUG	5,113	106.70	545,557.10
HERMES INTERNATIONAL	924	439.10	405,728.40
HOCHTIEF AG	534	138.10	73,745.40
HUGO BOSS AG	1,797	72.22	129,779.34
IBERDROLA SA	164,517	6.15	1,011,779.55
ILIAD SA	795	198.00	157,410.00
IMERYS SA	1,001	85.20	85,285.20
INDITEX SA	31,489	27.33	860,594.37
INFINEON TECHNOLOGIES AG	32,834	22.43	736,466.62
ING GROEP NV-CVA	112,259	14.71	1,651,329.89
INGENICO GROUP	1,692	92.62	156,713.04
INNOGY SE	4,028	30.47	122,733.16
INTESA SANPAOLO	412,666	3.08	1,274,725.27
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	18,335	6.99	128,308.33
IPSEN	1,080	120.15	129,762.00
JC DECAUX SA	2,167	33.02	71,554.34
JERONIMO MARTINS	7,074	17.62	124,643.88
K+S AG	5,461	22.22	121,343.42
KBC GROEP NV	7,223	72.76	525,545.48
KERING	2,199	390.20	858,049.80

KERRY GROUP PLC-A	4,695	81.80	384,051.00
KION GROUP AG	2,022	71.42	144,411.24
KONE OYJ	9,737	45.00	438,165.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	36,986	17.65	652,802.90
KONINKLIJKE DSM NV	5,245	84.14	441,314.30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	27,217	31.22	849,850.82
L'OREAL SA	7,288	175.60	1,279,772.80
LAGARDERE S.C.A.	3,492	24.80	86,601.60
LANXESS	2,602	68.12	177,248.24
LEGRAND SA	7,711	63.50	489,648.50
LEONARDO SPA	11,536	9.07	104,723.80
LINDE AG - TENDER	5,327	184.25	981,499.75
LUXOTTICA GROUP SPA	4,957	49.55	245,619.35
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	8,082	245.10	1,980,898.20
MAN SE	979	94.80	92,809.20
MAPFRE SA	28,800	2.77	79,776.00
MEDIOBANCA SPA	16,404	9.87	161,973.09
MERCK KGAA	3,729	83.52	311,446.08
METRO AG	4,922	16.40	80,720.80
METSO OYJ	3,220	26.61	85,684.20
MICHELIN (C.G.D.E.)	4,958	126.30	626,195.40
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	1,498	141.50	211,967.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	4,456	184.15	820,572.40
NATIXIS	26,900	7.06	189,967.80
NESTE OYJ	3,603	58.78	211,784.34
NN GROUP NV	8,742	36.26	316,984.92
NOKIA OYJ	169,181	4.66	788,721.82
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,299	37.65	124,207.35
OMV AG	4,250	48.18	204,765.00
ORANGE S.A.	58,688	13.67	802,558.40
ORION OYJ-CLASS B	2,880	27.38	78,854.40
OSRAM LICHT AG	2,874	68.62	197,213.88
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,362	95.35	225,216.70
PERNOD-RICARD	6,149	133.00	817,817.00
PEUGEOT SA	16,992	17.90	304,156.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	4,419	69.20	305,794.80
POSTE ITALIANE SPA	14,971	6.78	101,503.38
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE- REG	6,826	31.20	212,971.20
PROXIMUS	4,608	25.85	119,116.80
PRYSMIAN SPA	5,881	26.70	157,022.70
PUBLICIS GROUPE	6,051	61.50	372,136.50
QIAGEN NV	6,151	27.68	170,259.68
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	4,208	31.44	132,299.52
RANDSTAD HOLDINGS NV	3,352	58.96	197,633.92
RECORDATI SPA	3,014	30.02	90,480.28
RED ELECTRICA DE ESPANA	12,588	15.98	201,219.18
RELX NV	27,980	17.01	476,079.70
REMY COINTREAU	633	107.70	68,174.10
RENAULT SA	5,546	86.90	481,947.40
REPSOL SA	34,900	14.12	492,788.00
REXEL SA	8,624	14.83	127,893.92



ROYAL KPN NV	102,777	2.59	266,706.31
RTL GROUP	1,104	70.30	77,611.20
RWE AG	15,061	16.47	248,054.67
SAFRAN SA	9,646	89.86	866,789.56
SAMPO OYJ	12,856	47.15	606,160.40
SANOFI	32,895	64.55	2,123,372.25
SAP SE	28,430	84.50	2,402,335.00
SCHAEFFLER AG	4,598	13.43	61,751.14
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,393	72.52	1,188,820.36
SCOR REGROUPE	4,861	35.89	174,461.29
SEB SA	665	164.70	109,525.50
SIEMENS AG	22,122	112.42	2,486,955.24
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	6,484	12.83	83,222.14
SNAM SPA	66,439	3.62	241,107.13
SOCIETE BIC SA	789	83.90	66,197.10
SOCIETE GENERALE	22,159	46.25	1,024,964.54
SODEXO	2,605	99.30	258,676.50
SOLVAY SA	2,135	113.90	243,176.50
STMICROELECTRONICS NV	18,493	18.45	341,288.31
STORA ENSO OYJ	15,932	14.35	228,703.86
SUEZ	10,819	10.86	117,548.43
SYMRISE AG	3,577	66.34	237,298.18
TELECOM ITALIA SPA	454,410	0.71	326,266.38
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	21,994	4.04	89,009.71
TELEFONICA SA	132,142	7.65	1,011,414.86
TELENET GROUP HOLDING NV	1,625	56.40	91,650.00
TELEPERFORMANCE	1,690	119.90	202,631.00
TENARIS SA	13,317	13.70	182,509.48
TERNA SPA	41,847	4.53	189,734.29
THALES SA	3,070	92.12	282,808.40
THYSSENKRUPP AG	12,634	22.88	289,065.92
TOTAL SA	68,706	46.60	3,201,699.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,816	68.20	123,851.20
UCB SA	3,661	66.56	243,676.16
UMICORE	5,479	46.10	252,581.90
UNICREDIT SPA	58,013	17.56	1,019,172.38
UNILEVER NV	47,148	43.43	2,047,637.64
UNIPER SE	5,552	24.65	136,856.80
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	26,744	2.02	54,236.83
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,592	55.96	201,008.32
UPM-KYMMENE OYJ	15,373	28.11	432,135.03
VALEO SA	6,952	60.58	421,152.16
VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,078	19.35	272,479.69
VINCI SA	14,620	82.78	1,210,243.60
VIVENDI SA	30,113	21.30	641,406.90
VOESTALPINE AG	3,247	46.38	150,595.86
VOLKSWAGEN AG	888	166.50	147,852.00
VOLKSWAGEN AG	5,392	163.40	881,052.80
VONOVIA SE	14,031	37.33	523,777.23
VOPAK	1,903	38.73	73,703.19
WARTSILA OYJ	4,273	59.22	253,047.06
WENDEL	835	141.70	118,319.50
WIRECARD AG	3,403	99.88	339,891.64
WOLTERS KLUWER NV	8,734	40.36	352,504.24

	ZALANDO SE	3,175	47.52	150,876.00	
ユーロ 小計		5,592,134		113,802,103.52 (15,098,125,075)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	350,075	63.25	22,142,243.75	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,800	110.50	861,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	35,400	33.30	1,178,820.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	108,039	38.90	4,202,717.10	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	74,909	68.00	5,093,812.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	78,409	97.85	7,672,320.65	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	20,500	65.10	1,334,550.00	
	CLP HOLDINGS LTD	48,643	76.65	3,728,485.95	
	FIRST PACIFIC CO	66,000	5.20	343,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	66,810	68.00	4,543,080.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	28,000	26.50	742,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,157	18.38	1,050,545.66	
	HANG SENG BANK LTD	22,412	189.20	4,240,350.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	36,217	49.85	1,805,417.45	
	HONG KONG & CHINA GAS	249,346	15.12	3,770,111.52	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34,011	277.80	9,448,255.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	43.50	739,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	19,000	35.00	665,000.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	114,000	5.02	572,280.00	
	LI & FUNG LTD	171,278	3.91	669,696.98	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	26,400	23.40	617,760.00	
	MINTH GROUP LTD	20,000	43.65	873,000.00	
	MTR CORP	48,255	41.25	1,990,518.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,669	11.56	2,007,613.64	
	NWS HOLDINGS LTD	45,000	14.52	653,400.00	
	PCCW LTD	140,000	4.45	623,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	41,087	65.65	2,697,361.55	
	SANDS CHINA LTD	70,980	45.10	3,201,198.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	34,000	17.04	579,360.00	
	SINO LAND CO	90,000	13.60	1,224,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	53,000	7.61	403,330.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	43,023	126.80	5,455,316.40	
	SWIRE PACIFIC LTD	15,366	75.30	1,157,059.80	
	SWIRE PROPERTIES LTD	34,400	26.55	913,320.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40,000	48.75	1,950,000.00	
	WH GROUP LTD	258,000	9.05	2,334,900.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	35,733	29.05	1,038,043.65	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	36,733	50.55	1,856,853.15	
	WHEELOCK & CO LTD	22,000	56.60	1,245,200.00	
	WYNN MACAU LTD	44,503	27.70	1,232,733.10	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,500	33.35	717,025.00	
香港・ドル 小計		2,898,655		107,575,280.30 (1,478,084,351)	
合計		32,588,179		112,897,598,099 (112,897,598,099)	

## 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	10,503.00	197,771.49			
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,709.00	327,707.73			
		AMERICAN TOWER REIT INC	12,453.00	1,733,955.72			
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	32,685.00	338,943.45			
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,008.00	642,963.36			
		BOSTON PROPERTIES INC	4,472.00	533,912.08			
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8,759.00	137,078.35			
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,690.00	219,773.00			
		COLONY NORTHSTAR INC- CLASS A	14,792.00	122,034.00			
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	11,780.00	1,278,954.60			
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,940.00	591,505.20			
		DUKE REALTY CORP	10,274.00	261,678.78			
		EQUINIX INC	2,257.00	894,765.08			
		EQUITY RESIDENTIAL	10,633.00	612,886.12			
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,910.00	430,590.40			
		EXTRA SPACE STORAGE INC	3,666.00	296,029.50			
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,094.00	239,888.64			
		GGP INC	17,904.00	387,084.48			
		HCP INC	13,582.00	304,915.90			
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	21,414.00	417,787.14			
		INVITATION HOMES INC	8,976.00	190,829.76			
		IRON MOUNTAIN INC	7,285.00	233,994.20			
		KIMCO REALTY CORP	12,084.00	184,281.00			
		LIBERTY PROPERTY TRUST	4,197.00	166,159.23			
		MACERICH CO/THE	3,489.00	207,176.82			
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,289.00	290,254.25			
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,240.00	158,915.20			
		PROLOGIS INC	15,407.00	943,370.61			
		PUBLIC STORAGE	4,529.00	843,797.99			
		REALTY INCOME CORP	7,942.00	392,334.80			
		REGENCY CENTERS CORP	4,440.00	257,786.40			
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,507.00	595,208.04			
		SIMON PROPERTY GROUP INC	9,016.00	1,402,799.44			
		SL GREEN REALTY CORP	2,874.00	276,622.50			
		UDR INC	7,836.00	268,304.64			
		VENTAS INC	10,322.00	518,886.94			
		VEREIT	27,459.00	187,819.56			
		VORNADO REALTY TRUST	4,967.00	334,229.43			
		WELLTOWER INC	10,672.00	584,825.60			
			アメリカ・ドル 小計		347,056.00	18,007,821.43 (1,936,561,117)	
		イギリス・ポンド		BRITISH LAND CO PLC	28,047.00	181,632.37	
				HAMMERSON PLC	22,610.00	105,317.38	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,390.00	200,745.15	
	SEGRO PLC	28,362.00	164,726.49	
イギリス・ポンド 小計		100,409.00	652,421.39 (98,248,137)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	32,572.00	303,245.32	
	GOODMAN GROUP	55,934.00	462,574.18	
	GPT GROUP	58,614.00	279,002.64	
	MIRVAC GROUP	117,895.00	247,579.50	
	SCENTRE GROUP	162,077.00	619,134.14	
	STOCKLAND	77,433.00	310,506.33	
	VICINITY CENTRES	107,796.00	269,490.00	
オーストラリア・ドル 小計	WESTFIELD CORP	60,341.00	517,725.78	
オーストラリア・ドル 小計		672,662.00	3,009,257.89 (255,365,624)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	4,016.00	81,444.48	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,583.00	109,258.72	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,896.00	56,861.04	
カナダ・ドル 小計		10,495.00	247,564.24 (21,050,387)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	71,000.00	185,310.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	69,400.00	122,144.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	70,500.00	141,000.00	
	SUNTEC REIT	73,500.00	141,855.00	
シンガポール・ドル 小計		284,400.00	590,309.00 (48,145,602)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	983.00	85,422.70	
	GECINA SA	1,371.00	209,488.80	
	ICADE	956.00	78,248.60	
	KLEPIERRE	6,372.00	214,545.24	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,893.00	545,619.80	
ユーロ 小計		12,575.00	1,133,325.14 (150,358,246)	
香港・ドル	LINK REIT	64,871.00	4,216,615.00	
香港・ドル 小計		64,871.00	4,216,615.00 (57,936,290)	
投資証券 合計			2,567,665,403 (2,567,665,403)	
合計			2,567,665,403 (2,567,665,403)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## (注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	602銘柄	62.83%	-
	投資証券	39銘柄	-	
イギリス・ポンド	株式	99銘柄	6.80%	-
	投資証券	4銘柄	-	
イスラエル・シケル	株式	9銘柄	0.10%	-
オーストラリア・ドル	株式	57銘柄	2.49%	-
	投資証券	8銘柄	-	
カナダ・ドル	株式	87銘柄	3.54%	-
	投資証券	3銘柄	-	
シンガポール・ドル	株式	21銘柄	0.49%	-
	投資証券	4銘柄	-	
スイス・フラン	株式	37銘柄	3.17%	-
スウェーデン・クローナ	株式	30銘柄	1.08%	-
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.72%	-
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.07%	-
ノルウェー・クローネ	株式	9銘柄	0.27%	-
ユーロ	株式	235銘柄	12.78%	-
	投資証券	5銘柄	-	
香港・ドル	株式	41銘柄	1.25%	-
	投資証券	1銘柄	-	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	44,592,859	29,864,159
金銭信託	1,703,310	1,839,635
コール・ローン	116,871,965	68,761,857
国債証券	10,586,152,868	14,591,334,799
派生商品評価勘定	228,403	59
未収利息	76,894,825	101,509,998
前払費用	6,438,669	14,079,326
流動資産合計	10,832,882,899	14,807,389,833
資産合計	10,832,882,899	14,807,389,833
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	170,501	138,280
未払金	95,765,701	28,320,985
未払解約金	25,116,084	31,467,602
その他未払費用	96	340
流動負債合計	121,052,382	59,927,207
負債合計	121,052,382	59,927,207
純資産の部		
元本等		
元本	8,392,729,180	11,229,834,925
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,319,101,337	3,517,627,701
純資産合計	10,711,830,517	14,747,462,626
負債純資産合計	10,832,882,899	14,807,389,833

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で 評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に 換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
1. 受益権総口数	8,392,729,180口	11,229,834,925口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2763円 (12,763円)	1.3132円 (13,132円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 2016年2月23日 至 2017年2月21日）	（自 2017年2月22日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、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、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	76,676,294	313,104,263
合計	76,676,294	313,104,263

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	（2017年2月21日 現在）				（2018年2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	91,618,507	-	91,676,409	57,902	59,270,345	-	59,132,124	138,221
アメリカ・ドル	57,305,276	-	57,244,048	61,228	45,005,524	-	44,867,341	138,183
イギリス・ポンド	5,162,783	-	5,206,384	43,601	1,471,622	-	1,471,681	59
カナダ・ドル	1,772,075	-	1,777,710	5,635	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	1,375,715	-	1,381,378	5,663	-	-	-	-
ユーロ	24,386,170	-	24,444,788	58,618	12,793,199	-	12,793,102	97
南アフリカ・ランド	1,616,488	-	1,622,101	5,613	-	-	-	-
合計	91,618,507	-	91,676,409	57,902	59,270,345	-	59,132,124	138,221

## （注）1．時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （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。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2017年2月21日現在)	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	6,098,993,413円	8,392,729,180円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,704,500,235円	6,358,922,180円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,410,764,468円	3,521,816,435円
元本の内訳		
ファンド名		
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	675,414,699円	1,210,082,327円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	1,704,138,534円	2,277,494,458円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	647,618,017円	807,934,874円
ニッセイ外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	789,995円	786,831円
ニッセイ厚生年金型バランス運用(現物型)DB(適格機関投資家限定)	1,195,726,527円	-円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	3,884,647,482円	6,209,806,473円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	255,884,039円	386,305,633円
DCニッセイ外国債券インデックス	28,406,600円	316,272,279円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	103,287円	1,283,694円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	-円	5,103,614円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	-円	95,027円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	-円	145,249円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	-円	261,567円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	-円	9,923,633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)	-円	2,037,267円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	-円	2,301,999円
計	8,392,729,180円	11,229,834,925円

附属明細表(2018年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	70,000.00	84,959.70	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	40,000.00	48,707.60	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	110,000.00	138,754.00	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	50,000.00	61,603.50	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	60,000.00	73,542.00	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	80,000.00	101,831.20	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	40,000.00	51,204.40	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/06/15	690,000.00	678,539.10	

US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	1,090,000.00	1,069,900.40	
US TREASURY N/B 1 2019/03/15	820,000.00	810,545.40	
US TREASURY N/B 1 2019/09/30	850,000.00	833,926.50	
US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	1,060,000.00	1,043,061.20	
US TREASURY N/B 1.375 2019/12/15	830,000.00	817,350.80	
US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	910,000.00	894,784.80	
US TREASURY N/B 1.375 2020/02/29	630,000.00	618,678.90	
US TREASURY N/B 1.375 2020/03/31	660,000.00	647,598.60	
US TREASURY N/B 1.375 2020/08/31	700,000.00	683,291.00	
US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	1,140,000.00	1,106,199.00	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	360,000.00	336,304.80	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	320,000.00	297,635.20	
US TREASURY N/B 1.5 2020/05/31	620,000.00	608,685.00	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	320,000.00	302,172.80	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	510,000.00	456,429.60	
US TREASURY N/B 1.625 2019/03/31	850,000.00	845,444.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/06/30	710,000.00	704,895.10	
US TREASURY N/B 1.625 2019/08/31	820,000.00	813,013.60	
US TREASURY N/B 1.625 2019/12/31	830,000.00	820,562.90	
US TREASURY N/B 1.625 2020/06/30	600,000.00	590,178.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,150,000.00	1,102,022.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,200,000.00	1,146,420.00	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	490,000.00	446,184.20	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	500,000.00	453,750.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	670,000.00	648,432.70	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,030,000.00	995,598.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	580,000.00	557,907.80	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	720,000.00	687,009.60	
US TREASURY N/B 1.875 2020/12/15	780,000.00	769,119.00	
US TREASURY N/B 2 2020/09/30	640,000.00	634,048.00	

US TREASURY N/B 2 2021/11/15	1,160,000.00	1,138,064.40	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,080,000.00	1,057,125.60	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,010,000.00	978,871.80	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	310,000.00	295,709.00	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	520,000.00	492,596.00	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	510,000.00	480,812.70	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	500,000.00	465,000.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	660,000.00	652,291.20	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	1,070,000.00	1,056,325.40	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	700,000.00	690,235.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	710,000.00	698,767.80	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	560,000.00	548,996.00	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	620,000.00	605,175.80	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	300,000.00	289,113.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	320,000.00	306,787.20	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	520,000.00	495,783.60	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	670,000.00	666,020.20	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	320,000.00	311,398.40	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	870,000.00	839,680.50	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	300,000.00	289,392.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	520,000.00	497,837.60	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	510,000.00	483,260.70	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	500,000.00	472,440.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	480,000.00	452,904.00	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	310,000.00	257,129.50	
US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	710,000.00	709,439.10	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	890,000.00	867,465.20	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	500,000.00	478,300.00	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	720,000.00	712,317.60	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	860,000.00	846,257.20	

US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	340,000.00	299,489.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	320,000.00	280,822.40	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	310,000.00	271,804.90	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	950,000.00	956,118.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	1,120,000.00	1,126,865.60	
US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	770,000.00	774,897.20	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	760,000.00	760,919.60	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	730,000.00	729,737.20	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	180,000.00	168,249.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	230,000.00	214,725.70	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	320,000.00	294,748.80	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	290,000.00	267,206.00	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	340,000.00	324,193.40	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	320,000.00	303,449.60	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	310,000.00	293,275.50	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	130,000.00	127,237.50	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	330,000.00	321,000.90	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	320,000.00	311,110.40	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	330,000.00	320,562.00	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	310,000.00	300,625.60	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	320,000.00	310,147.20	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	860,000.00	870,044.80	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	970,000.00	989,400.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	110,000.00	110,059.40	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	140,000.00	140,064.40	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	220,000.00	219,535.80	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	320,000.00	318,649.60	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	340,000.00	353,810.80	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	950,000.00	974,491.00	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	90,000.00	95,986.80	

	US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	260,000.00	281,936.20	
	US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	350,000.00	379,760.50	
	US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	340,000.00	376,281.40	
	US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	130,000.00	146,285.10	
	US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	100,000.00	118,304.00	
	US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	140,000.00	166,135.20	
	US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	50,000.00	59,917.50	
	US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	110,000.00	132,446.60	
	US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	110,000.00	132,807.40	
	US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	70,000.00	85,320.20	
	US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	100,000.00	122,328.00	
	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	170,000.00	211,661.90	
	US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	160,000.00	203,155.20	
	US TREASURY N/B 5 2037/05/15	60,000.00	77,181.60	
	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	60,000.00	80,338.80	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	120,000.00	132,674.40	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	160,000.00	192,942.40	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	110,000.00	132,996.60	
	アメリカ・ドル 小計	57,870,000.00	56,977,488.60 (6,127,359,124)	
イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	120,000.00	125,692.80	
	TSY 3 3/4% 2020 3.75 2020/09/07	150,000.00	161,145.00	
	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	120,000.00	131,928.00	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	150,000.00	156,094.50	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	170,000.00	233,505.20	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	150,000.00	224,284.50	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	170,000.00	231,035.10	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	130,000.00	195,011.70	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	110,000.00	136,609.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	120,000.00	156,753.60	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	110,000.00	154,398.20	

TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	130,000.00	184,561.00	
TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	140,000.00	232,696.80	
TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	140,000.00	151,482.80	
TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	110,000.00	147,613.40	
TSY 4% 2022 4 2022/03/07	100,000.00	112,061.00	
TSY 4% 2060 4 2060/01/22	120,000.00	198,720.00	
TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	120,000.00	177,864.00	
TSY 5 2025 5 2025/03/07	130,000.00	162,089.20	
TSY 8% 2021 8 2021/06/07	100,000.00	123,075.00	
UK TREASURY 6 2028/12/07	80,000.00	114,584.00	
UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	200,000.00	203,724.00	
UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	150,000.00	150,385.50	
UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	160,000.00	143,704.00	
UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	190,000.00	184,355.10	
UK TSY 1 3/4% 2019 1.75 2019/07/22	250,000.00	253,847.50	
UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	180,000.00	185,607.00	
UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	70,000.00	68,964.70	
UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	130,000.00	137,475.00	
UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	120,000.00	131,053.20	
UK TSY 2% 2020 2 2020/07/22	210,000.00	216,102.60	
UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	160,000.00	167,342.40	
UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	140,000.00	222,346.60	
UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	190,000.00	238,691.30	
UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	130,000.00	191,545.90	
UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	180,000.00	236,840.40	
UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	110,000.00	170,867.40	
UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	210,000.00	205,109.10	
UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	140,000.00	136,731.00	
UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	90,000.00	87,120.00	
UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	140,000.00	174,022.80	
イギリス・ポンド 小計	5,820,000.00	7,017,040.30 (1,056,696,099)	



オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2020/11/21	210,000.00	207,807.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	60,000.00	59,335.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	50,000.00	49,570.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	170,000.00	160,216.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2019/10/21	180,000.00	182,359.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	210,000.00	211,619.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	210,000.00	207,721.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	170,000.00	167,295.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	70,000.00	68,349.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	50,000.00	46,743.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	90,000.00	81,703.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	210,000.00	217,154.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	160,000.00	164,710.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	50,000.00	49,133.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	100,000.00	106,475.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	250,000.00	276,455.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2020/04/15	230,000.00	241,810.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	110,000.00	128,302.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	240,000.00	276,559.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	140,000.00	144,995.20	
AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	180,000.00	206,220.60		
AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	300,000.00	332,997.00		
AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	210,000.00	239,618.40		
オーストラリア・ドル 小計		3,650,000.00	3,827,153.60 (324,772,254)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	40,000.00	43,451.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2019/02/01	30,000.00	29,693.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	120,000.00	112,918.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2019/05/01	40,000.00	39,570.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2019/08/01	80,000.00	78,868.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2020/09/01	210,000.00	204,115.80	

	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	170,000.00	164,055.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	110,000.00	105,384.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	120,000.00	114,414.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	130,000.00	115,700.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2019/11/01	110,000.00	109,049.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2020/02/01	110,000.00	108,795.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2020/03/01	180,000.00	178,826.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	120,000.00	116,227.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	100,000.00	94,043.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/03/01	160,000.00	160,212.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/09/01	210,000.00	209,972.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	90,000.00	88,411.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	50,000.00	48,394.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	110,000.00	110,007.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	100,000.00	101,732.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	110,000.00	113,129.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	110,000.00	116,545.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	90,000.00	93,612.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2020/06/01	100,000.00	103,600.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	130,000.00	156,130.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	200,000.00	205,136.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	120,000.00	151,815.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	110,000.00	152,329.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	90,000.00	119,925.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	90,000.00	127,919.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	30,000.00	44,138.70	
	カナダ・ドル 小計	3,570,000.00	3,718,126.50 (316,152,296)	
	シンガポール・ドル			
	SINGAPORE GOVERNMENT 1.625 2019/10/01	50,000.00	50,025.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	20,000.00	19,730.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	80,000.00	81,104.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	10,000.00	9,301.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	20,000.00	20,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.5 2019/06/01	60,000.00	60,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	50,000.00	51,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	40,000.00	39,620.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	20,000.00	19,682.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	10,000.00	10,363.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	40,000.00	41,320.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	50,000.00	52,325.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	60,000.00	63,030.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25 2020/09/01	50,000.00	51,865.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	50,000.00	54,522.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	50,000.00	54,607.50	
シンガポール・ドル	小計	660,000.00	680,005.80 (55,461,273)	
スイス・フラン	SWITZERLAND 2.25 2020/07/06	160,000.00	171,961.60	
	SWITZERLAND 4 2023/02/11	40,000.00	48,858.00	
スイス・フラン	小計	200,000.00	220,819.60 (25,376,588)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	330,000.00	325,574.70	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	520,000.00	533,332.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	660,000.00	706,464.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	520,000.00	594,266.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	770,000.00	886,832.10	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	360,000.00	485,179.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25 2019/03/12	750,000.00	789,982.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	800,000.00	921,080.00	
スウェーデン・クローナ	小計	4,710,000.00	5,242,711.70 (69,623,211)	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2020/11/15	260,000.00	264,318.60	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	420,000.00	408,366.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	400,000.00	428,176.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	660,000.00	720,766.20	

	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	660,000.00	737,332.20	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	570,000.00	615,240.90	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,040,000.00	1,679,901.60	
デンマーク・クローネ 小計		4,010,000.00	4,854,101.50 (86,451,548)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	320,000.00	313,078.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	290,000.00	290,794.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	240,000.00	237,076.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	550,000.00	565,570.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	420,000.00	454,784.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	610,000.00	661,685.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	650,000.00	681,343.00	
ノルウェー・クローネ 小計		3,080,000.00	3,204,333.00 (43,963,449)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0 2019/04/25	170,000.00	167,314.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.5 2020/04/25	120,000.00	119,592.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	350,000.00	329,542.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	230,000.00	213,348.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2019/07/25	60,000.00	61,498.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	180,000.00	180,531.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	330,000.00	349,684.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2020/10/25	280,000.00	304,752.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	260,000.00	277,019.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	540,000.00	605,556.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	350,000.00	398,055.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	70,000.00	85,620.50	
	ポーランド・ズロチ 小計		2,940,000.00	3,092,513.90 (98,867,669)
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	240,000.00	236,575.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	140,000.00	137,793.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	80,000.00	77,516.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.759 2019/03/15	50,000.00	50,325.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	60,000.00	55,771.20	

	MALAYSIA GOVERNMENT 3.889 2020/07/31	230,000.00	232,493.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	200,000.00	194,766.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	60,000.00	59,176.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	90,000.00	89,550.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	30,000.00	28,646.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	280,000.00	286,036.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	170,000.00	172,040.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	120,000.00	116,880.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	70,000.00	67,270.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.378 2019/11/29	200,000.00	203,568.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	120,000.00	121,809.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	70,000.00	70,130.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	50,000.00	48,904.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	70,000.00	71,204.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	101,779.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	64,402.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.734 2019/07/30	50,000.00	51,801.00	
	マレーシア・リンギット 小計	2,540,000.00	2,538,440.10 (69,883,256)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	2,090,000.00	2,347,613.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	700,000.00	846,601.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5 2019/12/11	1,730,000.00	1,652,720.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	1,240,000.00	1,095,589.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	2,450,000.00	2,368,317.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	2,050,000.00	1,963,428.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	1,260,000.00	1,241,364.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,050,000.00	1,045,296.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	640,000.00	634,905.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	1,580,000.00	1,556,552.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	2,360,000.00	2,378,266.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	710,000.00	720,770.70	

	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	400,000.00	403,712.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	840,000.00	886,225.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	780,000.00	829,483.20	
メキシコ・ペソ 小計		19,880,000.00	19,970,846.90 (114,832,370)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	40,000.00	39,830.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	50,000.00	50,013.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	130,000.00	131,911.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	100,000.00	99,185.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	40,000.00	39,122.80	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	130,000.00	132,589.60	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	80,000.00	77,696.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	20,000.00	19,781.60	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	70,000.00	67,137.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	50,000.00	53,036.50	
	BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	20,000.00	20,835.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	110,000.00	122,089.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	20,000.00	21,703.40	
	BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	120,000.00	136,383.60	
	BELGIUM KINGDOM 3 2019/09/28	100,000.00	105,600.00	
	BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	60,000.00	74,173.80	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	150,000.00	166,038.00	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	80,000.00	116,048.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2019/03/28	100,000.00	105,024.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	110,000.00	128,403.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	60,000.00	81,762.60	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	140,000.00	162,272.60	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	130,000.00	155,197.90	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	140,000.00	212,655.80	
	BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	80,000.00	104,365.60	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	160,000.00	249,035.20	

BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	150,000.00	216,987.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	80,000.00	80,068.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2019/01/31	140,000.00	140,861.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	160,000.00	160,561.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	80,000.00	80,143.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	160,000.00	163,644.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	160,000.00	164,873.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	180,000.00	179,317.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2020/01/31	180,000.00	185,621.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	180,000.00	178,812.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	140,000.00	140,775.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	160,000.00	166,686.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	160,000.00	168,596.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	160,000.00	162,184.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	170,000.00	182,637.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	60,000.00	61,989.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2019/04/30	180,000.00	186,696.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	180,000.00	201,832.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	130,000.00	137,216.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	60,000.00	68,056.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	170,000.00	200,856.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	180,000.00	196,360.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	160,000.00	208,376.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	160,000.00	172,409.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	160,000.00	193,612.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.6 2019/07/30	170,000.00	182,102.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	170,000.00	213,834.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	140,000.00	197,057.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	140,000.00	173,269.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.85 2020/10/31	140,000.00	158,506.60	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	130,000.00	186,431.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	140,000.00	188,312.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	100,000.00	149,992.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	180,000.00	223,246.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	200,000.00	234,650.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	170,000.00	251,970.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	180,000.00	219,738.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	150,000.00	205,381.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	200,000.00	287,052.00	
BUNDES OBLIGATION 0 2020/04/17	150,000.00	151,654.50	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/04/09	170,000.00	171,842.80	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/10/08	170,000.00	171,451.80	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/04/08	140,000.00	140,778.40	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/10/07	120,000.00	120,180.00	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2019/10/11	140,000.00	141,964.20	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2020/10/16	150,000.00	152,773.50	
BUNDES OBLIGATION 0.5 2019/04/12	120,000.00	121,610.40	
BUNDES OBLIGATION 1 2019/02/22	140,000.00	142,371.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	200,000.00	190,794.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	210,000.00	203,353.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	180,000.00	181,697.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	200,000.00	200,152.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	210,000.00	206,543.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	30,000.00	29,346.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	160,000.00	167,273.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	180,000.00	187,642.80	



BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	40,000.00	38,576.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	340,000.00	364,218.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	140,000.00	150,281.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	140,000.00	150,362.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	140,000.00	150,761.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	230,000.00	250,987.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	150,000.00	162,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	160,000.00	176,305.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2020/09/04	60,000.00	64,156.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	150,000.00	162,558.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	170,000.00	213,543.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	180,000.00	228,211.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3 2020/07/04	270,000.00	292,482.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	160,000.00	171,536.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	260,000.00	291,202.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	120,000.00	168,916.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	190,000.00	200,809.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	180,000.00	267,033.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	120,000.00	188,436.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	150,000.00	233,004.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	130,000.00	219,226.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	70,000.00	112,924.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/03/15	90,000.00	90,650.70	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/06/14	90,000.00	90,769.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/09/13	100,000.00	100,961.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/12/13	100,000.00	101,053.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2019/10/15	120,000.00	120,494.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.1 2019/04/15	180,000.00	180,916.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	150,000.00	150,805.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2020/11/01	130,000.00	131,888.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	120,000.00	117,016.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	260,000.00	264,147.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	120,000.00	120,126.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.05 2019/12/01	120,000.00	122,572.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	140,000.00	132,533.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	460,000.00	473,381.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	250,000.00	257,712.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2019/08/01	130,000.00	133,348.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	160,000.00	158,772.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	140,000.00	137,449.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	170,000.00	153,635.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	110,000.00	113,494.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	140,000.00	142,647.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	120,000.00	119,913.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	240,000.00	255,050.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	140,000.00	142,165.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	120,000.00	111,603.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	100,000.00	97,977.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2019/05/01	130,000.00	134,378.40	

BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	250,000.00	266,585.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	120,000.00	111,714.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	40,000.00	35,590.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	70,000.00	70,650.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	120,000.00	124,405.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	60,000.00	63,488.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	180,000.00	200,907.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	190,000.00	210,280.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	140,000.00	155,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	430,000.00	479,798.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	170,000.00	194,896.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	260,000.00	285,771.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	220,000.00	260,055.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	210,000.00	219,187.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	170,000.00	181,656.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2020/03/01	190,000.00	206,744.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2019/03/01	90,000.00	94,468.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2020/02/01	180,000.00	196,160.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	160,000.00	188,576.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	190,000.00	225,607.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	180,000.00	216,862.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	190,000.00	227,498.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	180,000.00	222,759.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	140,000.00	182,256.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	200,000.00	246,202.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	200,000.00	262,588.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	180,000.00	239,560.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	180,000.00	238,469.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	220,000.00	286,125.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	160,000.00	193,912.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	170,000.00	206,691.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	150,000.00	208,825.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	240,000.00	336,007.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	230,000.00	320,095.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	90,000.00	129,081.60	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	90,000.00	125,973.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	150,000.00	233,901.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	110,000.00	161,584.50	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	80,000.00	122,579.20	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	30,000.00	29,546.40	
FINNISH GOVERNMENT 0.375 2020/09/15	40,000.00	40,735.20	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	50,000.00	49,387.50	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	30,000.00	29,073.30	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	30,000.00	28,718.10	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	30,000.00	30,666.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	50,000.00	53,385.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	70,000.00	75,061.70	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	40,000.00	43,980.80	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	40,000.00	50,566.80	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	40,000.00	47,470.80	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	60,000.00	64,903.20	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	50,000.00	55,861.50	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	40,000.00	49,996.00	
FINNISH GOVERNMENT 4.375 2019/07/04	40,000.00	42,716.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2019/02/25	130,000.00	130,786.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/02/25	220,000.00	221,969.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/05/25	180,000.00	181,634.40	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	30,000.00	30,199.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	200,000.00	201,212.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	200,000.00	199,840.00	

FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	100,000.00	99,007.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	180,000.00	182,664.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	230,000.00	219,525.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2019/11/25	200,000.00	203,578.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	270,000.00	269,076.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	220,000.00	216,418.40	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	100,000.00	97,605.00	
FRANCE (GOVT OF) 1 2019/05/25	130,000.00	132,594.80	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	220,000.00	226,153.40	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	250,000.00	252,987.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	190,000.00	182,698.30	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	280,000.00	288,932.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	380,000.00	411,008.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	290,000.00	314,745.70	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	80,000.00	82,315.20	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	50,000.00	46,638.50	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	140,000.00	145,404.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	250,000.00	275,305.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	270,000.00	301,214.70	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2020/10/25	300,000.00	322,782.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	260,000.00	299,912.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	300,000.00	351,519.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	350,000.00	394,296.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	310,000.00	348,585.70	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	200,000.00	265,316.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	310,000.00	336,585.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	290,000.00	356,033.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2019/10/25	380,000.00	407,447.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	310,000.00	349,348.30	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	210,000.00	302,402.10	

FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	110,000.00	172,055.40	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	110,000.00	176,229.90	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	260,000.00	274,830.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	370,000.00	453,512.70	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	260,000.00	406,049.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	210,000.00	318,786.30	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	250,000.00	368,040.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	260,000.00	416,806.00	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	220,000.00	309,914.00	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	50,000.00	51,562.00	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	90,000.00	90,899.10	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	40,000.00	40,166.80	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	60,000.00	61,900.80	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	80,000.00	89,918.40	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	30,000.00	29,739.90	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	30,000.00	29,241.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	60,000.00	70,552.80	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	50,000.00	59,225.50	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	90,000.00	128,751.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	120,000.00	120,548.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	60,000.00	58,942.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2020/01/15	120,000.00	121,837.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	120,000.00	117,595.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	120,000.00	118,509.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	120,000.00	119,631.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	130,000.00	141,009.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	120,000.00	132,460.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	130,000.00	143,135.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	110,000.00	131,093.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	110,000.00	145,272.60	

NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	130,000.00	145,540.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.5 2020/07/15	120,000.00	131,470.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	110,000.00	129,827.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	120,000.00	180,187.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	120,000.00	127,796.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	120,000.00	177,210.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	100,000.00	144,952.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	30,000.00	29,949.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.25 2019/10/18	50,000.00	50,643.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	60,000.00	58,212.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	90,000.00	90,033.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	80,000.00	83,674.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	30,000.00	29,399.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	20,000.00	17,266.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	80,000.00	86,378.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	130,000.00	140,856.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.95 2019/06/18	70,000.00	72,312.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	30,000.00	31,295.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	50,000.00	58,181.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	50,000.00	68,182.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	80,000.00	92,627.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	130,000.00	146,968.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	80,000.00	92,216.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	30,000.00	49,533.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.9 2020/07/15	110,000.00	121,277.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	110,000.00	162,347.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	90,000.00	94,681.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	60,000.00	80,221.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	80,000.00	119,808.80	
TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	90,000.00	99,609.30	

	TREASURY 4.4% 2019 4.4 2019/06/18	30,000.00	31,969.80	
	TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	60,000.00	68,611.80	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	90,000.00	119,271.60	
	TREASURY 5.9% 2019 5.9 2019/10/18	70,000.00	77,457.10	
ユーロ	小計	40,370,000.00	46,018,710.50 (6,105,302,322)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	1,580,000.00	1,816,368.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	790,000.00	602,098.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	710,000.00	534,026.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	450,000.00	446,805.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	820,000.00	716,688.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	390,000.00	393,783.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	640,000.00	649,254.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	840,000.00	807,189.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	680,000.00	653,786.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	790,000.00	752,672.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	760,000.00	731,272.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	1,420,000.00	1,367,815.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	610,000.00	606,218.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	460,000.00	455,648.40	
南アフリカ・ランド	小計	10,940,000.00	10,533,625.10 (96,593,342)	
国債証券	合計		14,591,334,799 (14,591,334,799)	
合計			14,591,334,799 (14,591,334,799)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 116銘柄	41.55%	41.99%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	7.17%	7.24%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	2.20%	2.23%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	2.14%	2.17%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.38%	0.38%
スイス・フラン	国債証券 2銘柄	0.17%	0.17%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.47%	0.48%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.59%	0.59%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.30%	0.30%



ポーランド・ズロチ	国債証券	12銘柄	0.67%	0.68%
マレーシア・リンギット	国債証券	22銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.78%	0.79%
ユーロ	国債証券	285銘柄	41.40%	41.84%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	0.65%	0.66%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等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。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」（2018年2月28日現在）

資産総額	8,120,804,751円
負債総額	581,905円
純資産総額（ - ）	8,120,222,846円
発行済数量	4,612,734,452口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7604円

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」（2018年2月28日現在）

資産総額	20,501,127,711円
負債総額	8,395,623円
純資産総額（ - ）	20,492,732,088円
発行済数量	9,912,210,575口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0674円

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」（2018年2月28日現在）

資産総額	10,976,266,329円
負債総額	9,844,754円
純資産総額（ - ）	10,966,421,575円
発行済数量	4,611,936,100口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3778円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

### （2）受益者に対する特典

ありません。

### （3）譲渡制限

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

### （4）受益権の譲渡

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

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

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2018年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年2月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	348	53,212
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	75	17,552
単位型公社債投資信託	2	81
合計	425	70,846

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

- (1) 委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

#### 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22期事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第23期事業年度に係る中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2016年3月31日)		当事業年度 (2017年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		9,619,679		20,957,403
有価証券		7,602,477		6,499,770
前払費用		390,202		511,014
未収委託者報酬		3,426,935		3,687,850
未収運用受託報酬		1,649,081		1,656,206
未収投資助言報酬		208,775		91,351
繰延税金資産		480,820		327,435
その他		19,980		11,984
流動資産合計		23,397,951		33,743,017
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	80,574	1	71,578
車両	1	294	1	0
器具備品	1	114,079	1	92,090
有形固定資産合計		194,948		163,668
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		742,019		765,393
ソフトウェア仮勘定		88,417		166,377
その他		8,043		8,013
無形固定資産合計		838,479		939,784
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		35,476,609		29,600,256
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		171,056
差入保証金		285,819		285,884
繰延税金資産		170,956		280,043
その他		793		10,177
投資その他の資産合計		36,000,401		30,413,641
固定資産合計		37,033,830		31,517,095
資産合計		60,431,781		65,260,112

## 負債の部

## 流動負債

預り金	34,054	34,889
未払収益分配金	1,531	2,498
未払償還金	118,764	27,718
未払手数料	1,204,424	1,269,371
未払運用委託報酬	746,912	659,099
未払投資助言報酬	624,770	566,198
その他未払金	447,074	356,756
未払費用	110,997	104,560
未払法人税等	2,793,014	1,272,113
賞与引当金	864,968	746,320
その他	505,003	217,295
流動負債合計	7,451,515	5,256,823

## 固定負債

退職給付引当金	1,404,058	1,519,642
役員退職慰労引当金	26,800	15,750
固定負債合計	1,430,858	1,535,392
負債合計	8,882,374	6,792,216

## 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	31,277,901	38,693,404
利益剰余金合計	31,957,708	39,373,211
株主資本合計	50,239,548	57,655,051

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,309,858	812,844
評価・換算差額等合計	1,309,858	812,844

## 純資産合計

純資産合計	51,549,407	58,467,896
負債・純資産合計	60,431,781	65,260,112



## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2015年4月1日 至 2016年3月31日)		当事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		23,796,732		24,865,689
運用受託報酬		10,253,108		9,257,111
投資助言報酬		887,392		511,448
営業収益計		34,937,233		34,634,249
営業費用				
支払手数料		10,915,789		11,232,556
広告宣伝費		59,346		25,920
調査費		5,358,400		5,110,928
支払運用委託報酬		2,043,036		1,719,103
支払投資助言報酬		2,189,966		2,287,929
委託調査費		90,937		85,290
調査費		1,034,460		1,018,604
委託計算費		189,969		204,532
営業雑経費		712,706		776,544
通信費		47,397		49,069
印刷費		207,694		191,262
協会費		22,682		26,975
その他営業雑経費		434,931		509,237
営業費用計		17,236,212		17,350,482
一般管理費				
役員報酬	1	69,958	1	80,235
給料・手当		2,984,319		3,191,860
賞与引当金繰入額		864,968		745,410
賞与		245,495		244,745
福利厚生費		581,952		611,979
退職給付費用		298,054		241,990
役員退職慰労引当金繰入額		7,450		7,350
役員退職慰労金		100		630
その他人件費		134,593		128,730
不動産賃借料		544,913		623,115
その他不動産経費		25,766		25,985
交際費		24,568		28,549
旅費交通費		114,715		146,828
固定資産減価償却費		401,740		378,339
租税公課		183,280		280,494
業務委託費		225,301		206,740
器具備品費		173,657		245,657
保険料		57,047		56,210
諸経費		146,268		163,433
一般管理費計		7,084,153		7,408,286
営業利益		10,616,866		9,875,480
営業外収益				
受取利息		747		170
有価証券利息		66,047		50,483
受取配当金		214,632		138,431
為替差益		-		15,249
時効成立償還金		18,330		91,045

その他営業外収益		13,850		10,670
営業外収益計		313,608		306,050
営業外費用				
為替差損		18,136		-
控除対象外消費税		10,447		14,608
その他営業外費用		499		96
営業外費用計		29,083		14,704
経常利益		10,901,391		10,166,826
特別利益				
投資有価証券売却益		100,523		624,481
投資有価証券償還益		17,323		195,321
事故受取保険金	4	5,609		-
特別利益計		123,456		819,803
特別損失				
投資有価証券売却損		726		2,615
投資有価証券償還損		-		16,134
投資有価証券評価損		-		129,060
固定資産除却損	3	6,419	3	1,787
事故損失賠償金		-	2	6,119
特別損失計		7,145		155,717
税引前当期純利益		11,017,702		10,830,912
法人税、住民税及び事業税		3,740,258		3,013,428
法人税等調整額		137,203		274,628
法人税等合計		3,603,055		3,288,057
当期純利益		7,414,647		7,542,855

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2015年4月1日 至2016年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,087
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,560
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

当事業年度(自2016年4月1日 至2017年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金				利益 剰余金 合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
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	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,542,855	7,542,855	7,542,855
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,407,295	7,407,295	7,407,295
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,542,855
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	497,014	497,014	497,014
当期変動額合計	497,014	497,014	6,910,281
当期末残高	812,844	812,844	58,467,896

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

**(会計方針の変更)****(繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用)**

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日。以下「回収可能性適用指針」という。）を当期から適用し、繰延税金資産の回収可能性に関する会計処理の方法の一部を見直しております。

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当期の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3) から に該当する定めを適用した場合の繰延税金資産の額と、前期末の繰延税金資産の額との差額を、当期の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

この結果、当期の期首において、繰延税金資産（投資その他の資産）が8,207千円、繰越利益剰余金が8,207千円増加しております。

当期の期首の純資産に影響額が反映されたことにより、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は8,207千円増加しております。

**(2016年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用)**

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当期に適用し、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当期の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ187千円増加しております。

**(表示方法の変更)****(損益計算書の表示方法の変更)**

前期において、「営業外収益」の「その他営業外収益」に含めていた「時効成立償還金」は、重要性が増したため、当期より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他営業外収益」に表示していた32,180千円は、「時効成立償還金」18,330千円、「その他営業外収益」13,850千円として組み替えております。

## （貸借対照表関係）

	前事業年度 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
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。		
建物附属設備	287,659千円	301,414千円
車両	6,720	7,014
器具備品	453,566	450,664
計	747,946	759,093

## （損益計算書関係）

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	40,000千円	
2. 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。		
3. 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 2015年4月 1日 至 2016年3月31日)	当事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)
器具備品	6,419千円	1,787千円
4. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。		

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2015年4月1日 至2016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

2015年6月25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	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2015年3月31日
効力発生日	2015年6月25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

2016年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2016年3月31日
効力発生日	2016年6月24日

当事業年度(自2016年4月1日 至2017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

2016年6月24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	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2016年3月31日
効力発生日	2016年6月24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

2017年6月23日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,278,000千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日



## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、自己勘定の資金運用にあたっては、資金運用規則に沿って、慎重な資金管理、資本金の保全、投機の回避に十分に留意しております。また、資金の管理にあたっては、投資信託委託会社としての業務により当社が受け入れる投資信託財産に属する金銭等との混同を来たさないよう、分離して行っております。

投資有価証券は主として利付国債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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません(注2)を参照下さい)。

前事業年度(2016年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
その他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

当事業年度(2017年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	20,957,403	20,957,403	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,499,770	6,515,850	16,079
投資有価証券			
満期保有目的の債券	15,613,017	15,730,180	117,162
その他有価証券	13,919,739	13,919,739	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 現金・預金

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

## 有価証券

決算日の市場価格等によっております。

## 投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

非上場株式については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2016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	9,619,679	-	-	-
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	7,600,000	22,100,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2017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	20,957,403	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,500,000	15,600,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	1,543,642	10,698,606	1,611,564	1,136
合計	29,001,045	26,298,606	1,611,564	1,136

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2016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	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

当事業年度(2017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	22,112,787	22,246,030	133,242
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	22,112,787	22,246,030	133,242
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		22,112,787	22,246,030	133,242

## 2. その他有価証券

前事業年度（2016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	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
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）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
合計		13,290,620	11,398,606	1,892,014

当事業年度（2017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	5,850,740	5,806,313	44,426
	国債・地方債等	5,850,740	5,806,313	44,426
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	5,152,625	3,951,939	1,200,685
	小計	11,003,365	9,758,253	1,245,112
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）	2,916,373	2,988,610	72,236
	小計	2,916,373	2,988,610	72,236
	合計	13,919,739	12,746,863	1,172,876

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、前事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自2015年4月1日 至2016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	2,120,246	100,523	726
合計	2,120,246	100,523	726

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,520,915	624,481	2,615
合計	1,520,915	624,481	2,615

## 4．減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券のその他について129,060千円減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自2015年4月1日 至2016年3月31日）

## 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、年俸制総合職および一般職を制度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せん。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）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

退職給付引当金の期首残高	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 220,314 千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、46,819千円であります。

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

#### 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、年俸制総合職および一般職を制度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せん。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 2. 簡便法を適用した確定給付制度

##### （1）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

退職給付引当金の期首残高	1,404,058 千円
退職給付費用	167,807
退職給付の支払額	52,223
<u>退職給付引当金の期末残高</u>	<u>1,519,642</u>

##### （2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 167,807 千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、50,618千円であります。

## (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 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	266,903 千円	230,314 千円
未払事業税	179,194	63,109
その他	34,722	34,011
繰延税金資産合計	480,820	327,435
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	430,318	465,488
税務上の繰延資産償却超過額	2,980	3,415
役員退職慰労引当金	8,207	4,822
投資有価証券評価損	36,550	39,827
投資有価証券評価差額	39,867	22,140
その他	2,207	3,623
小計	520,132	539,318
評価性引当額	8,246	10
繰延税金資産合計	511,885	539,308
繰延税金負債		
特別分配金否認	68,623	34,979
投資有価証券評価差額	272,306	224,285
繰延税金負債合計	340,929	259,265
繰延税金資産(は負債)の純額	170,956	280,043

## 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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06 %	法定実効税率 (調整) 30.86 %
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.07	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.06
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.15	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.06
住民税均等割	0.05	住民税均等割 0.05
税率変更に伴う影響	0.71	税率変更に伴う影響 0.01
特定外国子会社留保金課税	0.16	特定外国子会社留保金課税 0.11
所得拡大促進税制による特別控除額	0.35	所得拡大促進税制による特別控除額 0.64
評価性引当額の増加	0.76	外国税額控除 0.02
外国税額控除	0.08	その他 0.02
その他	0.00	税効果会計適用後の法人税等の負担率 30.36
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.70	



## (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2015年4月1日 至2016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	営業収益
日本生命保険相互会社	4,199,085

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

## 1．サービスごとの情報

当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

## 1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等  
前事業年度（自2015年4月1日 至2016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	200,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,566,369	未収運用受託報酬	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

## 当事業年度（自2016年4月1日 至2017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	150,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,036,007	未収運用受託報酬	715,220
								投資助言報酬の受取	218,363	未収投資助言報酬	11,670

(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。

3. 取引条件の変更

一部の投資助言契約について取引条件を変更し、契約内容の一部を投資一任契約に移行しております。これにより、投資助言報酬及び未収投資助言報酬が減少し、運用受託報酬及び未収運用受託報酬が増加しております。

## 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 2015年4月 1日 至 2016年3月31日)	当事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)
1株当たり純資産額	475,337円55銭	539,133円00銭
1株当たり当期純利益金額	68,370円53銭	69,552円73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 2015年4月 1日 至 2016年3月31日)	当事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)
当期純利益	7,414,647千円	7,542,855千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	7,414,647千円	7,542,855千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第23期中間会計期間末 (2017年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		17,671,147
有価証券		6,602,399
前払費用		609,445
未収委託者報酬		3,999,420
未収運用受託報酬		2,335,491
未収投資助言報酬		107,292
繰延税金資産		273,657
その他		109,390
流動資産合計		31,708,245
固定資産		
有形固定資産	1	162,927
無形固定資産		943,974
投資その他の資産		
投資有価証券		31,224,218
関係会社株式		66,222
長期前払費用		24,779
差入保証金		285,839
繰延税金資産		285,545
その他		10,144
投資その他の資産合計		31,896,749
固定資産合計		33,003,651
資産合計		64,711,897

## 負債の部

## 流動負債

預り金	56,934
未払収益分配金	2,498
未払手数料	1,424,904
未払運用委託報酬	670,029
未払投資助言報酬	704,922
その他未払金	247,977
未払費用	148,596
未払法人税等	1,838,558
前受投資助言報酬	46,905
賞与引当金	469,996
その他	251,773
流動負債合計	5,863,096

## 固定負債

退職給付引当金	1,624,004
役員退職慰労引当金	19,475
固定負債合計	1,643,479

## 負債合計

7,506,576

## 純資産の部

## 株主資本

資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	37,387,299
利益剰余金合計	38,067,106
株主資本合計	56,348,946

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	856,374
評価・換算差額等合計	856,374

## 純資産合計

57,205,320

## 負債・純資産合計

64,711,897

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第23期中間会計期間	
(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	13,451,780
運用受託報酬	5,105,340
投資助言報酬	245,433
営業収益計	18,802,554
営業費用	9,435,094
一般管理費	1 3,962,305
営業利益	5,405,154
営業外収益	2 156,704
営業外費用	3 19,156
経常利益	5,542,703
特別利益	4 201,622
特別損失	5 1,216
税引前中間純利益	5,743,108
法人税、住民税及び事業税	1,741,273
法人税等調整額	29,939
法人税等合計	1,771,213
中間純利益	3,971,895

## (3)中間株主資本等変動計算書

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,278,000	5,278,000	5,278,000
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,971,895	3,971,895	3,971,895
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,306,104	1,306,104	1,306,104
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	37,387,299	38,067,106	56,348,946

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	812,844	812,844	58,467,896
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	5,278,000
中間純利益	-	-	3,971,895
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	43,529	43,529	43,529
当中間期変動額合計	43,529	43,529	1,262,575
当中間期末残高	856,374	856,374	57,205,320

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	第23期中間会計期間 （自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>其他有価証券 時価のあるもの ...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間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。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>



## (中間貸借対照表関係)

第23期中間会計期末 (2017年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	766,173千円
2.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

## (中間損益計算書関係)

第23期中間会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	24,084千円
無形固定資産	161,452千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	108,390千円
時効成立償還金	27,718千円
有価証券利息	18,426千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	9,594千円
為替差損	9,032千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	199,774千円
投資有価証券償還益	1,677千円
5.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	1,110千円
投資有価証券売却損	106千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第23期中間会計期間  
 (自 2017年4月1日  
 至 2017年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数(千株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項  
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2017年6月23日 定時株主総会	普通株式	5,278,000	48,686	2017年3月31日	2017年6月23日

（金融商品関係）

第23期中間会計期間末（2017年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含まれておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	17,671,147	17,671,147	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,602,399	6,615,380	12,980
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,857,433	14,910,725	53,291
其他有価証券	16,299,285	16,299,285	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

短期で決済されるため、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。

有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式（中間貸借対照表計上額66,222千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(有価証券関係)

第23期中間会計期間末(2017年9月30日現在)

## 1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	19,009,833	19,083,320	73,486
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	19,009,833	19,083,320	73,486
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	2,450,000	2,442,785	7,215
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,450,000	2,442,785	7,215
合計		21,459,833	21,526,105	66,271

## 2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,804,993	5,832,950	27,956
	国債・地方債等	5,804,993	5,832,950	27,956
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	5,916,409	7,162,730	1,246,320
小計		11,721,402	12,995,680	1,274,277
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,343,140	3,303,604	39,535
小計		3,343,140	3,303,604	39,535
合計		15,064,542	16,299,285	1,234,742

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式(中間貸借対照表計上額67,500千円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

1. サービスごとの情報

当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

該当事項はありません。

## （ 1 株当たり情報）

	第23期中間会計期間 （自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）
1株当たり純資産額	527,490円79銭
1株当たり中間純利益金額	36,624円88銭

（注）1．潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	3,971,861千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>3,971,861千円</u>
期中平均株式数	108千株

## （重要な後発事象）

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常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

2017年3月24日に開催された臨時株主総会において、定款の「取締役の責任免除」にかかる条項の追加が決議されました。

##### 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

2017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

2017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

(2017年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
東海東京証券株式会社	6,000百万円	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。
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
日本生命保険相互会社	1,300,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

2017年3月末現在、450百万円

##### c. 事業の内容

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



## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

### (3) 投資助言会社(参考情報)

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

## 3【資本関係】

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

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

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

### 第3【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  
（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）  
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

2017年5月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小暮和敏 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野あや子 印

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2016年4月1日から2017年3月31日までの第22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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 監査意見

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2017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すべ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。

### 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

2018年3月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2017年2月22日から2018年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2018年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

## 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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2018年3月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2017年2月22日から2018年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2018年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

## 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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2018年3月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2017年2月22日から2018年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2018年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

## 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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2017年11月27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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小暮和敏

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野あや子

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2017年4月1日から2018年3月31日までの第23期事業年度の中間会計期間（2017年4月1日から2017年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2017年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2017年4月1日から2017年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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