

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2019年8月20日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 西 啓介
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【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】</b>	<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）
<b>【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

<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)  
(以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の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：2019年8月21日(水)～2020年2月20日(木)

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)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

( 9 ) 【払込期日】

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

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(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/>

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### 基本方針

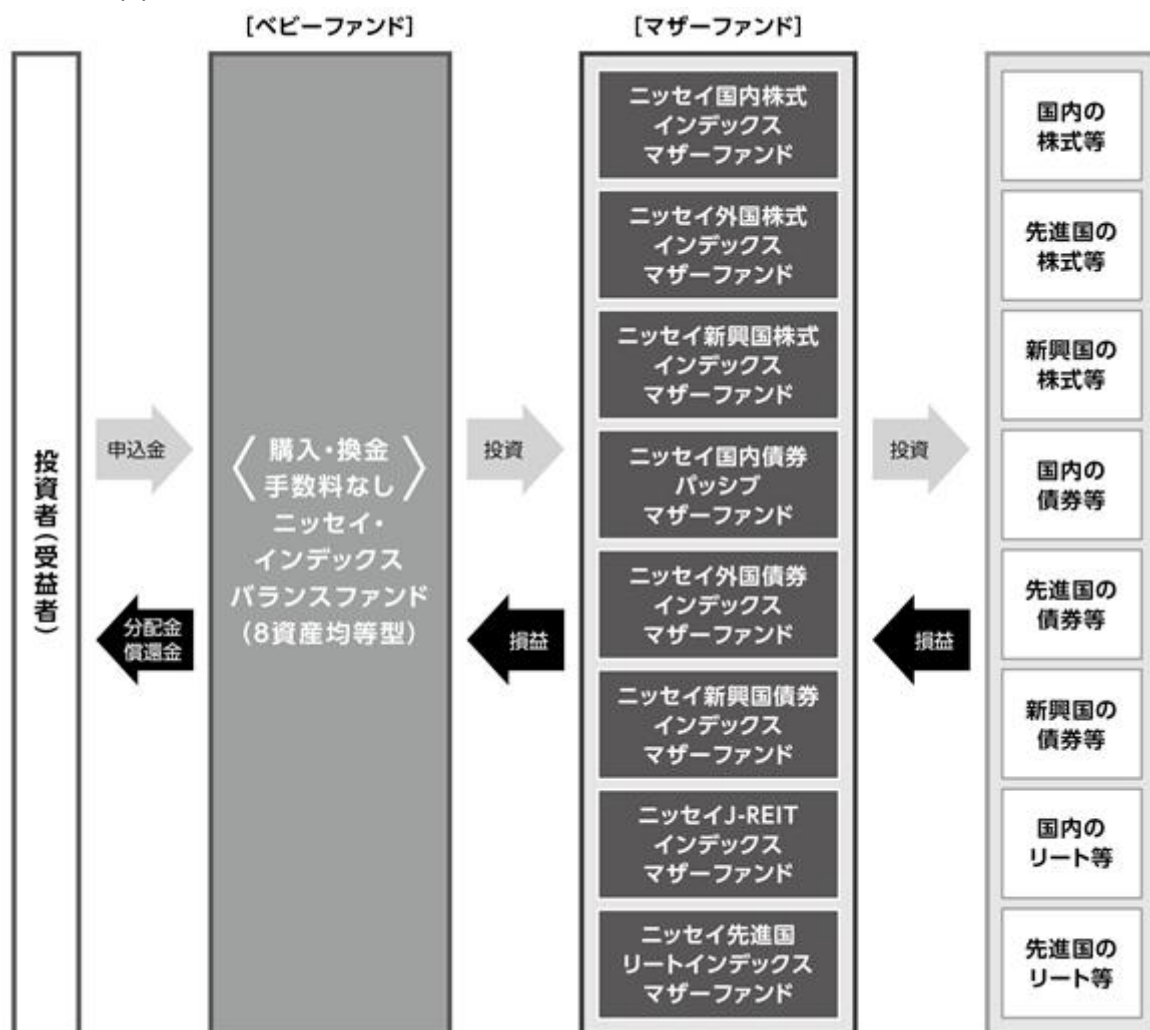
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



## ファンドの特色

## 1 国内外の株式・債券・リート(不動産投資信託証券)に分散投資を行います。

- 各投資対象資産の指数の動きに連動する投資成果をめざす8つのマザーファンドを主要投資対象とします。

### 【投資対象とするマザーファンド】

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	「TOPIX(東証株価指数)(配当込み)」の動きに連動する投資成果をめざします。
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)」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド <sup>※</sup>	「MSCIエマージング・マーケット・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めざします。
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざします。
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)」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	「JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	「東証REIT指数(配当込み)」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	「S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)」の動きに連動する投資成果をめざします。

※投資対象には、DR(預託証券)もしくは株式等と同等の投資効果が得られる証券および証書等を含みます。DR(預託証券)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し海外で発行される証券をいい、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

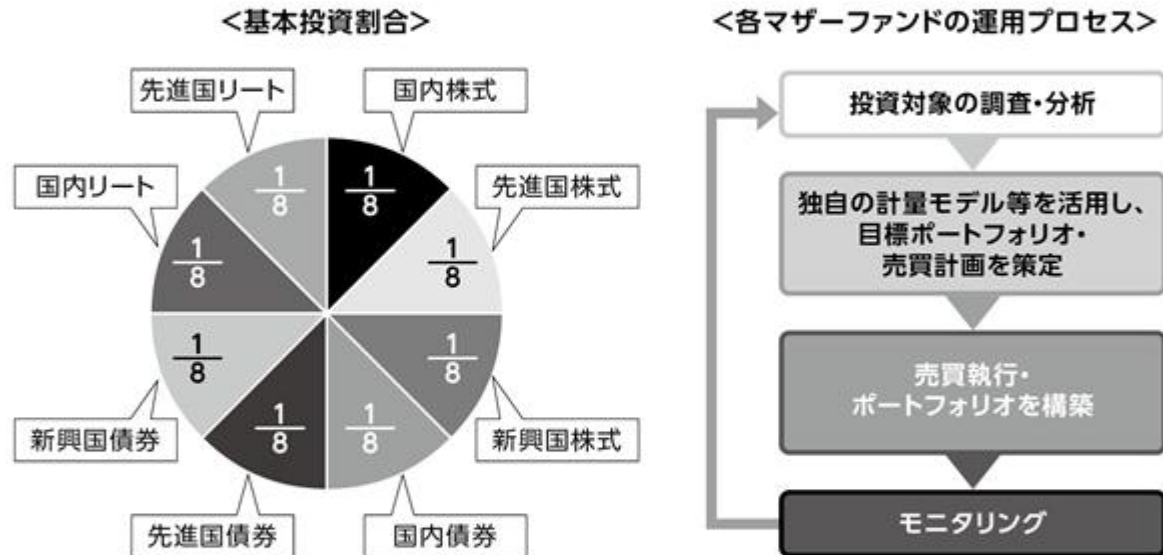
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ<sup>※</sup>を行いません。

※為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

## 2 8つの資産への投資割合は均等を基本とします。

- 各投資対象資産の指数を8分の1ずつ組合せた合成ベンチマーク\*の動きに連動する投資成果をめざします。

\*TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を8分の1ずつ組合せ、委託会社が独自に指数化したもの(以下「ベンチマーク」ということがあります)。



### <基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点>

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

## 3 購入時および換金時の手数料は無料です。

- 購入時の購入時手数料および換金時の換金時手数料、信託財産留保額はありせん。

・保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

## 〈各指数について〉

### ●TOPIX(東証株価指数)

株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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)の商標または標章に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

### ●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)はMSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。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。

### ●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)はMSCI Inc.が公表している指数であり、世界の新興国の株式により構成されています。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。

### ●NOMURA-BPI総合

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

### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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。

### ●JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)はJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(以下「EMBI+」)といいますがから格付がB格以下の債券等を除いたものです。

EMBI+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付債券等やローンを対象としています。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

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。

### ●東証REIT指数

東証REIT指数は、東証市場に上場する不動産投資信託(Real Estate Investment Trust)全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。東証REIT指数は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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・ノウハウおよび東証REIT指数の商標または標章に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。

### ●S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)

S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)(「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJII」)の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJII、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。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。



**<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独創性、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

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 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)			
債券 一般	年1回	日本			日経225
公債	年2回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
社債	年4回	欧州			
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	アジア			TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 債券・不動産 投信)資産配分 固定型))	日々	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 (合成ベンチ マーク)
	その他 ( )	アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマー ジング			

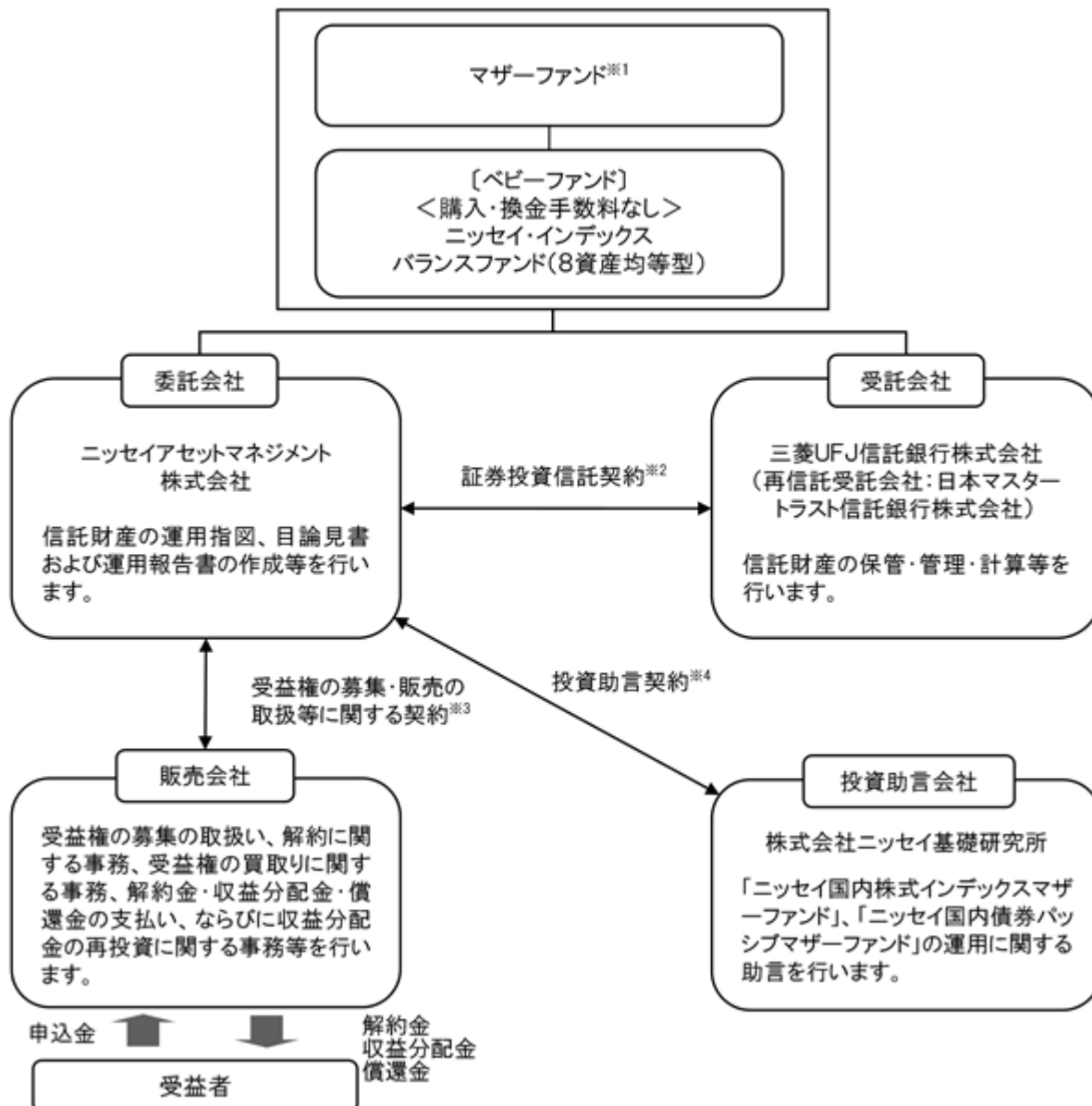
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券・ 不動産投信) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる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、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券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)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。
その他の指数 (合成ベンチマーク)	目論見書または約款において、合成ベンチマークの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2018年2月13日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



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

## 委託会社の概況（2019年5月末現在）

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】

複数のマザーファンドへの投資を通じ、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、東証REIT指数（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）を8分の1ずつ組合せた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ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、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興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基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の8分の1とします。

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

実質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。

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

### (1) 基本方針

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

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

#### b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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



## ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

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

## b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

## ニッセイ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。

## ニッセイ先進国リート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、S & P先進国REITインデックス（除く日本、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

世界各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みません）している日本を除く不動産投資信託証券（不動産投資法人の投資証券または不動産投資信託の受益証券をいいます）を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

主として、世界各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国の不動産投資信託証券に投資することにより、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

株式、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30%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の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投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

## ニッセイ新興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、MSCIEマージング・マーケット・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

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCIEマージング・マーケット・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めざします。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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。

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投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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。

## ニッセイ新興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、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（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

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

公社債の組入比率は、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

株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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



## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ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、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

## b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  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

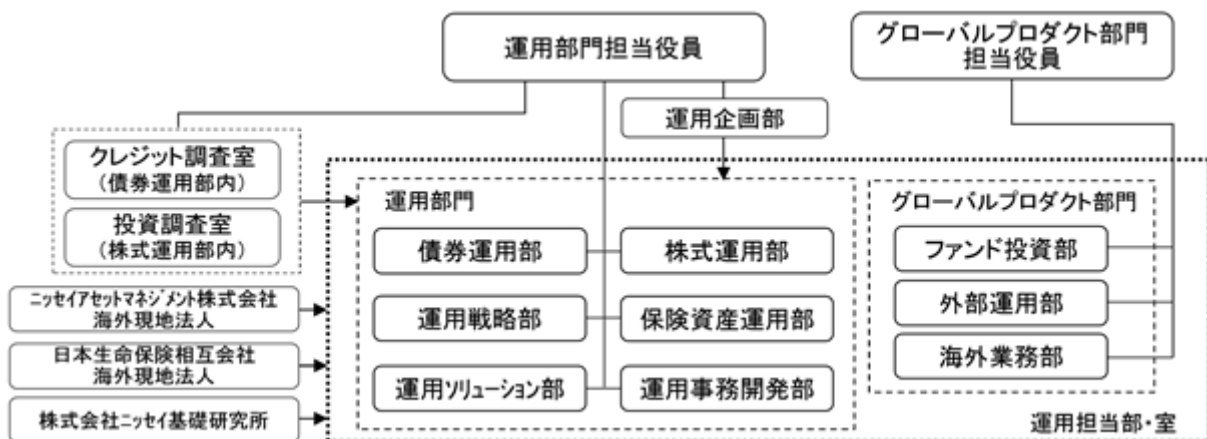
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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 に掲げる金融商品により運用することができます。

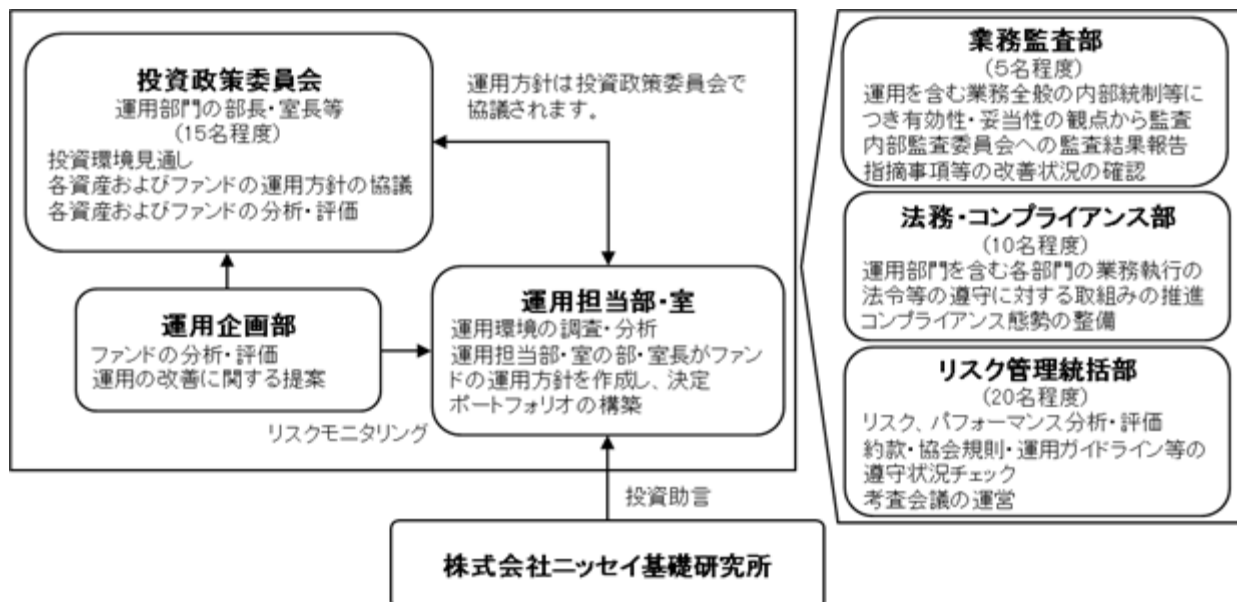
### （3）【運用体制】

#### 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



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲  
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
2. 分配対象額についての分配方針  
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。  
信託財産の十分な成長に資することに配慮し、分配を抑制する方針です。
3. 留保益の運用方針  
留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。  
分配時期  
毎決算日とし、決算日は11月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。  
支払方法  
< 分配金受取コースの場合 >  
税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。  
< 分配金再投資コースの場合 >  
税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

## a 約款に定める主な投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます）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。

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

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

## 信用取引の範囲

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

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

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

## 先物取引等

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

2. 国内の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品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. 国内の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

## スワップ取引

1. 異なった通貨、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、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、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、
  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、
  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、  
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、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、
    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、
- 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、
    - ・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、
  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、
  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、
- 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、
- 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、
  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、

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ます。
- 4．予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
- 5．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するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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



### 3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（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。また、ベンチマークの動きに連動することを目標に運用しますので、ベンチマークの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・不動産投資信託（リート）投資リスク

###### 保有不動産に関するリスク

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

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

###### 金利変動リスク

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

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

###### 信用リスク

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

###### J - R E I T の税制に関するリスク

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

###### リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

##### ・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。

##### ・カントリーリスク

外国の資産に投資するため、各国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受け、ファンドの資産価値が減少する可能性があります。特に、新興国の経済状況は先進

国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があり、ファンドの資産価値が大きく減少したり、運用方針にそった運用が困難になる可能性があります。

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

また、ファンドは中国A株への投資に際し、ストックコネクト(上海・香港相互株式取引制度および深セン・香港相互株式取引制度)を通じて行う場合があります。ストックコネクトを通じた投資は、取引や決済に関する特有の制限等で意図した取引等ができない場合、取引等に特有の費用が課される場合、ストックコネクトにおける取引停止や中国本土市場と香港市場の休業日の違いにより、中国本土市場の急変あるいは株価の大幅な変動時に対応できない場合等には、ファンドの基準価額と合成ベンチマークとの動きが一致しない要因となる場合があります。なお、ストックコネクトでは、大きな制度変更が行われる可能性があります。

ストックコネクトとは、ファンドを含む外国の投資家が、上海証券取引所および深セン証券取引所の中国A株を香港の証券会社を通じて売買することができる制度です。なお、中国A株とは、主な投資家として中国居住者を想定しているものですが、一定の条件のもとでファンドを含む外国の投資家にも投資が認められています。

・新興国の株式および債券投資に関する留意点

金融商品取引所の取引の停止(個別銘柄の売買停止等を含みます)、外国為替取引の停止、

その他やむを得ない事情(投資対象国・地域における非常事態の発生による市場の閉鎖、流動性の著しい低下あるいは資金の受渡しに関する障害等)があるときには、ファンドの購入・換金の申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた購入・換金の申込みの受け付けを取消すことがあります。

金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、クーデターや重大な政治体制の変更等。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

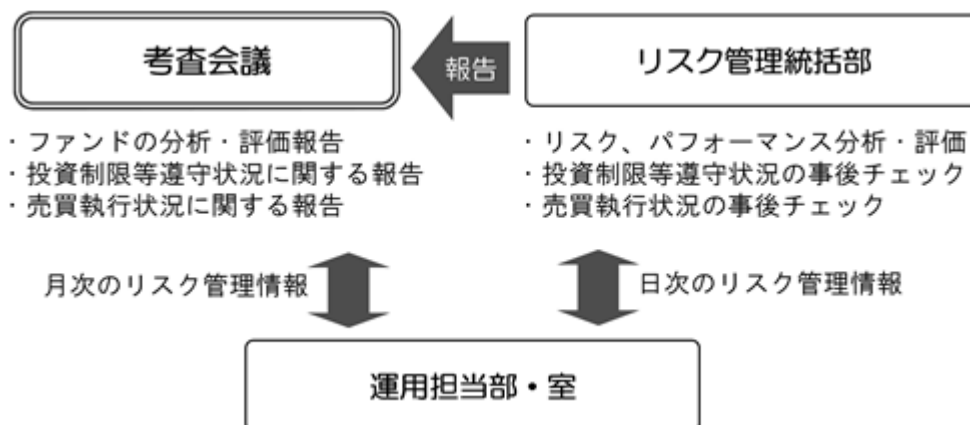
委託会社は2018年11月20日現在、ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の0.8%）保有しています。また、委託会社および委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2018年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に保有しています。

当該保有分は委託会社また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。

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（%）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	-	13.6
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	55.9	-
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	98.5	-
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	-	97.9

委託会社については実質保有比率が5%超のマザーファンドを記載しています。

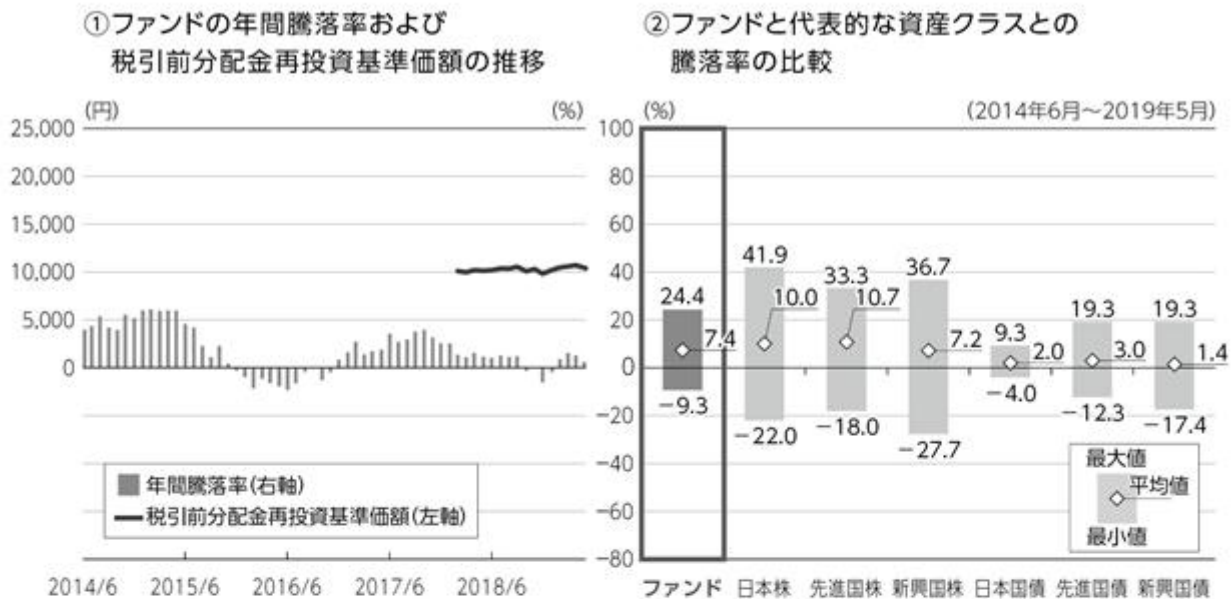
（2）投資リスク管理体制



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。



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

- ・TOPIX(東証株価指数)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)の商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。
- ・MSCIE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、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。
- ・JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPMオ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財産権は同社に帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.17172%（税抜0.159%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。

なお、2019年8月21日現在の信託報酬率は年0.17172%（税抜0.159%）であり、その配分は次の通りとします。

消費税率が10%になった場合は、年0.1749%となります。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.069%	0.070%	0.020%

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

ファンドが投資対象とするリートは、市場の需給により価格形成されるため、リートの費用は表示しておりません。

##### (4)【その他の手数料等】

###### 証券取引の手数料等

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

###### 監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.00108%（税抜0.001%）の率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

消費税率が10%になった場合は、年0.0011%となります。

###### 信託事務の諸費用

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

###### 借入金の利息

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

###### 信託財産留保額

ありません。

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

## &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】

## 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（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

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

#### < 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

#### 法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

#### 税率（法人）

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

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

#### 個別元本

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

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



### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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



## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

「&lt;購入・換金手数料なし&gt;ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	193,212,722	100.00
内 日本	193,212,722	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	917	0.00
純資産総額	193,211,805	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」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	53,929,180,730	95.03
内 日本	53,929,180,730	95.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,819,267,525	4.97
純資産総額	56,748,448,255	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）	2,771,040,000	4.88
内 日本	2,771,040,000	4.88

(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)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	62,835,927,640	72.33
内 日本	62,835,927,640	72.33
地方債証券	8,346,563,414	9.61
内 日本	8,346,563,414	9.61
特殊債券	8,650,913,303	9.96
内 日本	8,650,913,303	9.96
社債券	6,291,122,900	7.24
内 日本	5,876,919,100	6.76
内 スウェーデン	414,203,800	0.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	748,120,021	0.86
純資産総額	86,872,647,278	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」- REITインデックス マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	21,154,932,150	98.74
内 日本	21,154,932,150	98.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	269,935,004	1.26
純資産総額	21,424,867,154	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」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	160,368,110,184	94.89
内 アメリカ	104,879,975,403	62.06
内 イギリス	9,761,208,025	5.78
内 カナダ	6,290,058,182	3.72
内 フランス	6,171,401,914	3.65
内 スイス	6,164,575,802	3.65
内 ドイツ	5,230,637,196	3.09
内 オーストラリア	3,942,434,298	2.33
内 オランダ	3,559,040,495	2.11
内 アイルランド	2,467,726,227	1.46
内 香港	1,916,821,420	1.13
内 スペイン	1,853,857,021	1.10
内 スウェーデン	1,596,363,238	0.94
内 イタリア	1,122,212,387	0.66
内 デンマーク	1,040,435,163	0.62
内 シンガポール	783,618,519	0.46
内 フィンランド	603,429,755	0.36
内 ベルギー	594,286,608	0.35
内 ノルウェー	410,140,201	0.24
内 バミューダ	406,149,520	0.24
内 ジャージイー	319,023,107	0.19
内 イスラエル	269,375,203	0.16
内 ケイマン諸島	232,390,452	0.14
内 オランダ領キュラソー	223,411,828	0.13
内 ニュージーランド	153,283,986	0.09
内 オーストリア	138,316,814	0.08
内 ボルトガル	95,036,217	0.06
内 ルクセンブルグ	80,612,054	0.05
内 パプアニューギニア	33,377,371	0.02
内 イギリス領バージン諸島	23,221,104	0.01
内 モーリシャス	5,690,674	0.00
投資証券	4,452,557,351	2.63
内 アメリカ	3,604,520,736	2.13
内 オーストラリア	327,988,205	0.19
内 フランス	191,517,415	0.11
内 香港	117,399,282	0.07
内 イギリス	103,144,912	0.06
内 シンガポール	74,315,702	0.04
内 カナダ	33,671,099	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,182,209,694	2.47
純資産総額	169,002,877,229	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）	3,822,237,313	2.26
内 アメリカ	2,838,072,444	1.68
内 ドイツ	705,818,085	0.42
内 イギリス	278,346,784	0.16

（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せん。

（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」

（2019年5月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	19,655,047,971	98.99
内 アメリカ	9,335,455,828	47.02
内 フランス	1,943,073,065	9.79
内 イタリア	1,697,468,029	8.55
内 ドイツ	1,293,593,272	6.52
内 イギリス	1,276,618,964	6.43
内 スペイン	1,145,364,121	5.77
内 ベルギー	484,622,091	2.44
内 オーストラリア	394,665,304	1.99
内 オランダ	385,916,546	1.94
内 カナダ	383,253,876	1.93
内 オーストリア	288,424,986	1.45
内 メキシコ	158,782,260	0.80
内 アイルランド	138,615,749	0.70
内 フィンランド	117,840,210	0.59
内 ポーランド	117,225,463	0.59
内 南アフリカ	108,126,319	0.54
内 デンマーク	100,305,168	0.51
内 マレーシア	89,598,301	0.45
内 シンガポール	78,992,157	0.40
内 スウェーデン	69,543,606	0.35
内 ノルウェー	47,562,656	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	200,544,245	1.01
純資産総額	19,855,592,216	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)

「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	2,175,457,109	98.34
内 アメリカ	1,606,238,233	72.61
内 オーストラリア	153,017,205	6.92
内 イギリス	108,440,286	4.90
内 フランス	89,992,145	4.07
内 シンガポール	71,364,797	3.23
内 香港	52,745,753	2.38
内 カナダ	35,651,180	1.61
内 スペイン	15,611,571	0.71
内 ベルギー	14,032,937	0.63
内 ニュージーランド	9,283,373	0.42
内 オランダ	5,983,369	0.27
内 アイルランド	5,279,530	0.24
内 ドイツ	4,634,663	0.21
内 イスラエル	1,120,879	0.05
内 イタリア	832,070	0.04
内 ガーンジー	632,742	0.03
内 マン島	596,376	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	36,680,029	1.66
純資産総額	2,212,137,138	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)

「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,646,861,637	88.37
内 ケイマン諸島	218,274,581	11.71
内 韓国	207,424,036	11.13
内 台湾	186,997,580	10.03
内 中国	169,104,097	9.07
内 インド	167,736,127	9.00
内 ブラジル	132,452,997	7.11
内 香港	108,257,001	5.81
内 南アフリカ	97,115,516	5.21
内 ロシア	66,563,072	3.57
内 タイ	50,166,319	2.69
内 メキシコ	44,705,926	2.40
内 マレーシア	34,994,819	1.88
内 インドネシア	34,650,136	1.86
内 アメリカ	34,533,233	1.85
内 フィリピン	18,424,941	0.99
内 ポーランド	17,659,021	0.95
内 チリ	14,887,276	0.80
内 バミューダ	11,312,130	0.61
内 トルコ	7,660,240	0.41
内 ギリシャ	6,109,303	0.33
内 コロンビア	5,990,719	0.32
内 ハンガリー	4,797,060	0.26
内 チェコ	2,616,725	0.14
内 イギリス	2,223,119	0.12
内 オランダ	1,351,731	0.07
内 ペルー	853,932	0.05
投資信託受益証券	60,074,645	3.22
内 アメリカ	60,074,645	3.22
投資証券	4,368,780	0.24
内 南アフリカ	3,101,324	0.17
内 メキシコ	1,267,456	0.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	152,233,155	8.17
純資産総額	1,863,538,217	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)	146,956,874	7.89
内 アメリカ	146,956,874	7.89

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価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)

「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」

(2019年5月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	1,024,740,109	96.09
内 メキシコ	148,116,285	13.89
内 トルコ	142,234,762	13.34
内 インドネシア	136,796,781	12.83
内 ロシア	105,974,499	9.94
内 ブラジル	103,663,325	9.72
内 フィリピン	90,407,582	8.48
内 コロンビア	84,368,319	7.91
内 南アフリカ	52,491,334	4.92
内 ハンガリー	38,872,425	3.64
内 パナマ	35,875,864	3.36
内 クロアチア	29,504,103	2.77
内 ペルー	29,390,543	2.76
内 ルーマニア	27,044,287	2.54
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	41,732,349	3.91
純資産総額	1,066,472,458	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】

「&lt;購入・換金手数料なし&gt;ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)」

## 【投資有価証券の主要銘柄】

(2019年5月31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J-REITインデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	15,364,977	1.5404 23,668,841	1.6472 25,309,190	- -	13.10%
2	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	25,254,824	0.9742 24,604,615	0.9916 25,042,683	- -	12.96%
3	ニッセイ新興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	23,599,379	1.0044 23,704,163	1.0469 24,706,189	- -	12.79%
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	18,430,581	1.3308 24,528,828	1.3403 24,702,507	- -	12.79%
5	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	22,682,891	1.0373 23,529,862	1.0674 24,211,717	- -	12.53%
6	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	13,577,858	1.6934 22,993,385	1.7193 23,344,411	- -	12.08%
7	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	14,542,142	1.6766 24,382,423	1.6039 23,324,141	- -	12.07%
8	ニッセイ新興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	25,817,093	0.8997 23,228,049	0.8743 22,571,884	- -	11.68%

(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	100.00
	小計		100.00
合計(対純資産総額比)			100.00

(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。



(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

(2019年5月31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	276,800	6,789.90 1,879,445,030	6,384.00 1,767,091,200	- -	3.11%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	101,900	10,400.85 1,059,847,515	10,250.00 1,044,475,000	- -	1.84%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	166,700	5,272.18 878,873,582	5,257.00 876,341,900	- -	1.54%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,686,700	586.90 989,938,070	501.10 845,205,370	- -	1.49%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	166,700	4,698.60 783,257,880	4,866.00 811,162,200	- -	1.43%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	216,900	4,474.75 970,573,950	3,669.00 795,806,100	- -	1.40%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	12,200	62,570.00 763,354,000	61,510.00 750,422,000	- -	1.32%
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	172,700	4,040.87 697,859,726	3,783.00 653,324,100	- -	1.15%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	214,800	2,717.72 583,767,706	2,788.50 598,969,800	- -	1.06%
10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	170,100	3,025.30 514,604,670	3,468.00 589,906,800	- -	1.04%
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	209,600	3,033.08 635,735,184	2,651.00 555,649,600	- -	0.98%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	14,200	29,675.00 421,385,000	38,700.00 549,540,000	- -	0.97%
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,329,500	176.19 586,643,174	153.70 511,744,150	- -	0.90%
14	花王 日本	株式 化学	60,300	8,329.95 502,296,405	8,480.00 511,344,000	- -	0.90%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	22,200	24,839.22 551,430,778	22,645.00 502,719,000	- -	0.89%
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	171,700	3,253.99 558,711,102	2,833.00 486,426,100	- -	0.86%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	87,600	5,569.64 487,900,668	5,401.00 473,127,600	- -	0.83%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	44,200	10,620.66 469,433,400	10,310.00 455,702,000	- -	0.80%
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	33,900	12,351.28 418,708,600	13,230.00 448,497,000	- -	0.79%
20	ファナック 日本	株式 電気機器	23,600	19,408.80 458,047,900	18,475.00 436,010,000	- -	0.77%
21	日立製作所 日本	株式 電気機器	111,800	3,482.38 389,331,024	3,686.00 412,094,800	- -	0.73%
22	キヤノン 日本	株式 電気機器	133,700	3,223.95 431,042,810	3,065.00 409,790,500	- -	0.72%
23	日本電産 日本	株式 電気機器	29,900	13,401.25 400,697,600	13,590.00 406,341,000	- -	0.72%

24	信越化学工業	日本	株式 化学	42,900	9,595.17 411,633,100	9,047.00 388,116,300	- -	0.68%
25	資生堂	日本	株式 化学	49,400	7,217.80 356,559,600	7,833.00 386,950,200	- -	0.68%
26	NTTドコモ	日本	株式 情報・通信業	154,300	2,607.50 402,337,250	2,495.50 385,055,650	- -	0.68%
27	HOYA	日本	株式 精密機器	50,000	6,772.45 338,622,755	7,558.00 377,900,000	- -	0.67%
28	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式 小売業	102,600	4,973.56 510,288,244	3,666.00 376,131,600	- -	0.66%
29	第一三共	日本	株式 医薬品	71,100	3,906.31 277,738,869	5,255.00 373,630,500	- -	0.66%
30	オリエンタルランド	日本	株式 サービス業	28,100	12,286.24 345,243,600	13,250.00 372,325,000	- -	0.66%

(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	12.48
		情報・通信業	8.68
		輸送用機器	7.32
		化学	6.95
		銀行業	5.69
		医薬品	5.27
		サービス業	5.07
		機械	4.74
		卸売業	4.71
		陸運業	4.67
		小売業	4.38
		食料品	4.01
		建設業	2.72
		不動産業	2.35
		保険業	2.21
		その他製品	2.08
		精密機器	2.02
		電気・ガス業	1.65
		その他金融業	1.05
		鉄鋼	0.85
		ガラス・土石製品	0.80
		ゴム製品	0.73
		証券、商品先物取引業	0.72
		非鉄金属	0.70
		繊維製品	0.61
		石油・石炭製品	0.58
空運業	0.54		
金属製品	0.51		
パルプ・紙	0.26		
鉱業	0.24		
倉庫・運輸関連業	0.19		
海運業	0.14		
水産・農林業	0.11		
合計(対純資産総額比)	小計		95.03
			95.03

(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 0106月	買建	184	2,903,079,360	2,771,040,000	4.88%

(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)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2019年5月31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133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	103.22 1,032,263,000	103.25 1,032,520,000	0.828000 2023/5/19	1.19%
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	849,000,000	101.68 863,263,200	102.18 867,525,180	0.100000 2028/3/20	1.00%
3	第342回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	827,000,000	101.84 842,216,800	102.06 844,085,820	0.100000 2026/3/20	0.97%
4	第312回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	779,000,000	102.40 797,696,000	102.12 795,561,540	1.200000 2020/12/20	0.92%
5	第343回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	741,000,000	101.91 755,153,100	102.14 756,887,040	0.100000 2026/6/20	0.87%
6	第344回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	720,000,000	101.94 733,968,000	102.18 735,724,800	0.100000 2026/9/20	0.85%
7	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	714,000,000	101.77 726,637,800	102.20 729,765,120	0.100000 2027/12/20	0.84%
8	第347回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	696,000,000	101.92 709,363,200	102.24 711,618,240	0.100000 2027/6/20	0.82%
9	第339回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	680,000,000	103.54 704,072,000	103.67 704,969,600	0.400000 2025/6/20	0.81%
10	第348回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	689,000,000	101.85 701,746,500	102.22 704,357,810	0.100000 2027/9/20	0.81%
11	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	664,000,000	103.69 688,501,600	103.82 689,411,280	0.400000 2025/9/20	0.79%
12	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	665,000,000	101.58 675,546,900	102.15 679,310,800	0.100000 2028/6/20	0.78%
13	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	643,000,000	103.15 663,254,500	103.31 664,328,310	0.300000 2025/12/20	0.76%
14	第346回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	647,000,000	101.94 659,597,090	102.21 661,318,110	0.100000 2027/3/20	0.76%

15	第352回 利付国債（10年） 日本	国債証券	625,000,000	101.48 634,275,000	102.11 638,225,000	0.100000 2028/9/20	0.73%
16	第137回 利付国債（5年） 日本	国債証券	592,000,000	101.31 599,755,200	101.30 599,696,000	0.100000 2023/9/20	0.69%
17	第353回 利付国債（10年） 日本	国債証券	576,000,000	101.64 585,486,320	102.02 587,669,760	0.100000 2028/12/20	0.68%
18	第338回 利付国債（10年） 日本	国債証券	559,000,000	103.40 578,006,000	103.51 578,660,030	0.400000 2025/3/20	0.67%
19	第127回 利付国債（5年） 日本	国債証券	572,000,000	100.50 574,876,520	100.50 574,882,880	0.100000 2021/3/20	0.66%
20	第345回 利付国債（10年） 日本	国債証券	532,000,000	101.96 542,459,120	102.22 543,810,400	0.100000 2026/12/20	0.63%
21	第396回 利付国債（2年） 日本	国債証券	528,000,000	100.47 530,500,400	100.43 530,296,800	0.100000 2021/1/1	0.61%
22	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	103.86 519,347,500	103.71 518,574,000	0.660000 2024/5/31	0.60%
23	第190回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	102.90 514,509,000	102.82 514,135,500	0.605000 2023/5/31	0.59%
24	第139回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	102.81 514,068,000	102.55 512,792,000	1.100000 2021/7/30	0.59%
25	第37回 利付国債（30年） 日本	国債証券	362,000,000	131.54 476,174,800	134.40 486,538,860	1.900000 2042/9/20	0.56%
26	第36回 利付国債（30年） 日本	国債証券	350,000,000	133.30 466,550,000	136.12 476,437,500	2.000000 2042/3/20	0.55%
27	第399回 利付国債（2年） 日本	国債証券	473,000,000	100.48 475,284,590	100.51 475,426,490	0.100000 2021/4/1	0.55%
28	第128回 利付国債（5年） 日本	国債証券	464,000,000	100.57 466,644,800	100.57 466,668,000	0.100000 2021/6/20	0.54%
29	第398回 利付国債（2年） 日本	国債証券	463,000,000	100.46 465,134,430	100.48 465,264,070	0.100000 2021/3/1	0.54%
30	第147回 利付国債（20年） 日本	国債証券	374,000,000	120.52 450,744,800	121.77 455,419,800	1.600000 2033/12/20	0.52%

（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	72.33
		地方債証券	9.61
		特殊債券	9.96
		社債券	6.76
	小計		98.66
	外国	社債券	0.48
	小計		0.48
合計（対純資産総額比）			99.14

（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」- R E I T インデックス マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

（2019年5月31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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	2,152	716,835.13 1,542,629,217	742,000.00 1,596,784,000	- -	7.45%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,223	617,589.06 1,372,900,502	645,000.00 1,433,835,000	- -	6.69%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	6,916	164,485.55 1,137,582,092	168,400.00 1,164,654,400	- -	5.44%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	4,201	211,155.42 887,063,938	218,600.00 918,338,600	- -	4.29%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	4,902	179,098.22 877,939,501	179,000.00 877,458,000	- -	4.10%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	4,429	194,158.32 859,927,237	194,600.00 861,883,400	- -	4.02%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	2,982	252,167.46 751,963,369	256,600.00 765,181,200	- -	3.57%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	2,981	239,209.84 713,084,546	236,100.00 703,814,100	- -	3.29%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,166	308,118.54 667,384,779	314,000.00 680,124,000	- -	3.17%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	5,508	122,955.18 677,237,152	120,800.00 665,366,400	- -	3.11%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,407	447,405.05 629,498,906	464,000.00 652,848,000	- -	3.05%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	7,154	88,906.33 636,035,943	88,100.00 630,267,400	- -	2.94%
13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,168	462,019.22 539,638,449	469,500.00 548,376,000	- -	2.56%

14	ケネディクス・オフィス投資 法人 日本	投資証券	688	750,002.22 516,001,528	747,000.00 513,936,000	- -	2.40%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	5,735	82,001.96 470,281,297	81,100.00 465,108,500	- -	2.17%
16	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,668	54,460.64 417,604,233	57,800.00 443,210,400	- -	2.07%
17	日本アコモデーションファンド 投資法人 日本	投資証券	739	574,103.15 424,262,233	573,000.00 423,447,000	- -	1.98%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	513	764,478.82 392,177,638	751,000.00 385,263,000	- -	1.80%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	2,549	149,027.65 379,871,480	149,500.00 381,075,500	- -	1.78%
20	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券	1,452	245,711.59 356,773,232	241,800.00 351,093,600	- -	1.64%
21	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	756	461,476.32 348,876,105	458,500.00 346,626,000	- -	1.62%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	2,590	129,418.07 335,192,816	130,100.00 336,959,000	- -	1.57%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	1,797	180,617.76 324,570,116	179,800.00 323,100,600	- -	1.51%
24	ジャパンエクセレント投資法 人 日本	投資証券	1,990	158,656.99 315,727,412	161,200.00 320,788,000	- -	1.50%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,281	133,844.83 305,300,076	136,000.00 310,216,000	- -	1.45%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	717	417,267.84 299,181,047	424,500.00 304,366,500	- -	1.42%
27	プレミア投資法人 日本	投資証券	2,113	138,248.08 292,118,203	138,500.00 292,650,500	- -	1.37%
28	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人 日本	投資証券	922	297,361.87 274,167,645	297,500.00 274,295,000	- -	1.28%
29	森トラスト総合リート投資法 人 日本	投資証券	1,589	169,088.75 268,682,029	172,500.00 274,102,500	- -	1.28%
30	東急リアル・エステート投資 法人 日本	投資証券	1,490	180,231.15 268,544,416	177,100.00 263,879,000	- -	1.23%

(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 (%)
投資証券	国内	投資証券	98.74
	小計		98.74
合計(対純資産総額比)			98.74

(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

(2019年5月31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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	305,406	14,002.69 4,276,506,649	13,749.83 4,199,281,436	- -	2.48%
2	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	197,590	20,658.67 4,081,948,467	19,498.88 3,852,785,279	- -	2.28%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	17,496	204,292.75 3,574,306,058	198,632.75 3,475,278,684	- -	2.06%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	99,955	20,260.33 2,025,122,132	20,013.97 2,000,496,731	- -	1.18%
5	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	111,597	15,158.62 1,691,656,663	14,447.54 1,612,303,192	- -	0.95%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	13,177	127,062.02 1,674,296,357	122,259.01 1,611,007,001	- -	0.95%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	137,149	12,113.74 1,661,387,404	11,708.08 1,605,751,683	- -	0.95%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	12,537	127,761.50 1,601,745,980	122,637.39 1,537,505,053	- -	0.91%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	177,490	8,298.25 1,472,856,469	7,870.63 1,396,959,751	- -	0.83%
10	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	128,358	10,868.57 1,395,068,310	10,686.71 1,371,724,850	- -	0.81%
11	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	73,302	17,943.25 1,315,276,791	17,799.43 1,304,734,081	- -	0.77%
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	104,861	11,749.10 1,232,023,355	11,518.88 1,207,882,198	- -	0.71%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	54,644	22,225.64 1,214,498,359	21,843.56 1,193,619,842	- -	0.71%
14	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	384,314	3,105.82 1,193,611,644	2,970.21 1,141,496,206	- -	0.68%
15	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	75,445	14,767.97 1,114,169,828	14,457.39 1,090,737,939	- -	0.65%
16	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	184,373	6,162.43 1,136,186,812	5,858.41 1,080,133,585	- -	0.64%
17	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	173,446	6,354.83 1,102,220,651	6,214.92 1,077,954,540	- -	0.64%
18	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	40,196	26,406.37 1,061,430,455	26,629.15 1,070,385,715	- -	0.63%

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	232,689	4,535.15 1,055,281,659	4,582.18 1,066,223,812	- -	0.63%
20	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	305,599	3,478.49 1,063,024,798	3,484.20 1,064,770,969	- -	0.63%
21	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	38,231	27,617.80 1,055,856,412	27,798.21 1,062,753,687	- -	0.63%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	79,616	13,178.03 1,049,182,724	12,617.95 1,004,591,248	- -	0.59%
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	47,315	21,062.29 996,562,691	20,896.50 988,718,313	- -	0.59%
24	MERCK & CO 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	108,189	8,611.03 931,619,766	8,713.80 942,737,827	- -	0.56%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造 装置	188,415	4,909.13 924,954,326	4,891.67 921,664,530	- -	0.55%
26	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	170,334	5,381.38 916,633,487	5,385.97 917,415,517	- -	0.54%
27	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	181,081	4,997.75 904,997,929	4,926.66 892,125,968	- -	0.53%
28	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア・娯楽	189,549	4,760.55 902,359,307	4,564.68 865,231,742	- -	0.51%
29	BOEING CO アメリカ	株式 資本財	22,496	38,824.85 873,403,961	38,261.78 860,737,074	- -	0.51%
30	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	90,857	9,143.75 830,773,935	9,444.72 858,119,579	- -	0.51%

(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	9.41
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.87
		銀行	7.78
		資本財	6.80
		メディア・娯楽	5.94
		エネルギー	5.93
		食品・飲料・タバコ	4.95
		小売	4.70
		ヘルスケア機器・サービス	4.66
		素材	4.21
		各種金融	4.20
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.01
		保険	3.90
		公益事業	3.41
		半導体・半導体製造装置	2.68
		電気通信サービス	2.35
		家庭用品・パーソナル用品	2.12
		消費者サービス	1.87
		運輸	1.87
		耐久消費財・アパレル	1.83
		食品・生活必需品小売り	1.48
		商業・専門サービス	1.24
		自動車・自動車部品	1.06
不動産	0.60		
その他	0.02		
	小計		94.89
投資証券	外国	投資証券	2.63
	小計		2.63
合計(対純資産総額比)			97.53

(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GICS分類(産業グループ)によるものです。なお、GICS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 5 0 0 E M I N I F U T U R E 2 0 1 9 0 6	買建	186	2,898,365,619	2,838,072,444	1.68%
	EUREX取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 2 0 1 9 0 6	買建	175	719,409,382	705,818,085	0.42%
	ICE-EU	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E 2 0 1 9 0 6	買建	28	282,124,017	278,346,784	0.16%

(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

(2019年5月31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	196,848,000	100.50 197,838,145	100.64 198,115,701	2.625000 2020/11/15	1.00%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	188,099,200	98.53 185,336,022	98.74 185,740,436	1.375000 2021/1/31	0.94%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	178,256,800	102.40 182,538,528	102.97 183,561,722	2.750000 2023/11/15	0.92%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	172,788,800	100.37 173,443,472	100.45 173,571,533	2.625000 2020/8/15	0.87%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	169,508,000	101.29 171,704,823	101.85 172,652,373	2.500000 2023/8/15	0.87%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	172,788,800	99.61 172,120,730	99.91 172,647,113	2.000000 2021/11/15	0.87%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	167,320,800	102.51 171,528,918	103.15 172,608,137	2.750000 2024/2/15	0.87%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	169,508,000	98.37 166,746,714	98.90 167,660,362	1.750000 2023/5/15	0.84%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	165,133,600	99.40 164,152,706	99.88 164,951,953	2.000000 2023/2/15	0.83%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	149,823,200	101.09 151,460,767	101.10 151,472,753	3.500000 2020/5/15	0.76%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	149,823,200	99.58 149,207,426	99.93 149,728,811	2.000000 2022/2/15	0.75%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	149,823,200	98.20 147,141,364	98.67 147,838,042	1.625000 2022/11/15	0.74%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	145,448,800	99.84 145,220,445	100.13 145,652,428	2.125000 2021/8/15	0.73%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	145,448,800	98.82 143,744,140	99.21 144,305,572	1.750000 2022/5/15	0.73%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	141,074,400	98.33 138,731,154	98.77 139,343,417	1.625000 2022/8/15	0.70%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	138,887,200	100.04 138,946,921	100.24 139,228,862	2.250000 2021/3/31	0.70%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	138,887,200	99.56 138,278,874	99.78 138,583,037	2.000000 2021/2/28	0.70%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	137,793,600	100.16 138,025,093	100.33 138,255,208	2.375000 2020/12/31	0.70%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	137,793,600	98.84 136,196,703	98.95 136,356,412	1.375000 2020/8/31	0.69%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	134,512,800	99.59 133,965,332	99.70 134,113,296	2.000000 2020/9/30	0.68%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	131,232,000	101.75 133,537,746	101.97 133,819,895	3.125000 2021/5/15	0.67%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	131,232,000	98.75 129,595,536	99.56 130,667,702	2.000000 2025/2/15	0.66%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	131,232,000	99.38 130,431,484	99.56 130,662,453	1.875000 2020/12/15	0.66%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	129,044,800	98.49 127,103,966	99.38 128,257,626	2.000000 2025/8/15	0.65%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	126,857,600	99.87 126,693,953	100.81 127,892,758	2.250000 2025/11/15	0.64%

26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	126,857,600	99.31 125,984,819	100.16 127,070,720	2.125000 2025/5/15	0.64%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	124,670,400	99.13 123,588,260	99.20 123,676,776	1.500000 2020/5/31	0.62%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	120,296,000	99.21 119,350,473	99.28 119,435,883	1.625000 2020/6/30	0.60%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	117,015,200	100.13 117,174,340	100.90 118,070,677	2.250000 2024/11/15	0.59%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	121,389,600	95.90 116,424,634	96.91 117,648,372	1.625000 2026/2/15	0.59%

（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	98.99
	小計		98.99
合 計（対純資産総額比）			98.99

（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）

「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」

#### 投資有価証券の主要銘柄

（2019年5月31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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	5,103	20,404.41 104,123,750	17,831.14 90,992,348	- -	4.11%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	10,736	7,437.85 79,852,766	8,018.27 86,084,202	- -	3.89%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	2,528	23,346.85 59,020,839	25,509.31 64,487,544	- -	2.92%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	6,754	7,772.42 52,494,942	8,831.91 59,650,744	- -	2.70%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	6,474	7,652.85 49,544,575	8,291.67 53,680,305	- -	2.43%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	2,386	20,649.80 49,270,431	22,024.01 52,549,288	- -	2.38%
7	LINK REIT 香港	投資証券	35,500	1,033.60 36,692,987	1,328.48 47,161,111	- -	2.13%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	3,473	12,251.60 42,549,809	12,873.85 44,710,913	- -	2.02%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	6,247	6,768.39 42,282,161	7,016.53 43,832,310	- -	1.98%
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	5,350	7,092.11 37,942,839	7,569.89 40,498,960	- -	1.83%
11	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD フランス	投資証券	2,451	18,785.38 46,042,989	16,428.81 40,267,020	- -	1.82%
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,767	13,815.17 38,226,579	14,305.38 39,582,990	- -	1.79%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,061	28,289.30 30,014,952	31,217.90 33,122,197	- -	1.50%

14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	1,863	13,500.21 25,150,906	15,916.25 29,651,981	- -	1.34%
15	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	28,118	792.02 22,270,240	1,002.90 28,199,699	- -	1.27%
16	HCP INC アメリカ	投資証券	8,119	3,143.57 25,522,656	3,433.90 27,879,866	- -	1.26%
17	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	12,683	2,094.24 26,561,296	2,012.22 25,521,036	- -	1.15%
18	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	88,728	292.26 25,931,858	286.22 25,395,799	- -	1.15%
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	2,156	10,486.72 22,609,370	11,554.97 24,912,531	- -	1.13%
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	2,687	7,604.69 20,433,818	8,976.26 24,119,234	- -	1.09%
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	1,859	11,153.97 20,735,241	12,394.86 23,042,049	- -	1.04%
22	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	2,948	7,802.83 23,002,760	7,266.97 21,423,033	- -	0.97%
23	UDR INC アメリカ	投資証券	4,380	4,531.87 19,849,627	4,835.89 21,181,238	- -	0.96%
24	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証券	6,291	3,129.23 19,686,004	3,280.79 20,639,512	- -	0.93%
25	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	2,836	6,970.63 19,768,727	7,141.20 20,252,465	- -	0.92%
26	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	1,397	11,300.12 15,786,268	13,510.33 18,873,937	- -	0.85%
27	DEXUS オーストラリア	投資証券	19,255	794.63 15,300,657	963.63 18,554,795	- -	0.84%
28	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	1,653	10,258.76 16,957,745	11,176.59 18,474,906	- -	0.84%
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	1,402	10,791.10 15,129,124	12,901.19 18,087,481	- -	0.82%
30	SEGRO PLC イギリス	投資証券	18,721	857.78 16,058,558	955.64 17,890,608	- -	0.81%

（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 (%)
投資証券	外国	投資証券	98.34
	小計		98.34
合計（対純資産総額比）			98.34

（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)

「ニッセイ新興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

(2019年5月31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	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	18,000	4,090.15 73,622,795	4,522.13 81,398,448	- -	4.37%
2	ALIBABA GROUP HOLDING- SP ADR ケイマン諸島	株式 小売	4,467	16,667.01 74,451,578	16,521.01 73,799,374	- -	3.96%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・半導体製造 装置	78,000	771.31 60,162,313	799.26 62,342,280	- -	3.35%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハー ドウェアおよび機器	15,081	4,017.70 60,590,972	3,910.34 58,971,912	- -	3.16%
5	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 小売	1,385	20,249.02 28,044,906	24,133.78 33,425,286	- -	1.79%
6	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	7,600	3,534.51 26,862,315	3,526.86 26,804,136	- -	1.44%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	305,000	91.76 27,987,618	86.42 26,360,540	- -	1.41%
8	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	17,500	1,079.03 18,883,099	1,209.99 21,174,860	- -	1.14%
9	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	9,646	2,065.13 19,920,333	1,996.91 19,262,228	- -	1.03%
10	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	9,134	1,824.44 16,664,442	2,101.00 19,190,579	- -	1.03%
11	CHINA MOBILE LTD/HK 香港	株式 電気通信サービス	19,500	1,080.84 21,076,419	976.49 19,041,691	- -	1.02%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 銀行	5,230	2,994.98 15,663,781	3,451.35 18,050,570	- -	0.97%
13	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	207,000	76.46 15,828,351	78.06 16,159,248	- -	0.87%
14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	15,650	965.05 15,103,146	962.94 15,070,104	- -	0.81%
15	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	9,104	1,634.20 14,877,780	1,538.69 14,008,281	- -	0.75%
16	VALE SA ブラジル	株式 素材	10,167	1,508.95 15,341,532	1,372.77 13,956,998	- -	0.75%
17	BANCO BRADESCO SA-PREF ブラジル	株式 銀行	13,008	854.45 11,114,706	1,018.12 13,243,711	- -	0.71%
18	SBERBANK PAO - SPONSORED ADR ロシア	株式 銀行	8,219	1,351.68 11,109,536	1,592.28 13,086,962	- -	0.70%

19	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	11,231	1,039.24 11,671,780	1,159.00 13,016,830	- -	0.70%
20	PJSC GAZPROM ADR ロシア	株式 エネルギー	16,685	514.32 8,581,518	709.96 11,845,768	- -	0.64%
21	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	256,000	47.46 12,152,234	45.30 11,598,080	- -	0.62%
22	LUKOIL PJSC-SPON ADR ロシア	株式 エネルギー	1,285	7,994.41 10,272,822	8,759.73 11,256,260	- -	0.60%
23	BAIDU INC - SPON ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	863	20,022.72 17,279,609	12,228.63 10,553,312	- -	0.57%
24	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	1,728	6,416.55 11,087,811	6,056.20 10,465,130	- -	0.56%
25	CNOOC LTD 香港	株式 エネルギー	57,000	186.13 10,609,525	182.05 10,377,214	- -	0.56%
26	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	39,200	253.26 9,927,923	253.96 9,955,388	- -	0.53%
27	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	2,825	3,005.87 8,491,585	3,391.15 9,580,010	- -	0.51%
28	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR ブラジル	株式 エネルギー	13,200	716.18 9,453,707	717.81 9,475,191	- -	0.51%
29	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 電気通信サービス	108,100	76.47 8,267,034	79.01 8,541,759	- -	0.46%
30	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,604	3,294.61 8,579,177	3,165.95 8,244,146	- -	0.44%

(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	銀行	16.08
		小売	7.62
		エネルギー	7.52
		メディア・娯楽	6.64
		素材	6.39
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.01
		半導体・半導体製造装置	4.80
		電気通信サービス	4.09
		保険	3.64
		食品・飲料・タバコ	3.25
		資本財	2.61
		公益事業	2.22
		各種金融	2.22
		不動産	2.20
		自動車・自動車部品	2.13
		ソフトウェア・サービス	1.94
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.73
		食品・生活必需品小売り	1.62
		運輸	1.54
		消費者サービス	1.17
		耐久消費財・アパレル	1.09
		家庭用品・パーソナル用品	1.07
		ヘルスケア機器・サービス	0.63
		商業・専門サービス	0.14
その他	0.02		
	小計		88.37
投資信託受益証券	外国	投資信託受益証券	3.22
	小計		3.22
投資証券	外国	投資証券	0.24
	小計		0.24
合計(対純資産総額比)			91.83

(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。

株式(外国)の業種はGICS分類(産業グループ)によるものです。なお、GICS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	NYSE LI FFEU S	MINI MSC I EM IND EX FUTUR E 201906	買建	27	153,510,983	146,956,874	7.89%

(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)

「ニッセイ新興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

(2019年5月31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	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	43,744,000	91.18 39,886,216	105.15 45,999,878	5.250000 2047/6/23	4.31%
2	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	27,340,000	95.43 26,092,749	109.62 29,971,748	5.250000 2047/1/8	2.81%
3	CROATIA クロアチア	国債証券	26,246,400	107.60 28,241,913	112.41 29,504,103	6.000000 2024/1/26	2.77%
4	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	21,872,000	104.85 22,934,979	111.10 24,300,010	6.000000 2026/4/7	2.28%
5	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,872,000	104.92 22,949,196	110.37 24,140,345	5.875000 2024/1/15	2.26%
6	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,872,000	101.76 22,258,478	106.29 23,248,404	4.875000 2023/9/16	2.18%
7	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	21,872,000	105.73 23,127,015	106.28 23,245,999	4.200000 2024/1/21	2.18%
8	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,872,000	99.44 21,750,172	105.88 23,158,511	4.750000 2026/1/8	2.17%
9	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,872,000	97.94 21,422,749	104.92 22,949,196	4.750000 2026/5/27	2.15%
10	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証券	21,872,000	95.62 20,915,100	104.62 22,883,798	3.875000 2028/3/17	2.15%
11	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,872,000	92.50 20,231,600	104.30 22,812,496	5.000000 2045/6/15	2.14%
12	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	21,872,000	89.73 19,625,964	103.50 22,639,707	3.700000 2042/2/2	2.12%
13	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,872,000	102.02 22,314,908	103.34 22,604,055	4.875000 2021/5/5	2.12%
14	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,872,000	97.65 21,358,008	103.25 22,582,840	4.000000 2024/2/26	2.12%
15	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,872,000	94.73 20,721,095	102.17 22,347,716	4.150000 2027/3/28	2.10%
16	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	21,872,000	96.61 21,132,070	102.15 22,342,466	4.250000 2025/1/7	2.09%
17	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,872,000	93.75 20,505,000	101.36 22,170,771	3.875000 2027/4/25	2.08%
18	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,872,000	94.20 20,603,424	100.55 21,992,296	3.600000 2025/1/30	2.06%
19	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	21,872,000	90.65 19,826,968	99.60 21,784,730	5.625000 2047/2/21	2.04%
20	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,872,000	87.50 19,138,000	99.50 21,762,640	4.750000 2044/3/8	2.04%
21	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,872,000	87.20 19,072,384	99.25 21,708,178	4.350000 2048/1/11	2.04%
22	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,872,000	85.50 18,700,560	97.30 21,281,674	4.600000 2046/1/23	2.00%
23	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券	21,872,000	97.70 21,368,944	96.99 21,214,746	6.250000 2022/9/26	1.99%
24	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	21,872,000	90.98 19,900,895	94.12 20,586,145	4.300000 2028/10/12	1.93%
25	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券	21,872,000	93.77 20,511,124	92.52 20,237,286	5.750000 2024/3/22	1.90%



26	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	21,872,000	80.01 17,500,662	90.00 19,684,800	5.000000 2046/10/12	1.85%
27	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券	21,872,000	92.33 20,196,604	89.56 19,589,219	6.000000 2027/3/25	1.84%
28	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券	21,872,000	85.07 18,607,822	84.97 18,585,732	6.625000 2045/2/17	1.74%
29	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券	21,872,000	85.18 18,632,756	84.80 18,547,456	4.875000 2026/10/9	1.74%
30	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券	21,872,000	76.48 16,729,455	77.60 16,974,203	5.750000 2047/5/11	1.59%

(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	96.09
	小計		96.09
合計(対純資産総額比)			96.09

(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】

「<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)」

#### 【純資産の推移】

2019年5月31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1計算期間末 (2018年11月20日)	123,377,684	123,377,684	1.0166	1.0166
2018年5月末日	63,056,338	-	1.0142	-
6月末日	66,785,069	-	1.0198	-
7月末日	78,073,309	-	1.0374	-
8月末日	78,256,389	-	1.0359	-
9月末日	84,190,630	-	1.0558	-
10月末日	119,513,837	-	1.0082	-
11月末日	127,351,281	-	1.0309	-
12月末日	135,254,337	-	0.9826	-
2019年1月末日	155,257,007	-	1.0220	-
2月末日	157,619,685	-	1.0472	-
3月末日	171,643,576	-	1.0598	-
4月末日	185,038,621	-	1.0717	-
5月末日	193,211,805	-	1.0388	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2018年11月21日～ 2019年5月20日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
2018年11月21日～ 2019年5月20日	3.6

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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】

「＜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）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1計算期間	155,808,418	34,441,297	121,367,121
2018年11月21日～ 2019年5月20日	96,047,516	30,206,210	187,208,427

(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

2019年5月末現在

### ● 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,388円
純資産総額	193百万円

### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

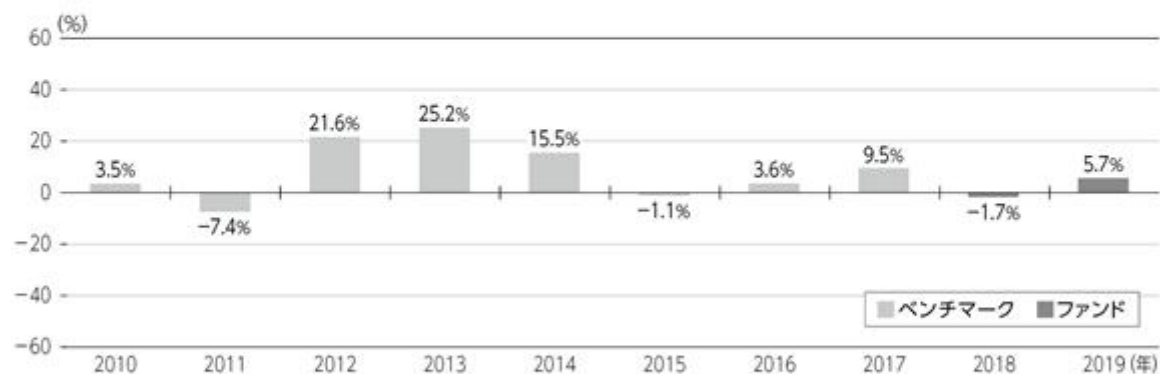
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

### ● 資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

### ● 年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

・2018年はファンド設定時から年末まで、2019年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2017年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2019年5月末現在

## 3.運用実績

## ●マザーファンドの状況

## 1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.3%
2	ソフトバンクグループ	1.9%
3	ソニー	1.6%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%
5	日本電信電話	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	マイクロソフト	情報技術	2.5%
2	アップル	情報技術	2.3%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.1%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.2%
5	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	1.0%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&amp;PおよびMSCI Inc.に帰属します。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 3. ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	テンセント・ホールディングス	コミュニケーション・サービス	4.8%
2	アリババグループ・ホールディング	一般消費財・サービス	4.3%
3	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	3.6%
4	サムスン電子	情報技術	3.4%
5	ナスパース	一般消費財・サービス	2.0%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&amp;PおよびMSCI Inc.に帰属します。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 4. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.2%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第342回 利付国債(10年)	2026/03/20	0.100%	1.0%
4	第312回 利付国債(10年)	2020/12/20	1.200%	0.9%
5	第343回 利付国債(10年)	2026/06/20	0.100%	0.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	13.1%
2	情報・通信業	9.1%
3	輸送用機器	7.7%
4	化学	7.3%
5	銀行業	6.0%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	68.2%
2	イギリス	6.3%
3	フランス	4.1%
4	カナダ	3.8%
5	スイス	3.4%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	31.0%
2	韓国	12.1%
3	台湾	11.0%
4	インド	9.8%
5	ブラジル	7.7%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	-
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 3.運用実績

2019年5月末現在

## 5.ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2020/11/15	2.625%	1.0%
2	アメリカ国債	米ドル	2021/01/31	1.375%	0.9%
3	アメリカ国債	米ドル	2023/11/15	2.750%	0.9%
4	アメリカ国債	米ドル	2020/08/15	2.625%	0.9%
5	アメリカ国債	米ドル	2023/08/15	2.500%	0.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	47.5%
2	フランス	9.9%
3	イタリア	8.6%
4	ドイツ	6.6%
5	イギリス	6.5%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

## 6.ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	ロシア国債	米ドル	2047/06/23	5.250%	4.5%
2	インドネシア国債	米ドル	2047/01/08	5.250%	2.9%
3	クロアチア国債	米ドル	2024/01/26	6.000%	2.9%
4	ブラジル国債	米ドル	2026/04/07	6.000%	2.4%
5	インドネシア国債	米ドル	2024/01/15	5.875%	2.4%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	メキシコ	14.5%
2	トルコ	13.9%
3	インドネシア	13.3%
4	ロシア	10.3%
5	ブラジル	10.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

## 7.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.5%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.8%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.5%
4	日本リテールファンド投資法人	4.3%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.1%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## 組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.7%
短期金融資産等	1.3%

・比率は対純資産総額比です。

## 8.ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.2%
2	PROLOGIS INC	アメリカ	4.0%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.0%
4	WELLTOWER INC	アメリカ	2.7%
5	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.5%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	73.8%
2	オーストラリア	7.0%
3	イギリス	5.0%
4	フランス	4.1%
5	シンガポール	3.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、香港取引決済所、香港の銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、申込みの受付けを行いません）。

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

金融商品取引所の取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます）、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態の発生による市場の閉鎖、流動性の著しい低下あるいは資金の受渡しに関する障害等）があるときには、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

#### 取扱コース

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

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

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の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）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、香港取引決済所、香港の銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、換金の受付けを行いません）。

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

金融商品取引所の取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます）、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態の発生による市場の閉鎖、流動性の

著しい低下あるいは資金の受渡しに関する障害等)があるときには、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

#### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

#### 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 換金価額

##### < 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の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8営業日目からお支払いします。

#### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(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/>

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（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/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

#### (5)【その他】

繰上償還

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

- ・受益権の口数が30億口を下回っている場合
- ・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき



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

#### 約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前記2. から5. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1. から6. までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1. から7. までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2018年2月13日を期首としております。

3) 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1期計算期間（2018年2月13日から2018年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

【＜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）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2018年11月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		18,411
コール・ローン		25,615
親投資信託受益証券		123,378,301
未収入金		320,469
流動資産合計		123,742,796
資産合計		123,742,796
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		316,158
未払受託者報酬		5,692
未払委託者報酬		40,459
その他未払費用		2,803
流動負債合計		365,112
負債合計		365,112
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		121,367,121
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,010,563
純資産合計		123,377,684
負債純資産合計		123,742,796

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 (自2018年 2月13日 至2018年11月20日)
営業収益	
有価証券売買等損益	121,708
営業収益合計	121,708
営業費用	
受託者報酬	11,849
委託者報酬	99,124
その他費用	5,822
営業費用合計	116,795
営業利益又は営業損失（ ）	4,913
経常利益又は経常損失（ ）	4,913
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,913
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（ ）	470,424
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,801,481
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	2,801,481
剰余金減少額又は欠損金増加額	325,407
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	325,407
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（ ）	2,010,563

## (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1期 (2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	121,367,121口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0166円 (10,166円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 (自2018年2月13日 至2018年11月20日)
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,010,563円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は2,010,563円(1口当たり0.016566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1期 (自2018年2月13日 至2018年11月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2018年11月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年11月20日現在)
	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	510,559
合計	510,559

(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1期 (2018年11月20日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	154,808,418円
期中一部解約元本額	34,441,297円



## ( 4 ) 【附属明細表】 ( 2018年11月20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	8,877,953	15,103,173	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	15,976,935	15,440,109	
	ニッセイ J - R E I T インデックス マザーファンド	10,434,740	15,751,240	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	8,947,629	15,120,598	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	11,639,679	15,403,951	
	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	15,202,838	15,665,004	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	17,471,266	15,545,932	
	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	15,618,494	15,348,294	
親投資信託受益証券 合計		104,169,534	123,378,301	
合計		104,169,534	123,378,301	

## 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（＜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））は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REIT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、「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、「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興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）

	（2018年11月20日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	471,797,753
コール・ローン	656,414,314
株式	54,651,417,270
派生商品評価勘定	2,849,740
未収配当金	473,077,219
前払金	9,685,000
差入委託証拠金	44,625,000
流動資産合計	56,309,866,296
資産合計	56,309,866,296
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,605,640
未払解約金	118,516,537
その他未払費用	36,709
流動負債合計	145,158,886
負債合計	145,158,886
純資産の部	
元本等	
元本	33,015,590,469
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,149,116,941
純資産合計	56,164,707,410
負債純資産合計	56,309,866,296

## 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	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	33,015,590,469口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7012円 (17,012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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載し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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	4,203,418,286	
合計	4,203,418,286	

## （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	（2018年11月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
先物取引				
買 建	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000
合計	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000

## （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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	27,646,429,664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	11,710,957,645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	6,341,796,840円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	7,091,055,877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)	5,174,155,540円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,502,125円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,135,818円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,126,664,808円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,002,161,723円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,800,194,280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)	12,096,632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)	44,290,695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)	51,317,865円
DCニッセイ国内株式インデックス	145,946,565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	12,044,346,864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)	407,253,399円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	17,881,836円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,201,733円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,809,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	14,634,712円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,304,455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)	14,120,028円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,504,084円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,655,590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)	598,026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)	880,678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)	8,877,953円
計	33,015,590,469円

## 附属明細表(2018年11月20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	1,000	3,075.00	3,075,000	
日本水産	32,300	711.00	22,965,300	
マルハニチロ	4,700	4,265.00	20,045,500	
カネコ種苗	1,100	1,438.00	1,581,800	
サカタのタネ	3,900	3,745.00	14,605,500	
ホクト	2,700	2,020.00	5,454,000	
ヒノキヤグループ	700	2,220.00	1,554,000	
ショーボンドホールディングス	2,500	8,300.00	20,750,000	
ミライト・ホールディングス	8,200	1,582.00	12,972,400	
タマホーム	2,000	1,072.00	2,144,000	
TATERU	3,900	400.00	1,560,000	
スペースバリューホールディングス	3,900	1,037.00	4,044,300	
住石ホールディングス	9,500	112.00	1,064,000	
日鉄鉱業	700	5,050.00	3,535,000	
三井松島ホールディングス	1,300	1,574.00	2,046,200	
国際石油開発帝石	129,300	1,259.00	162,788,700	
石油資源開発	4,600	2,338.00	10,754,800	
K&Oエナジーグループ	1,600	1,552.00	2,483,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	849.00	1,528,200	
安藤・間	20,600	711.00	14,646,600	
東急建設	9,400	1,117.00	10,499,800	
コムシスホールディングス	11,400	2,829.00	32,250,600	
ミサワホーム	2,500	786.00	1,965,000	
高松コンストラクショングループ	2,000	2,850.00	5,700,000	
東建コーポレーション	1,000	7,600.00	7,600,000	
ソネック	1,900	776.00	1,474,400	
ヤマウラ	1,600	903.00	1,444,800	
大成建設	26,500	4,855.00	128,657,500	
大林組	79,700	1,106.00	88,148,200	
清水建設	81,300	928.00	75,446,400	
飛鳥建設	2,300	1,517.00	3,489,100	
長谷工コーポレーション	33,200	1,323.00	43,923,600	
松井建設	2,900	856.00	2,482,400	
銭高組	300	5,380.00	1,614,000	
鹿島建設	62,300	1,499.00	93,387,700	
不動テトラ	2,000	1,824.00	3,648,000	
大末建設	1,300	1,135.00	1,475,500	
鉄建建設	1,600	2,908.00	4,652,800	
西松建設	5,700	2,526.00	14,398,200	
三井住友建設	19,200	712.00	13,670,400	
大豊建設	1,800	3,460.00	6,228,000	
前田建設工業	19,000	1,096.00	20,824,000	
佐田建設	3,600	417.00	1,501,200	
ナカノフドー建設	2,200	633.00	1,392,600	
奥村組	4,400	3,645.00	16,038,000	
東鉄工業	3,200	3,125.00	10,000,000	
浅沼組	900	3,380.00	3,042,000	
戸田建設	30,900	736.00	22,742,400	
熊谷組	3,800	3,335.00	12,673,000	
青木あすなる建設	1,500	986.00	1,479,000	
北野建設	600	4,060.00	2,436,000	
植木組	600	2,373.00	1,423,800	
矢作建設工業	3,600	754.00	2,714,400	
ピーエス三菱	2,800	730.00	2,044,000	

日本ハウスホールディングス	5,100	485.00	2,473,500
大東建託	9,500	14,320.00	136,040,000
新日本建設	3,200	1,207.00	3,862,400
N I P P O	7,000	1,810.00	12,670,000
東亜道路工業	500	3,170.00	1,585,000
前田道路	8,300	2,154.00	17,878,200
日本道路	700	5,990.00	4,193,000
東亜建設工業	2,300	1,528.00	3,514,400
若築建設	1,300	1,609.00	2,091,700
東洋建設	9,700	396.00	3,841,200
五洋建設	31,600	664.00	20,982,400
世紀東急工業	3,900	643.00	2,507,700
福田組	900	4,880.00	4,392,000
住友林業	18,800	1,588.00	29,854,400
日本基礎技術	4,400	329.00	1,447,600
巴コーポレーション	3,300	436.00	1,438,800
大和ハウス工業	73,700	3,464.00	255,296,800
ライト工業	5,100	1,465.00	7,471,500
積水ハウス	81,400	1,687.00	137,321,800
日特建設	2,300	688.00	1,582,400
北陸電気工事	1,400	1,021.00	1,429,400
ユアテック	4,300	864.00	3,715,200
四電工	600	2,597.00	1,558,200
中電工	3,400	2,441.00	8,299,400
関電工	12,100	1,122.00	13,576,200
きんでん	17,700	1,904.00	33,700,800
東京エネシス	2,700	921.00	2,486,700
トーエネック	700	3,120.00	2,184,000
住友電設	1,800	1,920.00	3,456,000
日本電設工業	4,500	2,378.00	10,701,000
協和エクシオ	10,400	2,782.00	28,932,800
新日本空調	2,200	1,830.00	4,026,000
日本工営	1,500	2,416.00	3,624,000
九電工	5,200	4,350.00	22,620,000
三機工業	6,100	1,148.00	7,002,800
日揮	22,900	1,754.00	40,166,600
中外炉工業	700	2,388.00	1,671,600
ヤマト	2,400	616.00	1,478,400
太平電業	1,800	2,777.00	4,998,600
高砂熱学工業	6,700	2,002.00	13,413,400
三晃金属工業	500	2,900.00	1,450,000
N E C ネットエスアイ	2,600	2,472.00	6,427,200
朝日工業社	600	3,110.00	1,866,000
明星工業	4,900	810.00	3,969,000
大気社	3,600	2,915.00	10,494,000
ダイダン	1,800	2,543.00	4,577,400
日比谷総合設備	2,500	1,815.00	4,537,500
東芝プラントシステム	5,800	2,358.00	13,676,400
日本製粉	7,900	1,835.00	14,496,500
日清製粉グループ本社	26,900	2,288.00	61,547,200
日東富士製粉	200	5,420.00	1,084,000
昭和産業	2,200	2,839.00	6,245,800
鳥越製粉	2,100	931.00	1,955,100
中部飼料	2,900	1,336.00	3,874,400
フィード・ワン	16,000	201.00	3,216,000
東洋精糖	1,300	1,172.00	1,523,600
日本甜菜製糖	1,400	1,965.00	2,751,000
三井製糖	1,900	3,030.00	5,757,000
塩水港精糖	6,100	240.00	1,464,000
日新製糖	1,100	2,282.00	2,510,200



L I F U L L	7,900	771.00	6,090,900
ジェイエシーリクルートメント	1,800	2,070.00	3,726,000
日本M&Aセンター	16,900	2,504.00	42,317,600
タケエイ	2,400	826.00	1,982,400
トラスト・テック	1,100	2,926.00	3,218,600
コシダカホールディングス	6,100	1,394.00	8,503,400
パソナグループ	2,200	1,257.00	2,765,400
C D S	1,200	1,244.00	1,492,800
リンクアンドモチベーション	4,200	928.00	3,897,600
G C A	2,300	788.00	1,812,400
エス・エム・エス	8,300	1,759.00	14,599,700
パーソルホールディングス	22,700	1,919.00	43,561,300
リニカル	1,300	1,478.00	1,921,400
クックパッド	7,100	387.00	2,747,700
アイ・ケイ・ケイ	2,100	720.00	1,512,000
森永製菓	6,000	4,880.00	29,280,000
中村屋	600	4,505.00	2,703,000
江崎グリコ	7,200	5,370.00	38,664,000
名糖産業	1,100	1,474.00	1,621,400
井村屋グループ	1,000	2,991.00	2,991,000
不二家	1,300	2,461.00	3,199,300
山崎製パン	19,500	2,390.00	46,605,000
モロゾフ	400	5,450.00	2,180,000
亀田製菓	1,500	5,250.00	7,875,000
寿スピリッツ	2,500	4,340.00	10,850,000
カルビー	10,900	3,720.00	40,548,000
森永乳業	4,800	3,360.00	16,128,000
六甲バター	1,700	2,315.00	3,935,500
ヤクルト本社	17,600	8,170.00	143,792,000
明治ホールディングス	16,900	8,760.00	148,044,000
雪印メグミルク	5,700	3,075.00	17,527,500
プリマハム	3,400	2,226.00	7,568,400
日本ハム	10,300	4,200.00	43,260,000
丸大食品	2,500	1,887.00	4,717,500
S F o o d s	2,100	4,715.00	9,901,500
伊藤ハム米久ホールディングス	15,300	745.00	11,398,500
学情	1,000	1,408.00	1,408,000
スタジオアリス	1,100	2,583.00	2,841,300
シミックホールディングス	1,300	2,087.00	2,713,100
システナ	8,300	1,289.00	10,698,700
N J S	800	1,727.00	1,381,600
デジタルアーツ	1,200	6,210.00	7,452,000
新日鉄住金ソリューションズ	3,500	3,165.00	11,077,500
総合警備保障	9,000	5,250.00	47,250,000
いちご	29,800	391.00	11,651,800
日本駐車場開発	28,200	152.00	4,286,400
コア	1,100	1,365.00	1,501,500
カカクコム	17,100	1,979.00	33,840,900
アイロムグループ	900	2,224.00	2,001,600
セントケア・ホールディング	2,500	567.00	1,417,500
ルネサンス	1,300	2,287.00	2,973,100
ディップ	3,700	2,274.00	8,413,800
S B Sホールディングス	2,300	1,336.00	3,072,800
オプトホールディング	1,400	1,991.00	2,787,400
新日本科学	3,100	647.00	2,005,700
ツクイ	5,300	977.00	5,178,100
エムスリー	47,700	1,703.00	81,233,100
ツカダ・グローバルホールディング	2,400	599.00	1,437,600
アウトソーシング	11,900	1,277.00	15,196,300
ウェルネット	2,300	1,103.00	2,536,900

ワールドホールディングス	600	2,470.00	1,482,000
ディー・エヌ・エー	12,200	2,103.00	25,656,600
博報堂DYホールディングス	31,500	1,673.00	52,699,500
ぐるなび	3,200	856.00	2,739,200
エスアルジータカミヤ	2,300	646.00	1,485,800
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	1,455.00	2,619,000
ファンコミュニケーションズ	6,200	638.00	3,955,600
ライク	900	1,553.00	1,397,700
ビジネス・ブレークスルー	3,900	371.00	1,446,900
WDBホールディングス	1,000	2,687.00	2,687,000
バリューコマース	1,500	1,392.00	2,088,000
インフォマート	12,400	1,362.00	16,888,800
サッポロホールディングス	8,700	2,483.00	21,602,100
アサヒグループホールディングス	49,900	4,906.00	244,809,400
麒麟ホールディングス	107,800	2,571.00	277,153,800
宝ホールディングス	17,800	1,402.00	24,955,600
オエノンホールディングス	6,800	382.00	2,597,600
養命酒製造	700	2,376.00	1,663,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	18,200	3,350.00	60,970,000
サントリー食品インターナショナル	15,900	4,590.00	72,981,000
ダイドーグループホールディングス	1,300	6,190.00	8,047,000
伊藤園	7,900	5,330.00	42,107,000
キーコーヒー	2,300	2,091.00	4,809,300
日清オイリオグループ	3,100	3,565.00	11,051,500
不二製油グループ本社	5,800	3,385.00	19,633,000
かどや製油	300	5,880.00	1,764,000
J・オイルミルズ	1,200	3,975.00	4,770,000
ローソン	5,900	7,280.00	42,952,000
サンエー	1,800	4,620.00	8,316,000
カワチ薬品	1,800	2,194.00	3,949,200
エービーシー・マート	3,600	5,980.00	21,528,000
ハードオフコーポレーション	1,600	914.00	1,462,400
高千穂交易	1,400	1,045.00	1,463,000
アスクル	2,000	2,931.00	5,862,000
ゲオホールディングス	3,600	1,857.00	6,685,200
アダストリア	3,200	2,017.00	6,454,400
ジーフット	2,000	748.00	1,496,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	734.00	1,468,000
伊藤忠食品	600	5,040.00	3,024,000
くらコーポレーション	1,400	6,880.00	9,632,000
キャンドウ	1,100	1,682.00	1,850,200
エレマテック	1,100	2,204.00	2,424,400
パルグループホールディングス	1,200	3,100.00	3,720,000
JALUX	700	2,732.00	1,912,400
エディオン	9,900	1,187.00	11,751,300
あらた	1,300	4,490.00	5,837,000
サーラコーポレーション	4,700	650.00	3,055,000
トーメンデバイス	500	2,417.00	1,208,500
ハローズ	900	2,533.00	2,279,700
JPホールディングス	6,500	312.00	2,028,000
あみやき亭	500	4,090.00	2,045,000
東京エレクトロン デバイス	800	1,960.00	1,568,000
ひらまつ	4,700	355.00	1,668,500
フィールズ	2,000	1,030.00	2,060,000
双日	129,100	401.00	51,769,100
アルフレッサ ホールディングス	26,000	3,060.00	79,560,000
大黒天物産	600	4,350.00	2,610,000
ハニーズホールディングス	2,300	902.00	2,074,600
キッコーマン	15,700	5,950.00	93,415,000

味の素	54,800	1,886.50	103,380,200
キューピー	13,300	2,742.00	36,468,600
ハウス食品グループ本社	9,100	3,835.00	34,898,500
カゴメ	9,500	3,245.00	30,827,500
アリアケジャパン	2,200	9,960.00	21,912,000
ピエトロ	900	1,647.00	1,482,300
エバラ食品工業	700	2,183.00	1,528,100
ニチレイ	12,400	3,150.00	39,060,000
横浜冷凍	6,100	973.00	5,935,300
東洋水産	12,300	3,805.00	46,801,500
イートアンド	900	1,660.00	1,494,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,300	640.00	1,472,000
日清食品ホールディングス	10,100	6,910.00	69,791,000
永谷園ホールディングス	1,300	2,690.00	3,497,000
フジッコ	2,600	2,428.00	6,312,800
ロック・フィールド	2,600	1,664.00	4,326,400
日本たばこ産業	137,600	2,829.00	389,270,400
ケンコーマヨネーズ	1,300	2,168.00	2,818,400
わらべや日洋ホールディングス	1,600	1,915.00	3,064,000
なとり	1,300	1,850.00	2,405,000
ピクルスコーポレーション	700	2,212.00	1,548,400
北の達人コーポレーション	9,400	486.00	4,568,400
ユーグレナ	9,500	686.00	6,517,000
片倉工業	2,900	1,184.00	3,433,600
グンゼ	1,700	4,355.00	7,403,500
ヒューリック	48,900	1,069.00	52,274,100
ラサ商事	1,600	916.00	1,465,600
アルペン	1,800	1,890.00	3,402,000
クオールホールディングス	3,400	2,050.00	6,970,000
アルコニックス	2,500	1,230.00	3,075,000
神戸物産	3,500	3,250.00	11,375,000
ジンズ	1,600	6,850.00	10,960,000
ビックカメラ	12,500	1,491.00	18,637,500
DCMホールディングス	12,600	1,113.00	14,023,800
ペッパーフードサービス	1,800	3,840.00	6,912,000
MonotaRO	14,800	2,608.00	38,598,400
DDホールディングス	600	2,528.00	1,516,800
あいホールディングス	3,800	2,146.00	8,154,800
ディーブイエックス	1,300	1,192.00	1,549,600
きちり	1,800	833.00	1,499,400
アークランドサービスホールディングス	1,700	2,362.00	4,015,400
J.フロントリテイリング	29,900	1,607.00	48,049,300
ドトール・日レスホールディングス	4,100	2,144.00	8,790,400
マツモトキヨシホールディングス	9,700	4,105.00	39,818,500
ブロンコピリー	1,200	2,900.00	3,480,000
ZOZO	25,300	2,230.00	56,419,000
物語コーポレーション	700	10,570.00	7,399,000
ココカラファイン	2,600	6,170.00	16,042,000
三越伊勢丹ホールディングス	43,700	1,331.00	58,164,700
東洋紡	9,800	1,572.00	15,405,600
ユニチカ	6,800	539.00	3,665,200
富士紡ホールディングス	1,200	3,120.00	3,744,000
日清紡ホールディングス	13,200	1,004.00	13,252,800
倉敷紡績	2,200	2,667.00	5,867,400
ダイワボウホールディングス	2,100	6,660.00	13,986,000
シキボウ	1,300	1,129.00	1,467,700
日東紡績	3,500	2,118.00	7,413,000
トヨタ紡織	8,300	1,823.00	15,130,900
マクニカ・富士エレホールディングス	6,500	1,652.00	10,738,000
Hamee	900	1,677.00	1,509,300

ラクト・ジャパン	500	6,710.00	3,355,000
ウエルシアホールディングス	6,200	5,780.00	35,836,000
クリエイトSDホールディングス	3,400	2,998.00	10,193,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	1,202.00	5,288,800
八洲電機	1,800	804.00	1,447,200
UKCホールディングス	1,500	2,325.00	3,487,500
ジュテックホールディングス	1,400	1,055.00	1,477,000
大光	2,100	704.00	1,478,400
OCHIホールディングス	1,200	1,232.00	1,478,400
TOKAIホールディングス	12,400	940.00	11,656,000
ミサワ	3,200	463.00	1,481,600
ティーライフ	1,500	973.00	1,459,500
Cominix	1,800	832.00	1,497,600
三洋貿易	1,200	1,997.00	2,396,400
チムニー	700	2,728.00	1,909,600
シュッピン	1,600	1,014.00	1,622,400
ビューティガレージ	900	1,623.00	1,460,700
ウイン・パートナーズ	1,500	1,262.00	1,893,000
ネクステージ	3,600	1,102.00	3,967,200
ジョイフル本田	6,800	1,656.00	11,260,800
鳥貴族	800	2,085.00	1,668,000
キリン堂ホールディングス	1,000	1,562.00	1,562,000
ホットランド	1,200	1,477.00	1,772,400
すかいらくホールディングス	21,800	1,776.00	38,716,800
綿半ホールディングス	900	2,505.00	2,254,500
日本毛織	7,600	911.00	6,923,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,800	1,299.00	8,833,200
三栄建築設計	900	1,518.00	1,366,200
スター・マイカ	1,100	1,697.00	1,866,700
野村不動産ホールディングス	15,600	2,176.00	33,945,600
三重交通グループホールディングス	4,700	588.00	2,763,600
サムティ	3,200	1,622.00	5,190,400
ディア・ライフ	3,000	512.00	1,536,000
コーセーアールイー	1,700	844.00	1,434,800
日本商業開発	1,500	1,677.00	2,515,500
プレサンスコーポレーション	3,700	1,326.00	4,906,200
ユニゾホールディングス	3,500	2,372.00	8,302,000
THEグローバル社	2,300	602.00	1,384,600
日本管理センター	1,500	947.00	1,420,500
サンセイランディック	1,300	995.00	1,293,500
フージャースホールディングス	5,200	651.00	3,385,200
オープンハウス	3,800	3,680.00	13,984,000
東急不動産ホールディングス	63,000	613.00	38,619,000
飯田グループホールディングス	19,500	1,933.00	37,693,500
イーグランド	2,000	716.00	1,432,000
帝国繊維	2,600	2,362.00	6,141,200
日本コークス工業	20,000	103.00	2,060,000
あさひ	1,900	1,418.00	2,694,200
日本調剤	800	3,435.00	2,748,000
コスモス薬品	1,200	21,610.00	25,932,000
シップヘルスケアホールディングス	4,900	4,290.00	21,021,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,000	1,689.00	1,689,000
オンリー	900	1,169.00	1,052,100
セブン&アイ・ホールディングス	98,000	4,973.00	487,354,000
薬王堂	1,000	3,275.00	3,275,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,300	1,242.00	7,824,600
明治電機工業	700	2,207.00	1,544,900

ツルハホールディングス	5,100	11,280.00	57,528,000
サンマルクホールディングス	1,800	2,700.00	4,860,000
フェリシモ	1,200	1,232.00	1,478,400
トリドールホールディングス	2,900	1,935.00	5,611,500
帝人	19,000	1,925.00	36,575,000
東レ	180,300	916.40	165,226,920
クラレ	39,200	1,787.00	70,050,400
旭化成	165,400	1,209.00	199,968,600
サカイオーベックス	600	2,416.00	1,449,600
稲葉製作所	1,300	1,374.00	1,786,200
宮地エンジニアリンググループ	700	2,104.00	1,472,800
トーカロ	6,100	929.00	5,666,900
アルファ	1,000	1,393.00	1,393,000
SUMCO	25,900	1,529.00	39,601,100
川田テクノロジーズ	500	7,500.00	3,750,000
RS Technologies	500	4,565.00	2,282,500
ハウズドゥ	1,300	1,125.00	1,462,500
シーアールイー	1,500	1,023.00	1,534,500
ケイアイスター不動産	800	1,811.00	1,448,800
住江織物	600	2,632.00	1,579,200
日本フェルト	3,100	472.00	1,463,200
イチカワ	900	1,539.00	1,385,100
芦森工業	200	1,631.00	326,200
アツギ	1,900	1,019.00	1,936,100
ジャパンミート	900	2,100.00	1,890,000
コメダホールディングス	5,400	2,297.00	12,403,800
サツドラホールディングス	700	1,961.00	1,372,700
パロックジャパンリミテッド	1,900	1,058.00	2,010,200
クスリのアオキホールディングス	1,900	8,210.00	15,599,000
共和レザー	1,700	856.00	1,455,200
スシローグローバルホールディングス	2,600	6,280.00	16,328,000
LIXILビバ	2,000	1,771.00	3,542,000
セーレン	5,700	1,787.00	10,185,900
ソトー	1,500	975.00	1,462,500
東海染工	800	1,122.00	897,600
小松マテーレ	3,800	894.00	3,397,200
ワコールホールディングス	6,800	3,025.00	20,570,000
ホギメディカル	2,900	3,280.00	9,512,000
クラウドシアホールディングス	3,000	518.00	1,554,000
TSIホールディングス	8,600	783.00	6,733,800
マツオカコーポレーション	700	3,070.00	2,149,000
ワールド	2,400	2,020.00	4,848,000
TIS	7,800	5,050.00	39,390,000
電算システム	900	2,258.00	2,032,200
グリー	12,500	480.00	6,000,000
コーエーテクモホールディングス	4,800	1,683.00	8,078,400
三菱総合研究所	900	3,785.00	3,406,500
ボルテージ	2,300	672.00	1,545,600
電算	700	2,096.00	1,467,200
AGS	1,600	760.00	1,216,000
ファインデックス	2,200	662.00	1,456,400
ヒト・コミュニケーションズ	700	1,970.00	1,379,000
ブレインパッド	500	6,950.00	3,475,000
KLab	4,200	986.00	4,141,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	2,273.00	3,409,500
ネクソン	59,300	1,098.00	65,111,400
アイスタイル	5,900	1,011.00	5,964,900
エムアップ	800	2,695.00	2,156,000
エイチーム	1,500	1,664.00	2,496,000

テクノスジャパン	2,000	1,013.00	2,026,000
コロプラ	6,600	798.00	5,266,800
ブロードリーフ	11,500	602.00	6,923,000
デジタルハーツホールディングス	1,100	1,622.00	1,784,200
メディアドゥホールディングス	700	2,551.00	1,785,700
じげん	2,500	651.00	1,627,500
サイバーリンクス	1,400	1,016.00	1,422,400
フィックスターズ	2,200	1,318.00	2,899,600
VOYAGE GROUP	1,200	1,242.00	1,490,400
オプティム	500	4,525.00	2,262,500
セレス	800	2,090.00	1,672,000
特種東海製紙	1,500	4,130.00	6,195,000
ティーガイア	2,300	2,307.00	5,306,100
セック	400	4,395.00	1,758,000
豆蔵ホールディングス	1,600	948.00	1,516,800
テクマトリックス	1,600	1,667.00	2,667,200
プロシップ	600	2,507.00	1,504,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	56,100	238.00	13,351,800
GMOペイメントゲートウェイ	3,800	5,530.00	21,014,000
ザッパラス	3,900	376.00	1,466,400
インターネットイニシアティブ	3,800	2,388.00	9,074,400
さくらインターネット	2,800	554.00	1,551,200
GMOクラウド	500	3,560.00	1,780,000
SRAホールディングス	1,200	2,753.00	3,303,600
MINORIソリューションズ	1,000	1,482.00	1,482,000
朝日ネット	2,900	506.00	1,467,400
アドソル日進	800	1,912.00	1,529,600
フリービット	1,700	856.00	1,455,200
コムチュア	1,300	3,090.00	4,017,000
サイバーコム	900	1,622.00	1,459,800
王子ホールディングス	104,600	666.00	69,663,600
日本製紙	11,100	2,059.00	22,854,900
三菱製紙	3,800	562.00	2,135,600
北越コーポレーション	15,400	553.00	8,516,200
中越パルプ工業	1,000	1,661.00	1,661,000
大王製紙	11,300	1,333.00	15,062,900
阿波製紙	1,900	568.00	1,079,200
メディカル・データ・ビジョン	2,100	1,041.00	2,186,100
gumi	2,700	612.00	1,652,400
モバイルファクトリー	1,100	1,317.00	1,448,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,526.00	1,526,000
PCIホールディングス	600	2,645.00	1,587,000
パイプドHD	1,500	1,000.00	1,500,000
ランドコンピュータ	1,400	1,006.00	1,408,400
オープンドア	1,200	2,888.00	3,465,600
アカツキ	800	5,510.00	4,408,000
LINE	7,100	3,165.00	22,471,500
レンゴー	24,000	918.00	22,032,000
トーモク	1,400	1,840.00	2,576,000
ザ・バック	1,800	3,205.00	5,769,000
シンクロ・フード	2,600	611.00	1,588,600
オークネット	1,300	1,050.00	1,365,000
AOI TYO HOLDINGS	2,500	1,047.00	2,617,500
マクロミル	2,900	1,746.00	5,063,400
ビーグリー	1,100	1,021.00	1,123,100
昭和電工	15,400	4,350.00	66,990,000
住友化学	183,000	589.00	107,787,000
住友精化	1,100	4,795.00	5,274,500

日産化学	14,300	5,890.00	84,227,000
ラサ工業	900	1,579.00	1,421,100
クレハ	2,100	7,320.00	15,372,000
多木化学	300	7,770.00	2,331,000
テイカ	1,900	1,969.00	3,741,100
石原産業	4,500	1,253.00	5,638,500
片倉コープアグリ	1,300	1,175.00	1,527,500
日東エフシー	1,900	782.00	1,485,800
日本曹達	3,700	2,685.00	9,934,500
東ソー	35,900	1,610.00	57,799,000
トクヤマ	6,700	2,697.00	18,069,900
セントラル硝子	5,100	2,619.00	13,356,900
東亜合成	14,600	1,220.00	17,812,000
大阪ソーダ	2,500	2,674.00	6,685,000
関東電化工業	5,500	938.00	5,159,000
デンカ	9,100	3,415.00	31,076,500
イビデン	14,500	1,661.00	24,084,500
信越化学工業	41,000	9,685.00	397,085,000
日本カーバイド工業	800	1,866.00	1,492,800
堺化学工業	1,500	2,708.00	4,062,000
第一稀元素化学工業	1,900	983.00	1,867,700
エア・ウォーター	19,000	1,808.00	34,352,000
大陽日酸	19,100	1,856.00	35,449,600
日本化学工業	800	2,641.00	2,112,800
日本パーカライジング	12,700	1,466.00	18,618,200
高圧ガス工業	3,700	872.00	3,226,400
四国化成工業	3,900	1,186.00	4,625,400
戸田工業	600	2,411.00	1,446,600
ステラ ケミファ	1,400	3,175.00	4,445,000
保土谷化学工業	800	2,540.00	2,032,000
日本触媒	3,900	6,970.00	27,183,000
大日精化工業	1,900	3,340.00	6,346,000
カネカ	6,200	4,190.00	25,978,000
協和発酵キリン	29,700	2,244.00	66,646,800
三菱瓦斯化学	23,900	1,834.00	43,832,600
三井化学	21,100	2,919.00	61,590,900
J S R	23,300	1,723.00	40,145,900
東京応化工業	4,000	3,405.00	13,620,000
大阪有機化学工業	2,100	1,422.00	2,986,200
三菱ケミカルホールディングス	155,400	914.10	142,051,140
K Hネオケム	3,500	3,335.00	11,672,500
ダイセル	36,100	1,289.00	46,532,900
住友ベークライト	4,000	3,850.00	15,400,000
積水化学工業	50,800	1,865.00	94,742,000
日本ゼオン	21,000	1,100.00	23,100,000
アイカ工業	7,000	3,460.00	24,220,000
宇部興産	11,700	2,575.00	30,127,500
積水樹脂	3,800	2,066.00	7,850,800
タキロンシーアイ	5,000	578.00	2,890,000
旭有機材	1,600	1,803.00	2,884,800
日立化成	10,700	1,760.00	18,832,000
ニチバン	1,200	2,132.00	2,558,400
リケンテクノス	6,300	504.00	3,175,200
大倉工業	1,200	2,022.00	2,426,400
積水化成成品工業	3,500	953.00	3,335,500
群栄化学工業	600	3,165.00	1,899,000
タイガースポリマー	2,200	673.00	1,480,600
ミライアル	1,500	943.00	1,414,500
ダイキョーニシカワ	4,900	989.00	4,846,100
竹本容器	500	2,670.00	1,335,000

森六ホールディングス	1,200	2,906.00	3,487,200
日本化薬	14,800	1,439.00	21,297,200
カーリットホールディングス	2,500	872.00	2,180,000
E P Sホールディングス	3,400	1,999.00	6,796,600
プレステージ・インターナショナル	4,200	1,250.00	5,250,000
アミューズ	1,400	2,692.00	3,768,800
野村総合研究所	14,800	4,905.00	72,594,000
ドリームインキュベータ	800	1,806.00	1,444,800
サイバネットシステム	2,200	657.00	1,445,400
クイック	1,400	1,450.00	2,030,000
T A C	5,900	249.00	1,469,100
C Eホールディングス	2,000	723.00	1,446,000
ケネディクス	21,200	525.00	11,130,000
日本システム技術	700	1,964.00	1,374,800
電通	27,600	5,010.00	138,276,000
インテージホールディングス	3,000	985.00	2,955,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	1,909.00	1,718,100
東邦システムサイエンス	1,600	893.00	1,428,800
ぴあ	600	5,130.00	3,078,000
イオンファンタジー	700	3,050.00	2,135,000
ソースネクスト	4,500	1,224.00	5,508,000
シーティーエス	2,600	684.00	1,778,400
ネクシィーズグループ	800	1,591.00	1,272,800
メディカルシステムネットワーク	3,200	440.00	1,408,000
日本精化	1,900	1,049.00	1,993,100
扶桑化学工業	2,400	2,280.00	5,472,000
トリケミカル研究所	500	4,335.00	2,167,500
F I G	3,300	381.00	1,257,300
A D E K A	11,500	1,695.00	19,492,500
日油	9,000	3,750.00	33,750,000
ミヨシ油脂	1,200	1,234.00	1,480,800
新日本理化	7,700	181.00	1,393,700
ハリマ化成グループ	1,900	1,024.00	1,945,600
花王	57,600	7,988.00	460,108,800
第一工業製薬	900	2,542.00	2,287,800
ニイタカ	800	1,786.00	1,428,800
三洋化成工業	1,600	5,510.00	8,816,000
武田薬品工業	93,700	4,476.00	419,401,200
アステラス製薬	218,800	1,661.00	363,426,800
大日本住友製薬	17,600	2,882.00	50,723,200
塩野義製薬	31,100	7,582.00	235,800,200
田辺三菱製薬	24,800	1,665.00	41,292,000
わかもと製薬	5,000	294.00	1,470,000
あすか製薬	2,900	1,205.00	3,494,500
日本新薬	6,200	7,390.00	45,818,000
中外製薬	24,700	7,130.00	176,111,000
科研製薬	4,300	5,490.00	23,607,000
エーザイ	28,400	9,846.00	279,626,400
理研ビタミン	1,100	3,550.00	3,905,000
ロート製薬	12,200	3,440.00	41,968,000
小野薬品工業	56,100	2,654.00	148,889,400
久光製薬	7,000	7,030.00	49,210,000
有機合成薬品工業	5,800	248.00	1,438,400
持田製薬	1,800	9,750.00	17,550,000
参天製薬	45,000	1,802.00	81,090,000
扶桑薬品工業	800	2,887.00	2,309,600
日本ケミファ	400	4,085.00	1,634,000
ツムラ	7,400	3,495.00	25,863,000
日医工	5,800	1,720.00	9,976,000
テルモ	33,600	6,254.00	210,134,400



みらかホールディングス	6,300	2,675.00	16,852,500
キッセイ薬品工業	4,200	3,295.00	13,839,000
生化学工業	4,600	1,572.00	7,231,200
栄研化学	4,200	2,458.00	10,323,600
日水製薬	1,200	1,200.00	1,440,000
鳥居薬品	1,300	2,332.00	3,031,600
J C Rファーマ	1,700	5,300.00	9,010,000
東和薬品	1,100	8,400.00	9,240,000
富士製薬工業	1,600	1,842.00	2,947,200
沢井製薬	4,900	5,670.00	27,783,000
ゼリア新薬工業	4,700	2,102.00	9,879,400
第一三共	67,900	4,043.00	274,519,700
キョーリン製薬ホールディングス	6,100	2,666.00	16,262,600
大幸薬品	1,100	2,012.00	2,213,200
ダイト	1,400	3,465.00	4,851,000
大塚ホールディングス	45,200	5,064.00	228,892,800
大正製薬ホールディングス	5,300	12,150.00	64,395,000
ペプチドリーム	10,900	4,415.00	48,123,500
大日本塗料	2,600	1,111.00	2,888,600
日本ペイントホールディングス	19,200	3,670.00	70,464,000
関西ペイント	26,100	1,871.00	48,833,100
中国塗料	7,600	957.00	7,273,200
日本特殊塗料	1,700	1,729.00	2,939,300
藤倉化成	3,100	632.00	1,959,200
太陽ホールディングス	1,900	3,705.00	7,039,500
D I C	10,500	3,520.00	36,960,000
サカタインクス	5,100	1,254.00	6,395,400
東洋インキS Cホールディングス	4,900	2,628.00	12,877,200
T & K T O K A	1,800	1,116.00	2,008,800
アルプス技研	2,000	2,004.00	4,008,000
日本空調サービス	2,600	775.00	2,015,000
オリエンタルランド	26,800	10,960.00	293,728,000
フォーカスシステムズ	1,600	1,110.00	1,776,000
ダスキン	6,100	2,510.00	15,311,000
パーク24	13,700	2,960.00	40,552,000
明光ネットワークジャパン	2,900	1,023.00	2,966,700
ファルコホールディングス	1,200	1,636.00	1,963,200
クレスコ	700	3,445.00	2,411,500
フジ・メディア・ホールディングス	24,200	1,703.00	41,212,600
秀英予備校	3,000	484.00	1,452,000
ラウンドワン	7,000	1,210.00	8,470,000
リゾートトラスト	9,600	1,801.00	17,289,600
オービック	8,100	9,430.00	76,383,000
ジャストシステム	3,300	2,241.00	7,395,300
T D Cソフト	2,000	966.00	1,932,000
ヤフー	151,800	306.00	46,450,800
ビー・エム・エル	2,900	2,693.00	7,809,700
トレンドマイクロ	12,400	6,180.00	76,632,000
りらいあコミュニケーションズ	4,100	1,024.00	4,198,400
インフォメーション・ディベロプメント	1,000	1,485.00	1,485,000
リソー教育	3,800	1,166.00	4,430,800
日本オラクル	3,800	7,180.00	27,284,000
アルファシステムズ	800	2,610.00	2,088,000
フューチャー	3,200	1,584.00	5,068,800
C A C Holdings	1,700	1,034.00	1,757,800
ソフトバンク・テクノロジー	1,000	1,966.00	1,966,000
トーセ	1,600	913.00	1,460,800
ユー・エス・エス	27,700	1,836.00	50,857,200
オービックビジネスコンサルタント	1,200	9,250.00	11,100,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,600	2,007.00	21,274,200

アイティフォー	2,800	770.00	2,156,000
東計電算	400	3,370.00	1,348,000
サイバーエージェント	14,000	4,690.00	65,660,000
楽天	105,700	916.00	96,821,200
エックスネット	1,600	906.00	1,449,600
クリーク・アンド・リバー社	1,400	1,060.00	1,484,000
テー・オー・ダブリュー	2,200	882.00	1,940,400
大塚商会	12,600	3,740.00	47,124,000
サイボウズ	2,700	639.00	1,725,300
セントラルスポーツ	800	3,610.00	2,888,000
パラカ	800	1,881.00	1,504,800
電通国際情報サービス	1,400	3,795.00	5,313,000
デジタルガレージ	4,500	2,926.00	13,167,000
イーエムシステムズ	1,900	1,095.00	2,080,500
ウェザーニューズ	800	3,370.00	2,696,000
C I J	2,000	741.00	1,482,000
東洋ビジネスエンジニアリング	700	2,160.00	1,512,000
日本エンタープライズ	6,500	228.00	1,482,000
WOWOW	1,100	3,175.00	3,492,500
スカラ	1,900	794.00	1,508,600
フルキャストホールディングス	2,300	2,116.00	4,866,800
エン・ジャパン	2,500	4,015.00	10,037,500
富士フイルムホールディングス	49,300	4,453.00	219,532,900
コニカミノルタ	51,900	1,038.00	53,872,200
資生堂	47,200	7,269.00	343,096,800
ライオン	33,100	2,045.00	67,689,500
高砂香料工業	1,600	3,690.00	5,904,000
マンダム	5,300	3,170.00	16,801,000
ミルボン	2,900	4,280.00	12,412,000
ファンケル	5,300	5,640.00	29,892,000
コーセー	4,000	18,200.00	72,800,000
コタ	1,100	1,514.00	1,665,400
シーズ・ホールディングス	2,900	5,860.00	16,994,000
シーボン	500	2,645.00	1,322,500
ポーラ・オルビスホールディングス	10,100	3,165.00	31,966,500
ノエビアホールディングス	1,600	5,320.00	8,512,000
アジュバンコスメジャパン	1,500	1,017.00	1,525,500
エステー	1,700	2,115.00	3,595,500
アグロ カネショウ	1,000	2,356.00	2,356,000
コニシ	4,200	1,717.00	7,211,400
長谷川香料	2,800	1,565.00	4,382,000
星光PMC	1,600	893.00	1,428,800
小林製薬	6,700	7,330.00	49,111,000
荒川化学工業	2,100	1,511.00	3,173,100
メック	1,600	1,249.00	1,998,400
日本高純度化学	700	2,344.00	1,640,800
タカラバイオ	6,200	2,494.00	15,462,800
JCU	3,100	1,881.00	5,831,100
新田ゼラチン	2,000	741.00	1,482,000
デクセリアルズ	6,100	983.00	5,996,300
アース製薬	1,800	5,440.00	9,792,000
北興化学工業	2,500	570.00	1,425,000
大成ラミック	800	3,045.00	2,436,000
クミアイ化学工業	9,800	694.00	6,801,200
日本農薬	5,700	567.00	3,231,900
昭和シェル石油	22,200	1,752.00	38,894,400
富士興産	2,400	615.00	1,476,000
ニチレキ	3,000	1,064.00	3,192,000
ユシロ化学工業	1,200	1,359.00	1,630,800
ビーピー・カストロール	800	1,453.00	1,162,400

富士石油	5,800	340.00	1,972,000
MORESCO	900	1,659.00	1,493,100
出光興産	18,400	4,070.00	74,888,000
JXTGホールディングス	404,000	670.80	271,003,200
コスモエネルギーホールディングス	6,900	2,801.00	19,326,900
横浜ゴム	13,700	2,358.00	32,304,600
東洋ゴム工業	12,200	1,740.00	21,228,000
ブリヂストン	73,000	4,361.00	318,353,000
住友ゴム工業	21,300	1,552.00	33,057,600
藤倉ゴム工業	2,800	507.00	1,419,600
オカモト	1,700	5,760.00	9,792,000
アキレス	1,700	2,237.00	3,802,900
フコク	200	905.00	181,000
ニッタ	2,700	3,875.00	10,462,500
クリエートメディック	1,300	1,095.00	1,423,500
住友理工	4,600	1,064.00	4,894,400
三ツ星ベルト	3,100	2,400.00	7,440,000
バンドー化学	4,500	1,192.00	5,364,000
AGC	23,900	3,835.00	91,656,500
日本板硝子	11,300	948.00	10,712,400
石塚硝子	700	2,132.00	1,492,400
有沢製作所	3,700	800.00	2,960,000
日本山村硝子	1,000	1,708.00	1,708,000
日本電気硝子	10,300	2,925.00	30,127,500
オハラ	900	2,284.00	2,055,600
住友大阪セメント	4,800	4,865.00	23,352,000
太平洋セメント	15,000	3,820.00	57,300,000
リソルホールディングス	400	4,025.00	1,610,000
日本ヒューム	2,400	904.00	2,169,600
日本コンクリート工業	5,100	305.00	1,555,500
三谷セキサン	1,100	2,800.00	3,080,000
アジアパイルホールディングス	3,400	653.00	2,220,200
東海カーボン	21,500	1,579.00	33,948,500
日本カーボン	1,100	5,490.00	6,039,000
東洋炭素	1,400	2,721.00	3,809,400
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	5,580.00	7,812,000
TOTO	18,300	4,355.00	79,696,500
日本碍子	29,000	1,657.00	48,053,000
日本特殊陶業	20,000	2,400.00	48,000,000
MARUWA	800	5,740.00	4,592,000
品川リフラクトリーズ	600	4,190.00	2,514,000
黒崎播磨	500	6,530.00	3,265,000
ヨータイ	2,100	673.00	1,413,300
東京窯業	3,500	439.00	1,536,500
ニッカトー	1,500	961.00	1,441,500
フジインコーポレーテッド	2,100	2,393.00	5,025,300
エーアンドエーマテリアル	900	1,104.00	993,600
ニチアス	6,500	2,228.00	14,482,000
新日鐵住金	105,000	2,132.50	223,912,500
神戸製鋼所	43,000	940.00	40,420,000
中山製鋼所	3,300	576.00	1,900,800
合同製鐵	1,100	1,941.00	2,135,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	63,400	2,082.00	131,998,800
日新製鋼	5,700	1,511.00	8,612,700
東京製鐵	12,600	992.00	12,499,200
共英製鋼	2,600	2,401.00	6,242,600
大和工業	5,000	2,890.00	14,450,000
東京鐵鋼	1,000	1,328.00	1,328,000
大阪製鐵	1,600	2,056.00	3,289,600
淀川製鋼所	3,200	2,376.00	7,603,200

丸一鋼管	8,300	3,295.00	27,348,500
モリ工業	700	2,640.00	1,848,000
大同特殊鋼	3,800	4,510.00	17,138,000
日本高周波鋼業	2,100	697.00	1,463,700
日本冶金工業	19,400	282.00	5,470,800
山陽特殊製鋼	3,000	2,618.00	7,854,000
愛知製鋼	1,300	3,920.00	5,096,000
日立金属	25,300	1,297.00	32,814,100
日本金属	900	1,369.00	1,232,100
大平洋金属	1,600	3,215.00	5,144,000
新日本電工	14,100	258.00	3,637,800
栗本鐵工所	1,200	1,625.00	1,950,000
日本製鋼所	7,100	2,095.00	14,874,500
三菱製鋼	1,700	1,911.00	3,248,700
日亜鋼業	4,600	330.00	1,518,000
日本精線	400	3,285.00	1,314,000
大紀アルミニウム工業所	3,900	670.00	2,613,000
日本軽金属ホールディングス	64,000	242.00	15,488,000
三井金属鉱業	6,300	2,401.00	15,126,300
東邦亜鉛	1,300	3,885.00	5,050,500
三菱マテリアル	15,500	3,055.00	47,352,500
住友金属鉱山	32,100	3,172.00	101,821,200
DOWAホールディングス	5,500	3,600.00	19,800,000
古河機械金属	3,900	1,413.00	5,510,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,700	1,881.00	5,078,700
東邦チタニウム	4,200	1,303.00	5,472,600
UACJ	3,600	2,256.00	8,121,600
CKサンエツ	100	2,871.00	287,100
古河電気工業	6,800	3,205.00	21,794,000
住友電気工業	87,800	1,573.00	138,109,400
フジクラ	28,300	465.00	13,159,500
昭和電線ホールディングス	2,700	656.00	1,771,200
東京特殊電線	700	1,972.00	1,380,400
タツタ電線	4,700	517.00	2,429,900
カナレ電気	700	2,018.00	1,412,600
平河ヒューテック	1,100	1,240.00	1,364,000
リョービ	2,900	3,035.00	8,801,500
アーレスティ	2,900	681.00	1,974,900
アサヒホールディングス	4,400	2,329.00	10,247,600
東洋製罐グループホールディングス	14,900	2,475.00	36,877,500
ホッカンホールディングス	1,200	1,613.00	1,935,600
コロナ	1,300	1,120.00	1,456,000
横河ブリッジホールディングス	4,400	1,760.00	7,744,000
OSJBホールディングス	11,700	301.00	3,521,700
三和ホールディングス	24,200	1,340.00	32,428,000
文化シャッター	6,900	753.00	5,195,700
三協立山	3,300	1,286.00	4,243,800
アルインコ	1,900	1,050.00	1,995,000
LIXILグループ	34,600	1,448.00	50,100,800
日本フィルコン	2,400	602.00	1,444,800
ノーリツ	5,200	1,710.00	8,892,000
長府製作所	2,400	2,354.00	5,649,600
リンナイ	4,200	8,440.00	35,448,000
ユニプレス	4,600	2,023.00	9,305,800
ダイニチ工業	2,000	735.00	1,470,000
日東精工	3,200	628.00	2,009,600
岡部	4,800	964.00	4,627,200
ジーテクト	2,600	1,598.00	4,154,800
東プレ	4,400	2,277.00	10,018,800
高周波熱錬	4,500	955.00	4,297,500

東京製綱	1,400	1,083.00	1,516,200
サンコール	2,000	775.00	1,550,000
モリテックスチール	3,200	453.00	1,449,600
パイオラックス	3,800	2,615.00	9,937,000
エイチワン	2,300	1,047.00	2,408,100
日本発条	23,400	987.00	23,095,800
アドバネクス	900	1,546.00	1,391,400
三浦工業	10,200	2,768.00	28,233,600
タクマ	8,600	1,516.00	13,037,600
テクノプロ・ホールディングス	4,300	5,160.00	22,188,000
インターワークス	1,900	740.00	1,406,000
Keeper 技研	1,300	1,111.00	1,444,300
Gunosy	1,400	2,860.00	4,004,000
イー・ガーディアン	1,100	2,479.00	2,726,900
リブセンス	4,200	324.00	1,360,800
ジャパンマテリアル	6,200	1,091.00	6,764,200
ベクトル	2,800	1,766.00	4,944,800
ウチヤマホールディングス	3,000	480.00	1,440,000
キャリアリンク	3,500	415.00	1,452,500
I B J	2,300	738.00	1,697,400
アサンテ	900	2,185.00	1,966,500
N・フィールド	1,500	1,230.00	1,845,000
M&Aキャピタルパートナーズ	600	4,255.00	2,553,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,100	1,650.00	1,815,000
E R Iホールディングス	1,600	909.00	1,454,400
アピスト	400	3,575.00	1,430,000
シグマクシス	1,400	1,049.00	1,468,600
ウィルグループ	1,500	1,095.00	1,642,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,100	441.00	1,367,100
日本ビューホテル	1,200	1,186.00	1,423,200
リクルートホールディングス	162,500	2,884.00	468,650,000
エラン	800	3,335.00	2,668,000
ツガミ	5,300	818.00	4,335,400
オークマ	3,000	5,350.00	16,050,000
東芝機械	2,700	1,912.00	5,162,400
アマダホールディングス	36,200	1,130.00	40,906,000
アイダエンジニアリング	6,500	897.00	5,830,500
滝澤鉄工所	900	1,565.00	1,408,500
F U J I	7,000	1,441.00	10,087,000
牧野フライス製作所	2,800	4,390.00	12,292,000
オーエスジー	11,600	2,148.00	24,916,800
旭ダイヤモンド工業	6,200	718.00	4,451,600
D M G 森精機	14,800	1,435.00	21,238,000
ソディック	5,100	807.00	4,115,700
ディスコ	3,200	16,320.00	52,224,000
日東工器	1,300	2,541.00	3,303,300
日進工具	700	2,422.00	1,695,400
パンチ工業	2,400	565.00	1,356,000
日本郵政	185,900	1,391.00	258,586,900
ベルシステム24ホールディングス	3,800	1,470.00	5,586,000
鎌倉新書	1,600	996.00	1,593,600
一蔵	2,000	709.00	1,418,000
エポラブルアジア	700	2,094.00	1,465,800
ストライク	600	2,782.00	1,669,200
ソラスト	5,500	1,303.00	7,166,500
セラク	2,000	715.00	1,430,000
インソース	700	2,505.00	1,753,500
豊田自動織機	19,200	5,730.00	110,016,000
豊和工業	1,700	826.00	1,404,200

OKK	1,400	928.00	1,299,200
石川製作所	1,000	1,404.00	1,404,000
東洋機械金属	2,400	585.00	1,404,000
島精機製作所	3,200	3,270.00	10,464,000
オプトラ	2,300	2,196.00	5,050,800
NCホールディングス	2,500	564.00	1,410,000
フリー	1,900	973.00	1,848,700
ヤマシンフィルタ	4,100	887.00	3,636,700
日阪製作所	2,900	950.00	2,755,000
やまびこ	4,600	1,190.00	5,474,000
平田機工	1,100	5,690.00	6,259,000
ペガサスミシン製造	2,200	825.00	1,815,000
ナブテスコ	12,900	2,812.00	36,274,800
三井海洋開発	2,500	2,799.00	6,997,500
レオン自動機	2,300	1,705.00	3,921,500
SMC	7,000	37,550.00	262,850,000
新川	3,000	481.00	1,443,000
ホソカワミクロン	800	4,955.00	3,964,000
ユニオンツール	1,000	3,550.00	3,550,000
オイレス工業	3,300	1,949.00	6,431,700
日精エー・エス・ピー機械	700	3,675.00	2,572,500
サトーホールディングス	2,800	2,957.00	8,279,600
技研製作所	1,600	3,840.00	6,144,000
日本エアテック	2,000	708.00	1,416,000
カワタ	900	1,703.00	1,532,700
日精樹脂工業	2,000	1,022.00	2,044,000
小松製作所	107,500	2,894.50	311,158,750
住友重機械工業	13,600	3,610.00	49,096,000
日立建機	9,500	3,015.00	28,642,500
日工	600	2,452.00	1,471,200
巴工業	1,000	2,370.00	2,370,000
井関農機	2,400	1,699.00	4,077,600
TOWA	2,000	727.00	1,454,000
丸山製作所	900	1,595.00	1,435,500
北川鉄工所	1,100	2,535.00	2,788,500
シンニッタン	4,000	444.00	1,776,000
ローツェ	1,000	1,701.00	1,701,000
タカキタ	2,200	644.00	1,416,800
クボタ	127,300	1,889.50	240,533,350
荏原実業	800	1,872.00	1,497,600
東洋エンジニアリング	3,100	785.00	2,433,500
三菱化工機	900	1,715.00	1,543,500
月島機械	4,700	1,268.00	5,959,600
帝国電機製作所	1,700	1,671.00	2,840,700
新東工業	5,600	899.00	5,034,400
澁谷工業	2,100	3,985.00	8,368,500
アイチコーポレーション	4,100	649.00	2,660,900
小森コーポレーション	6,400	1,197.00	7,660,800
鶴見製作所	1,800	1,961.00	3,529,800
荏原製作所	10,500	2,861.00	30,040,500
石井鐵工所	800	1,884.00	1,507,200
西島製作所	2,400	997.00	2,392,800
北越工業	2,400	1,203.00	2,887,200
千代田化工建設	19,200	319.00	6,124,800
ダイキン工業	32,400	11,510.00	372,924,000
オルガノ	900	3,005.00	2,704,500
トーヨーカネツ	900	2,376.00	2,138,400
栗田工業	12,800	2,906.00	37,196,800
椿本チエイン	3,100	4,170.00	12,927,000
日機装	7,100	1,095.00	7,774,500

木村化工機	1,100	449.00	493,900
新興プランテック	4,800	1,050.00	5,040,000
アネスト岩田	3,700	1,177.00	4,354,900
ダイフク	13,100	5,450.00	71,395,000
サムコ	1,300	1,152.00	1,497,600
加藤製作所	1,200	2,782.00	3,338,400
油研工業	700	2,048.00	1,433,600
タダノ	11,500	1,312.00	15,088,000
フジテック	8,600	1,369.00	11,773,400
C K D	6,600	1,004.00	6,626,400
キトー	1,800	1,910.00	3,438,000
平和	6,600	2,395.00	15,807,000
理想科学工業	2,100	1,912.00	4,015,200
S A N K Y O	5,900	4,450.00	26,255,000
日本金銭機械	2,600	1,060.00	2,756,000
マースグループホールディングス	1,500	2,324.00	3,486,000
福島工業	1,500	4,445.00	6,667,500
ダイコク電機	1,100	1,518.00	1,669,800
竹内製作所	4,000	2,161.00	8,644,000
アマノ	6,800	2,464.00	16,755,200
J U K I	3,300	1,506.00	4,969,800
サンデンホールディングス	2,900	867.00	2,514,300
蛇の目マシン工業	2,600	542.00	1,409,200
ブラザー工業	30,900	1,883.00	58,184,700
マックス	3,600	1,440.00	5,184,000
モリタホールディングス	4,100	2,122.00	8,700,200
グローリー	6,600	2,925.00	19,305,000
新晃工業	2,200	1,571.00	3,456,200
大和冷機工業	3,400	1,324.00	4,501,600
セガサミーホールディングス	23,500	1,637.00	38,469,500
日本ピストンリング	900	2,074.00	1,866,600
リケン	1,100	5,170.00	5,687,000
T P R	3,200	2,703.00	8,649,600
ツバキ・ナカシマ	3,600	1,824.00	6,566,400
ホシザキ	6,900	8,200.00	56,580,000
大豊工業	1,900	1,053.00	2,000,700
日本精工	48,700	1,051.00	51,183,700
N T N	51,000	380.00	19,380,000
ジェイテクト	22,800	1,371.00	31,258,800
不二越	2,200	4,635.00	10,197,000
ミネベアミツミ	44,100	1,633.00	72,015,300
日本トムソン	7,000	612.00	4,284,000
T H K	14,800	2,455.00	36,334,000
ユーシン精機	1,800	1,182.00	2,127,600
前澤給装工業	900	1,858.00	1,672,200
イーグル工業	2,900	1,459.00	4,231,100
日本ピラー工業	2,400	1,499.00	3,597,600
キッツ	9,600	947.00	9,091,200
日立製作所	106,900	3,220.00	344,218,000
三菱電機	237,300	1,458.50	346,102,050
富士電機	15,400	3,300.00	50,820,000
東洋電機製造	1,000	1,512.00	1,512,000
安川電機	27,500	3,230.00	88,825,000
シンフォニア テクノロジー	3,300	1,556.00	5,134,800
明電舎	4,700	1,520.00	7,144,000
山洋電気	1,100	4,085.00	4,493,500
デンヨー	2,200	1,563.00	3,438,600
M S - J a p a n	1,000	1,308.00	1,308,000
グレイステクノロジー	700	2,374.00	1,661,800

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,300	2,044.00	2,657,200
フルテック	1,300	1,103.00	1,433,900
日総工産	700	1,701.00	1,190,700
キュービーネットホールディングス	1,200	2,267.00	2,720,400
三櫻工業	3,000	625.00	1,875,000
マキタ	28,900	4,380.00	126,582,000
東芝テック	3,000	3,090.00	9,270,000
芝浦メカトロニクス	400	3,965.00	1,586,000
マブチモーター	6,600	3,815.00	25,179,000
日本電産	28,600	13,855.00	396,253,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,300	2,382.00	3,096,600
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,417.00	1,417,000
東光高岳	1,200	1,591.00	1,909,200
ダブル・スコープ	3,500	1,206.00	4,221,000
ダイヘン	2,600	2,558.00	6,650,800
ヤーマン	3,400	1,919.00	6,524,600
JVCケンウッド	17,400	284.00	4,941,600
ミマキエンジニアリング	2,100	835.00	1,753,500
第一精工	1,100	1,256.00	1,381,600
日新電機	5,600	932.00	5,219,200
大崎電気工業	4,700	757.00	3,557,900
オムロン	25,200	4,630.00	116,676,000
日東工業	3,800	1,845.00	7,011,000
I D E C	3,200	2,310.00	7,392,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	8,500	2,501.00	21,258,500
メルコホールディングス	1,000	3,810.00	3,810,000
日本電気	30,700	3,365.00	103,305,500
富士通	22,900	6,910.00	158,239,000
沖電気工業	10,300	1,544.00	15,903,200
電気興業	1,200	2,759.00	3,310,800
サンケン電気	2,800	2,437.00	6,823,600
アイホン	1,300	1,633.00	2,122,900
ルネサスエレクトロニクス	24,600	545.00	13,407,000
セイコーエプソン	29,400	1,852.00	54,448,800
ワコム	17,200	551.00	9,477,200
アルバック	5,500	4,025.00	22,137,500
アクセル	2,500	576.00	1,440,000
E I Z O	2,200	4,485.00	9,867,000
ジャパンディスプレイ	56,100	70.00	3,927,000
日本信号	6,000	970.00	5,820,000
京三製作所	5,100	471.00	2,402,100
能美防災	3,100	2,250.00	6,975,000
ホーチキ	1,500	1,182.00	1,773,000
星和電機	2,900	460.00	1,334,000
エレコム	2,100	2,865.00	6,016,500
パナソニック	271,100	1,109.00	300,649,900
シャープ	23,500	1,722.00	40,467,000
アンリツ	15,300	1,693.00	25,902,900
富士通ゼネラル	7,200	1,556.00	11,203,200
ソニー	159,100	5,709.00	908,301,900
T D K	12,400	8,680.00	107,632,000
帝国通信工業	1,200	1,218.00	1,461,600
タムラ製作所	9,100	580.00	5,278,000
アルプス電気	21,900	2,473.00	54,158,700
池上通信機	1,100	1,343.00	1,477,300
パイオニア	39,500	93.00	3,673,500
日本電波工業	2,800	515.00	1,442,000
鈴木	2,100	680.00	1,428,000
日本トリム	400	5,970.00	2,388,000



ローランド ディー・ジー	1,200	2,405.00	2,886,000
フォスター電機	2,800	1,516.00	4,244,800
クラリオン	2,100	2,471.00	5,189,100
SMK	700	2,368.00	1,657,600
ヨコオ	1,700	1,535.00	2,609,500
ホシデン	7,000	821.00	5,747,000
ヒロセ電機	3,400	11,680.00	39,712,000
日本航空電子工業	5,400	1,391.00	7,511,400
TOA	2,500	1,110.00	2,775,000
マクセルホールディングス	5,100	1,562.00	7,966,200
古野電気	3,100	1,190.00	3,689,000
ユニデンホールディングス	700	2,507.00	1,754,900
アルパイン	4,100	1,781.00	7,302,100
スミダコーポレーション	2,000	1,441.00	2,882,000
アイコム	1,300	2,354.00	3,060,200
リオン	1,100	1,972.00	2,169,200
船井電機	2,400	725.00	1,740,000
横河電機	23,800	2,088.00	49,694,400
新電元工業	900	4,310.00	3,879,000
アズビル	15,300	2,238.00	34,241,400
東亜ディーケーケー	1,400	963.00	1,348,200
日本光電工業	10,500	3,255.00	34,177,500
チノー	1,100	1,415.00	1,556,500
共和電業	3,500	415.00	1,452,500
日本電子材料	1,900	690.00	1,311,000
堀場製作所	4,700	4,925.00	23,147,500
アドバンテスト	16,200	2,152.00	34,862,400
小野測器	2,000	709.00	1,418,000
エスベック	2,100	1,919.00	4,029,900
キーエンス	11,600	61,000.00	707,600,000
日置電機	1,200	4,010.00	4,812,000
シスメックス	18,500	6,209.00	114,866,500
日本マイクロニクス	3,800	824.00	3,131,200
メガチップス	1,900	2,199.00	4,178,100
OBARA GROUP	1,400	4,485.00	6,279,000
IMAGICA GROUP	2,400	580.00	1,392,000
澤藤電機	700	1,912.00	1,338,400
デンソー	52,700	5,134.00	270,561,800
コーセル	3,300	1,104.00	3,643,200
イリソ電子工業	2,200	4,695.00	10,329,000
オプテックスグループ	4,200	2,111.00	8,866,200
千代田インテグレ	1,000	2,367.00	2,367,000
アイ・オー・データ機器	1,200	1,200.00	1,440,000
レーザーテック	4,900	3,250.00	15,925,000
スタンレー電気	16,800	3,270.00	54,936,000
岩崎電気	1,000	1,525.00	1,525,000
ウシオ電機	14,400	1,282.00	18,460,800
岡谷電機産業	3,400	431.00	1,465,400
ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	745.00	1,639,000
日本セラミック	2,400	2,716.00	6,518,400
遠藤照明	1,800	782.00	1,407,600
古河電池	1,800	820.00	1,476,000
双信電機	3,500	414.00	1,449,000
山一電機	1,700	1,291.00	2,194,700
図研	1,500	1,826.00	2,739,000
日本電子	4,700	1,878.00	8,826,600
カシオ計算機	21,000	1,574.00	33,054,000
ファナック	22,600	18,595.00	420,247,000
日本シイエムケイ	6,000	873.00	5,238,000
エンプラス	1,100	3,065.00	3,371,500

ローム	11,500	7,730.00	88,895,000
浜松ホトニクス	17,000	3,650.00	62,050,000
三井ハイテック	2,600	1,193.00	3,101,800
新光電気工業	8,000	762.00	6,096,000
京セラ	36,200	5,780.00	209,236,000
協栄産業	900	1,708.00	1,537,200
太陽誘電	10,600	2,015.00	21,359,000
村田製作所	24,900	15,705.00	391,054,500
ユーシン	3,700	985.00	3,644,500
双葉電子工業	3,900	1,724.00	6,723,600
日東電工	17,900	5,893.00	105,484,700
北陸電気工業	1,400	1,068.00	1,495,200
東海理化電機製作所	6,200	2,069.00	12,827,800
ニチコン	7,500	849.00	6,367,500
日本ケミコン	1,700	2,222.00	3,777,400
K O A	3,600	1,469.00	5,288,400
三井E & Sホールディングス	8,600	1,133.00	9,743,800
日立造船	18,800	380.00	7,144,000
三菱重工業	39,800	4,320.00	171,936,000
川崎重工業	18,500	2,622.00	48,507,000
I H I	18,200	3,740.00	68,068,000
名村造船所	7,100	535.00	3,798,500
スプリックス	700	2,241.00	1,568,700
日本車輛製造	900	2,634.00	2,370,600
三菱ロジスネクスト	2,800	1,224.00	3,427,200
近畿車輛	600	2,436.00	1,461,600
F P G	7,500	1,250.00	9,375,000
島根銀行	1,500	924.00	1,386,000
じもとホールディングス	15,800	153.00	2,417,400
全国保証	6,600	3,815.00	25,179,000
めぶきフィナンシャルグループ	121,600	341.00	41,465,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,200	1,936.00	6,195,200
九州フィナンシャルグループ	38,400	507.00	19,468,800
かんぽ生命保険	8,800	2,875.00	25,300,000
ゆうちょ銀行	66,300	1,324.00	87,781,200
富山第一銀行	5,600	441.00	2,469,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	149,100	509.00	75,891,900
西日本フィナンシャルホールディングス	15,000	1,117.00	16,755,000
日本モーゲージサービス	1,200	1,070.00	1,284,000
アルヒ	2,100	1,831.00	3,845,100
日産自動車	279,900	950.70	266,100,930
いすゞ自動車	75,000	1,597.50	119,812,500
トヨタ自動車	264,500	6,717.00	1,776,646,500
日野自動車	29,600	1,067.00	31,583,200
三菱自動車工業	87,900	680.00	59,772,000
エフテック	1,700	1,053.00	1,790,100
レシップホールディングス	2,000	713.00	1,426,000
武蔵精密工業	5,600	1,719.00	9,626,400
日産車体	4,600	905.00	4,163,000
新明和工業	11,100	1,452.00	16,117,200
極東開発工業	4,700	1,590.00	7,473,000
日信工業	4,300	1,517.00	6,523,100
トピー工業	2,000	2,641.00	5,282,000
ティラド	900	2,552.00	2,296,800
曙ブレーキ工業	13,000	209.00	2,717,000
タチエス	4,000	1,512.00	6,048,000
N O K	12,800	1,636.00	20,940,800
フタバ産業	6,600	606.00	3,999,600
K Y B	2,500	2,692.00	6,730,000

市光工業	3,500	702.00	2,457,000
大同メタル工業	3,900	903.00	3,521,700
プレス工業	11,800	581.00	6,855,800
ミクニ	3,000	585.00	1,755,000
太平洋工業	5,000	1,605.00	8,025,000
ケーヒン	5,500	1,936.00	10,648,000
河西工業	2,900	942.00	2,731,800
アイシン精機	19,500	4,455.00	86,872,500
マツダ	74,500	1,178.50	87,798,250
今仙電機製作所	2,200	1,047.00	2,303,400
本田技研工業	200,200	3,166.00	633,833,200
スズキ	43,400	5,330.00	231,322,000
S U B A R U	73,700	2,551.00	188,008,700
安永	1,100	1,710.00	1,881,000
ヤマハ発動機	33,500	2,242.00	75,107,000
ショーワ	5,600	1,500.00	8,400,000
小糸製作所	14,200	6,000.00	85,200,000
T B K	100	442.00	44,200
エクセディ	3,200	2,807.00	8,982,400
ミツバ	4,400	716.00	3,150,400
豊田合成	7,700	2,169.00	16,701,300
愛三工業	3,700	803.00	2,971,100
盟和産業	1,300	1,076.00	1,398,800
日本プラスト	1,900	903.00	1,715,700
ヨロズ	2,200	1,438.00	3,163,600
エフ・シー・シー	4,300	2,787.00	11,984,100
シマノ	9,600	15,720.00	150,912,000
テイ・エス テック	5,500	3,285.00	18,067,500
関西みらいフィナンシャルグループ	11,000	868.00	9,548,000
三十三フィナンシャルグループ	2,000	1,918.00	3,836,000
第四北越フィナンシャルグループ	4,100	3,720.00	15,252,000
ジャムコ	1,200	3,045.00	3,654,000
小野建	2,100	1,647.00	3,458,700
ノジマ	4,200	2,608.00	10,953,600
佐島電機	1,700	1,060.00	1,802,000
カップ・クリエイト	3,300	1,477.00	4,874,100
エコートレーディング	2,300	648.00	1,490,400
伯東	1,600	1,294.00	2,070,400
コンドーテック	1,800	1,015.00	1,827,000
ライトオン	2,000	930.00	1,860,000
ナガイレーベン	3,400	2,677.00	9,101,800
三菱食品	2,600	3,010.00	7,826,000
良品計画	3,300	28,930.00	95,469,000
三城ホールディングス	3,000	481.00	1,443,000
松田産業	1,700	1,511.00	2,568,700
第一興商	3,500	5,200.00	18,200,000
メディカルホールディングス	25,200	2,561.00	64,537,200
アドヴァン	3,600	1,056.00	3,801,600
S P K	600	2,375.00	1,425,000
萩原電気ホールディングス	900	3,015.00	2,713,500
アルビス	900	2,892.00	2,602,800
アズワン	1,700	7,940.00	13,498,000
シモジマ	1,400	1,090.00	1,526,000
ドウシシャ	2,200	2,002.00	4,404,400
小津産業	700	1,945.00	1,361,500
コナカ	3,000	489.00	1,467,000
高速	1,400	1,206.00	1,688,400
G - 7 ホールディングス	700	2,559.00	1,791,300
イオン北海道	2,300	812.00	1,867,600
コジマ	3,400	502.00	1,706,800

ヒマラヤ	1,500	993.00	1,489,500
コーナン商事	3,100	2,699.00	8,366,900
ネットワンシステムズ	8,200	2,116.00	17,351,200
エコス	900	2,186.00	1,967,400
ワタミ	3,100	1,332.00	4,129,200
マルシェ	1,800	800.00	1,440,000
システムソフト	12,900	109.00	1,406,100
ドンキホーテホールディングス	15,200	7,000.00	106,400,000
丸文	2,100	738.00	1,549,800
西松屋チェーン	5,100	1,014.00	5,171,400
ゼンショーホールディングス	11,000	2,749.00	30,239,000
ハピネット	1,900	1,547.00	2,939,300
幸楽苑ホールディングス	1,500	1,957.00	2,935,500
日本ライフライン	7,300	1,681.00	12,271,300
サイゼリヤ	3,900	2,121.00	8,271,900
エクセル	900	1,889.00	1,700,100
VTホールディングス	7,900	479.00	3,784,100
マルカキカイ	800	2,309.00	1,847,200
アルゴグラフィックス	1,000	4,340.00	4,340,000
魚力	1,000	1,418.00	1,418,000
IDOM	7,900	499.00	3,942,100
日本エム・ディ・エム	1,400	1,373.00	1,922,200
ユナイテッドアローズ	2,700	3,915.00	10,570,500
進和	1,400	2,371.00	3,319,400
ダイトロン	1,100	1,558.00	1,713,800
ハイデイ日高	3,100	2,253.00	6,984,300
シークス	3,000	1,689.00	5,067,000
京都きもの友禅	3,200	451.00	1,443,200
コロワイド	7,800	2,511.00	19,585,800
ピーシーデポコーポレーション	3,100	515.00	1,596,500
田中商事	2,300	625.00	1,437,500
オーハシテクニカ	1,300	1,397.00	1,816,100
壱番屋	1,600	4,490.00	7,184,000
白銅	800	1,688.00	1,350,400
トップカルチャー	3,900	382.00	1,489,800
PLANT	1,300	1,077.00	1,400,100
スギホールディングス	5,100	5,240.00	26,724,000
島津製作所	30,500	2,485.00	75,792,500
長野計器	1,900	948.00	1,801,200
バイ・テクノロジー	600	16,110.00	9,666,000
スター精密	4,100	1,534.00	6,289,400
東京計器	1,500	1,066.00	1,599,000
インターアクション	1,300	2,368.00	3,078,400
オーバル	1,600	282.00	451,200
東京精密	4,300	3,220.00	13,846,000
マニー	2,900	4,970.00	14,413,000
ニコン	41,400	1,814.00	75,099,600
トプコン	12,700	1,557.00	19,773,900
オリンパス	35,400	3,625.00	128,325,000
理研計器	2,100	2,321.00	4,874,100
SCREENホールディングス	4,100	5,290.00	21,689,000
キヤノン電子	2,200	2,005.00	4,411,000
タムロン	2,100	1,813.00	3,807,300
HOYA	47,800	6,747.00	322,506,600
シード	1,000	1,690.00	1,690,000
ノーリツ鋼機	1,900	1,845.00	3,505,500
エー・アンド・デイ	2,200	812.00	1,786,400
朝日インテック	8,600	5,160.00	44,376,000
キヤノン	127,800	3,203.00	409,343,400
リコー	71,400	1,110.00	79,254,000

シチズン時計	26,000	602.00	15,652,000
リズム時計工業	800	1,981.00	1,584,800
大研医器	1,900	766.00	1,455,400
メニコン	3,300	2,803.00	9,249,900
シンシア	2,800	619.00	1,733,200
スノーピーク	1,000	1,392.00	1,392,000
パラマウントベッドホールディングス	2,700	4,490.00	12,123,000
トランザクション	1,700	824.00	1,400,800
S H O B I	3,800	396.00	1,504,800
ニホンフラッシュ	1,000	1,838.00	1,838,000
前田工織	2,600	2,530.00	6,578,000
永大産業	3,400	428.00	1,455,200
アートネイチャー	2,500	669.00	1,672,500
バンダイナムコホールディングス	24,500	4,900.00	120,050,000
共立印刷	5,600	256.00	1,433,600
S H O E I	1,100	4,435.00	4,878,500
フランスベッドホールディングス	3,400	952.00	3,236,800
マーベラス	3,600	886.00	3,189,600
パイロットコーポレーション	4,100	5,720.00	23,452,000
萩原工業	1,300	1,654.00	2,150,200
エイベックス	4,000	1,511.00	6,044,000
トッパン・フォームズ	5,100	996.00	5,079,600
フジシールインターナショナル	5,400	3,635.00	19,629,000
タカラトミー	9,900	1,317.00	13,038,300
廣済堂	3,400	430.00	1,462,000
エステールホールディングス	2,200	675.00	1,485,000
アーク	15,600	93.00	1,450,800
レック	2,500	2,139.00	5,347,500
プロネクス	2,000	1,052.00	2,104,000
ホクシン	9,200	157.00	1,444,400
大建工業	1,800	2,103.00	3,785,400
凸版印刷	33,500	1,783.00	59,730,500
大日本印刷	33,400	2,596.00	86,706,400
図書印刷	2,200	808.00	1,777,600
共同印刷	700	2,591.00	1,813,700
N I S S H A	4,900	1,899.00	9,305,100
藤森工業	2,100	3,020.00	6,342,000
ヴィア・ホールディングス	2,900	703.00	2,038,700
宝印刷	1,200	1,798.00	2,157,600
前澤化成工業	1,600	1,099.00	1,758,400
アシックス	23,600	1,520.00	35,872,000
ツツミ	700	2,194.00	1,535,800
J S P	1,400	2,387.00	3,341,800
ニチハ	3,300	2,953.00	9,744,900
エフピコ	2,000	6,720.00	13,440,000
小松ウオール工業	700	2,006.00	1,404,200
ヤマハ	14,100	4,755.00	67,045,500
河合楽器製作所	700	3,335.00	2,334,500
クリナップ	2,300	689.00	1,584,700
ビジョン	14,300	4,865.00	69,569,500
天馬	1,600	2,048.00	3,276,800
キングジム	2,000	904.00	1,808,000
象印マホービン	4,400	1,163.00	5,117,200
リンテック	5,600	2,560.00	14,336,000
信越ポリマー	4,300	849.00	3,650,700
東リ	5,900	305.00	1,799,500
イトーキ	4,400	601.00	2,644,400
任天堂	14,600	31,220.00	455,812,000
三菱鉛筆	3,900	2,120.00	8,268,000
松風	1,200	1,235.00	1,482,000

タカラスタンダード	4,900	1,750.00	8,575,000
コクヨ	11,400	1,679.00	19,140,600
ナカバヤシ	2,500	587.00	1,467,500
ニフコ	9,500	2,868.00	27,246,000
立川ブラインド工業	1,300	1,136.00	1,476,800
グローブライド	1,100	2,851.00	3,136,100
オカムラ	8,300	1,573.00	13,055,900
バルカー	1,900	2,663.00	5,059,700
MUTOHホールディングス	600	2,300.00	1,380,000
伊藤忠商事	171,500	2,054.00	352,261,000
丸紅	230,500	869.20	200,350,600
スクロール	3,600	441.00	1,587,600
ヨンドシーホールディングス	2,600	2,434.00	6,328,400
三陽商会	1,400	1,916.00	2,682,400
長瀬産業	13,100	1,618.00	21,195,800
蝶理	1,500	1,903.00	2,854,500
豊田通商	26,100	4,010.00	104,661,000
オンワードホールディングス	14,400	691.00	9,950,400
三共生興	4,000	449.00	1,796,000
兼松	9,300	1,475.00	13,717,500
美津濃	2,400	2,532.00	6,076,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,500	15,580.00	101,270,000
三井物産	192,600	1,789.00	344,561,400
日本紙バルブ商事	1,300	4,305.00	5,596,500
東京エレクトロン	15,800	14,645.00	231,391,000
日立ハイテクノロジーズ	7,100	3,975.00	28,222,500
カメイ	3,000	1,289.00	3,867,000
OUGホールディングス	600	2,620.00	1,572,000
スターゼン	900	4,510.00	4,059,000
セイコーホールディングス	3,700	2,440.00	9,028,000
山善	9,100	1,134.00	10,319,400
椿本興業	500	3,430.00	1,715,000
住友商事	138,300	1,750.00	242,025,000
日本ユニシス	7,300	2,718.00	19,841,400
内田洋行	1,100	2,667.00	2,933,700
三菱商事	164,000	3,057.00	501,348,000
第一実業	1,100	3,890.00	4,279,000
キヤノンマーケティングジャパン	6,700	2,105.00	14,103,500
西華産業	1,300	1,622.00	2,108,600
佐藤商事	2,100	975.00	2,047,500
菱洋エレクトロ	2,400	1,655.00	3,972,000
東京産業	2,400	587.00	1,408,800
ユアサ商事	2,400	3,545.00	8,508,000
神鋼商事	500	2,759.00	1,379,500
小林産業	4,800	304.00	1,459,200
阪和興業	4,100	3,115.00	12,771,500
正栄食品工業	1,200	4,575.00	5,490,000
カナデン	2,200	1,287.00	2,831,400
菱電商事	1,900	1,565.00	2,973,500
ニプロ	16,400	1,540.00	25,256,000
フルサト工業	1,300	1,900.00	2,470,000
岩谷産業	5,200	3,905.00	20,306,000
すてきなイスグループ	1,300	1,112.00	1,445,600
昭光通商	1,900	782.00	1,485,800
イワキ	2,900	520.00	1,508,000
兼松エレクトロニクス	1,300	3,530.00	4,589,000
三愛石油	6,300	1,133.00	7,137,900
稲畑産業	5,600	1,540.00	8,624,000
ゴールドウイン	2,100	11,440.00	24,024,000

ユニ・チャーム	50,300	3,323.00	167,146,900
デサント	5,700	2,363.00	13,469,100
キング	3,000	496.00	1,488,000
ワキタ	5,000	1,262.00	6,310,000
ヤマトインターナショナル	3,200	455.00	1,456,000
東邦ホールディングス	6,900	3,120.00	21,528,000
サンゲツ	7,100	2,173.00	15,428,300
ミツウロコグループホールディングス	3,400	674.00	2,291,600
シナネンホールディングス	1,000	2,585.00	2,585,000
伊藤忠エネクス	5,200	1,036.00	5,387,200
サンリオ	7,200	2,188.00	15,753,600
サンワテクノス	1,400	1,210.00	1,694,000
リョーサン	2,600	3,205.00	8,333,000
新光商事	2,200	1,686.00	3,709,200
トーホー	1,100	2,413.00	2,654,300
三信電気	1,900	1,922.00	3,651,800
東陽テクニカ	2,600	885.00	2,301,000
モスフードサービス	3,100	3,015.00	9,346,500
加賀電子	2,300	2,221.00	5,108,300
三益半導体工業	1,800	1,497.00	2,694,600
ソーダニッカ	2,400	657.00	1,576,800
立花エレテック	1,700	1,708.00	2,903,600
木曽路	2,900	2,584.00	7,493,600
S R Sホールディングス	2,800	1,017.00	2,847,600
タカキュー	7,600	194.00	1,474,400
ケーヨー	4,300	583.00	2,506,900
上新電機	2,800	2,601.00	7,282,800
日本瓦斯	4,300	3,795.00	16,318,500
ロイヤルホールディングス	4,100	2,671.00	10,951,100
東天紅	1,000	1,486.00	1,486,000
いなげや	2,600	1,534.00	3,988,400
島忠	5,300	2,950.00	15,635,000
チヨダ	2,500	2,008.00	5,020,000
ライフコーポレーション	1,800	2,760.00	4,968,000
リンガーハット	2,900	2,393.00	6,939,700
MrMaxHD	3,200	514.00	1,644,800
テンアライド	3,500	414.00	1,449,000
AOKIホールディングス	4,700	1,420.00	6,674,000
オークワ	3,300	1,198.00	3,953,400
コメリ	3,600	2,795.00	10,062,000
青山商事	4,500	2,818.00	12,681,000
しまむら	2,700	9,330.00	25,191,000
はせがわ	3,200	468.00	1,497,600
高島屋	18,300	1,895.00	34,678,500
松屋	4,700	1,157.00	5,437,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,000	1,965.00	23,580,000
近鉄百貨店	900	3,620.00	3,258,000
パルコ	2,200	1,266.00	2,785,200
丸井グループ	19,800	2,434.00	48,193,200
クレディセゾン	16,400	1,489.00	24,419,600
アクシアル リテイリング	1,900	3,995.00	7,590,500
イオン	90,000	2,709.00	243,810,000
イズミ	4,800	6,580.00	31,584,000
平和堂	4,700	3,100.00	14,570,000
フジ	2,800	2,148.00	6,014,400
ヤオコー	2,700	6,330.00	17,091,000
ゼビオホールディングス	2,800	1,499.00	4,197,200
ケーズホールディングス	24,300	1,211.00	29,427,300
PALTAC	4,200	5,930.00	24,906,000
三谷産業	4,600	311.00	1,430,600

Olympicグループ	1,900	771.00	1,464,900
新生銀行	17,200	1,595.00	27,434,000
あおぞら銀行	13,100	3,760.00	49,256,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,630,300	638.70	1,041,272,610
りそなホールディングス	256,900	578.00	148,488,200
三井住友トラスト・ホールディングス	46,100	4,524.00	208,556,400
三井住友フィナンシャルグループ	165,000	4,193.00	691,845,000
千葉銀行	82,900	718.00	59,522,200
群馬銀行	46,800	528.00	24,710,400
武蔵野銀行	3,500	3,010.00	10,535,000
千葉興業銀行	6,400	423.00	2,707,200
筑波銀行	9,700	244.00	2,366,800
七十七銀行	7,300	2,255.00	16,461,500
青森銀行	1,900	3,005.00	5,709,500
秋田銀行	1,500	2,389.00	3,583,500
山形銀行	2,600	2,356.00	6,125,600
岩手銀行	1,700	4,185.00	7,114,500
東邦銀行	20,900	380.00	7,942,000
東北銀行	1,200	1,323.00	1,587,600
みちのく銀行	1,500	1,798.00	2,697,000
ふくおかフィナンシャルグループ	19,100	2,556.00	48,819,600
静岡銀行	58,900	1,001.00	58,958,900
十六銀行	3,100	2,586.00	8,016,600
スルガ銀行	23,900	546.00	13,049,400
八十二銀行	42,400	507.00	21,496,800
山梨中央銀行	2,900	1,590.00	4,611,000
大垣共立銀行	3,700	2,469.00	9,135,300
福井銀行	2,000	1,894.00	3,788,000
北國銀行	2,500	4,075.00	10,187,500
清水銀行	1,000	1,858.00	1,858,000
富山銀行	500	3,910.00	1,955,000
滋賀銀行	4,700	2,754.00	12,943,800
南都銀行	2,700	2,535.00	6,844,500
百五銀行	21,100	433.00	9,136,300
京都銀行	8,400	5,250.00	44,100,000
紀陽銀行	8,300	1,766.00	14,657,800
ほくほくフィナンシャルグループ	15,600	1,459.00	22,760,400
広島銀行	34,600	697.00	24,116,200
山陰合同銀行	13,900	909.00	12,635,100
中国銀行	15,100	1,021.00	15,417,100
鳥取銀行	900	1,590.00	1,431,000
伊予銀行	31,000	659.00	20,429,000
百十四銀行	2,500	2,944.00	7,360,000
四国銀行	3,400	1,371.00	4,661,400
阿波銀行	3,800	3,120.00	11,856,000
大分銀行	1,500	3,695.00	5,542,500
宮崎銀行	1,600	3,170.00	5,072,000
佐賀銀行	1,400	2,120.00	2,968,000
十八銀行	1,500	2,820.00	4,230,000
沖縄銀行	2,200	3,770.00	8,294,000
琉球銀行	5,400	1,301.00	7,025,400
セブン銀行	79,100	370.00	29,267,000
みずほフィナンシャルグループ	3,180,900	189.90	604,052,910
山口フィナンシャルグループ	29,200	1,185.00	34,602,000
芙蓉総合リース	2,700	6,160.00	16,632,000
興銀リース	4,400	2,746.00	12,082,400
東京センチュリー	4,700	5,300.00	24,910,000
SBIホールディングス	27,900	2,633.00	73,460,700
日本証券金融	10,300	642.00	6,612,600
アイフル	35,700	302.00	10,781,400



長野銀行	900	1,668.00	1,501,200
名古屋銀行	1,900	3,655.00	6,944,500
北洋銀行	35,300	320.00	11,296,000
愛知銀行	900	4,290.00	3,861,000
中京銀行	1,000	2,303.00	2,303,000
大光銀行	800	2,134.00	1,707,200
愛媛銀行	3,300	1,166.00	3,847,800
京葉銀行	10,300	786.00	8,095,800
栃木銀行	12,100	289.00	3,496,900
北日本銀行	700	2,541.00	1,778,700
東和銀行	4,100	896.00	3,673,600
リコーリース	1,800	3,605.00	6,489,000
イオンフィナンシャルサービス	15,000	2,240.00	33,600,000
アコム	47,100	412.00	19,405,200
ジャックス	2,600	2,031.00	5,280,600
オリエントコーポレーション	63,300	178.00	11,267,400
日立キャピタル	5,500	2,778.00	15,279,000
アプラスフィナンシャル	15,000	99.00	1,485,000
オリックス	156,200	1,792.00	279,910,400
三菱UFJリース	52,800	597.00	31,521,600
ジャフコ	3,800	4,225.00	16,055,000
トモニホールディングス	18,100	462.00	8,362,200
大和証券グループ本社	187,800	627.30	117,806,940
野村ホールディングス	429,600	512.70	220,255,920
岡三証券グループ	19,900	550.00	10,945,000
丸三証券	7,000	887.00	6,209,000
東洋証券	8,400	203.00	1,705,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	27,900	557.00	15,540,300
光世証券	1,400	980.00	1,372,000
水戸証券	6,800	313.00	2,128,400
いちよし証券	4,900	927.00	4,542,300
松井証券	11,500	1,215.00	13,972,500
SOMPOホールディングス	45,900	4,407.00	202,281,300
だいこう証券ビジネス	1,500	497.00	745,500
日本取引所グループ	63,200	2,042.00	129,054,400
マネックスグループ	21,900	415.00	9,088,500
カブドットコム証券	17,500	423.00	7,402,500
極東証券	3,100	1,310.00	4,061,000
岩井コスモホールディングス	2,400	1,403.00	3,367,200
藍澤證券	4,400	759.00	3,339,600
フィデアホールディングス	22,700	154.00	3,495,800
池田泉州ホールディングス	24,800	339.00	8,407,200
アニコムホールディングス	1,800	3,790.00	6,822,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	61,200	3,458.00	211,629,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	19,200	2,416.00	46,387,200
マネーパートナーズグループ	4,000	344.00	1,376,000
第一生命ホールディングス	132,400	2,013.00	266,521,200
東京海上ホールディングス	84,900	5,534.00	469,836,600
イー・ギャランティ	2,200	1,065.00	2,343,000
アサックス	1,600	587.00	939,200
NECキャピタルソリューション	1,000	1,699.00	1,699,000
T&Dホールディングス	72,400	1,671.00	120,980,400
アドバンスクリエイト	600	2,057.00	1,234,200
三井不動産	124,200	2,749.50	341,487,900
三菱地所	164,000	1,751.50	287,246,000
平和不動産	4,400	1,881.00	8,276,400
東京建物	25,600	1,182.00	30,259,200
ダイビル	6,900	1,176.00	8,114,400

京阪神ビルディング	4,200	882.00	3,704,400
住友不動産	52,600	4,148.00	218,184,800
大京	3,700	2,963.00	10,963,100
テーオーシー	5,400	852.00	4,600,800
東京楽天地	300	4,870.00	1,461,000
レオパレス21	29,800	438.00	13,052,400
スターツコーポレーション	3,200	2,659.00	8,508,800
フジ住宅	3,000	861.00	2,583,000
空港施設	2,700	590.00	1,593,000
明和地所	2,300	618.00	1,421,400
ゴールドクレスト	1,800	1,690.00	3,042,000
リログループ	12,400	2,771.00	34,360,400
日本エスリード	800	1,550.00	1,240,000
日神不動産	3,500	495.00	1,732,500
日本エスコン	4,200	684.00	2,872,800
タカラレーベン	11,000	322.00	3,542,000
サンヨーハウジング名古屋	1,400	1,026.00	1,436,400
イオンモール	11,700	2,105.00	24,628,500
ファースト住建	1,200	1,178.00	1,413,600
カチタス	2,600	2,973.00	7,729,800
東祥	1,400	3,920.00	5,488,000
トーセイ	3,200	1,017.00	3,254,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	14,600	1,679.00	24,513,400
サンフロンティア不動産	3,200	1,172.00	3,750,400
エフ・ジェー・ネクスト	2,000	925.00	1,850,000
ランドビジネス	2,700	586.00	1,582,200
グランディハウス	3,400	426.00	1,448,400
東武鉄道	25,000	3,220.00	80,500,000
相鉄ホールディングス	8,100	3,410.00	27,621,000
東京急行電鉄	64,500	1,899.00	122,485,500
京浜急行電鉄	32,500	1,773.00	57,622,500
小田急電鉄	38,000	2,453.00	93,214,000
京王電鉄	13,300	6,270.00	83,391,000
京成電鉄	17,800	3,600.00	64,080,000
富士急行	3,200	3,080.00	9,856,000
新京成電鉄	700	2,153.00	1,507,100
東日本旅客鉄道	42,200	10,340.00	436,348,000
西日本旅客鉄道	21,300	8,056.00	171,592,800
東海旅客鉄道	21,300	22,565.00	480,634,500
西武ホールディングス	30,300	2,160.00	65,448,000
鴻池運輸	3,800	1,718.00	6,528,400
西日本鉄道	6,600	2,940.00	19,404,000
ハマキョウレックス	1,800	3,930.00	7,074,000
サカイ引越センター	1,200	6,020.00	7,224,000
近鉄グループホールディングス	22,500	4,610.00	103,725,000
阪急阪神ホールディングス	30,000	3,815.00	114,450,000
南海電気鉄道	10,000	2,744.00	27,440,000
京阪ホールディングス	10,000	4,685.00	46,850,000
神戸電鉄	600	3,975.00	2,385,000
名古屋鉄道	18,000	2,825.00	50,850,000
山陽電気鉄道	1,700	2,282.00	3,879,400
トランコム	600	6,640.00	3,984,000
日本通運	8,800	7,250.00	63,800,000
ヤマトホールディングス	39,400	2,887.50	113,767,500
山九	6,200	5,510.00	34,162,000
日新	1,900	1,874.00	3,560,600
丸全昭和運輸	1,800	3,015.00	5,427,000
センコーグループホールディングス	12,400	857.00	10,626,800
トナミホールディングス	500	6,020.00	3,010,000
ニッコンホールディングス	8,500	2,934.00	24,939,000

日本石油輸送	500	2,858.00	1,429,000
福山通運	2,900	4,785.00	13,876,500
セイノーホールディングス	16,800	1,656.00	27,820,800
神奈川中央交通	600	3,785.00	2,271,000
日立物流	4,900	3,130.00	15,337,000
丸和運輸機関	1,200	3,425.00	4,110,000
C & F ロジホールディングス	2,300	1,312.00	3,017,600
日本郵船	18,800	1,874.00	35,231,200
商船三井	13,400	2,629.00	35,228,600
川崎汽船	7,000	1,599.00	11,193,000
NSユナイテッド海運	1,300	2,983.00	3,877,900
飯野海運	10,700	462.00	4,943,400
九州旅客鉄道	18,900	3,580.00	67,662,000
SGホールディングス	21,200	2,907.00	61,628,400
日本航空	41,200	4,212.00	173,534,400
ANAホールディングス	41,100	4,039.00	166,002,900
パスコ	200	1,135.00	227,000
西本Wismettacホールディングス	500	5,140.00	2,570,000
Genky DrugStores	900	3,480.00	3,132,000
国際紙パルプ商事	4,400	312.00	1,372,800
総合メディカルホールディングス	2,000	2,570.00	5,140,000
三菱倉庫	7,800	2,771.00	21,613,800
三井倉庫ホールディングス	2,800	1,977.00	5,535,600
住友倉庫	8,400	1,414.00	11,877,600
澁澤倉庫	1,200	1,592.00	1,910,400
ヤマタネ	1,200	1,901.00	2,281,200
東陽倉庫	4,800	304.00	1,459,200
乾汽船	2,100	967.00	2,030,700
日本トランスシティ	4,900	471.00	2,307,900
ケイヒン	1,000	1,396.00	1,396,000
中央倉庫	1,400	1,070.00	1,498,000
安田倉庫	1,800	844.00	1,519,200
東洋埠頭	1,000	1,501.00	1,501,000
宇徳	2,800	517.00	1,447,600
上組	13,900	2,431.00	33,790,900
キムラユニティー	1,300	1,104.00	1,435,200
キューソー流通システム	300	2,521.00	756,300
近鉄エクスプレス	4,200	1,834.00	7,702,800
エーアイテイー	1,500	1,010.00	1,515,000
日本コンセプト	1,300	1,128.00	1,466,400
東京放送ホールディングス	15,400	2,022.00	31,138,800
日本テレビホールディングス	21,400	1,784.00	38,177,600
朝日放送グループホールディングス	2,300	776.00	1,784,800
テレビ朝日ホールディングス	6,400	2,199.00	14,073,600
スカパーJ S A Tホールディングス	17,800	528.00	9,398,400
テレビ東京ホールディングス	1,900	2,564.00	4,871,600
日本BS放送	1,200	1,231.00	1,477,200
ビジョン	700	4,365.00	3,055,500
USEN-NEXT HOLDINGS	1,300	1,150.00	1,495,000
ワイヤレスゲート	2,700	523.00	1,412,100
コネクシオ	1,600	1,455.00	2,328,000
日本通信	19,800	131.00	2,593,800
日本電信電話	159,300	4,655.00	741,541,500
KDDI	205,200	2,560.00	525,312,000
光通信	2,700	17,860.00	48,222,000
NTTドコモ	167,200	2,586.50	432,462,800
エムティーアイ	2,700	598.00	1,614,600
GMOインターネット	8,500	1,405.00	11,942,500
カドカワ	6,800	1,396.00	9,492,800

学研ホールディングス	800	4,520.00	3,616,000
ゼンリン	4,600	2,567.00	11,808,200
昭文社	2,500	544.00	1,360,000
インプレスホールディングス	9,100	157.00	1,428,700
東京電力ホールディングス	189,500	662.00	125,449,000
中部電力	72,600	1,727.50	125,416,500
関西電力	96,800	1,813.50	175,546,800
中国電力	32,800	1,448.00	47,494,400
北陸電力	23,200	1,036.00	24,035,200
東北電力	55,600	1,518.00	84,400,800
四国電力	21,400	1,376.00	29,446,400
九州電力	48,900	1,369.00	66,944,100
北海道電力	22,200	746.00	16,561,200
沖縄電力	4,400	2,187.00	9,622,800
電源開発	18,900	2,952.00	55,792,800
エフオン	1,100	1,000.00	1,100,000
イーレックス	4,100	678.00	2,779,800
レノバ	2,500	1,112.00	2,780,000
東京瓦斯	46,600	2,874.50	133,951,700
大阪瓦斯	46,100	2,117.00	97,593,700
東邦瓦斯	11,800	4,505.00	53,159,000
北海道瓦斯	1,300	1,468.00	1,908,400
広島ガス	4,900	352.00	1,724,800
西部瓦斯	2,700	2,403.00	6,488,100
静岡ガス	7,300	960.00	7,008,000
メタウォーター	1,100	3,110.00	3,421,000
アイネット	1,300	1,494.00	1,942,200
松竹	1,500	11,170.00	16,755,000
東宝	15,300	3,690.00	56,457,000
エイチ・アイ・エス	4,000	3,725.00	14,900,000
東映	1,000	13,420.00	13,420,000
ラックランド	500	2,908.00	1,454,000
エヌ・ティ・ティ・データ	62,000	1,298.00	80,476,000
共立メンテナンス	3,500	5,520.00	19,320,000
イチネンホールディングス	2,400	1,447.00	3,472,800
建設技術研究所	1,600	1,474.00	2,358,400
スペース	1,500	1,218.00	1,827,000
アインホールディングス	3,100	8,710.00	27,001,000
燦ホールディングス	500	2,747.00	1,373,500
東京テアトル	1,100	1,336.00	1,469,600
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,025.00	1,417,500
ナガワ	600	5,530.00	3,318,000
よみうりランド	500	4,060.00	2,030,000
東京都競馬	1,500	3,270.00	4,905,000
常磐興産	900	1,702.00	1,531,800
カナモト	3,200	3,390.00	10,848,000
東京ドーム	8,500	1,004.00	8,534,000
D T S	2,600	4,105.00	10,673,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,800	3,395.00	36,666,000
シーイーシー	2,500	2,319.00	5,797,500
カブコン	10,000	2,160.00	21,600,000
西尾レントオール	2,300	3,960.00	9,108,000
アイ・エス・ピー	600	2,308.00	1,384,800
日本空港ビルデング	7,500	4,240.00	31,800,000
トランス・コスモス	2,500	2,618.00	6,545,000
乃村工藝社	5,300	2,633.00	13,954,900
ジャステック	1,400	1,073.00	1,502,200
S C S K	6,100	4,285.00	26,138,500
藤田観光	900	3,065.00	2,758,500

KNT - CTホールディングス	1,200	1,199.00	1,438,800
日本管財	2,400	2,059.00	4,941,600
トーカイ	2,200	2,713.00	5,968,600
白洋舎	500	3,005.00	1,502,500
セコム	24,100	8,976.00	216,321,600
日本システムウエア	800	2,219.00	1,775,200
セントラル警備保障	1,100	5,570.00	6,127,000
アイネス	3,000	1,220.00	3,660,000
丹青社	4,300	1,102.00	4,738,600
メイトック	2,900	4,770.00	13,833,000
TKC	2,000	3,960.00	7,920,000
富士ソフト	3,500	4,965.00	17,377,500
応用地質	2,400	1,279.00	3,069,600
船井総研ホールディングス	4,700	2,153.00	10,119,100
NSD	3,800	2,346.00	8,914,800
進学会ホールディングス	2,400	606.00	1,454,400
丸紅建材リース	700	2,103.00	1,472,100
コナミホールディングス	9,500	4,830.00	45,885,000
いであ	1,400	1,061.00	1,485,400
学究社	900	1,631.00	1,467,900
ベネッセホールディングス	8,300	3,245.00	26,933,500
イオンディライト	2,800	3,945.00	11,046,000
ナック	1,400	1,070.00	1,498,000
福井コンピュータホールディングス	800	1,701.00	1,360,800
ニチイ学館	3,200	1,136.00	3,635,200
ダイセキ	3,800	2,645.00	10,051,000
ステップ	900	1,559.00	1,403,100
日鉄住金物産	1,700	5,120.00	8,704,000
泉州電業	800	2,532.00	2,025,600
元気寿司	700	5,480.00	3,836,000
トラスコ中山	4,900	3,090.00	15,141,000
ヤマダ電機	71,200	528.00	37,593,600
オートバックスセブン	9,300	1,717.00	15,968,100
モリト	1,700	838.00	1,424,600
アークランドサカモト	4,000	1,484.00	5,936,000
ニトリホールディングス	10,100	14,285.00	144,278,500
グルメ杵屋	1,700	1,191.00	2,024,700
愛眼	4,500	321.00	1,444,500
吉野家ホールディングス	8,200	1,904.00	15,612,800
加藤産業	3,700	3,455.00	12,783,500
イノテック	1,600	1,069.00	1,710,400
イエローハット	2,200	2,869.00	6,311,800
松屋フーズホールディングス	1,100	3,735.00	4,108,500
JBCホールディングス	1,800	1,699.00	3,058,200
JKホールディングス	2,200	635.00	1,397,000
サガミホールディングス	3,100	1,368.00	4,240,800
日伝	1,900	1,765.00	3,353,500
関西スーパーマーケット	1,800	1,053.00	1,895,400
ミロク情報サービス	2,300	2,650.00	6,095,000
北沢産業	6,400	229.00	1,465,600
杉本商事	1,300	1,790.00	2,327,000
因幡電機産業	3,300	4,620.00	15,246,000
王将フードサービス	1,700	7,250.00	12,325,000
プレナス	2,600	1,932.00	5,023,200
ミニストップ	1,700	2,058.00	3,498,600
アークス	4,400	2,765.00	12,166,000
パローホールディングス	5,000	2,988.00	14,940,000
バイテックホールディングス	1,100	2,303.00	2,533,300
東テク	800	2,676.00	2,140,800
ミスミグループ本社	29,200	2,329.00	68,006,800

藤久	1,600	878.00	1,404,800	
ベルク	1,200	5,840.00	7,008,000	
大 庄	1,200	1,689.00	2,026,800	
タキヒヨー	100	1,940.00	194,000	
ファーストリテイリング	3,100	58,270.00	180,637,000	
ソフトバンクグループ	97,300	8,803.00	856,531,900	
蔵王産業	1,000	1,442.00	1,442,000	
スズケン	10,700	5,900.00	63,130,000	
サンドラッグ	8,800	3,875.00	34,100,000	
サックスパー ホールディングス	2,000	1,100.00	2,200,000	
ジェコス	1,600	1,082.00	1,731,200	
やまや	600	2,537.00	1,522,200	
ルネサスイーストン	3,200	433.00	1,385,600	
ペルーナ	5,700	1,195.00	6,811,500	
合計	27,250,800		54,651,417,270	

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。

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	276,927,062
コール・ローン	385,289,854
国債証券	61,070,828,590
地方債証券	8,962,582,824
特殊債券	10,327,688,820
社債券	7,228,130,800
未収利息	227,564,980
前払費用	1,137,409
流動資産合計	88,480,150,339
資産合計	88,480,150,339
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,989,115
その他未払費用	12,309
流動負債合計	3,001,424
負債合計	3,001,424
純資産の部	
元本等	
元本	91,553,091,806
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,075,942,891
純資産合計	88,477,148,915
負債純資産合計	88,480,150,339

## 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、地方債証券、特殊債券及び社債券 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。 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	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	91,553,091,806口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	3,075,942,891円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9664円 (9,664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 2018年2月13日 至 2018年11月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年11月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2018年11月20日現在)	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		683,058,940
地方債証券		47,932,410
特殊債証券		40,211,543
社債証券		37,580,000
合計		808,782,893

## (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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	130,618,054,372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	2,178,212,374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	41,243,174,940円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	90,032,868,109円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,198,123,874円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	6,925,913円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	196,812,753円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	5,784,972円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	13,759,679円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,804,002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)	25,017,328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)	2,688,418円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	7,329,823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)	15,976,935円
計	91,553,091,806円

## 附属明細表(2018年11月20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383回 利付国債(2年)	163,000,000	163,451,510	
	第384回 利付国債(2年)	148,000,000	148,433,640	
	第385回 利付国債(2年)	516,000,000	517,625,400	
	第386回 利付国債(2年)	547,000,000	548,832,450	
	第387回 利付国債(2年)	103,000,000	103,367,710	
	第388回 利付国債(2年)	97,000,000	97,366,660	
	第389回 利付国債(2年)	52,000,000	52,202,800	
	第390回 利付国債(2年)	117,000,000	117,480,870	
	第392回 利付国債(2年)	200,000,000	200,908,000	
	第393回 利付国債(2年)	200,000,000	200,932,000	
	第122回 利付国債(5年)	605,000,000	606,663,750	
	第123回 利付国債(5年)	603,000,000	605,001,960	
	第124回 利付国債(5年)	299,000,000	300,181,050	
	第125回 利付国債(5年)	284,000,000	285,275,160	
	第126回 利付国債(5年)	429,000,000	431,192,190	
	第127回 利付国債(5年)	391,000,000	393,189,600	
	第128回 利付国債(5年)	354,000,000	356,148,780	
	第129回 利付国債(5年)	264,000,000	265,723,920	
	第130回 利付国債(5年)	229,000,000	230,591,550	
	第131回 利付国債(5年)	297,000,000	299,230,470	
	第132回 利付国債(5年)	164,000,000	165,295,600	
	第133回 利付国債(5年)	402,000,000	405,400,920	
	第134回 利付国債(5年)	307,000,000	309,766,070	
	第1回 利付国債(40年)	102,000,000	143,318,160	
	第2回 利付国債(40年)	140,000,000	190,153,600	
	第3回 利付国債(40年)	139,000,000	189,404,180	
	第4回 利付国債(40年)	190,000,000	259,988,400	
	第5回 利付国債(40年)	172,000,000	226,305,560	
	第6回 利付国債(40年)	180,000,000	232,072,200	
	第7回 利付国債(40年)	191,000,000	235,105,720	
	第8回 利付国債(40年)	208,000,000	237,120,000	
	第9回 利付国債(40年)	224,000,000	184,954,560	
	第10回 利付国債(40年)	245,000,000	239,872,150	
	第11回 利付国債(40年)	162,000,000	152,638,020	
	第305回 利付国債(10年)	549,000,000	557,575,380	
	第306回 利付国債(10年)	183,000,000	186,755,160	
	第307回 利付国債(10年)	57,000,000	58,093,830	
	第308回 利付国債(10年)	61,000,000	62,393,850	
	第309回 利付国債(10年)	316,000,000	322,222,040	
	第310回 利付国債(10年)	165,000,000	168,450,150	
	第311回 利付国債(10年)	123,000,000	125,120,520	
	第312回 利付国債(10年)	862,000,000	885,989,460	
	第313回 利付国債(10年)	262,000,000	270,771,760	
	第314回 利付国債(10年)	100,000,000	102,881,000	
	第315回 利付国債(10年)	246,000,000	254,494,380	
	第316回 利付国債(10年)	110,000,000	113,514,500	
	第317回 利付国債(10年)	80,000,000	82,783,200	
	第318回 利付国債(10年)	208,000,000	214,645,600	
	第319回 利付国債(10年)	106,000,000	109,996,200	
	第320回 利付国債(10年)	225,000,000	232,787,250	
	第321回 利付国債(10年)	231,000,000	239,639,400	

第322回	利付国債(10年)	80,000,000	82,724,800
第323回	利付国債(10年)	59,000,000	61,151,140
第324回	利付国債(10年)	194,000,000	200,376,780
第325回	利付国債(10年)	203,000,000	210,145,600
第326回	利付国債(10年)	2,000,000	2,066,800
第327回	利付国債(10年)	49,000,000	50,837,500
第328回	利付国債(10年)	39,000,000	40,203,540
第329回	利付国債(10年)	9,000,000	9,374,670
第330回	利付国債(10年)	3,000,000	3,131,040
第332回	利付国債(10年)	366,000,000	378,982,020
第333回	利付国債(10年)	325,000,000	336,999,000
第334回	利付国債(10年)	328,000,000	340,591,920
第335回	利付国債(10年)	289,000,000	298,817,330
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	54,844,400
第337回	利付国債(10年)	336,000,000	343,590,240
第338回	利付国債(10年)	646,000,000	665,076,380
第339回	利付国債(10年)	685,000,000	705,803,450
第340回	利付国債(10年)	875,000,000	901,985,000
第341回	利付国債(10年)	854,000,000	874,923,000
第342回	利付国債(10年)	878,000,000	886,700,980
第343回	利付国債(10年)	883,000,000	891,379,670
第344回	利付国債(10年)	911,000,000	919,208,110
第345回	利付国債(10年)	532,000,000	536,293,240
第346回	利付国債(10年)	647,000,000	651,567,820
第347回	利付国債(10年)	905,000,000	910,801,050
第348回	利付国債(10年)	819,000,000	823,316,130
第349回	利付国債(10年)	892,000,000	895,621,520
第350回	利付国債(10年)	915,000,000	917,534,550
第351回	利付国債(10年)	665,000,000	665,944,300
第1回	利付国債(30年)	13,000,000	16,653,520
第2回	利付国債(30年)	27,000,000	33,701,670
第3回	利付国債(30年)	28,000,000	34,723,080
第4回	利付国債(30年)	79,000,000	104,111,730
第5回	利付国債(30年)	50,000,000	62,037,000
第6回	利付国債(30年)	69,000,000	87,784,560
第7回	利付国債(30年)	70,000,000	88,557,000
第8回	利付国債(30年)	73,000,000	87,773,740
第9回	利付国債(30年)	66,000,000	75,756,120
第10回	利付国債(30年)	105,000,000	116,138,400
第11回	利付国債(30年)	77,000,000	91,736,260
第12回	利付国債(30年)	53,000,000	66,262,720
第13回	利付国債(30年)	70,000,000	86,605,400
第14回	利付国債(30年)	119,000,000	154,483,420
第15回	利付国債(30年)	127,000,000	167,088,820
第16回	利付国債(30年)	108,000,000	142,400,160
第17回	利付国債(30年)	79,000,000	103,103,690
第18回	利付国債(30年)	97,000,000	125,243,490
第19回	利付国債(30年)	98,000,000	126,751,240
第20回	利付国債(30年)	113,000,000	150,062,870
第21回	利付国債(30年)	112,000,000	145,323,360
第22回	利付国債(30年)	134,000,000	178,438,420
第23回	利付国債(30年)	138,000,000	184,082,340
第24回	利付国債(30年)	114,000,000	152,322,240
第25回	利付国債(30年)	130,000,000	169,360,100
第26回	利付国債(30年)	334,000,000	441,644,860
第27回	利付国債(30年)	323,000,000	433,801,920
第28回	利付国債(30年)	368,000,000	495,519,360
第29回	利付国債(30年)	261,000,000	347,333,580
第30回	利付国債(30年)	281,000,000	369,548,720
第31回	利付国債(30年)	265,000,000	344,462,900

第32回	利付国債(30年)	331,000,000	437,800,460
第33回	利付国債(30年)	367,000,000	464,827,520
第34回	利付国債(30年)	335,000,000	438,799,750
第35回	利付国債(30年)	366,000,000	465,614,220
第36回	利付国債(30年)	374,000,000	476,749,020
第37回	利付国債(30年)	386,000,000	484,557,380
第38回	利付国債(30年)	267,000,000	329,761,020
第39回	利付国債(30年)	244,000,000	307,008,120
第40回	利付国債(30年)	222,000,000	274,527,420
第41回	利付国債(30年)	231,000,000	280,579,530
第42回	利付国債(30年)	245,000,000	297,704,400
第43回	利付国債(30年)	241,000,000	292,964,420
第44回	利付国債(30年)	238,000,000	289,427,040
第45回	利付国債(30年)	267,000,000	312,381,990
第46回	利付国債(30年)	303,000,000	354,519,090
第47回	利付国債(30年)	288,000,000	343,771,200
第48回	利付国債(30年)	277,000,000	317,569,420
第49回	利付国債(30年)	276,000,000	316,378,800
第50回	利付国債(30年)	272,000,000	271,695,360
第51回	利付国債(30年)	174,000,000	152,109,060
第52回	利付国債(30年)	184,000,000	169,695,840
第53回	利付国債(30年)	166,000,000	156,948,020
第54回	利付国債(30年)	272,000,000	270,436,000
第55回	利付国債(30年)	163,000,000	161,870,410
第56回	利付国債(30年)	237,000,000	235,070,820
第57回	利付国債(30年)	265,000,000	262,522,250
第58回	利付国債(30年)	285,000,000	281,984,700
第44回	利付国債(20年)	5,000,000	5,176,000
第45回	利付国債(20年)	5,000,000	5,169,400
第46回	利付国債(20年)	3,000,000	3,111,630
第47回	利付国債(20年)	78,000,000	81,361,020
第48回	利付国債(20年)	66,000,000	69,645,840
第49回	利付国債(20年)	40,000,000	42,090,800
第50回	利付国債(20年)	54,000,000	56,569,860
第52回	利付国債(20年)	4,000,000	4,253,000
第53回	利付国債(20年)	4,000,000	4,274,440
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,071,700
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,151,960
第70回	利付国債(20年)	51,000,000	58,086,450
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	72,151,040
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,780,900
第76回	利付国債(20年)	8,000,000	8,995,680
第78回	利付国債(20年)	8,000,000	9,032,480
第80回	利付国債(20年)	8,000,000	9,138,160
第81回	利付国債(20年)	106,000,000	120,850,600
第82回	利付国債(20年)	126,000,000	144,515,700
第83回	利付国債(20年)	104,000,000	119,800,720
第84回	利付国債(20年)	136,000,000	155,696,880
第85回	利付国債(20年)	112,000,000	129,514,560
第86回	利付国債(20年)	104,000,000	121,791,280
第87回	利付国債(20年)	101,000,000	117,536,730
第88回	利付国債(20年)	220,000,000	258,735,400
第89回	利付国債(20年)	104,000,000	121,521,920
第90回	利付国債(20年)	331,000,000	388,474,840
第91回	利付国債(20年)	209,000,000	246,929,320
第92回	利付国債(20年)	431,000,000	504,123,460
第93回	利付国債(20年)	230,000,000	267,963,800
第94回	利付国債(20年)	332,000,000	389,562,160
第95回	利付国債(20年)	305,000,000	364,392,650
第96回	利付国債(20年)	174,000,000	204,904,140

第97回	利付国債(20年)	236,000,000	280,976,880
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	203,266,160
第99回	利付国債(20年)	387,000,000	458,703,360
第100回	利付国債(20年)	277,000,000	331,821,070
第101回	利付国債(20年)	224,000,000	272,484,800
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	220,914,120
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	204,660,690
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	160,920,000
第105回	利付国債(20年)	252,000,000	301,208,040
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	183,160,000
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	182,243,440
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	238,164,060
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	190,326,150
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	221,271,040
第111回	利付国債(20年)	145,000,000	176,411,350
第112回	利付国債(20年)	203,000,000	244,856,570
第113回	利付国債(20年)	225,000,000	272,047,500
第114回	利付国債(20年)	119,000,000	144,288,690
第115回	利付国債(20年)	66,000,000	80,745,060
第116回	利付国債(20年)	79,000,000	96,927,470
第117回	利付国債(20年)	126,000,000	153,192,060
第118回	利付国債(20年)	96,000,000	115,881,600
第119回	利付国債(20年)	68,000,000	80,539,200
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	102,172,400
第121回	利付国債(20年)	237,000,000	283,888,080
第122回	利付国債(20年)	154,000,000	182,685,580
第123回	利付国債(20年)	253,000,000	309,694,770
第124回	利付国債(20年)	149,000,000	180,632,700
第125回	利付国債(20年)	164,000,000	203,210,760
第126回	利付国債(20年)	147,000,000	178,506,510
第127回	利付国債(20年)	137,000,000	164,719,210
第128回	利付国債(20年)	238,000,000	286,761,440
第129回	利付国債(20年)	138,000,000	164,585,700
第130回	利付国債(20年)	233,000,000	278,241,610
第131回	利付国債(20年)	127,000,000	150,078,440
第132回	利付国債(20年)	169,000,000	200,035,160
第133回	利付国債(20年)	219,000,000	261,991,890
第134回	利付国債(20年)	190,000,000	227,538,300
第135回	利付国債(20年)	120,000,000	142,164,000
第136回	利付国債(20年)	126,000,000	147,650,580
第137回	利付国債(20年)	137,000,000	162,553,240
第138回	利付国債(20年)	145,000,000	168,139,100
第139回	利付国債(20年)	129,000,000	151,273,140
第140回	利付国債(20年)	373,000,000	442,930,040
第141回	利付国債(20年)	274,000,000	325,818,880
第142回	利付国債(20年)	169,000,000	203,244,470
第143回	利付国債(20年)	267,000,000	314,029,380
第144回	利付国債(20年)	173,000,000	201,100,390
第145回	利付国債(20年)	400,000,000	476,552,000
第146回	利付国債(20年)	347,000,000	413,918,950
第147回	利付国債(20年)	385,000,000	453,930,400
第148回	利付国債(20年)	329,000,000	383,196,170
第149回	利付国債(20年)	359,000,000	418,134,480
第150回	利付国債(20年)	361,000,000	415,052,530
第151回	利付国債(20年)	219,000,000	245,098,230
第152回	利付国債(20年)	219,000,000	244,909,890
第153回	利付国債(20年)	287,000,000	325,386,250
第154回	利付国債(20年)	220,000,000	245,812,600
第155回	利付国債(20年)	237,000,000	257,062,050
第156回	利付国債(20年)	210,000,000	206,650,500

	第157回 利付国債（20年）	218,000,000	206,596,420	
	第158回 利付国債（20年）	235,000,000	234,041,200	
	第159回 利付国債（20年）	235,000,000	237,516,850	
	第160回 利付国債（20年）	339,000,000	347,752,980	
	第161回 利付国債（20年）	289,000,000	290,944,970	
	第162回 利付国債（20年）	334,000,000	335,416,160	
	第163回 利付国債（20年）	347,000,000	347,891,790	
	第164回 利付国債（20年）	245,000,000	240,548,350	
国債証券 合計		55,245,000,000	61,070,828,590	
地方債証券	第682回 東京都公募公債	300,000,000	305,267,100	
	第697回 東京都公募公債	200,000,000	205,791,400	
	第707回 東京都公募公債	200,000,000	205,796,000	
	第708回 東京都公募公債	300,000,000	309,582,900	
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	310,295,400	
	平成22年度第12回 北海道公募公債	200,000,000	205,652,200	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	306,921,000	
	第30回 神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,161,100	
	第360回 大阪府公募公債（10年）	300,000,000	309,348,000	
	第378回 大阪府公募公債（10年）	144,000,000	148,757,904	
	第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	113,336,200	
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	310,243,800	
	第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	114,630,300	
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	309,506,100	
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	308,253,000	
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	104,261,800	
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	123,043,620	
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	308,738,700	
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	310,020,000	
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	310,059,000	
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	309,738,300	
	第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,366,000	
	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,875,500	
	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,747,800	
	平成22年度第1回 福島県公募公債	200,000,000	204,266,200	
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	155,582,250	
	第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	95,506,800	
	第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	130,645,300	
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	338,163,000	
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	103,483,100	
	平成22年度第1回 横浜市公募公債	300,000,000	306,195,900	
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	206,255,400	
	第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,919,500	
	平成22年度第7回 札幌市公募公債	200,000,000	203,853,000	
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	155,388,600	
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	153,703,350	
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	205,898,000	
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	103,156,100	
	平成22年度第6回 広島市公募公債	200,000,000	206,191,000	
	平成22年度第1回 相模原市公募公債	100,000,000	102,695,800	
	平成22年度第1回 岡山県公募公債	200,000,000	204,286,400	
地方債証券 合計		8,613,000,000	8,962,582,824	
特殊債券	第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	206,355,000	
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	330,699,600	
	第107回 政保道路機構債券	315,000,000	321,632,325	
	第137回 政保道路機構債券	400,000,000	413,220,000	
	第139回 政保道路機構債券	500,000,000	515,629,500	
	第155回 政保道路機構債券	300,000,000	309,057,300	
	第163回 政保道路機構債券	300,000,000	310,000,800	
	第190回 政保道路機構債券	500,000,000	514,459,500	
	第212回 政保道路機構債券	100,000,000	115,521,300	

第218回	政保道路機構債券	500,000,000	518,410,500		
第233回	政府道路機構債券	100,000,000	112,813,000		
第278回	政保道路機構債券	100,000,000	94,562,000		
第12回	政保地方公共団体金融機構債券	313,000,000	319,497,567		
第12回	地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,173,600		
第25回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,509,200		
第36回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,598,600		
第48回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,570,400		
第48回	地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,977,200		
第72回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,427,800		
第5回	政保阪神高速道路債券	140,000,000	142,570,540		
第35回	日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,591,700		
第133回	住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,035,124,000		
第37回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,316,000	37,608,008		
第42回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	95,230,000	100,677,156		
第46回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	115,647,000	124,204,878		
第54回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	93,350,000	98,941,665		
第55回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	101,214,000	107,043,926		
第60回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	103,056,000	108,888,968		
第61回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,792,000	52,386,163		
第62回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	423,912,000	445,022,817		
第63回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	262,860,000	274,557,270		
第73回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	169,185,000	178,371,745		
第78回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	155,172,000	161,751,292		
第19回	沖縄振興開発金融公庫債券	300,000,000	311,400,600		
い第778号	利付農林債券	300,000,000	301,047,300		
い第779号	利付農林債券	300,000,000	301,134,900		
第333回	利付しんきん中金債券	100,000,000	100,041,200		
第335回	利付しんきん中金債券	100,000,000	100,082,300		
第336回	利付しんきん中金債券	100,000,000	100,080,000		
第4回	広島高速道路債券	200,000,000	206,293,400		
第45回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,288,200		
第55回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,465,600		
特殊債券 合計		9,972,734,000	10,327,688,820		
社債券	第3回	ノルデア・バンク	200,000,000	210,754,200	
	第5回	スヴェンスカ・ハンデルスバンク	200,000,000	203,355,000	
	第16回	中日本高速道路債券	500,000,000	509,485,500	
	第33回	中日本高速道路債券	300,000,000	308,932,500	
	第56回	中日本高速道路債券	200,000,000	206,873,600	
	第60回	中日本高速道路債券	100,000,000	102,622,200	
	第20回	西日本高速道路債券	100,000,000	103,333,500	
	第25回	西日本高速道路債券	200,000,000	205,014,800	
	第26回	西日本高速道路債券	200,000,000	206,251,200	
	第14回	森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,557,600	
	第12回	オリエンタルランド	100,000,000	101,074,900	
	第3回	富士フィルムホールディングス	300,000,000	309,385,800	
	第68回	新日本製鐵	200,000,000	205,834,800	
	第19回	豊田自動織機	200,000,000	205,979,800	
	第24回	豊田自動織機	100,000,000	103,178,200	
	第71回	伊藤忠商事	200,000,000	206,196,000	
	第39回	住友商事	100,000,000	105,331,300	
	第45回	住友商事	100,000,000	103,465,900	
	第46回	住友商事	100,000,000	103,112,000	
	第79回	三菱商事	100,000,000	103,303,300	
第1回	三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	102,675,200		

第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	206,633,800	
第1回 三井住友フィナンシャルグループ 劣後特約付	100,000,000	102,927,400	
第9回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	200,000,000	207,793,800	
第23回 三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	103,296,000	
第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	104,685,500	
第173回 オリックス	100,000,000	101,128,000	
第27回 三菱UFJリース	100,000,000	101,010,100	
第46回 三井不動産	100,000,000	103,331,200	
第111回 三菱地所	100,000,000	103,230,200	
第75回 東京急行電鉄	100,000,000	103,135,100	
第77回 東京急行電鉄	100,000,000	103,966,800	
第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	104,588,800	
第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,393,300	
第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	206,202,400	
第27回 西日本旅客鉄道	100,000,000	102,125,900	
第19回 KDDI	100,000,000	101,756,900	
第483回 関西電力	200,000,000	204,177,200	
第381回 中国電力	200,000,000	208,299,400	
第304回 北陸電力	100,000,000	104,176,700	
第306回 北陸電力	100,000,000	103,741,600	
第253回 四国電力	200,000,000	208,221,400	
第429回 九州電力	200,000,000	207,855,800	
第290回 北海道電力	200,000,000	209,813,600	
第13回 電源開発	100,000,000	111,487,900	
第19回 大阪瓦斯	100,000,000	102,434,700	
社債券 合計	7,000,000,000	7,228,130,800	
合計	80,830,734,000	87,589,231,034	



## 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」-REITインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	112,422,984
コール・ローン	156,414,598
投資証券	17,146,099,070
未収配当金	91,860,624
流動資産合計	17,506,797,276
資産合計	17,506,797,276
負債の部	
流動負債	
未払金	77,893,800
未払解約金	40,589,882
その他未払費用	4,427
流動負債合計	118,488,109
負債合計	118,488,109
純資産の部	
元本等	
元本	11,518,929,567
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,869,379,600
純資産合計	17,388,309,167
負債純資産合計	17,506,797,276

## 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>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. 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>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2018年11月20日現在）
1. 受益権総口数	11,518,929,567口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5095円 (15,095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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年11月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2018年11月20日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	87,179,958
合計	87,179,958

(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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,094,614,072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	3,509,722,093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	3,085,406,598円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,702,001,026円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,029,916,722円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	5,938,188,472円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,915,320,160円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	654,619,964円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	248,488,740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)	16,289,044円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,945,644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)	702,607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)	1,022,448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)	10,434,740円
計	11,518,929,567円

## 附属明細表(2018年11月20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
投資証券	CRE ロジスティクスファンド投資法人	196	20,658,400	
	GLP 投資法人	4,858	560,613,200	
	MCUBS MidCity 投資法人	2,209	194,392,000	
	One リート投資法人	286	73,301,800	
	いちごオフィスリート投資法人	1,626	152,681,400	
	いちごホテルリート投資法人	343	46,236,400	
	さくら総合リート投資法人	424	36,760,800	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	939	442,738,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,911	569,478,000	
	イオンリート投資法人	2,012	255,322,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	11,621	194,884,170	
	インヴィンシブル投資法人	6,861	319,036,500	
	オリックス不動産投資法人	3,906	702,689,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,254	145,213,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	606	442,380,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,163	199,687,100	
	ケネディクス商業リート投資法人	719	176,298,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	748	208,168,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	392	35,280,000	
	ザイマックス・リート投資法人	181	20,597,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,677	451,321,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,756	264,980,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,960	1,209,320,000	
	スターアジア不動産投資法人	609	64,371,300	
	スターツプロシード投資法人	309	52,097,400	
	タカラレーベン不動産投資法人	293	26,135,600	
	トーセイ・リート投資法人	377	41,243,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,585	262,159,000	
	フロンティア不動産投資法人	667	291,145,500	
	プレミアム投資法人	1,864	227,035,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	260	29,198,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	169	18,302,700	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,324	775,293,200	
	ラサールロジポート投資法人	1,479	158,400,900	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	303	27,391,200	
	阪急阪神リート投資法人	813	117,966,300	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	335	112,057,500	
	三菱地所物流リート投資法人	207	52,081,200	
	産業ファンド投資法人	2,284	252,838,800	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	460	62,744,000	
	森トラスト総合リート投資法人	1,401	228,643,200	
	森ヒルズリート投資法人	2,248	309,100,000	
	星野リゾート・リート投資法人	298	160,920,000	
積水ハウス・リート投資法人	5,058	350,013,600		
大江戸温泉リート投資法人	316	27,460,400		
大和ハウスリート投資法人	2,455	609,822,000		
大和証券オフィス投資法人	452	327,700,000		
投資法人みらい	528	96,993,600		

東急リアル・エステート投資法人	1,314	212,211,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	651	345,030,000	
日本ビルファンド投資法人	1,898	1,303,926,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,241	532,389,000	
日本プロロジスリート投資法人	2,630	620,417,000	
日本ヘルスケア投資法人	90	15,408,000	
日本リート投資法人	633	232,944,000	
日本リテールファンド投資法人	3,705	822,510,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,294	292,444,000	
日本賃貸住宅投資法人	2,205	196,024,500	
福岡リート投資法人	1,014	171,366,000	
平和不動産リート投資法人	1,221	138,827,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	5,811	859,446,900	
投資証券 合計	104,449	17,146,099,070	
合計	104,449	17,146,099,070	

## 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)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	465,602,430
金銭信託	1,475,219,625
コール・ローン	2,052,479,632
株式	140,969,194,066
投資証券	3,569,453,040
派生商品評価勘定	15,686,337
未収入金	128,523,528
未収配当金	227,585,194
差入委託証拠金	1,285,508,197
流動資産合計	150,189,252,049
資産合計	150,189,252,049
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	91,327,346
未払金	66,447,914
未払解約金	313,161,773
その他未払費用	53,264
流動負債合計	470,990,297
負債合計	470,990,297
純資産の部	
元本等	
元本	88,596,175,879
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	61,122,085,873
純資産合計	149,718,261,752
負債純資産合計	150,189,252,049

## 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	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	88,596,175,879口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6899円 (16,899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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載し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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	6,309,143,648	
投資証券	237,194,371	
合計	6,071,949,277	

## （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	（2018年11月20日 現在）			評価損益 （円）
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	17,712,427	-	17,725,213	12,786
アメリカ・ドル	17,712,427	-	17,725,213	12,786
買 建	3,104,436,814	-	3,082,215,620	22,221,194
アメリカ・ドル	2,224,128,384	-	2,202,953,420	21,174,964
イギリス・ポンド	261,185,981	-	257,530,400	3,655,581
ユーロ	619,122,449	-	621,731,800	2,609,351
合計	3,122,149,241	-	3,099,940,833	22,233,980

## （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	(2018年11月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028
合計	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028

## (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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	69,768,494,357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	28,563,949,383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	9,736,267,861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)	562,227,597円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,650,340,512円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,084,617,874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)	11,709,845,155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	60,295,944,002円
DCニッセイ外国株式インデックス	10,792,141,547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)	406,450,400円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	13,254,832円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,183,684円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	7,256,656円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	10,766,461円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,134,713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)	14,090,128円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,703,740円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,668,453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)	602,496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)	8,947,629円
計	88,596,175,879円

## 附属明細表（2018年11月20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	21,732	205.58	4,467,664.56	
	ABBOTT LABORATORIES	64,192	70.54	4,528,103.68	
	ABBVIE INC	55,546	89.48	4,970,256.08	
	ABIOMED INC	1,547	299.83	463,837.01	
	ACCENTURE PLC	23,526	162.77	3,829,327.02	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	26,474	49.14	1,300,932.36	
	ACUITY BRANDS INC	1,496	123.78	185,174.88	
	ADOBE INC	18,035	219.69	3,962,109.15	
	ADVANCE AUTO PARTS	2,706	177.75	480,991.50	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	33,714	19.11	644,274.54	
	AERCAP HOLDINGS NV	4,596	50.09	230,213.64	
	AES CORP	24,528	15.38	377,240.64	
	AETNA INC	11,972	207.49	2,484,070.28	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,969	110.10	216,786.90	
	AFLAC INC	28,200	45.37	1,279,434.00	
	AGCO CORP	2,287	57.35	131,159.45	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,681	62.61	731,347.41	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,006	159.89	1,280,079.34	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	6,239	68.27	425,936.53	
	ALBEMARLE CORP	4,047	99.61	403,121.67	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,143	115.06	936,933.58	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	2,787	204.43	569,746.41	
	ALKERMES PLC	5,679	34.03	193,256.37	
	ALLEGHANY CORP	550	626.45	344,547.50	
	ALLEGION PLC	3,467	89.44	310,088.48	
	ALLERGAN PLC	12,408	156.04	1,936,144.32	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,834	192.98	353,925.32	
	ALLIANT ENERGY CORP	8,586	45.38	389,632.68	
	ALLSTATE CORP	12,811	88.45	1,133,132.95	
	ALLY FINANCIAL INC	15,724	24.98	392,785.52	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,311	71.48	236,670.28	
	ALPHABET INC-CL A	10,940	1,027.42	11,239,974.80	
	ALPHABET INC-CL C	11,500	1,020.00	11,730,000.00	
	ALTRIA GROUP INC	69,297	55.68	3,858,456.96	
AMAZON.COM INC	15,106	1,512.29	22,844,652.74		
AMERCO	355	339.61	120,561.55		
AMEREN CORPORATION	8,998	69.74	627,520.52		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,478	35.82	160,401.96		
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	18,128	77.43	1,403,651.04		
AMERICAN EXPRESS CO	26,785	108.25	2,899,476.25		
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,699	103.28	278,752.72		

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,853	43.30	1,422,534.90	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,583	93.49	615,444.67	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,278	125.96	664,816.88	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,030	90.82	547,644.60	
AMERITRADE HOLDING CORP	10,369	52.07	539,913.83	
AMETEK INC	8,423	72.60	611,509.80	
AMGEN INC	24,230	194.91	4,722,669.30	
AMPHENOL CORP-CL A	11,029	86.16	950,258.64	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18,827	55.61	1,046,969.47	
ANALOG DEVICES INC	13,564	85.52	1,159,993.28	
ANSYS INC	3,061	149.71	458,262.31	
ANTERO RESOURCES CORP	7,464	14.14	105,540.96	
ANTHEM INC	9,343	281.79	2,632,763.97	
AON PLC	8,937	165.58	1,479,788.46	
APACHE CORP	13,940	36.53	509,228.20	
APPLE INC	180,015	185.86	33,457,587.90	
APPLIED MATERIALS INC	36,898	34.42	1,270,029.16	
APTIV PLC	9,684	72.24	699,572.16	
ARAMARK	8,985	35.83	321,932.55	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,763	28.25	417,054.75	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,377	46.31	943,658.87	
ARCONIC INC	15,899	20.34	323,385.66	
ARISTA NETWORKS INC	1,912	223.00	426,376.00	
ARROW ELECTRONICS INC	3,174	73.61	233,638.14	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,618	78.32	518,321.76	
ASSURANT INC	1,892	99.37	188,008.04	
AT&T INC	266,374	30.35	8,084,450.90	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5,666	43.69	247,547.54	
ATMOS ENERGY CORP	4,105	99.34	407,790.70	
AUTODESK INC	8,035	125.74	1,010,320.90	
AUTOLIV INC	3,169	85.18	269,935.42	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	16,123	143.44	2,312,683.12	
AUTOZONE INC	978	829.35	811,104.30	
AVERY DENNISON CORP	3,210	92.44	296,732.40	
AVNET INC	4,269	42.91	183,182.79	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	8,116	24.39	197,949.24	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,985	53.62	160,055.70	
BAKER HUGHES A GE CO	15,185	23.00	349,255.00	
BALL CORP	12,137	49.51	600,902.87	
BANK OF AMERICA CORP	352,581	27.75	9,784,122.75	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	36,947	50.12	1,851,783.64	
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,612	65.02	1,210,152.24	
BB&T CORPORATION	28,394	51.64	1,466,266.16	
BECTON DICKINSON & CO	9,788	243.40	2,382,399.20	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	46,820	217.94	10,203,950.80	

BEST BUY CO INC	9,274	62.20	576,842.80	
BIOGEN INC	7,726	319.21	2,466,216.46	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,467	93.71	606,022.57	
BLACKROCK INC	4,389	407.78	1,789,746.42	
BOEING CO	20,269	320.94	6,505,132.86	
BOOKING HOLDINGS INC	1,765	1,780.00	3,141,700.00	
BORGWARNER INC	7,643	39.41	301,210.63	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	50,484	35.29	1,781,580.36	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	3,880	39.59	153,609.20	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	59,838	53.48	3,200,136.24	
BROADCOM INC	15,038	229.13	3,445,656.94	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,302	101.16	435,190.32	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	9,695	47.48	460,318.60	
BUNGE LIMITED	5,143	58.41	300,402.63	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,238	90.57	474,405.66	
CABOT OIL & GAS CORP	16,520	25.80	426,216.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	10,298	42.77	440,445.46	
CAMPBELL SOUP CO	6,584	38.45	253,154.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,795	87.73	1,561,155.35	
CARDINAL HEALTH INC	11,366	54.57	620,242.62	
CARMAX INC	6,535	62.21	406,542.35	
CARNIVAL CORP	15,597	59.05	921,002.85	
CATERPILLAR INC	21,888	125.98	2,757,450.24	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,110	110.92	455,881.20	
CBRE GROUP INC	11,983	43.61	522,578.63	
CBS CORP-CL B	12,640	54.97	694,820.80	
CDK GLOBAL INC	4,601	49.69	228,623.69	
CDW CORP/DE	5,562	87.86	488,677.32	
CELANESE CORP-SERIES A	4,950	101.69	503,365.50	
CELGENE CORP	26,553	69.40	1,842,778.20	
CENTENE CORP	7,508	131.37	986,325.96	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,195	27.97	425,004.15	
CENTURYLINK INC	35,725	19.03	679,846.75	
CERNER CORP	10,924	56.25	614,475.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,524	45.51	387,927.24	
CHARLES SCHWAB CORP	44,448	45.97	2,043,274.56	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	6,109	323.60	1,976,872.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	4,643	111.42	517,323.06	
CHEMOURS CO/THE - W/I	6,503	29.26	190,277.78	
CHENIERE ENERGY INC	7,765	59.71	463,648.15	
CHEVRON CORP	69,961	119.42	8,354,742.62	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	915	465.87	426,271.05	
CHUBB LTD	17,007	134.33	2,284,550.31	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,917	64.82	577,999.94	
CIGNA CORP	8,905	211.19	1,880,646.95	
CIMAREX ENERGY CO	3,485	88.03	306,784.55	

CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,639	80.71	455,123.69	
CINTAS CORP	3,315	179.58	595,307.70	
CISCO SYSTEMS INC	172,317	45.75	7,883,502.75	
CIT GROUP INC	4,169	44.79	186,729.51	
CITIGROUP INC	93,344	64.62	6,031,889.28	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	17,635	35.95	633,978.25	
CITRIX SYSTEMS INC	4,961	107.09	531,273.49	
CLOROX CO	4,730	162.39	768,104.70	
CME GROUP INC	12,449	195.61	2,435,148.89	
CMS ENERGY CORP	10,503	51.66	542,584.98	
COCA-COLA CO	148,052	50.51	7,478,106.52	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,992	48.85	390,409.20	
COGNEX CORP	6,328	40.71	257,612.88	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	21,430	69.21	1,483,170.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,348	62.77	1,904,943.96	
COMCAST CORP	168,392	38.18	6,429,206.56	
COMERICA INC	6,251	80.66	504,205.66	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	7,107	18.14	128,920.98	
CONAGRA BRANDS INC	14,359	33.42	479,877.78	
CONCHO RESOURCES INC	7,308	139.03	1,016,031.24	
CONOCOPHILLIPS	42,763	66.44	2,841,173.72	
CONSOLIDATED EDISON INC	11,454	77.50	887,685.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,155	193.39	1,190,315.45	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,389	47.22	160,028.58	
COOPER COS INC/THE	1,790	256.80	459,672.00	
COPART INC	7,634	48.54	370,554.36	
CORNING INC	30,393	31.16	947,045.88	
COSTAR GROUP INC	1,326	350.09	464,219.34	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,064	228.74	3,674,479.36	
COTY INC-CL A	17,806	9.15	162,924.90	
CROWN HOLDINGS INC	4,954	49.05	242,993.70	
CSX CORP	30,620	72.08	2,207,089.60	
CUMMINS INC	5,707	145.72	831,624.04	
CVS HEALTH CORP	37,220	78.55	2,923,631.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	12,400	8.90	110,360.00	
DANAHER CORP	23,003	101.30	2,330,203.90	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,514	113.46	512,158.44	
DAVITA INC	5,125	60.45	309,806.25	
DEERE & CO	11,283	142.57	1,608,617.31	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	7,286	103.30	752,643.80	
DELTA AIR LINES INC	6,575	56.19	369,449.25	
DENTSPLY SIRONA INC	8,309	36.92	306,768.28	
DEVON ENERGY CORPORATION	19,113	29.62	566,127.06	
DIAMONDBACK ENERGY INC	3,604	113.81	410,171.24	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,769	69.98	893,574.62	
DISCOVERY INC-A	6,004	30.47	182,941.88	
DISCOVERY INC-C	11,006	27.84	306,407.04	

DISH NETWORK CORP	8,500	31.50	267,750.00	
DOLLAR GENERAL CORP	9,791	110.51	1,082,003.41	
DOLLAR TREE INC	8,706	84.03	731,565.18	
DOMINION ENERGY INC	24,013	74.42	1,787,047.46	
DOMINO'S PIZZA INC	1,472	252.07	371,047.04	
DOVER CORP	5,629	86.54	487,133.66	
DOWDUPONT INC	84,945	57.80	4,909,821.00	
DR HORTON INC	13,124	34.96	458,815.04	
DTE ENERGY COMPANY	6,709	119.21	799,779.89	
DUKE ENERGY CORP	25,768	87.64	2,258,307.52	
DXC TECHNOLOGY CO	10,401	59.42	618,027.42	
E*TRADE FINANCIAL	9,634	51.32	494,416.88	
EAST WEST BANCORP INC	5,187	52.61	272,888.07	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,198	81.82	425,300.36	
EATON CORP PLC	15,948	73.48	1,171,859.04	
EATON VANCE CORP	4,298	41.70	179,226.60	
EBAY INC	34,597	27.96	967,332.12	
ECOLAB INC	9,502	160.30	1,523,170.60	
EDISON INTERNATIONAL	11,978	53.91	645,733.98	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,712	149.88	1,155,874.56	
ELECTRONIC ARTS INC	11,229	83.04	932,456.16	
ELI LILLY & CO	35,756	115.81	4,140,902.36	
EMERSON ELECTRIC CO	23,022	68.46	1,576,086.12	
ENTERGY CORP	6,677	86.76	579,296.52	
EOG RESOURCES INC	21,145	105.71	2,235,237.95	
EQUIFAX INC	4,396	101.52	446,281.92	
ESTEE LAUDER COS INC	8,188	142.87	1,169,819.56	
EVEREST RE GROUP LTD	1,484	215.81	320,262.04	
EVERGY INC	10,002	59.85	598,619.70	
EVERSOURCE ENERGY	11,691	67.38	787,739.58	
EXELON CORP	35,477	46.10	1,635,489.70	
EXPEDIA GROUP INC	4,527	113.10	512,003.70	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	6,586	73.67	485,190.62	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	20,558	96.90	1,992,070.20	
EXXON MOBIL CORP	154,993	79.22	12,278,545.46	
F5 NETWORKS INC	2,250	169.54	381,465.00	
FACEBOOK INC-A	87,850	131.55	11,556,667.50	
FASTENAL CO	10,502	57.48	603,654.96	
FEDEX CORP	9,366	226.30	2,119,525.80	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,959	32.32	321,874.88	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	12,099	104.34	1,262,409.66	
FIFTH THIRD BANCORP	24,948	27.37	682,826.76	
FIRST DATA CORP- CLASS A	19,331	16.92	327,080.52	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,888	93.65	551,411.20	
FIRSTENERGY CORP	17,645	38.54	680,038.30	
FISERV INC	14,990	78.56	1,177,614.40	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,279	191.14	626,748.06	
FLEX LTD	19,292	8.06	155,493.52	
FLIR SYSTEMS INC	5,012	45.88	229,950.56	
FLOWSERVE CORP	4,749	48.83	231,893.67	



FLUOR CORP	5,136	43.65	224,186.40	
FMC CORP	4,919	81.90	402,866.10	
FORD MOTOR CO	136,125	9.25	1,259,156.25	
FORTINET INC	5,218	67.78	353,676.04	
FORTIVE CORP	11,447	73.76	844,330.72	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	5,302	42.76	226,713.52	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,692	32.22	376,716.24	
FREEPORT-MCMORAN INC	50,236	11.51	578,216.36	
GAP INC	8,513	25.44	216,570.72	
GARMIN LTD	4,109	64.84	266,427.56	
GARTNER INC	3,345	145.34	486,162.30	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,227	179.38	1,655,139.26	
GENERAL ELECTRIC CO	318,101	7.84	2,493,911.84	
GENERAL MILLS INC	21,698	44.23	959,702.54	
GENERAL MOTORS CO	46,443	35.68	1,657,086.24	
GENUINE PARTS CO	5,358	101.66	544,694.28	
GILEAD SCIENCES INC	47,601	68.01	3,237,344.01	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,836	104.38	609,161.68	
GODADDY INC - CLASS A	5,914	59.25	350,404.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,149	198.22	2,606,394.78	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	8,728	22.35	195,070.80	
H&R BLOCK INC	7,634	27.96	213,446.64	
HALLIBURTON CO	31,986	32.99	1,055,218.14	
HANESBRANDS INC	13,238	14.93	197,643.34	
HARLEY-DAVIDSON INC	6,102	40.19	245,239.38	
HARRIS CORP	4,331	148.10	641,421.10	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	13,020	43.83	570,666.60	
HASBRO INC	4,347	94.89	412,486.83	
HCA HEALTHCARE INC	10,246	135.16	1,384,849.36	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	6,419	37.85	242,959.15	
HELMERICH & PAYNE	3,914	64.36	251,905.04	
HENRY SCHEIN INC	5,633	86.25	485,846.25	
HERSHEY CO/THE	5,172	108.35	560,386.20	
HESS CORP	10,091	56.96	574,783.36	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	55,844	14.83	828,166.52	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,453	71.20	744,253.60	
HOLLYFRONTIER CORP	6,122	62.33	381,584.26	
HOLOGIC INC	9,994	41.57	415,450.58	
HOME DEPOT INC	42,260	173.59	7,335,913.40	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,325	147.47	4,029,617.75	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,600	6.42	286,332.00	
HORMEL FOODS CORP	10,587	45.36	480,226.32	
HP INC	60,100	23.55	1,415,355.00	
HUMANA INC	5,039	310.40	1,564,105.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	40,111	14.84	595,247.24	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,623	211.83	343,800.09	
IAC/INTERACTIVECORP	2,855	167.31	477,670.05	
IDEX CORP	2,783	134.61	374,619.63	
IDEX LABORATORIES INC	3,185	193.52	616,361.20	

IHS MARKIT LTD	14,276	50.60	722,365.60	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	11,151	133.99	1,494,122.49	
ILLUMINA INC	5,382	301.59	1,623,157.38	
INCYTE CORP	6,599	64.25	423,985.75	
INGERSOLL-RAND PLC	9,042	103.26	933,676.92	
INGREDION INC	2,630	104.32	274,361.60	
INTEL CORP	170,631	48.00	8,190,288.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,161	81.39	1,722,293.79	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	33,607	120.31	4,043,258.17	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	3,224	140.59	453,262.16	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,376	46.23	664,602.48	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14,250	23.47	334,447.50	
INTUIT INC	8,918	199.24	1,776,822.32	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,147	482.67	2,001,632.49	
INVESCO LTD	14,933	20.11	300,302.63	
IPG PHOTONICS CORP	1,371	136.13	186,634.23	
IQVIA HOLDINGS INC	5,872	115.44	677,863.68	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,806	135.27	379,567.62	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,624	72.93	337,228.32	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,200	63.69	522,258.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	8,200	35.72	292,904.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,188	143.19	313,299.72	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,350	108.51	363,508.50	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	11,331	21.26	240,897.06	
JM SMUCKER CO	4,144	111.85	463,506.40	
JOHNSON & JOHNSON	98,206	147.73	14,507,972.38	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	33,844	33.45	1,132,081.80	
JONES LANG LASALLE INC	1,697	139.08	236,018.76	
JPMORGAN CHASE & CO	124,641	110.83	13,813,962.03	
JUNIPER NETWORKS INC	12,863	28.06	360,935.78	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,885	98.98	384,537.30	
KELLOGG CO	9,528	61.69	587,782.32	
KEYCORP	38,639	18.26	705,548.14	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,820	55.57	378,987.40	
KIMBERLY-CLARK CORP	12,789	110.45	1,412,545.05	
KINDER MORGAN INC	72,624	17.42	1,265,110.08	
KLA-TENCOR CORP	5,703	92.33	526,557.99	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,125	32.22	165,127.50	
KOHL'S CORP	6,146	71.00	436,366.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	22,295	51.89	1,156,887.55	
KROGER CO	29,743	30.56	908,946.08	
L BRANDS INC	8,690	34.55	300,239.50	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,860	187.50	536,250.00	

LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	3,741	161.70	604,919.70	
LAM RESEARCH CORP	6,004	143.74	863,014.96	
LAS VEGAS SANDS CORP	14,399	50.45	726,429.55	
LEAR CORP	2,410	134.97	325,277.70	
LEGGETT & PLATT INC	4,795	37.48	179,716.60	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,251	63.91	335,591.41	
LENNAR CORP-CL A	10,564	41.47	438,089.08	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,359	216.45	294,155.55	
LIBERTY BROADBAND-C	3,951	81.70	322,796.70	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,196	23.67	170,329.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,022	23.20	464,510.40	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,244	38.76	125,737.44	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,528	38.69	252,568.32	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	7,487	29.87	223,636.69	
LINCOLN NATIONAL CORP	7,919	62.93	498,342.67	
LINDE PLC	20,598	159.50	3,285,381.00	
LIVE NATION INC	5,430	53.03	287,952.90	
LKQ CORP	11,347	27.49	311,929.03	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,420	294.59	2,775,037.80	
LOEWS CORP	9,832	48.45	476,360.40	
LOWE'S COS INC	30,108	91.35	2,750,365.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,725	126.99	473,037.75	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,168	92.78	1,128,947.04	
M&T BANK CORP	5,004	168.58	843,574.32	
MACY'S INC	11,187	33.08	370,065.96	
MANPOWER GROUP	2,379	78.07	185,728.53	
MARATHON OIL CORP	31,025	17.12	531,148.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	25,436	63.41	1,612,896.76	
MARKEL CORP	504	1,113.85	561,380.40	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	10,991	116.50	1,280,451.50	
MARSH & MCLENNAN COS INC	18,534	88.84	1,646,560.56	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,302	185.73	427,550.46	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,439	15.19	340,848.41	
MASCO CORP	11,384	30.78	350,399.52	
MASTERCARD INC-CLASS A	33,953	189.28	6,426,623.84	
MATTEL INC	12,655	13.25	167,678.75	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	10,209	52.00	530,868.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,439	149.15	662,076.85	
MCDONALD'S CORP	28,759	186.72	5,369,880.48	
MCKESSON CORP	7,393	126.19	932,922.67	
MEDTRONIC PLC	49,580	90.37	4,480,544.60	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	9,071	16.34	148,220.14	
MERCADOLIBRE INC	1,538	335.39	515,829.82	

MERCK & CO INC	98,489	76.35	7,519,635.15
METLIFE INC	31,484	43.67	1,374,906.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	929	577.79	536,766.91
MGM MIRAGE	19,338	25.67	496,406.46
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,481	44.60	244,452.60
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,587	73.88	634,407.56
MICRON TECHNOLOGY INC	42,450	36.83	1,563,433.50
MICROSOFT CORP	267,308	104.62	27,965,762.96
MIDDLEBY CORP	2,030	115.95	235,378.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	124.36	288,266.48
MOLSON COORS BREWING CO -B	6,917	66.39	459,219.63
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,988	44.43	2,398,686.84
MONSTER BEVERAGE CORP	15,443	57.04	880,868.72
MOODY'S CORP	6,333	148.19	938,487.27
MORGAN STANLEY	48,644	44.41	2,160,280.04
MOSAIC CO/THE	13,371	34.93	467,049.03
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,985	126.29	755,845.65
MSCI INC	3,268	145.53	475,592.04
MYLAN NV	18,847	34.60	652,106.20
NASDAQ INC	4,247	88.99	377,940.53
NATIONAL-OILWELL INC	13,944	32.81	457,502.64
NEKTAR THERAPEUTICS	6,277	38.01	238,588.77
NETAPP INC	9,800	67.28	659,344.00
NETFLIX INC	15,922	270.60	4,308,493.20
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	17,454	9.59	167,383.86
NEWELL BRANDS INC	17,785	21.42	380,954.70
NEWFIELD EXPLORATION CO	7,279	19.32	140,630.28
NEWMONT MINING CORP	19,379	32.79	635,437.41
NEWS CORP - CLASS A	14,375	13.30	191,187.50
NEXTERA ENERGY INC	17,306	182.01	3,149,865.06
NIelsen HOLDINGS PLC	13,056	25.60	334,233.60
NIKE INC	46,979	72.52	3,406,917.08
NISOURCE INC	13,480	25.93	349,536.40
NOBLE ENERGY INC	17,676	24.94	440,839.44
NORDSTROM INC	4,294	51.26	220,110.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,449	170.53	1,781,867.97
NORTHERN TRUST CORP	7,799	97.60	761,182.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,064	269.26	1,632,792.64
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	7,791	49.27	383,862.57
NUCOR CORP	11,543	62.14	717,282.02
NVIDIA CORP	21,116	144.70	3,055,485.20
NVR INC	127	2,435.33	309,286.91
NXP SEMICONDUCTORS NV	12,598	81.36	1,024,973.28
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,003	354.24	1,063,782.72
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	27,960	73.36	2,051,145.60
OGE ENERGY CORP	7,375	39.51	291,386.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,326	134.31	312,405.06
OMNICOM GROUP	8,414	76.85	646,615.90

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	15,598	17.61	274,680.78	
ONEOK INC	15,045	62.28	937,002.60	
ORACLE CORP	112,105	49.55	5,554,802.75	
OWENS CORNING	4,024	48.95	196,974.80	
PACCAR INC	12,821	60.49	775,542.29	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,439	96.84	333,032.76	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,373	163.44	551,283.12	
PARKER HANNIFIN CORP	4,856	167.57	813,719.92	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,018	21.44	193,345.92	
PAYCHEX INC	11,795	68.41	806,895.95	
PAYPAL HOLDINGS INC	41,302	80.13	3,309,529.26	
PENTAIR PLC	6,139	41.99	257,776.61	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	12,025	16.07	193,241.75	
PEPSICO INC	51,946	119.01	6,182,093.46	
PERRIGO CO PLC	4,797	62.79	301,203.63	
PFIZER INC	214,121	44.18	9,459,865.78	
PG&E CORP	18,951	23.26	440,800.26	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	56,946	87.63	4,990,177.98	
PHILLIPS 66	16,202	94.90	1,537,569.80	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,149	88.87	368,721.63	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,220	157.18	977,659.60	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	5,441	20.49	111,486.09	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,143	135.30	2,319,447.90	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,192	92.49	202,738.08	
PPG INDUSTRIES INC	9,118	107.70	982,008.60	
PPL CORPORATION	25,753	31.44	809,674.32	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,392	49.02	509,415.84	
PROCTER & GAMBLE CO	92,033	93.29	8,585,758.57	
PROGRESSIVE CORP	21,278	65.01	1,383,282.78	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,300	91.65	1,402,245.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,565	54.56	1,012,906.40	
PULTE GROUP INC	9,949	25.22	250,913.78	
PVH CORP	2,818	110.90	312,516.20	
QORVO INC	4,624	63.15	292,005.60	
QUALCOMM INC	51,504	54.90	2,827,569.60	
QUEST DIAGNOSTICS	4,959	94.26	467,435.34	
QURATE RETAIL INC	16,089	22.73	365,702.97	
RALPH LAUREN CORP	2,033	113.44	230,623.52	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,772	77.91	371,786.52	
RAYTHEON CO	10,511	176.44	1,854,560.84	
RED HAT INC	6,500	173.36	1,126,840.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,908	338.99	985,782.92	
REGIONS FINANCIAL CORP	40,770	16.13	657,620.10	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,327	150.24	349,608.48	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,446	125.89	182,036.94	
REPUBLIC SERVICES INC	8,372	76.51	640,541.72	
RESMED INC	5,215	102.57	534,902.55	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	4,491	60.52	271,795.32	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,581	168.04	769,791.24	
ROCKWELL COLLINS INC.	5,994	130.40	781,617.60	
ROLLINS INC	3,528	61.37	216,513.36	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,763	294.03	1,106,434.89	
ROSS STORES INC	13,849	91.19	1,262,890.31	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,184	107.02	661,811.68	
S&P GLOBAL INC	9,213	177.28	1,633,280.64	
SABRE CORP	9,604	24.07	231,168.28	
SALESFORCE.COM INC	25,819	121.01	3,124,357.19	
SCANA CORP	4,999	43.71	218,506.29	
SCHLUMBERGER LTD	50,711	48.31	2,449,848.41	
SEAGATE TECHNOLOGY	9,978	42.06	419,674.68	
SEALED AIR CORP	5,951	36.40	216,616.40	
SEATTLE GENETICS INC	4,044	57.06	230,750.64	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,865	53.42	259,888.30	
SEMPRA ENERGY	9,229	115.24	1,063,549.96	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,240	46.30	288,912.00	
SERVICENOW INC	6,476	156.80	1,015,436.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,087	415.26	1,281,907.62	
SIGNATURE BANK	1,995	117.09	233,594.55	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	58,603	6.05	354,548.15	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,652	70.76	470,695.52	
SMITH (A.O.) CORP	5,248	45.64	239,518.72	
SNAP-ON INC	2,052	164.43	337,410.36	
SOUTHERN CO	37,247	47.04	1,752,098.88	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,455	52.39	285,787.45	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	4,140	81.81	338,693.40	
SPLUNK INC	5,312	89.27	474,202.24	
SPRINT CORP	30,183	6.19	186,832.77	
SQUARE INC - A	10,618	62.97	668,615.46	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,826	45.30	354,517.80	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,629	126.87	714,151.23	
STARBUCKS CORP	50,518	67.91	3,430,677.38	
STATE STREET CORP	13,349	71.77	958,057.73	
STEEL DYNAMICS INC	8,542	39.75	339,544.50	
STERICYCLE INC	3,122	46.19	144,205.18	
STRYKER CORP	12,308	167.72	2,064,297.76	
SUNTRUST BANKS INC	16,920	63.09	1,067,482.80	
SVB FINANCIAL GROUP	1,930	240.34	463,856.20	
SYMANTEC CORP	22,738	22.26	506,147.88	
SYNCHRONY FINANCIAL	26,222	25.53	669,447.66	
SYNOPSYS INC	5,423	85.71	464,805.33	
SYSCO CORP	18,112	66.02	1,195,754.24	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,830	94.96	838,496.80	
T-MOBILE US INC	12,562	68.00	854,216.00	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,181	106.00	443,186.00	
TAPESTRY INC	10,529	39.14	412,105.06	
TARGA RESOURCES CORP	7,984	47.25	377,244.00	
TARGET CORP	18,534	77.79	1,441,759.86	
TE CONNECTIVITY LTD	12,797	74.62	954,912.14	
TECHNIPFMC PLC	15,968	24.27	387,543.36	
TELEFLEX INC	1,664	253.07	421,108.48	
TESLA, INC.	4,668	353.47	1,649,997.96	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	35,399	22.00	778,778.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	35,828	94.62	3,390,045.36	
TEXTRON INC	9,329	55.81	520,651.49	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,726	232.88	3,429,390.88	
TIFFANY & CO	4,086	102.48	418,733.28	
TJX COS INC	45,880	48.96	2,246,284.80	
TOLL BROTHERS INC	5,272	31.07	163,801.04	
TORCHMARK CORP	3,874	86.99	336,999.26	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5,997	84.45	506,446.65	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,462	92.26	411,664.12	
TRANSDIGM GROUP INC	1,731	337.87	584,852.97	
TRANSUNION	6,720	61.30	411,936.00	
TRAVELERS COS INC/THE	9,867	130.52	1,287,840.84	
TRIMBLE INC	9,093	34.97	317,982.21	
TRIPADVISOR INC	3,873	60.87	235,749.51	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	16,082	48.54	780,620.28	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	38,714	48.91	1,893,501.74	
TWITTER INC	24,810	31.98	793,423.80	
TYSON FOODS INC-CL A	10,863	59.42	645,479.46	
UGI CORP	6,400	57.23	366,272.00	
ULTA BEAUTY INC	2,105	313.28	659,454.40	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,001	21.14	148,001.14	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	6,782	19.42	131,706.44	
UNION PACIFIC CORP	28,550	150.64	4,300,772.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,603	92.09	239,710.27	
UNITED PARCEL SERVICE INC	25,407	111.29	2,827,545.03	
UNITED RENTALS INC	3,058	112.54	344,147.32	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	27,805	127.85	3,554,869.25	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,579	116.52	183,985.08	
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,192	266.05	9,362,831.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3,187	131.10	417,815.70	
UNUM GROUP	7,993	35.41	283,032.13	
US BANCORP	56,983	55.00	3,134,065.00	
VAIL RESORTS INC	1,473	262.39	386,500.47	
VALERO ENERGY CORP	15,765	80.69	1,272,077.85	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,338	115.36	385,071.68	

VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	4,401	84.76	373,028.76	
VERISIGN INC	4,072	149.20	607,542.40	
VERISK ANALYTICS INC	5,736	122.50	702,660.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	151,593	60.62	9,189,567.66	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,335	161.07	1,503,588.45	
VF CORP	12,275	80.01	982,122.75	
VIACOM INC-CLASS B	13,021	31.42	409,119.82	
VISA INC-CLASS A SHARES	65,419	134.76	8,815,864.44	
VISTRA ENERGY CORP	12,494	23.55	294,233.70	
VMWARE INC-CLASS A	2,694	153.40	413,259.60	
VOYA FINANCIAL INC	6,143	43.43	266,790.49	
VULCAN MATERIALS CO	4,843	103.90	503,187.70	
WABCO HOLDINGS INC	1,943	117.06	227,447.58	
WABTEC CORP	3,154	87.31	275,375.74	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,849	81.92	2,527,150.08	
WALMART INC	54,037	96.78	5,229,700.86	
WALT DISNEY CO	54,532	115.42	6,294,083.44	
WASTE CONNECTIONS INC	9,579	76.67	734,421.93	
WASTE MANAGEMENT INC	15,819	92.65	1,465,630.35	
WATERS CORP	2,861	197.77	565,819.97	
WEC ENERGY GROUP INC	11,636	71.60	833,137.60	
WELLS FARGO & CO	169,472	53.32	9,036,247.04	
WESTERN DIGITAL CORP	10,950	45.11	493,954.50	
WESTERN UNION CO	16,787	18.71	314,084.77	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,395	69.69	97,217.55	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	9,352	46.07	430,846.64	
WEYERHAEUSER CO	28,002	27.09	758,574.18	
WHIRLPOOL CORP	2,360	118.60	279,896.00	
WILLIAMS COS INC	44,304	25.33	1,122,220.32	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,801	160.26	769,408.26	
WORKDAY INC-CLASS A	5,356	124.07	664,518.92	
WORLDPAY INC	10,886	78.45	854,006.70	
WR BERKLEY CORP	3,491	78.54	274,183.14	
WW GRAINGER INC	1,741	305.10	531,179.10	
WYNN RESORTS LTD	3,584	104.22	373,524.48	
XCEL ENERGY INC	18,772	51.62	969,010.64	
XEROX CORP	8,365	26.53	221,923.45	
XILINX INC	9,264	87.92	814,490.88	
XPO LOGISTICS INC	4,492	73.70	331,060.40	
XYLEM INC	6,553	69.45	455,105.85	
YUM! BRANDS INC	11,839	88.13	1,043,371.07	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8,053	26.00	209,378.00	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	4,272	27.16	116,027.52	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,438	113.50	844,213.00	
ZIONS BANCORP, N.A.	7,079	48.50	343,331.50	
ZOETIS INC	17,714	90.10	1,596,031.40	
アメリカ・ドル 小計	11,226,152		850,286,215.54 (95,801,747,905)	



イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	34,875	8.09	282,348.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,274	19.89	144,716.23	
	ANGLO AMERICAN PLC	38,261	17.24	659,619.64	
	ANTOFAGASTA PLC	13,961	8.13	113,614.61	
	ASHTREAD GROUP PLC	17,942	17.98	322,597.16	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,008	24.80	322,598.40	
	ASTRAZENECA PLC	46,388	61.74	2,863,995.12	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	34,999	4.27	149,515.72	
	AVIVA PLC	146,019	4.16	608,023.11	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	9,069	5.88	53,398.27	
	BAE SYSTEMS PLC	116,694	5.19	606,342.02	
	BARCLAYS PLC	626,439	1.66	1,039,888.74	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	36,828	4.91	181,156.93	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	4,621	33.71	155,773.91	
	BHP GROUP PLC	77,081	16.23	1,251,178.79	
	BP PLC	730,531	5.22	3,818,485.53	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,027	27.22	2,287,214.94	
	BT GROUP PLC	311,645	2.56	797,811.20	
	BUNZL PLC	12,286	22.94	281,840.84	
	BURBERRY GROUP PLC	15,322	17.82	273,038.04	
	CARNIVAL PLC	6,591	44.78	295,144.98	
	CENTRICA PLC	207,447	1.42	294,989.63	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	7,398	22.85	169,044.30	
	COMPASS GROUP PLC	58,054	15.87	921,607.25	
	CONVATEC GROUP PLC	50,407	1.61	81,356.89	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,822	48.25	232,661.50	
	DCC PLC	3,274	57.95	189,728.30	
	DIAGEO PLC	90,167	27.85	2,511,601.78	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,702	3.17	157,853.55	
	EASYJET PLC	6,165	11.75	72,438.75	
	EXPERIAN PLC	33,634	18.45	620,547.30	
	FERGUSON PLC	8,483	48.90	414,818.70	
	FRESNILLO PLC	7,896	8.94	70,606.03	
	G4S PLC	56,981	1.83	104,446.17	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	181,688	15.68	2,849,957.96	
	GLENCORE PLC	421,271	3.00	1,266,340.62	
	GVC HOLDINGS PLC	19,975	7.80	155,805.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,379	18.29	189,831.91	
	HSBC HOLDINGS PLC	733,876	6.51	4,780,468.26	
	IMPERIAL BRANDS PLC	34,962	25.60	895,202.01	
	INFORMA PLC	46,603	7.32	341,227.16	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,650	41.53	276,174.50	
INTERTEK GROUP PLC	5,904	45.16	266,624.64		
INVESTEC PLC	24,552	5.00	122,956.41		
ITV PLC	134,853	1.46	197,020.23		
JOHNSON MATTHEY PLC	7,080	28.77	203,691.60		
KINGFISHER PLC	78,195	2.45	191,577.75		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	216,683	2.46	533,473.54		

LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,640,131	0.55	1,473,193.09	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,467	40.56	465,101.52	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	59,147	2.94	174,010.47	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	13,544	3.31	44,938.99	
MEGGITT PLC	28,054	5.14	144,253.66	
MELROSE INDUSTRIES PLC	177,330	1.70	301,992.99	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	26,080	3.34	87,107.20	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,940	14.71	234,477.40	
MONDI PLC/WI	13,406	17.63	236,347.78	
MORRISON WM SUPERMARKETS	81,342	2.44	199,206.55	
NATIONAL GRID PLC	123,917	8.25	1,023,430.50	
NEXT PLC	5,158	51.62	266,255.96	
NMC HEALTH PLC	3,828	35.30	135,128.40	
PEARSON PLC	28,848	9.42	271,748.16	
PERSIMMON PLC	11,328	21.06	238,567.68	
PRUDENTIAL PLC	94,848	15.66	1,485,793.92	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,423	64.06	219,277.38	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,515	64.67	1,585,385.05	
RELX PLC	73,429	16.18	1,188,448.36	
RIO TINTO PLC	43,265	38.89	1,682,575.85	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	61,301	7.96	488,446.36	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT	2,757,700	0.00	2,757.70	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	175,545	2.17	381,283.74	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	168,218	23.94	4,027,980.01	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	137,248	24.36	3,343,361.28	
ROYAL MAIL PLC	34,488	3.08	106,464.45	
RSA INSURANCE GROUP PLC	37,170	5.37	199,602.90	
SAGE GROUP PLC	39,754	5.50	218,965.03	
SAINSBURY (J) PLC	63,861	3.06	195,989.40	
SCHRODERS PLC	4,413	24.88	109,795.44	
SEVERN TRENT PLC	8,947	18.54	165,922.11	
SHIRE PLC	33,466	46.00	1,539,436.00	
SMITH & NEPHEW PLC	32,015	13.91	445,328.65	
SMITHS GROUP PLC	14,401	14.15	203,846.15	
SSE PLC	37,812	11.06	418,389.78	
ST JAMES'S PLACE PLC	19,419	10.08	195,840.61	
STANDARD CHARTERED PLC	102,810	5.97	614,186.94	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	85,383	2.56	219,263.54	
TAYLOR WIMPEY PLC	118,991	1.48	176,225.67	
TESCO PLC	358,121	2.05	735,580.53	
TRAVIS PERKINS PLC	9,009	10.16	91,576.48	
TUI AG-DI	15,899	12.67	201,440.33	
UNILEVER PLC	44,734	42.61	1,906,115.74	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,822	7.44	192,322.25	
	VODAFONE GROUP PLC	984,730	1.55	1,534,209.34	
	WEIR GROUP PLC/THE	8,795	15.02	132,100.90	
	WHITBREAD PLC	6,675	45.59	304,313.25	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	24,820	6.42	159,443.68	
	WPP PLC	46,555	8.56	398,697.02	
イギリス・ポンド 小計		13,828,064		64,786,480.11 (9,381,730,185)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	1,609	192.40	309,571.60	
	BANK HAPOLIM BM	38,099	26.50	1,009,623.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,987	24.30	1,263,284.10	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	79,214	4.66	369,295.66	
	ELBIT SYSTEMS LTD	834	439.20	366,292.80	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	25,236	22.82	575,885.52	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,825	66.97	323,130.25	
	NICE LTD	2,220	419.00	930,180.00	
イスラエル・シュケル 小計		204,024		5,147,263.43 (156,631,226)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	25,393	18.40	467,231.20	
	ALUMINA LTD	93,622	2.32	217,203.04	
	AMCOR LTD	45,229	13.49	610,139.21	
	AMP LTD	112,760	2.58	290,920.80	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	21,754	25.82	561,688.28	
	ASX LTD	7,806	60.98	476,009.88	
	AURIZON HOLDINGS LTD	84,614	4.14	350,301.96	
	AUSNET SERVICES	94,101	1.60	150,561.60	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	107,858	25.16	2,713,707.28	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	17,081	9.72	166,027.32	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,143	10.11	203,645.73	
	BHP GROUP LIMITED	118,818	32.40	3,849,703.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,755	12.86	266,909.30	
	BORAL LTD	45,559	5.30	241,462.70	
	BRAMBLES LTD	60,981	10.26	625,665.06	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	10,335	26.40	272,844.00	
	CHALLENGER LTD	22,237	9.67	215,031.79	
	CIMIC GROUP LIMITED	3,907	43.03	168,118.21	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	21,238	10.17	215,990.46	
	COCHLEAR LTD	2,237	156.03	349,039.11	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	65,283	68.50	4,471,885.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	18,107	19.29	349,284.03	
	CROWN RESORTS LTD	15,485	11.70	181,174.50	
	CSL LIMITED	16,663	182.30	3,037,664.90	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,369	47.92	113,522.48		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,237	46.07	103,058.59		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	60,016	4.05	243,064.80		

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,466	3.15	73,917.90	
	HEALTHSCOPE LTD	69,305	2.35	162,866.75	
	INCITEC PIVOT LTD	67,047	3.90	261,483.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	89,097	7.07	629,915.79	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,356	16.04	278,390.24	
	MACQUARIE GROUP LTD	12,195	116.23	1,417,424.85	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	109,095	2.60	283,647.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	101,773	23.58	2,399,807.34	
	NEWCREST MINING LIMITED	29,075	20.59	598,654.25	
	OIL SEARCH LTD	52,536	7.46	391,918.56	
	ORICA LTD	15,006	17.58	263,805.48	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	66,703	6.86	457,582.58	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	52,150	11.35	591,902.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	5,592	54.33	303,813.36	
	REA GROUP LTD	2,212	74.20	164,130.40	
	RIO TINTO LTD	15,493	79.44	1,230,763.92	
	SANTOS LTD	66,436	6.10	405,259.60	
	SEEK LTD	13,508	17.66	238,551.28	
	SONIC HEALTHCARE LTD	16,036	21.71	348,141.56	
	SOUTH32 LTD	190,957	3.31	632,067.67	
	SUNCORP GROUP LTD	51,044	13.42	685,010.48	
	TABCORP HOLDINGS LTD	73,524	4.51	331,593.24	
	TELSTRA CORP LTD	163,109	3.03	494,220.27	
	TPG TELECOM LTD	16,244	7.34	119,230.96	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,214	14.34	390,248.76	
	WESFARMERS LIMITED	42,140	43.86	1,848,260.40	
	WESTPAC BANKING CORP	127,428	25.12	3,200,991.36	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,936	32.55	1,137,166.80	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	49,479	28.65	1,417,573.35	
	オーストラリア・ドル 小計	2,716,744		41,670,194.88 (3,426,540,125)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,541	47.08	402,110.28	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	15,867	65.14	1,033,576.38	
	ALTAGAS LTD	9,774	15.80	154,429.20	
	ARC RESOURCES LTD	12,857	10.91	140,269.87	
	ATCO LTD -CL 'I'	3,146	40.26	126,657.96	
	AURORA CANNABIS INC	23,953	8.02	192,103.06	
	BANK OF MONTREAL	23,416	98.01	2,295,002.16	
	BANK OF NOVA SCOTIA	43,830	70.76	3,101,410.80	
	BARRICK GOLD CORP	42,617	17.26	735,569.42	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	11,527	30.98	357,106.46	
	BCE INC	6,299	55.70	350,854.30	
	BLACKBERRY LTD	18,693	11.32	211,604.76	
	BOMBARDIER INC	77,085	2.07	159,565.95	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	31,146	57.59	1,793,698.14	
	CAE INC	9,766	26.31	256,943.46	
	CAMECO CORP	14,440	16.14	233,061.60	

CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	16,254	113.56	1,845,804.24	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	27,265	113.70	3,100,030.50	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	45,035	35.86	1,614,955.10	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,355	275.39	1,474,713.45	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,297	152.60	350,522.20	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,195	31.55	163,902.25	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,484	52.47	287,745.48	
CENOVUS ENERGY INC	38,238	10.60	405,322.80	
CGI GROUP INC	9,393	80.68	757,827.24	
CI FINANCIAL CORP	9,844	19.65	193,434.60	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	739	894.21	660,821.19	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	19,967	4.96	99,036.32	
DOLLARAMA INC	11,477	34.60	397,104.20	
EMERA INC	2,653	43.99	116,705.47	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,376	24.76	157,869.76	
ENBRIDGE INC	62,490	43.79	2,736,437.10	
ENCANA CORP	35,360	10.05	355,368.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,022	605.50	618,821.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	6,193	26.81	166,034.33	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,713	19.61	151,251.93	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	25,130	12.38	311,109.40	
FORTIS INC	15,988	46.02	735,767.76	
FRANCO-NEVADA CORP	6,805	88.81	604,352.05	
GEORGE WESTON LTD	2,846	94.66	269,402.36	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,892	41.20	325,150.40	
GOLDCORP INC	31,720	12.51	396,817.20	
GREAT-WEST LIFECO INC	10,769	30.74	331,039.06	
HUSKY ENERGY INC	12,837	16.87	216,560.19	
HYDRO ONE LTD	12,773	19.46	248,562.58	
IGM FINANCIAL INC	3,235	33.40	108,049.00	
IMPERIAL OIL LTD	10,601	41.52	440,153.52	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,971	48.64	193,149.44	
INTACT FINANCIAL CORP	5,120	103.21	528,435.20	
INTER PIPELINE LTD	14,100	22.78	321,198.00	
KEYERA CORP	7,560	29.52	223,171.20	
KINROSS GOLD CORP	45,418	3.40	154,421.20	
LINAMAR CORP	1,652	48.99	80,931.48	
LOBLAW COS LTD	6,960	58.79	409,178.40	
LUNDIN MINING CORP	23,557	5.39	126,972.23	
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,302	66.28	815,376.56	
MANULIFE FINANCIAL CORP	72,585	21.77	1,580,175.45	
METHANEX CORP	2,407	76.39	183,870.73	
METRO INC	8,903	43.14	384,075.42	

	NATIONAL BANK OF CANADA	12,498	60.34	754,129.32	
	NUTRIEN LTD	23,232	68.89	1,600,452.48	
	ONEX CORPORATION	3,285	83.49	274,264.65	
	OPEN TEXT CORP	9,838	42.88	421,853.44	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,492	44.81	828,626.52	
	POWER CORP OF CANADA	13,018	26.96	350,965.28	
	POWER FINANCIAL CORP	9,132	28.33	258,709.56	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,656	18.72	143,320.32	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	8,730	70.84	618,433.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	13,699	70.25	962,354.75	
	ROYAL BANK OF CANADA	52,773	94.82	5,003,935.86	
	SAPUTO INC	8,566	39.38	337,329.08	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	9,858	11.98	118,098.84	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,179	25.21	433,082.59	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,235	176.33	570,427.55	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	6,446	47.11	303,671.06	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	22,241	48.44	1,077,354.04	
	SUNCOR ENERGY INC	59,822	43.18	2,583,113.96	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	18,516	28.31	524,187.96	
	THOMSON REUTERS CORP	10,528	63.84	672,107.52	
	TORONTO-DOMINION BANK	67,578	71.71	4,846,018.38	
	TOURMALINE OIL CORP	9,422	20.01	188,534.22	
	TRANSCANADA CORP	32,806	53.22	1,745,935.32	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	35,503	2.46	87,337.38	
	VERMILION ENERGY INC	5,252	33.59	176,414.68	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,183	70.51	153,923.33	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,123	21.09	340,034.07	
	WSP GLOBAL INC	3,795	64.67	245,422.65	
	カナダ・ドル 小計	1,517,844		61,805,627.80 (5,285,617,289)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	98,600	3.14	309,604.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	15,600	8.35	130,260.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	84,300	2.15	181,245.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,100	23.20	1,510,320.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	217,100	0.94	204,074.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	223,700	0.23	52,569.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,500	34.98	122,430.00	
	KEPPEL CORP LTD	52,400	6.29	329,596.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	113,900	11.09	1,263,151.00	
	SATS LTD	28,400	4.85	137,740.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	35,700	2.69	96,033.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	20,700	9.40	194,580.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,100	7.25	203,725.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	60,400	2.67	161,268.00	

	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	54,500	3.50	190,750.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	306,000	3.08	942,480.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	48,400	24.25	1,173,700.00	
	UOL Group Limited	19,300	6.17	119,081.00	
	VENTURE CORP LTD	9,800	14.95	146,510.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	67,700	3.25	220,025.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	81,100	1.27	102,997.00	
	シンガポール・ドル 小計	1,634,300		7,792,138.50 (640,280,021)	
スイス・フラン	ABB LTD	67,443	19.87	1,340,429.62	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,905	47.53	280,664.65	
	BALOISE HOLDING AG	1,757	145.30	255,292.10	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	82	1,725.00	141,450.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	39	6,955.00	271,245.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	79,600.00	238,800.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,156	65.92	1,262,763.52	
	CLARIANT AG	7,310	20.86	152,486.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	93,867	12.32	1,156,441.44	
	DUFREY AG-REG	1,199	102.90	123,377.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	299	541.00	161,759.00	
	GEBERIT AG-REG	1,356	377.40	511,754.40	
	GIVAUDAN-REG	338	2,419.00	817,622.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,283	43.53	360,558.99	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,174	130.00	282,620.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,808	45.73	814,359.84	
	LONZA GROUP AG	2,729	299.80	818,154.20	
	NESTLE SA	114,012	83.30	9,497,199.60	
	NOVARTIS AG	79,392	87.28	6,929,333.76	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,392	70.40	97,996.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	636	671.50	427,074.00	
	ROCHE HOLDING AG	25,733	246.50	6,343,184.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	696	193.00	134,328.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,516	198.40	300,774.40	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	196	2,273.00	445,508.00	
	SIKA AG-BEARER	4,750	124.20	589,950.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,037	150.00	305,550.00	
	STRAUMANN HOLDING AG	379	631.50	239,338.50	
	SWATCH GROUP AG	1,195	305.10	364,594.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,235	381.90	471,646.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,871	81.40	233,699.40	
	SWISS RE AG	11,455	88.52	1,013,996.60	
	SWISSCOM AG	999	461.80	461,338.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,221	123.50	274,293.50	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,639	59.70	97,848.30	
	UBS GROUP AG	141,418	13.57	1,919,749.35	
	VIFOR PHARMA AG	1,662	127.75	212,320.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,531	305.20	1,688,061.20	
スイス・フラン	小計	630,713		41,037,564.07 (4,654,480,517)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	10,864	198.00	2,151,072.00	
	ASSA ABLOY AB	36,921	171.50	6,331,951.50	
	ATLAS COPCO AB	14,226	191.76	2,727,977.76	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	24,773	205.25	5,084,658.25	
	BOLIDEN AB	9,850	204.55	2,014,817.50	
	ELECTROLUX AB	8,933	189.35	1,691,463.55	
	EPIROC AB-A	24,732	78.84	1,949,870.88	
	EPIROC AB-B	14,359	75.73	1,087,407.07	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	22,336	220.40	4,922,854.40	
	HENNES & MAURITZ AB	32,208	160.52	5,170,028.16	
	HEXAGON AB-B SHS	9,568	423.30	4,050,134.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,550	67.26	1,045,893.00	
	ICA GRUPPEN AB	2,966	326.70	968,992.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,379	182.00	1,160,978.00	
	INVESTOR AB	16,811	382.20	6,425,164.20	
	KINNEVIK AB - B	8,624	235.60	2,031,814.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,863	270.20	773,582.60	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,988	241.00	1,684,108.00	
	NORDEA BANK ABP	111,966	81.24	9,096,117.84	
	SANDVIK AB	41,525	133.55	5,545,663.75	
	SECURITAS AB	11,744	153.00	1,796,832.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	60,263	93.36	5,626,153.68	
	SKANSKA AB-B SHS	12,566	142.90	1,795,681.40	
	SKF AB	13,963	138.05	1,927,592.15	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	56,588	97.00	5,489,036.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	33,608	206.10	6,926,608.80	
	SWEDISH MATCH AB	6,551	403.60	2,643,983.60	
	TELE2 AB	13,915	107.60	1,497,254.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	113,031	75.92	8,581,313.52	
	TELIA CO AB	106,630	41.05	4,377,161.50	
	VOLVO AB	57,507	125.10	7,194,125.70	
スウェーデン・クローナ	小計	908,808		113,770,291.81 (1,423,266,350)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	241	8,798.00	2,120,318.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	141	8,200.00	1,156,200.00	
	CARLSBERG AS-B	3,903	731.60	2,855,434.80	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,625	626.40	2,270,700.00	
	COLOPLAST-B	4,334	616.00	2,669,744.00	
	DANSKE BANK A/S	26,168	135.45	3,544,455.60	
	DSV A/S	7,040	505.60	3,559,424.00	
	GENMAB A/S	2,250	928.00	2,088,000.00	
	H LUNDBECK A/S	2,510	276.90	695,019.00	
	ISS A/S	6,092	221.70	1,350,596.40	
	NOVO-NORDISK A/S	66,507	295.15	19,629,541.05	
	NOVOZYMES A/S	7,982	318.50	2,542,267.00	



	ORSTED A/S	6,921	446.60	3,090,918.60	
	PANDORA A/S	4,028	343.20	1,382,409.60	
	TRYGVESTA AS	4,140	161.70	669,438.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,140	457.40	3,265,836.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,660	196.70	719,922.00	
デンマーク・クローネ 小計		156,682		53,610,224.05 (926,384,672)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	26,729	10.47	279,852.63	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	39,323	7.10	279,193.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,920	12.97	271,332.40	
	FLETCHER BUILDING LTD	31,136	5.55	172,804.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	46,726	3.24	151,625.87	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,659	11.85	173,709.15	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	71,511	4.12	294,982.87	
ニュージーランド・ドル 小計		251,004		1,623,501.02 (125,139,458)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	3,951	242.60	958,512.60	
	DNB ASA	35,795	150.00	5,369,250.00	
	EQUINOR ASA	42,813	205.30	8,789,508.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,286	134.60	980,695.60	
	MARINE HARVEST	15,267	197.75	3,019,049.25	
	NORSK HYDRO ASA	48,595	41.97	2,039,532.15	
	ORKLA ASA	29,933	71.56	2,142,005.48	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,697	278.00	1,027,766.00	
	TELENOR ASA	28,094	164.10	4,610,225.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,522	343.00	2,237,046.00	
ノルウェー・クローネ 小計		221,953		31,173,591.38 (413,985,294)	
ユーロ	1 AND 1 DRILLISCH AG	2,055	43.46	89,310.30	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	15,417	22.67	349,503.39	
	ACCOR	7,126	38.88	277,058.88	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,388	32.97	309,522.36	
	ADIDAS AG	6,901	200.80	1,385,720.80	
	ADP	1,223	175.00	214,025.00	
	AEGON NV	64,817	5.33	345,474.61	
	AENA SME SA	2,642	133.00	351,386.00	
	AGEAS	6,648	44.39	295,104.72	
	AIB GROUP PLC	30,183	3.78	114,333.20	
	AIR LIQUIDE	15,879	104.95	1,666,501.05	
	AIRBUS SE	21,398	92.57	1,980,812.86	
	AKZO NOBEL NV	9,266	73.34	679,568.44	
	ALLIANZ SE	16,106	188.66	3,038,557.96	
	ALSTOM RGPT	5,907	38.46	227,183.22	
	AMADEUS IT GROUP SA	16,061	65.86	1,057,777.46	
	AMUNDI SA	2,378	47.59	113,169.02	
	ANDRITZ AG	2,652	42.16	111,808.32	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	27,959	68.36	1,911,277.24	
	ARCELORMITTAL	24,463	21.67	530,235.52	
	ARKEMA	2,638	87.18	229,980.84	
	ASML HOLDING NV	15,021	143.96	2,162,423.16	

ASSICURAZIONI GENERALI SPA	42,909	14.46	620,464.14	
ATLANTIA SPA	19,074	18.01	343,618.11	
ATOS SE	3,564	70.90	252,687.60	
AXA	71,462	21.68	1,549,653.47	
AXEL SPRINGER SE	1,872	58.00	108,576.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	243,821	4.91	1,197,161.11	
BANCO DE SABADELL SA	204,626	1.15	235,319.90	
BANCO SANTANDER SA	590,783	4.20	2,483,060.94	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	36,124	5.90	213,131.60	
BANKIA SA	44,780	2.89	129,458.98	
BANKINTER SA	24,305	7.64	185,690.20	
BASF SE	33,620	69.02	2,320,452.40	
BAYER AG	33,389	62.30	2,080,134.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,153	74.18	901,509.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,962	65.95	129,393.90	
BEIERSDORF AG	3,658	92.02	336,609.16	
BIOMERIEUX	1,600	64.90	103,840.00	
BNP PARIBAS	41,377	45.28	1,873,757.44	
BOLLORE	37,694	3.86	145,725.00	
BOUYGUES	8,274	32.73	270,808.02	
BRENNTAG AG	5,612	42.31	237,443.72	
BUREAU VERITAS SA	10,348	19.28	199,509.44	
CAIXABANK	131,045	3.71	486,307.99	
CAPGEMINI SA	5,980	102.15	610,857.00	
CARREFOUR SA	21,570	17.35	374,347.35	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,147	38.01	81,607.47	
CIE DE SAINT-GOBAIN	18,546	31.25	579,655.23	
CNH INDUSTRIAL NV	37,349	8.47	316,495.42	
CNP ASSURANCES	7,091	20.04	142,103.64	
COLRUYT NV	2,167	56.38	122,175.46	
COMMERZBANK AG	36,749	8.12	298,475.37	
CONTINENTAL AG	4,018	135.95	546,247.10	
COVESTRO AG	7,015	55.90	392,138.50	
CREDIT AGRICOLE SA	42,796	10.88	465,706.07	
CRH PLC	31,012	23.99	743,977.88	
DAIMLER AG	33,312	50.45	1,680,590.40	
DANONE	22,782	64.71	1,474,223.22	
DASSAULT AVIATION SA	97	1,351.00	131,047.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,875	105.35	513,581.25	
DAVIDE CAMPARI -MILANO SPA	21,412	7.68	164,444.16	
DELIVERY HERO SE	3,367	32.58	109,696.86	
DEUTSCHE BANK AG	71,982	8.56	616,453.84	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,060	111.75	788,955.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	8,861	20.22	179,169.42	
DEUTSCHE POST AG	36,728	28.13	1,033,158.64	
DEUTSCHE TELEKOM AG	123,630	15.17	1,875,467.10	
DEUTSCHE WOHNEN SE	13,366	40.76	544,798.16	
E.ON SE	81,063	9.20	746,265.97	
EDENRED	8,812	32.92	290,091.04	
EDF	22,023	14.96	329,464.08	
EIFFAGE	3,104	87.74	272,344.96	
ELISA OYJ	5,500	37.49	206,195.00	

ENAGAS SA	8,280	24.32	201,369.60
ENDESA SA	11,757	20.22	237,726.54
ENEL SPA	299,975	4.56	1,368,485.95
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	94,957	3.08	292,467.56
ENGIE	68,142	12.19	830,991.69
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	93,253	14.72	1,372,684.16
ERSTE GROUP BANK AG	11,043	35.47	391,695.21
ESSILORLUXOTTICA	7,735	115.00	889,525.00
EURAZEO	1,892	65.40	123,736.80
EUROFINS SCIENTIFIC	432	383.40	165,628.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,743	18.60	125,419.80
EVONIK INDUSTRIES AG	5,908	25.87	152,839.96
EXOR NV	3,988	50.62	201,872.56
FAURECIA	2,912	39.80	115,897.60
FERRARI NV	4,508	95.26	429,432.08
FERROVIAL S.A.	17,760	17.60	312,664.80
FERROVIAL SA - RTS	17,369	0.41	7,121.29
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	39,456	14.37	567,140.54
FORTUM OYJ	16,489	18.85	310,817.65
FRAPORT AG	1,733	64.70	112,125.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	7,902	68.48	541,128.96
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,264	51.46	785,485.44
FUCHS PETROLUB AG -PFD	2,511	40.08	100,640.88
GALP ENERGIA SGPS SA	18,247	14.55	265,585.08
GEA GROUP AG	6,309	25.94	163,655.46
GETLINK SE - REGR	19,586	10.94	214,368.77
GRIFOLS SA	10,940	26.09	285,424.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,936	80.24	235,584.64
HANNOVER RUECK SE	2,157	122.40	264,016.80
HEIDELBERGCEMENT AG	5,450	59.22	322,749.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,255	77.40	329,337.00
HEINEKEN NV	9,526	80.38	765,699.88
HENKEL AG & CO KGAA	3,741	90.00	336,690.00
HENKEL KGAA-VORZUG	6,540	98.06	641,312.40
HERMES INTERNATIONAL	1,182	482.80	570,669.60
HOCHTIEF AG	697	124.50	86,776.50
HUGO BOSS AG	2,314	61.08	141,339.12
IBERDROLA SA	219,326	6.69	1,468,606.89
ILIAD SA	1,037	108.50	112,514.50
IMERYS SA	1,449	51.00	73,899.00
INDITEX SA	39,942	25.19	1,006,138.98
INFINEON TECHNOLOGIES AG	41,590	17.07	710,149.25
ING GROEP NV-CVA	142,570	10.88	1,551,731.88
INGENICO GROUP	2,234	63.40	141,635.60
INNOGY SE	5,183	39.88	206,698.04
INTESA SANPAOLO	546,299	1.92	1,052,171.87
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	23,376	7.14	166,998.14
IPSEN	1,420	120.30	170,826.00
JC DECAUX SA	3,117	28.84	89,894.28
JERONIMO MARTINS	9,131	10.63	97,108.18
K+S AG	7,023	16.45	115,563.46

KBC GROEP NV	9,171	62.00	568,602.00
KERING	2,792	382.60	1,068,219.20
KERRY GROUP PLC-A	5,886	91.70	539,746.20
KION GROUP AG	2,584	51.02	131,835.68
KONE OYJ	12,386	42.86	530,863.96
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	45,638	22.88	1,044,425.63
KONINKLIJKE DSM NV	6,656	77.66	516,904.96
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,477	32.71	1,127,915.05
L'OREAL SA	9,325	205.40	1,915,355.00
LANXESS	3,183	51.14	162,778.62
LEGRAND SA	10,018	53.04	531,354.72
LEONARDO SPA	14,843	8.32	123,553.13
LUXOTTICA GROUP SPA	6,254	52.88	330,711.52
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,226	259.25	2,651,090.50
MAPFRE SA	37,428	2.53	94,805.12
MEDIOBANCA SPA	22,845	7.40	169,053.00
MERCK KGAA	4,727	96.92	458,140.84
METRO AG	6,476	14.29	92,542.04
METSO OYJ	3,871	26.05	100,839.55
MICHELIN (C.G.D.E.)	6,363	88.94	565,925.22
MONCLER SPA	6,575	29.99	197,184.25
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	1,892	181.00	342,452.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	5,471	190.30	1,041,131.30
NATIXIS	36,808	4.92	181,242.59
NATURGY ENERGY GROUP SA	13,051	23.03	300,564.53
NESTE OYJ	4,684	70.18	328,723.12
NN GROUP NV	10,950	38.04	416,538.00
NOKIA OYJ	206,795	5.04	1,043,073.98
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,279	27.29	116,773.91
OMV AG	5,350	45.57	243,799.50
ORANGE S.A.	75,600	14.67	1,109,052.00
ORION OYJ-CLASS B	3,810	29.74	113,309.40
OSRAM LICHT AG	3,607	32.45	117,047.15
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,124	81.95	256,011.80
PERNOD-RICARD	7,892	139.85	1,103,696.20
PEUGEOT SA	21,751	19.75	429,691.00
PIRELLI & C SPA	14,843	6.29	93,392.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	5,568	57.50	320,160.00
POSTE ITALIANE SPA	18,891	6.55	123,811.61
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	8,713	17.37	151,344.81
PROXIMUS	6,079	23.40	142,248.60
PRYSMIAN SPA	8,813	16.04	141,404.58
PUBLICIS GROUPE	7,849	52.82	414,584.18
PUMA AG	303	440.00	133,320.00
QIAGEN NV	8,270	29.76	246,115.20
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	5,380	26.43	142,193.40
RANDSTAD NV	4,328	42.14	182,381.92
RECORDATI SPA	3,833	28.79	110,352.07
RED ELECTRICA DE ESPANA	16,103	19.00	306,037.51

REMY COINTREAU	889	102.80	91,389.20
RENAULT SA	7,109	59.06	419,857.54
REPSOL SA	49,327	15.61	769,994.47
REXEL SA	11,536	10.16	117,263.44
ROYAL KPN NV	129,954	2.40	312,929.23
RTL GROUP	1,488	51.35	76,408.80
RWE AG	19,081	19.30	368,263.30
SAFRAN SA	12,308	107.95	1,328,648.60
SAMPO OYJ	16,163	40.02	646,843.26
SANOFI	41,312	78.55	3,245,057.60
SAP SE	35,990	88.95	3,201,310.50
SARTORIUS AG-VORZUG	1,305	114.10	148,900.50
SCHAEFFLER AG	6,026	7.91	47,701.81
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,178	63.40	1,279,285.20
SCOR REGROUPE	6,329	42.14	266,704.06
SEB SA	879	116.90	102,755.10
SIEMENS AG	28,002	100.02	2,800,760.04
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,643	11.72	101,295.96
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,421	37.17	201,498.57
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,349	25.06	209,225.94
SNAM SPA	83,016	3.88	322,683.19
SOCIETE BIC SA	1,014	93.80	95,113.20
SOCIETE GENERALE	28,340	33.03	936,070.20
SODEXO	3,383	91.40	309,206.20
SOLVAY SA	2,732	100.85	275,522.20
STMICROELECTRONICS NV	25,249	12.21	308,290.29
STORA ENSO OYJ	20,124	12.20	245,512.80
SUEZ	14,514	13.28	192,818.49
SYMRISE AG	4,532	71.12	322,315.84
TELECOM ITALIA SPA	605,643	0.54	331,286.72
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,156	3.44	100,296.64
TELEFONICA SA	173,822	7.46	1,297,928.87
TELENET GROUP HOLDING NV	2,085	42.54	88,695.90
TELEPERFORMANCE	2,174	143.00	310,882.00
TENARIS SA	17,292	12.10	209,319.66
TERNA SPA	53,542	4.88	261,445.58
THALES SA	4,006	110.05	440,860.30
THYSSENKRUPP AG	15,991	16.09	257,375.14
TOTAL SA	87,907	49.55	4,355,791.85
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,951	67.18	198,248.18
UCB SA	4,630	75.84	351,139.20
UMICORE	7,688	40.59	312,055.92
UNICREDIT SPA	73,563	10.82	796,245.91
UNILEVER NV	56,549	48.72	2,755,067.28
UNIPER SE	7,370	25.90	190,883.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,497	38.47	172,999.59
UPM-KYMMENE OYJ	19,470	26.06	507,388.20
VALEO SA	8,965	24.72	221,614.80
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,519	18.47	378,985.93
VINCI SA	18,757	76.80	1,440,537.60
VIVENDI SA	38,660	21.64	836,602.40
VOESTALPINE AG	4,117	30.26	124,580.42

	VOLKSWAGEN AG	1,104	143.40	158,313.60	
	VOLKSWAGEN AG	6,857	146.72	1,006,059.04	
	VONOVIA SE	18,189	42.13	766,302.57	
	VOPAK	2,559	39.23	100,389.57	
	WARTSILA OYJ	16,233	14.48	235,053.84	
	WENDEL	1,106	111.30	123,097.80	
	WIRECARD AG	4,299	137.60	591,542.40	
	WOLTERS KLUWER NV	10,642	51.90	552,319.80	
	ZALANDO SE	4,095	27.23	111,506.85	
ユーロ 小計		7,165,572		131,599,563.98 (16,973,711,762)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	442,675	65.55	29,017,346.25	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,100	74.90	831,390.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,400	26.20	1,189,480.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	135,039	30.30	4,091,681.70	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	96,409	56.40	5,437,467.60	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	98,909	82.85	8,194,610.65	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	25,000	58.15	1,453,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	60,643	88.75	5,382,066.25	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	86,810	46.90	4,071,389.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	36,000	21.65	779,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,157	15.64	1,238,015.48	
	HANG SENG BANK LTD	27,912	179.50	5,010,204.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	51,038	38.90	1,985,378.20	
	HONG KONG & CHINA GAS	342,680	15.28	5,236,150.40	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	43,311	228.00	9,874,908.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	26,000	39.70	1,032,200.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	25,000	26.65	666,250.00	
	LI & FUNG LTD	221,278	1.66	367,321.48	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	35,200	12.16	428,032.00	
	MINTH GROUP LTD	26,000	27.10	704,600.00	
	MTR CORP	59,755	39.70	2,372,273.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	233,669	10.76	2,514,278.44	
	NWS HOLDINGS LTD	56,000	16.38	917,280.00	
	PCCW LTD	183,000	4.35	796,050.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	51,587	53.80	2,775,380.60	
	SANDS CHINA LTD	88,980	32.90	2,927,442.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	11.68	560,640.00	
	SINO LAND CO	126,000	13.00	1,638,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	72,000	6.96	501,120.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	59,523	110.10	6,553,482.30	
	SWIRE PACIFIC LTD	19,366	88.35	1,710,986.10	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,200	29.60	1,337,920.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	50,500	43.15	2,179,075.00	
	WH GROUP LTD	324,000	6.50	2,106,000.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	46,733	20.85	974,383.05	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	45,733	52.05	2,380,402.65	
	WHELOCK & CO LTD	33,000	46.30	1,527,900.00	

	WYNN MACAU LTD	57,703	16.76	967,102.28	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	23.65	638,550.00	
香港・ドル	小計	3,543,310		122,369,906.93 (1,759,679,262)	
合計		44,005,170		140,969,194,066 (140,969,194,066)	

## 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	16,781.00	294,338.74	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,876.00	473,220.84	
		AMERICAN TOWER REIT INC	16,281.00	2,706,390.63	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	41,783.00	417,412.17	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,158.00	968,414.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,767.00	724,508.21	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	8,812.00	160,907.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,519.00	325,683.45	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	15,315.00	1,719,415.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,625.00	854,228.75	
		DUKE REALTY CORP	13,464.00	383,185.44	
		EQUINIX INC	2,940.00	1,127,401.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	13,722.00	952,306.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,468.00	636,275.08	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,738.00	452,005.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,779.00	359,241.33	
		HCP INC	17,555.00	503,126.30	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	27,635.00	529,210.25	
		INVITATION HOMES INC	11,957.00	250,140.44	
		IRON MOUNTAIN INC	10,218.00	341,894.28	
		KIMCO REALTY CORP	15,934.00	247,614.36	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,680.00	248,727.20	
		MACERICH CO/THE	4,003.00	199,589.58	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,276.00	433,800.20	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,882.00	289,217.94	
		PROLOGIS INC	23,223.00	1,572,197.10	
		PUBLIC STORAGE	5,815.00	1,233,128.90	
		REALTY INCOME CORP	10,673.00	682,751.81	
		REGENCY CENTERS CORP	5,751.00	365,533.56	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,293.00	743,290.02	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	11,448.00	2,138,715.36	
		SL GREEN REALTY CORP	3,344.00	311,426.72	
		UDR INC	10,203.00	422,812.32	
VENTAS INC	13,217.00	817,603.62			
VEREIT	36,764.00	277,200.56			
VORNADO REALTY TRUST	6,451.00	460,278.85			
WELLTOWER INC	13,794.00	969,856.14			

アメリカ・ドル 小計		413,144.00	25,593,050.62 (2,883,569,013)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	35,987.00	210,595.92	
	HAMMERSON PLC	29,897.00	125,686.98	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,588.00	240,482.25	
	SEGRO PLC	38,956.00	238,566.54	
イギリス・ポンド 小計		133,428.00	815,331.69 (118,068,182)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	43,116.00	440,645.52	
	GOODMAN GROUP	65,883.00	680,571.39	
	GPT GROUP	79,388.00	419,962.52	
	MIRVAC GROUP	159,537.00	350,981.40	
	SCENTRE GROUP	214,210.00	828,992.70	
	STOCKLAND	103,871.00	374,974.31	
	VICINITY CENTRES	142,192.00	381,074.56	
オーストラリア・ドル 小計		808,197.00	3,477,202.40 (285,930,353)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	6,586.00	136,461.92	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,817.00	168,925.26	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,331.00	103,360.93	
カナダ・ドル 小計		16,734.00	408,748.11 (34,956,138)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	98,000.00	250,880.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	102,900.00	174,930.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	98,800.00	216,372.00	
	SUNTEC REIT	85,400.00	152,012.00	
シンガポール・ドル 小計		385,100.00	794,194.00 (65,258,921)	
ユーロ	COVIVIO	1,767.00	153,905.70	
	GECINA SA	1,856.00	238,867.20	
	ICADE	1,615.00	114,503.50	
	KLEPIERRE	8,367.00	243,981.72	
ユーロ 小計		13,605.00	751,258.12 (96,897,272)	
香港・ドル	LINK REIT	80,371.00	5,895,212.85	
香港・ドル 小計		80,371.00	5,895,212.85 (84,773,161)	
投資証券 合計			3,569,453,040 (3,569,453,040)	
合計			3,569,453,040 (3,569,453,040)	



(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 595銘柄	63.99%	-%	68.28%
	投資証券 37銘柄	-%	1.93%	
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	6.27%	-%	6.57%
	投資証券 4銘柄	-%	0.08%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄	2.29%	-%	2.57%
	投資証券 7銘柄	-%	0.19%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.53%	-%	3.68%
	投資証券 3銘柄	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.43%	-%	0.49%
	投資証券 4銘柄	-%	0.04%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.11%	-%	3.22%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	0.95%	-%	0.98%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.62%	-%	0.64%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.28%	-%	0.29%
ユーロ	株式 235銘柄	11.34%	-%	11.81%
	投資証券 4銘柄	-%	0.06%	
香港・ドル	株式 39銘柄	1.18%	-%	1.28%
	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	

(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)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	76,842,988
金銭信託	23,080,139
コール・ローン	32,111,499
国債証券	17,613,140,774
派生商品評価勘定	72
未収入金	665,973
未収利息	113,252,488
前払費用	7,551,171
流動資産合計	17,866,645,104
資産合計	17,866,645,104
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	374,889
未払金	78,852,405
未払解約金	18,722,533
その他未払費用	2,464
流動負債合計	97,952,291
負債合計	97,952,291
純資産の部	
元本等	
元本	13,426,526,479
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,342,166,334
純資産合計	17,768,692,813
負債純資産合計	17,866,645,104

## 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	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	13,426,526,479口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3234円 (13,234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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載し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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		173,435,958
合計		173,435,958

## （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	（2018年11月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	49,345,189	-	48,970,372	374,817
アメリカ・ドル	41,561,341	-	41,186,717	374,624
ユーロ	7,783,848	-	7,783,655	193
合計	49,345,189	-	48,970,372	374,817

## （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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,298,147,706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	4,211,379,155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	2,083,000,382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)	1,461,969,133円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,584,015,447円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	903,148,588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	7,278,919,564円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファン ド(4資産均等型)	528,387,080円
DCニッセイ外国債券インデックス	561,411,674円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	5,967,897円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	59,712,782円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	3,292,189円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	4,935,002円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	2,849,336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)	18,318,542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)	1,959,566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)	11,639,679円
計	13,426,526,479円

附属明細表(2018年11月20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	80,000.00	94,921.60	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	50,000.00	59,476.50	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	120,000.00	147,642.00	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	60,000.00	72,234.00	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	80,000.00	95,762.40	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	90,000.00	111,690.90	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	60,000.00	74,908.20	
		US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	1,160,000.00	1,144,583.60	
		US TREASURY N/B 1.375 2019/12/15	1,020,000.00	1,005,567.00	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	1,390,000.00	1,367,565.40	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/02/29	1,010,000.00	992,516.90	

US TREASURY N/B 1.375 2020/03/31	970,000.00	952,152.00	
US TREASURY N/B 1.375 2020/08/31	1,120,000.00	1,092,604.80	
US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	1,230,000.00	1,192,755.60	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	800,000.00	748,496.00	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	810,000.00	755,001.00	
US TREASURY N/B 1.5 2020/05/31	1,090,000.00	1,069,213.70	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	790,000.00	745,617.80	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	580,000.00	519,935.20	
US TREASURY N/B 1.625 2019/12/31	1,080,000.00	1,066,834.80	
US TREASURY N/B 1.625 2020/06/30	1,000,000.00	981,950.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,240,000.00	1,185,985.60	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,270,000.00	1,211,059.30	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	580,000.00	528,791.80	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	590,000.00	535,950.10	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	800,000.00	772,056.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,210,000.00	1,166,173.80	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	770,000.00	738,776.50	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	1,520,000.00	1,448,392.80	
US TREASURY N/B 1.875 2020/12/15	780,000.00	765,796.20	
US TREASURY N/B 2 2020/09/30	1,070,000.00	1,054,827.40	
US TREASURY N/B 2 2021/02/28	790,000.00	775,985.40	
US TREASURY N/B 2 2021/05/31	850,000.00	833,161.50	
US TREASURY N/B 2 2021/08/31	890,000.00	870,420.00	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	1,320,000.00	1,289,164.80	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,220,000.00	1,188,682.60	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,460,000.00	1,409,469.40	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	380,000.00	362,140.00	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	1,020,000.00	965,205.60	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	1,070,000.00	1,006,752.30	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	590,000.00	547,520.00	

US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	870,000.00	854,905.50	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	1,280,000.00	1,256,550.40	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	920,000.00	902,317.60	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	890,000.00	871,292.20	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	730,000.00	711,859.50	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	800,000.00	777,056.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	350,000.00	336,574.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	380,000.00	363,610.60	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	1,100,000.00	1,046,023.00	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	820,000.00	809,618.80	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	440,000.00	426,712.00	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	1,040,000.00	1,000,875.20	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	380,000.00	365,392.80	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	900,000.00	858,762.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	590,000.00	556,600.10	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	580,000.00	544,834.60	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	580,000.00	543,610.80	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	350,000.00	281,953.00	
US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	790,000.00	783,174.40	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	1,010,000.00	980,720.10	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	580,000.00	551,742.40	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	1,480,000.00	1,455,476.40	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	1,000,000.00	979,370.00	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	400,000.00	342,576.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	360,000.00	306,997.20	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	370,000.00	315,236.30	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	1,440,000.00	1,435,939.20	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	1,660,000.00	1,654,156.80	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	380,000.00	372,829.40	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	1,140,000.00	1,133,046.00	



US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	950,000.00	943,312.00	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	350,000.00	345,649.50	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	600,000.00	585,114.00	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	220,000.00	199,700.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	270,000.00	244,822.50	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	360,000.00	321,987.60	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	360,000.00	321,735.60	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	650,000.00	640,146.00	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	670,000.00	659,373.80	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	370,000.00	342,653.30	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	400,000.00	368,528.00	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	370,000.00	340,081.80	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	390,000.00	390,850.20	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	150,000.00	142,552.50	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	380,000.00	359,305.20	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	390,000.00	368,382.30	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	390,000.00	368,046.90	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	360,000.00	339,087.60	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	360,000.00	338,850.00	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	380,000.00	357,078.40	
US TREASURY N/B 3 2048/08/15	430,000.00	404,079.60	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	1,090,000.00	1,098,207.70	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	130,000.00	126,495.20	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	170,000.00	165,245.10	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	280,000.00	271,250.00	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	400,000.00	386,984.00	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	430,000.00	414,059.90	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	390,000.00	394,219.80	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	1,320,000.00	1,333,912.80	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	110,000.00	114,481.40	

US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	330,000.00	347,325.00	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	390,000.00	410,701.20	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	380,000.00	408,142.80	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	160,000.00	174,968.00	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	120,000.00	138,182.40	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	160,000.00	184,374.40	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	60,000.00	70,092.00	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	130,000.00	152,135.10	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	140,000.00	164,827.60	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	70,000.00	83,111.00	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	110,000.00	130,801.00	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	200,000.00	241,858.00	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	170,000.00	209,511.40	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	60,000.00	75,215.40	
US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	80,000.00	104,308.80	
WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	150,000.00	161,073.00	
WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	160,000.00	187,374.40	
WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	140,000.00	164,274.60	
アメリカ・ドル 小計	73,750,000.00	71,862,022.20 (8,096,694,041)	
イギリス・ボンド			
TSY 3 3/4% 2020 3.75 2020/09/07	170,000.00	179,276.90	
TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	140,000.00	151,653.60	
TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	180,000.00	249,282.00	
TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	180,000.00	269,065.80	
TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	200,000.00	273,408.00	
TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	160,000.00	239,046.40	
TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	130,000.00	163,485.40	
TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	150,000.00	198,342.00	
TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	140,000.00	196,938.00	
TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	160,000.00	227,664.00	
TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	160,000.00	260,116.80	

TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	170,000.00	178,885.90	
TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	130,000.00	176,768.80	
TSY 4% 2022 4 2022/03/07	120,000.00	132,654.00	
TSY 4% 2060 4 2060/01/22	140,000.00	225,495.20	
TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	140,000.00	208,012.00	
TSY 5 2025 5 2025/03/07	150,000.00	186,192.00	
TSY 8% 2021 8 2021/06/07	120,000.00	142,118.40	
UK TREASURY 6 2028/12/07	100,000.00	144,028.00	
UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	240,000.00	244,159.20	
UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	170,000.00	174,278.90	
UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	210,000.00	189,588.00	
UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	220,000.00	219,540.20	
UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	150,000.00	153,451.50	
UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	100,000.00	92,121.00	
UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	80,000.00	80,029.60	
UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	220,000.00	227,724.20	
UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	30,000.00	28,665.30	
UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	150,000.00	144,691.50	
UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	160,000.00	170,180.80	
UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	120,000.00	131,905.20	
UK TSY 2% 2020 2 2020/07/22	240,000.00	245,248.80	
UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	160,000.00	169,796.80	
UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	160,000.00	244,036.80	
UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	220,000.00	276,386.00	
UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	140,000.00	204,026.20	
UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	210,000.00	275,807.70	
UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	130,000.00	200,252.00	
UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	240,000.00	237,559.20	
UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	250,000.00	248,192.50	
UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	130,000.00	127,719.80	

	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	170,000.00	203,789.20	
イギリス・ポンド 小計		6,740,000.00	8,091,583.60 (1,171,742,221)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2020/11/21	250,000.00	248,582.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	160,000.00	159,403.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	130,000.00	130,156.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	250,000.00	241,435.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	80,000.00	78,361.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	250,000.00	254,805.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	260,000.00	262,371.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	240,000.00	241,790.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	150,000.00	150,888.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	60,000.00	58,400.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	40,000.00	37,605.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	110,000.00	106,229.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	250,000.00	261,657.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	200,000.00	210,512.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	70,000.00	71,916.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	110,000.00	121,532.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	300,000.00	334,737.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2020/04/15	230,000.00	237,845.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	130,000.00	155,694.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	280,000.00	325,472.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	230,000.00	261,238.60		
AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	280,000.00	304,836.00		
AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	230,000.00	258,823.60		
オーストラリア・ドル 小計		4,290,000.00	4,514,293.20 (371,210,330)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	40,000.00	44,016.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	140,000.00	132,245.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2020/09/01	250,000.00	243,720.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	230,000.00	222,485.90	

CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	190,000.00	182,401.90	
CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	140,000.00	133,589.40	
CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	150,000.00	134,433.00	
CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2019/11/01	130,000.00	129,025.00	
CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2020/02/01	130,000.00	128,692.20	
CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2020/03/01	210,000.00	208,334.70	
CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	120,000.00	116,010.00	
CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	120,000.00	113,062.80	
CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2020/05/01	110,000.00	109,357.60	
CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2020/08/01	100,000.00	99,258.00	
CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	140,000.00	137,008.20	
CANADIAN GOVERNMENT 2 2020/11/01	100,000.00	99,595.00	
CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	120,000.00	118,470.00	
CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	120,000.00	116,352.00	
CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	30,000.00	27,144.90	
CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	30,000.00	29,925.90	
CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	110,000.00	109,502.80	
CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	50,000.00	49,457.00	
CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	130,000.00	131,315.60	
CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	130,000.00	132,091.70	
CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	140,000.00	149,660.00	
CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	120,000.00	122,962.80	
CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2020/06/01	120,000.00	122,400.00	
CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	160,000.00	193,556.80	
CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	140,000.00	177,588.60	
CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	120,000.00	165,805.20	
CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	100,000.00	131,228.00	
CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	110,000.00	155,019.70	
CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	40,000.00	57,370.80	
カナダ・ドル 小計	4,070,000.00	4,223,087.70 (361,158,460)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	50,000.00	49,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	80,000.00	80,338.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	30,000.00	28,019.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	30,000.00	30,090.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	40,000.00	40,696.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	110,000.00	112,675.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	40,000.00	39,731.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	50,000.00	49,325.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	10,000.00	10,325.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	40,000.00	41,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	50,000.00	51,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	80,000.00	82,832.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25 2020/09/01	100,000.00	102,080.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	50,000.00	54,121.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	70,000.00	75,845.00	
シンガポール・ドル 小計		830,000.00	848,389.80 (69,712,190)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	560,000.00	568,803.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	620,000.00	648,650.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	760,000.00	815,578.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	520,000.00	595,561.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	940,000.00	1,062,378.60	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	430,000.00	601,045.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	880,000.00	977,609.60	
スウェーデン・クローナ 小計		4,710,000.00	5,269,627.00 (65,923,034)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2020/11/15	410,000.00	417,031.50	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	830,000.00	842,151.20	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	490,000.00	531,047.30	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	720,000.00	803,275.20	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	830,000.00	916,925.90	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	720,000.00	753,400.80	

	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,190,000.00	2,029,675.90	
デンマーク・クローネ 小計		5,190,000.00	6,293,507.80 (108,751,815)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	320,000.00	313,737.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	310,000.00	310,502.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	340,000.00	337,120.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	650,000.00	663,162.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	210,000.00	211,344.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	420,000.00	449,194.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	790,000.00	838,585.00	
ノルウェー・クローネ 小計		3,040,000.00	3,123,645.70 (41,482,015)	
ポーランド・ズロ チ	POLAND GOVERNMENT BOND 1.5 2020/04/25	280,000.00	280,050.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	350,000.00	337,417.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	300,000.00	285,405.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	140,000.00	134,813.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	330,000.00	337,672.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	550,000.00	588,912.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2020/10/25	330,000.00	353,034.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	590,000.00	655,165.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	420,000.00	473,999.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	70,000.00	85,693.30	
	ポーランド・ズロチ 小計		3,360,000.00	3,532,163.10 (105,223,139)
マレーシア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	280,000.00	276,491.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	280,000.00	275,797.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	80,000.00	77,355.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	200,000.00	184,150.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.889 2020/07/31	270,000.00	271,536.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	250,000.00	244,402.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	60,000.00	58,804.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	200,000.00	198,164.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	30,000.00	28,770.30	

	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	310,000.00	314,023.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	210,000.00	211,438.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	120,000.00	117,060.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	70,000.00	65,772.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.378 2019/11/29	260,000.00	262,399.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	120,000.00	121,855.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	110,000.00	110,072.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	80,000.00	76,694.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	110,000.00	109,049.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	99,507.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	64,467.00	
マレーシア・リンギット 小計		3,200,000.00	3,167,811.20 (85,214,121)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	2,490,000.00	2,625,854.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	900,000.00	954,909.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5 2019/12/11	1,980,000.00	1,910,125.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	1,490,000.00	1,239,233.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	3,300,000.00	3,141,633.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	2,550,000.00	2,380,093.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	2,400,000.00	2,186,904.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,450,000.00	1,291,341.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	720,000.00	628,279.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	1,830,000.00	1,539,450.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	2,570,000.00	2,551,316.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	1,670,000.00	1,619,198.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	600,000.00	515,550.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	840,000.00	806,215.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	1,230,000.00	1,132,276.50	
	メキシコ・ペソ 小計		26,020,000.00	24,522,380.20 (135,853,986)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	90,000.00	90,797.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	70,000.00	71,092.00	



BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	150,000.00	154,381.50	
BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	130,000.00	131,134.90	
BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	130,000.00	129,591.80	
BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	130,000.00	134,518.80	
BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	100,000.00	98,639.00	
BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	40,000.00	39,962.80	
BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	40,000.00	39,516.00	
BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	100,000.00	95,252.00	
BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	60,000.00	63,528.00	
BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	40,000.00	40,441.20	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	130,000.00	144,040.00	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	40,000.00	42,268.00	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	140,000.00	159,076.40	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	70,000.00	86,427.60	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	180,000.00	194,466.60	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	90,000.00	128,394.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	130,000.00	148,942.30	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	80,000.00	108,392.80	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	150,000.00	170,071.50	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	150,000.00	176,104.50	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	160,000.00	238,707.20	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	100,000.00	129,197.00	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	180,000.00	276,156.00	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	170,000.00	242,998.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	190,000.00	190,395.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/10/31	30,000.00	29,909.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	90,000.00	88,920.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	190,000.00	191,065.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	170,000.00	170,477.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	200,000.00	203,948.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	180,000.00	184,163.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	200,000.00	199,434.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2020/01/31	210,000.00	214,454.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	190,000.00	186,984.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	150,000.00	146,718.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	210,000.00	208,929.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	170,000.00	170,608.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	200,000.00	207,342.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	180,000.00	188,854.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	200,000.00	201,518.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	210,000.00	224,137.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	140,000.00	143,280.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	80,000.00	78,471.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	230,000.00	254,421.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	160,000.00	165,532.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	80,000.00	87,272.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	190,000.00	219,970.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	230,000.00	244,230.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	180,000.00	230,707.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	170,000.00	177,542.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	200,000.00	236,068.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	210,000.00	258,352.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	190,000.00	261,348.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	160,000.00	192,888.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.85 2020/10/31	170,000.00	186,462.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	170,000.00	238,926.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	170,000.00	224,388.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	130,000.00	190,832.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	200,000.00	241,020.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	230,000.00	260,944.20	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	200,000.00	289,768.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	210,000.00	247,892.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	190,000.00	253,859.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	240,000.00	337,442.40	
BUNDES OBLIGATION 0 2020/04/17	170,000.00	171,596.30	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/04/09	200,000.00	202,782.00	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/10/08	180,000.00	182,723.40	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/04/08	170,000.00	172,621.40	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/10/07	150,000.00	152,229.00	
BUNDES OBLIGATION 0 2023/10/13	120,000.00	121,318.80	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2020/10/16	170,000.00	172,857.70	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	240,000.00	237,614.40	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	250,000.00	251,297.50	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	140,000.00	138,369.00	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	200,000.00	206,918.00	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	240,000.00	247,497.60	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	240,000.00	245,282.40	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	200,000.00	203,478.00	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	180,000.00	191,597.40	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	220,000.00	234,808.20	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	100,000.00	105,196.00	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	380,000.00	407,618.40	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	180,000.00	194,144.40	
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	310,000.00	335,289.80	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	170,000.00	185,473.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	270,000.00	297,534.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	190,000.00	204,916.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	160,000.00	177,313.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2020/09/04	230,000.00	242,033.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	170,000.00	181,373.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	250,000.00	335,955.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	230,000.00	312,710.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3 2020/07/04	200,000.00	211,924.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	210,000.00	219,450.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	330,000.00	363,204.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	140,000.00	209,277.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	210,000.00	324,618.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	130,000.00	213,908.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	190,000.00	304,877.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	150,000.00	265,473.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	90,000.00	147,269.70	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/12/13	120,000.00	120,856.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/03/13	130,000.00	131,133.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/06/12	120,000.00	121,248.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2021/04/15	150,000.00	144,021.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.2 2020/10/15	140,000.00	136,924.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2020/06/15	120,000.00	118,603.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	170,000.00	164,418.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2020/11/01	170,000.00	167,563.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	180,000.00	162,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	200,000.00	198,934.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	320,000.00	298,265.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.05 2019/12/01	140,000.00	140,595.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	160,000.00	138,286.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	530,000.00	512,960.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	330,000.00	317,588.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	320,000.00	289,488.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	170,000.00	151,855.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	200,000.00	159,494.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	150,000.00	141,529.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	240,000.00	222,072.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	170,000.00	151,689.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	190,000.00	170,838.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	300,000.00	300,243.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	160,000.00	146,158.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	140,000.00	113,090.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	150,000.00	128,493.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	320,000.00	310,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	150,000.00	120,286.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	90,000.00	84,350.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	60,000.00	46,869.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	110,000.00	94,934.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	150,000.00	132,408.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	140,000.00	125,867.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	210,000.00	207,513.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	220,000.00	229,935.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	160,000.00	167,081.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	490,000.00	511,251.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	180,000.00	186,368.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	240,000.00	250,869.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	260,000.00	264,256.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2020/03/01	220,000.00	229,050.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2020/02/01	210,000.00	218,893.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	180,000.00	193,170.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	220,000.00	235,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	200,000.00	215,834.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	230,000.00	249,878.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	220,000.00	243,130.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	160,000.00	175,814.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	230,000.00	254,184.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	230,000.00	261,227.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	210,000.00	237,211.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	210,000.00	236,245.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	260,000.00	297,629.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	180,000.00	199,054.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	200,000.00	221,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	190,000.00	229,398.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	280,000.00	342,669.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	250,000.00	307,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	110,000.00	140,981.50	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	110,000.00	156,365.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	150,000.00	238,783.50	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	140,000.00	207,935.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	100,000.00	154,070.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	50,000.00	50,164.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.375 2020/09/15	50,000.00	50,853.50	

FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	50,000.00	50,575.50	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	50,000.00	49,888.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	40,000.00	39,528.40	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	40,000.00	41,710.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	40,000.00	40,676.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	50,000.00	53,608.50	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	90,000.00	96,413.40	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	40,000.00	44,271.60	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	40,000.00	52,101.20	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	70,000.00	84,086.10	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	60,000.00	63,351.00	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	60,000.00	65,745.60	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	50,000.00	62,461.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/02/25	240,000.00	241,850.40	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/05/25	210,000.00	211,904.70	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	260,000.00	262,693.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	280,000.00	283,141.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	230,000.00	232,127.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	250,000.00	251,057.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	160,000.00	159,203.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	230,000.00	233,571.90	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	280,000.00	274,699.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2019/11/25	200,000.00	202,230.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	340,000.00	345,446.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	310,000.00	311,999.50	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	310,000.00	310,979.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	160,000.00	159,545.60	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	280,000.00	293,073.20	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	290,000.00	300,248.60	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	90,000.00	90,568.80	

FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	270,000.00	266,770.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	430,000.00	454,905.60	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	450,000.00	487,647.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	340,000.00	372,351.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	140,000.00	147,810.60	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	100,000.00	94,964.00	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	230,000.00	245,416.90	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	310,000.00	339,998.70	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	320,000.00	358,313.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2020/10/25	350,000.00	370,657.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	310,000.00	364,026.80	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	350,000.00	415,520.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	430,000.00	478,830.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	370,000.00	409,630.70	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	230,000.00	311,277.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	350,000.00	370,506.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	330,000.00	406,411.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	360,000.00	397,011.60	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	240,000.00	350,916.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	140,000.00	222,202.40	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	120,000.00	194,940.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	430,000.00	521,306.20	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	310,000.00	490,215.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	250,000.00	383,262.50	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	330,000.00	487,221.90	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	300,000.00	483,522.00	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	270,000.00	375,767.10	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	70,000.00	72,114.00	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	100,000.00	102,073.00	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	40,000.00	38,893.60	



IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	30,000.00	30,011.70	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	50,000.00	50,147.50	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	80,000.00	82,152.00	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	90,000.00	101,106.00	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	50,000.00	50,019.50	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	80,000.00	79,165.60	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	70,000.00	81,495.40	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	60,000.00	69,970.20	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	120,000.00	152,410.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	140,000.00	141,807.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	130,000.00	130,412.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2020/01/15	140,000.00	141,575.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	140,000.00	141,054.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	150,000.00	152,734.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	140,000.00	144,104.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	110,000.00	112,475.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	140,000.00	152,661.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	150,000.00	167,064.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	140,000.00	153,395.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	130,000.00	159,712.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	130,000.00	181,745.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	160,000.00	176,158.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.5 2020/07/15	130,000.00	139,003.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	140,000.00	163,658.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	140,000.00	219,676.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	150,000.00	228,280.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	120,000.00	175,149.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	70,000.00	70,654.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	80,000.00	79,961.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	110,000.00	112,823.70	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	90,000.00	91,140.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	100,000.00	106,455.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	50,000.00	50,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	20,000.00	18,060.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	90,000.00	98,345.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	160,000.00	174,531.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	40,000.00	43,981.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	70,000.00	83,204.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	60,000.00	83,292.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	100,000.00	114,725.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	150,000.00	166,864.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	80,000.00	90,972.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	40,000.00	67,976.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.9 2020/07/15	130,000.00	139,678.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	130,000.00	193,934.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	80,000.00	106,369.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	80,000.00	119,065.60	
	TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	90,000.00	96,386.40	
	TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	60,000.00	66,292.20	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	110,000.00	143,224.40	
	ユーロ 小計	48,020,000.00	53,483,975.00 (6,898,363,096)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	2,030,000.00	2,186,716.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	890,000.00	630,493.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	860,000.00	596,040.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	450,000.00	443,520.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	1,020,000.00	831,249.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	260,000.00	262,704.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	840,000.00	820,470.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	1,240,000.00	1,109,961.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	830,000.00	741,032.30	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	1,140,000.00	1,007,281.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	1,260,000.00	1,118,187.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	1,730,000.00	1,531,915.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	810,000.00	746,714.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	730,000.00	668,519.40	
	南アフリカ・ランド 小計	14,090,000.00	12,694,803.80 (101,812,326)	
国債証券 合計			17,613,140,774 (17,613,140,774)	
合計			17,613,140,774 (17,613,140,774)	

(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 119銘柄	45.57%	45.97%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	6.59%	6.65%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	2.09%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	2.03%	2.05%
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	0.39%	0.40%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.37%	0.37%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.61%	0.62%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.23%	0.24%
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	0.59%	0.60%
マレーシア・リンギット	国債証券 20銘柄	0.48%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.76%	0.77%
ユーロ	国債証券 278銘柄	38.82%	39.17%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	0.57%	0.58%

(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。

## 「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	13,079,208
金銭信託	37,276,284
コール・ローン	51,862,661
投資証券	1,984,027,628
未収入金	7,660,389
未収配当金	4,155,320
流動資産合計	2,098,061,490
資産合計	2,098,061,490
負債の部	
流動負債	
未払解約金	80,146,262
その他未払費用	500
流動負債合計	80,146,762
負債合計	80,146,762
純資産の部	
元本等	
元本	1,958,293,015
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	59,621,713
純資産合計	2,017,914,728
負債純資産合計	2,098,061,490

## 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>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. 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>
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	（2018年11月20日現在）	
1. 受益権総口数		1,958,293,015口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		1.0304円 (10,304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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資証券		1,849,537
合計		1,849,537

（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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	2,012,602,409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	44,790,636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	99,100,030円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,915,161,338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）	24,070,947円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	2,834,846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）	1,023,046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）	15,202,838円
計	1,958,293,015円

## 附属明細表（2018年11月20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
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	1,299.00	36,982.53	
		AGREE REALTY CORP	445.00	26,041.40	
		ALEXANDER'S INC	59.00	18,539.57	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,726.00	210,727.34	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	644.00	25,702.04	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,119.00	89,358.23	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3,909.00	77,163.66	
		AMERICOLD REALTY TRUST	888.00	23,443.20	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2,439.00	112,120.83	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	3,257.00	51,037.19	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3,177.00	15,535.53	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,196.00	412,299.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	376.00	3,135.84	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,498.00	313,823.74	
		BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1,080.00	10,400.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	2,724.00	38,680.80	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,001.00	76,765.35	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,396.00	129,199.80	
		CARETRUST REIT INC	1,179.00	22,766.49	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6,394.00	17,327.74	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,217.00	4,247.33	
		CHATHAM LODGING TRUST	958.00	18,834.28	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	934.00	27,095.34	
		CITY OFFICE REIT INC	423.00	4,640.31	
		CLIPPER REALTY INC	655.00	8,567.40	
		COLONY CAPITAL INC	9,328.00	56,154.56	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1,883.00	40,936.42	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	266.00	7,833.70	
		CORECIVIC INC	2,512.00	53,756.80	
		CORESITE REALTY CORP	567.00	53,354.70	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,545.00	38,192.40	
		COUSINS PROPERTIES INC	6,524.00	54,410.16	
		CUBESMART	2,620.00	79,910.00	
		CYRUSONE INC	1,801.00	97,452.11	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3,111.00	32,603.28			
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,473.00	389,080.19			
DOUGLAS EMMETT INC	2,478.00	88,018.56			
DUKE REALTY CORP	5,836.00	166,092.56			



EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	677.00	11,861.04	
EASTGROUP PROPERTIES	533.00	52,964.21	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	1,983.00	30,617.52	
EPR PROPERTIES	1,136.00	80,633.28	
EQUITY COMMONWEALTH	1,040.00	32,177.60	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,316.00	128,204.72	
EQUITY RESIDENTIAL	5,891.00	408,835.40	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,026.00	264,513.06	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,061.00	196,619.40	
FARMLAND PARTNERS INC	1,300.00	8,658.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,166.00	150,728.82	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1,862.00	59,341.94	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	4,126.00	104,222.76	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	951.00	25,505.82	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,666.00	12,794.88	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	491.00	4,198.05	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,515.00	117,190.10	
GEO GROUP INC/THE	2,109.00	47,178.33	
GETTY REALTY CORP	508.00	14,762.48	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	430.00	8,260.30	
GLADSTONE LAND CORP	168.00	2,167.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,354.00	12,524.50	
GLOBAL NET LEASE INC	1,882.00	40,707.66	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	1,789.00	15,850.54	
HCP INC	7,528.00	215,752.48	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,923.00	56,497.74	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	3,185.00	85,612.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	611.00	10,967.45	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,604.00	70,110.84	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2,552.00	67,423.84	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12,683.00	242,879.45	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2,412.00	73,469.52	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1,269.00	12,575.79	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	305.00	6,545.30	
INFREIT INC	605.00	12,826.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	80.00	4,077.60	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,874.00	10,063.38	
INVITATION HOMES INC	4,603.00	96,294.76	
IRON MOUNTAIN INC	4,949.00	165,593.54	
JBG SMITH PROPERTIES	1,553.00	62,974.15	
KILROY REALTY CORP	1,614.00	110,300.76	

KIMCO REALTY CORP	6,837.00	106,246.98	
KITE REALTY GROUP TRUST	1,573.00	25,230.92	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,759.00	60,333.70	
LEXINGTON REALTY TRUST	3,364.00	28,324.88	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,288.00	100,191.52	
LIFE STORAGE INC	723.00	70,760.01	
LTC PROPERTIES INC	615.00	27,724.20	
MACERICH CO/THE	1,691.00	84,313.26	
MACK-CALI REALTY CORP	1,934.00	40,923.44	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	14,900.00	11,622.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	494.00	3,665.48	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,655.00	93,986.10	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,769.00	179,465.05	
MONMOUTH REIT -CL A	1,155.00	17,209.50	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,516.00	123,711.72	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	688.00	19,174.56	
NATL HEALTH INVESTORS INC	637.00	47,921.51	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1,276.00	6,801.08	
NEXPOINT RESIDENTIAL	298.00	10,531.32	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1,294.00	20,626.36	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3,194.00	113,259.24	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	246.00	6,447.66	
PARAMOUNT GROUP INC	3,153.00	44,835.66	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	3,291.00	100,803.33	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,071.00	38,020.50	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,117.00	17,232.38	
PHYSICIANS REALTY TRUST	2,763.00	46,031.58	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2,260.00	42,352.40	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	508.00	7,650.48	
PROLOGIS INC	10,309.00	697,919.30	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	309.00	42,441.15	
PUBLIC STORAGE	2,353.00	498,977.18	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	870.00	33,529.80	
REALTY INCOME CORP	4,587.00	293,430.39	
REGENCY CENTERS CORP	2,682.00	170,467.92	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1,704.00	30,297.12	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	3,587.00	43,366.83	
RETAIL VALUE INC	555.00	15,545.55	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1,328.00	44,076.32	
RLJ LODGING TRUST	3,105.00	61,199.55	
RPT REALTY	1,233.00	16,731.81	

	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	942.00	70,951.44	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	3,871.00	74,516.75	
	SAUL CENTERS INC	186.00	10,051.44	
	SELECT INCOME REIT	1,000.00	19,270.00	
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	3,690.00	50,589.90	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	390.00	14,285.70	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,969.00	928,308.58	
	SITE CENTERS CORP	2,371.00	26,768.59	
	SL GREEN REALTY CORP	1,537.00	143,140.81	
	SPIRIT MTA REIT	1,132.00	11,308.68	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7,120.00	54,895.20	
	STAG INDUSTRIAL INC	1,433.00	37,988.83	
	STORE CAPITAL CORP	2,865.00	83,285.55	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,619.00	17,598.53	
	SUN COMMUNITIES INC	1,315.00	134,169.45	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3,500.00	53,270.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,475.00	34,839.50	
	TAUBMAN CENTERS INC	943.00	49,526.36	
	TERRENO REALTY CORP	813.00	31,983.42	
	TIER REIT INC	743.00	17,014.70	
	UDR INC	4,380.00	181,507.20	
	UMH PROPERTIES INC	479.00	6,265.32	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	194.00	13,389.88	
	URBAN EDGE PROPERTIES	1,644.00	32,945.76	
	URSTADT BIDDLE - CL A	462.00	9,466.38	
	VENTAS INC	5,702.00	352,725.72	
	VEREIT	15,132.00	114,095.28	
	VICI PROPERTIES INC	1,101.00	23,583.42	
	VORNADO REALTY TRUST	2,948.00	210,339.80	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	5,238.00	33,261.30	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,195.00	34,463.80	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,855.00	52,051.30	
	WELLTOWER INC	6,015.00	422,914.65	
	WHITESTONE REIT	599.00	8,386.00	
	WP CAREY INC	1,613.00	110,651.80	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,658.00	33,010.78	
	アメリカ・ドル 小計	372,087.00	13,012,915.35 (1,466,165,172)	
	イギリス・債券			
	ASSURA PLC	37,412.00	21,511.90	
	BIG YELLOW GROUP PLC	2,305.00	21,194.47	
	BRITISH LAND CO PLC	16,112.00	94,287.42	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	8,029.00	3,195.54	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	3,044.00	3,257.08	
	DERWENT LONDON PLC	1,721.00	51,096.49	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	8,890.00	8,134.35	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	4,375.00	30,480.62	
	HAMMERSON PLC	12,928.00	54,349.31	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	12,807.00	12,409.98	
	INTU PROPERTIES PLC	22,692.00	41,980.20	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	8,089.00	4,594.55	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	12,250.00	103,047.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	10,754.00	19,991.68	
	LXI REIT PLC	2,150.00	2,515.50	
	NEWRIVER REIT PLC	4,756.00	11,200.38	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	9,264.00	10,227.45	
	RDI REIT PLC	19,704.00	6,758.47	
	REGIONAL REIT LTD	4,251.00	4,216.99	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	3,251.00	17,425.36	
	SEGRO PLC	16,209.00	99,263.91	
	SHAFTESBURY PLC	3,847.00	34,969.23	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	21,169.00	29,043.86	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	3,183.00	2,632.34	
	UNITE GROUP PLC	4,054.00	34,519.81	
	WORKSPACE GROUP PLC	1,850.00	16,779.50	
	イギリス・ボンド 小計	255,096.00	739,083.39 (107,026,666)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	5,006.00	16,319.56	
	ARENA REIT	4,050.00	9,234.00	
	BWP TRUST	7,508.00	25,752.44	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	3,279.00	9,574.68	
	CHARTER HALL GROUP	7,189.00	48,957.09	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	2,376.00	9,765.36	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	5,119.00	22,114.08	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	24,522.00	25,012.44	
	DEXUS	16,985.00	173,586.70	
	GDI PROPERTY GROUP	7,871.00	9,799.39	
	GOODMAN GROUP	26,607.00	274,850.31	
	GPT GROUP	29,886.00	158,096.94	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	3,903.00	14,089.83	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	2,236.00	6,976.32	
	INDUSTRIA REIT	1,545.00	4,094.25	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,170.00	9,383.20	
	INVESTA OFFICE FUND	7,725.00	43,028.25	
	MIRVAC GROUP	62,074.00	136,562.80	
	NATIONAL STORAGE REIT	7,877.00	13,587.82	
	PROPERTYLINK GROUP	7,772.00	9,170.96	
	RURAL FUNDS GROUP	3,891.00	8,754.75	
	SCENTRE GROUP	88,728.00	343,377.36	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	11,207.00	28,914.06	
STOCKLAND	39,820.00	143,750.20		
VICINITY CENTRES	53,252.00	142,715.36		
VIVA ENERGY REIT	6,754.00	14,588.64		
	オーストラリア・ドル 小計	440,352.00	1,702,056.79 (139,960,130)	

カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	200.00	2,852.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	700.00	31,087.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,100.00	11,022.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	300.00	13,023.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,600.00	73,808.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	1,748.00	21,255.68	
	COMINAR REAL ESTATE INV- TR U	1,400.00	15,120.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	600.00	7,920.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	400.00	5,188.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	400.00	3,992.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	500.00	11,925.00	
	Dream Global Real Estate Investment Trust	1,300.00	17,758.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	300.00	16,629.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT- UTS	2,200.00	45,584.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	600.00	7,530.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	500.00	8,085.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	200.00	3,478.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	300.00	7,839.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	600.00	6,378.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,400.00	59,472.00	
SLATE OFFICE REIT	400.00	2,920.00		
SLATE RETAIL REIT	300.00	3,768.00		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,000.00	31,030.00		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	400.00	3,684.00		
カナダ・ドル 小計		19,448.00	411,347.68 (35,178,454)	
シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	8,700.00	11,397.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	11,300.00	8,701.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	37,200.00	95,232.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	19,600.00	21,168.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	16,500.00	10,972.50	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,200.00	68,340.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	41,800.00	91,542.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	8,400.00	11,424.00	

	CDL HOSPITALITY TRUSTS	11,700.00	17,316.00	
	ESR REIT	17,200.00	8,600.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	13,100.00	7,860.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	8,800.00	9,152.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	100.00	138.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	5,300.00	5,512.00	
	KEPPEL DC REIT	1,900.00	2,584.00	
	KEPPEL REIT	27,400.00	30,962.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	29,800.00	6,258.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	29,400.00	47,922.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	11,400.00	21,204.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	31,600.00	38,236.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	35,000.00	37,800.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	17,300.00	11,504.50	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	1,400.00	3,626.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	12,400.00	4,836.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	9,700.00	5,674.50	
	SPH REIT	9,900.00	9,801.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	2,500.00	1,662.50	
	SUNTEC REIT	34,500.00	61,410.00	
シンガポール・ドル	小計	494,100.00	650,835.00 (53,479,112)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	12,804.00	14,084.40	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	15,954.00	24,170.31	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	22,016.00	29,611.52	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	15,233.00	21,554.69	
	STRIDE PROPERTY GROUP	5,671.00	10,661.48	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	5,056.00	10,642.88	
ニュージーランド・ドル	小計	76,734.00	110,725.28 (8,534,705)	
ユーロ	AEDIFICA	279.00	20,897.10	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,936.00	23,754.72	
	ALTAREA	57.00	10,773.00	
	BENI STABILI SPA	15,847.00	11,663.39	
	COVIVIO	826.00	71,944.60	
	EUROCOMMERCIAL-CVA	759.00	22,542.30	
	GECINA SA	784.00	100,900.80	
	GREEN REIT PLC	10,723.00	15,033.64	
	HAMBORNER REIT AG	1,238.00	11,067.72	
	ICADE	700.00	49,630.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	6,700.82	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	6,861.00	58,730.16	
	INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	245.00	4,936.75	
	INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS	245.00	112.70	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	5,442.00	7,836.48	
	KLEPIERRE	3,382.00	98,619.12	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1,439.00	11,972.48	
	MERCIALYS	857.00	10,935.32	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	5,180.00	57,912.40	
	NSI NV	282.00	10,278.90	
	RETAIL ESTATES	98.00	7,134.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,203.00	342,918.98	
	VASTNED RETAIL NV	245.00	8,097.25	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	251.00	28,513.60	
	WERELDHAVE NV	626.00	18,385.62	
	ユーロ 小計	61,631.00	1,011,292.25 (130,436,474)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	31,000.00	165,850.00	
	FORTUNE REIT	21,000.00	186,900.00	
	LINK REIT	35,500.00	2,603,925.00	
	PROSPERITY REIT	18,000.00	50,760.00	
	香港・ドル 小計	105,500.00	3,007,435.00 (43,246,915)	
投資証券 合計			1,984,027,628 (1,984,027,628)	
合計			1,984,027,628 (1,984,027,628)	

(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 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	投資証券 156銘柄	72.66%	73.90%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	5.30%	5.39%
オーストラリア・ドル	投資証券 26銘柄	6.94%	7.05%
カナダ・ドル	投資証券 24銘柄	1.74%	1.77%
シンガポール・ドル	投資証券 28銘柄	2.65%	2.70%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	0.42%	0.43%
ユーロ	投資証券 25銘柄	6.46%	6.57%
香港・ドル	投資証券 4銘柄	2.14%	2.18%

(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

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。



## 「ニッセイ新興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)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	30,054,694
金銭信託	39,227,272
コール・ローン	54,577,078
株式	1,453,862,370
投資信託受益証券	31,654,646
投資証券	4,797,246
派生商品評価勘定	1,617,697
未収入金	2,944,034
未収配当金	964,063
差入委託証拠金	42,137,115
流動資産合計	1,661,836,215
資産合計	1,661,836,215
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,465,541
未払金	2,216,650
未払解約金	16,580,249
その他未払費用	1,401
流動負債合計	20,263,841
負債合計	20,263,841
純資産の部	
元本等	
元本	1,844,866,571
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	203,294,197
純資産合計	1,641,572,374
負債純資産合計	1,661,836,215

## 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、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	（2018年11月20日現在）	
1. 受益権総口数		1,844,866,571口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損		203,294,197円
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.8898円 (8,898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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載し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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式		127,663,938
投資信託受益証券		869,462
投資証券		1,368,636
合計		128,163,112

## （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	（2018年11月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	11,813,763	-	11,808,376	5,387
アメリカ・ドル	11,810,532	-	11,805,150	5,382
マレーシア・リンギット	3,231	-	3,226	5
買 建	85,895,742	-	85,000,313	895,429
アメリカ・ドル	85,895,742	-	85,000,313	895,429
合計	97,709,505	-	96,808,689	890,042

## （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	(2018年11月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	143,158,502	-	144,200,699	1,042,197
合計	143,158,502	-	144,200,699	1,042,197

## (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	(2018年11月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,299,927,274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	764,471,127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	219,531,830円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	995,014,308円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	781,520,587円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	46,427,320円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,257,038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)	1,176,052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)	17,471,266円
計	1,844,866,571円

## 附属明細表(2018年11月20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	51JOB INC-ADR	100	66.05	6,605.00	
	58.COM INC-ADR	339	58.09	19,692.51	
	ALIBABA GROUP HOLDING- SP ADR	3,567	149.53	533,373.51	
	AUTOHOME INC-ADR	134	73.82	9,891.88	
	BAIDU INC - SPON ADR	863	183.09	158,006.67	
	BAOZUN INC-SPN ADR	100	31.08	3,108.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	14.64	7,803.12	
	CREDICORP LTD	182	226.20	41,168.40	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	1,227	26.17	32,110.59	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	100	27.59	2,759.00	
	HUAZHU GROUP LIMITED ADR	300	27.54	8,262.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	2,100	1.22	2,562.00	
	JD.COM INC-ADR	2,250	21.11	47,497.50	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,352	73.04	98,750.08	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	971	13.42	13,030.82	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	418	9.18	3,837.24	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC	1,082	8.09	8,753.38	
	MOMO INC-SPON ADR	366	30.59	11,195.94	
	NETEASE.COM INC -ADR	298	233.28	69,517.44	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO- SP ADR	333	54.83	18,258.39	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	100	40.80	4,080.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	279	182.00	50,778.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	319	24.82	7,917.58	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	319	13.17	4,201.23	
	PJSC GAZPROM ADR	16,724	4.70	78,602.80	
	PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	1,907	17.70	33,753.90	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	149	34.00	5,066.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	3,874	6.40	24,793.60	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	2,860	0.75	2,159.30	
	SBERBANK PAO - SPONSORED ADR	8,782	12.36	108,545.52	
	SEVERSTAL PAO - GDR REG S	550	15.26	8,393.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	1,900	1.36	2,584.00	
SINA CORP	134	60.84	8,152.56		
SOUTHERN COPPER CORP	234	37.27	8,721.18		
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	3,536	4.07	14,391.52		

	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,024	27.56	28,221.44	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	822	69.14	56,833.08	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD -ADR	815	5.70	4,645.50	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	4,273	1.34	5,734.36	
	WEIBO CORP-SPON ADR	134	56.80	7,611.20	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	296	23.82	7,050.72	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,091	35.02	38,206.82	
	YY INC-ADR	134	66.61	8,925.74	
アメリカ・ドル	小計	66,871		1,615,552.52 (182,024,302)	
インド・ルピー	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	1,512	350.55	530,031.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	1,139	220.40	251,035.60	
	ASHOK LEYLAND LTD	2,247	108.80	244,473.60	
	ASIAN PAINTS LTD	766	1,312.15	1,005,106.90	
	AUROBINDO PHARMA LTD	525	794.00	416,850.00	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	275	1,412.55	388,451.25	
	AXIS BANK LTD	5,495	616.30	3,386,568.50	
	BAJAJ AUTO LTD	181	2,679.65	485,016.65	
	BAJAJ FINANCE LTD	465	2,360.95	1,097,841.75	
	BAJAJ FINSERV LTD	80	5,725.95	458,076.00	
	BHARAT FORGE LTD	429	594.85	255,190.65	
	BHARAT HEAVY ELECTROCALCS	1,757	68.00	119,476.00	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	1,562	322.95	504,447.90	
	BHARTI AIRTEL LTD	3,682	336.85	1,240,281.70	
	BHARTI INFRA TEL LTD	733	259.95	190,543.35	
	BOSCH LTD	15	18,706.85	280,602.75	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	56	5,989.55	335,414.80	
	CADILA HEALTHCARE LTD	415	364.05	151,080.75	
	CIPLA LIMITED	742	528.25	391,961.50	
	COAL INDIA LTD	1,406	264.15	371,394.90	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	156	673.55	105,073.80	
	DABUR INDIA LTD	1,011	408.50	412,993.50	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	244	2,528.60	616,978.40	
	EICHER MOTORS LTD	35	24,897.10	871,398.50	
	GAIL INDIA LTD	2,132	334.70	713,580.40	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	289	646.25	186,766.25	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	745	728.35	542,620.75	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	864	849.40	733,881.60	
	HAVELLS INDIA LTD	486	684.50	332,667.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	1,383	1,040.10	1,438,458.30	
	HERO MOTOCORP LTD	100	2,980.65	298,065.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	2,381	234.45	558,225.45	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,253	244.30	306,107.90	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	1,991	1,701.40	3,387,487.40	

HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	4,826	1,899.35	9,166,263.10	
ICICI BANK LTD	6,781	362.40	2,457,434.40	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	666	733.80	488,710.80	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	3,699	142.55	527,292.45	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	10,461	651.70	6,817,433.70	
INTERGLOBE AVIATION LTD	203	1,042.65	211,657.95	
ITC LTD	10,481	284.50	2,981,844.50	
JSW STEEL LTD	1,739	336.65	585,434.35	
LARSEN & TOUBRO LTD	1,349	1,417.20	1,911,802.80	
LIC HOUSING FINANCE LTD	589	457.75	269,614.75	
LUPIN LTD	477	855.50	408,073.50	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	557	436.25	242,991.25	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	2,149	781.35	1,679,121.15	
MARICO LTD	867	352.55	305,660.85	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	330	7,411.65	2,445,844.50	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2,044	152.90	312,527.60	
NESTLE INDIA LTD	62	10,342.65	641,244.30	
NTPC LTD	5,281	152.95	807,728.95	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,676	154.55	413,575.80	
PAGE INDUSTRIES LTD	14	26,532.40	371,453.60	
PETRONET LNG LTD	849	215.85	183,256.65	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	274	1,122.60	307,592.40	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	164	2,361.25	387,245.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	3,524	189.70	668,502.80	
REC LTD	1,368	124.45	170,247.60	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	8,651	1,150.00	9,948,650.00	
SHREE CEMENT LTD	16	15,891.80	254,268.80	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	315	1,220.40	384,426.00	
SIEMENS LTD	143	941.65	134,655.95	
STATE BANK OF INDIA	4,794	288.15	1,381,391.10	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	2,759	531.55	1,466,546.45	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	2,825	1,902.45	5,374,421.25	
TATA MOTORS LTD	4,240	184.60	782,704.00	
TATA POWER CO LTD	2,139	77.35	165,451.65	
TATA STEEL LTD	620	582.40	361,088.00	
TECH MAHINDRA LTD	1,261	732.55	923,745.55	
TITAN CO LTD	643	920.55	591,913.65	
ULTRATECH CEMENT LTD	257	4,031.95	1,036,211.15	
UNITED SPIRITS LTD	610	650.95	397,079.50	
UPL LTD	744	775.20	576,748.80	
VEDANTA LTD	3,049	211.35	644,406.15	



	VODAFONE IDEA LTD	2,827	42.70	120,712.90	
	WIPRO LTD	2,568	332.85	854,758.80	
	YES BANK LTD	4,189	204.80	857,907.20	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	1,097	446.80	490,139.60	
インド・ルピー	小計	141,729		84,117,931.65 (133,747,511)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY TBK PT	27,100	1,485.00	40,243,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	58,400	8,500.00	496,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	30,700	25,100.00	770,570,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	6,700	7,450.00	49,915,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	53,900	7,475.00	402,902,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	15,800	8,400.00	132,720,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	159,900	3,520.00	562,848,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	8,300	2,380.00	19,754,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	16,300	1,210.00	19,723,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	14,400	5,625.00	81,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	1,100	78,200.00	86,020,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	19,900	3,400.00	67,660,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	11,250.00	67,500,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	3,800	19,625.00	74,575,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	4,600	8,775.00	40,365,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	8,500	5,950.00	50,575,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	4,100	4,020.00	16,482,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	41,800	1,540.00	64,372,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	4,700	4,490.00	21,103,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	45,300	610.00	27,633,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	21,500	2,030.00	43,645,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	5,600	11,100.00	62,160,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	11,100	1,830.00	20,313,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	143,800	3,950.00	568,010,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	4,000	4,040.00	16,160,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	3,200	41,300.00	132,160,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	3,500	34,400.00	120,400,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	8,800	1,630.00	14,344,000.00	
インドネシア・ルピア	小計	732,800		4,069,553,000.00 (31,742,513)	
オフショア・人民元	CHINA MERCHANTS BANK-A	800	28.95	23,160.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	100	569.02	56,902.00	

	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	400	65.72	26,288.00	
オフショア・人民元 小計		1,300		106,350.00 (1,727,124)	
コロンビア・ペ ソ	BANCOLOMBIA SA	498	33,480.00	16,673,040.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,206	33,400.00	40,280,400.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	871	7,140.00	6,218,940.00	
	ECOPETROL SA	12,689	3,190.00	40,477,910.00	
	GRUPO ARGOS SA	540	16,100.00	8,694,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	7,675	1,175.00	9,018,125.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	521	33,000.00	17,193,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	239	31,460.00	7,518,940.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	814	13,120.00	10,679,680.00	
コロンビア・ペソ 小計		25,053		156,754,035.00 (5,564,768)	
タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	2,800	180.50	505,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	12,500	65.25	815,625.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	500	206.00	103,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	7,400	25.00	185,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	14,400	8.65	124,560.00	
	BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	3,800	17.50	66,500.00	
	BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	2,400	51.00	122,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	11,100	9.40	104,340.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	600	188.50	113,100.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	3,000	74.25	222,750.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	5,800	25.00	145,000.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	14,200	69.50	986,900.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	1,000	69.00	69,000.00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	200	236.00	47,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	2,200	49.00	107,800.00	
	GLOW ENERGY PCL -FOREIGN	1,000	87.50	87,500.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	7,400	15.00	111,000.00	
	INDORAMA VENTURES-FOREIGN	3,000	54.50	163,500.00	
	IRPC PCL - FOREIGN	18,400	5.75	105,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	5,400	196.50	1,061,100.00	
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	6,700	19.80	132,660.00		

	LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	8,700	10.20	88,740.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	4,100	35.00	143,500.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	3,700	132.50	490,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	5,900	77.75	458,725.00	
	PTT PCL/FOREIGN	32,000	48.75	1,560,000.00	
	ROBINSON PCL-FOREIGN	1,000	67.50	67,500.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	900	440.00	396,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	5,200	136.50	709,800.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	2,400	76.25	183,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-F	3,700	18.40	68,080.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	27,100	2.32	62,872.00	
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	20,200	5.85	118,170.00	
タイ・パーツ 小計		238,700		9,726,772.00 (33,168,292)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	387	559.00	216,333.00	
	KOMERCNI BANKA AS	188	907.00	170,516.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	79.15	88,964.60	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	169	226.00	38,194.00	
チェコ・コルナ 小計		1,868		514,007.60 (2,549,477)	
チリ・ペソ	AGUAS ANDINAS SA-A	4,650	386.24	1,796,016.00	
	BANCO DE CHILE	68,939	98.60	6,797,385.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6	2,395.40	14,372.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	79	43,967.00	3,473,393.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	178,052	52.49	9,345,949.48	
	CENCOSUD SA	2,743	1,359.50	3,729,108.50	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	8,430.00	2,301,390.00	
	COLBUN SA	13,714	138.67	1,901,720.38	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	470	2,420.10	1,137,447.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	269	5,510.40	1,482,297.60	
	EMPRESAS CMPC SA	2,486	2,462.30	6,121,277.80	
	EMPRESAS COPEC SA	927	9,774.30	9,060,776.10	
	ENEL CHILE SA	60,487	63.22	3,823,988.14	
	ENERSIS SA	58,878	111.29	6,552,532.62	
	ITAU CORPBANCA	257,531	6.36	1,639,957.40	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	613	6,398.90	3,922,525.70	
	S.A.C.I. FALABELLA	1,858	5,225.80	9,709,536.40	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	314	29,487.00	9,258,918.00		
チリ・ペソ 小計		652,289		82,068,591.92 (13,828,557)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	4,636	7.49	34,723.64	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	403	20.64	8,317.92	
	ARCELIK AS	433	15.39	6,663.87	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	380	26.94	10,237.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	437	83.05	36,292.85	
	COCA-COLA ICECEK AS	152	28.06	4,265.12	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	2,891	8.76	25,325.16	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	53.90	8,462.30	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	1,803	7.82	14,099.46	
	KOC HOLDING AS	1,525	15.00	22,875.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	1,378	5.15	7,096.70	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	294	26.06	7,661.64	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	271	16.97	4,598.87	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	254	125.10	31,775.40	
	TURK HAVA YOLLARI AO	997	16.35	16,300.95	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	1,339	5.18	6,936.02	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	2,283	12.09	27,601.47	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	4,865	8.09	39,357.85	
	TURKIYE HALK BANKASI	1,174	7.15	8,394.10	
	TURKIYE IS BANKASI-C	3,028	4.09	12,384.52	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	1,413	3.67	5,185.71	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	304	15.37	4,672.48	
	YAPI VE KREDI BANKASI	1,678	1.65	2,768.70	
トルコ・リラ 小計		32,095		345,996.93 (7,335,135)	
ハンガリー・フォロント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	623	3,096.00	1,928,808.00	
	OTP BANK RT	665	11,450.00	7,614,250.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	280	5,325.00	1,491,000.00	
ハンガリー・フォロント 小計		1,568		11,034,058.00 (4,430,174)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	3,670	46.85	171,939.50	
	ABOITIZ POWER CORP	2,800	32.50	91,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	7,500	10.76	80,700.00	
	AYALA CORPORATION	535	945.50	505,842.50	
	AYALA LAND INC	19,700	39.90	786,030.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,590	88.70	141,033.00	
	BDO UNIBANK INC	5,360	129.70	695,192.00	
	DMCI HOLDINGS INC	7,100	13.10	93,010.00	
	GLOBE TELECOM INC	65	1,999.00	129,935.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	176	860.00	151,360.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	950	95.30	90,535.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	5,960	47.00	280,120.00	

	JOLLIBEE FOODS CORP	800	282.00	225,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	440	384.00	168,960.00	
	MEGAWORLD CORP	22,900	4.62	105,798.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	28,100	4.65	130,665.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	1,280	72.15	92,352.00	
	PLDT INC	165	1,236.00	203,940.00	
	ROBINSONS LAND CO	3,400	21.00	71,400.00	
	SECURITY BANK CORP	450	146.50	65,925.00	
	SM INVESTMENTS CORP	495	928.00	459,360.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	27,300	32.90	898,170.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	1,720	131.00	225,320.00	
	フィリピン・ペソ 小計	142,456		5,864,187.00 (12,549,360)	
ブラジル・リアル	AMBEV SA	14,400	16.46	237,024.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	800	16.41	13,128.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	2,890	32.87	94,994.30	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	10,340	37.06	383,200.40	
	BANCO DO BRASIL SA	2,400	44.10	105,840.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	1,000	42.76	42,760.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	1,500	26.64	39,960.00	
	BM&FBOVESPA SA	6,000	26.26	157,560.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,800	12.25	22,050.00	
	BRASKEM SA-PREF A	300	53.65	16,095.00	
	BRF SA	1,000	20.16	20,160.00	
	CCR SA	2,600	10.67	27,742.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	400	27.77	11,108.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	400	24.50	9,800.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	300	80.71	24,213.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,700	11.65	19,805.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	600	27.75	16,650.00	
	CIELO SA	2,700	9.26	25,002.00	
	COSAN SA	300	33.67	10,101.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	600	13.80	8,280.00	
	EMBRAER SA	1,400	20.20	28,280.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	300	41.90	12,570.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	400	71.00	28,400.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	700	71.04	49,728.00	
	GERDAU SA-PREF	2,200	16.15	35,530.00	
	HYPERA S.A	600	29.75	17,850.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	300	72.89	21,867.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	9,900	52.72	521,928.00	

ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	13,730	12.07	165,721.10	
JBS SA	1,600	10.85	17,360.00	
KLABIN SA - UNIT	1,900	17.40	33,060.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	2,900	10.83	31,407.00	
LOCALIZA RENT A CAR	1,100	28.37	31,207.00	
LOJAS AMERICANAS SA- PREF	1,500	17.79	26,685.00	
LOJAS RENNER S.A.	2,200	39.62	87,164.00	
M DIAS BRANCO SA	200	43.64	8,728.00	
MAGAZINE LUIZA SA	200	156.15	31,230.00	
MULTIPLAN EMPREENHIMENTOS	600	22.57	13,542.00	
NATURA COSMETICOS SA	300	37.33	11,199.00	
ODONTOPREV S.A.	500	14.10	7,050.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	8,500	28.03	238,255.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	12,000	26.00	312,000.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	800	23.46	18,768.00	
PORTO SEGURO SA	200	52.74	10,548.00	
RAIA DROGASIL SA	600	63.50	38,100.00	
RUMO SA	2,400	17.39	41,736.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	400	24.84	9,936.00	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	1,200	37.40	44,880.00	
TELEF BRASIL	1,000	45.00	45,000.00	
TIM PARTICIPACOES SA	1,800	11.69	21,042.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	900	43.60	39,240.00	
VALE SA	9,667	55.37	535,261.79	
WEG SA	2,260	18.20	41,132.00	
ブラジル・リアル 小計	136,287		3,861,877.59 (115,624,615)	
ポーランド・ズ ロチ				
ALIOR BANK SA	185	52.00	9,620.00	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	75	70.50	5,287.50	
BANK MILLENNIUM SA	1,249	9.30	11,615.70	
BANK PEKAO SA	472	102.55	48,403.60	
CCC SA	57	178.20	10,157.40	
CD PROJEKT SA	139	134.00	18,626.00	
CYFROWY POLSAT SA	430	21.68	9,322.40	
DINO POLSKA SA	96	85.00	8,160.00	
GRUPA AZOTY SA	89	26.40	2,349.60	
GRUPA LOTOS SA	178	74.86	13,325.08	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	101	77.56	7,833.56	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	291	91.24	26,550.84	
LPP SA	2	7,590.00	15,180.00	
MBANK SA	30	394.20	11,826.00	
ORANGE POLSKA SA	1,329	4.54	6,033.66	
PGE SA	1,780	12.19	21,698.20	
PKO BANK POLSKI SA	2,716	39.14	106,304.24	
PLAY COMMUNICATIONS SA	233	16.73	3,898.09	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	855	101.80	87,039.00	

	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	3,644	6.25	22,775.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	1,623	39.50	64,108.50	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	76	351.80	26,736.80	
ポーランド・ズロチ	小計	15,650		536,851.17 (15,992,796)	
マレーシア・リンギット	AIRASIA GROUP BERHAD	2,500	3.11	7,775.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	2,000	3.90	7,800.00	
	AMBANK HOLDINGS BHD	3,200	4.15	13,280.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	2,800	1.22	3,416.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	5,700	3.51	20,007.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	300	38.28	11,484.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	12,600	5.73	72,198.00	
	DIALOG GROUP BHD	9,900	3.23	31,977.00	
	DIGI.COM BHD	6,500	4.32	28,080.00	
	FGV HOLDINGS BHD	2,900	1.21	3,509.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	300	33.40	10,020.00	
	GAMUDA BHD	3,100	2.48	7,688.00	
	GENTING BHD	4,500	6.95	31,275.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	5,900	3.61	21,299.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	500	9.78	4,890.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	1,100	9.90	10,890.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	2,600	6.20	16,120.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	1,300	20.70	26,910.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	400	19.62	7,848.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	6,300	4.81	30,303.00	
	IJM CORP BHD	5,200	1.73	8,996.00	
	IOI CORPORATION BHD	4,400	4.33	19,052.00	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	3,500	1.69	5,915.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,100	24.90	27,390.00	
	MALAYAN BANKING BHD	12,200	9.50	115,900.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,600	7.98	12,768.00	
	MAXIS BHD	6,200	5.41	33,542.00	
	MISC BHD	2,400	6.60	15,840.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	100	147.80	14,780.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	6,200	9.31	57,722.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	400	27.16	10,864.00	
	PETRONAS GAS BHD	1,500	18.80	28,200.00	
	PPB GROUP BERHAD	1,080	17.06	18,424.80	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	2,400	5.00	12,000.00	
	PUBLIC BANK BHD	9,100	25.00	227,500.00	
	RHB BANK BHD	1,600	5.19	8,304.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.41	11,568.00	

	SIME DARBY PLANTATION BHD	5,200	5.29	27,508.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	4,800	0.99	4,776.00	
	SP SETIA BHD	2,300	2.14	4,922.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	2,200	2.26	4,972.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	9,700	14.86	144,142.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	3,000	5.78	17,340.00	
	UMW HOLDINGS BHD	1,100	4.99	5,489.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,800	3.73	6,714.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	8,340	1.14	9,507.60	
マレーシア・リングgit	小計	176,620		1,220,905.40 (32,842,355)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	6,300	21.41	134,883.00	
	ALSEA SAB DE CV	1,100	47.55	52,305.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	102,300	13.59	1,390,257.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,000	105.09	105,090.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	3,500	25.99	90,965.00	
	CEMEX SAB-CPO	41,700	10.14	422,838.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	1,100	123.43	135,773.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	300	131.51	39,453.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	6,000	174.11	1,044,660.00	
	GRUMA S.A.B.-B	420	232.25	97,545.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	435	293.33	127,598.55	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	900	144.59	130,131.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	3,500	38.81	135,835.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	64.31	57,879.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	8,100	98.24	795,744.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	4,900	27.11	132,839.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	10,700	44.02	471,014.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	6,900	60.29	416,001.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	360	267.02	96,127.20	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	1,100	74.94	82,434.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	2,900	29.91	86,739.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	2,000	51.34	102,680.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	430	185.06	79,575.80	
	WALMART DE MEXICO-SER V	14,900	49.77	741,573.00	
メキシコ・ペソ	小計	221,745		6,969,939.55 (38,613,465)	
ユーロ	FF GROUP	129	4.80	619.20	



	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	793	10.20	8,088.60	
	JUMBO SA	317	13.06	4,140.02	
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	250	20.25	5,062.50	
	OPAP SA	662	8.15	5,398.61	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	175	19.76	3,458.00	
ユーロ 小計		2,326		26,766.93 (3,452,398)	
韓国・ウォン	AMOREPACIFIC CORP	79	158,000.00	12,482,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	17	89,800.00	1,526,600.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	60	61,400.00	3,684,000.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	177,500.00	2,662,500.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	506	7,830.00	3,961,980.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	73	77,500.00	5,657,500.00	
	CELLTRION INC	247	229,000.00	56,563,000.00	
	CELLTRION PHARM INC	34	69,600.00	2,366,400.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	23,100.00	3,049,200.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	15	352,500.00	5,287,500.00	
	CJ CORP	28	129,500.00	3,626,000.00	
	CJ ENM CO LTD	28	219,500.00	6,146,000.00	
	CJ LOGISTICS	16	149,500.00	2,392,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	53	88,100.00	4,669,300.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	241	4,855.00	1,170,055.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	133	107,000.00	14,231,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	105	72,100.00	7,570,500.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	326	8,920.00	2,907,920.00	
	DONGSUH COMPANIES INC	66	17,200.00	1,135,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	69	36,800.00	2,539,200.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	102	10,650.00	1,086,300.00	
	E-MART CO LTD	43	194,500.00	8,363,500.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	96	42,650.00	4,094,400.00	
	GS HOLDINGS CORP	105	51,500.00	5,407,500.00	
	GS RETAIL CO LTD	52	36,500.00	1,898,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	847	38,650.00	32,736,550.00	
	HANKOOK TIRE CO LTD	158	43,300.00	6,841,400.00	
	HANMI PHARM CO LTD	13	448,000.00	5,824,000.00	
	HANMI SCIENCE CO LTD	25	72,500.00	1,812,500.00	
	HANON SYSTEMS	373	10,600.00	3,953,800.00	
	HANSSEM CO LTD	20	58,400.00	1,168,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	221	17,850.00	3,944,850.00	
	HANWHA CORPORATION	83	30,200.00	2,506,600.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	521	4,545.00	2,367,945.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	67	41,100.00	2,753,700.00	
	HLB INC	69	86,100.00	5,940,900.00	
	HOTEL SHILLA CO LTD	61	85,400.00	5,209,400.00	
	HYUNDAI DEPT STORE CO	26	92,000.00	2,392,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	207	54,000.00	11,178,000.00	

HYUNDAI GLOVIS CO LTD	35	119,000.00	4,165,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	101	134,500.00	13,584,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	21	376,000.00	7,896,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	123	42,700.00	5,252,100.00	
HYUNDAI MOBIS	196	191,000.00	37,436,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	474	101,500.00	48,111,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	78	68,600.00	5,350,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	45	63,200.00	2,844,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	165	44,100.00	7,276,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	531	14,900.00	7,911,900.00	
KANGWON LAND INC	241	30,250.00	7,290,250.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	1,213	46,900.00	56,889,700.00	
KCC CORP	11	280,000.00	3,080,000.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	44	29,250.00	1,287,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	656	29,700.00	19,483,200.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	144	33,050.00	4,759,200.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	633	27,350.00	17,312,550.00	
KOREA GAS CORPORATION	54	50,200.00	2,710,800.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	83	68,700.00	5,702,100.00	
KOREA ZINC CO LTD	17	436,500.00	7,420,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	87	32,600.00	2,836,200.00	
KT&G CORP	334	100,000.00	33,400,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	35	89,800.00	3,143,000.00	
LG CHEM LTD	132	345,500.00	45,606,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	15	196,500.00	2,947,500.00	
LG CORP	250	72,800.00	18,200,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	484	17,600.00	8,518,400.00	
LG ELECTRONICS INC	261	71,600.00	18,687,600.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	29	1,174,000.00	34,046,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	4	694,000.00	2,776,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	28	101,000.00	2,828,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	284	13,650.00	3,876,600.00	
LG UPLUS CORP	567	15,450.00	8,760,150.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	45	291,500.00	13,117,500.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	57	55,300.00	3,152,100.00	
LOTTE SHOPPING CO	22	227,000.00	4,994,000.00	
MEDY-TOX INC	8	557,200.00	4,457,600.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	785	6,800.00	5,338,000.00	
NAVER CORP	427	111,500.00	47,610,500.00	
NCSOFT CORPORATION	47	467,500.00	21,972,500.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	123,000.00	7,134,000.00	

OCI CO LTD	32	98,300.00	3,145,600.00	
ORANGE LIFE INSURANCE, LTD.	65	31,950.00	2,076,750.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	43	100,000.00	4,300,000.00	
OTTOGI CORPORATION	2	712,000.00	1,424,000.00	
PEARL ABYSS CORP	13	187,300.00	2,434,900.00	
POSCO	239	260,500.00	62,259,500.00	
POSCO DAEWOO CORP	69	19,750.00	1,362,750.00	
S-1 CORPORATION	32	96,000.00	3,072,000.00	
S-OIL CORPORATION	94	111,500.00	10,481,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	44	334,500.00	14,718,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	217	104,000.00	22,568,000.00	
SAMSUNG CARD CO	58	33,250.00	1,928,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	140	114,500.00	16,030,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	14,637	43,650.00	638,905,050.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	2,604	35,850.00	93,353,400.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	349	18,000.00	6,282,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	89	279,500.00	24,875,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1,171	7,650.00	8,958,150.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	188	90,800.00	17,070,400.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	156	222,500.00	34,710,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	93	190,000.00	17,670,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	135	29,200.00	3,942,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,315	42,400.00	55,756,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	14	290,000.00	4,060,000.00	
SILLAJEN INC	111	75,800.00	8,413,800.00	
SK HOLDINGS CO LTD	78	280,000.00	21,840,000.00	
SK HYNIX INC	1,771	69,800.00	123,615,800.00	
SK INNOVATION CO LTD	185	203,000.00	37,555,000.00	
SK TELECOM CO LTD	42	276,000.00	11,592,000.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	417	4,475.00	1,866,075.00	
VIROMED CO LTD	30	201,700.00	6,051,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	109	74,400.00	8,109,600.00	
WOORI BANK	1,257	15,850.00	19,923,450.00	
YUHAN CORP	16	254,500.00	4,072,000.00	
韓国・ウォン 小計	39,971		2,106,694,175.00 (210,669,418)	
香港・ドル				
3SBIO INC	2,500	12.38	30,950.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2,000	56.00	112,000.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	4,000	10.00	40,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	90,000	3.51	315,900.00	
AIR CHINA LIMITED-H	4,000	7.51	30,040.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	10,000	7.63	76,300.00	

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	20,000	1.19	23,800.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	6,000	2.99	17,940.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	2,000	6.37	12,740.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,000	39.85	159,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,000	36.35	109,050.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	5.94	23,760.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	4,000	4.59	18,360.00	
BANK OF CHINA LTD - H	242,000	3.39	820,380.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	24,000	5.94	142,560.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	8.95	35,800.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,000	45.00	45,000.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	4.35	69,600.00	
BOC AVIATION LTD	500	62.30	31,150.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	8,000	6.89	55,120.00	
BYD CO LTD	1,500	58.50	87,750.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	1,000	11.26	11,260.00	
CGN POWER CO LTD-H	20,000	1.97	39,400.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	18,000	2.07	37,260.00	
CHINA CITIC BANK	24,000	5.04	120,960.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	10,000	7.90	79,000.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	4,000	7.05	28,200.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	4,500	23.45	105,525.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	293,000	6.56	1,922,080.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	5,500	3.16	17,380.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	5,000	3.53	17,650.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	9,000	7.12	64,080.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	2,000	14.86	29,720.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	7,000	20.00	140,000.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	8,000	3.17	25,360.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6,500	4.28	27,820.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	5,200	25.75	133,900.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	21,000	1.61	33,810.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	2,400	14.88	35,712.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	12,000	3.64	43,680.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	23,000	16.88	388,240.00	
CHINA LITERATURE LTD	400	46.45	18,580.00	

CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	6,000	5.98	35,880.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	3,000	9.67	29,010.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	8,000	24.45	195,600.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	12,000	31.80	381,600.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	4,000	14.92	59,680.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	14,400	5.87	84,528.00	
CHINA MOBILE LTD/HK	18,500	77.25	1,429,125.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,000	3.23	19,380.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	8,000	5.89	47,120.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	4,000	7.21	28,840.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	12,000	27.50	330,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	7,600	30.20	229,520.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	78,000	6.77	528,060.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	14,000	17.10	239,400.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	10,000	1.82	18,200.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	9,000	7.70	69,300.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION-H	4,000	10.88	43,520.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	13,000	1.56	20,280.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	4,000	29.75	119,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	6,000	7.12	42,720.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	2,000	29.45	58,900.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	10,000	29.80	298,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	4,000	12.30	49,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	4,000	14.84	59,360.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	10,000	18.68	186,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	4,000	5.28	21,120.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	4,000	6.29	25,160.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	4,400	26.25	115,500.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	42,000	4.15	174,300.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	90,000	1.18	106,200.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	5.39	32,340.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	18,000	8.85	159,300.00	

CHINA VANKE CO LTD-H	2,600	28.00	72,800.00	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	40,000	0.23	9,400.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	5,000	4.55	22,750.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	8,000	3.69	29,520.00	
CITIC LTD	16,000	12.48	199,680.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	5,000	15.22	76,100.00	
CNOOC LTD	54,000	13.34	720,360.00	
COSCO PACIFIC LTD	2,000	7.97	15,940.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	23,000	9.38	215,740.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	3,000	11.64	34,920.00	
CRRC CORP LTD H	9,000	7.31	65,790.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	4,500	6.06	27,270.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	8,000	7.75	62,000.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2,000	69.95	139,900.00	
FAR EAST HORIZON LTD	4,000	7.68	30,720.00	
FOSUN INTERNATIONAL	5,500	12.86	70,730.00	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	12,500	3.09	38,625.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	4,000	4.85	19,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	800	25.35	20,280.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	25,000	0.54	13,500.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	15,000	15.16	227,400.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	2,000	14.46	28,920.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	3,000	11.98	35,940.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	20,000	0.68	13,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	6,500	4.83	31,395.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	2,000	6.16	12,320.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	8,000	14.42	115,360.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	5,600	8.06	45,136.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,600	11.98	19,168.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	1,400	16.94	23,716.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	3,000	18.40	55,200.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1,000	17.14	17,140.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6,800	8.60	58,480.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	2,000	63.05	126,100.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1,000	16.12	16,120.00	

HUANENG POWER INTL INC-H	8,000	4.85	38,800.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	8,000	2.38	19,040.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	3,400	13.92	47,328.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	210,000	5.45	1,144,500.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	10.80	21,600.00	
JIANGXI COPPER CO LTD- H	2,000	9.37	18,740.00	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	2,000	14.96	29,920.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	2,000	22.45	44,900.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	6.80	17,000.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	4,000	7.64	30,560.00	
KINGSOFT CORP LTD	1,000	12.84	12,840.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	6,000	9.31	55,860.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	6,500	6.51	42,315.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	3,000	6.98	20,940.00	
LEGEND GROUP LTD	18,000	5.86	105,480.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	1,000	23.50	23,500.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	4,000	8.55	34,200.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	4,000	21.70	86,800.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	2,500	6.45	16,125.00	
MEITU INC	2,500	4.35	10,875.00	
MMG LTD	4,000	3.65	14,600.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	2,200	36.50	80,300.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	2,000	11.86	23,720.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	7.95	23,850.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	15,000	3.50	52,500.00	
PETROCHINA CO LTD-H	64,000	5.67	362,880.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	19,000	8.20	155,800.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	16,000	76.80	1,228,800.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	7,000	4.58	32,060.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	6,000	6.85	41,100.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	4,000	7.46	29,840.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	4,000	2.76	11,040.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	1,000	28.35	28,350.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	1,000	17.54	17,540.00	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,300	19.12	24,856.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	2,000	15.34	30,680.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	8,000	2.55	20,400.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2,000	94.90	189,800.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	3,000	18.50	55,500.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	8,000	1.73	13,840.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	18,000	7.51	135,180.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	6,000	3.43	20,580.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	3,000	7.18	21,540.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	6,000	3.70	22,200.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	2,800	39.20	109,760.00	
SOHO CHINA LTD	4,500	3.08	13,860.00	
SSY GROUP LTD	4,000	8.21	32,840.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	5,500	9.12	50,160.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	6,000	25.05	150,300.00	
SUNNY OPTICAL TECH	2,100	77.60	162,960.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	17,400	291.20	5,066,880.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	4,000	13.22	52,880.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	2,000	20.20	40,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	7.72	23,160.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	11,000	5.58	61,380.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	3,000	8.68	26,040.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,500	67.70	101,550.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	6,000	3.05	18,300.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	4,000	7.73	30,920.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	16,000	1.40	22,400.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	3,500	7.06	24,710.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	6.35	12,700.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	1,000	15.10	15,100.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	1,200	43.15	51,780.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	2.89	52,020.00	
ZTE CORP-H	1,200	16.46	19,752.00	
香港・ドル 小計	2,304,300		24,123,711.00 (346,898,964)	
台湾・ドル				
ACER INC	5,000	19.50	97,500.00	
ADVANTECH CO LTD	1,000	226.00	226,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	10,000	59.70	597,000.00	



ASIA CEMENT CORP	4,000	33.65	134,600.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	2,000	215.00	430,000.00	
AU OPTRONICS CORP	17,000	12.75	216,750.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	264.00	528,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	25,000	51.00	1,275,000.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	3,040	94.70	287,888.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	11,440	18.00	205,920.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	4,000	40.00	160,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	1,005	61.10	61,405.50	
CHINA AIRLINES LTD	4,000	10.30	41,200.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	37,000	10.05	371,850.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	5,300	30.00	159,000.00	
CHINA STEEL CORP	37,000	24.50	906,500.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	13,000	106.50	1,384,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	8,000	17.70	141,600.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	55,000	21.35	1,174,250.00	
DELTA ELECTRONICS INC	7,000	127.50	892,500.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	31,164	21.15	659,118.60	
EVA AIRWAYS CORP	3,150	14.80	46,620.00	
EVERGREEN MARINE	3,150	11.70	36,855.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	6,000	29.45	176,700.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	4,000	73.90	295,600.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,000	192.00	192,000.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	27,270	20.45	557,671.50	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	10,000	108.00	1,080,000.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	3,000	115.00	345,000.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	14,000	102.00	1,428,000.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	1,000	34.00	34,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	2,000	62.50	125,000.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	20,000	51.50	1,030,000.00	
GIANT MANUFACTURING	1,000	147.50	147,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	296.00	296,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	2,000	46.45	92,900.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,000	228.00	228,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	35,200	73.40	2,583,680.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	231.00	231,000.00	
HTC CORP	1,000	41.85	41,850.00	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	21,720	17.80	386,616.00	
INNOLUX CORPORATION	18,000	10.25	184,500.00	
INVENTEC CO LTD	4,000	22.55	90,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	4,000	38.70	154,800.00	
MACRONIX INTERNATIONAL	3,060	18.95	57,987.00	
MEDIATEK INC	5,000	223.50	1,117,500.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	32,000	26.50	848,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	1,000	65.50	65,500.00	
NAN YA PLASTICS CORP	15,000	78.80	1,182,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	2,000	57.50	115,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	2,000	129.00	258,000.00	
PEGATRON CORP	4,000	52.50	210,000.00	
POU CHEN	4,000	33.35	133,400.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	1,000	70.90	70,900.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	320.00	640,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	7,000	49.65	347,550.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	1,000	126.50	126,500.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,200	47.25	56,700.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	600	84.20	50,520.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	17,244	10.30	177,613.20	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	24,480	10.80	264,384.00	
STANDARD FOODS CORP	1,000	48.80	48,800.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	2,000	33.75	67,500.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	27,931	13.95	389,637.45	
TAIWAN BUSINESS BANK	8,320	10.75	89,440.00	
TAIWAN CEMENT	11,800	36.50	430,700.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	24,510	18.00	441,180.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	3,000	32.85	98,550.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	4,000	109.50	438,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	75,000	222.00	16,650,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	3,000	17.00	51,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	15,000	76.20	1,143,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	31,000	11.10	344,100.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	2,000	60.10	120,200.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	1,000	166.50	166,500.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	1,000	102.00	102,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	5,000	13.95	69,750.00	
WISTRON CORP	5,146	19.70	101,376.20	

	WPG HOLDINGS LTD	2,760	37.30	102,948.00	
	YAGEO CORPORATION	1,000	317.50	317,500.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	22,000	15.80	347,600.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	1,000	78.10	78,100.00	
台湾・ドル	小計	837,490		47,054,510.45 (171,278,418)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	2,216	159.13	352,632.08	
	ANGLO PLATINUM LTD	142	479.28	68,057.76	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	948	139.10	131,866.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	961	150.03	144,178.83	
	BID CORP LTD	879	283.13	248,871.27	
	BIDVEST GROUP LTD	883	197.42	174,321.86	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	86	1,102.96	94,854.56	
	CLICKS GROUP LTD	552	186.48	102,936.96	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	445	44.88	19,971.60	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	746	165.20	123,239.20	
	EXXARO RESOURCES LTD	481	152.56	73,381.36	
	FIRSTRAND LTD	10,343	69.05	714,184.15	
	GOLD FIELDS LTD	1,963	41.80	82,053.40	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	306	143.00	43,758.00	
	INVESTEC LTD	523	90.99	47,587.77	
	KUMBA IRON ORE LTD	123	298.00	36,654.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	231	108.60	25,086.60	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	2,421	25.07	60,694.47	
	MMI HOLDINGS LTD	1,761	18.50	32,578.50	
	MONDI LTD	237	324.31	76,861.47	
	MR PRICE GROUP LTD	673	233.83	157,367.59	
	MTN GROUP LTD	4,827	85.11	410,825.97	
	NASPERS LTD-N SHS	1,332	2,825.00	3,762,900.00	
	NEDBANK GROUP LTD	1,028	265.46	272,892.88	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	791	117.50	92,942.50	
	NETWORK HEALTHCARE HOLDINGS	1,837	25.70	47,210.90	
	OLD MUTUAL LTD	15,106	23.32	352,271.92	
	PICK N PAY STORES LTD	671	69.13	46,386.23	
	PIONEER FOODS GROUP LTD	244	78.29	19,102.76	
	PSG GROUP LTD	405	235.37	95,324.85	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	1,292	36.65	47,351.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	328	209.37	68,673.36	
	REMGRO LTD	1,311	201.30	263,904.30	
	RMB HOLDINGS LTD	1,472	80.31	118,216.32	
	SANLAM LIMITED	5,295	78.76	417,034.20	
	SAPPI LIMITED	1,124	82.49	92,718.76	
	SASOL LTD	1,683	442.00	743,886.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	1,161	191.05	221,809.05	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	354	179.00	63,366.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	3,959	171.70	679,760.30	
	TELKOM SA SOC LTD	465	55.75	25,923.75	

	THE FOSCHINI GROUP LTD	452	164.56	74,381.12	
	TIGER BRANDS LTD	338	278.00	93,964.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	891	83.77	74,639.07	
	VODACOM GROUP LTD	1,596	122.02	194,743.92	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	2,023	53.62	108,473.26	
南アフリカ・ランド 小計		76,905		11,199,841.45 (89,822,728)	
合計		5,848,023		1,453,862,370 (1,453,862,370)	

## 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	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	9,140.00	172,746.00		
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	7,204.00	108,204.08		
	アメリカ・ドル 小計		16,344.00	280,950.08 (31,654,646)		
投資信託受益証券 合計				280,950.08 (31,654,646)		
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	3,872.00	6,504.96		
	トルコ・リラ 小計		3,872.00	6,504.96 (137,905)		
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8,900.00	194,910.00		
	メキシコ・ペソ 小計		8,900.00	194,910.00 (1,079,801)		
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-A		1,927.00	33,125.13	
		FORTRESS REIT LTD-B		1,865.00	28,385.30	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		6,665.00	158,027.15	
		HYPROP INVESTMENTS LTD- UTS		485.00	43,223.20	
		REDEFINE PROPERTIES LTD		14,324.00	143,812.96	
	南アフリカ・ランド 小計		631.00	39,753.00		
南アフリカ・ランド 小計		25,897.00	446,326.74 (3,579,540)			
投資証券 合計				4,797,246 (4,797,246)		
合計				36,451,892 (36,451,892)		

(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	組入 投資信託 受益証券 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 43銘柄 投資信託 2銘柄 受益証券	11.09% -%	-% -%	-% 1.93%	14.34%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.15%	-%	-%	8.97%
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	1.93%	-%	-%	2.13%
オフショア・人民元	株式 3銘柄	0.11%	-%	-%	0.12%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.34%	-%	-%	0.37%
タイ・バーツ	株式 33銘柄	2.02%	-%	-%	2.23%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.16%	-%	-%	0.17%
チリ・ペソ	株式 18銘柄	0.84%	-%	-%	0.93%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	0.45% -%	-% 0.01%	-% -%	0.50%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	0.76%	-%	-%	0.84%
ブラジル・レアル	株式 53銘柄	7.04%	-%	-%	7.76%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	0.97%	-%	-%	1.07%
マレーシア・リングgit	株式 46銘柄	2.00%	-%	-%	2.20%
メキシコ・ペソ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	2.35% -%	-% 0.07%	-% -%	2.66%
ユーロ	株式 6銘柄	0.21%	-%	-%	0.23%
韓国・ウォン	株式 114銘柄	12.83%	-%	-%	14.14%
香港・ドル	株式 175銘柄	21.13%	-%	-%	23.28%
台湾・ドル	株式 82銘柄	10.43%	-%	-%	11.49%
南アフリカ・ランド	株式 46銘柄 投資証券 6銘柄	5.47% -%	-% 0.22%	-% -%	6.27%

(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。

## 「ニッセイ新興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)

	(2018年11月20日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	12,770,048
金銭信託	998,162
コール・ローン	1,388,748
国債証券	966,387,788
未収入金	40,041
未収利息	13,352,115
前払費用	316,884
流動資産合計	995,253,786
資産合計	995,253,786
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,528
未払解約金	89,792
その他未払費用	42
流動負債合計	112,362
負債合計	112,362
純資産の部	
元本等	
元本	1,012,672,810
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	17,531,386
純資産合計	995,141,424
負債純資産合計	995,253,786

## 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	(2018年11月20日現在)	
1. 受益権総口数		1,012,672,810口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損		17,531,386円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		0.9827円 (9,827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 2018年2月13日 至 2018年11月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載し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。



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（2018年11月20日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		91,377,247
合計		91,377,247

## （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	（2018年11月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	2,093,042	-	2,070,514	22,528
アメリカ・ドル	2,093,042	-	2,070,514	22,528
合計	2,093,042	-	2,070,514	22,528

## （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	（2018年11月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	999,909,334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	20,717,858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	7,954,382円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	997,054,316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）	15,618,494円
計	1,012,672,810円

## 附属明細表（2018年11月20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	CROATIA 6 2024/01/26	240,000.00	258,247.20	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 4.25 2025/01/07	200,000.00	193,234.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 4.875 2021/01/22	100,000.00	101,875.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.625 2041/01/07	100,000.00	92,250.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.625 2047/02/21	200,000.00	181,300.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 6 2026/04/07	200,000.00	209,720.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 7.125 2037/01/20	100,000.00	110,026.00	
		HUNGARY 5.375 2023/02/21	60,000.00	62,640.00	
		HUNGARY 5.375 2024/03/25	70,000.00	73,771.60	
		HUNGARY 5.75 2023/11/22	60,000.00	63,808.80	
		HUNGARY 6.25 2020/01/29	80,000.00	82,400.00	
		HUNGARY 6.375 2021/03/29	80,000.00	84,443.20	
		HUNGARY 7.625 2041/03/29	40,000.00	53,684.40	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 3.875 2027/04/25	200,000.00	187,500.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 4 2024/02/26	200,000.00	195,300.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 5 2045/06/15	200,000.00	185,000.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 6.125 2041/01/18	100,000.00	105,801.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 8.125 2024/05/21	30,000.00	34,987.50	
		REPUBLIC OF INDONESIA 4.75 2026/01/08	200,000.00	198,886.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA 4.875 2021/05/05	200,000.00	204,050.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA 5.25 2047/01/08	250,000.00	238,595.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA 5.875 2024/01/15	200,000.00	209,850.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA 7.75 2038/01/17	100,000.00	124,151.00	
		REPUBLIC OF PANAMA 3.875 2028/03/17	200,000.00	191,250.00	
		REPUBLIC OF PANAMA 6.7 2036/01/26	90,000.00	106,875.00	
		REPUBLIC OF PERU 4.125 2027/08/25	100,000.00	100,401.00	
REPUBLIC OF PERU 5.625 2050/11/18	80,000.00	89,200.00			

REPUBLIC OF PERU 6.55 2037/03/14	40,000.00	48,500.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 3.7 2042/02/02	200,000.00	179,462.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 4 2021/01/15	100,000.00	100,988.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 6.375 2032/01/15	100,000.00	120,167.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 6.375 2034/10/23	100,000.00	122,222.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 7.75 2031/01/14	100,000.00	131,575.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.665 2024/01/17	110,000.00	105,394.30	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5 2046/10/12	200,000.00	160,028.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5.5 2020/03/09	120,000.00	121,224.00	
REPUBLIC OF TURKEY 11.875 2030/01/15	50,000.00	65,505.00	
REPUBLIC OF TURKEY 4.875 2026/10/09	200,000.00	170,380.00	
REPUBLIC OF TURKEY 5.75 2024/03/22	200,000.00	187,556.00	
REPUBLIC OF TURKEY 5.75 2047/05/11	200,000.00	152,976.00	
REPUBLIC OF TURKEY 6.25 2022/09/26	200,000.00	195,400.00	
REPUBLIC OF TURKEY 6.625 2045/02/17	200,000.00	170,152.00	
REPUBLIC OF TURKEY 6.75 2040/05/30	100,000.00	87,409.00	
REPUBLIC OF TURKEY 7 2020/06/05	100,000.00	101,003.00	
REPUBLIC OF TURKEY 7.375 2025/02/05	100,000.00	99,769.00	
ROMANIA 4.375 2023/08/22	50,000.00	49,877.00	
ROMANIA 4.875 2024/01/22	30,000.00	30,550.50	
ROMANIA 6.125 2044/01/22	30,000.00	32,175.00	
ROMANIA 6.75 2022/02/07	70,000.00	75,257.00	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 2026/05/27	200,000.00	195,892.00	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 2023/09/16	200,000.00	203,534.00	
RUSSIAN FEDERATION 5 2020/04/29	200,000.00	203,388.00	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 2047/06/23	400,000.00	364,724.00	
RUSSIAN FEDERATION 7.5 2030/03/31	124,500.00	135,482.14	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 2025/01/30	200,000.00	188,400.00	
UNITED MEXICAN STATES 4 2023/10/02	110,000.00	107,800.00	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 2027/03/28	200,000.00	189,476.00	

	UNITED MEXICAN STATES 4.6 2046/01/23	200,000.00	171,000.00	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 2044/03/08	200,000.00	175,000.00	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 2045/01/21	100,000.00	97,750.00	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 2110/10/12	90,000.00	81,765.00	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 2040/01/11	100,000.00	103,000.00	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 2034/09/27	100,000.00	113,125.00	
	アメリカ・ドル 小計	8,704,500.00	8,577,152.64 (966,387,788)	
国債証券 合計			966,387,788 (966,387,788)	
合計			966,387,788 (966,387,788)	

(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 63銘柄	97.11%	100%

(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。

## 中間財務諸表

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【&lt;購入・換金手数料なし&gt;ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	18,411	1,015
コール・ローン	25,615	123,479
親投資信託受益証券	123,378,301	197,124,827
未収入金	320,469	1,644,870
流動資産合計	123,742,796	198,894,191
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	316,158	1,638,531
未払受託者報酬	5,692	16,679
未払委託者報酬	40,459	116,204
その他未払費用	2,803	737
流動負債合計	365,112	1,772,151
負債合計	365,112	1,772,151
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	121,367,121	187,208,427
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,010,563	9,913,613
純資産合計	123,377,684	197,122,040
負債純資産合計	123,742,796	198,894,191

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 (自2018年2月13日 至2018年8月12日)	第2期中間計算期間 (自2018年11月21日 至2019年5月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	1,933,725	5,948,410
営業収益合計	1,933,725	5,948,410
営業費用		
支払利息	-	7
受託者報酬	6,019	16,679
委託者報酬	57,345	116,204
その他費用	2,950	737
営業費用合計	66,314	133,627
営業利益又は営業損失( )	1,867,411	5,814,783
経常利益又は経常損失( )	1,867,411	5,814,783
中間純利益又は中間純損失( )	1,867,411	5,814,783
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	168,580	453,603
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	2,010,563
剰余金増加額又は欠損金減少額	789,147	3,008,964
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	789,147	3,008,964
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,600	467,094
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,600	467,094
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,449,378	9,913,613

## (3) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	---

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
1. 受益権総口数	121,367,121口	187,208,427口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0166円 (10,166円)	1.0530円 (10,530円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。



(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第1期 (2018年11月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年5月20日現在)
期首元本額	1,000,000円	121,367,121円
期中追加設定元本額	154,808,418円	96,047,516円
期中一部解約元本額	34,441,297円	30,206,210円

## &lt;参考&gt;

開示対象ファンド（＜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））は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイJ-REIT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、「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、「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興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、中間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)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	471,797,753	15,030,547
コール・ローン	656,414,314	1,829,389,428
株式	54,651,417,270	55,449,535,440
派生商品評価勘定	2,849,740	3,358,800
未収配当金	473,077,219	661,002,945
前払金	9,685,000	43,260,000
差入委託証拠金	44,625,000	77,520,000
流動資産合計	56,309,866,296	58,079,097,160
資産合計	56,309,866,296	58,079,097,160
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,605,640	50,500,880
未払解約金	118,516,537	142,805,449
その他未払費用	36,709	8,704
流動負債合計	145,158,886	193,315,033
負債合計	145,158,886	193,315,033
純資産の部		
元本等		
元本	33,015,590,469	35,097,981,789
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	23,149,116,941	22,787,800,338
純資産合計	56,164,707,410	57,885,782,127
負債純資産合計	56,309,866,296	58,079,097,160

## 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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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</p> <p>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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	33,015,590,469口	35,097,981,789口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7012円 (17,012円)	1.6493円 (16,493円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(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	(2018年11月20日 現在)				(2019年5月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	2,408,380,000	-	2,361,320,000	47,060,000
合計	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	2,408,380,000	-	2,361,320,000	47,060,000

(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。

(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	27,646,429,664円	33,015,590,469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	11,710,957,645円	7,232,372,917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	6,341,796,840円	5,149,981,597円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,091,055,877円	6,760,423,316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)	5,174,155,540円	4,817,829,059円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,502,125円	3,160,912円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,135,818円	4,187,559円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,126,664,808円	1,234,953,483円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,002,161,723円	4,434,688,167円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,800,194,280円	3,038,984,221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)	12,096,632円	12,356,142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)	44,290,695円	42,971,266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)	51,317,865円	51,465,149円
DCニッセイ国内株式インデックス	145,946,565円	262,087,309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	12,044,346,864円	13,663,052,117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)	407,253,399円	515,353,988円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	17,881,836円	45,078,704円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,201,733円	18,010,073円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,809,183円	31,085,591円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	14,634,712円	62,337,095円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,304,455円	17,865,985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)	14,120,028円	28,022,953円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,504,084円	25,760,807円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,655,590円	2,470,899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)	598,026円	794,757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)	880,678円	1,717,293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)	8,877,953円	14,639,310円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	2,733,707円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	1,316,272円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	2,121,977円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	2,513,678円
計	33,015,590,469円	35,097,981,789円

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	276,927,062	6,052,303
コール・ローン	385,289,854	736,634,521
国債証券	61,070,828,590	62,110,178,250
地方債証券	8,962,582,824	8,334,478,411
特殊債券	10,327,688,820	8,641,735,976
社債券	7,228,130,800	6,283,877,400
未収利息	227,564,980	205,435,750
前払費用	1,137,409	5,939,660
流動資産合計	88,480,150,339	86,324,332,271
資産合計	88,480,150,339	86,324,332,271
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,989,115	3,020,465
その他未払費用	12,309	3,827
流動負債合計	3,001,424	3,024,292
負債合計	3,001,424	3,024,292
純資産の部		
元本等		
元本	91,553,091,806	87,570,499,781
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,075,942,891	1,249,191,802
純資産合計	88,477,148,915	86,321,307,979
負債純資産合計	88,480,150,339	86,324,332,271

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	91,553,091,806口	87,570,499,781口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	3,075,942,891円	1,249,191,802円
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9664円 (9,664円)	0.9857円 (9,857円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。



(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	130,618,054,372円	91,553,091,806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	2,178,212,374円	4,005,824,383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	41,243,174,940円	7,988,416,408円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	90,032,868,109円	85,357,646,489円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,198,123,874円	1,489,109,530円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	6,925,913円	17,755,847円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	196,812,753円	375,537,644円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	5,784,972円	18,626,544円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	13,759,679円	62,099,571円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,804,002円	149,370,094円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド(6資産均等型)	25,017,328円	48,440,017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)	2,688,418円	3,453,088円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リー ト/債券)	7,329,823円	13,927,152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)	15,976,935円	25,414,980円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	876,295円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	643,042円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	1,475,769円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	6,123,719円
計	91,553,091,806円	87,570,499,781円

## 「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	112,422,984	2,645,643
コール・ローン	156,414,598	322,004,973
投資証券	17,146,099,070	21,189,129,280
未収配当金	91,860,624	153,118,799
流動資産合計	17,506,797,276	21,666,898,695
資産合計	17,506,797,276	21,666,898,695
負債の部		
流動負債		
未払金	77,893,800	89,977,885
未払解約金	40,589,882	103,547,287
その他未払費用	4,427	1,987
流動負債合計	118,488,109	193,527,159
負債合計	118,488,109	193,527,159
純資産の部		
元本等		
元本	11,518,929,567	12,840,999,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,869,379,600	8,632,372,402
純資産合計	17,388,309,167	21,473,371,536
負債純資産合計	17,506,797,276	21,666,898,695

## 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>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. 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>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	11,518,929,567口	12,840,999,134口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5095円 (15,095円)	1.6723円 (16,723円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (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。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,094,614,072円	11,518,929,567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	3,509,722,093円	3,526,965,072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	3,085,406,598円	2,204,895,505円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,702,001,026円	1,675,485,344円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,029,916,722円	1,369,747,280円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	5,938,188,472円	6,181,801,175円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,915,320,160円	1,884,489,800円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	654,619,964円	1,283,422,186円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	248,488,740円	395,850,585円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	16,289,044円	29,470,708円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,945,644円	2,615,458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)	702,607円	840,183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)	1,022,448円	1,815,946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)	10,434,740円	15,460,469円
計	11,518,929,567円	12,840,999,134円

## 「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)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	465,602,430	881,112,904
金銭信託	1,475,219,625	18,972,589
コール・ローン	2,052,479,632	2,309,180,938
株式	140,969,194,066	162,959,040,070
投資証券	3,569,453,040	4,372,246,003
派生商品評価勘定	15,686,337	30,293,891
未収入金	128,523,528	34,296,400
未収配当金	227,585,194	326,446,401
差入委託証拠金	1,285,508,197	1,862,500,526
流動資産合計	150,189,252,049	172,794,089,722
資産合計	150,189,252,049	172,794,089,722
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	91,327,346	20,399,831
未払金	66,447,914	82,901,066
未払解約金	313,161,773	575,335,700
その他未払費用	53,264	31,402
流動負債合計	470,990,297	678,667,999
負債合計	470,990,297	678,667,999
純資産の部		
元本等		
元本	88,596,175,879	97,019,551,907
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	61,122,085,873	75,095,869,816
純資産合計	149,718,261,752	172,115,421,723
負債純資産合計	150,189,252,049	172,794,089,722

## 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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	88,596,175,879口	97,019,551,907口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6899円 (16,899円)	1.7740円 (17,740円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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	（2018年11月20日 現在）				（2019年5月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	17,712,427	-	17,725,213	12,786	1,265,767	-	1,264,016	1,751
アメリカ・ドル	17,712,427	-	17,725,213	12,786	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	440,830	-	441,050	220
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	824,937	-	822,966	1,971
買 建	3,104,436,814	-	3,082,215,620	22,221,194	1,502,485,669	-	1,505,508,064	3,022,395
アメリカ・ドル	2,224,128,384	-	2,202,953,420	21,174,964	917,466,537	-	921,239,064	3,772,527
イギリス・ポンド	261,185,981	-	257,530,400	3,655,581	172,176,765	-	171,056,200	1,120,565
ユーロ	619,122,449	-	621,731,800	2,609,351	412,842,367	-	413,212,800	370,433
合計	3,122,149,241	-	3,099,940,833	22,233,980	1,503,751,436	-	1,506,772,080	3,024,146

## （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。

## 株式関連

種類	（2018年11月20日 現在）				（2019年5月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028	4,229,518,611	-	4,236,388,527	6,869,916
合計	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028	4,229,518,611	-	4,236,388,527	6,869,916



## （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。

## （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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	69,768,494,357円	88,596,175,879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	28,563,949,383円	18,655,005,947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	9,736,267,861円	10,231,629,919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）	562,227,597円	576,731,046円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	2,650,340,512円	2,738,552,541円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,084,617,874円	2,111,410,344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）	11,709,845,155円	11,537,759,767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	60,295,944,002円	67,054,316,932円
DCニッセイ外国株式インデックス	10,792,141,547円	12,322,673,014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）	406,450,400円	481,337,046円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	13,254,832円	31,217,784円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	9,183,684円	16,820,998円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	7,256,656円	21,409,967円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	10,766,461円	42,858,005円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,134,713円	11,533,650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）	14,090,128円	26,167,915円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	23,703,740円	24,060,675円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリート）	1,668,453円	2,309,272円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリートノ債券）	602,496円	742,227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）	8,947,629円	13,670,414円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	1,901,063円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	908,561円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	1,466,109円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	1,704,577円
計	88,596,175,879円	97,019,551,907円

## 「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)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	76,842,988	78,488,600
金銭信託	23,080,139	675,293
コール・ローン	32,111,499	82,190,937
国債証券	17,613,140,774	19,499,637,810
派生商品評価勘定	72	268,194
未収入金	665,973	-
未収利息	113,252,488	125,529,111
前払費用	7,551,171	9,369,895
流動資産合計	17,866,645,104	19,796,159,840
資産合計	17,866,645,104	19,796,159,840
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	374,889	3,603
未払金	78,852,405	88,241,664
未払解約金	18,722,533	21,735,783
その他未払費用	2,464	609
流動負債合計	97,952,291	109,981,659
負債合計	97,952,291	109,981,659
純資産の部		
元本等		
元本	13,426,526,479	14,660,272,235
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,342,166,334	5,025,905,946
純資産合計	17,768,692,813	19,686,178,181
負債純資産合計	17,866,645,104	19,796,159,840

## 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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
1. 受益権総口数	13,426,526,479口	14,660,272,235口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3234円 (13,234円)	1.3428円 (13,428円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(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	(2018年11月20日 現在)				(2019年5月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	49,345,189	-	48,970,372	374,817	57,466,692	-	57,731,283	264,591
アメリカ・ドル	41,561,341	-	41,186,717	374,624	42,901,169	-	43,152,465	251,296
イギリス・ポンド	-	-	-	-	1,887,760	-	1,884,471	3,289
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,142,915	-	1,147,619	4,704
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	1,822,477	-	1,828,235	5,758
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	1,803,996	-	1,803,682	314
ユーロ	7,783,848	-	7,783,655	193	7,908,375	-	7,914,811	6,436
合計	49,345,189	-	48,970,372	374,817	57,466,692	-	57,731,283	264,591

## (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。

(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,298,147,706円	13,426,526,479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	4,211,379,155円	2,704,936,175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	2,083,000,382円	1,471,190,419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)	1,461,969,133円	1,567,362,044円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,584,015,447円	2,791,026,922円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	903,148,588円	956,344,080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	7,278,919,564円	7,771,159,649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)	528,387,080円	653,676,464円
DCニッセイ外国債券インデックス	561,411,674円	694,525,723円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	5,967,897円	14,742,580円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	59,712,782円	114,078,685円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	3,292,189円	10,113,909円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	4,935,002円	20,668,406円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	2,849,336円	7,102,316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)	18,318,542円	35,552,284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)	1,959,566円	2,519,362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)	11,639,679円	18,549,141円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	889,317円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	425,843円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	685,740円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	849,770円
計	13,426,526,479円	14,660,272,235円

## 「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	13,079,208	14,684,498
金銭信託	37,276,284	234,520
コール・ローン	51,862,661	28,543,773
投資証券	1,984,027,628	2,204,960,193
派生商品評価勘定	-	69
未収入金	7,660,389	1,633,758
未収配当金	4,155,320	4,908,450
流動資産合計	2,098,061,490	2,254,965,261
資産合計	2,098,061,490	2,254,965,261
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	7
未払金	-	1,149,252
未払解約金	80,146,262	675,651
その他未払費用	500	315
流動負債合計	80,146,762	1,825,225
負債合計	80,146,762	1,825,225
純資産の部		
元本等		
元本	1,958,293,015	2,054,048,565
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	59,621,713	199,091,471
純資産合計	2,017,914,728	2,253,140,036
負債純資産合計	2,098,061,490	2,254,965,261

## 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>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>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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	1,958,293,015口	2,054,048,565口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0304円 (10,304円)	1.0969円 (10,969円)



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	<p>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。</p> <p>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。</p>

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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	（2018年11月20日 現在）				（2019年5月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	-	-	-	-	13,114	-	13,121	7
シンガポール・ ドル	-	-	-	-	13,114	-	13,121	7
買 建	-	-	-	-	13,114	-	13,183	69
アメリカ・ドル	-	-	-	-	13,114	-	13,183	69
合計	-	-	-	-	26,228	-	26,304	62

## （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。

## （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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	2,012,602,409円	1,958,293,015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	44,790,636円	121,612,909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	99,100,030円	25,857,359円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,915,161,338円	1,911,825,917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）	24,070,947円	43,751,854円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	2,834,846円	3,860,904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）	1,023,046円	1,240,013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）	15,202,838円	22,828,840円
DCニッセイ先進国リートインデックス	-円	70,541,037円
計	1,958,293,015円	2,054,048,565円

## 「ニッセイ新興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)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	30,054,694	45,283,003
金銭信託	39,227,272	779,735
コール・ローン	54,577,078	94,902,634
株式	1,453,862,370	1,611,153,939
投資信託受益証券	31,654,646	32,893,243
投資証券	4,797,246	4,950,394
派生商品評価勘定	1,617,697	471,610
未収入金	2,944,034	332,074
未収配当金	964,063	2,367,149
差入委託証拠金	42,137,115	66,935,254
流動資産合計	1,661,836,215	1,860,069,035
資産合計	1,661,836,215	1,860,069,035
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,465,541	12,120,050
未払金	2,216,650	1,576,730
未払解約金	16,580,249	3,398,829
その他未払費用	1,401	648
流動負債合計	20,263,841	17,096,257
負債合計	20,263,841	17,096,257
純資産の部		
元本等		
元本	1,844,866,571	2,085,456,317
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	203,294,197	242,483,539
純資産合計	1,641,572,374	1,842,972,778
負債純資産合計	1,661,836,215	1,860,069,035

## 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、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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	1,844,866,571口	2,085,456,317口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	203,294,197円	242,483,539円
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8898円 (8,898円)	0.8837円 (8,837円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## (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	(2018年11月20日 現在)				(2019年5月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	11,813,763	-	11,808,376	5,387	10,574	-	10,543	31
アメリカ・ドル	11,810,532	-	11,805,150	5,382	-	-	-	-
タイ・パーツ	-	-	-	-	10,574	-	10,543	31
マレーシア・リンギット	3,231	-	3,226	5	-	-	-	-
買 建	85,895,742	-	85,000,313	895,429	91,493,784	-	91,963,462	469,678
アメリカ・ドル	85,895,742	-	85,000,313	895,429	91,493,784	-	91,963,462	469,678
合計	97,709,505	-	96,808,689	890,042	91,504,358	-	91,974,005	469,709

## (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。

## 株式関連

種類	(2018年11月20日 現在)				(2019年5月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	143,158,502	-	144,200,699	1,042,197	202,891,275	-	190,773,126	12,118,149
合計	143,158,502	-	144,200,699	1,042,197	202,891,275	-	190,773,126	12,118,149

## (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。

(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,299,927,274円	1,844,866,571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	764,471,127円	466,442,046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	219,531,830円	225,852,300円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	995,014,308円	936,981,569円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	781,520,587円	1,064,444,951円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	46,427,320円	45,863,868円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,257,038円	4,386,454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)	1,176,052円	1,411,225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)	17,471,266円	26,002,872円
DCニッセイ新興国株式インデックス	-円	6,365,378円
計	1,844,866,571円	2,085,456,317円

## 「ニッセイ新興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)

	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	12,770,048	24,438,118
金銭信託	998,162	24,948
コール・ローン	1,388,748	3,036,444
国債証券	966,387,788	1,027,315,430
派生商品評価勘定	-	17,025
未収入金	40,041	-
未収利息	13,352,115	13,257,700
前払費用	316,884	260,701
流動資産合計	995,253,786	1,068,350,366
資産合計	995,253,786	1,068,350,366
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,528	-
未払金	-	49,572
未払解約金	89,792	236,782
その他未払費用	42	20
流動負債合計	112,362	286,374
負債合計	112,362	286,374
純資産の部		
元本等		
元本	1,012,672,810	1,019,011,621
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	17,531,386	49,052,371
純資産合計	995,141,424	1,068,063,992
負債純資産合計	995,253,786	1,068,350,366



## 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	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 受益権総口数	1,012,672,810口	1,019,011,621口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	17,531,386円	
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9827円 (9,827円)	1.0481円 (10,481円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年11月20日現在）	（2019年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(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	(2018年11月20日 現在)				(2019年5月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	2,093,042	-	2,070,514	22,528	2,430,751	-	2,447,776	17,025
アメリカ・ドル	2,093,042	-	2,070,514	22,528	2,430,751	-	2,447,776	17,025
合計	2,093,042	-	2,070,514	22,528	2,430,751	-	2,447,776	17,025

(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。

(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	(2018年11月20日現在)	(2019年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	999,909,334円	1,012,672,810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	20,717,858円	12,764,527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	7,954,382円	6,425,716円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	997,054,316円	995,258,795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)	15,618,494円	23,752,826円
計	1,012,672,810円	1,019,011,621円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

「<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)」

(2019年5月31日現在)

資産総額	196,840,726円
負債総額	3,628,921円
純資産総額( - )	193,211,805円
発行済数量	185,998,732口
1口当たり純資産額( / )	1.0388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

2019年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に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。

2019年5月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	394	58,897
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	102	23,975
単位型公社債投資信託	2	85
合計	498	82,957

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期事業年度（自2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		19,824,114		18,401,863
有価証券		7,102,076		8,008,550
前払費用		421,985		608,442
未収委託者報酬		4,433,940		4,705,229
未収運用受託報酬		1,806,719		1,911,554
未収投資助言報酬		101,471		168,445
その他		323,490		31,744
流動資産合計		34,013,799		33,835,830
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	82,291	1	72,641
車両	1	4,900	1	3,268
器具備品	1	94,283	1	95,277
有形固定資産合計		181,475		171,187
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		889,998		968,052
ソフトウェア仮勘定		44,035		24,478
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		942,047		1,000,545
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		34,455,496		36,902,679
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		14,723		167,886
差入保証金		299,871		293,513
繰延税金資産		778,580		1,066,925
その他		14,474		87,940
投資その他の資産合計		35,629,369		38,585,168
固定資産合計		36,752,892		39,756,901
資産合計		70,766,691		73,592,732



## 負債の部

## 流動負債

預り金	70,706	65,641
未払収益分配金	3,465	6,368
未払手数料	1,700,145	1,736,084
未払運用委託報酬	703,881	702,648
未払投資助言報酬	771,152	723,039
その他未払金	437,257	461,392
未払費用	109,199	113,233
未払法人税等	2,548,634	1,996,248
賞与引当金	864,699	853,083
その他	377,984	289,152
流動負債合計	7,587,128	6,946,893

## 固定負債

退職給付引当金	1,682,532	1,801,748
役員退職慰労引当金	18,200	22,500

固定負債合計	1,700,732	1,824,248
--------	-----------	-----------

負債合計	9,287,861	8,771,142
------	-----------	-----------

## 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	41,733,107	45,192,421
---------	------------	------------

利益剰余金合計	42,412,914	45,872,228
---------	------------	------------

株主資本合計	60,694,754	64,154,068
--------	------------	------------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	779,438	711,399
--------------	---------	---------

繰延ヘッジ損益	4,637	43,878
---------	-------	--------

評価・換算差額等合計	784,076	667,521
------------	---------	---------

純資産合計	61,478,830	64,821,590
-------	------------	------------

負債・純資産合計	70,766,691	73,592,732
----------	------------	------------

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,937,202	26,471,631
運用受託報酬	11,497,098	11,784,292
投資助言報酬	493,070	610,372
その他営業収益	-	16,907
営業収益計	38,927,371	38,883,204
営業費用		
支払手数料	12,354,679	11,518,158
広告宣伝費	31,453	23,965
公告費	260	130
調査費	5,782,852	5,954,296
支払運用委託報酬	1,754,925	1,695,119
支払投資助言報酬	2,906,672	3,019,717
委託調査費	82,637	106,467
調査費	1,038,617	1,132,991
委託計算費	216,637	229,936
営業雑経費	794,505	812,655
通信費	45,726	49,932
印刷費	179,345	190,576
協会費	32,226	34,445
その他営業雑経費	537,207	537,701
営業費用計	19,180,389	18,539,142
一般管理費		
役員報酬	83,616	137,828
給料・手当	3,439,572	3,685,286
賞与引当金繰入額	864,584	851,086
賞与	248,146	279,376
福利厚生費	662,791	710,135
退職給付費用	330,209	311,969
役員退職慰労引当金繰入額	2,450	8,350
役員退職慰労金	-	150
その他人件費	148,712	151,765
不動産賃借料	630,692	673,220
その他不動産経費	26,725	30,378
交際費	26,650	29,832
旅費交通費	152,875	209,373
固定資産減価償却費	396,898	405,606
租税公課	332,001	325,740
業務委託費	223,322	261,111
器具備品費	282,137	332,440
保険料	54,193	52,393
寄付金	162	-
諸経費	175,371	189,822
一般管理費計	8,081,115	8,645,865
営業利益	11,665,865	11,698,196
営業外収益		
受取利息	165	573
有価証券利息	33,950	24,008

受取配当金	176,877			124,674
金融派生商品収益	-			35,286
為替差益	-			22,977
時効成立償還金	27,718			-
その他営業外収益	13,552			14,395
営業外収益計	252,264			221,915
営業外費用				
為替差損	15,293			-
金融派生商品費用	-			20,127
控除対象外消費税	13,239			17,501
雑損失	27,789			-
その他営業外費用	657			1,080
営業外費用計	56,980			38,709
経常利益	11,861,150			11,881,403
特別利益				
投資有価証券売却益	201,537			655,395
投資有価証券償還益	31,108			46,876
固定資産売却益	1	169	1	-
特別利益計	232,815			702,272
特別損失				
投資有価証券売却損	107			81,265
投資有価証券償還損	15,469			68,047
固定資産除却損	2	5,271	2	1,089
事故損失賠償金	-		3	511
特別損失計	20,848			150,913
税引前当期純利益	12,073,117			12,432,761
法人税、住民税及び事業税	3,912,569			3,862,523
法人税等調整額	157,154			43,320
法人税等合計	3,755,414			3,905,844
当期純利益	8,317,703			8,526,917

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,278,000	5,278,000	5,278,000
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,317,703	8,317,703	8,317,703
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,039,703	3,039,703	3,039,703
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	812,844	-	812,844	58,467,896
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,278,000
当期純利益	-	-	-	8,317,703
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	33,405	4,637	28,768	28,768
当期変動額合計	33,405	4,637	28,768	3,010,934
当期末残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,067,603	5,067,603	5,067,603
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,526,917	8,526,917	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,459,314	3,459,314	3,459,314
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,067,603
当期純利益	-	-	-	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	68,039	48,515	116,554	116,554
当期変動額合計	68,039	48,515	116,554	3,342,759
当期末残高	711,399	43,878	667,521	64,821,590

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019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．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15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>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</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>
5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6．ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8．連結納税制度の適用を前提とした会計処理	<p>日本生命保険相互会社及び当社を含む一部の子会社は、2018年12月に連結納税制度の承認申請を行い、翌事業年度より連結納税制度が適用されることとなったため、当事業年度より「連結納税制度を適用する場合の税効果会計に関する当面の取扱い（その1）」（2015年1月16日 企業会計基準委員会 実務対応報告第5号）及び「連結納税制度を適用する場合の税効果会計に関する当面の取扱い（その2）」（2015年1月16日 企業会計基準委員会 実務対応報告第7号）に基づき、連結納税制度の適用を前提とした会計処理を行っております。</p>

（表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」に表示していた「繰延税金資産」437,736千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」778,580千円に含めて表示しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

#### （1）概要

本会計基準により、顧客と約束する財又はサービスを提供する履行義務の実質的な実施主体についての評価を行ったうえで、約束した財又はサービスが顧客に移転された時点で、当該財又はサービスと交換に権利を得ると見込む対価を反映した金額で、収益を認識することが求められます。

#### （2）適用予定日

2021年4月1日以後開始する会計年度の期首から適用予定であります。

#### （3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

## （貸借対照表関係）

- 1．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物附属設備	313,759千円	325,809千円
車両	1,828	3,460
器具備品	469,355	474,339
計	784,943	803,609

## （損益計算書関係）

- 1．固定資産売却益の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
車両	169千円	-

- 2．固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
器具備品	5,271千円	623千円
ソフトウェア	-	465
計	5,271	1,089

- 3．事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。



(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2017年4月1日 至2018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

2017年6月23日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,278,000千円
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

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

2018年6月22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	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

当事業年度（自2018年4月1日 至2019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

2018年6月22日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

2019年3月19日開催の臨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
配当財産の種類	投資有価証券
配当財産の帳簿価額	67,500千円
譲渡株数	1,350株
1株当たり配当額	-
基準日	2019年3月19日
効力発生日	2019年3月22日

(注) 配当財産のすべてを普通株式(108千株)の唯一の株主である日本生命保険相互会社に対して割り当てることとしており、1株当たり配当額は定めておりません。

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  
2019年6月28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	未定 千円
配当の原資	未定
1株当たり配当額	未定 円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28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。

上記の自社設定投資信託の一部につきましてはデリバティブを用いてヘッジを行っております。デリバティブを用いたヘッジ取引につきましては、外貨建て資産の為替変動リスクを回避する目的で為替予約、外国株式の価格変動リスクを回避する目的で株価指数先物を使ってヘッジ会計を適用しております。ヘッジ会計の適用にあたっては、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前の有効性の確認、事後の有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運用しております。ヘッジの有効性判定については資金運用リスク管理規程に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018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	19,824,114	19,824,114	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,102,076	7,115,800	13,723
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,652,704	14,687,680	34,975
その他有価証券	19,735,292	19,735,292	-
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	103,394	103,394	-

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

当事業年度(2019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	18,401,863	18,401,863	-
有価証券			
満期保有目的の債券	2,199,830	2,205,940	6,109
その他有価証券	5,808,720	5,808,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,649,504	17,681,300	31,795
その他有価証券	19,253,174	19,253,174	-
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	47,244	47,244	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

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。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非上場株式	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 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(2018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	19,824,114	-	-	-
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	7,100,000	14,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	2,896,071	14,413,880	2,089,902	299,797
合計	29,820,185	29,063,880	2,089,902	299,797

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2019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	18,401,863	-	-	-
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	2,200,000	17,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	7,033,352	15,714,537	2,156,988	138,951
合計	27,635,215	33,364,537	2,156,988	138,951

(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(2018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	15,606,746	15,660,060	53,313
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	15,606,746	15,660,060	53,313
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	6,148,033	6,143,420	4,613
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,148,033	6,143,420	4,613
合計		21,754,780	21,803,480	48,699

当事業年度(2019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	18,749,335	18,787,460	38,124
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	18,749,335	18,787,460	38,124
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	1,100,000	1,099,780	220
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,100,000	1,099,780	220
合計		19,849,335	19,887,240	37,904

## 2. その他有価証券

前事業年度（2018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	5,824,610	5,803,679	20,930
	国債・地方債等	5,824,610	5,803,679	20,930
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,066,429	5,762,409	1,304,019
	小計	12,891,039	11,566,089	1,324,949
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）	6,844,252	7,045,700	201,447
	小計	6,844,252	7,045,700	201,447
合計		19,735,292	18,611,789	1,123,502

当事業年度（2019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	5,808,720	5,801,046	7,673
	国債・地方債等	5,808,720	5,801,046	7,673
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	13,421,370	12,553,359	868,010
	小計	19,230,090	18,354,406	875,684
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)	5,831,804	5,981,670	149,865
	小計	5,831,804	5,981,670	149,865
合計		25,061,894	24,336,076	725,818

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、当事業年度の貸借対照表計上額は-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（前事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。



## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自2017年4月1日 至2018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	344,430	201,537	107
合計	344,430	201,537	107

当事業年度（自2018年4月1日 至2019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	2,232,532	655,395	81,265
合計	2,232,532	655,395	81,265

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 株価指数先物関連

前事業年度(2018年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	新興国株価指数先物売建	投資有価証券	1,022,464	-	31,858
合計			1,022,464	-	31,858

(注1) 時価の算定方法 取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## (2) 通貨関連

前事業年度(2018年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引米ドル売建	投資有価証券	1,988,812	-	71,536
合計			1,988,812	-	71,536

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2019年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引米ドル売建	投資有価証券	1,909,028	-	47,244
合計			1,909,028	-	47,244

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

## （退職給付関係）

前事業年度（自2017年4月1日 至2018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	1,519,642 千円
退職給付費用	248,707
退職給付の支払額	85,817
退職給付引当金の期末残高	1,682,532

## （2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 248,707 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、54,955千円であります。

当事業年度（自2018年4月1日 至2019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	1,682,532 千円
退職給付費用	229,805
退職給付の支払額	110,589
退職給付引当金の期末残高	1,801,748

## （2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 229,805 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、58,788千円であります。

## (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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	264,770 千円	261,214 千円
未払事業税	138,553	119,420
退職給付引当金	515,191	551,695
税務上の繰延資産償却超過額	3,662	6,126
役員退職慰労引当金	5,572	6,889
投資有価証券評価差額	61,683	88,160
その他	48,864	62,896
小計	1,038,300	1,096,402
評価性引当額	47	9
繰延税金資産合計	1,038,253	1,096,393
繰延税金負債		
繰延ヘッジ損益	2,021	-
特別分配金否認	9,827	5,022
投資有価証券評価差額	247,824	24,444
繰延税金負債合計	259,672	29,467
繰延税金資産(は負債)の純額	778,580	1,066,925

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳  
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2017年4月1日 至2018年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2018年4月1日 至2019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2017年4月1日 至2018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 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,608,592	未収運用受託報酬	833,260
								投資助言報酬の受取	132,212	未収投資助言報酬	11,876

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	(被所有) 直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,299,726	未収運用受託報酬	762,239
								投資助言報酬の受取	130,542	未収投資助言報酬	11,530

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

## 2 親会社に関する注記

## 親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

## （ 1株当たり情報 ）

	前事業年度 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
1株当たり純資産額	566,896円85銭	597,720円47銭
1株当たり当期純利益金額	76,697円61銭	78,626円78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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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



## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2019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

2019年3月末現在、10,000百万円

##### c. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

(資本金の額：2019年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	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。
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
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	

#### (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

2019年3月末現在、450百万円

##### c. 事業の内容

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

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

### (3) 投資助言会社(参考情報)

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

## 3【資本関係】

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

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

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
  - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
  - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
- コールセンター 0120-762-506  
（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

2019年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第24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2019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12月25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<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）の2018年2月13日から2018年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、<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）の2018年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年6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  
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている<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）の2018年11月21日から2019年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、<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）の2019年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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