

**【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11月21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>	DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）
<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】

DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)

(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11月22日(金)～2020年5月21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)

( 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)

( 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】

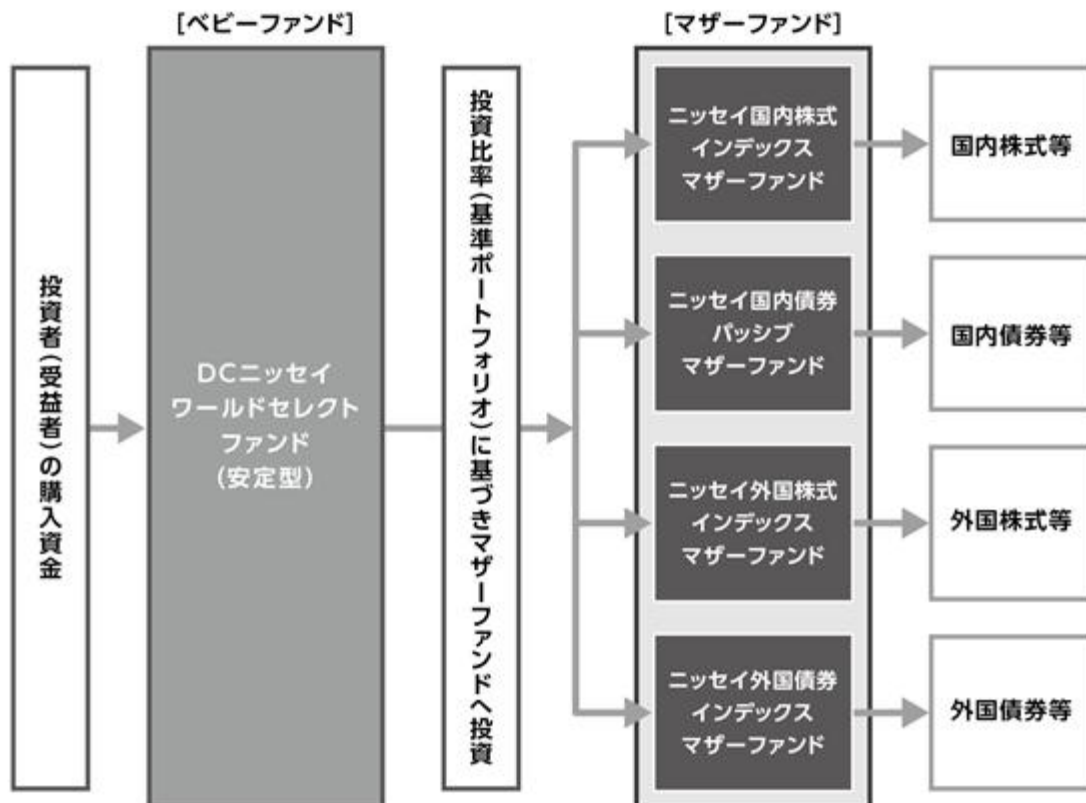
###### 基本方針

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。

###### ファンドの特色

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

- 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。



**1** マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にもない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

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

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

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

### ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド(以下「国内債券パッシブ」ということがあります)

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

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

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

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

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

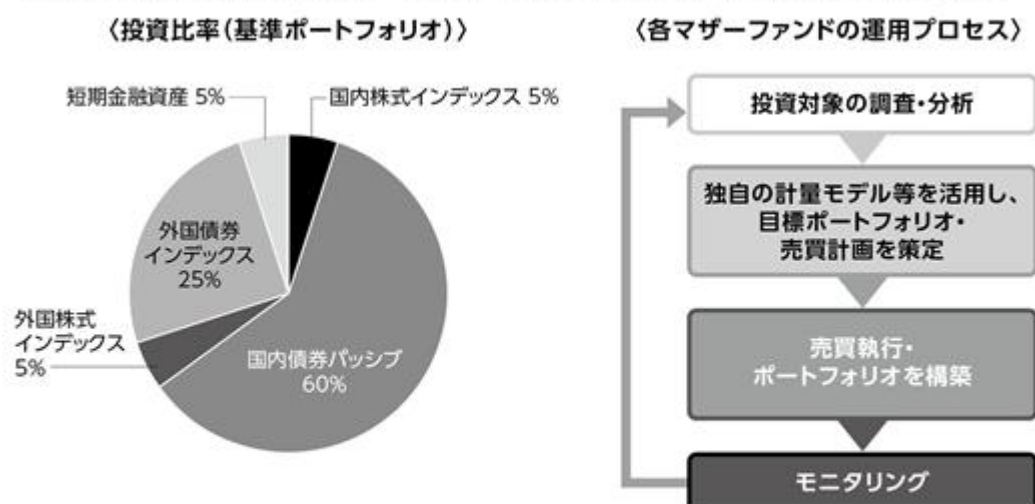
※1 TOPIX(東証株価指数)は、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの高標または標章に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の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

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

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

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

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



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

### ＜MSCI指数にかかる免責条項等＞

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

MSCI Inc. は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI 指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI 指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、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. との関係を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 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式・債券） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

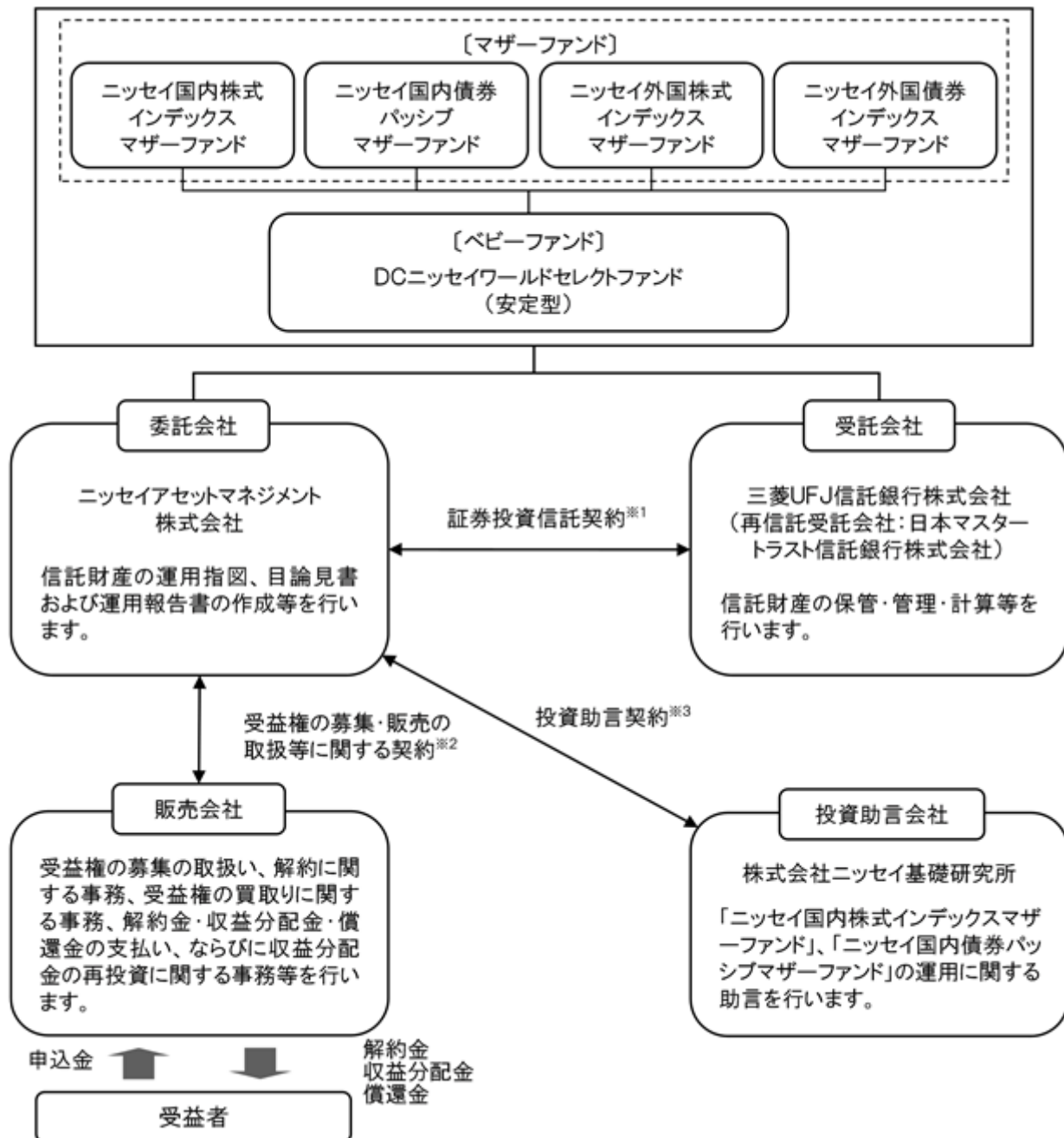
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、  
一般社団法人 投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## （２）【ファンドの沿革】

2017年7月14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 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。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

## 委託会社の概況（2019年8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】

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	投資比率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5%
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	60%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25%
短期金融資産	5%

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、

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

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

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。また、各マザーファンドはそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

- ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド  
...TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
- ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド  
...NOMURA - BPI総合
- ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド  
...MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）
- ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド  
...FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## イ．有価証券

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

## ハ．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「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」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます）のほか、次の有価証券（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ます）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの  
 なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品

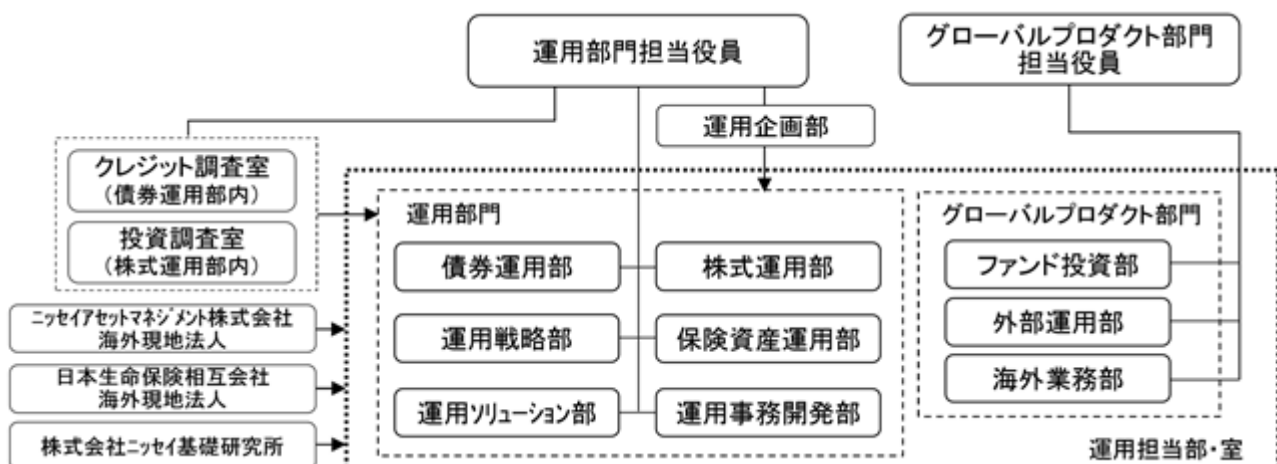
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

### （3）【運用体制】

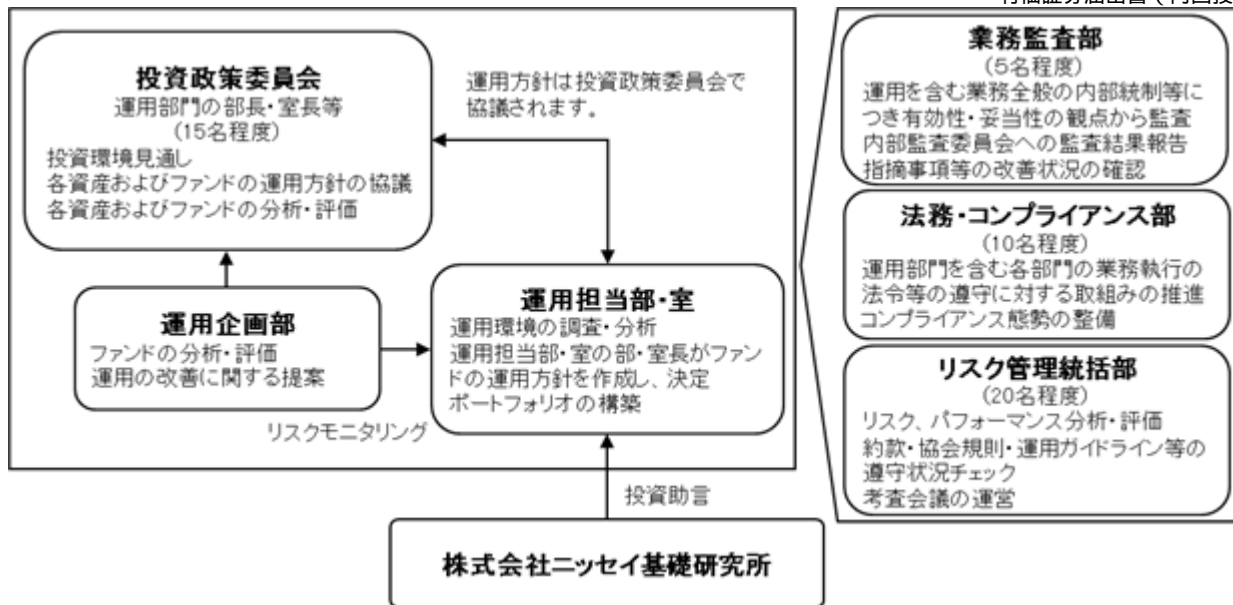
#### 委託会社の組織体制



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

#### 内部管理体制および意思決定を監督する組織





#### < 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

##### 分配時期

毎決算日とし、決算日は2月21日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

##### 支払方法

#### < 分配金受取コースの場合 >

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

#### < 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

確定拠出年金法に基づく運用として購入する加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%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45%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。

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。

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

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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。

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

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

信用取引の範囲

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

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

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

先物取引等

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

2. 国内の金融商品取引所における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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の

一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

- 4．前記3．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
- 5．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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

#### 有価証券の貸付けおよび範囲

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

#### 有価証券の空売り

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

#### 有価証券の借入れ

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

#### 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ならびに安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます)を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
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。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

##### ・流動性リスク

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

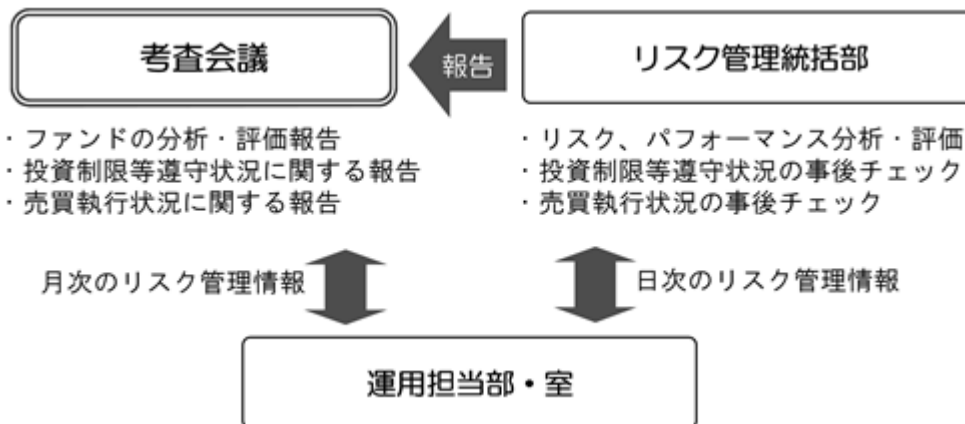
##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2019年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に12.4%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

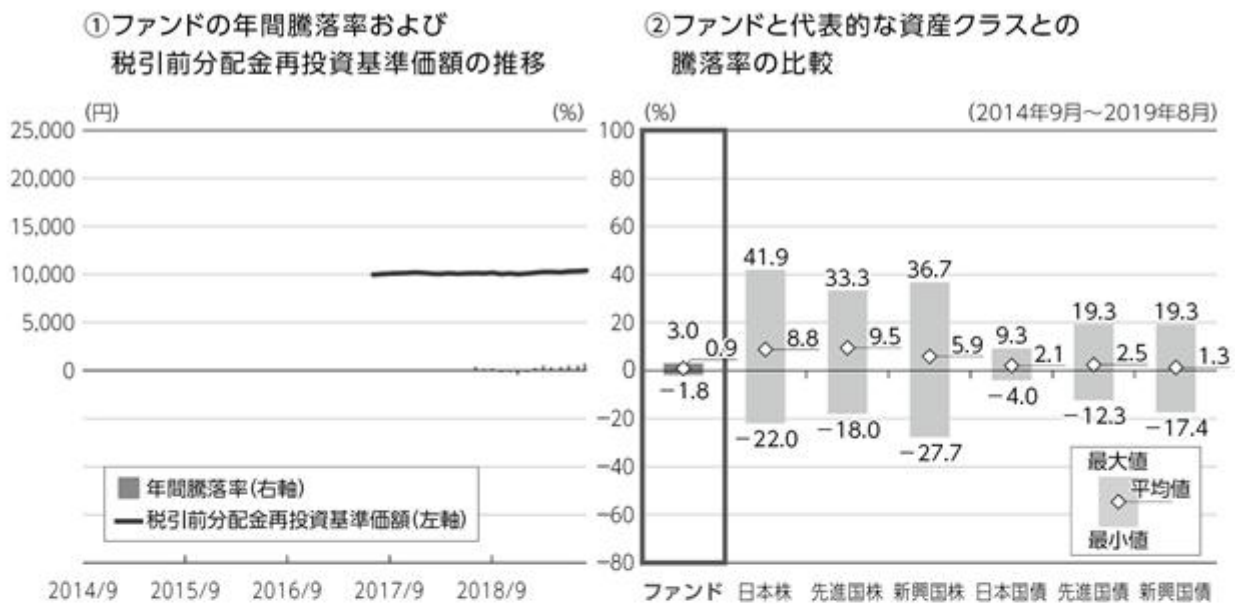
(2) 投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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



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

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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の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、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。



#### 4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.154%（税抜0.14%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.06%	0.06%	0.02%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.0022% （税抜0.002%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.0055% （税抜0.005%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.0077% （税抜0.007%）
10億円以下 の部分	年 0.0110% （税抜0.010%）

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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



## &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・收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收受
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收受
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收受
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收受
証券取引の手数料	有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
監査費用	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
借入金の利息	受託会社等から一時的に資金を借入れた場合に発生する利息

## （５）【課税上の取扱い】

### 確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

### 確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

#### 課税対象

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

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

#### 個人の課税の取扱い

分 配 時： 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

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

#### 税率（個人）

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

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

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

#### < 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

## 法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

(2019年8月30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	2,389,225,459	95.06
内 日本	2,389,225,459	95.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	124,056,590	4.94
純資産総額	2,513,282,049	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8月30日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	59,997,634,560	97.40
内 日本	59,997,634,560	97.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,599,730,973	2.60
純資産総額	61,597,365,533	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,570,400,000	2.55
内 日本	1,570,400,000	2.55

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価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8月30日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	61,391,823,430	73.40
内 日本	61,391,823,430	73.40
地方債証券	7,278,271,643	8.70
内 日本	7,278,271,643	8.70
特殊債券	8,469,801,724	10.13
内 日本	8,469,801,724	10.13
社債券	5,775,339,500	6.90
内 日本	5,157,644,500	6.17
内 スウェーデン	415,172,600	0.50
内 フランス	202,522,400	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	730,465,695	0.87
純資産総額	83,645,701,992	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8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	178,796,320,185	94.95
内 アメリカ	118,234,316,398	62.79
内 イギリス	10,242,128,180	5.44
内 スイス	7,065,069,915	3.75
内 カナダ	7,057,801,029	3.75
内 フランス	6,854,780,663	3.64
内 ドイツ	5,604,357,232	2.98
内 オーストラリア	4,166,303,664	2.21
内 オランダ	3,893,325,381	2.07
内 アイルランド	2,922,310,851	1.55
内 香港	1,950,840,591	1.04
内 スペイン	1,906,599,867	1.01
内 スウェーデン	1,690,507,042	0.90
内 イタリア	1,297,465,631	0.69
内 デンマーク	1,213,541,527	0.64
内 シンガポール	833,695,128	0.44
内 ベルギー	676,084,115	0.36
内 フィンランド	656,719,617	0.35
内 バミューダ	450,493,767	0.24
内 ノルウェー	432,512,939	0.23
内 ジャージー	334,858,768	0.18
内 イスラエル	290,358,967	0.15
内 ケイマン諸島	244,487,504	0.13
内 オランダ領キュラソー	221,539,380	0.12
内 ニュージーランド	166,822,979	0.09
内 オーストリア	147,093,184	0.08
内 ポルトガル	102,844,312	0.05
内 ルクセンブルグ	81,232,773	0.04
内 パプアニューギニア	32,445,394	0.02
内 イギリス領バージン諸島	19,754,499	0.01
内 モーリシャス	6,028,888	0.00
投資証券	5,192,253,309	2.76
内 アメリカ	4,273,903,145	2.27
内 オーストラリア	369,620,252	0.20
内 フランス	196,543,085	0.10
内 香港	120,013,228	0.06
内 イギリス	110,233,636	0.06
内 シンガポール	85,498,121	0.05
内 カナダ	36,441,842	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,317,885,405	2.29
純資産総額	188,306,458,899	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）	4,086,062,062	2.17
内 アメリカ	3,037,922,598	1.61
内 ドイツ	750,311,189	0.40
内 イギリス	297,828,275	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」

（2019年8月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	23,285,590,918	99.05
内 アメリカ	11,177,759,422	47.55
内 フランス	2,321,644,716	9.88
内 イタリア	2,094,812,663	8.91
内 ドイツ	1,498,866,423	6.38
内 イギリス	1,457,563,419	6.20
内 スペイン	1,308,884,916	5.57
内 ベルギー	587,554,448	2.50
内 オーストラリア	454,115,220	1.93
内 カナダ	446,828,205	1.90
内 オランダ	434,257,497	1.85
内 オーストリア	326,877,727	1.39
内 メキシコ	171,802,564	0.73
内 アイルランド	166,967,816	0.71
内 フィンランド	135,717,215	0.58
内 ポーランド	129,818,774	0.55
内 デンマーク	122,767,232	0.52
内 南アフリカ	122,258,858	0.52
内 マレーシア	104,162,855	0.44
内 シンガポール	92,183,400	0.39
内 スウェーデン	77,662,496	0.33
内 ノルウェー	53,085,052	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	222,918,658	0.95
純資産総額	23,508,509,576	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

## (2) 【投資資産】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

## 【投資有価証券の主要銘柄】

(2019年8月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,487,528,279	0.9936 1,478,098,642	1.0127 1,506,419,888	- -	59.94%
2	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	462,398,941	1.3566 627,321,419	1.3706 633,763,988	- -	25.22%
3	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	77,817,880	1.6736 130,238,629	1.6065 125,014,424	- -	4.97%
4	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	71,329,169	1.7787 126,874,385	1.7388 124,027,159	- -	4.93%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	95.06
	小計		95.06
合計(対純資産総額比)			95.06

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(2019年8月30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	308,900	6,788.03 2,096,823,080	6,960.00 2,149,944,000	- -	3.49%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	186,000	5,311.37 987,915,322	6,042.00 1,123,812,000	- -	1.82%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	215,800	5,183.65 1,118,632,495	4,824.00 1,041,019,200	- -	1.69%
4	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	1,882,000	579.27 1,090,187,810	510.40 960,572,800	- -	1.56%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	186,000	4,732.60 880,263,990	5,096.00 947,856,000	- -	1.54%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	242,000	4,394.74 1,063,528,540	3,590.00 868,780,000	- -	1.41%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	13,600	62,745.91 853,344,510	62,900.00 855,440,000	- -	1.39%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	192,700	4,009.09 772,551,786	3,484.00 671,366,800	- -	1.09%

9	任天堂 日本	株式 その他製品	15,900	30,742.06 488,798,800	40,290.00 640,611,000	- -	1.04%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	223,000	2,719.89 606,536,798	2,835.00 632,205,000	- -	1.03%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	189,700	3,076.30 583,575,010	3,219.00 610,644,300	- -	0.99%
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	233,800	3,001.23 701,688,164	2,523.50 589,994,300	- -	0.96%
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,715,100	174.06 646,651,184	154.70 574,725,970	- -	0.93%
14	第一三共 日本	株式 医薬品	79,300	4,154.51 329,453,179	7,018.00 556,527,400	- -	0.90%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	97,800	5,563.15 544,076,518	5,472.00 535,161,600	- -	0.87%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	24,800	24,530.71 608,361,608	21,015.00 521,172,000	- -	0.85%
17	花王 日本	株式 化学	67,300	8,309.25 559,213,185	7,674.00 516,460,200	- -	0.84%
18	信越化学工業 日本	株式 化学	47,800	9,641.11 460,845,300	10,715.00 512,177,000	- -	0.83%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	49,300	10,577.15 521,453,520	10,115.00 498,669,500	- -	0.81%
20	ダイキン工業 日本	株式 機械	37,800	12,518.29 473,191,700	13,155.00 497,259,000	- -	0.81%
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	191,600	3,211.78 615,378,902	2,585.00 495,286,000	- -	0.80%
22	ファナック 日本	株式 電気機器	26,300	19,402.31 510,281,010	18,455.00 485,366,500	- -	0.79%
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	31,300	12,451.37 389,727,970	15,470.00 484,211,000	- -	0.79%
24	HOYA 日本	株式 精密機器	55,800	6,914.22 385,813,705	8,649.00 482,614,200	- -	0.78%
25	資生堂 日本	株式 化学	55,100	7,299.19 402,185,700	8,690.00 478,819,000	- -	0.78%
26	日本電産 日本	株式 電気機器	33,400	13,502.53 450,984,810	13,855.00 462,757,000	- -	0.75%
27	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	172,200	2,600.80 447,858,090	2,682.00 461,840,400	- -	0.75%
28	日立製作所 日本	株式 電気機器	124,800	3,529.70 440,506,984	3,629.00 452,899,200	- -	0.74%
29	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	288,400	1,355.89 391,038,730	1,490.50 429,860,200	- -	0.70%
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	114,400	4,842.10 553,936,554	3,757.00 429,800,800	- -	0.70%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。



## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	13.35
		情報・通信業	8.84
		輸送用機器	7.57
		化学	7.08
		医薬品	5.57
		銀行業	5.57
		サービス業	5.12
		卸売業	4.76
		機械	4.75
		陸運業	4.68
		小売業	4.67
		食料品	3.98
		建設業	2.77
		不動産業	2.49
		保険業	2.23
		その他製品	2.19
		精密機器	2.13
		電気・ガス業	1.67
		その他金融業	1.09
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.76
		証券、商品先物取引業	0.75
		ゴム製品	0.75
		非鉄金属	0.69
		繊維製品	0.62
		空運業	0.54
		金属製品	0.54
		石油・石炭製品	0.52
鉱業	0.26		
パルプ・紙	0.25		
倉庫・運輸関連業	0.19		
海運業	0.15		
水産・農林業	0.11		
	小計		97.40
合計（対純資産総額比）			97.40

（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 0109月	買建	104	1,558,371,160	1,570,400,000	2.55%

（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8月30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	103.22 1,032,299,000	0.828000 2023/5/19	1.23%
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	826,000,000	101.68 839,876,800	103.96 858,734,380	0.100000 2028/3/20	1.03%
3	第312回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	762,000,000	102.40 780,288,000	101.92 776,645,640	1.200000 2020/12/20	0.93%
4	第344回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	678,000,000	101.94 691,153,200	103.47 701,567,280	0.100000 2026/9/20	0.84%
5	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	660,000,000	101.58 670,428,000	103.94 686,023,800	0.100000 2028/6/20	0.82%
6	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	656,000,000	101.77 667,611,200	103.97 682,102,240	0.100000 2027/12/20	0.82%
7	第346回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	647,000,000	101.94 659,597,090	103.76 671,378,960	0.100000 2027/3/20	0.80%
8	第131回 利付国債(5 年) 日本	国債証券	658,000,000	100.88 663,796,840	101.06 665,001,120	0.100000 2022/3/20	0.80%
9	第348回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	633,000,000	101.85 644,710,500	103.94 657,952,860	0.100000 2027/9/20	0.79%
10	第347回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	628,000,000	101.92 640,057,600	103.85 652,215,680	0.100000 2027/6/20	0.78%
11	第352回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	625,000,000	101.48 634,275,000	103.96 649,762,500	0.100000 2028/9/20	0.78%
12	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	575,000,000	103.69 596,217,500	104.76 602,393,000	0.400000 2025/9/20	0.72%
13	第353回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	576,000,000	101.64 585,486,320	103.92 598,608,000	0.100000 2028/12/20	0.72%
14	第343回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	572,000,000	101.91 582,925,200	103.31 590,950,360	0.100000 2026/6/20	0.71%
15	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	561,000,000	103.15 578,671,500	104.32 585,235,200	0.300000 2025/12/20	0.70%
16	第342回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	565,000,000	101.84 575,396,000	103.15 582,808,800	0.100000 2026/3/20	0.70%
17	第127回 利付国債(5 年) 日本	国債証券	559,000,000	100.50 561,811,520	100.60 562,381,950	0.100000 2021/3/20	0.67%

18	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	536,000,000	103.54 554,974,400	104.56 560,446,960	0.400000 2025/6/20	0.67%
19	第137回 利付国債（5年） 日本	国債証券	545,000,000	101.36 552,464,480	101.84 555,071,600	0.100000 2023/9/20	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	103.64 551,375,440	0.100000 2026/12/20	0.66%
21	第396回 利付国債（2年） 日本	国債証券	528,000,000	100.47 530,500,400	100.50 530,676,960	0.100000 2021/1/1	0.63%
22	第397回 利付国債（2年） 日本	国債証券	524,000,000	100.49 526,574,040	100.54 526,829,600	0.100000 2021/2/1	0.63%
23	第399回 利付国債（2年） 日本	国債証券	520,000,000	100.48 522,546,380	100.61 523,213,600	0.100000 2021/4/1	0.63%
24	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	104.08 520,424,000	0.660000 2024/5/31	0.62%
25	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	103.05 515,284,500	0.605000 2023/5/31	0.62%
26	第398回 利付国債（2年） 日本	国債証券	510,000,000	100.46 512,383,530	100.57 512,942,700	0.100000 2021/3/1	0.61%
27	第338回 利付国債（10年） 日本	国債証券	491,000,000	103.40 507,694,000	104.35 512,402,690	0.400000 2025/3/20	0.61%
28	第37回 利付国債（30年） 日本	国債証券	362,000,000	131.54 476,174,800	141.51 512,266,200	1.900000 2042/9/20	0.61%
29	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	102.39 511,983,500	1.100000 2021/7/30	0.61%
30	第400回 利付国債（2年） 日本	国債証券	504,000,000	100.58 506,948,400	100.65 507,321,360	0.100000 2021/5/1	0.61%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	73.40
		地方債証券	8.70
		特殊債券	10.13
		社債券	6.17
	小計	98.39	
	外国	社債券	0.74
	小計	0.74	
合計（対純資産総額比）			99.13

（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8月30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	339,313	13,708.30 4,651,407,397	14,704.25 4,989,344,944	- -	2.65%
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	214,463	20,224.24 4,337,352,491	22,251.20 4,772,060,092	- -	2.53%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	19,506	198,490.77 3,871,761,102	190,180.14 3,709,653,888	- -	1.97%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	111,977	19,737.58 2,210,155,472	19,755.78 2,212,193,223	- -	1.17%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	14,631	123,513.43 1,807,125,058	126,990.81 1,858,002,555	- -	0.99%
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	13,933	124,144.01 1,729,698,557	127,138.79 1,771,424,766	- -	0.94%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	151,146	11,784.44 1,781,171,417	11,627.56 1,757,459,365	- -	0.93%
8	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	142,786	10,838.65 1,547,608,817	11,898.06 1,698,876,537	- -	0.90%
9	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	123,752	14,713.43 1,820,816,870	13,652.43 1,689,515,566	- -	0.90%
10	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	81,030	17,574.71 1,424,079,070	19,287.35 1,562,854,634	- -	0.83%
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナ ル用品	116,967	11,525.19 1,348,068,004	12,900.82 1,508,970,540	- -	0.80%
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	197,144	8,032.39 1,583,538,152	7,285.05 1,436,205,434	- -	0.76%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	60,588	21,640.69 1,311,166,237	21,632.67 1,310,680,331	- -	0.70%
14	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	340,573	3,410.43 1,161,502,062	3,742.06 1,274,447,665	- -	0.68%
15	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	42,351	27,053.47 1,145,741,857	29,955.71 1,268,654,477	- -	0.67%
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	51,272	20,642.22 1,058,368,046	24,200.48 1,240,807,379	- -	0.66%
17	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	83,917	14,419.53 1,210,043,734	14,674.44 1,231,435,518	- -	0.65%
18	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	420,770	3,020.02 1,270,735,624	2,909.55 1,224,252,110	- -	0.65%
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	193,114	6,173.03 1,192,100,425	6,168.29 1,191,183,618	- -	0.63%

20	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	88,776	12,811.79 1,137,379,844	12,511.17 1,110,692,444	- -	0.59%
21	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	120,040	8,445.55 1,013,804,609	9,232.21 1,108,234,632	- -	0.59%
22	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	189,028	5,276.63 997,432,259	5,860.62 1,107,821,844	- -	0.59%
23	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	44,284	25,743.50 1,140,025,210	24,551.80 1,087,252,141	- -	0.58%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造 装置	208,647	4,798.87 1,001,271,051	4,989.78 1,041,102,669	- -	0.55%
25	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	199,446	5,958.67 1,188,433,552	5,032.36 1,003,684,910	- -	0.53%
26	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア・娯楽	211,405	4,626.85 978,141,067	4,702.33 994,097,807	- -	0.53%
27	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	198,995	4,866.44 968,398,451	4,917.38 978,535,505	- -	0.52%
28	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	258,793	4,384.00 1,134,549,027	3,761.23 973,380,461	- -	0.52%
29	BOEING CO アメリカ	株式 資本財	24,923	37,668.64 938,815,584	38,617.30 962,458,977	- -	0.51%
30	ROCHE HOLDING 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	32,742	28,786.93 942,541,745	29,195.01 955,903,197	- -	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	9.60
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.91
		銀行	7.28
		資本財	6.75
		メディア・娯楽	5.97
		エネルギー	5.32
		食品・飲料・タバコ	5.06
		小売	4.82
		ヘルスケア機器・サービス	4.81
		各種金融	4.18
		素材	4.17
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.13
		保険	3.77
		公益事業	3.61
		半導体・半導体製造装置	2.94
		電気通信サービス	2.38
		家庭用品・パーソナル用品	2.22
		消費者サービス	1.94
		運輸	1.86
		耐久消費財・アパレル	1.86
		食品・生活必需品小売り	1.54
		商業・専門サービス	1.27
		自動車・自動車部品	1.02
不動産	0.56		
	小計		94.95
投資証券	外国	投資証券	2.76
	小計		2.76
合計(対純資産総額比)			97.71

(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 500 EMINI FUTURE 201909	買建	195	3,002,133,408	3,037,922,598	1.61%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 201909	買建	187	733,171,792	750,311,189	0.40%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 201909	買建	32	295,664,694	297,828,275	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8月30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	216,113,800	102.34 221,179,507	104.81 226,530,485	2.500000 2024/5/15	0.96%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	221,436,800	100.18 221,854,399	101.06 223,806,173	2.125000 2021/8/15	0.95%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	213,984,600	98.64 211,085,853	99.56 213,047,347	1.375000 2021/1/31	0.91%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	210,790,800	100.53 211,926,004	101.05 213,020,966	2.625000 2020/11/15	0.91%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	194,821,800	102.60 199,887,230	105.29 205,147,355	2.750000 2023/11/15	0.87%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	200,144,800	99.82 199,800,934	101.85 203,849,480	2.000000 2023/2/15	0.87%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	189,498,800	102.76 194,744,616	105.63 200,171,372	2.750000 2024/2/15	0.85%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	187,369,600	101.55 190,287,711	104.05 194,965,563	2.500000 2023/8/15	0.83%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	185,240,400	101.96 188,873,410	102.53 189,928,834	3.125000 2021/5/15	0.81%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	186,305,000	98.56 183,635,675	101.10 188,356,218	1.750000 2023/5/15	0.80%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	178,852,800	99.68 178,290,382	101.05 180,745,062	2.000000 2021/11/15	0.77%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	173,529,800	100.38 174,202,935	100.78 174,892,008	2.625000 2020/8/15	0.74%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	171,400,600	98.44 168,743,103	100.53 172,317,593	1.625000 2022/11/15	0.73%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	167,142,200	99.81 166,836,372	101.23 169,211,420	2.000000 2022/2/15	0.72%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	159,690,000	101.33 161,822,851	104.45 166,807,383	2.375000 2024/8/15	0.71%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	165,013,000	100.20 165,345,847	100.97 166,630,127	2.125000 2021/6/30	0.71%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	163,948,400	98.58 161,621,035	100.47 164,728,794	1.625000 2022/8/15	0.70%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	159,690,000	99.91 159,555,349	100.67 160,767,907	2.000000 2021/5/31	0.68%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	156,496,200	99.06 155,029,873	100.71 157,619,842	1.750000 2022/5/15	0.67%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	155,431,600	100.27 155,856,673	100.87 156,791,626	2.375000 2020/12/31	0.67%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	153,302,400	100.13 153,511,284	100.94 154,757,239	2.250000 2021/3/31	0.66%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	153,302,400	99.53 152,593,057	100.19 153,601,339	1.875000 2020/12/15	0.65%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	144,785,600	100.24 145,141,772	104.64 151,509,443	2.250000 2025/11/15	0.64%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	150,108,600	99.64 149,580,324	100.52 150,893,667	2.000000 2021/2/28	0.64%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	149,044,000	98.92 147,435,793	99.59 148,443,352	1.375000 2020/8/31	0.63%

26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	146,914,800	99.67 146,440,935	100.23 147,264,457	2.000000 2020/9/30	0.63%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	136,268,800	98.75 134,578,619	103.08 140,468,604	2.000000 2025/8/15	0.60%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	130,945,800	101.42 132,812,650	102.51 134,244,324	2.625000 2021/12/15	0.57%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	128,816,600	100.49 129,453,656	104.03 134,019,502	2.250000 2024/11/15	0.57%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	128,816,600	99.01 127,552,862	102.90 132,554,857	2.000000 2025/2/15	0.56%

(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	99.05
	小計		99.05
合計(対純資産総額比)			99.05

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

#### 【純資産の推移】

2019年8月30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2月21日)	27,072,959	27,072,959	1.0066	1.0066
第2計算期間末 (2019年2月21日)	459,363,791	459,363,791	1.0190	1.0190
2018年8月末日	230,784,137	-	1.0108	-
9月末日	248,805,790	-	1.0177	-
10月末日	303,299,681	-	1.0043	-
11月末日	343,204,171	-	1.0106	-
12月末日	359,046,970	-	1.0029	-
2019年1月末日	423,194,278	-	1.0094	-
2月末日	464,174,368	-	1.0183	-
3月末日	513,925,603	-	1.0263	-
4月末日	565,734,716	-	1.0265	-
5月末日	657,313,246	-	1.0217	-
6月末日	735,111,460	-	1.0316	-
7月末日	2,416,511,639	-	1.0349	-
8月末日	2,513,282,049	-	1.0409	-



## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
2019年2月22日～ 2019年8月21日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	1.2
2019年2月22日～ 2019年8月21日	1.8

(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】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1計算期間	32,130,976	5,235,210	26,895,766
第2計算期間	452,842,888	28,932,225	450,806,429
2019年2月22日～ 2019年8月21日	1,981,541,271	61,547,584	2,370,800,116

(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8月末現在

### ●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,409円
純資産総額	25億円

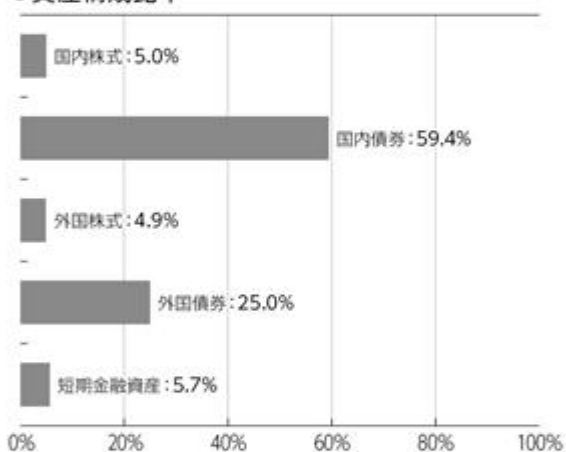
### ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年2月	0円
2019年2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

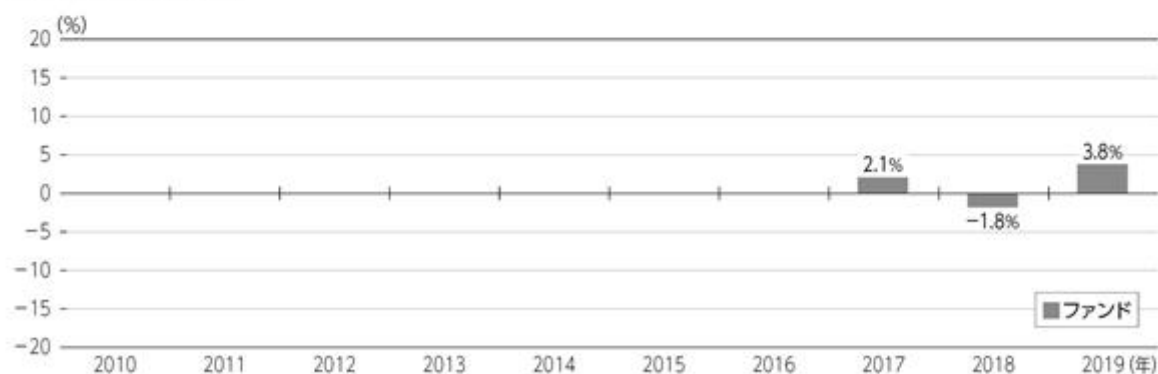
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

### ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

### ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2017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。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

#### 取扱コース

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

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

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

ありません。

#### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

金融商品取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止すること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5営業日目からお支払いします。

**その他**

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

#### (5)【その他】

繰上償還

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

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

確定拠出年金法に基づく運用として購入する加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

### (2) 償還金に対する請求権

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

## (3) 解約請求権

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

## (4) 帳簿閲覧権

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

## (5) 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2017年7月14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2期計算期間(2018年2月22日から2019年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2018年2月21日現在)	第2期 (2019年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	35,757	1,079,152
コール・ローン	1,336,506	22,028,580
親投資信託受益証券	25,704,751	436,627,664
未収入金	6,742	1,488,995
流動資産合計	27,083,756	461,224,391
資産合計	27,083,756	461,224,391
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,580	1,562,905
未払受託者報酬	492	34,992
未払委託者報酬	3,496	245,258
その他未払費用	229	17,445
流動負債合計	10,797	1,860,600
負債合計	10,797	1,860,600
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,895,766	450,806,429
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	177,193	8,557,362
純資産合計	27,072,959	459,363,791
負債純資産合計	27,083,756	461,224,391

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2017年7月14日 至2018年2月21日)	第2期 (自2018年2月22日 至2019年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	85
有価証券売買等損益	295,674	4,875,365
営業収益合計	295,674	4,875,450
<b>営業費用</b>		
支払利息	83	8,158
受託者報酬	828	44,819
委託者報酬	6,447	314,281
その他費用	372	24,355
営業費用合計	7,730	391,613
営業利益又は営業損失( )	303,404	4,483,837
経常利益又は経常損失( )	303,404	4,483,837
当期純利益又は当期純損失( )	303,404	4,483,837
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( )	315	39,841
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	177,193
剰余金増加額又は欠損金減少額	557,619	4,209,896
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	557,619	4,209,896
剰余金減少額又は欠損金増加額	77,337	273,723
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	77,337	273,723
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( )	177,193	8,557,362

## ( 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2月21日現在 )	第2期 ( 2019年2月21日現在 )
1 . 受益権総口数	26,895,766口	450,806,429口
2 . 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.0066円 ( 10,066円 )	1.0190円 ( 10,190円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 ( 自2017年7月14日 至2018年2月21日 )	第2期 ( 自2018年2月22日 至2019年2月21日 )
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(177,300円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は177,300円(1口当たり0.006592円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(4,192,793円)、収益調整金(4,382,083円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は8,574,876円(1口当たり0.019021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2017年7月14日 至2018年2月21日)	第2期 (自2018年2月22日 至2019年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2018年2月21日現在)	第2期 (2019年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年2月21日現在)	第2期 (2019年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	297,712	4,927,737
合計	297,712	4,927,737

## (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2月21日現在)	第2期 (2019年2月21日現在)
期首元本額	1,000,000円	26,895,766円
期中追加設定元本額	31,130,976円	452,842,888円
期中一部解約元本額	5,235,210円	28,932,225円

## ( 4 ) 【附属明細表】 ( 2019年2月21日現在 )

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	13,748,346	23,255,327	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	279,529,696	274,917,456	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	13,566,941	23,522,362	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	86,130,485	114,932,519	
親投資信託受益証券 合計		392,975,468	436,627,664	
合計		392,975,468	436,627,664	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

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

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（2018年2月21日現在）	（2019年2月21日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	58,384,850	47,564,462
コール・ローン	2,182,308,482	970,926,881
株式	49,912,570,510	57,385,765,970
派生商品評価勘定	12,928,800	39,356,380
未収入金	36,702,090	-
未収配当金	66,199,765	91,169,006
差入委託証拠金	33,210,000	24,645,000
流動資産合計	52,302,304,497	58,559,427,699
資産合計	52,302,304,497	58,559,427,699
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,652,960	-
前受金	10,575,000	41,505,000
未払金	1,310,006,690	-
未払解約金	66,428,452	194,719,481
その他未払費用	4,169	801
流動負債合計	1,389,667,271	236,225,282
負債合計	1,389,667,271	236,225,282
純資産の部		
元本等		
元本	28,178,885,286	34,479,781,252
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,733,751,940	23,843,421,165
純資産合計	50,912,637,226	58,323,202,417
負債純資産合計	52,302,304,497	58,559,427,699



## 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2月21日現在）	（2019年2月21日現在）
1. 受益権総口数	28,178,885,286口	34,479,781,252口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8068円 (18,068円)	1.6915円 (16,915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 2017年7月14日 至 2018年2月21日）	（自 2018年2月22日 至 2019年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	24,555,600	990,360
合計	24,555,600	990,360

## (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2月21日 現在)				(2019年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	941,445,000	-	951,750,000	10,305,000	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000
合計	941,445,000	-	951,750,000	10,305,000	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000

## (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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	26,129,457,793円	28,178,885,286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	8,479,307,701円	15,224,610,246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	6,429,880,208円	8,923,714,280円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,166,753,242円	6,998,062,126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)	5,442,163,554円	5,016,960,919円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,462,634円	3,238,783円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,114,792円	4,210,362円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	902,241,656円	1,206,781,976円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,416,510,058円	4,302,209,365円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,426,134,995円	2,930,765,501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)	15,427,793円	12,596,798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)	52,427,695円	44,117,130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)	65,691,986円	51,034,232円
DCニッセイ国内株式インデックス	69,513,538円	158,510,666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	8,325,872,380円	13,120,980,625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)	269,192,835円	474,668,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	3,727,551円	26,528,689円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	760,570円	13,748,346円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	273,300円	16,200,912円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	417,228円	26,018,748円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	647,891円	9,123,269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)	6,943,387円	22,218,183円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	3,535,483円	25,051,252円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	543,295円	2,050,565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)	587,583円	703,909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)	249,893円	1,345,741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)	1,691,947円	11,655,177円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	286,258円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	274,453円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	258,941円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	180,146円
計	28,178,885,286円	34,479,781,252円

## 附属明細表(2019年2月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,100	2,998.00	3,297,800	
日本水産	33,900	716.00	24,272,400	
マルハニチロ	4,900	3,710.00	18,179,000	
カネコ種苗	1,200	1,334.00	1,600,800	
サカタのタネ	4,100	3,795.00	15,559,500	
ホクト	2,800	1,953.00	5,468,400	
ヒノキヤグループ	800	2,286.00	1,828,800	
ショーボンドホールディングス	2,400	7,800.00	18,720,000	
ミライト・ホールディングス	9,500	1,671.00	15,874,500	
タマホーム	1,600	1,119.00	1,790,400	
ファーストコーポレーション	2,000	742.00	1,484,000	
スペースバリューホールディングス	4,100	892.00	3,657,200	
住石ホールディングス	6,400	101.00	646,400	
日鉄鉱業	800	4,645.00	3,716,000	
三井松島ホールディングス	1,400	1,538.00	2,153,200	
国際石油開発帝石	135,600	1,146.00	155,397,600	
石油資源開発	4,900	2,335.00	11,441,500	
K&Oエナジーグループ	1,600	1,506.00	2,409,600	
ダイセキ環境ソリューション	500	634.00	317,000	
安藤・間	21,600	752.00	16,243,200	
東急建設	9,900	954.00	9,444,600	
コムシスホールディングス	12,000	2,945.00	35,340,000	
ミサワホーム	2,700	743.00	2,006,100	
高松コンストラクショングループ	2,100	2,714.00	5,699,400	
東建コーポレーション	1,000	6,770.00	6,770,000	
ソネック	2,100	723.00	1,518,300	
ヤマウラ	1,500	975.00	1,462,500	
大成建設	27,800	5,040.00	140,112,000	
大林組	83,600	1,042.00	87,111,200	
清水建設	85,300	948.00	80,864,400	
飛鳥建設	2,400	1,484.00	3,561,600	
長谷工コーポレーション	34,900	1,355.00	47,289,500	
松井建設	3,100	752.00	2,331,200	
銭高組	300	5,370.00	1,611,000	
鹿島建設	65,400	1,574.00	102,939,600	
不動テトラ	1,900	1,593.00	3,026,700	
大末建設	1,600	940.00	1,504,000	
鉄建建設	1,700	2,710.00	4,607,000	
西松建設	6,000	2,511.00	15,066,000	
三井住友建設	20,100	702.00	14,110,200	
大豊建設	1,900	3,130.00	5,947,000	
前田建設工業	19,900	1,149.00	22,865,100	
佐田建設	3,700	379.00	1,402,300	
ナカノフドー建設	3,000	511.00	1,533,000	
奥村組	4,600	3,410.00	15,686,000	
東鉄工業	3,300	3,010.00	9,933,000	
浅沼組	1,000	2,656.00	2,656,000	
戸田建設	32,400	706.00	22,874,400	
熊谷組	4,000	3,270.00	13,080,000	
青木あすなる建設	1,500	1,017.00	1,525,500	
北野建設	600	3,130.00	1,878,000	
植木組	700	2,351.00	1,645,700	
矢作建設工業	3,800	761.00	2,891,800	
ピーエス三菱	2,900	617.00	1,789,300	

日本ハウスホールディングス	5,300	435.00	2,305,500
大東建託	9,900	15,725.00	155,677,500
新日本建設	3,300	1,010.00	3,333,000
N I P P O	7,400	2,096.00	15,510,400
東亜道路工業	500	3,055.00	1,527,500
前田道路	8,700	2,090.00	18,183,000
日本道路	800	6,540.00	5,232,000
東亜建設工業	2,400	1,637.00	3,928,800
若築建設	1,400	1,482.00	2,074,800
東洋建設	10,200	421.00	4,294,200
五洋建設	33,200	542.00	17,994,400
世紀東急工業	4,100	625.00	2,562,500
福田組	900	4,360.00	3,924,000
住友林業	19,800	1,432.00	28,353,600
日本基礎技術	4,300	374.00	1,608,200
巴コーポレーション	3,700	383.00	1,417,100
大和ハウス工業	77,200	3,426.00	264,487,200
ライト工業	5,400	1,516.00	8,186,400
積水ハウス	85,400	1,633.00	139,458,200
日特建設	2,400	613.00	1,471,200
北陸電気工事	1,600	933.00	1,492,800
ユアテック	4,500	887.00	3,991,500
四電工	600	2,650.00	1,590,000
中電工	3,600	2,332.00	8,395,200
関電工	12,700	1,023.00	12,992,100
きんでん	18,500	1,791.00	33,133,500
東京エネシス	2,900	990.00	2,871,000
トーエネック	800	3,230.00	2,584,000
住友電設	1,900	1,850.00	3,515,000
日本電設工業	4,800	2,282.00	10,953,600
協和エクシオ	10,900	2,875.00	31,337,500
新日本空調	2,300	1,889.00	4,344,700
日本工営	1,600	2,523.00	4,036,800
九電工	5,500	3,845.00	21,147,500
三機工業	6,300	1,187.00	7,478,100
日揮	24,000	1,674.00	40,176,000
中外炉工業	800	1,754.00	1,403,200
ヤマト	3,000	468.00	1,404,000
太平電業	1,900	2,589.00	4,919,100
高砂熱学工業	7,000	1,810.00	12,670,000
三晃金属工業	500	2,999.00	1,499,500
N E C ネットエスアイ	2,700	2,575.00	6,952,500
朝日工業社	600	2,971.00	1,782,600
明星工業	5,000	734.00	3,670,000
大気社	3,800	3,235.00	12,293,000
ダイダン	1,900	2,476.00	4,704,400
日比谷総合設備	2,700	1,875.00	5,062,500
東芝プラントシステム	6,000	2,037.00	12,222,000
日本製粉	8,300	1,904.00	15,803,200
日清製粉グループ本社	28,200	2,380.00	67,116,000
昭和産業	2,300	3,020.00	6,946,000
鳥越製粉	2,200	793.00	1,744,600
中部飼料	3,000	1,081.00	3,243,000
フィード・ワン	16,800	179.00	3,007,200
東洋精糖	1,400	1,040.00	1,456,000
日本甜菜製糖	1,400	1,821.00	2,549,400
三井製糖	2,000	2,825.00	5,650,000
塩水港精糖	6,700	226.00	1,514,200
日新製糖	1,200	2,070.00	2,484,000
L I F U L L	9,200	643.00	5,915,600

ジェイエイシーリクルートメント	1,900	2,434.00	4,624,600
日本M&Aセンター	17,700	2,895.00	51,241,500
タケエイ	2,500	818.00	2,045,000
トラスト・テック	1,300	3,550.00	4,615,000
コシダカホールディングス	6,400	1,649.00	10,553,600
パソナグループ	2,900	1,468.00	4,257,200
C D S	1,300	1,273.00	1,654,900
リンクアンドモチベーション	4,400	912.00	4,012,800
G C A	2,400	895.00	2,148,000
エス・エム・エス	8,700	1,960.00	17,052,000
パーソルホールディングス	23,800	1,925.00	45,815,000
リニカル	1,300	1,710.00	2,223,000
クックパッド	7,500	293.00	2,197,500
アイ・ケイ・ケイ	2,000	740.00	1,480,000
森永製菓	6,300	4,865.00	30,649,500
中村屋	600	4,270.00	2,562,000
江崎グリコ	7,500	5,710.00	42,825,000
名糖産業	1,200	1,399.00	1,678,800
井村屋グループ	1,100	2,440.00	2,684,000
不二家	1,400	2,250.00	3,150,000
山崎製パン	20,400	1,933.00	39,433,200
モロゾフ	400	5,040.00	2,016,000
亀田製菓	1,600	5,360.00	8,576,000
寿スピリッツ	2,600	4,385.00	11,401,000
カルビー	11,400	3,080.00	35,112,000
森永乳業	5,000	3,450.00	17,250,000
六甲バター	1,800	2,007.00	3,612,600
ヤクルト本社	18,500	7,490.00	138,565,000
明治ホールディングス	17,700	8,720.00	154,344,000
雪印メグミルク	6,000	2,718.00	16,308,000
プリマハム	3,500	2,158.00	7,553,000
日本ハム	10,800	4,330.00	46,764,000
丸大食品	2,700	1,901.00	5,132,700
S Foods	2,200	4,155.00	9,141,000
伊藤ハム米久ホールディングス	16,100	676.00	10,883,600
学情	1,200	1,304.00	1,564,800
スタジオアリス	1,200	2,323.00	2,787,600
シミックホールディングス	1,300	1,615.00	2,099,500
システナ	8,700	1,128.00	9,813,600
N J S	1,000	1,486.00	1,486,000
デジタルアーツ	1,300	8,460.00	10,998,000
新日鉄住金ソリューションズ	3,700	2,999.00	11,096,300
総合警備保障	9,500	4,825.00	45,837,500
いちご	31,200	388.00	12,105,600
日本駐車場開発	29,600	155.00	4,588,000
コア	1,300	1,371.00	1,782,300
カカクコム	17,900	2,141.00	38,323,900
セントケア・ホールディング	2,800	574.00	1,607,200
ルネサンス	1,300	2,009.00	2,611,700
ディップ	3,800	2,038.00	7,744,400
S B Sホールディングス	2,500	1,981.00	4,952,500
オプトホールディング	1,500	1,678.00	2,517,000
新日本科学	3,200	809.00	2,588,800
ツクイ	5,600	738.00	4,132,800
ベネフィット・ワン	3,300	4,225.00	13,942,500
エムスリー	50,100	1,729.00	86,622,900
ツカダ・グローバルホールディング	2,400	619.00	1,485,600
アウトソーシング	12,500	1,360.00	17,000,000
ウェルネット	2,200	1,092.00	2,402,400
ワールドホールディングス	700	2,123.00	1,486,100

ディー・エヌ・エー	12,800	1,704.00	21,811,200
博報堂DYホールディングス	33,100	1,788.00	59,182,800
ぐるなび	3,400	720.00	2,448,000
エスアールジータカミヤ	2,500	673.00	1,682,500
ジャパンベストレスキューシステム	1,900	1,284.00	2,439,600
ファンコミュニケーションズ	6,500	529.00	3,438,500
ライク	1,300	973.00	1,264,900
ビジネス・ブレークスルー	4,500	381.00	1,714,500
WDBホールディングス	1,100	2,817.00	3,098,700
バリューコマース	1,600	2,190.00	3,504,000
インフォマート	13,000	1,272.00	16,536,000
サッポロホールディングス	9,100	2,451.00	22,304,100
アサヒグループホールディングス	52,300	4,823.00	252,242,900
麒麟ホールディングス	113,000	2,540.00	287,020,000
宝ホールディングス	18,700	1,255.00	23,468,500
オエノンホールディングス	7,100	382.00	2,712,200
養命酒製造	800	2,139.00	1,711,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	19,100	2,975.00	56,822,500
サントリー食品インターナショナル	16,700	5,020.00	83,834,000
ダイドーグループホールディングス	1,400	5,480.00	7,672,000
伊藤園	7,600	5,190.00	39,444,000
キーコーヒー	2,500	2,054.00	5,135,000
日清オイリオグループ	3,200	3,425.00	10,960,000
不二製油グループ本社	6,100	3,850.00	23,485,000
かどや製油	300	5,050.00	1,515,000
J・オイルミルズ	1,300	4,035.00	5,245,500
ローソン	6,200	6,890.00	42,718,000
サンエー	1,900	4,470.00	8,493,000
カワチ薬品	1,900	2,117.00	4,022,300
エービーシー・マート	3,800	6,480.00	24,624,000
ハードオフコーポレーション	1,800	817.00	1,470,600
高千穂交易	1,500	1,017.00	1,525,500
アスクル	2,600	2,420.00	6,292,000
ゲオホールディングス	3,700	1,655.00	6,123,500
アダストリア	3,400	1,902.00	6,466,800
ジーフット	2,200	678.00	1,491,600
伊藤忠食品	600	4,875.00	2,925,000
くらコーポレーション	1,400	5,570.00	7,798,000
キャンドウ	1,200	1,585.00	1,902,000
エレマテック	1,100	1,852.00	2,037,200
パルグループホールディングス	1,300	3,110.00	4,043,000
JALUX	700	2,516.00	1,761,200
エディオン	10,400	972.00	10,108,800
あらた	1,400	4,430.00	6,202,000
サーラコーポレーション	5,000	578.00	2,890,000
トーメンデバイス	600	2,514.00	1,508,400
ハローズ	900	2,140.00	1,926,000
JPホールディングス	6,800	283.00	1,924,400
あみやき亭	500	3,675.00	1,837,500
東京エレクトロン デバイス	900	1,844.00	1,659,600
ひらまつ	4,900	351.00	1,719,900
フィールズ	2,100	720.00	1,512,000
双日	135,400	422.00	57,138,800
アルフレッサ ホールディングス	27,200	3,230.00	87,856,000
大黒天物産	600	4,055.00	2,433,000
ハニーズホールディングス	2,200	956.00	2,103,200
キッコーマン	16,500	5,670.00	93,555,000
味の素	55,200	1,689.00	93,232,800
キューピー	13,900	2,576.00	35,806,400



ハウス食品グループ本社	9,500	4,390.00	41,705,000
カゴメ	10,000	2,938.00	29,380,000
アリアケジャパン	2,300	5,980.00	13,754,000
ピエトロ	900	1,646.00	1,481,400
エバラ食品工業	700	2,157.00	1,509,900
ニチレイ	13,000	2,795.00	36,335,000
横浜冷凍	6,400	924.00	5,913,600
東洋水産	12,900	4,185.00	53,986,500
イトアンド	900	1,703.00	1,532,700
大冷	900	1,743.00	1,568,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,000	637.00	1,911,000
日清食品ホールディングス	10,600	7,630.00	80,878,000
永谷園ホールディングス	1,300	2,406.00	3,127,800
フジッコ	2,700	2,277.00	6,147,900
ロック・フィールド	2,700	1,606.00	4,336,200
日本たばこ産業	144,300	2,891.50	417,243,450
ケンコーマヨネーズ	1,400	2,246.00	3,144,400
わらべや日洋ホールディングス	1,600	1,973.00	3,156,800
なとり	1,400	1,691.00	2,367,400
ピクルスコーポレーション	700	1,878.00	1,314,600
北の達人コーポレーション	9,800	447.00	4,380,600
ユウグレナ	10,600	755.00	8,003,000
片倉工業	3,000	1,235.00	3,705,000
グンゼ	1,600	5,060.00	8,096,000
ヒューリック	51,200	1,025.00	52,480,000
ラサ商事	1,800	858.00	1,544,400
アルペン	1,900	1,662.00	3,157,800
クオールホールディングス	3,600	1,475.00	5,310,000
アルコニックス	2,600	1,271.00	3,304,600
神戸物産	3,700	3,700.00	13,690,000
ジンズ	1,700	5,390.00	9,163,000
ビックカメラ	13,100	1,259.00	16,492,900
D C Mホールディングス	13,200	1,117.00	14,744,400
ペッパーフードサービス	1,900	2,860.00	5,434,000
Monotaro	15,500	2,474.00	38,347,000
DDホールディングス	700	2,166.00	1,516,200
あいホールディングス	3,500	1,955.00	6,842,500
ディービーエックス	1,300	1,178.00	1,531,400
きちりホールディングス	2,200	735.00	1,617,000
アークランドサービスホールディングス	1,800	2,051.00	3,691,800
J・フロントリテイリング	31,400	1,228.00	38,559,200
ドトール・日レスホールディングス	4,300	2,193.00	9,429,900
マツモトキヨシホールディングス	10,100	3,900.00	39,390,000
ブロンコビリー	1,300	2,683.00	3,487,900
ZOZO	26,500	1,814.00	48,071,000
物語コーポレーション	600	9,840.00	5,904,000
ココカラファイン	2,800	4,935.00	13,818,000
三越伊勢丹ホールディングス	45,900	1,101.00	50,535,900
東洋紡	10,300	1,583.00	16,304,900
ユニチカ	7,100	486.00	3,450,600
富士紡ホールディングス	1,300	2,837.00	3,688,100
日清紡ホールディングス	13,800	959.00	13,234,200
倉敷紡績	2,300	2,269.00	5,218,700
ダイワボウホールディングス	2,200	6,540.00	14,388,000
シキボウ	1,400	1,034.00	1,447,600
日東紡績	3,700	1,972.00	7,296,400
トヨタ紡織	8,700	1,821.00	15,842,700
マクニカ・富士エレホールディングス	6,800	1,527.00	10,383,600
Hamee	1,600	826.00	1,321,600
ラクト・ジャパン	500	8,720.00	4,360,000

ウエルシアホールディングス	6,500	4,100.00	26,650,000
クリエイトSDホールディングス	3,600	2,875.00	10,350,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,600	1,089.00	5,009,400
八洲電機	1,900	840.00	1,596,000
UKCホールディングス	1,600	2,075.00	3,320,000
ジュテックホールディングス	900	1,051.00	945,900
大光	2,700	618.00	1,668,600
OCHIホールディングス	1,300	1,258.00	1,635,400
TOKAIホールディングス	13,000	918.00	11,934,000
ミサワ	3,400	435.00	1,479,000
ティーライフ	1,600	1,036.00	1,657,600
Cominix	1,800	876.00	1,576,800
三洋貿易	1,200	2,106.00	2,527,200
チムニー	700	2,681.00	1,876,700
シュッピン	2,100	773.00	1,623,300
ビューティガレージ	900	1,473.00	1,325,700
ウイン・パートナーズ	1,600	1,171.00	1,873,600
ネクステージ	3,800	981.00	3,727,800
ジョイフル本田	7,200	1,447.00	10,418,400
鳥貴族	800	1,809.00	1,447,200
キリン堂ホールディングス	1,100	1,566.00	1,722,600
ホットランド	1,300	1,367.00	1,777,100
すかいらくホールディングス	22,800	1,728.00	39,398,400
綿半ホールディングス	900	2,293.00	2,063,700
日本毛織	8,000	897.00	7,176,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,100	1,186.00	8,420,600
三栄建築設計	1,000	1,645.00	1,645,000
スター・マイカ	1,100	1,378.00	1,515,800
野村不動産ホールディングス	16,300	2,076.00	33,838,800
三重交通グループホールディングス	5,000	614.00	3,070,000
サムティ	3,400	1,515.00	5,151,000
ディア・ライフ	3,300	435.00	1,435,500
日本商業開発	1,500	1,538.00	2,307,000
プレサンスコーポレーション	3,900	1,418.00	5,530,200
ユニゾホールディングス	3,700	2,147.00	7,943,900
THEグローバル社	2,700	502.00	1,355,400
日本管理センター	1,700	766.00	1,302,200
サンセイランディック	1,800	754.00	1,357,200
エストラスト	1,900	790.00	1,501,000
フージャースホールディングス	5,300	687.00	3,641,100
オープンハウス	4,000	3,945.00	15,780,000
東急不動産ホールディングス	66,000	616.00	40,656,000
飯田グループホールディングス	20,500	2,036.00	41,738,000
イーグランド	2,200	693.00	1,524,600
ムゲンエステート	1,300	624.00	811,200
帝国繊維	2,700	2,425.00	6,547,500
日本コークス工業	21,000	101.00	2,121,000
あさひ	2,000	1,481.00	2,962,000
日本調剤	900	3,940.00	3,546,000
コスモス薬品	1,100	20,750.00	22,825,000
シップヘルスケアホールディングス	5,100	4,255.00	21,700,500
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	1,567.00	1,723,700
セブン&アイ・ホールディングス	102,800	4,989.00	512,869,200
薬王堂	1,100	2,610.00	2,871,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,600	1,283.00	8,467,800
明治電機工業	900	1,820.00	1,638,000
ツルハホールディングス	5,300	9,930.00	52,629,000

サンマルクホールディングス	1,900	2,604.00	4,947,600
フェリシモ	1,300	1,133.00	1,472,900
トリドールホールディングス	3,000	2,304.00	6,912,000
帝人	19,900	1,877.00	37,352,300
東レ	189,100	785.60	148,556,960
クラレ	41,100	1,539.00	63,252,900
旭化成	173,400	1,201.00	208,253,400
サカイオーベックス	800	1,827.00	1,461,600
TOKYO BASE	2,200	885.00	1,947,000
稲葉製作所	1,400	1,267.00	1,773,800
宮地エンジニアリンググループ	700	2,088.00	1,461,600
トーカロ	6,400	922.00	5,900,800
アルファ	1,200	1,383.00	1,659,600
SUMCO	27,200	1,539.00	41,860,800
川田テクノロジーズ	500	6,840.00	3,420,000
RS Technologies	600	3,175.00	1,905,000
ハウズドゥ	1,400	1,530.00	2,142,000
アグレ都市デザイン	2,400	628.00	1,507,200
テンポイノベーション	1,000	1,750.00	1,750,000
住江織物	700	2,702.00	1,891,400
日本フェルト	3,300	459.00	1,514,700
イチカワ	1,100	1,398.00	1,537,800
芦森工業	1,000	1,709.00	1,709,000
アツギ	2,000	976.00	1,952,000
ジャパンミート	900	1,777.00	1,599,300
コメダホールディングス	5,700	2,134.00	12,163,800
サツドラホールディングス	800	1,883.00	1,506,400
パロックジャパンリミテッド	2,000	918.00	1,836,000
クスリのアオキホールディングス	2,400	7,740.00	18,576,000
共和レザー	1,900	789.00	1,499,100
スシローグローバルホールディングス	2,700	7,090.00	19,143,000
LIXILビバ	2,100	1,466.00	3,078,600
セーレン	6,000	1,874.00	11,244,000
ソトー	1,500	979.00	1,468,500
東海染工	1,500	1,064.00	1,596,000
小松マテーレ	4,000	814.00	3,256,000
ワコールホールディングス	7,100	2,785.00	19,773,500
ホギメディカル	3,100	3,765.00	11,671,500
クラウドシアホールディングス	3,100	477.00	1,478,700
TSIホールディングス	9,000	716.00	6,444,000
マツオカコーポレーション	800	3,275.00	2,620,000
ワールド	2,400	2,041.00	4,898,400
TIS	8,100	5,260.00	42,606,000
電算システム	900	2,541.00	2,286,900
グリー	16,800	462.00	7,761,600
コーエーテクモホールディングス	5,000	1,887.00	9,435,000
三菱総合研究所	1,000	3,310.00	3,310,000
ボルテージ	2,600	583.00	1,515,800
電算	700	2,228.00	1,559,600
AGS	2,200	712.00	1,566,400
ファインデックス	2,400	802.00	1,924,800
ヒト・コミュニケーションズ	1,000	1,626.00	1,626,000
ブレインパッド	500	5,100.00	2,550,000
KLab	4,400	808.00	3,555,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,200	861.00	2,755,200
ネクソン	62,200	1,643.00	102,194,600
アイスタイル	6,200	737.00	4,569,400
エムアップ	800	2,078.00	1,662,400
エイチーム	1,500	1,867.00	2,800,500

テクノスジャパン	2,000	760.00	1,520,000
コロプラ	7,000	703.00	4,921,000
ブロードリーフ	12,100	581.00	7,030,100
デジタルハーツホールディングス	1,100	1,299.00	1,428,900
メディアドゥホールディングス	800	2,336.00	1,868,800
じげん	2,600	669.00	1,739,400
サイバーリンクス	1,600	950.00	1,520,000
フィックスターズ	2,300	1,272.00	2,925,600
CARTA HOLDINGS	1,400	1,086.00	1,520,400
オプティム	500	3,875.00	1,937,500
セレス	900	1,956.00	1,760,400
特種東海製紙	1,600	3,985.00	6,376,000
ティーガイア	2,400	2,035.00	4,884,000
セック	400	3,680.00	1,472,000
豆蔵ホールディングス	1,700	1,029.00	1,749,300
テクマトリックス	1,700	1,812.00	3,080,400
プロシップ	1,100	1,398.00	1,537,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	58,900	302.00	17,787,800
GMOペイメントゲートウェイ	4,000	6,260.00	25,040,000
ザッパラス	4,000	397.00	1,588,000
インターネットイニシアティブ	4,000	2,510.00	10,040,000
さくらインターネット	3,100	524.00	1,624,400
GMOクラウド	500	3,435.00	1,717,500
SRAホールディングス	1,300	2,659.00	3,456,700
MINORIソリューションズ	900	1,643.00	1,478,700
朝日ネット	2,900	514.00	1,490,600
アドソル日進	1,000	1,739.00	1,739,000
フリービット	1,800	967.00	1,740,600
コムチュア	1,400	2,994.00	4,191,600
王子ホールディングス	109,800	671.00	73,675,800
日本製紙	11,700	2,052.00	24,008,400
三菱製紙	4,000	573.00	2,292,000
北越コーポレーション	16,200	630.00	10,206,000
大王製紙	11,900	1,307.00	15,553,300
阿波製紙	3,100	466.00	1,444,600
メディカル・データ・ビジョン	2,200	1,093.00	2,404,600
gumi	3,100	600.00	1,860,000
モバイルファクトリー	600	1,426.00	855,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,483.00	1,631,300
PCIホールディングス	600	2,297.00	1,378,200
パイブドHD	1,600	866.00	1,385,600
ランドコンピュータ	1,500	1,145.00	1,717,500
オープンドア	1,200	3,155.00	3,786,000
マイネット	800	1,110.00	888,000
アカツキ	900	5,950.00	5,355,000
LINE	7,400	4,010.00	29,674,000
レンゴー	25,200	942.00	23,738,400
トーモク	1,500	1,653.00	2,479,500
ザ・バック	1,900	3,225.00	6,127,500
シンクロ・フード	2,400	712.00	1,708,800
オークネット	1,600	1,011.00	1,617,600
AOI TYO HOLDINGS	2,700	805.00	2,173,500
マクロミル	4,300	1,395.00	5,998,500
ピーグリー	1,700	950.00	1,615,000
昭和電工	16,200	3,985.00	64,557,000
住友化学	191,900	560.00	107,464,000
住友精化	1,200	4,335.00	5,202,000
日産化学	15,000	5,900.00	88,500,000

ラサ工業	1,100	1,520.00	1,672,000
クレハ	2,300	6,810.00	15,663,000
多木化学	700	5,550.00	3,885,000
テイカ	2,000	2,145.00	4,290,000
石原産業	4,700	1,181.00	5,550,700
片倉コープアグリ	1,300	1,155.00	1,501,500
日東エフシー	2,000	775.00	1,550,000
日本曹達	3,800	2,945.00	11,191,000
東ソー	37,700	1,651.00	62,242,700
トクヤマ	7,000	2,794.00	19,558,000
セントラル硝子	5,300	2,538.00	13,451,400
東亜合成	15,300	1,272.00	19,461,600
大阪ソーダ	2,600	2,835.00	7,371,000
関東電化工業	5,800	883.00	5,121,400
デンカ	9,600	3,375.00	32,400,000
イビデン	15,200	1,572.00	23,894,400
信越化学工業	43,000	9,552.00	410,736,000
日本カーバイド工業	900	1,522.00	1,369,800
堺化学工業	1,600	2,381.00	3,809,600
第一稀元素化学工業	2,000	909.00	1,818,000
エア・ウォーター	20,000	1,828.00	36,560,000
大陽日酸	20,100	1,577.00	31,697,700
日本化学工業	800	2,386.00	1,908,800
日本パーカライジング	13,300	1,454.00	19,338,200
高圧ガス工業	3,900	820.00	3,198,000
四国化成工業	4,100	1,307.00	5,358,700
戸田工業	700	2,201.00	1,540,700
ステラ ケミファ	1,400	3,250.00	4,550,000
保土谷化学工業	800	2,838.00	2,270,400
日本触媒	4,100	7,530.00	30,873,000
大日精化工業	2,000	3,110.00	6,220,000
カネカ	6,500	4,445.00	28,892,500
協和発酵キリン	31,200	2,141.00	66,799,200
三菱瓦斯化学	25,100	1,769.00	44,401,900
三井化学	22,100	2,804.00	61,968,400
J S R	24,500	1,838.00	45,031,000
東京応化工業	4,200	3,435.00	14,427,000
大阪有機化学工業	2,300	1,218.00	2,801,400
三菱ケミカルホールディングス	163,000	832.90	135,762,700
K Hネオケム	3,700	2,971.00	10,992,700
ダイセル	37,900	1,155.00	43,774,500
住友ベークライト	4,200	4,450.00	18,690,000
積水化学工業	53,300	1,758.00	93,701,400
日本ゼオン	22,000	1,158.00	25,476,000
アイカ工業	7,300	3,890.00	28,397,000
宇部興産	12,300	2,589.00	31,844,700
積水樹脂	4,000	2,112.00	8,448,000
タキロンシーアイ	5,300	616.00	3,264,800
旭有機材	1,700	1,681.00	2,857,700
日立化成	11,300	2,053.00	23,198,900
ニチバン	1,300	2,207.00	2,869,100
リケンテクノス	6,600	473.00	3,121,800
大倉工業	1,200	1,784.00	2,140,800
積水化成成品工業	3,600	975.00	3,510,000
群栄化学工業	600	2,817.00	1,690,200
タイガースポリマー	2,500	626.00	1,565,000
ミライアル	1,300	1,190.00	1,547,000
ダイキョーニシカワ	5,100	1,272.00	6,487,200
竹本容器	1,000	1,421.00	1,421,000
森六ホールディングス	1,300	2,622.00	3,408,600

日本化薬	15,500	1,324.00	20,522,000
カーリットホールディングス	2,600	833.00	2,165,800
E P Sホールディングス	3,600	1,815.00	6,534,000
プレステージ・インターナショナル	4,400	1,314.00	5,781,600
アミューズ	1,400	2,556.00	3,578,400
野村総合研究所	15,500	4,495.00	69,672,500
ドリームインキュベータ	900	1,500.00	1,350,000
サイバネットシステム	2,600	602.00	1,565,200
クイック	1,500	1,560.00	2,340,000
T A C	6,400	235.00	1,504,000
C Eホールディングス	2,100	730.00	1,533,000
ケネディクス	20,900	535.00	11,181,500
日本システム技術	1,000	1,365.00	1,365,000
電通	29,000	4,970.00	144,130,000
インテージホールディングス	3,100	854.00	2,647,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	1,738.00	1,564,200
東邦システムサイエンス	1,600	918.00	1,468,800
ぴあ	700	4,060.00	2,842,000
イオンファンタジー	800	2,802.00	2,241,600
ソースネクスト	9,500	530.00	5,035,000
シーティーエス	2,700	708.00	1,911,600
ネクシィーズグループ	800	1,731.00	1,384,800
インフォコム	1,000	4,005.00	4,005,000
日本精化	2,000	1,256.00	2,512,000
扶桑化学工業	2,500	2,185.00	5,462,500
トリケミカル研究所	500	5,060.00	2,530,000
F I G	4,500	337.00	1,516,500
A D E K A	12,000	1,714.00	20,568,000
日油	9,400	3,815.00	35,861,000
ミヨシ油脂	1,400	1,065.00	1,491,000
新日本理化	7,500	189.00	1,417,500
ハリマ化成グループ	2,000	1,074.00	2,148,000
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,314.00	2,628,000
花王	60,400	8,407.00	507,782,800
第一工業製薬	900	3,135.00	2,821,500
石原ケミカル	900	1,847.00	1,662,300
日華化学	900	954.00	858,600
ニイタカ	1,000	1,476.00	1,476,000
三洋化成工業	1,600	5,490.00	8,784,000
武田薬品工業	157,800	4,440.00	700,632,000
アステラス製薬	229,500	1,688.50	387,510,750
大日本住友製薬	18,500	2,761.00	51,078,500
塩野義製薬	32,600	7,012.00	228,591,200
田辺三菱製薬	26,000	1,559.00	40,534,000
わかもと製薬	5,300	282.00	1,494,600
あすか製薬	3,100	1,279.00	3,964,900
日本新薬	6,500	6,860.00	44,590,000
中外製薬	26,000	7,450.00	193,700,000
科研製薬	4,500	5,290.00	23,805,000
エーザイ	29,800	9,035.00	269,243,000
理研ビタミン	1,200	3,610.00	4,332,000
ロート製薬	12,800	2,998.00	38,374,400
小野薬品工業	58,800	2,280.00	134,064,000
久光製薬	7,400	5,520.00	40,848,000
有機合成薬品工業	6,900	198.00	1,366,200
持田製薬	1,900	11,420.00	21,698,000
参天製薬	47,200	1,648.00	77,785,600
扶桑薬品工業	900	2,612.00	2,350,800
ツムラ	7,700	3,515.00	27,065,500
日医工	6,400	1,602.00	10,252,800

テルモ	35,200	6,711.00	236,227,200
みらかホールディングス	6,600	3,040.00	20,064,000
キッセイ薬品工業	4,400	2,900.00	12,760,000
生化学工業	4,800	1,374.00	6,595,200
栄研化学	4,400	2,571.00	11,312,400
日水製薬	1,100	1,192.00	1,311,200
鳥居薬品	1,300	2,392.00	3,109,600
JCRファーマ	1,800	5,990.00	10,782,000
東和薬品	1,200	8,790.00	10,548,000
富士製薬工業	1,700	1,856.00	3,155,200
沢井製薬	5,100	6,020.00	30,702,000
ゼリア新薬工業	4,900	1,908.00	9,349,200
第一三共	71,200	3,909.00	278,320,800
キョーリン製薬ホールディングス	5,500	2,235.00	12,292,500
大幸薬品	1,100	1,829.00	2,011,900
ダイト	1,500	2,800.00	4,200,000
大塚ホールディングス	47,400	4,569.00	216,570,600
大正製薬ホールディングス	5,600	11,310.00	63,336,000
ペプチドリーム	12,400	5,080.00	62,992,000
大日本塗料	2,800	1,140.00	3,192,000
日本ペイントホールディングス	20,100	4,140.00	83,214,000
関西ペイント	27,400	2,089.00	57,238,600
中国塗料	8,000	1,015.00	8,120,000
日本特殊塗料	1,800	1,344.00	2,419,200
藤倉化成	3,300	627.00	2,069,100
太陽ホールディングス	2,000	3,750.00	7,500,000
DIC	11,000	3,595.00	39,545,000
サカタインクス	5,300	1,210.00	6,413,000
東洋インキSCホールディングス	5,200	2,629.00	13,670,800
T&K TOKA	1,900	1,045.00	1,985,500
アルプス技研	2,100	1,964.00	4,124,400
日本空調サービス	2,700	677.00	1,827,900
オリエンタルランド	28,100	12,325.00	346,332,500
フォーカスシステムズ	1,600	1,015.00	1,624,000
ダスキン	6,400	2,756.00	17,638,400
パーク24	14,300	2,671.00	38,195,300
明光ネットワークジャパン	3,000	937.00	2,811,000
ファルコホールディングス	1,300	1,445.00	1,878,500
クレスコ	700	3,365.00	2,355,500
フジ・メディア・ホールディングス	25,300	1,657.00	41,922,100
秀英予備校	3,000	495.00	1,485,000
ラウンドワン	7,400	1,412.00	10,448,800
リゾートトラスト	10,100	1,583.00	15,988,300
オービック	8,500	10,300.00	87,550,000
ジャストシステム	3,500	2,662.00	9,317,000
TDCソフト	2,100	951.00	1,997,100
ヤフー	159,300	313.00	49,860,900
ビー・エム・エル	3,100	3,365.00	10,431,500
トレンドマイクロ	13,000	5,360.00	69,680,000
りらいあコミュニケーションズ	4,300	996.00	4,282,800
インフォメーション・ディベロプメント	1,100	1,373.00	1,510,300
リソー教育	12,100	482.00	5,832,200
日本オラクル	4,900	8,240.00	40,376,000
アルファシステムズ	800	2,637.00	2,109,600
フューチャー	3,300	1,744.00	5,755,200
CAC Holdings	1,700	1,208.00	2,053,600
ソフトバンク・テクノロジー	1,000	2,075.00	2,075,000
トーセ	1,800	814.00	1,465,200
ユー・エス・エス	29,100	2,011.00	58,520,100
オービックビジネスコンサルタント	2,500	4,430.00	11,075,000

伊藤忠テクノソリューションズ	11,100	2,603.00	28,893,300
アイティフォー	3,000	839.00	2,517,000
サイバーエージェント	14,700	3,395.00	49,906,500
楽天	110,900	838.00	92,934,200
エクスネット	1,700	842.00	1,431,400
クリーク・アンド・リバー社	1,400	1,162.00	1,626,800
テー・オー・ダブリュー	2,100	790.00	1,659,000
大塚商会	13,200	4,025.00	53,130,000
サイボウズ	2,900	643.00	1,864,700
セントラルスポーツ	900	3,465.00	3,118,500
パラカ	900	1,902.00	1,711,800
電通国際情報サービス	1,500	3,670.00	5,505,000
デジタルガレージ	4,800	2,904.00	13,939,200
イーエムシステムズ	2,000	1,262.00	2,524,000
ウェザーニューズ	800	3,085.00	2,468,000
C I J	1,900	806.00	1,531,400
東洋ビジネスエンジニアリング	800	2,059.00	1,647,200
日本エンタープライズ	8,200	178.00	1,459,600
WOWOW	1,200	3,045.00	3,654,000
スカラ	2,100	825.00	1,732,500
フルキャストホールディングス	2,400	2,208.00	5,299,200
エン・ジャパン	2,600	3,845.00	9,997,000
富士フイルムホールディングス	51,700	4,980.00	257,466,000
コニカミノルタ	54,400	1,076.00	58,534,400
資生堂	49,500	7,174.00	355,113,000
ライオン	34,700	2,230.00	77,381,000
高砂香料工業	1,700	3,600.00	6,120,000
マンダム	5,600	2,737.00	15,327,200
ミルボン	3,100	4,925.00	15,267,500
ファンケル	11,100	2,531.00	28,094,100
コーセー	4,200	18,390.00	77,238,000
コタ	1,200	1,491.00	1,789,200
シーボン	600	2,679.00	1,607,400
ポーラ・オルビスホールディングス	10,600	3,215.00	34,079,000
ノエビアホールディングス	1,600	5,290.00	8,464,000
アジュバンコスメジャパン	1,500	982.00	1,473,000
エステー	1,800	1,947.00	3,504,600
アグロ カネショウ	1,000	2,078.00	2,078,000
コニシ	4,400	1,670.00	7,348,000
長谷川香料	3,000	1,737.00	5,211,000
星光PMC	1,900	816.00	1,550,400
小林製薬	7,000	8,990.00	62,930,000
荒川化学工業	2,200	1,440.00	3,168,000
メック	1,700	1,204.00	2,046,800
日本高純度化学	700	2,346.00	1,642,200
タカラバイオ	6,500	2,454.00	15,951,000
JCU	3,200	1,850.00	5,920,000
新田ゼラチン	2,200	716.00	1,575,200
デクセリアルズ	6,400	829.00	5,305,600
アース製薬	1,900	5,040.00	9,576,000
北興化学工業	2,700	555.00	1,498,500
大成ラミック	800	2,827.00	2,261,600
クミアイ化学工業	10,300	708.00	7,292,400
日本農薬	6,000	485.00	2,910,000
昭和シェル石油	23,000	1,716.00	39,468,000
富士興産	2,300	668.00	1,536,400
ニチレキ	3,200	1,130.00	3,616,000
ユシロ化学工業	1,300	1,320.00	1,716,000
ビーピー・カストロール	1,200	1,350.00	1,620,000
富士石油	6,000	290.00	1,740,000



MORESCO	700	1,609.00	1,126,300
出光興産	19,300	4,065.00	78,454,500
JXTGホールディングス	418,700	552.60	231,373,620
コスモエネルギーホールディングス	7,200	2,385.00	17,172,000
横浜ゴム	14,400	2,283.00	32,875,200
TOYO TIRE	12,800	1,396.00	17,868,800
ブリヂストン	76,500	4,414.00	337,671,000
住友ゴム工業	22,400	1,402.00	31,404,800
藤倉ゴム工業	1,600	435.00	696,000
オカモト	1,700	5,800.00	9,860,000
アキレス	1,800	2,041.00	3,673,800
フコク	1,700	874.00	1,485,800
ニッタ	2,800	3,840.00	10,752,000
クリエートメディック	1,500	995.00	1,492,500
住友理工	4,800	1,039.00	4,987,200
三ツ星ベルト	3,300	2,185.00	7,210,500
バンドー化学	4,700	1,176.00	5,527,200
AGC	24,600	3,870.00	95,202,000
日本板硝子	11,900	985.00	11,721,500
石塚硝子	700	1,747.00	1,222,900
有沢製作所	3,900	821.00	3,201,900
日本山村硝子	1,000	1,511.00	1,511,000
日本電気硝子	10,800	3,025.00	32,670,000
オハラ	1,000	1,812.00	1,812,000
住友大阪セメント	5,000	4,725.00	23,625,000
太平洋セメント	15,700	3,730.00	58,561,000
リソルホールディングス	400	4,345.00	1,738,000
日本ヒューム	2,500	814.00	2,035,000
日本コンクリート工業	5,700	286.00	1,630,200
三谷セキサン	1,200	2,818.00	3,381,600
アジアパイルホールディングス	3,500	623.00	2,180,500
東海カーボン	22,600	1,564.00	35,346,400
日本カーボン	1,200	5,240.00	6,288,000
東洋炭素	1,500	2,094.00	3,141,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,500	5,320.00	7,980,000
TOTO	19,200	4,340.00	83,328,000
日本碍子	30,400	1,699.00	51,649,600
日本特殊陶業	21,000	2,344.00	49,224,000
MARUWA	900	6,210.00	5,589,000
品川リフラクトリーズ	700	3,415.00	2,390,500
黒崎播磨	500	5,800.00	2,900,000
ヨータイ	2,200	601.00	1,322,200
ニッカトー	1,400	1,019.00	1,426,600
フジインコーポレーテッド	2,200	2,327.00	5,119,400
エーアンドエーマテリアル	1,500	1,125.00	1,687,500
ニチアス	6,800	2,066.00	14,048,800
新日鐵住金	114,400	2,023.50	231,488,400
神戸製鋼所	45,100	883.00	39,823,300
中山製鋼所	3,400	496.00	1,686,400
合同製鐵	1,200	1,736.00	2,083,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	66,500	1,945.50	129,375,750
東京製鐵	13,200	891.00	11,761,200
共英製鋼	2,800	1,756.00	4,916,800
大和工業	5,200	3,025.00	15,730,000
東京鐵鋼	1,300	1,192.00	1,549,600
大阪製鐵	1,600	1,862.00	2,979,200
淀川製鋼所	3,300	2,210.00	7,293,000
丸一鋼管	8,700	3,325.00	28,927,500
モリ工業	700	2,605.00	1,823,500
大同特殊鋼	4,000	4,665.00	18,660,000

日本高周波鋼業	2,800	540.00	1,512,000
日本冶金工業	20,400	245.00	4,998,000
山陽特殊製鋼	3,100	2,525.00	7,827,500
愛知製鋼	1,400	3,525.00	4,935,000
日立金属	26,500	1,125.00	29,812,500
日本金属	600	1,302.00	781,200
大太平洋金属	1,700	2,956.00	5,025,200
新日本電工	14,700	238.00	3,498,600
栗本鐵工所	1,200	1,499.00	1,798,800
日本製鋼所	7,500	2,020.00	15,150,000
三菱製鋼	1,800	1,679.00	3,022,200
日亜鋼業	5,300	349.00	1,849,700
日本精線	400	3,385.00	1,354,000
大紀アルミニウム工業所	4,000	624.00	2,496,000
日本軽金属ホールディングス	67,100	247.00	16,573,700
三井金属鉱業	6,700	2,718.00	18,210,600
東邦亜鉛	1,400	3,295.00	4,613,000
三菱マテリアル	16,300	3,125.00	50,937,500
住友金属鉱山	33,700	3,301.00	111,243,700
DOWAホールディングス	5,700	3,575.00	20,377,500
古河機械金属	4,100	1,458.00	5,977,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	1,837.00	5,143,600
東邦チタニウム	4,400	976.00	4,294,400
UACJ	3,700	2,219.00	8,210,300
CKサンエツ	600	3,655.00	2,193,000
古河電気工業	7,100	3,520.00	24,992,000
住友電気工業	92,000	1,534.50	141,174,000
フジクラ	29,700	487.00	14,463,900
昭和電線ホールディングス	2,900	712.00	2,064,800
タツタ電線	4,900	517.00	2,533,300
カナレ電気	800	1,880.00	1,504,000
平河ヒューテック	1,300	1,617.00	2,102,100
リョービ	3,000	2,804.00	8,412,000
アーレスティ	3,000	697.00	2,091,000
アサヒホールディングス	4,600	2,189.00	10,069,400
東洋製罐グループホールディングス	15,700	2,308.00	36,235,600
ホッカンホールディングス	1,200	1,752.00	2,102,400
コロナ	1,400	1,036.00	1,450,400
横河ブリッジホールディングス	4,600	1,974.00	9,080,400
OSJBホールディングス	12,300	282.00	3,468,600
三和ホールディングス	25,400	1,288.00	32,715,200
文化シャッター	7,300	849.00	6,197,700
三協立山	3,400	1,475.00	5,015,000
アルインコ	2,000	991.00	1,982,000
LIXILグループ	36,300	1,545.00	56,083,500
日本フィルコン	2,900	552.00	1,600,800
ノーリツ	5,500	1,652.00	9,086,000
長府製作所	2,500	2,230.00	5,575,000
リンナイ	4,400	7,340.00	32,296,000
ユニプレス	4,800	1,987.00	9,537,600
ダイニチ工業	2,000	737.00	1,474,000
日東精工	3,400	546.00	1,856,400
岡部	5,000	969.00	4,845,000
ジーテクト	2,700	1,779.00	4,803,300
東プレ	4,600	2,429.00	11,173,400
高周波熱錬	4,700	889.00	4,178,300
東京製鋼	1,500	1,032.00	1,548,000
サンコール	1,700	690.00	1,173,000
モリテックスチール	3,600	441.00	1,587,600
パイオラックス	3,900	2,348.00	9,157,200

エイチワン	2,400	1,124.00	2,697,600
日本発条	24,500	1,056.00	25,872,000
アドバネクス	1,000	1,750.00	1,750,000
三浦工業	10,700	2,557.00	27,359,900
タクマ	9,000	1,474.00	13,266,000
テクノプロ・ホールディングス	4,800	5,980.00	28,704,000
インターワークス	2,100	733.00	1,539,300
Keeper 技研	1,600	1,118.00	1,788,800
Gunosy	1,600	2,633.00	4,212,800
イー・ガーディアン	1,100	2,103.00	2,313,300
リブセンス	5,300	279.00	1,478,700
ジャパンマテリアル	6,500	1,466.00	9,529,000
ベクトル	2,900	1,483.00	4,300,700
ウチヤマホールディングス	3,300	442.00	1,458,600
キャリアリンク	4,300	395.00	1,698,500
I B J	800	891.00	712,800
アサンテ	1,000	2,248.00	2,248,000
N・フィールド	1,600	927.00	1,483,200
M&Aキャピタルパートナーズ	600	5,330.00	3,198,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,200	1,196.00	1,435,200
E R Iホールディングス	1,900	809.00	1,537,100
アビスト	500	3,265.00	1,632,500
シグマクス	1,800	930.00	1,674,000
ウィルグループ	1,600	1,198.00	1,916,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,600	262.00	1,467,200
日本ビューホテル	1,300	1,137.00	1,478,100
リクルートホールディングス	170,400	3,018.00	514,267,200
エラン	1,600	1,578.00	2,524,800
ツガミ	5,500	762.00	4,191,000
オークマ	3,100	6,070.00	18,817,000
東芝機械	2,800	2,292.00	6,417,600
アマダホールディングス	38,000	1,148.00	43,624,000
アイダエンジニアリング	6,800	831.00	5,650,800
滝澤鉄工所	1,000	1,732.00	1,732,000
F U J I	7,400	1,573.00	11,640,200
牧野フライス製作所	2,900	4,650.00	13,485,000
オーエスジー	12,100	2,237.00	27,067,700
旭ダイヤモンド工業	6,500	819.00	5,323,500
D M G 森精機	15,600	1,474.00	22,994,400
ソディック	5,400	827.00	4,465,800
ディスコ	3,300	16,380.00	54,054,000
日東工器	1,300	2,331.00	3,030,300
日進工具	700	2,474.00	1,731,800
パンチ工業	2,700	635.00	1,714,500
日本郵政	195,000	1,345.00	262,275,000
ベルシステム24ホールディングス	4,000	1,501.00	6,004,000
鎌倉新書	1,700	1,890.00	3,213,000
一蔵	2,500	621.00	1,552,500
エポラブルアジア	700	2,666.00	1,866,200
ストライク	700	2,104.00	1,472,800
ソラスト	5,800	1,164.00	6,751,200
セラク	2,200	601.00	1,322,200
インソース	800	2,366.00	1,892,800
豊田自動織機	20,100	5,650.00	113,565,000
豊和工業	1,900	888.00	1,687,200
O K K	1,800	860.00	1,548,000
石川製作所	1,200	1,171.00	1,405,200
東洋機械金属	2,500	609.00	1,522,500
島精機製作所	3,400	3,815.00	12,971,000

オプトラン	2,400	2,226.00	5,342,400
NCホールディングス	1,700	486.00	826,200
フリー	2,000	1,060.00	2,120,000
ヤマシンフィルタ	4,300	712.00	3,061,600
日阪製作所	3,000	911.00	2,733,000
やまびこ	4,800	1,062.00	5,097,600
平田機工	1,200	6,650.00	7,980,000
ペガサスミシン製造	2,300	688.00	1,582,400
ナプテスコ	13,500	2,984.00	40,284,000
三井海洋開発	2,600	3,020.00	7,852,000
レオン自動機	2,400	1,618.00	3,883,200
S M C	7,300	38,990.00	284,627,000
新川	3,700	551.00	2,038,700
ホソカワミクロン	900	4,930.00	4,437,000
ユニオンツール	1,100	3,050.00	3,355,000
オイレス工業	3,400	1,949.00	6,626,600
日精エー・エス・ビー機械	700	3,990.00	2,793,000
サトーホールディングス	3,000	2,743.00	8,229,000
技研製作所	1,700	3,335.00	5,669,500
日本エアテック	2,500	593.00	1,482,500
カワタ	1,000	1,365.00	1,365,000
日精樹脂工業	2,100	925.00	1,942,500
オカダアイヨン	1,000	1,469.00	1,469,000
小松製作所	112,700	2,836.50	319,673,550
住友重機械工業	14,200	3,915.00	55,593,000
日立建機	10,000	2,932.00	29,320,000
日工	700	2,174.00	1,521,800
巴工業	1,100	2,391.00	2,630,100
井関農機	2,500	1,644.00	4,110,000
丸山製作所	1,100	1,295.00	1,424,500
北川鉄工所	1,100	2,445.00	2,689,500
シンニッタン	4,500	350.00	1,575,000
ローツェ	1,100	1,719.00	1,890,900
タカキタ	2,300	607.00	1,396,100
クボタ	133,400	1,569.50	209,371,300
荏原実業	700	2,211.00	1,547,700
東洋エンジニアリング	3,300	789.00	2,603,700
三菱化工機	1,000	1,548.00	1,548,000
月島機械	4,900	1,383.00	6,776,700
帝国電機製作所	1,700	1,222.00	2,077,400
新東工業	5,900	1,014.00	5,982,600
澁谷工業	2,200	3,350.00	7,370,000
アイチコーポレーション	4,300	730.00	3,139,000
小森コーポレーション	6,700	1,213.00	8,127,100
鶴見製作所	1,900	1,814.00	3,446,600
荏原製作所	11,000	3,170.00	34,870,000
石井鐵工所	800	1,781.00	1,424,800
西島製作所	2,500	946.00	2,365,000
北越工業	2,600	1,170.00	3,042,000
千代田化工建設	20,100	308.00	6,190,800
ダイキン工業	34,000	12,250.00	416,500,000
オルガノ	900	3,050.00	2,745,000
トーヨーカネツ	900	2,297.00	2,067,300
栗田工業	13,500	2,952.00	39,852,000
椿本チエイン	3,300	4,090.00	13,497,000
日機装	7,100	1,185.00	8,413,500
木村化工機	4,100	379.00	1,553,900
新興プランテック	5,000	1,238.00	6,190,000
アネスト岩田	3,900	1,004.00	3,915,600
ダイフク	13,700	5,610.00	76,857,000

サムコ	1,500	947.00	1,420,500
加藤製作所	1,300	2,752.00	3,577,600
油研工業	800	1,889.00	1,511,200
タダノ	12,000	1,176.00	14,112,000
フジテック	9,000	1,240.00	11,160,000
C K D	6,900	1,065.00	7,348,500
キトー	1,900	1,803.00	3,425,700
平和	6,900	2,216.00	15,290,400
理想科学工業	2,200	1,928.00	4,241,600
S A N K Y O	6,200	4,075.00	25,265,000
日本金銭機械	2,800	1,085.00	3,038,000
マースグループホールディングス	1,600	2,152.00	3,443,200
福島工業	1,500	3,875.00	5,812,500
ダイコク電機	1,100	1,472.00	1,619,200
竹内製作所	4,200	2,038.00	8,559,600
アマノ	7,100	2,375.00	16,862,500
J U K I	3,500	1,320.00	4,620,000
サンデンホールディングス	3,000	828.00	2,484,000
蛇の目ミシン工業	3,000	489.00	1,467,000
ブラザー工業	32,400	2,084.00	67,521,600
マックス	3,800	1,488.00	5,654,400
モリタホールディングス	4,400	1,858.00	8,175,200
グローリー	6,900	2,629.00	18,140,100
新晃工業	2,300	1,576.00	3,624,800
大和冷機工業	3,600	1,270.00	4,572,000
セガサミーホールディングス	24,700	1,312.00	32,406,400
日本ピストンリング	900	1,693.00	1,523,700
リケン	1,200	5,360.00	6,432,000
T P R	3,300	2,434.00	8,032,200
ツバキ・ナカシマ	3,800	2,012.00	7,645,600
ホシザキ	7,300	7,700.00	56,210,000
大豊工業	2,000	1,019.00	2,038,000
日本精工	51,100	1,059.00	54,114,900
N T N	53,500	357.00	19,099,500
ジェイテクト	23,900	1,412.00	33,746,800
不二越	2,300	4,535.00	10,430,500
ミネベアミツミ	46,200	1,786.00	82,513,200
日本トムソン	7,400	559.00	4,136,600
T H K	15,500	2,818.00	43,679,000
ユーシン精機	1,900	1,074.00	2,040,600
前澤給装工業	1,000	1,866.00	1,866,000
イーグル工業	3,100	1,312.00	4,067,200
日本ピラー工業	2,500	1,397.00	3,492,500
キッツ	10,100	847.00	8,554,700
日立製作所	112,100	3,479.00	389,995,900
三菱電機	248,900	1,428.00	355,429,200
富士電機	16,200	3,510.00	56,862,000
東洋電機製造	1,100	1,331.00	1,464,100
安川電機	28,900	3,270.00	94,503,000
シンフォニア テクノロジー	3,500	1,370.00	4,795,000
明電舎	4,900	1,621.00	7,942,900
山洋電気	1,200	4,105.00	4,926,000
デンヨー	2,300	1,432.00	3,293,600
ベイカレント・コンサルティング	1,300	3,295.00	4,283,500
M S - J a p a n	1,100	1,746.00	1,920,600
グレイステクノロジー	800	2,285.00	1,828,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	2,091.00	2,927,400
フルテック	1,300	1,129.00	1,467,700
日総工産	700	2,565.00	1,795,500

キュービーネットホールディングス	1,100	2,063.00	2,269,300
三櫻工業	3,200	557.00	1,782,400
マキタ	30,300	4,045.00	122,563,500
東芝テック	3,100	2,984.00	9,250,400
芝浦メカトロニクス	400	3,520.00	1,408,000
マブチモーター	6,900	3,860.00	26,634,000
日本電産	30,000	13,480.00	404,400,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,300	1,833.00	2,382,900
トレックス・セミコンダクター	1,200	1,136.00	1,363,200
東光高岳	1,300	1,415.00	1,839,500
ダブル・スコープ	3,600	1,384.00	4,982,400
ダイヘン	2,700	2,769.00	7,476,300
ヤーマン	3,600	1,352.00	4,867,200
JVCケンウッド	19,000	268.00	5,092,000
ミマキエンジニアリング	2,200	764.00	1,680,800
第一精工	1,200	1,045.00	1,254,000
日新電機	5,800	1,014.00	5,881,200
大崎電気工業	5,000	690.00	3,450,000
オムロン	26,500	4,940.00	130,910,000
日東工業	4,000	2,258.00	9,032,000
I D E C	3,300	2,112.00	6,969,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,000	2,304.00	20,736,000
サクサホールディングス	800	1,858.00	1,486,400
メルコホールディングス	1,000	3,960.00	3,960,000
日本電気	32,200	3,705.00	119,301,000
富士通	24,000	7,501.00	180,024,000
沖電気工業	10,800	1,307.00	14,115,600
電気興業	1,300	2,629.00	3,417,700
サンケン電気	2,900	2,276.00	6,600,400
アイホン	1,400	1,718.00	2,405,200
ルネサスエレクトロニクス	25,800	690.00	17,802,000
セイコーエプソン	30,900	1,674.00	51,726,600
ワコム	18,100	463.00	8,380,300
アルバック	5,000	3,215.00	16,075,000
E I Z O	2,300	4,695.00	10,798,500
ジャパンディスプレイ	58,900	71.00	4,181,900
日本信号	6,300	985.00	6,205,500
京三製作所	5,300	404.00	2,141,200
能美防災	3,300	2,000.00	6,600,000
ホーチキ	1,600	1,152.00	1,843,200
星和電機	3,800	442.00	1,679,600
エレコム	2,300	3,355.00	7,716,500
パナソニック	284,400	1,043.50	296,771,400
シャープ	24,700	1,365.00	33,715,500
アンリツ	16,000	2,142.00	34,272,000
富士通ゼネラル	7,600	1,485.00	11,286,000
ソニー	167,000	5,340.00	891,780,000
T D K	13,000	8,890.00	115,570,000
帝国通信工業	1,200	1,187.00	1,424,400
タムラ製作所	9,600	594.00	5,702,400
アルプスアルパイン	25,900	2,307.00	59,751,300
池上通信機	1,200	1,174.00	1,408,800
パイオニア	41,500	65.00	2,697,500
日本電波工業	3,900	369.00	1,439,100
鈴木	2,400	675.00	1,620,000
日本トリム	500	5,500.00	2,750,000
ローランド ディー・ジー	1,300	2,212.00	2,875,600
フォスター電機	2,900	1,574.00	4,564,600
クラリオン	2,200	2,498.00	5,495,600
S M K	700	2,621.00	1,834,700

ヨコオ	1,800	1,627.00	2,928,600
ホシデン	7,300	908.00	6,628,400
ヒロセ電機	3,600	11,680.00	42,048,000
日本航空電子工業	5,700	1,484.00	8,458,800
TOA	2,700	1,021.00	2,756,700
マクセルホールディングス	5,400	1,664.00	8,985,600
古野電気	3,200	960.00	3,072,000
ユニデンホールディングス	700	2,283.00	1,598,100
スミダコーポレーション	2,100	1,472.00	3,091,200
アイコム	1,400	2,208.00	3,091,200
リオン	1,100	1,903.00	2,093,300
船井電機	2,500	781.00	1,952,500
横河電機	24,900	2,157.00	53,709,300
新電元工業	900	4,395.00	3,955,500
アズビル	16,100	2,449.00	39,428,900
東亜ディーケーケー	2,000	854.00	1,708,000
日本光電工業	11,000	3,355.00	36,905,000
共和電業	4,000	379.00	1,516,000
日本電子材料	2,000	720.00	1,440,000
堀場製作所	4,900	5,840.00	28,616,000
アドバンテスト	17,000	2,645.00	44,965,000
小野測器	2,300	614.00	1,412,200
エスベック	2,200	2,086.00	4,589,200
キーエンス	12,200	63,210.00	771,162,000
日置電機	1,300	4,455.00	5,791,500
シスメックス	19,400	6,730.00	130,562,000
日本マイクロニクス	4,000	811.00	3,244,000
メガチップス	2,000	2,179.00	4,358,000
OBARA GROUP	1,500	3,925.00	5,887,500
IMAGICA GROUP	2,800	507.00	1,419,600
澤藤電機	500	1,592.00	796,000
デンソー	54,800	4,800.00	263,040,000
コーセル	3,200	1,174.00	3,756,800
イリソ電子工業	2,300	4,825.00	11,097,500
オプテックスグループ	4,400	2,078.00	9,143,200
千代田インテグレ	1,000	2,143.00	2,143,000
アイ・オー・データ機器	1,300	1,193.00	1,550,900
レーザーテック	5,100	4,075.00	20,782,500
スタンレー電気	17,600	3,200.00	56,320,000
ウシオ電機	15,100	1,311.00	19,796,100
岡谷電機産業	4,000	385.00	1,540,000
ヘリオス テクノ ホールディング	2,300	705.00	1,621,500
日本セラミック	2,500	2,786.00	6,965,000
遠藤照明	2,100	717.00	1,505,700
古河電池	2,100	734.00	1,541,400
双信電機	4,100	424.00	1,738,400
山一電機	1,800	1,187.00	2,136,600
図研	1,600	1,585.00	2,536,000
日本電子	4,900	1,880.00	9,212,000
カシオ計算機	22,000	1,525.00	33,550,000
ファナック	23,700	19,415.00	460,135,500
日本シイエムケイ	6,300	650.00	4,095,000
エンプラス	1,100	3,050.00	3,355,000
ローム	12,000	7,450.00	89,400,000
浜松ホトニクス	17,900	3,990.00	71,421,000
三井ハイテック	2,700	1,000.00	2,700,000
新光電気工業	8,400	837.00	7,030,800
京セラ	37,900	6,243.00	236,609,700
協栄産業	1,000	1,578.00	1,578,000
太陽誘電	11,100	2,319.00	25,740,900

村田製作所	26,100	17,560.00	458,316,000
ユーシン	3,900	982.00	3,829,800
双葉電子工業	4,100	1,760.00	7,216,000
日東電工	18,800	5,943.00	111,728,400
北陸電気工業	1,500	1,083.00	1,624,500
東海理化電機製作所	6,600	2,004.00	13,226,400
ニチコン	7,800	1,007.00	7,854,600
日本ケミコン	1,800	2,184.00	3,931,200
K O A	3,800	1,614.00	6,133,200
三井E & S ホールディングス	9,000	1,257.00	11,313,000
日立造船	19,700	351.00	6,914,700
三菱重工業	41,700	4,437.00	185,022,900
川崎重工業	19,400	2,851.00	55,309,400
I H I	19,100	3,080.00	58,828,000
名村造船所	7,500	430.00	3,225,000
スプリックス	700	2,755.00	1,928,500
日本車輛製造	900	2,666.00	2,399,400
三菱ロジスネクスト	3,000	1,426.00	4,278,000
近畿車輛	700	2,138.00	1,496,600
F P G	7,700	1,035.00	7,969,500
島根銀行	2,100	714.00	1,499,400
じもとホールディングス	16,600	125.00	2,075,000
全国保証	7,000	4,035.00	28,245,000
めぶきフィナンシャルグループ	127,600	303.00	38,662,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,300	1,584.00	5,227,200
九州フィナンシャルグループ	40,300	463.00	18,658,900
かんぼ生命保険	9,300	2,478.00	23,045,400
ゆうちょ銀行	69,600	1,259.00	87,626,400
富山第一銀行	5,900	389.00	2,295,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	156,400	456.00	71,318,400
西日本フィナンシャルホールディングス	15,700	989.00	15,527,300
日本モーゲージサービス	1,100	1,299.00	1,428,900
アルヒ	2,200	2,421.00	5,326,200
プレミアグループ	500	3,310.00	1,655,000
日産自動車	293,600	948.60	278,508,960
いすゞ自動車	78,700	1,597.50	125,723,250
トヨタ自動車	277,400	6,731.00	1,867,179,400
日野自動車	31,100	1,027.00	31,939,700
三菱自動車工業	92,100	623.00	57,378,300
エフテック	1,700	996.00	1,693,200
武蔵精密工業	6,000	1,578.00	9,468,000
日産車体	4,900	1,004.00	4,919,600
新明和工業	11,200	1,391.00	15,579,200
極東開発工業	5,000	1,500.00	7,500,000
日信工業	4,600	1,575.00	7,245,000
トピー工業	2,000	2,377.00	4,754,000
ティラド	900	2,305.00	2,074,500
曙ブレーキ工業	13,700	170.00	2,329,000
タチエス	4,200	1,670.00	7,014,000
N O K	13,400	1,785.00	23,919,000
フタバ産業	6,900	601.00	4,146,900
K Y B	2,600	3,060.00	7,956,000
市光工業	3,700	671.00	2,482,700
大同メタル工業	4,000	794.00	3,176,000
プレス工業	12,300	624.00	7,675,200
ミクニ	3,200	493.00	1,577,600
太平洋工業	5,200	1,721.00	8,949,200
ケーヒン	5,700	1,982.00	11,297,400
河西工業	3,100	911.00	2,824,100



アイシン精機	20,500	4,315.00	88,457,500
マツダ	78,100	1,289.50	100,709,950
今仙電機製作所	2,400	1,041.00	2,498,400
本田技研工業	210,000	3,103.00	651,630,000
スズキ	45,500	5,705.00	259,577,500
S U B A R U	77,300	2,819.50	217,947,350
安永	1,200	1,559.00	1,870,800
ヤマハ発動機	35,200	2,232.00	78,566,400
ショーワ	5,900	1,584.00	9,345,600
小糸製作所	14,900	6,660.00	99,234,000
T B K	3,600	431.00	1,551,600
エクセディ	3,400	2,643.00	8,986,200
ミツバ	4,600	705.00	3,243,000
豊田合成	8,000	2,446.00	19,568,000
愛三工業	3,900	759.00	2,960,100
盟和産業	1,400	1,059.00	1,482,600
日本プラスト	2,000	836.00	1,672,000
ヨロズ	2,300	1,626.00	3,739,800
エフ・シー・シー	4,500	2,643.00	11,893,500
シマノ	10,000	17,320.00	173,200,000
テイ・エス テック	5,800	3,225.00	18,705,000
関西みらいフィナンシャルグループ	11,600	832.00	9,651,200
三十三フィナンシャルグループ	2,100	1,592.00	3,343,200
第四北越フィナンシャルグループ	4,300	3,715.00	15,974,500
ジャムコ	1,200	2,639.00	3,166,800
小野建	2,200	1,606.00	3,533,200
ノジマ	4,400	2,019.00	8,883,600
佐島電機	1,800	982.00	1,767,600
カップ・クリエイト	3,400	1,415.00	4,811,000
エコトレーディング	2,500	605.00	1,512,500
伯東	1,700	1,231.00	2,092,700
コンドーテック	1,900	1,043.00	1,981,700
ライトオン	2,100	820.00	1,722,000
ナガイレーベン	3,500	2,354.00	8,239,000
三菱食品	2,700	2,889.00	7,800,300
良品計画	3,500	26,800.00	93,800,000
三城ホールディングス	3,600	399.00	1,436,400
松田産業	1,800	1,533.00	2,759,400
第一興商	3,600	5,470.00	19,692,000
メディカルホールディングス	26,500	2,635.00	69,827,500
アドヴァン	3,700	1,009.00	3,733,300
S P K	600	2,341.00	1,404,600
萩原電気ホールディングス	900	3,035.00	2,731,500
アルビス	900	2,365.00	2,128,500
アズワン	1,800	8,380.00	15,084,000
シモジマ	1,500	1,135.00	1,702,500
ドウシシャ	2,300	1,765.00	4,059,500
小津産業	800	1,875.00	1,500,000
コナカ	3,300	438.00	1,445,400
高速	1,500	1,167.00	1,750,500
G - 7ホールディングス	700	2,248.00	1,573,600
イオン北海道	2,500	788.00	1,970,000
コジマ	3,600	658.00	2,368,800
ヒマラヤ	1,600	998.00	1,596,800
コーナン商事	3,200	2,828.00	9,049,600
ネットワンシステムズ	8,600	2,521.00	21,680,600
エコス	900	1,700.00	1,530,000
ワタミ	3,200	1,651.00	5,283,200
マルシェ	1,900	771.00	1,464,900
システムソフト	14,400	100.00	1,440,000

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	14,700	6,730.00	98,931,000
丸文	2,200	717.00	1,577,400
西松屋チェーン	5,400	912.00	4,924,800
ゼンショーホールディングス	11,600	2,519.00	29,220,400
ハピネット	2,000	1,466.00	2,932,000
幸楽苑ホールディングス	1,600	2,320.00	3,712,000
日本ライフライン	7,700	1,743.00	13,421,100
サイゼリヤ	4,000	2,044.00	8,176,000
エクセル	900	2,302.00	2,071,800
V Tホールディングス	8,300	418.00	3,469,400
マルカキカイ	800	2,128.00	1,702,400
アルゴグラフィックス	1,000	4,960.00	4,960,000
魚力	1,000	1,467.00	1,467,000
I D O M	8,300	370.00	3,071,000
日本エム・ディ・エム	1,400	1,119.00	1,566,600
ユナイテッドアローズ	2,800	3,540.00	9,912,000
進和	1,400	2,193.00	3,070,200
ダイトロン	1,100	1,712.00	1,883,200
ハイデイ日高	3,200	2,315.00	7,408,000
シークス	3,100	1,700.00	5,270,000
京都きもの友禅	2,100	443.00	930,300
コロワイド	8,100	2,372.00	19,213,200
ピーシーデボコーポレーション	3,300	451.00	1,488,300
田中商事	2,700	610.00	1,647,000
オーハシテクニカ	1,400	1,432.00	2,004,800
壱番屋	1,700	4,810.00	8,177,000
白銅	900	1,676.00	1,508,400
トップカルチャー	5,000	300.00	1,500,000
P L A N T	1,400	1,008.00	1,411,200
スギホールディングス	5,400	4,765.00	25,731,000
島津製作所	32,000	2,766.00	88,512,000
長野計器	2,000	787.00	1,574,000
ブイ・テクノロジー	600	14,830.00	8,898,000
スター精密	4,200	1,674.00	7,030,800
東京計器	1,600	1,128.00	1,804,800
インターアクション	1,200	1,783.00	2,139,600
オーバル	6,300	248.00	1,562,400
東京精密	4,500	2,992.00	13,464,000
マニー	3,000	5,080.00	15,240,000
ニコン	43,400	1,728.00	74,995,200
トプコン	13,400	1,519.00	20,354,600
オリンパス	37,100	4,855.00	180,120,500
理研計器	2,200	2,223.00	4,890,600
S C R E E Nホールディングス	4,300	4,600.00	19,780,000
キヤノン電子	2,300	1,835.00	4,220,500
タムロン	2,200	2,075.00	4,565,000
H O Y A	50,100	6,813.00	341,331,300
シード	1,100	1,314.00	1,445,400
ノーリツ鋼機	2,000	2,185.00	4,370,000
エー・アンド・デイ	2,300	739.00	1,699,700
朝日インテック	10,600	5,570.00	59,042,000
キヤノン	134,000	3,219.00	431,346,000
リコー	74,800	1,131.00	84,598,800
シチズン時計	27,200	640.00	17,408,000
リズム時計工業	800	1,697.00	1,357,600
大研医器	2,500	590.00	1,475,000
メニコン	3,400	2,884.00	9,805,600
シンシア	3,000	474.00	1,422,000
スノーピーク	1,300	1,401.00	1,821,300

パラマウントベッドホールディングス	2,900	5,060.00	14,674,000
トランザクション	2,100	721.00	1,514,100
SHOBI	4,200	370.00	1,554,000
ニホンフラッシュ	1,100	2,032.00	2,235,200
前田工織	2,700	2,788.00	7,527,600
永大産業	3,400	435.00	1,479,000
アートネイチャー	2,700	642.00	1,733,400
バンダイナムコホールディングス	25,700	4,850.00	124,645,000
共立印刷	7,300	223.00	1,627,900
SHOEI	1,200	4,075.00	4,890,000
フランスベッドホールディングス	3,500	864.00	3,024,000
マーベラス	3,700	901.00	3,333,700
パイロットコーポレーション	4,400	5,230.00	23,012,000
萩原工業	1,400	1,660.00	2,324,000
エイベックス	4,200	1,432.00	6,014,400
トッパン・フォームズ	5,300	951.00	5,040,300
フジシールインターナショナル	5,600	4,180.00	23,408,000
タカラトミー	10,400	1,128.00	11,731,200
廣済堂	2,300	707.00	1,626,100
アーク	16,900	93.00	1,571,700
レック	2,700	1,664.00	4,492,800
プロネクス	2,100	1,232.00	2,587,200
ホクシン	10,200	138.00	1,407,600
大建工業	1,900	1,928.00	3,663,200
凸版印刷	35,100	1,774.00	62,267,400
大日本印刷	35,100	2,604.00	91,400,400
図書印刷	2,300	950.00	2,185,000
共同印刷	800	2,433.00	1,946,400
NISSHA	5,100	1,328.00	6,772,800
藤森工業	2,200	3,090.00	6,798,000
ヴィア・ホールディングス	3,000	667.00	2,001,000
宝印刷	1,200	1,624.00	1,948,800
前澤化成工業	1,700	1,025.00	1,742,500
未来工業	1,300	2,427.00	3,155,100
アシックス	24,700	1,460.00	36,062,000
ツツミ	800	2,022.00	1,617,600
JSP	1,500	2,426.00	3,639,000
ニチハ	3,500	3,110.00	10,885,000
エフピコ	2,100	6,640.00	13,944,000
小松ウオール工業	800	1,939.00	1,551,200
ヤマハ	14,800	5,470.00	80,956,000
河合楽器製作所	800	3,360.00	2,688,000
クリナップ	2,400	636.00	1,526,400
ピジョン	15,000	4,690.00	70,350,000
天馬	1,700	2,042.00	3,471,400
キングジム	2,100	828.00	1,738,800
象印マホービン	4,600	1,240.00	5,704,000
リンテック	5,900	2,479.00	14,626,100
信越ポリマー	4,500	827.00	3,721,500
東リ	6,100	278.00	1,695,800
イトーキ	4,600	571.00	2,626,600
任天堂	15,300	29,905.00	457,546,500
三菱鉛筆	4,100	2,275.00	9,327,500
松風	1,400	1,308.00	1,831,200
タカラスタンダード	5,100	1,718.00	8,761,800
コクヨ	11,900	1,687.00	20,075,300
ナカバヤシ	2,700	550.00	1,485,000
ニフコ	10,000	2,804.00	28,040,000
立川ブラインド工業	1,500	1,208.00	1,812,000
グローブライド	1,200	2,755.00	3,306,000

オカムラ	8,700	1,306.00	11,362,200
バルカー	2,000	2,300.00	4,600,000
MUTOHホールディングス	800	1,891.00	1,512,800
伊藤忠商事	171,500	2,026.50	347,544,750
丸紅	241,800	818.90	198,010,020
スクロール	3,800	401.00	1,523,800
ヨンドシーホールディングス	2,700	2,182.00	5,891,400
三陽商会	1,500	1,685.00	2,527,500
長瀬産業	13,800	1,666.00	22,990,800
蝶理	1,600	1,594.00	2,550,400
豊田通商	27,400	3,580.00	98,092,000
オンワードホールディングス	14,600	665.00	9,709,000
三共生興	4,200	449.00	1,885,800
兼松	9,800	1,319.00	12,926,200
美津濃	2,500	2,618.00	6,545,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,900	12,690.00	87,561,000
三井物産	202,000	1,796.00	362,792,000
日本紙パルプ商事	1,400	4,185.00	5,859,000
東京エレクトロン	16,600	15,805.00	262,363,000
日立ハイテクノロジーズ	7,500	4,280.00	32,100,000
カメイ	3,200	1,261.00	4,035,200
OUGホールディングス	600	2,539.00	1,523,400
スターゼン	900	4,025.00	3,622,500
セイコーホールディングス	3,800	2,554.00	9,705,200
山善	9,600	1,191.00	11,433,600
椿本興業	600	3,700.00	2,220,000
住友商事	145,000	1,640.50	237,872,500
日本ユニシス	7,600	2,831.00	21,515,600
内田洋行	1,100	2,441.00	2,685,100
三菱商事	172,100	3,248.00	558,980,800
第一実業	1,100	3,490.00	3,839,000
キヤノンマーケティングジャパン	7,000	2,089.00	14,623,000
西華産業	1,400	1,530.00	2,142,000
佐藤商事	2,200	964.00	2,120,800
菱洋エレクトロ	2,500	1,563.00	3,907,500
東京産業	2,700	549.00	1,482,300
ユアサ商事	2,500	3,355.00	8,387,500
神鋼商事	600	2,541.00	1,524,600
小林産業	5,400	286.00	1,544,400
阪和興業	4,300	3,335.00	14,340,500
正栄食品工業	1,300	3,135.00	4,075,500
カナデン	2,300	1,297.00	2,983,100
菱電商事	1,900	1,475.00	2,802,500
ニプロ	17,300	1,495.00	25,863,500
フルサト工業	1,400	1,682.00	2,354,800
岩谷産業	5,400	3,630.00	19,602,000
すてきなイスグループ	1,700	882.00	1,499,400
昭光通商	2,300	624.00	1,435,200
イワキ	3,600	418.00	1,504,800
兼松エレクトロニクス	1,300	3,285.00	4,270,500
三愛石油	6,600	979.00	6,461,400
稲畑産業	5,900	1,587.00	9,363,300
ゴールドウイン	2,200	13,690.00	30,118,000
ユニ・チャーム	52,800	3,551.00	187,492,800
デサント	5,900	2,428.00	14,325,200
ワキタ	5,200	1,236.00	6,427,200
ヤマトインターナショナル	3,500	429.00	1,501,500
東邦ホールディングス	7,300	2,732.00	19,943,600
サンゲツ	7,400	2,082.00	15,406,800

ミツウロコグループホールディングス	3,600	817.00	2,941,200
シナネンホールディングス	1,000	2,230.00	2,230,000
伊藤忠エネクス	5,400	955.00	5,157,000
サンリオ	7,600	2,355.00	17,898,000
サンワテクノス	1,500	975.00	1,462,500
リョーサン	2,700	3,130.00	8,451,000
新光商事	2,300	1,901.00	4,372,300
トーヨー	1,100	2,083.00	2,291,300
三信電気	2,000	1,853.00	3,706,000
東陽テクニカ	2,800	909.00	2,545,200
モスフードサービス	3,200	2,761.00	8,835,200
加賀電子	2,400	2,122.00	5,092,800
三益半導体工業	2,200	1,488.00	3,273,600
ソーダニッカ	2,900	564.00	1,635,600
立花エレテック	1,800	1,730.00	3,114,000
木曽路	3,000	2,563.00	7,689,000
S R S ホールディングス	2,900	1,019.00	2,955,100
ケーヨー	4,500	546.00	2,457,000
上新電機	2,900	2,367.00	6,864,300
日本瓦斯	4,000	4,035.00	16,140,000
ロイヤルホールディングス	4,300	2,687.00	11,554,100
いなげや	2,700	1,345.00	3,631,500
島忠	5,600	2,987.00	16,727,200
チヨダ	2,600	1,897.00	4,932,200
ライフコーポレーション	1,900	2,453.00	4,660,700
リンガーハット	3,000	2,383.00	7,149,000
MrMaxHD	3,400	511.00	1,737,400
テナアライド	3,700	417.00	1,542,900
AOKIホールディングス	4,900	1,266.00	6,203,400
オークワ	3,500	1,158.00	4,053,000
コメリ	3,800	2,789.00	10,598,200
青山商事	4,300	2,751.00	11,829,300
しまむら	2,900	9,220.00	26,738,000
はせがわ	3,700	394.00	1,457,800
高島屋	19,200	1,473.00	28,281,600
松屋	4,900	1,065.00	5,218,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,600	1,546.00	19,479,600
近鉄百貨店	900	3,425.00	3,082,500
パルコ	2,400	1,148.00	2,755,200
丸井グループ	20,700	2,017.00	41,751,900
クレディセゾン	17,200	1,611.00	27,709,200
アクシアル リテイリング	2,000	3,530.00	7,060,000
イオン	94,300	2,399.00	226,225,700
イズミ	5,000	5,270.00	26,350,000
平和堂	5,000	2,495.00	12,475,000
フジ	3,000	1,896.00	5,688,000
ヤオコー	2,800	5,910.00	16,548,000
ゼビオホールディングス	3,000	1,301.00	3,903,000
ケーズホールディングス	25,500	991.00	25,270,500
PALTAC	4,400	5,710.00	25,124,000
三谷産業	5,300	288.00	1,526,400
Olympicグループ	2,200	752.00	1,654,400
新生銀行	18,000	1,526.00	27,468,000
あおぞら銀行	13,800	3,250.00	44,850,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,709,900	587.40	1,004,395,260
りそなホールディングス	269,400	512.00	137,932,800
三井住友トラスト・ホールディングス	48,300	4,219.00	203,777,700
三井住友フィナンシャルグループ	173,100	4,033.00	698,112,300
千葉銀行	87,000	679.00	59,073,000
群馬銀行	49,100	481.00	23,617,100

武蔵野銀行	3,700	2,374.00	8,783,800
千葉興業銀行	6,700	333.00	2,231,100
筑波銀行	10,200	210.00	2,142,000
七十七銀行	7,700	1,832.00	14,106,400
青森銀行	2,000	2,873.00	5,746,000
秋田銀行	1,600	2,191.00	3,505,600
山形銀行	2,800	1,946.00	5,448,800
岩手銀行	1,800	3,285.00	5,913,000
東邦銀行	22,000	312.00	6,864,000
みちのく銀行	1,600	1,615.00	2,584,000
ふくおかフィナンシャルグループ	19,900	2,460.00	48,954,000
静岡銀行	61,800	883.00	54,569,400
十六銀行	3,300	2,324.00	7,669,200
スルガ銀行	25,100	545.00	13,679,500
八十二銀行	44,400	476.00	21,134,400
山梨中央銀行	3,000	1,407.00	4,221,000
大垣共立銀行	3,900	2,277.00	8,880,300
福井銀行	2,100	1,597.00	3,353,700
北國銀行	2,700	3,435.00	9,274,500
清水銀行	1,000	1,772.00	1,772,000
富山銀行	500	3,140.00	1,570,000
滋賀銀行	4,900	2,619.00	12,833,100
南都銀行	2,900	2,245.00	6,510,500
百五銀行	22,100	387.00	8,552,700
京都銀行	8,800	4,665.00	41,052,000
紀陽銀行	8,700	1,565.00	13,615,500
ほくほくフィナンシャルグループ	16,300	1,248.00	20,342,400
広島銀行	36,200	643.00	23,276,600
山陰合同銀行	14,600	822.00	12,001,200
中国銀行	15,800	1,069.00	16,890,200
鳥取銀行	1,100	1,393.00	1,532,300
伊予銀行	32,500	619.00	20,117,500
百十四銀行	2,600	2,451.00	6,372,600
四国銀行	3,500	1,031.00	3,608,500
阿波銀行	4,000	3,015.00	12,060,000
大分銀行	1,600	3,360.00	5,376,000
宮崎銀行	1,700	2,681.00	4,557,700
佐賀銀行	1,500	1,820.00	2,730,000
十八銀行	1,600	2,727.00	4,363,200
沖縄銀行	2,300	3,390.00	7,797,000
琉球銀行	5,700	1,174.00	6,691,800
セブン銀行	82,900	332.00	27,522,800
みずほフィナンシャルグループ	3,336,300	175.50	585,520,650
山口フィナンシャルグループ	30,600	1,059.00	32,405,400
芙蓉総合リース	2,800	5,650.00	15,820,000
興銀リース	4,600	2,722.00	12,521,200
東京センチュリー	4,900	5,040.00	24,696,000
SBIホールディングス	29,300	2,335.00	68,415,500
日本証券金融	10,800	623.00	6,728,400
アイフル	37,500	306.00	11,475,000
長野銀行	900	1,561.00	1,404,900
名古屋銀行	2,000	3,500.00	7,000,000
北洋銀行	37,000	307.00	11,359,000
愛知銀行	900	3,470.00	3,123,000
中京銀行	1,000	2,177.00	2,177,000
大光銀行	900	1,706.00	1,535,400
愛媛銀行	3,400	1,098.00	3,733,200
京葉銀行	10,800	715.00	7,722,000
栃木銀行	12,700	241.00	3,060,700
北日本銀行	800	2,117.00	1,693,600

東和銀行	4,300	710.00	3,053,000
リコーリース	1,900	3,470.00	6,593,000
イオンフィナンシャルサービス	15,700	2,198.00	34,508,600
アコム	49,300	384.00	18,931,200
ジャックス	2,700	1,910.00	5,157,000
オリエントコーポレーション	66,400	118.00	7,835,200
日立キャピタル	5,800	2,592.00	15,033,600
アプラスフィナンシャル	18,200	87.00	1,583,400
オリックス	163,800	1,620.00	265,356,000
三菱UFJリース	55,400	565.00	31,301,000
ジャフコ	4,000	3,860.00	15,440,000
トモニホールディングス	19,000	410.00	7,790,000
大和証券グループ本社	197,000	583.40	114,929,800
野村ホールディングス	432,000	445.50	192,456,000
岡三証券グループ	20,900	491.00	10,261,900
丸三証券	7,300	818.00	5,971,400
東洋証券	8,800	163.00	1,434,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	29,300	495.00	14,503,500
光世証券	1,900	762.00	1,447,800
水戸証券	7,100	263.00	1,867,300
いちよし証券	5,200	867.00	4,508,400
松井証券	12,000	1,201.00	14,412,000
SOMPOホールディングス	43,300	4,176.00	180,820,800
だいこう証券ビジネス	200	433.00	86,600
日本取引所グループ	66,300	1,965.00	130,279,500
マネックスグループ	22,900	433.00	9,915,700
カブドットコム証券	18,300	561.00	10,266,300
極東証券	3,300	1,180.00	3,894,000
岩井コスモホールディングス	2,500	1,289.00	3,222,500
藍澤證券	4,600	703.00	3,233,800
フィデアホールディングス	23,800	132.00	3,141,600
池田泉州ホールディングス	26,100	299.00	7,803,900
アニコムホールディングス	2,000	3,035.00	6,070,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	64,200	3,368.00	216,225,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	20,200	2,122.00	42,864,400
マネーパートナーズグループ	5,000	295.00	1,475,000
第一生命ホールディングス	138,900	1,707.50	237,171,750
東京海上ホールディングス	89,000	5,571.00	495,819,000
イー・ギャランティ	2,300	1,052.00	2,419,600
アサックス	2,700	548.00	1,479,600
NECキャピタルソリューション	1,000	1,650.00	1,650,000
T&Dホールディングス	75,900	1,375.50	104,400,450
アドバンスクリエイト	500	1,720.00	860,000
三井不動産	130,300	2,682.50	349,529,750
三菱地所	172,000	1,909.00	328,348,000
平和不動産	4,600	2,068.00	9,512,800
東京建物	26,800	1,288.00	34,518,400
ダイビル	7,200	1,093.00	7,869,600
京阪神ビルディング	4,400	912.00	4,012,800
住友不動産	55,200	4,254.00	234,820,800
テーオーシー	5,600	787.00	4,407,200
東京楽天地	400	4,645.00	1,858,000
レオパレス21	30,300	210.00	6,363,000
スターツコーポレーション	3,300	2,435.00	8,035,500
フジ住宅	3,100	870.00	2,697,000
空港施設	2,900	542.00	1,571,800
明和地所	2,500	611.00	1,527,500
ゴールドクレスト	1,900	1,616.00	3,070,400

リログループ	13,000	3,000.00	39,000,000
日本エスリード	1,000	1,626.00	1,626,000
日神不動産	3,600	464.00	1,670,400
日本エスコン	4,400	758.00	3,335,200
タカラレーベン	11,500	352.00	4,048,000
サンヨーハウジング名古屋	1,600	940.00	1,504,000
イオンモール	12,300	1,862.00	22,902,600
ファースト住建	1,300	1,232.00	1,601,600
カチタス	2,700	3,670.00	9,909,000
東祥	1,500	3,525.00	5,287,500
トーセイ	3,400	1,055.00	3,587,000
穴吹興産	500	2,860.00	1,430,000
サンフロンティア不動産	3,400	1,268.00	4,311,200
エフ・ジェー・ネクスト	2,100	875.00	1,837,500
グランディハウス	3,500	442.00	1,547,000
東武鉄道	26,300	3,120.00	82,056,000
相鉄ホールディングス	8,500	3,320.00	28,220,000
東京急行電鉄	67,600	1,864.00	126,006,400
京浜急行電鉄	34,100	1,855.00	63,255,500
小田急電鉄	39,900	2,555.00	101,944,500
京王電鉄	13,900	6,430.00	89,377,000
京成電鉄	18,700	3,785.00	70,779,500
富士急行	3,400	3,985.00	13,549,000
新京成電鉄	200	2,084.00	416,800
東日本旅客鉄道	44,300	10,630.00	470,909,000
西日本旅客鉄道	22,300	8,295.00	184,978,500
東海旅客鉄道	22,300	24,890.00	555,047,000
西武ホールディングス	31,700	2,004.00	63,526,800
鴻池運輸	4,000	1,796.00	7,184,000
西日本鉄道	6,900	2,712.00	18,712,800
ハマキョウレックス	1,900	4,380.00	8,322,000
サカイ引越センター	1,300	6,630.00	8,619,000
近鉄グループホールディングス	23,600	4,960.00	117,056,000
阪急阪神ホールディングス	31,400	4,090.00	128,426,000
南海電気鉄道	10,500	3,005.00	31,552,500
京阪ホールディングス	10,500	4,595.00	48,247,500
神戸電鉄	600	3,965.00	2,379,000
名古屋鉄道	18,900	3,045.00	57,550,500
山陽電気鉄道	1,800	2,197.00	3,954,600
トランコム	700	6,910.00	4,837,000
日本通運	9,300	6,990.00	65,007,000
ヤマトホールディングス	41,300	2,973.00	122,784,900
山九	6,600	5,500.00	36,300,000
日新	2,000	1,946.00	3,892,000
丸全昭和運輸	1,900	2,837.00	5,390,300
センコーグループホールディングス	13,000	945.00	12,285,000
トナミホールディングス	600	6,520.00	3,912,000
ニッコンホールディングス	9,000	2,894.00	26,046,000
日本石油輸送	500	2,995.00	1,497,500
福山通運	3,000	4,550.00	13,650,000
セイノーホールディングス	17,700	1,572.00	27,824,400
神奈川中央交通	600	3,750.00	2,250,000
日立物流	5,200	3,295.00	17,134,000
丸和運輸機関	1,200	3,575.00	4,290,000
C & F ロジホールディングス	2,400	1,308.00	3,139,200
日本郵船	19,800	1,838.00	36,392,400
商船三井	14,000	2,706.00	37,884,000
川崎汽船	7,300	1,661.00	12,125,300
N S ユナイテッド海運	1,300	2,634.00	3,424,200
飯野海運	11,200	402.00	4,502,400



九州旅客鉄道	19,800	3,715.00	73,557,000
S Gホールディングス	22,300	3,165.00	70,579,500
日本航空	43,200	4,063.00	175,521,600
A N Aホールディングス	43,100	4,121.00	177,615,100
パスコ	300	933.00	279,900
西本W i s m e t t a cホールディングス	600	4,315.00	2,589,000
G e n k y D r u g S t o r e s	1,200	2,641.00	3,169,200
国際紙パルプ商事	5,600	284.00	1,590,400
総合メディカルホールディングス	2,100	1,932.00	4,057,200
三菱倉庫	8,200	2,818.00	23,107,600
三井倉庫ホールディングス	2,900	1,970.00	5,713,000
住友倉庫	8,900	1,458.00	12,976,200
澁澤倉庫	1,300	1,658.00	2,155,400
ヤマタネ	1,200	1,664.00	1,996,800
東陽倉庫	5,300	323.00	1,711,900
乾汽船	2,200	718.00	1,579,600
日本トランスシティ	5,200	449.00	2,334,800
ケイヒン	1,200	1,407.00	1,688,400
中央倉庫	1,500	1,072.00	1,608,000
安田倉庫	1,900	905.00	1,719,500
東洋埠頭	1,000	1,495.00	1,495,000
宇徳	2,800	548.00	1,534,400
上組	14,500	2,559.00	37,105,500
キューソー流通システム	600	2,073.00	1,243,800
近鉄エクスプレス	4,500	1,836.00	8,262,000
エーアイティー	1,500	1,090.00	1,635,000
日本コンセプト	1,500	1,034.00	1,551,000
東京放送ホールディングス	16,200	1,996.00	32,335,200
日本テレビホールディングス	22,400	1,818.00	40,723,200
朝日放送グループホールディングス	2,400	778.00	1,867,200
テレビ朝日ホールディングス	6,700	2,041.00	13,674,700
スカパーJ S A Tホールディングス	18,600	505.00	9,393,000
テレビ東京ホールディングス	2,000	2,498.00	4,996,000
日本B S放送	1,400	1,070.00	1,498,000
ビジョン	800	4,745.00	3,796,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,500	958.00	1,437,000
ワイヤレスゲート	3,000	427.00	1,281,000
コネクシオ	1,700	1,437.00	2,442,900
日本通信	21,100	126.00	2,658,600
日本電信電話	167,100	4,690.00	783,699,000
K D D I	215,300	2,701.50	581,632,950
ソフトバンク	194,200	1,347.00	261,587,400
光通信	2,900	19,900.00	57,710,000
N T T ドコモ	175,400	2,604.00	456,741,600
エムティーアイ	2,800	636.00	1,780,800
G M O インターネット	8,900	1,840.00	16,376,000
カドカワ	7,100	1,227.00	8,711,700
学研ホールディングス	800	5,330.00	4,264,000
ゼンリン	4,900	3,095.00	15,165,500
昭文社	3,100	486.00	1,506,600
インプレスホールディングス	10,000	156.00	1,560,000
東京電力ホールディングス	198,700	673.00	133,725,100
中部電力	76,200	1,786.00	136,093,200
関西電力	101,600	1,656.50	168,300,400
中国電力	34,400	1,468.00	50,499,200
北陸電力	24,400	948.00	23,131,200
東北電力	58,300	1,471.00	85,759,300
四国電力	22,400	1,422.00	31,852,800
九州電力	51,300	1,326.00	68,023,800

北海道電力	23,300	810.00	18,873,000
沖縄電力	4,600	2,098.00	9,650,800
電源開発	19,800	2,844.00	56,311,200
エフオン	1,600	849.00	1,358,400
イーレックス	4,300	856.00	3,680,800
レノバ	3,000	1,095.00	3,285,000
東京瓦斯	48,800	3,051.00	148,888,800
大阪瓦斯	48,300	2,255.00	108,916,500
東邦瓦斯	12,300	4,895.00	60,208,500
北海道瓦斯	1,300	1,463.00	1,901,900
広島ガス	5,100	349.00	1,779,900
西部瓦斯	2,800	2,509.00	7,025,200
静岡ガス	7,700	905.00	6,968,500
メタウォーター	1,200	3,075.00	3,690,000
アイネット	1,400	1,420.00	1,988,000
松竹	1,600	11,570.00	18,512,000
東宝	16,100	4,120.00	66,332,000
エイチ・アイ・エス	4,200	4,275.00	17,955,000
東映	1,000	13,660.00	13,660,000
ラックランド	700	1,939.00	1,357,300
エヌ・ティ・ティ・データ	65,000	1,211.00	78,715,000
共立メンテナンス	3,600	5,290.00	19,044,000
イチネンホールディングス	2,500	1,331.00	3,327,500
建設技術研究所	1,600	1,503.00	2,404,800
スペース	1,500	1,352.00	2,028,000
アインホールディングス	3,300	7,450.00	24,585,000
燦ホールディングス	600	2,508.00	1,504,800
東京テアトル	1,200	1,297.00	1,556,400
ビジネスブレイン太田昭和	800	2,211.00	1,768,800
ナガワ	700	5,650.00	3,955,000
よみうりランド	500	4,170.00	2,085,000
東京都競馬	1,600	3,585.00	5,736,000
常磐興産	1,000	1,633.00	1,633,000
カナモト	3,600	2,917.00	10,501,200
東京ドーム	8,900	1,000.00	8,900,000
D T S	2,700	4,060.00	10,962,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,400	3,185.00	36,309,000
シーイーシー	2,600	2,309.00	6,003,400
カブコン	10,500	2,231.00	23,425,500
西尾レントオール	2,400	3,420.00	8,208,000
アイ・エス・ビー	800	2,194.00	1,755,200
日本空港ビルデング	7,800	4,335.00	33,813,000
トランス・コスモス	2,600	2,198.00	5,714,800
乃村工藝社	5,600	3,250.00	18,200,000
ジャステック	1,600	981.00	1,569,600
S C S K	6,400	4,850.00	31,040,000
藤田観光	900	2,681.00	2,412,900
K N T - C Tホールディングス	1,300	1,323.00	1,719,900
日本管財	2,500	1,917.00	4,792,500
トーカイ	2,300	2,885.00	6,635,500
白洋舎	500	2,890.00	1,445,000
セコム	25,200	9,587.00	241,592,400
日本システムウエア	900	1,952.00	1,756,800
セントラル警備保障	1,100	4,340.00	4,774,000
アイネス	3,100	1,297.00	4,020,700
丹青社	4,500	1,280.00	5,760,000
メイテック	3,000	5,000.00	15,000,000
T K C	2,100	3,810.00	8,001,000
富士ソフト	3,600	4,315.00	15,534,000

応用地質	2,600	1,163.00	3,023,800
船井総研ホールディングス	4,900	2,561.00	12,548,900
NSD	4,000	2,465.00	9,860,000
進学会ホールディングス	2,500	557.00	1,392,500
丸紅建材リース	800	2,039.00	1,631,200
コナミホールディングス	10,000	4,445.00	44,450,000
いであ	1,500	985.00	1,477,500
学究社	1,100	1,344.00	1,478,400
ベネッセホールディングス	8,700	3,140.00	27,318,000
イオンディライト	2,900	4,145.00	12,020,500
ナック	1,500	1,048.00	1,572,000
福井コンピュータホールディングス	900	1,919.00	1,727,100
ニチイ学館	3,400	1,249.00	4,246,600
ダイセキ	4,000	2,657.00	10,628,000
ステップ	1,200	1,423.00	1,707,600
日鉄住金物産	1,700	4,790.00	8,143,000
泉州電業	800	2,672.00	2,137,600
元気寿司	700	3,965.00	2,775,500
トラスコ中山	5,100	3,105.00	15,835,500
ヤマダ電機	74,700	532.00	39,740,400
オートバックスセブン	9,700	1,852.00	17,964,400
モリト	2,000	788.00	1,576,000
アークランドサカモト	4,200	1,439.00	6,043,800
ニトリホールディングス	10,600	14,170.00	150,202,000
グルメ杵屋	1,700	1,174.00	1,995,800
愛眼	5,000	317.00	1,585,000
吉野家ホールディングス	8,600	1,848.00	15,892,800
加藤産業	3,800	3,660.00	13,908,000
イノテック	1,500	1,054.00	1,581,000
イエローハット	2,300	2,930.00	6,739,000
松屋フーズホールディングス	1,200	3,680.00	4,416,000
JBCホールディングス	1,900	1,625.00	3,087,500
JKホールディングス	2,700	601.00	1,622,700
サガミホールディングス	3,300	1,373.00	4,530,900
日伝	2,000	1,585.00	3,170,000
関西スーパーマーケット	1,900	1,005.00	1,909,500
ミロク情報サービス	2,400	2,840.00	6,816,000
北沢産業	5,700	263.00	1,499,100
杉本商事	1,300	1,802.00	2,342,600
因幡電機産業	3,500	4,495.00	15,732,500
王将フードサービス	1,800	7,400.00	13,320,000
プレナス	2,700	1,816.00	4,903,200
ミニストップ	1,800	1,933.00	3,479,400
アークス	4,600	2,596.00	11,941,600
パローホールディングス	5,300	2,734.00	14,490,200
パイテックホールディングス	1,100	2,052.00	2,257,200
東テク	800	2,287.00	1,829,600
ミスミグループ本社	30,700	2,759.00	84,701,300
藤久	2,000	761.00	1,522,000
ベルク	1,200	5,110.00	6,132,000
大庄	1,300	1,541.00	2,003,300
タキヒヨー	800	1,823.00	1,458,400
ファーストリテイリング	3,300	51,090.00	168,597,000
ソフトバンクグループ	102,100	10,230.00	1,044,483,000
蔵王産業	1,100	1,313.00	1,444,300
スズケン	11,200	5,990.00	67,088,000
サンドラッグ	9,200	3,470.00	31,924,000
サックスパーホールディングス	2,100	1,110.00	2,331,000
ジェコス	1,700	1,095.00	1,861,500
やまや	700	2,373.00	1,661,100

ルネサスイーストン	3,500	446.00	1,561,000	
ペルーナ	6,000	904.00	5,424,000	
合計	28,825,000		57,385,765,970	

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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,305,026	30,799,524
コール・ローン	871,095,081	628,706,474
国債証券	90,298,001,520	65,768,216,770
地方債証券	12,224,423,731	8,658,947,780
特殊債券	13,565,701,225	9,851,727,173
社債券	8,910,746,900	6,505,142,700
未収利息	388,333,877	264,056,612
前払費用	5,563,316	4,671,465
流動資産合計	126,287,170,676	91,712,268,498
資産合計	126,287,170,676	91,712,268,498
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,430,835	3,101,294
その他未払費用	2,132	480
流動負債合計	15,432,967	3,101,774
負債合計	15,432,967	3,101,774
純資産の部		
元本等		
元本	130,621,929,148	93,246,832,729
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,350,191,439	1,537,666,005
純資産合計	126,271,737,709	91,709,166,724
負債純資産合計	126,287,170,676	91,712,268,498

## 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ありま 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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
1. 受益権総口数	130,621,929,148口	93,246,832,729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	4,350,191,439円	1,537,666,005円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9667円 (9,667円)	0.9835円 (9,835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 2017年7月14日 至 2018年2月21日）	（自 2018年2月22日 至 2019年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	218,703,770	683,620,430
地方債証券	93,859,836	43,645,654
特殊債券	96,116,374	26,259,478
社債券	87,740,900	40,936,500
合計	59,013,340	572,778,798

(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2月21日現在）	（2019年2月21日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	146,589,047,181円	130,621,929,148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	3,064,590,439円	4,833,282,961円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	19,031,708,472円	42,208,379,380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）	129,889,409,735円	91,430,070,853円
DCニッセイ日本債券インデックス	687,095,998円	1,345,859,235円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	1,491,858円	10,189,726円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	16,798,213円	279,529,696円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	167,240円	9,489,530円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	406,102円	25,399,457円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	4,389,059円	74,779,556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）	13,911,689円	37,376,874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）	2,799,893円	2,973,401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）	2,344,092円	10,630,035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）	3,115,269円	19,693,743円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	90,231円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	132,231円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	180,429円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	437,732円
計	130,621,929,148円	93,246,832,729円

附属明細表（2019年2月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
国債証券	第386回 利付国債（2年）	547,000,000	548,706,640	
	第387回 利付国債（2年）	103,000,000	103,341,960	
	第388回 利付国債（2年）	97,000,000	97,351,140	
	第389回 利付国債（2年）	52,000,000	52,195,000	
	第390回 利付国債（2年）	117,000,000	117,468,000	
	第391回 利付国債（2年）	147,000,000	147,614,460	
	第392回 利付国債（2年）	288,000,000	289,252,800	
	第393回 利付国債（2年）	270,000,000	271,236,600	
	第394回 利付国債（2年）	290,000,000	291,400,700	
	第395回 利付国債（2年）	361,000,000	362,826,660	
	第396回 利付国債（2年）	300,000,000	301,593,000	
	第123回 利付国債（5年）	603,000,000	604,941,660	
	第124回 利付国債（5年）	299,000,000	300,169,090	
	第125回 利付国債（5年）	284,000,000	285,300,720	
	第126回 利付国債（5年）	429,000,000	431,273,700	
	第127回 利付国債（5年）	627,000,000	630,711,840	
	第128回 利付国債（5年）	634,000,000	638,209,760	
	第129回 利付国債（5年）	625,000,000	629,606,250	
	第130回 利付国債（5年）	629,000,000	634,088,610	

第131回	利付国債(5年)	297,000,000	299,613,600
第132回	利付国債(5年)	666,000,000	672,340,320
第133回	利付国債(5年)	402,000,000	406,192,860
第134回	利付国債(5年)	307,000,000	310,429,190
第1回	利付国債(40年)	111,000,000	165,791,820
第2回	利付国債(40年)	142,000,000	205,640,140
第3回	利付国債(40年)	141,000,000	205,738,740
第4回	利付国債(40年)	193,000,000	283,682,980
第5回	利付国債(40年)	191,000,000	271,149,330
第6回	利付国債(40年)	197,000,000	275,285,830
第7回	利付国債(40年)	213,000,000	285,854,520
第8回	利付国債(40年)	208,000,000	260,041,600
第9回	利付国債(40年)	224,000,000	206,653,440
第10回	利付国債(40年)	245,000,000	266,537,950
第11回	利付国債(40年)	162,000,000	170,367,300
第306回	利付国債(10年)	183,000,000	186,132,960
第307回	利付国債(10年)	57,000,000	57,914,280
第308回	利付国債(10年)	61,000,000	62,205,360
第309回	利付国債(10年)	316,000,000	321,406,760
第310回	利付国債(10年)	165,000,000	168,102,000
第311回	利付国債(10年)	123,000,000	124,923,720
第312回	利付国債(10年)	862,000,000	883,937,900
第313回	利付国債(10年)	350,000,000	360,804,500
第314回	利付国債(10年)	128,000,000	131,418,880
第315回	利付国債(10年)	283,000,000	292,143,730
第316回	利付国債(10年)	110,000,000	113,297,800
第317回	利付国債(10年)	80,000,000	82,660,000
第318回	利付国債(10年)	208,000,000	214,377,280
第319回	利付国債(10年)	106,000,000	109,866,880
第320回	利付国債(10年)	225,000,000	232,569,000
第321回	利付国債(10年)	231,000,000	239,454,600
第322回	利付国債(10年)	80,000,000	82,680,800
第323回	利付国債(10年)	59,000,000	61,140,520
第324回	利付国債(10年)	194,000,000	200,388,420
第325回	利付国債(10年)	203,000,000	210,196,350
第326回	利付国債(10年)	2,000,000	2,068,160
第327回	利付国債(10年)	49,000,000	50,859,060
第328回	利付国債(10年)	39,000,000	40,247,610
第329回	利付国債(10年)	9,000,000	9,384,300
第330回	利付国債(10年)	3,000,000	3,135,630
第332回	利付国債(10年)	366,000,000	379,893,360
第333回	利付国債(10年)	325,000,000	337,974,000
第334回	利付国債(10年)	328,000,000	341,749,760
第335回	利付国債(10年)	289,000,000	300,065,810
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	55,121,060
第337回	利付国債(10年)	336,000,000	345,492,000
第338回	利付国債(10年)	646,000,000	668,790,880
第339回	利付国債(10年)	685,000,000	710,180,600
第340回	利付国債(10年)	875,000,000	908,460,000
第341回	利付国債(10年)	854,000,000	882,011,200
第342回	利付国債(10年)	878,000,000	895,279,040
第343回	利付国債(10年)	883,000,000	900,677,660
第344回	利付国債(10年)	911,000,000	929,511,520
第345回	利付国債(10年)	532,000,000	542,741,080
第346回	利付国債(10年)	647,000,000	659,940,000
第347回	利付国債(10年)	905,000,000	922,900,900
第348回	利付国債(10年)	819,000,000	834,610,140
第349回	利付国債(10年)	892,000,000	908,279,000
第350回	利付国債(10年)	915,000,000	930,893,550
第351回	利付国債(10年)	665,000,000	675,925,950

第352回 利付国債(10年)	625,000,000	634,625,000	
第1回 利付国債(30年)	13,000,000	16,831,620	
第2回 利付国債(30年)	27,000,000	34,086,960	
第3回 利付国債(30年)	28,000,000	35,158,200	
第4回 利付国債(30年)	79,000,000	105,406,540	
第5回 利付国債(30年)	50,000,000	62,999,500	
第6回 利付国債(30年)	69,000,000	89,135,580	
第7回 利付国債(30年)	66,000,000	84,914,940	
第8回 利付国債(30年)	60,000,000	73,582,800	
第9回 利付国債(30年)	56,000,000	65,658,320	
第10回 利付国債(30年)	101,000,000	114,300,690	
第11回 利付国債(30年)	77,000,000	93,735,180	
第12回 利付国債(30年)	79,000,000	100,900,380	
第13回 利付国債(30年)	95,000,000	120,225,350	
第14回 利付国債(30年)	119,000,000	157,878,490	
第15回 利付国債(30年)	127,000,000	170,808,650	
第16回 利付国債(30年)	108,000,000	145,629,360	
第17回 利付国債(30年)	91,000,000	121,615,130	
第18回 利付国債(30年)	110,000,000	145,627,900	
第19回 利付国債(30年)	98,000,000	130,016,600	
第20回 利付国債(30年)	113,000,000	153,832,550	
第21回 利付国債(30年)	112,000,000	149,189,600	
第22回 利付国債(30年)	134,000,000	183,212,840	
第23回 利付国債(30年)	138,000,000	189,084,840	
第24回 利付国債(30年)	114,000,000	156,655,380	
第25回 利付国債(30年)	130,000,000	174,434,000	
第26回 利付国債(30年)	234,000,000	318,780,540	
第27回 利付国債(30年)	223,000,000	309,046,780	
第28回 利付国債(30年)	268,000,000	373,010,440	
第29回 利付国債(30年)	261,000,000	359,678,880	
第30回 利付国債(30年)	281,000,000	383,399,210	
第31回 利付国債(30年)	265,000,000	357,720,850	
第32回 利付国債(30年)	331,000,000	454,982,670	
第33回 利付国債(30年)	367,000,000	484,106,030	
第34回 利付国債(30年)	335,000,000	457,291,750	
第35回 利付国債(30年)	366,000,000	485,740,560	
第36回 利付国債(30年)	374,000,000	498,287,680	
第37回 利付国債(30年)	386,000,000	507,454,900	
第38回 利付国債(30年)	267,000,000	346,034,670	
第39回 利付国債(30年)	244,000,000	322,270,320	
第40回 利付国債(30年)	222,000,000	288,635,520	
第41回 利付国債(30年)	231,000,000	295,476,720	
第42回 利付国債(30年)	245,000,000	313,994,450	
第43回 利付国債(30年)	241,000,000	309,130,700	
第44回 利付国債(30年)	238,000,000	305,882,360	
第45回 利付国債(30年)	267,000,000	330,711,540	
第46回 利付国債(30年)	303,000,000	375,919,980	
第47回 利付国債(30年)	288,000,000	364,659,840	
第48回 利付国債(30年)	277,000,000	337,458,020	
第49回 利付国債(30年)	276,000,000	336,341,880	
第50回 利付国債(30年)	272,000,000	290,417,120	
第51回 利付国債(30年)	174,000,000	163,666,140	
第52回 利付国債(30年)	184,000,000	182,231,760	
第53回 利付国債(30年)	166,000,000	168,612,840	
第54回 利付国債(30年)	272,000,000	290,300,160	
第55回 利付国債(30年)	163,000,000	173,837,870	
第56回 利付国債(30年)	237,000,000	252,566,160	
第57回 利付国債(30年)	265,000,000	282,185,250	
第58回 利付国債(30年)	285,000,000	303,237,150	
第60回 利付国債(30年)	70,000,000	76,328,700	

第44回	利付国債(20年)	5,000,000	5,144,650
第45回	利付国債(20年)	5,000,000	5,139,250
第46回	利付国債(20年)	3,000,000	3,095,490
第47回	利付国債(20年)	152,000,000	157,748,640
第48回	利付国債(20年)	66,000,000	69,255,120
第49回	利付国債(20年)	40,000,000	41,905,200
第50回	利付国債(20年)	54,000,000	56,346,840
第52回	利付国債(20年)	4,000,000	4,236,760
第53回	利付国債(20年)	4,000,000	4,259,520
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,067,720
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,146,120
第70回	利付国債(20年)	51,000,000	58,056,360
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	72,197,120
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,839,700
第76回	利付国債(20年)	8,000,000	9,015,840
第78回	利付国債(20年)	8,000,000	9,058,480
第80回	利付国債(20年)	8,000,000	9,160,720
第81回	利付国債(20年)	106,000,000	121,294,740
第82回	利付国債(20年)	126,000,000	145,018,440
第83回	利付国債(20年)	104,000,000	120,258,320
第84回	利付国債(20年)	136,000,000	156,322,480
第85回	利付国債(20年)	112,000,000	130,149,600
第86回	利付国債(20年)	104,000,000	122,341,440
第87回	利付国債(20年)	101,000,000	118,089,200
第88回	利付国債(20年)	220,000,000	260,101,600
第89回	利付国債(20年)	104,000,000	122,186,480
第90回	利付国債(20年)	331,000,000	390,748,810
第91回	利付国債(20年)	209,000,000	248,329,620
第92回	利付国債(20年)	431,000,000	507,575,770
第93回	利付国債(20年)	230,000,000	270,068,300
第94回	利付国債(20年)	332,000,000	392,546,840
第95回	利付国債(20年)	305,000,000	367,207,800
第96回	利付国債(20年)	174,000,000	206,562,360
第97回	利付国債(20年)	236,000,000	283,315,640
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	204,994,760
第99回	利付国債(20年)	387,000,000	462,801,690
第100回	利付国債(20年)	277,000,000	334,859,760
第101回	利付国債(20年)	224,000,000	274,886,080
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	222,953,990
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	206,587,290
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	162,491,400
第105回	利付国債(20年)	252,000,000	304,421,040
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	185,082,800
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	184,173,840
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	240,769,860
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	192,485,160
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	223,703,520
第111回	利付国債(20年)	145,000,000	178,390,600
第112回	利付国債(20年)	203,000,000	247,645,790
第113回	利付国債(20年)	225,000,000	275,258,250
第114回	利付国債(20年)	119,000,000	146,049,890
第115回	利付国債(20年)	66,000,000	81,717,240
第116回	利付国債(20年)	79,000,000	98,133,010
第117回	利付国債(20年)	126,000,000	155,122,380
第118回	利付国債(20年)	96,000,000	117,474,240
第119回	利付国債(20年)	68,000,000	81,674,120
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	103,708,000
第121回	利付国債(20年)	237,000,000	287,955,000
第122回	利付国債(20年)	154,000,000	185,335,920
第123回	利付国債(20年)	253,000,000	314,152,630

第124回	利付国債（20年）	149,000,000	183,261,060	
第125回	利付国債（20年）	155,000,000	194,869,100	
第126回	利付国債（20年）	141,000,000	173,885,430	
第127回	利付国債（20年）	130,000,000	158,761,200	
第128回	利付国債（20年）	226,000,000	276,698,580	
第129回	利付国債（20年）	131,000,000	158,786,410	
第130回	利付国債（20年）	233,000,000	282,894,620	
第131回	利付国債（20年）	127,000,000	152,614,630	
第132回	利付国債（20年）	169,000,000	203,496,280	
第133回	利付国債（20年）	216,000,000	262,826,640	
第134回	利付国債（20年）	182,000,000	221,919,880	
第135回	利付国債（20年）	114,000,000	137,534,160	
第136回	利付国債（20年）	119,000,000	142,030,070	
第137回	利付国債（20年）	130,000,000	157,141,400	
第138回	利付国債（20年）	141,000,000	166,733,910	
第139回	利付国債（20年）	129,000,000	154,237,560	
第140回	利付国債（20年）	348,000,000	421,445,400	
第141回	利付国債（20年）	251,000,000	304,515,710	
第142回	利付国債（20年）	153,000,000	187,698,870	
第143回	利付国債（20年）	255,000,000	306,374,850	
第144回	利付国債（20年）	167,000,000	198,340,890	
第145回	利付国債（20年）	383,000,000	466,241,220	
第146回	利付国債（20年）	347,000,000	423,110,980	
第147回	利付国債（20年）	385,000,000	464,610,300	
第148回	利付国債（20年）	329,000,000	392,434,490	
第149回	利付国債（20年）	359,000,000	428,703,440	
第150回	利付国債（20年）	364,000,000	429,327,080	
第151回	利付国債（20年）	321,000,000	369,105,060	
第152回	利付国債（20年）	350,000,000	402,615,500	
第153回	利付国債（20年）	345,000,000	402,442,500	
第154回	利付国債（20年）	334,000,000	384,500,800	
第155回	利付国債（20年）	361,000,000	403,735,180	
第156回	利付国債（20年）	233,000,000	237,168,370	
第157回	利付国債（20年）	218,000,000	214,232,960	
第158回	利付国債（20年）	333,000,000	343,829,160	
第159回	利付国債（20年）	334,000,000	350,062,060	
第160回	利付国債（20年）	339,000,000	361,004,490	
第161回	利付国債（20年）	338,000,000	353,460,120	
第162回	利付国債（20年）	334,000,000	348,866,340	
第163回	利付国債（20年）	347,000,000	362,000,810	
第164回	利付国債（20年）	415,000,000	424,607,250	
第165回	利付国債（20年）	345,000,000	352,452,000	
第166回	利付国債（20年）	330,000,000	349,239,000	
第167回	利付国債（20年）	77,000,000	78,413,720	
国債証券 合計		58,588,000,000	65,768,216,770	
地方債証券				
第697回	東京都公募公債	200,000,000	205,275,400	
第707回	東京都公募公債	200,000,000	205,503,000	
第708回	東京都公募公債	300,000,000	309,096,300	
第730回	東京都公募公債	300,000,000	310,133,100	
平成22年度第12回	北海道公募公債	200,000,000	205,030,000	
平成27年度第1回	北海道公募公債	300,000,000	307,220,100	
第30回	神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	111,935,700	
第360回	大阪府公募公債（10年）	300,000,000	308,915,700	
第378回	大阪府公募公債（10年）	144,000,000	148,691,808	
第12回	大阪府公募公債（20年）	100,000,000	115,614,600	
平成24年度第1回	兵庫県公募公債	300,000,000	309,694,800	
第21回	兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	116,680,500	
平成24年度第3回	静岡県公募公債	300,000,000	308,979,300	
平成24年度第19回	愛知県公募公債	300,000,000	307,851,600	
平成25年度第4回	埼玉県公募公債	100,000,000	104,067,300	

平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	122,985,072	
平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	308,324,700	
平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	309,453,900	
平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	309,544,800	
第10回 群馬県公募公債	300,000,000	309,545,100	
第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,861,100	
第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,300,100	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,627,200	
平成22年度第1回 福島県公募公債	200,000,000	203,771,200	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	155,305,500	
第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	98,414,200	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	133,134,300	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	337,195,500	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	103,430,800	
平成22年度第1回 横浜市公募公債	300,000,000	305,159,700	
平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	205,820,400	
第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,655,800	
平成22年度第7回 札幌市公募公債	200,000,000	203,347,200	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	155,281,800	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	153,843,600	
平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	205,480,000	
平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	103,005,500	
平成22年度第6回 広島市公募公債	200,000,000	205,594,400	
平成22年度第1回 相模原市公募公債	100,000,000	102,385,700	
平成22年度第1回 岡山県公募公債	200,000,000	203,791,000	
地方債証券 合計	8,313,000,000	8,658,947,780	
特殊債券			
第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	206,448,800	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	329,904,300	
第107回 政保道路機構債券	315,000,000	320,669,370	
第137回 政保道路機構債券	400,000,000	412,432,000	
第139回 政保道路機構債券	500,000,000	514,837,500	
第155回 政保道路機構債券	300,000,000	308,971,800	
第163回 政保道路機構債券	300,000,000	309,998,100	
第190回 政保道路機構債券	500,000,000	515,105,000	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	118,318,900	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	520,081,500	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	115,842,400	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	97,985,900	
第12回 政保地方公共団体金融機構債券	313,000,000	318,570,148	
第12回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,500,400	
第25回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,095,000	
第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,603,800	
第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,976,600	
第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,463,200	
第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,489,800	
第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,516,300	
第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,033,752,000	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,232,000	36,604,277	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	93,042,000	98,894,341	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	112,179,000	120,928,962	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	90,856,000	96,779,811	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	98,728,000	104,977,482	
第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	100,388,000	106,521,706	
第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,673,000	51,437,626	
第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	412,280,000	434,790,488	
第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	256,110,000	268,761,834	
第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	165,186,000	174,998,048	
第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	150,489,000	157,592,080	
第19回 沖縄振興開発金融公庫債券	300,000,000	310,968,900	
い第779号 利付農林債券	300,000,000	300,933,000	

	第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,287,700	
	第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,338,400	
	第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,341,900	
	第4回 広島高速道路債券	200,000,000	205,752,800	
	第45回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,925,800	
	第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,329,200	
特殊債券 合計		9,490,163,000	9,851,727,173	
社債券	第3回 ノルデア・バンク	200,000,000	210,228,200	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	204,126,400	
	第33回 中日本高速道路債券	300,000,000	308,222,400	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	206,778,800	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	102,703,400	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	103,238,400	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	205,186,400	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	206,434,000	
	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	103,035,700	
	第12回 オリエンタルランド	100,000,000	101,036,000	
	第3回 富士フィルムホールディングス	300,000,000	309,330,600	
	第68回 新日本製鐵	200,000,000	205,462,200	
	第19回 豊田自動織機	200,000,000	205,541,400	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	103,117,700	
	第71回 伊藤忠商事	200,000,000	206,064,400	
	第39回 住友商事	100,000,000	104,984,000	
	第45回 住友商事	100,000,000	103,264,200	
	第46回 住友商事	100,000,000	103,019,000	
	第79回 三菱商事	100,000,000	103,205,300	
	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	103,129,100	
	第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	206,237,000	
	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	102,529,600	
	第9回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	200,000,000	207,155,800	
	第23回 三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	102,885,800	
	第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	104,454,700	
	第27回 三菱UFJリース	100,000,000	100,979,600	
	第46回 三井不動産	100,000,000	103,277,400	
	第111回 三菱地所	100,000,000	103,198,500	
	第75回 東京急行電鉄	100,000,000	103,115,800	
	第77回 東京急行電鉄	100,000,000	103,966,600	
	第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	104,490,600	
	第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,271,500	
	第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	206,155,600	
	第27回 西日本旅客鉄道	100,000,000	101,800,900	
	第19回 KDDI	100,000,000	101,484,000	
	第483回 関西電力	200,000,000	203,610,200	
	第381回 中国電力	200,000,000	207,465,800	
	第304回 北陸電力	100,000,000	103,720,800	
	第306回 北陸電力	100,000,000	103,352,500	
	第253回 四国電力	200,000,000	207,428,600	
	第429回 九州電力	200,000,000	206,937,400	
	第290回 北海道電力	200,000,000	208,755,400	
	第13回 電源開発	100,000,000	110,761,000	
社債券 合計		6,300,000,000	6,505,142,700	
合計		82,691,163,000	90,784,034,423	

## 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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,506,798,630	388,094,903
金銭信託	25,199,972	111,174,221
コール・ローン	941,924,381	2,269,384,208
株式	112,897,598,099	156,190,082,429
投資証券	2,567,665,403	4,073,157,868
派生商品評価勘定	29,048,909	134,259,059
未収入金	28,614	32,983
未収配当金	152,728,671	222,399,264
差入委託証拠金	1,187,028,384	1,479,571,172
流動資産合計	120,308,021,063	164,868,156,107
資産合計	120,308,021,063	164,868,156,107
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	69,682,443	1,018,478
未払金	2,031,088,863	-
未払解約金	79,401,209	421,904,508
その他未払費用	6,700	1,521
流動負債合計	2,180,179,215	422,924,507
負債合計	2,180,179,215	422,924,507
純資産の部		
元本等		
元本	70,849,080,074	94,844,967,281
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	47,278,761,774	69,600,264,319
純資産合計	118,127,841,848	164,445,231,600
負債純資産合計	120,308,021,063	164,868,156,107

## 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2月21日現在）	（2019年2月21日現在）
1. 受益権総口数	70,849,080,074口	94,844,967,281口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6673円 (16,673円)	1.7338円 (17,338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 2017年7月14日 至 2018年2月21日）	（自 2018年2月22日 至 2019年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はあります。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,983,569,311	6,368,984,989
投資証券	239,515,875	183,691,569
合計	2,744,053,436	6,552,676,558

## (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2月21日 現在)				(2019年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	2,221,179,076	-	2,244,277,310	23,098,234	-	-	-	-
アメリカ・ドル	1,658,732,021	-	1,678,456,780	19,724,759	-	-	-	-
イギリス・ポンド	161,391,769	-	162,841,000	1,449,231	-	-	-	-
ユーロ	401,055,286	-	402,979,530	1,924,244	-	-	-	-
買 建	3,573,870,368	-	3,562,222,609	11,647,759	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343
アメリカ・ドル	2,559,463,683	-	2,550,444,542	9,019,141	1,181,436,898	-	1,183,137,060	1,700,162
イギリス・ポンド	308,075,691	-	307,170,500	905,191	151,340,332	-	153,482,000	2,141,668
シンガポール・ドル	15,145,615	-	15,208,463	62,848	-	-	-	-
ユーロ	653,973,880	-	652,171,350	1,802,530	397,018,667	-	399,309,180	2,290,513
香港・ドル	37,211,499	-	37,227,754	16,255	-	-	-	-
合計	5,795,049,444	-	5,806,499,919	34,745,993	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343

## (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2月21日 現在)				(2019年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買建	2,542,378,757	-	2,536,491,218	5,887,539	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236
合計	2,542,378,757	-	2,536,491,218	5,887,539	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236

## (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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	55,288,522,570円	70,849,080,074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	25,443,319,702円	37,550,145,965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	9,882,762,198円	13,554,258,758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)	495,246,552円	595,531,315円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,487,198,234円	2,819,138,551円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,986,286,663円	2,160,421,182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)	11,998,588,461円	11,698,042,919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	47,177,054,577円	65,072,270,014円
DCニッセイ外国株式インデックス	6,391,706,768円	11,899,518,770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)	293,662,765円	468,264,447円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	3,038,935円	19,393,803円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	833,478円	13,566,941円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	222,445円	11,777,271円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	337,631円	18,901,250円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	500,567円	6,227,388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)	7,561,367円	21,917,060円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	3,797,240円	24,928,154円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	587,649円	2,040,927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)	635,751円	700,329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)	1,820,991円	11,598,689円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	210,461円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	199,701円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	188,906円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	129,203円
計	70,849,080,074円	94,844,967,281円

附属明細表(2019年2月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	23,425	208.53	4,884,815.25	
	ABBOTT LABORATORIES	70,106	75.54	5,295,807.24	
	ABBVIE INC	60,483	79.99	4,838,035.17	
	ABIOMED INC	1,704	362.25	617,274.00	
	ACCENTURE PLC	25,584	159.71	4,086,020.64	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	28,922	42.78	1,237,283.16	
	ACUITY BRANDS INC	1,594	128.57	204,940.58	
	ADOBE INC	19,563	258.10	5,049,210.30	
	ADVANCE AUTO PARTS	2,957	166.00	490,862.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	36,976	23.95	885,575.20	
	AERCAP HOLDINGS NV	5,049	47.65	240,584.85	

AES CORP	26,776	17.15	459,208.40
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,088	109.95	229,575.60
AFLAC INC	30,541	49.12	1,500,173.92
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,725	78.56	999,676.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,754	177.64	1,555,060.56
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	6,762	69.83	472,190.46
ALBEMARLE CORP	4,326	82.81	358,236.06
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,895	129.84	1,154,926.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,045	253.79	772,790.55
ALKERMES PLC	6,208	33.35	207,036.80
ALLEGHANY CORP	591	650.82	384,634.62
ALLEGION PLC	3,823	87.95	336,232.85
ALLERGAN PLC	13,540	140.33	1,900,068.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,985	173.42	344,238.70
ALLIANT ENERGY CORP	9,496	45.17	428,934.32
ALLSTATE CORP	13,779	95.06	1,309,831.74
ALLY FINANCIAL INC	16,813	27.17	456,809.21
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,619	77.75	281,377.25
ALPHABET INC-CL A	11,940	1,120.59	13,379,844.60
ALPHABET INC-CL C	12,577	1,113.80	14,008,262.60
ALTRIA GROUP INC	75,272	50.51	3,801,988.72
AMAZON.COM INC	16,563	1,622.10	26,866,842.30
AMERCO	401	380.75	152,680.75
AMEREN CORPORATION	9,870	70.40	694,848.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,690	35.06	164,431.40
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	19,777	80.52	1,592,444.04
AMERICAN EXPRESS CO	29,263	106.78	3,124,703.14
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,980	99.85	297,553.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	35,386	43.29	1,531,859.94
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,292	98.66	719,428.72
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,636	132.89	748,968.04
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,479	86.33	559,332.07
AMERITRADE HOLDING CORP	11,317	56.66	641,221.22
AMETEK INC	9,255	79.81	738,641.55
AMGEN INC	25,853	186.92	4,832,442.76
AMPHENOL CORP-CL A	12,032	93.48	1,124,751.36
ANADARKO PETROLEUM CORP	20,417	45.16	922,031.72
ANALOG DEVICES INC	14,833	106.82	1,584,461.06
ANSYS INC	3,360	174.66	586,857.60
ANTERO RESOURCES CORP	8,059	9.84	79,300.56
ANTHEM INC	10,389	312.95	3,251,237.55
AON PLC	9,710	172.80	1,677,888.00
APACHE CORP	15,191	33.80	513,455.80
APPLE INC	192,958	172.03	33,194,564.74



APPLIED MATERIALS INC	39,181	39.00	1,528,059.00
APTIV PLC	10,592	81.71	865,472.32
ARAMARK	9,803	32.57	319,283.71
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,103	32.30	520,126.90
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,308	41.97	936,266.76
ARCONIC INC	17,319	18.39	318,496.41
ARISTA NETWORKS INC	2,098	270.72	567,970.56
ARROW ELECTRONICS INC	3,451	81.99	282,947.49
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,303	80.49	587,818.47
ASSURANT INC	2,105	98.83	208,037.15
AT&T INC	290,529	30.85	8,962,819.65
ATHENE HOLDING LTD- CLASS A	6,149	44.60	274,245.40
ATMOS ENERGY CORP	4,511	98.00	442,078.00
AUTODESK INC	8,736	159.80	1,396,012.80
AUTOLIV INC	3,490	82.77	288,867.30
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	17,501	150.56	2,634,950.56
AUTOZONE INC	1,057	921.14	973,644.98
AVERY DENNISON CORP	3,487	106.43	371,121.41
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	9,153	19.51	178,575.03
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	8,713	26.92	234,553.96
BAKER HUGHES A GE CO	19,966	26.58	530,696.28
BALL CORP	13,086	54.40	711,878.40
BANK OF AMERICA CORP	378,841	29.41	11,141,713.81
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	39,875	53.32	2,126,135.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,283	74.13	1,503,578.79
BB&T CORPORATION	30,828	51.78	1,596,273.84
BECTON DICKINSON & CO	10,700	249.06	2,664,942.00
BEIGENE LTD-ADR	1,302	139.01	180,991.02
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,820	206.16	10,683,211.20
BEST BUY CO INC	10,022	60.32	604,527.04
BIOGEN INC	8,044	335.16	2,696,027.04
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,101	90.66	643,776.66
BLACKROCK INC	4,769	437.22	2,085,102.18
BOEING CO	21,810	421.55	9,194,005.50
BOOKING HOLDINGS INC	1,896	1,926.17	3,652,018.32
BORGWARNER INC	8,313	41.86	347,982.18
BOSTON SCIENTIFIC CORP	55,284	40.11	2,217,441.24
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,167	43.34	180,597.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	65,166	51.30	3,343,015.80
BROADCOM INC	17,240	283.42	4,886,160.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,652	100.16	465,944.32
BROWN-FORMAN CORP -CL B	10,615	48.24	512,067.60
BUNGE LIMITED	5,626	52.70	296,490.20
BURLINGTON STORES INC	2,713	163.25	442,897.25

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,735	92.02	527,734.70	
CABOT OIL & GAS CORP	17,586	24.95	438,770.70	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	11,298	55.07	622,180.86	
CAMPBELL SOUP CO	7,244	35.18	254,843.92	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	19,075	82.72	1,577,884.00	
CAPRI HOLDINGS LIMITED	5,959	43.70	260,408.30	
CARDINAL HEALTH INC	12,317	55.91	688,643.47	
CARMAX INC	7,080	62.40	441,792.00	
CARNIVAL CORP	16,864	58.85	992,446.40	
CATERPILLAR INC	23,724	140.31	3,328,714.44	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,465	95.15	424,844.75	
CBRE GROUP INC	12,805	50.12	641,786.60	
CBS CORP-CL B	13,723	51.20	702,617.60	
CDK GLOBAL INC	4,970	57.90	287,763.00	
CDW CORP/DE	6,074	94.79	575,754.46	
CELANESE CORP-SERIES A	5,372	102.72	551,811.84	
CELGENE CORP	28,085	90.40	2,538,884.00	
CENTENE CORP	16,414	65.28	1,071,505.92	
CENTERPOINT ENERGY INC	19,852	30.98	615,014.96	
CENTURYLINK INC	39,039	13.90	542,642.10	
CERNER CORP	11,811	57.77	682,321.47	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,312	44.58	415,128.96	
CHARLES SCHWAB CORP	48,532	46.45	2,254,311.40	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	6,506	349.76	2,275,538.56	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	4,988	119.99	598,510.12	
CHEMOURS CO/THE - W/I	7,008	38.18	267,565.44	
CHENIERE ENERGY INC	8,496	65.96	560,396.16	
CHEVRON CORP	76,514	120.28	9,203,103.92	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	998	597.74	596,544.52	
CHUBB LTD	18,458	134.81	2,488,322.98	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,797	64.94	636,217.18	
CIGNA CORP	15,189	194.12	2,948,488.68	
CIMAREX ENERGY CO	3,780	76.42	288,867.60	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,146	85.95	528,248.70	
CINTAS CORP	3,605	203.06	732,031.30	
CISCO SYSTEMS INC	187,932	49.63	9,327,065.16	
CIT GROUP INC	4,474	51.26	229,337.24	
CITIGROUP INC	100,433	64.64	6,491,989.12	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	18,830	37.66	709,137.80	
CITRIX SYSTEMS INC	5,433	105.37	572,475.21	
CLOROX CO	5,120	155.28	795,033.60	
CME GROUP INC	14,281	175.59	2,507,600.79	
CMS ENERGY CORP	11,513	52.79	607,771.27	
COCA-COLA CO	161,432	45.10	7,280,583.20	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	8,755	46.46	406,757.30	
COGNEX CORP	6,861	51.27	351,763.47	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	23,149	72.25	1,672,515.25	

COLGATE-PALMOLIVE CO	32,930	66.51	2,190,174.30
COMCAST CORP	182,891	37.79	6,911,450.89
COMERICA INC	6,785	88.31	599,183.35
COMMSCOPE HOLDING CO INC	7,760	23.45	182,010.80
CONAGRA BRANDS INC	19,373	24.03	465,533.19
CONCHO RESOURCES INC	7,982	112.45	897,575.90
CONOCOPHILLIPS	46,329	70.65	3,273,143.85
CONSOLIDATED EDISON INC	12,506	79.01	988,099.06
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,704	166.98	1,119,433.92
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,703	45.00	166,635.00
COOPER COS INC/THE	1,967	284.62	559,847.54
COPART INC	8,333	53.48	445,648.84
CORNING INC	32,349	34.66	1,121,216.34
COSTAR GROUP INC	1,450	409.60	593,920.00
COSTCO WHOLESALE CORP	17,512	217.11	3,802,030.32
COTY INC-CL A	19,292	11.15	215,105.80
CROWN HOLDINGS INC	5,416	54.26	293,872.16
CSX CORP	32,812	73.25	2,403,479.00
CUMMINS INC	6,169	155.39	958,600.91
CVS HEALTH CORP	50,355	64.22	3,233,798.10
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	14,000	9.00	126,000.00
DANAHER CORP	25,161	112.20	2,823,064.20
DARDEN RESTAURANTS INC	4,939	110.54	545,957.06
DAVITA INC	5,356	59.06	316,325.36
DEERE & CO	12,211	159.88	1,952,294.68
DELL TECHNOLOGIES -C	14,372	55.54	798,220.88
DELTA AIR LINES INC	7,014	51.24	359,397.36
DENTSPLY SIRONA INC	8,836	42.69	377,208.84
DEVON ENERGY CORPORATION	20,235	30.27	612,513.45
DEXCOM INC	3,532	145.54	514,047.28
DIAMONDBACK ENERGY INC	6,207	106.45	660,735.15
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	13,674	71.62	979,331.88
DISCOVERY INC-A	6,324	29.09	183,965.16
DISCOVERY INC-C	12,258	27.42	336,114.36
DISH NETWORK CORP	9,253	31.26	289,248.78
DOLLAR GENERAL CORP	10,605	118.99	1,261,888.95
DOLLAR TREE INC	9,494	99.19	941,709.86
DOMINION ENERGY INC	29,856	73.54	2,195,610.24
DOMINO'S PIZZA INC	1,592	278.49	443,356.08
DOVER CORP	5,904	92.08	543,640.32
DOWDUPONT INC	92,094	56.24	5,179,366.56
DR HORTON INC	14,274	39.87	569,104.38
DTE ENERGY COMPANY	7,330	121.77	892,574.10
DUKE ENERGY CORP	28,533	88.85	2,535,157.05
DXC TECHNOLOGY CO	11,193	66.44	743,662.92
E*TRADE FINANCIAL	10,337	48.44	500,724.28
EAST WEST BANCORP INC	5,669	55.67	315,593.23
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,603	84.60	474,013.80
EATON CORP PLC	17,253	79.72	1,375,409.16
EATON VANCE CORP	4,642	41.80	194,035.60
EBAY INC	37,506	36.74	1,377,970.44

ECOLAB INC	10,406	165.29	1,720,007.74
EDISON INTERNATIONAL	13,080	62.68	819,854.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,366	176.68	1,478,104.88
ELECTRONIC ARTS INC	12,168	98.63	1,200,129.84
ELI LILLY & CO	38,616	122.66	4,736,638.56
EMERSON ELECTRIC CO	25,077	68.58	1,719,780.66
ENERGY CORP	7,309	91.24	666,873.16
EOG RESOURCES INC	23,086	98.78	2,280,435.08
EQUIFAX INC	4,797	108.13	518,699.61
ESTEE LAUDER COS INC	8,942	156.67	1,400,943.14
EVEREST RE GROUP LTD	1,621	221.65	359,294.65
EVERGY INC	10,935	59.39	649,429.65
EVERSOURCE ENERGY	12,761	70.27	896,715.47
EXELON CORP	38,706	48.13	1,862,919.78
EXPEDIA GROUP INC	4,906	128.59	630,862.54
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	7,201	75.55	544,035.55
EXXON MOBIL CORP	169,071	78.53	13,277,145.63
F5 NETWORKS INC	2,447	168.18	411,536.46
FACEBOOK INC-A	96,334	162.56	15,660,055.04
FASTENAL CO	11,448	62.10	710,920.80
FEDEX CORP	10,126	181.91	1,842,020.66
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,907	34.91	380,763.37
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	13,144	107.06	1,407,196.64
FIFTH THIRD BANCORP	26,485	27.93	739,726.05
FIRST DATA CORP- CLASS A	21,454	25.24	541,498.96
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,496	103.19	670,322.24
FIRSTENERGY CORP	19,656	39.59	778,181.04
FISERV INC	16,229	84.73	1,375,083.17
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,529	227.50	802,847.50
FLEX LTD	21,106	10.40	219,502.40
FLIR SYSTEMS INC	5,518	52.80	291,350.40
FLOWSERVE CORP	5,224	47.75	249,446.00
FLUOR CORP	5,594	37.70	210,893.80
FMC CORP	5,380	87.45	470,481.00
FORD MOTOR CO	148,637	8.94	1,328,814.78
FORTINET INC	5,746	83.87	481,917.02
FORTIVE CORP	12,008	81.06	973,368.48
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	5,623	47.83	268,948.09
FRANKLIN RESOURCES INC	12,425	32.62	405,303.50
FREEMPORT-MCMORAN INC	54,634	13.35	729,363.90
GAP INC	9,230	25.16	232,226.80
GARMIN LTD	4,534	83.06	376,594.04
GARTNER INC	3,643	141.10	514,027.30
GENERAL DYNAMICS CORP	10,048	174.45	1,752,873.60
GENERAL ELECTRIC CO	347,021	10.10	3,504,912.10
GENERAL MILLS INC	23,791	46.95	1,116,987.45
GENERAL MOTORS CO	50,723	39.95	2,026,383.85
GENUINE PARTS CO	5,853	109.11	638,620.83
GILEAD SCIENCES INC	51,759	66.98	3,466,817.82
GLOBAL PAYMENTS INC	6,324	125.94	796,444.56

GODADDY INC - CLASS A	6,664	72.39	482,406.96	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,329	198.60	2,845,739.40	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,405	19.38	182,268.90	
GRUBHUB INC	3,611	81.68	294,946.48	
H&R BLOCK INC	8,180	23.90	195,502.00	
HALLIBURTON CO	35,093	32.29	1,133,152.97	
HANESBRANDS INC	14,454	18.96	274,047.84	
HARLEY-DAVIDSON INC	6,695	37.27	249,522.65	
HARRIS CORP	4,693	165.20	775,283.60	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	14,199	49.07	696,744.93	
HASBRO INC	4,832	86.92	419,997.44	
HCA HEALTHCARE INC	11,089	142.33	1,578,297.37	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	6,975	44.13	307,806.75	
HELMERICH & PAYNE	4,307	57.07	245,800.49	
HENRY SCHEIN INC	6,124	60.17	368,481.08	
HERSHEY CO/THE	5,655	110.68	625,895.40	
HESS CORP	10,713	58.64	628,210.32	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	59,080	16.05	948,234.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,316	83.34	943,075.44	
HOLLYFRONTIER CORP	6,667	56.10	374,018.70	
HOLOGIC INC	10,890	46.42	505,513.80	
HOME DEPOT INC	45,720	191.85	8,771,382.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	29,660	154.58	4,584,842.80	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,600	7.15	340,340.00	
HORMEL FOODS CORP	11,647	43.13	502,335.11	
HP INC	63,269	23.38	1,479,229.22	
HUMANA INC	5,507	308.88	1,701,002.16	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	43,780	14.27	624,740.60	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,725	220.83	380,931.75	
IAC/INTERACTIVECORP	3,095	216.85	671,150.75	
IDEX CORP	3,065	143.17	438,816.05	
IDEXX LABORATORIES INC	3,472	211.44	734,119.68	
IHS MARKIT LTD	15,646	53.04	829,863.84	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	12,051	143.61	1,730,644.11	
ILLUMINA INC	5,873	302.24	1,775,055.52	
INCYTE CORP	7,211	83.74	603,849.14	
INGERSOLL-RAND PLC	9,795	105.57	1,034,058.15	
INGREDION INC	2,821	93.50	263,763.50	
INTEL CORP	184,162	51.39	9,464,085.18	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,906	74.48	1,706,038.88	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	36,430	138.00	5,027,340.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	3,411	129.97	443,327.67	
INTERNATIONAL PAPER CO	15,467	47.74	738,394.58	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,513	23.66	367,037.58	
INTUIT INC	9,732	235.97	2,296,460.04	

INTUITIVE SURGICAL INC	4,544	549.65	2,497,609.60
INVESCO LTD	16,196	19.04	308,371.84
IPG PHOTONICS CORP	1,498	153.22	229,523.56
IQVIA HOLDINGS INC	6,483	141.19	915,334.77
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,083	132.83	409,514.89
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,074	73.80	374,461.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,000	70.85	637,650.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,100	39.92	363,272.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,409	126.78	305,413.02
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,667	113.79	417,267.93
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	11,943	20.85	249,011.55
JM SMUCKER CO	4,533	106.94	484,759.02
JOHNSON & JOHNSON	107,168	136.35	14,612,356.80
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	36,858	35.43	1,305,878.94
JONES LANG LASALLE INC	1,794	164.28	294,718.32
JPMORGAN CHASE & CO	134,207	105.69	14,184,337.83
JUNIPER NETWORKS INC	13,848	27.19	376,527.12
KANSAS CITY SOUTHERN	4,247	111.06	471,671.82
KELLOGG CO	10,409	58.45	608,406.05
KEYCORP	41,783	17.95	750,004.85
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,500	81.08	608,100.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,883	118.58	1,646,246.14
KINDER MORGAN INC	79,322	19.17	1,520,602.74
KLA-TENCOR CORP	6,219	112.87	701,938.53
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,585	34.72	193,911.20
KOHL'S CORP	6,660	65.45	435,897.00
KRAFT HEINZ CO/THE	24,277	48.26	1,171,608.02
KROGER CO	31,800	28.75	914,250.00
L BRANDS INC	9,403	27.48	258,394.44
L3 TECHNOLOGIES INC	3,123	212.96	665,074.08
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	4,077	149.75	610,530.75
LAM RESEARCH CORP	6,277	182.21	1,143,732.17
LAMB WESTON HOLDING INC	5,879	70.06	411,882.74
LAS VEGAS SANDS CORP	15,668	61.35	961,231.80
LEAR CORP	2,605	157.93	411,407.65
LEGGETT & PLATT INC	5,186	45.27	234,770.22
LEIDOS HOLDINGS INC	5,705	61.68	351,884.40
LENNAR CORP-CL A	11,628	48.95	569,190.60
LENOX INTERNATIONAL INC	1,461	248.54	363,116.94
LIBERTY BROADBAND-C	4,328	89.37	386,793.36
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,504	25.64	192,402.56
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	21,206	24.78	525,484.68
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	3,595	40.38	145,166.10

LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,055	40.46	285,445.30	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	8,274	31.61	261,541.14	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,520	62.63	533,607.60	
LINDE PLC	22,002	170.30	3,746,940.60	
LIVE NATION INC	5,976	55.65	332,564.40	
LKQ CORP	12,652	26.97	341,224.44	
LOCKHEED MARTIN CORP	10,254	307.20	3,150,028.80	
LOEWS CORP	10,651	47.44	505,283.44	
LOWE'S COS INC	32,398	105.66	3,423,172.68	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,971	148.12	588,184.52	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,168	89.16	1,174,058.88	
M&T BANK CORP	5,425	176.00	954,800.00	
MACY'S INC	12,217	25.02	305,669.34	
MANPOWER GROUP	2,535	84.54	214,308.90	
MARATHON OIL CORP	33,889	17.08	578,824.12	
MARATHON PETROLEUM CORP	27,567	65.11	1,794,887.37	
MARKEL CORP	556	1,019.76	566,986.56	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	11,771	126.97	1,494,563.87	
MARSH & MCLENNAN COS INC	20,189	91.95	1,856,378.55	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,514	192.27	483,366.78	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	24,650	19.80	488,070.00	
MASCO CORP	12,288	37.57	461,660.16	
MASTERCARD INC-CLASS A	36,859	221.11	8,149,893.49	
MATTEL INC	13,879	13.63	189,170.77	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,087	55.92	619,985.04	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,862	130.42	634,102.04	
MCDONALD'S CORP	30,997	180.49	5,594,648.53	
MCKESSON CORP	7,968	134.04	1,068,030.72	
MEDTRONIC PLC	53,949	92.80	5,006,467.20	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	9,985	23.40	233,649.00	
MERCADOLIBRE INC	1,674	368.34	616,601.16	
MERCK & CO INC	106,237	79.43	8,438,404.91	
METLIFE INC	33,521	45.05	1,510,121.05	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,008	673.05	678,434.40	
MGM MIRAGE	20,355	28.81	586,427.55	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,375	89.65	840,468.75	
MICRON TECHNOLOGY INC	46,235	42.21	1,951,579.35	
MICROSOFT CORP	291,019	107.15	31,182,685.85	
MIDDLEBY CORP	2,223	118.68	263,825.64	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,518	139.77	351,940.86	
MOLSON COORS BREWING CO -B	7,528	61.39	462,143.92	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	58,545	47.99	2,809,574.55	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,542	58.70	971,015.40	

MOODY'S CORP	6,918	169.46	1,172,324.28	
MORGAN STANLEY	52,251	42.42	2,216,487.42	
MOSAIC CO/THE	14,608	33.48	489,075.84	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,551	139.21	911,964.71	
MSCI INC	3,572	176.11	629,064.92	
MYLAN NV	20,532	31.62	649,221.84	
NASDAQ INC	4,602	88.08	405,344.16	
NATIONAL-OILWELL INC	15,232	29.81	454,065.92	
NEKTAR THERAPEUTICS	6,885	43.03	296,261.55	
NETAPP INC	10,354	65.27	675,805.58	
NETFLIX INC	17,408	359.91	6,265,313.28	
NEWELL BRANDS INC	18,829	17.15	322,917.35	
NEWMONT MINING CORP	21,118	35.39	747,366.02	
NEWS CORP - CLASS A	15,735	12.88	202,666.80	
NEXTERA ENERGY INC	18,883	185.64	3,505,440.12	
NIELSEN HOLDINGS PLC	14,180	25.85	366,553.00	
NIKE INC	51,180	84.84	4,342,111.20	
NISOURCE INC	14,689	26.28	386,026.92	
NOBLE ENERGY INC	19,242	24.05	462,770.10	
NORDSTROM INC	4,685	45.00	210,825.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,323	183.49	2,077,657.27	
NORTHERN TRUST CORP	8,447	93.47	789,541.09	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,610	288.22	1,905,134.20	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	8,345	53.70	448,126.50	
NRG ENERGY INC	12,187	42.06	512,585.22	
NUCOR CORP	12,604	61.48	774,893.92	
NVIDIA CORP	23,067	158.55	3,657,272.85	
NVR INC	138	2,590.30	357,461.40	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,740	94.25	1,294,995.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,221	383.58	1,235,511.18	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,520	68.25	2,082,990.00	
OGE ENERGY CORP	8,078	41.94	338,791.32	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,538	152.50	387,045.00	
OMNICOM GROUP	9,074	75.05	681,003.70	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	16,917	22.59	382,155.03	
ONEOK INC	16,452	68.12	1,120,710.24	
ORACLE CORP	119,252	51.77	6,173,676.04	
OWENS CORNING	4,367	52.61	229,747.87	
PACCAR INC	13,926	69.04	961,451.04	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,755	100.72	378,203.60	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,728	226.64	844,913.92	
PARKER HANNIFIN CORP	5,272	175.34	924,392.48	
PARSLEY ENERGY INC- CLASS A	9,961	18.54	184,676.94	
PAYCHEX INC	12,882	75.32	970,272.24	
PAYPAL HOLDINGS INC	44,906	94.73	4,253,945.38	
PENTAIR PLC	6,641	42.79	284,168.39	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,504	17.70	256,720.80	
PEPSICO INC	56,523	115.83	6,547,059.09	
PERRIGO CO PLC	5,174	48.94	253,215.56	
PFIZER INC	234,117	42.20	9,879,737.40	



PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,110	85.04	5,281,834.40	
PHILLIPS 66	17,597	97.45	1,714,827.65	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,535	90.93	412,367.55	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,788	141.28	959,008.64	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	6,080	23.95	145,616.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	18,496	126.52	2,340,113.92	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,360	86.87	205,013.20	
PPG INDUSTRIES INC	9,661	109.74	1,060,198.14	
PPL CORPORATION	28,094	31.18	875,970.92	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,228	52.22	586,326.16	
PROCTER & GAMBLE CO	99,398	99.28	9,868,233.44	
PROGRESSIVE CORP	23,294	72.48	1,688,349.12	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	16,521	95.02	1,569,825.42	
PTC INC	4,471	91.83	410,571.93	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,277	56.61	1,147,880.97	
PULTE GROUP INC	10,749	27.14	291,727.86	
PVH CORP	3,075	114.06	350,734.50	
QORVO INC	5,009	65.86	329,892.74	
QUALCOMM INC	56,169	52.45	2,946,064.05	
QUEST DIAGNOSTICS	5,461	88.94	485,701.34	
QURATE RETAIL INC	17,140	21.84	374,337.60	
RALPH LAUREN CORP	2,207	125.33	276,603.31	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,203	82.78	430,704.34	
RAYTHEON CO	11,395	187.29	2,134,169.55	
RED HAT INC	7,081	182.31	1,290,937.11	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,177	422.51	1,342,314.27	
REGIONS FINANCIAL CORP	43,628	16.36	713,754.08	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,519	144.45	363,869.55	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,597	145.15	231,804.55	
REPUBLIC SERVICES INC	9,113	77.23	703,796.99	
RESMED INC	5,702	99.77	568,888.54	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	4,853	67.73	328,693.69	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,916	178.84	879,177.44	
ROLLINS INC	5,872	39.35	231,063.20	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,130	313.47	1,294,631.10	
ROSS STORES INC	15,042	93.97	1,413,496.74	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,642	120.83	802,552.86	
S&P GLOBAL INC	10,069	198.02	1,993,863.38	
SABRE CORP	10,465	21.97	229,916.05	
SALESFORCE.COM INC	28,720	158.54	4,553,268.80	
SCHLUMBERGER LTD	55,203	45.90	2,533,817.70	
SEAGATE TECHNOLOGY	10,870	45.89	498,824.30	
SEALED AIR CORP	6,362	42.82	272,420.84	
SEATTLE GENETICS INC	4,436	69.76	309,455.36	

SEI INVESTMENTS COMPANY	5,288	52.57	277,990.16	
SEMPRA ENERGY	10,981	117.13	1,286,204.53	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,762	49.78	336,612.36	
SERVICENOW INC	7,112	229.50	1,632,204.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,364	439.27	1,477,704.28	
SIGNATURE BANK	2,179	135.60	295,472.40	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	64,344	6.04	388,637.76	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,132	82.33	587,177.56	
SMITH (A.O.) CORP	5,718	52.47	300,023.46	
SNAP-ON INC	2,244	159.83	358,658.52	
SOUTHERN CO	40,677	49.74	2,023,273.98	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,807	54.41	315,958.87	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	4,247	97.98	416,121.06	
SPLUNK INC	5,788	133.12	770,498.56	
SPRINT CORP	33,555	6.31	211,732.05	
SQUARE INC - A	12,042	75.97	914,830.74	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,612	59.26	510,347.12	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,092	136.82	833,507.44	
STARBUCKS CORP	53,861	70.39	3,791,275.79	
STATE STREET CORP	15,097	72.24	1,090,607.28	
STEEL DYNAMICS INC	9,358	39.04	365,336.32	
STRYKER CORP	13,457	187.64	2,525,071.48	
SUNTRUST BANKS INC	18,296	66.55	1,217,598.80	
SVB FINANCIAL GROUP	2,114	250.81	530,212.34	
SYMANTEC CORP	24,788	22.47	556,986.36	
SYNCHRONY FINANCIAL	28,025	31.79	890,914.75	
SYNOPSIS INC	5,921	102.98	609,744.58	
SYSCO CORP	19,731	67.35	1,328,882.85	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,669	98.18	949,302.42	
T-MOBILE US INC	13,721	72.75	998,202.75	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,545	88.67	403,005.15	
TAPESTRY INC	11,510	34.99	402,734.90	
TARGA RESOURCES CORP	9,010	44.89	404,458.90	
TARGET CORP	19,965	72.71	1,451,655.15	
TE CONNECTIVITY LTD	13,897	82.78	1,150,393.66	
TECHNIPFMC PLC	17,136	24.59	421,374.24	
TELEFLEX INC	1,831	286.48	524,544.88	
TESLA, INC.	5,114	302.56	1,547,291.84	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	38,610	17.40	671,814.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,813	107.94	4,189,475.22	
TEXTRON INC	9,909	54.99	544,895.91	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,093	252.22	4,058,976.46	
TIFFANY & CO	4,395	91.62	402,669.90	
TJX COS INC	49,601	50.51	2,505,346.51	
TORCHMARK CORP	4,235	84.01	355,782.35	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6,575	93.67	615,880.25	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,861	97.55	474,190.55	
TRANSDIGM GROUP INC	1,902	436.19	829,633.38	
TRANSUNION	7,390	63.04	465,865.60	

TRAVELERS COS INC/THE	10,663	129.74	1,383,417.62
TRIMBLE INC	9,969	39.98	398,560.62
TRIPADVISOR INC	4,235	55.40	234,619.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	17,298	50.38	871,473.24
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	41,298	50.77	2,096,699.46
TWITTER INC	27,254	31.37	854,957.98
TYSON FOODS INC-CL A	11,791	63.60	749,907.60
UGI CORP	7,037	53.46	376,198.02
ULTA BEAUTY INC	2,267	306.31	694,404.77
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,502	21.28	159,642.56
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	7,551	19.18	144,828.18
UNION PACIFIC CORP	29,729	170.99	5,083,361.71
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,770	88.50	245,145.00
UNITED PARCEL SERVICE INC	27,888	111.07	3,097,520.16
UNITED RENTALS INC	3,295	136.26	448,976.70
UNITED TECHNOLOGIES CORP	32,685	128.43	4,197,734.55
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,726	117.89	203,478.14
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,454	269.51	10,363,737.54
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3,445	134.32	462,732.40
UNUM GROUP	8,588	37.31	320,418.28
US BANCORP	61,700	51.60	3,183,720.00
VAIL RESORTS INC	1,604	211.29	338,909.16
VALERO ENERGY CORP	17,045	85.43	1,456,154.35
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,659	132.64	485,329.76
VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	4,819	118.00	568,642.00
VERISIGN INC	4,421	176.01	778,140.21
VERISK ANALYTICS INC	6,269	122.83	770,021.27
VERIZON COMMUNICATIONS INC	165,396	55.76	9,222,480.96
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,212	187.84	1,918,222.08
VF CORP	13,481	86.37	1,164,353.97
VIACOM INC-CLASS B	14,238	29.31	417,315.78
VISA INC-CLASS A SHARES	70,980	144.73	10,272,935.40
VISTRA ENERGY CORP	13,516	26.64	360,066.24
VMWARE INC-CLASS A	3,011	170.76	514,158.36
VOYA FINANCIAL INC	6,344	50.18	318,341.92
VULCAN MATERIALS CO	5,277	114.27	603,002.79
WABCO HOLDINGS INC	2,104	117.82	247,893.28
WABTEC CORP	3,460	75.08	259,776.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	33,662	71.80	2,416,931.60
WALMART INC	58,922	99.88	5,885,129.36
WALT DISNEY CO	59,516	113.68	6,765,778.88
WASTE CONNECTIONS INC	10,537	83.43	879,101.91
WASTE MANAGEMENT INC	17,138	99.18	1,699,746.84
WATERS CORP	3,078	234.00	720,252.00

WAYFAIR INC- CLASS A	2,272	117.99	268,073.28	
WEC ENERGY GROUP INC	12,705	75.10	954,145.50	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,003	277.98	556,793.94	
WELLS FARGO & CO	182,677	49.81	9,099,141.37	
WESTERN DIGITAL CORP	11,575	48.46	560,924.50	
WESTERN UNION CO	17,835	17.84	318,176.40	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,519	79.89	121,352.91	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	10,101	40.32	407,272.32	
WEYERHAEUSER CO	30,096	25.87	778,583.52	
WHIRLPOOL CORP	2,569	142.70	366,596.30	
WILLIAMS COS INC	48,375	27.35	1,323,056.25	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,210	171.08	891,326.80	
WIX.COM LTD	1,736	111.11	192,886.96	
WORKDAY INC-CLASS A	5,842	188.65	1,102,093.30	
WORLDPAY INC	12,064	88.33	1,065,613.12	
WR BERKLEY CORP	3,902	82.59	322,266.18	
WW GRAINGER INC	1,907	311.04	593,153.28	
WYNN RESORTS LTD	3,898	129.18	503,543.64	
XCEL ENERGY INC	20,492	54.10	1,108,617.20	
XEROX CORP	9,144	30.87	282,275.28	
XILINX INC	10,101	120.11	1,213,231.11	
XPO LOGISTICS INC	5,198	55.09	286,357.82	
XYLEM INC	7,180	74.07	531,822.60	
YUM! BRANDS INC	12,699	94.72	1,202,849.28	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8,867	25.74	228,236.58	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	4,954	34.83	172,547.82	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,125	123.98	1,007,337.50	
ZIONS BANCORP, N.A.	7,634	51.28	391,471.52	
ZOETIS INC	19,278	94.39	1,819,650.42	
アメリカ・ドル 小計	12,175,126		958,221,419.10 (106,075,111,096)	
イギリス・ポンド				
3I GROUP PLC	38,113	9.50	362,302.17	
ADMIRAL GROUP PLC	8,148	21.84	177,952.32	
ANGLO AMERICAN PLC	41,742	20.20	843,188.40	
ANTOFAGASTA PLC	15,387	9.35	143,929.99	
ASHTREAD GROUP PLC	19,405	20.27	393,339.35	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,219	23.29	331,160.51	
ASTRAZENECA PLC	50,632	61.43	3,110,323.76	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI	38,449	4.61	177,480.58	
AVIVA PLC	155,538	4.25	661,503.11	
BABCOCK INTL GROUP PLC	9,677	5.59	54,171.84	
BAE SYSTEMS PLC	127,628	5.04	643,755.63	
BARCLAYS PLC	682,409	1.60	1,097,313.67	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,159	5.71	229,388.20	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	4,975	38.31	190,592.25	
BHP GROUP PLC	83,976	18.23	1,531,386.33	
BP PLC	797,835	5.39	4,303,521.99	

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	91,603	28.50	2,611,143.51	
BT GROUP PLC	339,840	2.29	779,253.12	
BUNZL PLC	13,597	25.15	341,964.55	
BURBERRY GROUP PLC	16,603	19.47	323,343.42	
CARNIVAL PLC	6,899	43.51	300,175.49	
CENTRICA PLC	227,164	1.37	311,669.00	
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,099	26.51	214,704.49	
COMPASS GROUP PLC	63,387	17.31	1,097,228.97	
CONVATEC GROUP PLC	54,935	1.26	69,492.77	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,315	50.84	270,214.60	
DCC PLC	3,951	66.95	264,519.45	
DIAGEO PLC	98,437	30.14	2,967,383.36	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	54,401	3.52	191,709.12	
EASYJET PLC	6,615	13.20	87,318.00	
EXPERIAN PLC	36,673	20.17	739,694.41	
FERGUSON PLC	9,260	53.94	499,484.40	
FRESNILLO PLC	8,534	10.27	87,686.85	
G4S PLC	62,238	2.10	131,010.99	
GLAXOSMITHKLINE PLC	198,328	15.74	3,121,682.72	
GLENORE PLC	453,740	3.10	1,408,408.96	
GVC HOLDINGS PLC	21,759	6.49	141,215.91	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,416	16.84	192,302.52	
HSBC HOLDINGS PLC	794,844	6.43	5,114,026.29	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,113	27.13	1,034,196.25	
INFORMA PLC	51,330	7.15	367,009.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,895	45.45	313,377.75	
INTERTEK GROUP PLC	6,471	51.96	336,233.16	
INVESTEC PLC	27,225	4.84	131,769.00	
ITV PLC	148,056	1.34	199,727.54	
JOHNSON MATTHEY PLC	7,731	32.03	247,623.93	
KINGFISHER PLC	84,186	2.41	203,393.37	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	236,818	2.71	643,197.68	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,841,730	0.61	1,736,297.03	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,564	45.08	566,385.12	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,637	2.91	188,546.12	
MEGGITT PLC	31,048	5.60	173,868.80	
MELROSE INDUSTRIES PLC	193,467	1.72	333,150.17	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	28,515	3.70	105,562.53	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	17,366	18.60	323,007.60	
MONDI PLC/WI	14,629	18.85	275,829.79	
MORRISON WM SUPERMARKETS	89,552	2.27	203,462.14	
NATIONAL GRID PLC	136,623	8.47	1,158,153.17	
NEXT PLC	5,589	50.06	279,785.34	
NMC HEALTH PLC	4,197	27.82	116,760.54	
PEARSON PLC	31,572	8.92	281,748.52	
PERSIMMON PLC	12,439	24.41	303,635.99	
PRUDENTIAL PLC	103,406	15.36	1,588,316.16	

	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,833	60.25	1,616,688.25	
	RELX PLC	79,244	16.85	1,335,261.40	
	RIO TINTO PLC	46,655	44.49	2,075,680.95	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	67,348	9.88	665,667.63	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	191,480	2.58	494,018.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	183,483	24.28	4,454,967.24	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	149,621	24.40	3,651,500.50	
	ROYAL MAIL PLC	37,354	2.78	103,918.82	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,874	5.41	221,373.58	
	SAGE GROUP PLC	43,387	6.62	287,482.26	
	SAINSBURY (J) PLC	70,013	2.34	164,180.48	
	SCHRODERS PLC	4,839	26.64	128,910.96	
	SEVERN TRENT PLC	9,762	20.24	197,582.88	
	SMITH & NEPHEW PLC	35,142	14.38	505,341.96	
	SMITHS GROUP PLC	15,840	14.62	231,580.80	
	SSE PLC	40,941	11.90	487,402.60	
	ST JAMES'S PLACE PLC	21,271	9.47	201,563.99	
	STANDARD CHARTERED PLC	111,816	6.16	689,681.08	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	92,416	2.34	216,900.35	
	TAYLOR WIMPEY PLC	129,824	1.67	216,935.90	
	TESCO PLC	390,722	2.27	888,501.82	
	TUI AG-DI	17,374	8.43	146,497.56	
	UNILEVER PLC	45,218	42.36	1,915,434.48	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	28,058	8.52	239,166.39	
	VODAFONE GROUP PLC	1,073,617	1.42	1,527,756.99	
	WEIR GROUP PLC/THE	9,789	16.19	158,532.85	
	WHITBREAD PLC	7,317	49.37	361,240.29	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	27,033	5.42	146,735.12	
	WPP PLC	50,680	8.48	430,070.48	
イギリス・ポンド 小計		11,958,040		70,388,556.21 (10,161,995,860)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	1,655	199.50	330,172.50	
	BANK HAPOLIM BM	41,872	24.80	1,038,425.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,512	24.00	1,428,288.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	87,313	3.29	287,696.33	
	ELBIT SYSTEMS LTD	936	482.00	451,152.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	27,956	20.20	564,711.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,527	68.66	379,483.82	
	NICE LTD	2,455	415.60	1,020,298.00	
イスラエル・シュケル 小計		227,226		5,500,227.45 (168,691,975)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	27,608	21.31	588,326.48	
	ALUMINA LTD	102,745	2.72	279,466.40	
	AMCOR LTD	49,099	14.85	729,120.15	
	AMP LTD	120,513	2.27	273,564.51	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,794	24.64	586,284.16	

ASX LTD	8,779	68.69	603,029.51	
AURIZON HOLDINGS LTD	94,551	4.66	440,607.66	
AUSNET SERVICES	108,989	1.73	189,095.91	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	116,751	27.27	3,183,799.77	
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,132	8.85	169,318.20	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	22,377	9.78	218,847.06	
BHP GROUP LIMITED	129,980	37.94	4,931,441.20	
BLUESCOPE STEEL LTD	22,887	12.16	278,305.92	
BORAL LTD	49,911	4.80	239,572.80	
BRAMBLES LTD	66,652	11.33	755,167.16	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	11,277	27.80	313,500.60	
CHALLENGER LTD	24,043	7.70	185,131.10	
CIMIC GROUP LIMITED	4,549	48.65	221,308.85	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,519	8.36	196,618.84	
COCHLEAR LTD	2,485	173.45	431,023.25	
COLES GROUP LTD	46,837	11.37	532,536.69	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	71,200	71.66	5,102,192.00	
COMPUTERSHARE LIMITED	19,867	18.01	357,804.67	
CROWN RESORTS LTD	17,253	11.55	199,272.15	
CSL LIMITED	18,207	185.35	3,374,667.45	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,652	44.50	118,014.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,432	43.06	104,721.92	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,236	6.69	443,118.84	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	27,497	3.51	96,514.47	
INCITEC PIVOT LTD	72,778	3.28	238,711.84	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	97,340	7.28	708,635.20	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	19,241	17.79	342,297.39	
MACQUARIE GROUP LTD	13,338	126.00	1,680,588.00	
MEDIBANK PRIVATE LTD	122,948	2.82	346,713.36	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	111,837	24.54	2,744,479.98	
NEWCREST MINING LIMITED	31,560	25.44	802,886.40	
OIL SEARCH LTD	57,646	8.18	471,544.28	
ORICA LTD	16,543	18.05	298,601.15	
ORIGIN ENERGY LIMITED	72,497	7.59	550,252.23	
QBE INSURANCE GROUP LTD	56,801	11.30	641,851.30	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	6,196	59.53	368,847.88	
REA GROUP LTD	2,437	77.43	188,696.91	
RIO TINTO LTD	15,295	94.94	1,452,107.30	
SANTOS LTD	72,950	6.94	506,273.00	
SEEK LTD	14,842	17.15	254,540.30	
SONIC HEALTHCARE LTD	17,834	24.30	433,366.20	
SOUTH32 LTD	208,334	3.91	814,585.94	
SUNCORP GROUP LTD	55,818	12.85	717,261.30	
TABCORP HOLDINGS LTD	80,450	4.49	361,220.50	

	TELSTRA CORP LTD	179,208	3.20	573,465.60	
	TPG TELECOM LTD	16,727	6.83	114,245.41	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	30,018	14.72	441,864.96	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,889	29.29	143,198.81	
	WESFARMERS LIMITED	46,407	32.72	1,518,437.04	
	WESTPAC BANKING CORP	139,474	26.42	3,684,903.08	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,126	37.30	1,422,099.80	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,017	28.69	1,549,747.73	
	WORLEYPARSONS LTD	13,563	15.46	209,683.98	
	オーストラリア・ドル 小計	2,970,936		48,723,478.59 (3,880,337,835)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	9,297	57.64	535,879.08	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	17,507	73.08	1,279,411.56	
	ALTAGAS LTD	10,822	15.93	172,394.46	
	ARC RESOURCES LTD	13,981	10.27	143,584.87	
	ATCO LTD -CL 'I'	3,416	42.13	143,916.08	
	AURORA CANNABIS INC	26,623	9.30	247,593.90	
	BANK OF MONTREAL	25,531	99.05	2,528,845.55	
	BANK OF NOVA SCOTIA	49,136	75.58	3,713,698.88	
	BARRICK GOLD CORP	69,004	18.14	1,251,732.56	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	12,590	31.61	397,969.90	
	BCE INC	6,941	57.68	400,356.88	
	BLACKBERRY LTD	20,460	11.20	229,152.00	
	BOMBARDIER INC	84,801	2.84	240,834.84	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	34,002	58.67	1,994,897.34	
	CAE INC	10,894	28.07	305,794.58	
	CAMECO CORP	15,849	15.83	250,889.67	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	17,705	114.20	2,021,911.00	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	29,665	113.39	3,363,714.35	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	48,731	37.27	1,816,204.37	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,823	273.91	1,594,977.93	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,464	145.72	359,054.08	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,658	33.46	189,316.68	
	CANOPY GROWTH CORP	8,077	60.80	491,081.60	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,040	57.38	346,575.20	
	CENOVUS ENERGY INC	41,676	11.64	485,108.64	
	CGI INC	10,142	87.89	891,380.38	
	CI FINANCIAL CORP	10,392	18.81	195,473.52	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	809	1,158.44	937,177.96	
	DOLLARAMA INC	12,470	37.09	462,512.30	
	EMERA INC	2,750	46.39	127,572.50	
	EMPIRE CO LTD 'A'	6,956	30.93	215,149.08	
	ENBRIDGE INC	73,092	48.30	3,530,343.60	
	ENCANA CORP	38,009	9.10	345,881.90	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,115	665.16	741,653.40	



FINNING INTERNATIONAL INC	6,800	26.09	177,412.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,593	21.71	164,844.03	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	27,354	14.65	400,736.10	
FORTIS INC	17,451	46.36	809,028.36	
FRANCO-NEVADA CORP	7,420	101.29	751,571.80	
GEORGE WESTON LTD	3,108	97.71	303,682.68	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,370	45.02	376,817.40	
GOLDCORP INC	34,401	15.21	523,239.21	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,875	29.95	355,656.25	
HUSKY ENERGY INC	14,077	15.98	224,950.46	
HYDRO ONE LTD	13,934	20.65	287,737.10	
IA FINANCIAL CORP INC	4,263	50.90	216,986.70	
IGM FINANCIAL INC	3,613	34.60	125,009.80	
IMPERIAL OIL LTD	11,274	36.42	410,599.08	
INTACT FINANCIAL CORP	5,647	110.93	626,421.71	
INTER PIPELINE LTD	15,621	21.26	332,102.46	
KEYERA CORP	8,414	29.23	245,941.22	
KINROSS GOLD CORP	49,288	5.00	246,440.00	
LOBLAW COS LTD	7,518	66.54	500,247.72	
LUNDIN MINING CORP	25,516	6.72	171,467.52	
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,960	69.54	901,238.40	
MANULIFE FINANCIAL CORP	79,019	22.27	1,759,753.13	
METHANEX CORP	2,548	76.77	195,609.96	
METRO INC	9,737	48.85	475,652.45	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,671	62.56	855,257.76	
NUTRIEN LTD	24,575	71.72	1,762,519.00	
ONEX CORPORATION	3,636	77.50	281,790.00	
OPEN TEXT CORP	10,784	49.68	535,749.12	
PEMBINA PIPELINE CORP	20,264	48.25	977,738.00	
POWER CORP OF CANADA	14,277	27.63	394,473.51	
POWER FINANCIAL CORP	10,043	28.68	288,033.24	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	8,385	19.82	166,190.70	
RESTAURANT BRANDS INTERN	9,564	85.22	815,044.08	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	15,053	72.64	1,093,449.92	
ROYAL BANK OF CANADA	57,490	102.78	5,908,822.20	
SAPUTO INC	9,408	41.76	392,878.08	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	10,718	10.61	113,717.98	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,007	27.37	520,221.59	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,561	236.35	841,642.35	
SNC-LAVALIN GROUP INC	7,057	34.31	242,125.67	
STARS GROUP INC/THE	7,014	22.25	156,061.50	
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,239	49.64	1,203,223.96	
SUNCOR ENERGY INC	64,854	45.24	2,933,994.96	
TECK RESOURCES LTD-CL B	20,205	30.50	616,252.50	
THOMSON REUTERS CORP	9,123	69.36	632,771.28	
TORONTO-DOMINION BANK	72,970	76.29	5,566,881.30	
TOURMALINE OIL CORP	10,212	20.24	206,690.88	
TRANSCANADA CORP	36,343	58.07	2,110,438.01	

	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	39,136	2.51	98,231.36	
	VERMILION ENERGY INC	5,794	33.58	194,562.52	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,254	68.70	154,849.80	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,576	28.99	509,528.24	
	WSP GLOBAL INC	4,203	70.57	296,605.71	
カナダ・ドル 小計		1,671,645		72,404,931.40 (6,085,634,484)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	102,500	3.43	351,575.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	15,700	9.53	149,621.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	94,800	2.43	230,364.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,200	25.08	1,785,696.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	237,000	1.10	260,700.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	248,700	0.26	64,662.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,900	36.55	142,545.00	
	KEPPEL CORP LTD	57,700	6.32	364,664.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	124,800	11.67	1,456,416.00	
	SATS LTD	34,000	5.14	174,760.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	41,100	2.66	109,326.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	22,600	10.02	226,452.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	32,400	7.86	254,664.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	68,200	2.49	169,818.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	63,000	3.77	237,510.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	336,600	3.05	1,026,630.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	53,200	25.98	1,382,136.00	
	UOL Group Limited	18,700	6.79	126,973.00	
	VENTURE CORP LTD	10,700	16.16	172,912.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	75,300	3.35	252,255.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	91,700	1.42	130,214.00		
シンガポール・ドル 小計		1,803,800		9,069,893.00 (743,005,634)	
スイス・フラン	ABB LTD	73,464	20.04	1,472,218.56	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,163	52.98	326,515.74	
	BALOISE HOLDING AG	1,918	159.10	305,153.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	90	1,739.00	156,510.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	43	6,350.00	273,050.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	72,600.00	290,400.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,902	73.18	1,529,608.36	
	CLARIANT AG	7,973	21.15	168,628.95	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	101,935	12.03	1,226,278.05	
	DUFREY AG-REG	1,296	99.82	129,366.72	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	332	561.50	186,418.00	

GEBERIT AG-REG	1,486	397.60	590,833.60	
GIVAUDAN-REG	372	2,455.00	913,260.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,989	40.27	361,987.03	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,397	138.95	333,063.15	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	19,370	48.93	947,774.10	
LONZA GROUP AG	2,978	290.00	863,620.00	
NESTLE SA	122,381	90.52	11,077,928.12	
NOVARTIS AG	86,594	90.68	7,852,343.92	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,522	79.60	121,151.20	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	698	711.00	496,278.00	
ROCHE HOLDING AG	28,064	276.70	7,765,308.80	
SCHINDLER HOLDING AG- REG	829	219.80	182,214.20	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,606	226.20	363,277.20	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	215	2,481.00	533,415.00	
SIKA AG-BEARER	5,189	132.00	684,948.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,226	184.60	410,919.60	
STRAUMANN HOLDING AG	415	771.00	319,965.00	
SWATCH GROUP AG	1,258	285.70	359,410.60	
SWISS LIFE HOLDING AG- REG	1,352	416.70	563,378.40	
SWISS PRIME SITE-REG	3,082	84.40	260,120.80	
SWISS RE AG	12,142	97.46	1,183,359.32	
SWISSCOM AG	1,097	454.40	498,476.80	
TEMENOS GROUP AG-REG	2,425	141.30	342,652.50	
THE SWATCH GROUP AG- REG	2,058	55.25	113,704.50	
UBS GROUP AG	153,878	12.50	1,923,475.00	
VIFOR PHARMA AG	1,811	128.10	231,989.10	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,030	324.10	1,954,323.00	
スイス・フラン 小計	684,584		47,313,325.12 (5,233,800,024)	
スウェーデン・ クローナ				
ALFA LAVAL AB	11,937	205.90	2,457,828.30	
ASSA ABLOY AB	40,400	192.75	7,787,100.00	
ATLAS COPCO AB	15,504	236.25	3,662,820.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	27,038	255.00	6,894,690.00	
BOLIDEN AB	10,742	245.90	2,641,457.80	
ELECTROLUX AB	9,710	242.80	2,357,588.00	
EPIROC AB-A	26,474	91.80	2,430,313.20	
EPIROC AB-B	15,540	86.39	1,342,500.60	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	24,384	265.20	6,466,636.80	
HENNES & MAURITZ AB	35,031	139.94	4,902,238.14	
HEXAGON AB-B SHS	10,463	482.90	5,052,582.70	
HUSQVARNA AB-B SHS	17,051	75.48	1,287,009.48	
ICA GRUPPEN AB	3,257	359.00	1,169,263.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,945	191.65	1,331,009.25	
INVESTOR AB	18,346	419.40	7,694,312.40	
KINNEVIK AB - B	9,686	225.40	2,183,224.40	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,155	290.00	914,950.00	
LUNDIN PETROLEUM AB	7,656	306.40	2,345,798.40	
NORDEA BANK ABP	121,896	84.70	10,324,591.20	
SANDVIK AB	45,343	152.40	6,910,273.20	

	SECURITAS AB	12,873	147.95	1,904,560.35	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	66,033	94.96	6,270,493.68	
	SKANSKA AB-B SHS	13,697	164.25	2,249,732.25	
	SKF AB	15,190	159.65	2,425,083.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	61,943	103.70	6,423,489.10	
	SWEDBANK AB - A SHARES	36,567	182.05	6,657,022.35	
	SWEDISH MATCH AB	7,191	446.10	3,207,905.10	
	TELE2 AB	20,757	120.50	2,501,218.50	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	123,295	85.26	10,512,131.70	
	TELIA CO AB	116,608	40.15	4,681,811.20	
	VOLVO AB	62,673	138.25	8,664,542.25	
スウェーデン・クローナ 小計		997,385		135,654,176.85 (1,611,571,620)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	258	9,366.00	2,416,428.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	159	8,785.00	1,396,815.00	
	CARLSBERG AS-B	4,264	795.00	3,389,880.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,971	655.60	2,603,387.60	
	COLOPLAST-B	4,743	638.00	3,026,034.00	
	DANSKE BANK A/S	28,415	126.40	3,591,656.00	
	DSV A/S	7,716	540.00	4,166,640.00	
	GENMAB A/S	2,453	1,008.00	2,472,624.00	
	H LUNDBECK A/S	2,761	292.90	808,696.90	
	ISS A/S	6,657	203.50	1,354,699.50	
	NOVO-NORDISK A/S	72,545	327.10	23,729,469.50	
	NOVOZYMES A/S	8,723	303.80	2,650,047.40	
	ORSTED A/S	7,575	478.50	3,624,637.50	
	PANDORA A/S	4,382	329.50	1,443,869.00	
	TRYGVESTA AS	4,804	175.40	842,621.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,804	548.00	4,276,592.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	4,016	201.40	808,822.40		
デンマーク・クローネ 小計		171,246		62,602,920.40 (1,052,981,121)	
ニュージーラン ド・ドル	A2 MILK CO LTD	29,241	14.22	415,807.02	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,831	7.34	321,719.54	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	22,902	13.38	306,428.76	
	FLETCHER BUILDING LTD	33,680	4.98	167,726.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	51,545	3.58	184,531.10	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	16,094	11.30	181,862.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	78,281	3.89	304,904.49	
ニュージーランド・ドル 小計		275,574		1,882,979.51 (143,125,272)	
ノルウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	4,320	293.60	1,268,352.00	
	DNB ASA	38,534	161.55	6,225,167.70	
	EQUINOR ASA	46,746	196.75	9,197,275.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,059	151.50	1,220,938.50	
	MOWI ASA	16,653	195.40	3,253,996.20	
	NORSK HYDRO ASA	52,815	34.85	1,840,602.75	
	ORKLA ASA	32,672	67.76	2,213,854.72	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,074	297.00	1,209,978.00	

	TELENOR ASA	30,202	164.70	4,974,269.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,102	353.80	2,512,687.60	
	ノルウェー・クローネ 小計	241,177		33,917,122.37 (436,852,536)	
ユーロ	1 AND 1 DRILLISCH AG	2,212	34.80	76,977.60	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	16,786	20.73	347,973.78	
	ACCOR	7,588	40.06	303,975.28	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,009	37.24	372,735.16	
	ADIDAS AG	7,525	202.10	1,520,802.50	
	ADP	1,328	171.60	227,884.80	
	AEGON NV	69,908	4.66	326,330.54	
	AENA SME SA	2,885	154.00	444,290.00	
	AGEAS	7,232	43.00	310,976.00	
	AIB GROUP PLC	32,788	3.89	127,545.32	
	AIR LIQUIDE	17,158	108.20	1,856,495.60	
	AIRBUS SE	23,290	111.12	2,587,984.80	
	AKZO NOBEL NV	8,998	79.76	717,680.48	
	ALLIANZ SE	17,135	192.00	3,289,920.00	
	ALSTOM RGPT	6,275	38.08	238,952.00	
	AMADEUS IT GROUP SA	17,538	68.94	1,209,069.72	
	AMUNDI SA	2,393	55.54	132,907.22	
	ANDRITZ AG	2,924	44.78	130,936.72	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	30,440	68.81	2,094,576.40	
	ARCELORMITTAL	26,202	20.29	531,769.59	
	ARKEMA	2,763	85.56	236,402.28	
	AROUNDTOWN SA	30,604	7.47	228,611.88	
	ASML HOLDING NV	16,374	161.84	2,649,968.16	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	46,699	15.22	710,992.27	
	ATLANTIA SPA	20,271	21.07	427,109.97	
	ATOS SE	3,809	82.86	315,613.74	
	AXA	77,177	21.16	1,633,065.32	
	AXEL SPRINGER SE	2,089	52.45	109,568.05	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	265,049	5.23	1,388,061.61	
	BANCO DE SABADELL SA	221,822	0.95	211,396.36	
	BANCO SANTANDER SA	648,469	4.14	2,684,661.66	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	39,206	5.48	215,044.91	
	BANKIA SA	48,623	2.59	125,933.57	
	BANKINTER SA	26,823	6.94	186,258.91	
	BASF SE	36,585	66.32	2,426,317.20	
	BAYER AG	37,200	68.36	2,542,992.00	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,236	72.51	959,742.36	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,162	63.55	137,395.10	
	BEIERSDORF AG	3,987	91.54	364,969.98	
	BIOMERIEUX	1,684	69.80	117,543.20	
	BNP PARIBAS	44,779	42.56	1,906,018.13	
	BOLLORE	39,525	3.65	144,266.25	
	BOUYGUES	8,727	31.57	275,511.39	
	BRENNTAG AG	6,145	44.04	270,625.80	
	BUREAU VERITAS SA	10,863	19.50	211,828.50	
	CAIXABANK	142,420	3.03	432,102.28	
	CAPGEMINI SA	6,416	103.30	662,772.80	
	CARREFOUR SA	23,659	17.90	423,496.10	

CASINO GUICHARD PERRACHON	2,175	43.81	95,286.75	
CIE DE SAINT-GOBAIN	19,770	33.17	655,770.90	
CNH INDUSTRIAL NV	40,635	9.32	378,718.20	
CNP ASSURANCES	7,107	20.38	144,840.66	
COLRUYT NV	2,382	62.24	148,255.68	
COMMERZBANK AG	39,728	6.67	265,144.67	
CONTINENTAL AG	4,378	144.80	633,934.40	
COVESTRO AG	7,584	51.02	386,935.68	
CREDIT AGRICOLE SA	45,699	10.59	483,952.41	
CRH PLC	33,346	27.65	922,016.90	
DAIMLER AG	36,283	51.76	1,878,008.08	
DANONE	24,676	66.88	1,650,330.88	
DASSAULT AVIATION SA	101	1,333.00	134,633.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	5,253	128.60	675,535.80	
DAVIDE CAMPARI -MILANO SPA	23,376	8.28	193,553.28	
DELIVERY HERO SE	3,704	35.40	131,121.60	
DEUTSCHE BANK AG	78,189	7.68	601,195.22	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,705	111.05	855,640.25	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	9,496	23.03	218,692.88	
DEUTSCHE POST AG	40,108	26.71	1,071,284.68	
DEUTSCHE TELEKOM AG	134,776	14.58	1,965,034.08	
DEUTSCHE WOHNEN SE	14,276	42.16	601,876.16	
E.ON SE	88,097	9.67	851,897.99	
EDENRED	9,650	37.72	363,998.00	
EDF	24,229	13.44	325,637.76	
EIFFAGE	3,236	83.66	270,723.76	
ELISA OYJ	6,006	36.36	218,378.16	
ENAGAS SA	9,119	24.60	224,327.40	
ENDESA SA	12,676	21.87	277,224.12	
ENEL SPA	325,639	5.23	1,703,743.24	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	102,302	3.27	334,834.44	
ENGIE	73,216	14.11	1,033,077.76	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	101,579	15.25	1,549,282.90	
ERSTE GROUP BANK AG	12,071	32.60	393,514.60	
ESSILORLUXOTTICA	8,364	107.30	897,457.20	
EURAZEO	1,909	65.15	124,371.35	
EUROFINS SCIENTIFIC	465	359.00	166,935.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,259	18.86	136,941.03	
EVONIK INDUSTRIES AG	6,388	25.05	160,019.40	
EXOR NV	4,320	56.94	245,980.80	
FAURECIA	3,012	42.06	126,684.72	
FERRARI NV	4,930	110.90	546,737.00	
FERROVIAL S.A.	19,809	20.10	398,160.90	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	43,247	13.26	573,541.71	
FORTUM OYJ	17,777	19.62	348,873.62	
FRAPORT AG	1,912	71.48	136,669.76	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	8,623	70.54	608,266.42	
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,660	49.00	816,340.00	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	2,739	40.86	111,915.54	
GALP ENERGIA SGPS SA	19,748	14.63	289,011.98	
GEA GROUP AG	6,394	20.89	133,570.66	
GETLINK SE - REGR	20,996	12.60	264,549.60	

GRIFOLS SA	11,954	23.83	284,863.82
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,199	83.60	267,436.40
HANNOVER RUECK SE	2,371	130.40	309,178.40
HEIDELBERGCEMENT AG	5,887	65.06	383,008.22
HEINEKEN HOLDING NV	4,648	84.70	393,685.60
HEINEKEN NV	10,365	87.92	911,290.80
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	82.50	338,332.50
HENKEL KGAA-VORZUG	7,092	88.52	627,783.84
HERMES INTERNATIONAL	1,276	549.00	700,524.00
HOCHTIEF AG	848	135.20	114,649.60
HUGO BOSS AG	2,528	63.68	160,983.04
IBERDROLA SA	243,059	7.32	1,779,677.99
ILIAD SA	1,093	93.08	101,736.44
IMERYS SA	1,424	50.15	71,413.60
INDITEX SA	43,515	25.48	1,108,762.20
INFINEON TECHNOLOGIES AG	45,275	19.69	891,691.12
ING GROEP NV-CVA	154,784	11.09	1,717,483.26
INGENICO GROUP	2,414	56.98	137,549.72
INNOGY SE	5,654	40.57	229,382.78
INTESA SANPAOLO	593,822	2.05	1,220,898.03
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	24,538	7.46	183,200.70
IPSEN	1,517	124.15	188,335.55
JC DECAUX SA	3,258	27.72	90,311.76
JERONIMO MARTINS	9,658	12.64	122,125.41
KBC GROEP NV	9,923	62.74	622,569.02
KERING	3,031	474.50	1,438,209.50
KERRY GROUP PLC-A	6,413	89.85	576,208.05
KINGSPAN GROUP PLC	6,232	39.96	249,030.72
KION GROUP AG	2,811	54.24	152,468.64
KONE OYJ	13,494	44.75	603,856.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	49,709	22.91	1,139,081.73
KONINKLIJKE DSM NV	7,233	91.40	661,096.20
KONINKLIJKE PHILIPS NV	37,951	34.76	1,319,176.76
L'OREAL SA	10,062	224.40	2,257,912.80
LANXESS	3,452	49.02	169,217.04
LEGRAND SA	10,751	58.12	624,848.12
LEONARDO SPA	16,101	8.91	143,588.71
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,108	296.60	3,294,632.80
MAPFRE SA	41,020	2.47	101,524.50
MEDIOBANCA SPA	24,841	8.31	206,627.43
MERCK KGAA	5,153	97.08	500,253.24
METRO AG	7,081	14.83	105,011.23
METSO OYJ	4,178	29.45	123,042.10
MICHELIN (C.G.D.E.)	6,793	103.00	699,679.00
MONCLER SPA	7,181	34.71	249,252.51
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	2,075	191.20	396,740.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	5,947	206.20	1,226,271.40
NATIXIS	38,017	4.45	169,517.80
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,124	23.80	336,151.20
NESTE OYJ	5,118	86.18	441,069.24
NN GROUP NV	12,015	37.98	456,329.70

NOKIA OYJ	225,172	5.34	1,203,769.51
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,663	30.87	143,946.81
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	2,773	44.14	122,400.22
OMV AG	5,829	46.40	270,465.60
ORANGE S.A.	81,549	13.64	1,112,736.10
ORION OYJ-CLASS B	4,125	29.62	122,182.50
OSRAM LICHT AG	3,926	39.18	153,820.68
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,291	71.05	233,825.55
PERNOD-RICARD	8,514	151.00	1,285,614.00
PEUGEOT SA	23,465	22.18	520,453.70
PIRELLI & C SPA	16,274	6.11	99,531.78
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	6,016	57.22	344,235.52
POSTE ITALIANE SPA	20,562	7.72	158,903.13
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	9,531	15.82	150,780.42
PROXIMUS	6,533	22.71	148,364.43
PRYSMIAN SPA	9,578	18.88	180,832.64
PUBLICIS GROUPE	8,622	48.98	422,305.56
PUMA AG	333	459.00	152,847.00
QIAGEN NV	9,066	34.04	308,606.64
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	5,801	23.10	134,003.10
RANDSTAD NV	4,638	46.58	216,038.04
RECORDATI SPA	4,196	33.53	140,691.88
RED ELECTRICA DE ESPANA	17,492	18.84	329,636.74
REMY COINTREAU	920	112.20	103,224.00
RENAULT SA	7,603	59.97	455,951.91
REPSOL SA	53,694	15.20	816,417.27
REXEL SA	12,125	11.31	137,133.75
ROYAL KPN NV	140,897	2.73	384,648.81
RTL GROUP	1,663	48.90	81,320.70
RWE AG	20,744	22.37	464,043.28
SAFRAN SA	13,350	117.50	1,568,625.00
SAMPO OYJ	17,570	42.80	751,996.00
SANOFI	44,998	74.20	3,338,851.60
SAP SE	39,227	94.45	3,704,990.15
SARTORIUS AG-VORZUG	1,429	147.00	210,063.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,127	104.00	117,208.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,957	69.40	1,523,815.80
SCOR REGROUPE	6,559	38.60	253,177.40
SEB SA	921	140.00	128,940.00
SIEMENS AG	30,523	94.60	2,887,475.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	9,467	13.60	128,751.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,004	36.28	217,855.14
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,090	26.32	239,248.80
SNAM SPA	90,674	4.17	378,110.58
SOCIETE BIC SA	1,019	82.35	83,914.65
SOCIETE GENERALE	30,489	25.32	771,981.48
SODEXO	3,616	95.88	346,702.08
SOLVAY SA	2,944	100.85	296,902.40
STMICROELECTRONICS NV	27,191	14.67	399,027.92



STORA ENSO OYJ	21,743	11.96	260,046.28	
SUEZ	15,349	11.51	176,743.73	
SYMRISE AG	4,957	77.84	385,852.88	
TELECOM ITALIA SPA	656,372	0.53	352,471.76	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,301	2.98	96,515.38	
TELEFONICA SA	189,081	7.68	1,452,142.08	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,269	39.70	90,079.30	
TELEPERFORMANCE	2,321	153.10	355,345.10	
TENARIS SA	18,757	12.00	225,084.00	
TERNA SPA	58,137	5.32	309,521.38	
THALES SA	4,276	107.25	458,601.00	
THYSSENKRUPP AG	17,515	13.28	232,599.20	
TOTAL SA	95,755	49.63	4,752,320.65	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,222	67.24	216,647.28	
UCB SA	5,054	79.18	400,175.72	
UMICORE	8,393	36.96	310,205.28	
UNICREDIT SPA	79,994	11.43	914,331.42	
UNILEVER NV	61,651	49.14	3,029,838.39	
UNIPER SE	8,028	25.97	208,487.16	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,076	32.36	164,259.36	
UPM-KYMMENE OYJ	21,088	26.91	567,478.08	
VALEO SA	9,553	28.16	269,012.48	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,743	19.42	422,249.06	
VINCI SA	20,307	81.04	1,645,679.28	
VIVENDI SA	42,175	23.95	1,010,091.25	
VOESTALPINE AG	4,474	26.33	117,800.42	
VOLKSWAGEN AG	7,424	146.68	1,088,952.32	
VOLKSWAGEN AG	1,254	151.00	189,354.00	
VONOVIA SE	19,656	43.93	863,488.08	
VOPAK	2,808	43.30	121,586.40	
WARTSILA OYJ	17,598	14.68	258,338.64	
WENDEL	1,171	104.00	121,784.00	
WIRECARD AG	4,687	114.25	535,489.75	
WOLTERS KLUWER NV	11,610	56.38	654,571.80	
ZALANDO SE	4,442	26.89	119,445.38	
ユーロ 小計	7,784,984		147,293,109.55 (18,483,812,317)	
香港・ドル				
AIA GROUP LTD	483,275	75.75	36,608,081.25	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	85.10	1,046,730.00	
BANK OF EAST ASIA	51,600	28.20	1,455,120.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,539	32.80	4,872,079.20	
CK ASSET HOLDINGS LTD	103,409	66.10	6,835,334.90	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	108,909	82.20	8,952,319.80	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	27,500	64.25	1,766,875.00	
CLP HOLDINGS LTD	67,143	95.65	6,422,227.95	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	94,810	54.70	5,186,107.00	
HANG LUNG GROUP LTD	37,000	24.10	891,700.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	84,157	18.94	1,593,933.58	
HANG SENG BANK LTD	30,812	188.40	5,804,980.80	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	53,038	44.85	2,378,754.30	

HONG KONG & CHINA GAS	376,680	17.86	6,727,504.80	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	47,511	260.00	12,352,860.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	27,000	42.10	1,136,700.00	
KERRY PROPERTIES LTD	26,500	33.35	883,775.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	38,400	15.60	599,040.00	
MINTH GROUP LTD	28,000	30.70	859,600.00	
MTR CORP	67,255	44.60	2,999,573.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	248,669	12.98	3,227,723.62	
NWS HOLDINGS LTD	64,000	19.74	1,263,360.00	
PCCW LTD	205,000	4.76	975,800.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	56,587	53.20	3,010,428.40	
SANDS CHINA LTD	97,380	37.55	3,656,619.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	56,000	10.50	588,000.00	
SINO LAND CO	132,000	14.82	1,956,240.00	
SJM HOLDINGS LTD	81,000	8.40	680,400.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	64,523	134.40	8,671,891.20	
SWIRE PACIFIC LTD	20,866	92.35	1,926,975.10	
SWIRE PROPERTIES LTD	48,000	31.55	1,514,400.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	55,000	47.55	2,615,250.00	
WH GROUP LTD	355,000	7.48	2,655,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	48,733	25.00	1,218,325.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,733	55.90	2,724,174.70	
WHEELLOCK & CO LTD	34,000	53.15	1,807,100.00	
WYNN MACAU LTD	62,503	19.42	1,213,808.26	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	30,000	26.35	790,500.00	
香港・ドル 小計	3,621,832		149,869,691.86 (2,113,162,655)	
合計	44,583,555		156,190,082,429 (156,190,082,429)	

## 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	20,222.00	357,322.74	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,224.00	570,113.28	
		AMERICAN TOWER REIT INC	17,631.00	3,115,221.39	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	50,977.00	515,377.47	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,527.00	1,072,790.70	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,183.00	827,718.21	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	6,422.00	127,669.36	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,709.00	357,918.50	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	16,592.00	1,984,071.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,230.00	975,172.70	
		DUKE REALTY CORP	14,260.00	426,659.20	
		EQUINIX INC	3,178.00	1,371,402.34	
		EQUITY RESIDENTIAL	14,731.00	1,070,649.08	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,644.00	731,832.76	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,078.00	487,488.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,951.00	394,342.13	
	HCP INC	18,807.00	579,819.81	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	29,500.00	580,560.00	
	INVITATION HOMES INC	12,593.00	292,535.39	
	IRON MOUNTAIN INC	10,884.00	388,776.48	
	KIMCO REALTY CORP	16,793.00	294,885.08	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	5,924.00	281,686.20	
	MACERICH CO/THE	4,235.00	184,307.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,544.00	468,986.24	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,283.00	323,825.82	
	PROLOGIS INC	25,127.00	1,766,930.64	
	PUBLIC STORAGE	6,266.00	1,288,414.92	
	REALTY INCOME CORP	11,600.00	798,196.00	
	REGENCY CENTERS CORP	6,087.00	400,707.21	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	4,615.00	844,498.85	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,388.00	2,220,177.36	
	SL GREEN REALTY CORP	3,458.00	314,228.46	
	UDR INC	10,767.00	477,301.11	
	VENTAS INC	14,248.00	902,325.84	
	VEREIT	38,603.00	315,000.48	
	VORNADO REALTY TRUST	6,887.00	468,178.26	
	WELLTOWER INC	14,866.00	1,126,099.50	
	WP CAREY INC	6,457.00	478,980.26	
アメリカ・ドル 小計		453,491.00	29,182,170.33 (3,230,466,255)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	36,875.00	211,588.75	
	HAMMERSON PLC	31,332.00	114,549.79	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	29,376.00	255,336.19	
	SEGRO PLC	40,556.00	258,179.49	
イギリス・ポンド 小計		138,139.00	839,654.22 (121,220,880)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	45,328.00	546,655.68	
	GOODMAN GROUP	70,006.00	895,376.74	
	GPT GROUP	81,493.00	478,363.91	
	MIRVAC GROUP	166,811.00	433,708.60	
	SCENTRE GROUP	226,685.00	877,270.95	
	STOCKLAND	107,428.00	395,335.04	
	VICINITY CENTRES	148,028.00	364,148.88	
オーストラリア・ドル 小計		845,779.00	3,990,859.80 (317,832,075)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	5,834.00	132,781.84	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,344.00	159,741.92	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,913.00	98,925.48	
カナダ・ドル 小計		15,091.00	391,449.24 (32,901,308)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	105,100.00	291,127.00	

	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	105,000.00	198,450.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	98,900.00	241,316.00	
	SUNTEC REIT	86,400.00	165,888.00	
シンガポール・ドル	小計	395,400.00	896,781.00 (73,464,299)	
ユーロ	COVIVIO	1,570.00	137,846.00	
	GECINA SA	1,836.00	229,316.40	
	ICADE	1,401.00	102,973.50	
	KLEPIERRE	8,091.00	243,539.10	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,503.00	791,441.46	
ユーロ	小計	18,401.00	1,505,116.46 (188,877,065)	
香港・ドル	LINK REIT	85,371.00	7,687,658.55	
香港・ドル	小計	85,371.00	7,687,658.55 (108,395,986)	
投資証券	合計		4,073,157,868 (4,073,157,868)	
合計			4,073,157,868 (4,073,157,868)	

(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 594銘柄 投資証券 38銘柄	64.50% -%	-% 1.96%	68.20%
イギリス・ポンド	株式 92銘柄 投資証券 4銘柄	6.18% -%	-% 0.07%	6.42%
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 58銘柄 投資証券 7銘柄	2.36% -%	-% 0.19%	2.62%
カナダ・ドル	株式 87銘柄 投資証券 3銘柄	3.70% -%	-% 0.02%	3.82%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 4銘柄	0.45% -%	-% 0.04%	0.51%
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.18%	-%	3.27%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	0.98%	-%	1.01%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64%	-%	0.66%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.09%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.27%	-%	0.27%
ユーロ	株式 235銘柄 投資証券 5銘柄	11.24% -%	-% 0.11%	11.65%
香港・ドル	株式 38銘柄 投資証券 1銘柄	1.29% -%	-% 0.07%	1.39%

(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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	29,864,159	42,879,632
金銭信託	1,839,635	3,632,937
コール・ローン	68,761,857	74,158,657
国債証券	14,591,334,799	18,552,550,153
派生商品評価勘定	59	27,062
未収利息	101,509,998	126,320,979
前払費用	14,079,326	9,531,810
流動資産合計	14,807,389,833	18,809,101,230
資産合計	14,807,389,833	18,809,101,230
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	138,280	-
未払金	28,320,985	60,842,044
未払解約金	31,467,602	27,415,629
その他未払費用	340	87
流動負債合計	59,927,207	88,257,760
負債合計	59,927,207	88,257,760
純資産の部		
元本等		
元本	11,229,834,925	14,029,005,797
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,517,627,701	4,691,837,673
純資産合計	14,747,462,626	18,720,843,470
負債純資産合計	14,807,389,833	18,809,101,230

## 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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
1. 受益権総口数	11,229,834,925口	14,029,005,797口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3132円 (13,132円)	1.3344円 (13,344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 2017年7月14日 至 2018年2月21日）	（自 2018年2月22日 至 2019年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2018年2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	313,104,263	400,241,003
合計	313,104,263	400,241,003

## (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2月21日 現在)			(2019年2月21日 現在)				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	59,270,345	-	59,132,124	138,221	63,756,714	-	63,783,776	27,062
アメリカ ドル	45,005,524	-	44,867,341	138,183	46,857,170	-	46,882,796	25,626
イギリ ス・ボン ド	1,471,622	-	1,471,681	59	2,961,702	-	2,961,805	103
ユーロ	12,793,199	-	12,793,102	97	13,937,842	-	13,939,175	1,333
合計	59,270,345	-	59,132,124	138,221	63,756,714	-	63,783,776	27,062

## (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2月21日現在)	(2019年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	9,112,345,322円	11,229,834,925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	4,476,739,533円	5,563,822,764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	2,359,249,930円	2,764,651,892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)	1,210,082,327円	1,511,175,019円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,277,494,458円	2,682,173,293円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	807,934,874円	913,366,571円
ニッセイ外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	786,831円	-円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	6,209,806,473円	7,539,991,502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)	386,305,633円	594,022,813円
DCニッセイ外国債券インデックス	316,272,279円	631,268,627円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	1,283,694円	8,572,161円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	5,103,614円	86,130,485円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	95,027円	5,218,659円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	145,249円	8,555,537円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	261,567円	3,599,749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)	9,923,633円	27,811,628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)	2,037,267円	2,202,592円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	2,301,999円	14,590,750円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	-円	92,162円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	-円	88,320円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	-円	84,480円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	-円	61,449円
計	11,229,834,925円	14,029,005,797円

## 附属明細表(2019年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	80,000.00	97,634.40	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	60,000.00	73,490.40	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	120,000.00	152,690.40	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	70,000.00	86,599.80	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	80,000.00	97,459.20	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	90,000.00	114,370.20	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	60,000.00	76,375.80	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	1,430,000.00	1,414,684.70	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/02/29	1,010,000.00	998,001.20	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/03/31	1,020,000.00	1,006,923.60	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/08/31	1,180,000.00	1,159,479.80	
		US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	1,270,000.00	1,242,415.60	
		US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	830,000.00	792,259.90	
		US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	970,000.00	923,469.10	
		US TREASURY N/B 1.5 2020/05/31	1,170,000.00	1,154,778.30	
		US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	850,000.00	817,589.50	
		US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	600,000.00	555,864.00	
		US TREASURY N/B 1.625 2020/06/30	1,000,000.00	987,770.00	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,290,000.00	1,253,467.20	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,320,000.00	1,279,872.00	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	610,000.00	573,326.80	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	610,000.00	571,942.10	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	880,000.00	861,124.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,330,000.00	1,300,114.90	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	810,000.00	789,750.00			
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	1,550,000.00	1,504,399.00			

US TREASURY N/B 1.875 2020/12/15	1,200,000.00	1,186,212.00	
US TREASURY N/B 2 2020/09/30	1,130,000.00	1,120,508.00	
US TREASURY N/B 2 2021/02/28	900,000.00	890,856.00	
US TREASURY N/B 2 2021/05/31	940,000.00	929,829.20	
US TREASURY N/B 2 2021/08/31	940,000.00	928,870.40	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	1,420,000.00	1,402,349.40	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,220,000.00	1,203,505.60	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,460,000.00	1,433,413.40	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	410,000.00	399,700.80	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	1,090,000.00	1,057,594.30	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	1,110,000.00	1,073,403.30	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	590,000.00	565,568.10	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	870,000.00	862,822.50	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	1,280,000.00	1,268,889.60	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	940,000.00	931,511.80	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	1,040,000.00	1,030,005.60	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	790,000.00	781,112.50	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	800,000.00	789,528.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	490,000.00	481,385.80	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	420,000.00	411,432.00	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	1,180,000.00	1,151,278.80	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	860,000.00	855,459.20	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	850,000.00	840,964.50	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	1,040,000.00	1,024,805.60	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	400,000.00	394,012.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	1,080,000.00	1,059,318.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	610,000.00	594,554.80	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	600,000.00	583,146.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	620,000.00	601,617.00	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	380,000.00	326,754.40	

US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	1,160,000.00	1,156,821.60	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	1,010,000.00	1,002,930.00	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	610,000.00	599,703.20	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	1,480,000.00	1,480,976.80	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	1,010,000.00	1,010,070.70	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	410,000.00	373,448.50	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	380,000.00	345,131.20	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	370,000.00	335,775.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	1,440,000.00	1,441,627.20	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	1,720,000.00	1,722,339.20	
US TREASURY N/B 2.625 2021/12/15	940,000.00	943,854.00	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	360,000.00	361,771.20	
US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	470,000.00	472,072.70	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	1,630,000.00	1,649,038.40	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	800,000.00	809,744.00	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	380,000.00	384,525.80	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	620,000.00	625,567.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	220,000.00	211,732.40	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	290,000.00	278,762.50	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	360,000.00	342,644.40	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	380,000.00	361,475.00	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	670,000.00	682,508.90	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	690,000.00	702,771.90	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	390,000.00	382,761.60	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	400,000.00	391,560.00	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	370,000.00	361,889.60	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	440,000.00	451,858.00	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	160,000.00	160,918.40	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	400,000.00	401,076.00	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	390,000.00	391,080.30	

US TREASURY N/B 3 2045/11/15	410,000.00	411,135.70	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	380,000.00	380,934.80	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	370,000.00	370,462.50	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	400,000.00	399,796.00	
US TREASURY N/B 3 2048/08/15	480,000.00	479,846.40	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	1,140,000.00	1,155,310.20	
US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	710,000.00	738,400.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	150,000.00	154,288.50	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	170,000.00	174,780.40	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	280,000.00	287,064.40	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	400,000.00	409,984.00	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	440,000.00	450,586.40	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	400,000.00	427,560.00	
US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	480,000.00	516,000.00	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	1,370,000.00	1,385,508.40	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	110,000.00	120,862.50	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	330,000.00	367,045.80	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	410,000.00	456,301.30	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	400,000.00	453,856.00	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	160,000.00	184,561.60	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	120,000.00	145,532.40	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	160,000.00	194,249.60	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	80,000.00	98,480.80	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	130,000.00	160,249.70	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	140,000.00	173,112.80	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	70,000.00	87,554.60	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	110,000.00	137,766.20	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	220,000.00	280,145.80	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	190,000.00	246,369.20	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	60,000.00	79,077.60	

	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	80,000.00	107,459.20	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	150,000.00	169,921.50	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	180,000.00	222,017.40	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	140,000.00	173,041.40	
アメリカ・ドル 小計		77,720,000.00	77,501,959.70 (8,579,466,939)	
イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2020 3.75 2020/09/07	180,000.00	188,278.20	
	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	140,000.00	150,605.00	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	180,000.00	254,716.20	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	180,000.00	279,549.00	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	200,000.00	280,298.00	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	170,000.00	265,370.00	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	130,000.00	164,495.50	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	160,000.00	215,120.00	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	160,000.00	232,774.40	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	160,000.00	235,752.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	180,000.00	310,284.00	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	180,000.00	187,437.60	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	130,000.00	178,968.40	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	130,000.00	142,680.20	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	140,000.00	240,416.40	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	150,000.00	229,813.50	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	150,000.00	186,090.00	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	120,000.00	139,862.40	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	100,000.00	144,750.00	
	UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	250,000.00	253,600.00	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	180,000.00	186,651.00	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	210,000.00	200,445.00	
	UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	230,000.00	233,132.60	
	UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	200,000.00	208,138.00	
UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	110,000.00	111,617.00		
UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	130,000.00	130,733.20		

	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	240,000.00	248,104.80	
	UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	40,000.00	40,448.00	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	150,000.00	155,583.00	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	160,000.00	170,140.80	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	120,000.00	132,133.20	
	UK TSY 2% 2020 2 2020/07/22	250,000.00	254,460.00	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	160,000.00	171,022.40	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	170,000.00	279,694.20	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	220,000.00	288,624.60	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	160,000.00	246,307.20	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	220,000.00	302,130.40	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	140,000.00	226,100.00	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	240,000.00	237,856.80	
	UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	270,000.00	269,019.90	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	180,000.00	183,420.00	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	180,000.00	232,975.80	
	イギリス・ポンド 小計	7,150,000.00	8,789,598.70 (1,268,954,364)	
オーストラリア・ ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2020/11/21	230,000.00	230,057.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	180,000.00	181,720.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	170,000.00	173,717.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	280,000.00	283,788.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	120,000.00	124,426.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	250,000.00	262,567.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	260,000.00	274,427.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	240,000.00	253,658.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	180,000.00	190,891.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	80,000.00	84,160.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	40,000.00	41,130.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	120,000.00	128,398.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	270,000.00	292,245.30	



	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	250,000.00	276,147.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	70,000.00	78,240.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	110,000.00	131,139.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	310,000.00	358,090.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2020/04/15	220,000.00	226,758.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	130,000.00	165,456.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	280,000.00	337,808.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	230,000.00	265,466.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	280,000.00	304,600.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	230,000.00	261,077.60	
	オーストラリア・ドル 小計	4,530,000.00	4,925,976.40 (392,304,760)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	40,000.00	47,362.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	160,000.00	153,972.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2020/09/01	250,000.00	246,190.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	230,000.00	225,347.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	190,000.00	185,193.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	140,000.00	136,196.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	150,000.00	139,902.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2020/02/01	110,000.00	109,445.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2020/03/01	210,000.00	209,382.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	140,000.00	138,272.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	120,000.00	117,052.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2020/05/01	110,000.00	109,957.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2020/08/01	120,000.00	119,962.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	140,000.00	139,722.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2020/11/01	130,000.00	130,491.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	120,000.00	121,041.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	130,000.00	131,092.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	50,000.00	48,245.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2021/02/01	110,000.00	110,990.00	

	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	80,000.00	81,704.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	130,000.00	133,133.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	90,000.00	92,758.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	130,000.00	134,481.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	130,000.00	133,954.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	140,000.00	158,340.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	120,000.00	123,916.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2020/06/01	120,000.00	122,583.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	160,000.00	203,120.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	140,000.00	185,269.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	120,000.00	172,244.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	100,000.00	135,374.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	130,000.00	189,865.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	40,000.00	58,584.00	
	カナダ・ドル 小計	4,280,000.00	4,545,147.20 (382,019,622)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 2 2020/07/01	20,000.00	20,020.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	30,000.00	30,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	100,000.00	100,730.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	30,000.00	29,372.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	30,000.00	30,630.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	40,000.00	41,703.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	110,000.00	113,619.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	40,000.00	41,820.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	50,000.00	51,969.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	30,000.00	32,040.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	40,000.00	42,660.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	50,000.00	52,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	80,000.00	83,216.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25 2020/09/01	100,000.00	101,974.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	50,000.00	56,258.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	70,000.00	77,315.00	
シンガポール・ドル	小計	870,000.00	906,116.70 (74,229,080)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	380,000.00	395,314.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	270,000.00	277,711.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	620,000.00	659,673.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	760,000.00	820,199.60	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	600,000.00	693,360.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,050,000.00	1,181,071.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	430,000.00	627,026.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	880,000.00	965,580.00	
スウェーデン・クローナ	小計	4,990,000.00	5,619,936.10 (66,764,841)	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2020/11/15	480,000.00	487,171.20	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	830,000.00	865,316.50	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	540,000.00	588,259.80	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	660,000.00	747,067.20	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	770,000.00	845,044.20	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,260,000.00	2,243,694.60	
デンマーク・クローネ	小計	4,540,000.00	5,776,553.50 (97,161,630)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	320,000.00	320,464.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	390,000.00	397,768.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	340,000.00	344,804.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	650,000.00	669,688.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	330,000.00	340,824.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	420,000.00	454,318.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	790,000.00	835,962.20	
ノルウェー・クローネ	小計	3,240,000.00	3,363,829.90 (43,326,129)	
ポーランド・ズロ チ	POLAND GOVERNMENT BOND 1.5 2020/04/25	280,000.00	280,635.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	130,000.00	131,950.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	350,000.00	350,252.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	300,000.00	298,848.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	290,000.00	291,644.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	330,000.00	348,219.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	550,000.00	598,757.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2020/10/25	290,000.00	308,287.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	640,000.00	709,529.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	533,102.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	70,000.00	89,408.90	
ポーランド・ズロチ	小計	3,700,000.00	3,940,634.80 (114,239,003)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	280,000.00	277,600.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	280,000.00	277,356.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	140,000.00	137,620.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	200,000.00	190,164.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.889 2020/07/31	300,000.00	301,692.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	250,000.00	248,185.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	120,000.00	119,520.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	200,000.00	200,500.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	30,000.00	29,619.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	310,000.00	314,119.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	210,000.00	213,771.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	120,000.00	120,272.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	70,000.00	68,617.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	120,000.00	123,188.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	110,000.00	113,586.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	100,000.00	99,700.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	110,000.00	113,850.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	40,000.00	42,063.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	103,294.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	65,652.00	
マレーシア・リンギット	小計	3,150,000.00	3,160,372.20 (85,993,728)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	2,490,000.00	2,704,289.40	

	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	900,000.00	1,009,341.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	1,490,000.00	1,295,659.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	3,800,000.00	3,671,902.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	2,550,000.00	2,432,700.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.25 2021/12/09	500,000.00	489,060.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	2,740,000.00	2,613,850.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,450,000.00	1,368,481.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	720,000.00	667,605.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	1,830,000.00	1,651,373.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	2,570,000.00	2,565,271.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	2,020,000.00	2,010,667.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	840,000.00	775,017.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	1,040,000.00	1,049,391.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	1,230,000.00	1,205,215.50	
	メキシコ・ペソ 小計	26,170,000.00	25,509,825.50 (146,936,595)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	90,000.00	91,553.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	70,000.00	71,992.90	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	170,000.00	177,600.70	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	130,000.00	134,279.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	140,000.00	143,529.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	60,000.00	61,519.80	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	150,000.00	158,275.50	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	120,000.00	122,389.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	40,000.00	41,442.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	50,000.00	51,532.50	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	110,000.00	110,640.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	60,000.00	66,018.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	40,000.00	43,119.60	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	130,000.00	144,222.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	50,000.00	55,928.00	

BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	150,000.00	171,370.50	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	70,000.00	89,250.00	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	180,000.00	192,288.60	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	90,000.00	134,100.90	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	130,000.00	147,854.20	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	80,000.00	111,080.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	160,000.00	179,656.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	160,000.00	186,712.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	160,000.00	247,406.40	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	100,000.00	130,448.00	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	190,000.00	299,282.30	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	180,000.00	260,778.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	180,000.00	180,815.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/10/31	70,000.00	70,259.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	160,000.00	161,099.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	210,000.00	213,122.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	170,000.00	172,794.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	200,000.00	204,446.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	190,000.00	193,940.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	230,000.00	237,288.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2020/01/31	220,000.00	223,581.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	200,000.00	204,610.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	200,000.00	203,562.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	210,000.00	216,778.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	110,000.00	111,415.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	180,000.00	187,162.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	210,000.00	223,305.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	190,000.00	205,245.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	200,000.00	210,750.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	210,000.00	230,069.70	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	150,000.00	161,347.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	80,000.00	84,808.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	230,000.00	259,444.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	170,000.00	189,133.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	100,000.00	119,693.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	200,000.00	235,102.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	220,000.00	231,248.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	200,000.00	269,282.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	200,000.00	238,530.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	220,000.00	275,858.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	200,000.00	290,484.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	170,000.00	207,328.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.85 2020/10/31	190,000.00	206,478.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	170,000.00	251,994.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	180,000.00	244,794.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	140,000.00	218,131.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	220,000.00	266,081.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	230,000.00	258,522.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	210,000.00	315,793.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	220,000.00	258,420.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	200,000.00	272,914.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	240,000.00	347,150.40	
BUNDESobligation 0 2020/04/17	190,000.00	191,278.70	
BUNDESobligation 0 2021/04/09	200,000.00	202,476.00	
BUNDESobligation 0 2021/10/08	180,000.00	182,604.60	
BUNDESobligation 0 2022/04/08	170,000.00	172,833.90	
BUNDESobligation 0 2022/10/07	170,000.00	173,102.50	
BUNDESobligation 0 2023/10/13	150,000.00	152,875.50	
BUNDESobligation 0.25 2020/10/16	170,000.00	172,320.50	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	240,000.00	242,995.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	250,000.00	257,405.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	220,000.00	224,292.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	40,000.00	40,600.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	220,000.00	230,641.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	260,000.00	273,072.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	250,000.00	262,045.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	190,000.00	198,779.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	160,000.00	171,889.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	220,000.00	238,185.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	130,000.00	148,018.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	400,000.00	428,716.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	180,000.00	194,311.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	310,000.00	335,912.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	220,000.00	241,681.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	290,000.00	321,247.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	190,000.00	203,982.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	180,000.00	199,861.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2020/09/04	260,000.00	271,330.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2021/09/04	100,000.00	107,163.00	



BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	170,000.00	179,939.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	250,000.00	357,195.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	260,000.00	377,345.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3 2020/07/04	200,000.00	209,804.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	250,000.00	272,687.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	150,000.00	236,734.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	220,000.00	354,015.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	130,000.00	223,471.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	190,000.00	315,314.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	150,000.00	277,734.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	90,000.00	150,102.90	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/03/13	130,000.00	130,795.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/06/12	120,000.00	120,906.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/12/11	110,000.00	111,142.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2021/04/15	150,000.00	147,813.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.2 2020/10/15	140,000.00	139,371.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2020/06/15	160,000.00	160,100.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	170,000.00	168,845.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2020/11/01	140,000.00	140,322.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	260,000.00	247,902.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	150,000.00	150,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	320,000.00	312,211.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	170,000.00	156,362.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	560,000.00	561,876.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	330,000.00	330,594.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	350,000.00	335,566.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	170,000.00	161,450.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	210,000.00	179,522.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	150,000.00	149,238.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	300,000.00	294,687.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	190,000.00	180,167.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	180,000.00	172,323.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	310,000.00	319,176.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	180,000.00	174,855.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	160,000.00	139,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.3 2021/10/15	150,000.00	154,842.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	150,000.00	137,629.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	340,000.00	347,633.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	160,000.00	137,342.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	150,000.00	149,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	60,000.00	48,988.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	150,000.00	139,234.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	160,000.00	151,556.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	90,000.00	90,280.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	160,000.00	154,294.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	220,000.00	230,476.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	230,000.00	244,041.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	160,000.00	170,179.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	490,000.00	522,986.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	180,000.00	195,606.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	240,000.00	252,799.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	260,000.00	281,938.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2020/03/01	240,000.00	249,751.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2020/02/01	220,000.00	228,863.80	

BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	190,000.00	211,789.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	220,000.00	246,697.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	230,000.00	261,305.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2021/09/01	40,000.00	43,723.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	250,000.00	282,332.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	240,000.00	280,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	160,000.00	188,329.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	230,000.00	266,174.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	240,000.00	288,924.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	220,000.00	265,564.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	210,000.00	252,701.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	280,000.00	338,332.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	190,000.00	216,470.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	200,000.00	228,388.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	210,000.00	268,392.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	280,000.00	361,734.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	250,000.00	323,167.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	120,000.00	158,853.60	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	110,000.00	159,047.90	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	160,000.00	260,872.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	140,000.00	210,924.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	100,000.00	155,552.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	50,000.00	50,536.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.375 2020/09/15	60,000.00	60,813.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	50,000.00	51,529.50	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	50,000.00	51,105.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	40,000.00	40,820.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	40,000.00	42,342.40	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	40,000.00	42,256.80	
FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	30,000.00	32,663.40	

FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	50,000.00	53,737.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	90,000.00	96,397.20	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	60,000.00	66,747.60	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	40,000.00	54,664.40	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	70,000.00	85,866.90	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	60,000.00	62,695.80	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	60,000.00	65,140.80	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	50,000.00	62,966.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/02/25	220,000.00	221,183.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/05/25	200,000.00	201,340.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	300,000.00	302,808.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	290,000.00	292,943.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	40,000.00	40,472.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	280,000.00	283,175.20	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	270,000.00	272,616.30	
FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	220,000.00	221,080.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	230,000.00	233,033.70	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	330,000.00	330,099.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	380,000.00	391,229.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	310,000.00	317,263.30	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	320,000.00	328,512.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	280,000.00	286,011.60	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	290,000.00	307,594.30	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	290,000.00	305,970.30	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	120,000.00	124,618.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	280,000.00	286,258.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	440,000.00	477,840.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	490,000.00	531,841.10	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	350,000.00	386,186.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	140,000.00	153,021.40	

FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	100,000.00	99,950.00	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	250,000.00	278,430.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	310,000.00	339,236.10	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	340,000.00	382,299.40	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2020/10/25	350,000.00	367,731.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	350,000.00	419,758.50	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	360,000.00	434,376.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	450,000.00	498,474.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	380,000.00	417,734.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	240,000.00	336,837.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	360,000.00	377,031.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	360,000.00	446,950.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	380,000.00	414,956.20	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	250,000.00	375,645.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	140,000.00	230,850.20	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	130,000.00	219,675.30	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	430,000.00	520,175.30	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	350,000.00	569,940.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	260,000.00	407,459.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	340,000.00	508,075.60	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	310,000.00	508,291.50	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	280,000.00	390,658.80	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	60,000.00	61,947.60	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	110,000.00	114,790.50	
IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	40,000.00	41,052.00	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	40,000.00	40,534.80	
IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	30,000.00	31,143.60	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	50,000.00	52,569.00	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	80,000.00	87,384.80	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	90,000.00	104,162.40	

IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	50,000.00	50,290.00	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	80,000.00	81,610.40	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	70,000.00	81,901.40	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	80,000.00	93,183.20	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	120,000.00	159,756.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	140,000.00	141,997.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	150,000.00	151,936.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	140,000.00	143,347.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	150,000.00	155,775.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	140,000.00	147,565.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	130,000.00	136,600.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	170,000.00	185,818.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	150,000.00	168,181.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	140,000.00	153,008.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	140,000.00	177,935.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	130,000.00	193,719.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	160,000.00	174,713.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.5 2020/07/15	150,000.00	158,587.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	140,000.00	163,067.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	150,000.00	247,128.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	150,000.00	236,611.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	120,000.00	177,494.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	60,000.00	60,760.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	100,000.00	102,258.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	110,000.00	114,995.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	80,000.00	83,006.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	100,000.00	107,997.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	50,000.00	53,575.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	20,000.00	19,766.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	100,000.00	110,111.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	180,000.00	197,044.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	40,000.00	49,247.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	70,000.00	85,823.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	70,000.00	101,634.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	100,000.00	114,234.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	150,000.00	165,444.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	80,000.00	90,259.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	40,000.00	72,024.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.9 2020/07/15	140,000.00	148,608.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	130,000.00	200,606.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	90,000.00	120,480.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	90,000.00	135,424.80	
	TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	100,000.00	105,800.00	
	TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	60,000.00	65,438.40	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	110,000.00	144,181.40	
	ユーロ 小計	50,380,000.00	57,336,079.00 (7,195,104,554)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	2,200,000.00	2,405,700.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	890,000.00	639,954.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	860,000.00	603,720.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	450,000.00	447,039.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	1,020,000.00	843,387.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	840,000.00	836,976.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	1,240,000.00	1,131,549.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	1,030,000.00	934,498.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	1,140,000.00	1,020,151.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	1,260,000.00	1,132,563.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	2,030,000.00	1,813,703.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	810,000.00	757,495.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	920,000.00	857,173.20	
	南アフリカ・ランド 小計	14,690,000.00	13,423,912.40 (106,048,908)	

国債証券 合計		18,552,550,153 (18,552,550,153)	
合計		18,552,550,153 (18,552,550,153)	

(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 120銘柄	45.83%	46.24%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	6.78%	6.84%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	2.10%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	2.04%	2.06%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.40%	0.40%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.36%	0.36%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.52%	0.52%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.23%	0.23%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.61%	0.62%
マレーシア・リンギット	国債証券 20銘柄	0.46%	0.46%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.78%	0.79%
ユーロ	国債証券 283銘柄	38.43%	38.78%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.57%	0.57%

(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（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (2019年2月21日現在)	第3期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,079,152	879,507
コール・ローン	22,028,580	121,855,587
親投資信託受益証券	436,627,664	2,337,416,161
未収入金	1,488,995	280,427
流動資産合計	461,224,391	2,460,431,682
資産合計	461,224,391	2,460,431,682
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,562,905	246,411
未払受託者報酬	34,992	115,889
未払委託者報酬	245,258	811,433
その他未払費用	17,445	51,774
流動負債合計	1,860,600	1,225,507
負債合計	1,860,600	1,225,507
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	450,806,429	2,370,800,116
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,557,362	88,406,059
純資産合計	459,363,791	2,459,206,175
負債純資産合計	461,224,391	2,460,431,682

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 (自2018年2月22日 至2018年8月21日)	第3期中間計算期間 (自2019年2月22日 至2019年8月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	28	436
有価証券売買等損益	821,091	18,567,919
営業収益合計	821,063	18,568,355
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,715	20,498
受託者報酬	9,827	115,889
委託者報酬	69,023	811,433
その他費用	5,291	53,407
営業費用合計	85,856	1,001,227
営業利益又は営業損失( )	906,919	17,567,128
経常利益又は経常損失( )	906,919	17,567,128
中間純利益又は中間純損失( )	906,919	17,567,128
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( )	30,213	265,410
期首剰余金又は期首欠損金( )	177,193	8,557,362
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,936,389	64,099,730
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	1,936,389	64,099,730
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,665	1,552,751
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,665	1,552,751
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( )	1,114,785	88,406,059

## ( 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2期 (2019年2月21日現在)	第3期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	450,806,429口	2,370,800,116口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0190円 (10,190円)	1.0373円 (10,373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2期 (2019年2月21日現在)	第3期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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2期 (2019年2月21日現在)	第3期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
期首元本額	26,895,766円	450,806,429円
期中追加設定元本額	452,842,888円	1,981,541,271円
期中一部解約元本額	28,932,225円	61,547,584円

## &lt; 参考 &gt;

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型））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、「ニッセイ国内債券バッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、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)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	47,564,462	8,578,731
コール・ローン	970,926,881	1,188,581,606
株式	57,385,765,970	59,429,929,550
派生商品評価勘定	39,356,380	2,140,560
未収配当金	91,169,006	89,307,025
差入委託証拠金	24,645,000	35,640,000
流動資産合計	58,559,427,699	60,754,177,472
資産合計	58,559,427,699	60,754,177,472
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	8,894,440
前受金	41,505,000	2,645,000
未払解約金	194,719,481	116,359,172
その他未払費用	801	1,591
流動負債合計	236,225,282	127,900,203
負債合計	236,225,282	127,900,203
純資産の部		
元本等		
元本	34,479,781,252	38,109,536,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	23,843,421,165	22,516,740,746
純資産合計	58,323,202,417	60,626,277,269
負債純資産合計	58,559,427,699	60,754,177,472

## 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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 受益権総口数	34,479,781,252口	38,109,536,523口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6915円 (16,915円)	1.5908円 (15,908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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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	(2019年2月21日 現在)				(2019年8月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買建	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000	1,080,955,000	-	1,074,240,000	6,715,000
合計	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000	1,080,955,000	-	1,074,240,000	6,715,000

(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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	28,178,885,286円	34,479,781,252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	15,224,610,246円	7,727,756,864円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	8,923,714,280円	4,098,001,593円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,998,062,126円	6,728,451,440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)	5,016,960,919円	4,763,395,907円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,238,783円	-円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,210,362円	4,182,206円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,206,781,976円	1,524,912,346円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,302,209,365円	5,323,614,771円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,930,765,501円	3,530,366,943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)	12,596,798円	9,354,616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)	44,117,130円	41,837,637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)	51,034,232円	54,043,504円
DCニッセイ国内株式インデックス	158,510,666円	308,252,587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	13,120,980,625円	14,777,186,366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)	474,668,180円	608,278,228円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	26,528,689円	67,490,497円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,748,346円	76,386,450円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	16,200,912円	49,524,601円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	26,018,748円	100,006,784円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,123,269円	30,565,675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)	22,218,183円	39,352,901円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	25,051,252円	26,339,965円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,050,565円	3,188,901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)	703,909円	918,805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)	1,345,741円	2,389,751円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	11,655,177円	16,572,509円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	286,258円	4,139,855円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	274,453円	4,276,925円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	258,941円	6,848,520円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	180,146円	7,657,833円
計	34,479,781,252円	38,109,536,523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)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,799,524	4,041,537
コール・ローン	628,706,474	559,954,173
国債証券	65,768,216,770	63,068,394,890
地方債証券	8,658,947,780	7,292,237,348
特殊債券	9,851,727,173	8,474,193,272
社債券	6,505,142,700	5,782,355,000
未収入金	-	1,959,477,990
未収利息	264,056,612	231,545,865
前払費用	4,671,465	4,409,020
流動資産合計	91,712,268,498	87,376,609,095
資産合計	91,712,268,498	87,376,609,095
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,101,294	2,002,264,321
その他未払費用	480	585
流動負債合計	3,101,774	2,002,264,906
負債合計	3,101,774	2,002,264,906
純資産の部		
元本等		
元本	93,246,832,729	84,525,370,115
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,537,666,005	848,974,074
純資産合計	91,709,166,724	85,374,344,189
負債純資産合計	91,712,268,498	87,376,609,095

## 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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 受益権総口数	93,246,832,729口	84,525,370,115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	1,537,666,005円	
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9835円 (9,835円)	1.0100円 (10,100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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	130,621,929,148円	93,246,832,729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	4,833,282,961円	3,269,534,210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	42,208,379,380円	11,990,996,824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)	91,430,070,853円	80,886,829,218円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,345,859,235円	1,662,393,882円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	10,189,726円	24,434,302円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	279,529,696円	1,460,674,526円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,489,530円	27,357,846円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25,399,457円	91,978,676円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	74,779,556円	235,751,122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)	37,376,874円	62,320,196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)	2,973,401円	3,734,778円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リー ト/債券)	10,630,035円	17,760,222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)	19,693,743円	26,930,923円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	90,231円	1,227,813円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	132,231円	1,945,023円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	180,429円	4,509,124円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	437,732円	17,522,464円
計	93,246,832,729円	84,525,370,115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)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	388,094,903	714,208,888
金銭信託	111,174,221	17,601,325
コール・ローン	2,269,384,208	2,438,660,237
株式	156,190,082,429	175,364,989,167
投資証券	4,073,157,868	5,026,635,570
派生商品評価勘定	134,259,059	36,835,315
未収入金	32,983	10,524,111
未収配当金	222,399,264	331,504,990
差入委託証拠金	1,479,571,172	1,717,946,783
流動資産合計	164,868,156,107	185,658,906,386
資産合計	164,868,156,107	185,658,906,386
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,018,478	17,097,192
未払金	-	148,636,409
未払解約金	421,904,508	334,140,069
その他未払費用	1,521	2,723
流動負債合計	422,924,507	499,876,393
負債合計	422,924,507	499,876,393
純資産の部		
元本等		
元本	94,844,967,281	107,407,368,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	69,600,264,319	77,751,661,493
純資産合計	164,445,231,600	185,159,029,993
負債純資産合計	164,868,156,107	185,658,906,386

## 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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 受益権総口数	94,844,967,281口	107,407,368,500口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7338円 (17,338円)	1.7239円 (17,239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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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	（2019年2月21日 現在）				（2019年8月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	3,116,617,043	-	3,116,496,250	120,793
アメリカ・ドル	-	-	-	-	2,333,102,833	-	2,332,616,130	486,703
イギリス・ポンド	-	-	-	-	218,969,679	-	219,320,280	350,601
ユーロ	-	-	-	-	564,544,531	-	564,559,840	15,309
買 建	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343	4,970,887,355	-	4,972,430,250	1,542,895
アメリカ・ドル	1,181,436,898	-	1,183,137,060	1,700,162	3,513,001,551	-	3,515,424,300	2,422,749
イギリス・ポンド	151,340,332	-	153,482,000	2,141,668	422,220,565	-	425,716,560	3,495,995
ユーロ	397,018,667	-	399,309,180	2,290,513	1,035,665,239	-	1,031,289,390	4,375,849
合計	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343	8,087,504,398	-	8,088,926,500	1,663,688

## （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	（2019年2月21日 現在）				（2019年8月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236	4,282,642,701	-	4,300,717,136	18,074,435
合計	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236	4,282,642,701	-	4,300,717,136	18,074,435

## （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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	70,849,080,074円	94,844,967,281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	37,550,145,965円	22,562,322,281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	13,554,258,758円	9,999,921,062円
元本の内訳		
ファンド名		
D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	595,531,315円	698,653,460円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,819,138,551円	3,241,321,544円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,160,421,182円	2,419,396,083円
ニッセイ/パナゴラ・外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	- 円	1,333,802,005円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	3,849,654円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	22,964,535円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	32,903,423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)	11,698,042,919円	11,525,937,107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	65,072,270,014円	72,900,642,046円
D Cニッセイ外国株式インデックス	11,899,518,770円	14,339,593,541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)	468,264,447円	557,400,550円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	19,393,803円	45,866,812円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,566,941円	70,004,086円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	11,777,271円	33,474,092円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	18,901,250円	67,551,278円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	6,227,388円	19,383,725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)	21,917,060円	36,069,604円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,928,154円	24,117,420円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,040,927円	2,921,364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)	700,329円	841,845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)	11,598,689円	15,188,102円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	210,461円	2,821,073円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	199,701円	2,898,069円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	188,906円	4,653,204円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	129,203円	5,113,878円
計	94,844,967,281円	107,407,368,500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)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	42,879,632	720,009,021
金銭信託	3,632,937	2,051,902
コール・ローン	74,158,657	284,290,570
国債証券	18,552,550,153	22,909,405,404
派生商品評価勘定	27,062	136,753
未収利息	126,320,979	125,772,713
前払費用	9,531,810	12,723,821
流動資産合計	18,809,101,230	24,054,390,184
資産合計	18,809,101,230	24,054,390,184
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	392,219
未払金	60,842,044	857,938,891
未払解約金	27,415,629	50,328,406
その他未払費用	87	135
流動負債合計	88,257,760	908,659,651
負債合計	88,257,760	908,659,651
純資産の部		
元本等		
元本	14,029,005,797	16,953,612,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,691,837,673	6,192,117,803
純資産合計	18,720,843,470	23,145,730,533
負債純資産合計	18,809,101,230	24,054,390,184

## 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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	14,029,005,797口	16,953,612,730口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3344円 (13,344円)	1.3652円 (13,652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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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	(2019年2月21日 現在)				(2019年8月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	63,756,714	-	63,783,776	27,062	221,400,530	-	221,145,064	255,466
アメリカ・ドル	46,857,170	-	46,882,796	25,626	124,321,930	-	124,209,554	112,376
イギリス・ポンド	2,961,702	-	2,961,805	103	11,668,277	-	11,673,601	5,324
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	3,057,323	-	3,057,238	85
カナダ・ドル	-	-	-	-	4,011,958	-	4,006,091	5,867
シンガポール・ドル	-	-	-	-	1,654,221	-	1,651,553	2,668
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	2,514,362	-	2,500,178	14,184
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	1,803,261	-	1,805,615	2,354
ユーロ	13,937,842	-	13,939,175	1,333	72,369,198	-	72,241,234	127,964
合計	63,756,714	-	63,783,776	27,062	221,400,530	-	221,145,064	255,466

(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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,229,834,925円	14,029,005,797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	5,563,822,764円	4,245,566,849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	2,764,651,892円	1,320,959,916円
元本の内訳		
ファンド名		
D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,511,175,019円	1,813,427,167円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,682,173,293円	3,156,085,064円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	913,366,571円	1,047,337,388円
ニッセイ/パナゴラ・外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定)	- 円	602,374,594円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	5,063,014円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	14,833,423円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	14,970,585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	7,539,991,502円	8,183,741,342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)	594,022,813円	723,408,983円
D Cニッセイ外国債券インデックス	631,268,627円	782,951,989円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	8,572,161円	20,740,792円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,130,485円	454,101,438円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	5,218,659円	15,176,136円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	8,555,537円	31,255,064円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	3,599,749円	11,443,463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)	27,811,628円	46,785,334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)	2,202,592円	2,768,935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)	14,590,750円	19,966,994円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	92,162円	1,271,797円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	88,320円	1,312,508円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	84,480円	2,125,237円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	61,449円	2,471,483円
計	14,029,005,797円	16,953,612,730円



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

(2019年8月30日現在)

資産総額	2,513,649,119円
負債総額	367,070円
純資産総額( - )	2,513,282,049円
発行済数量	2,414,559,346口
1口当たり純資産額( / )	1.0409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8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後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8月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	400	60,615
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	109	25,796
単位型公社債投資信託	2	88
合計	511	86,500

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

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

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

## 負債・純資産合計

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	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
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
日本生命保険相互会社	1,350,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

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】

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

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

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

### 第3【その他】

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



# 独立監査人の監査報告書

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

2019年3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DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2018年2月22日から2019年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2019年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年9月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2019年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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。