

**【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>	2020年8月20日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 大関 洋
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】</b>	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）
<b>【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)  
(以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

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

なお、委託会社へは後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

### (7)【申込期間】

継続申込期間：2020年8月21日(金)～2021年2月19日(金)

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### (8)【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

( 9 ) 【払込期日】

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

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時~午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### 基本方針

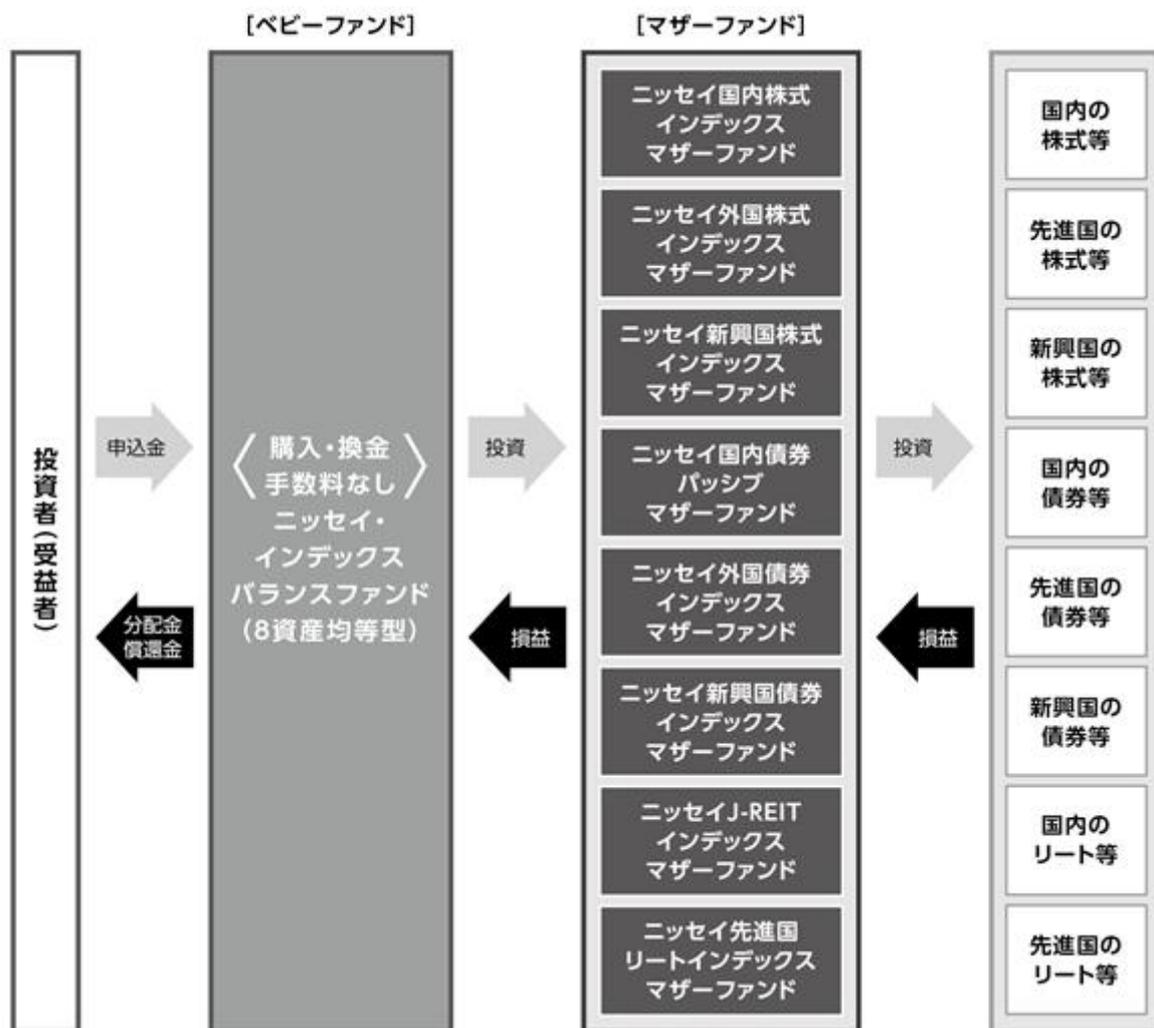
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



## ファンドの特色

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

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

### 【投資対象とするマザーファンド】

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

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

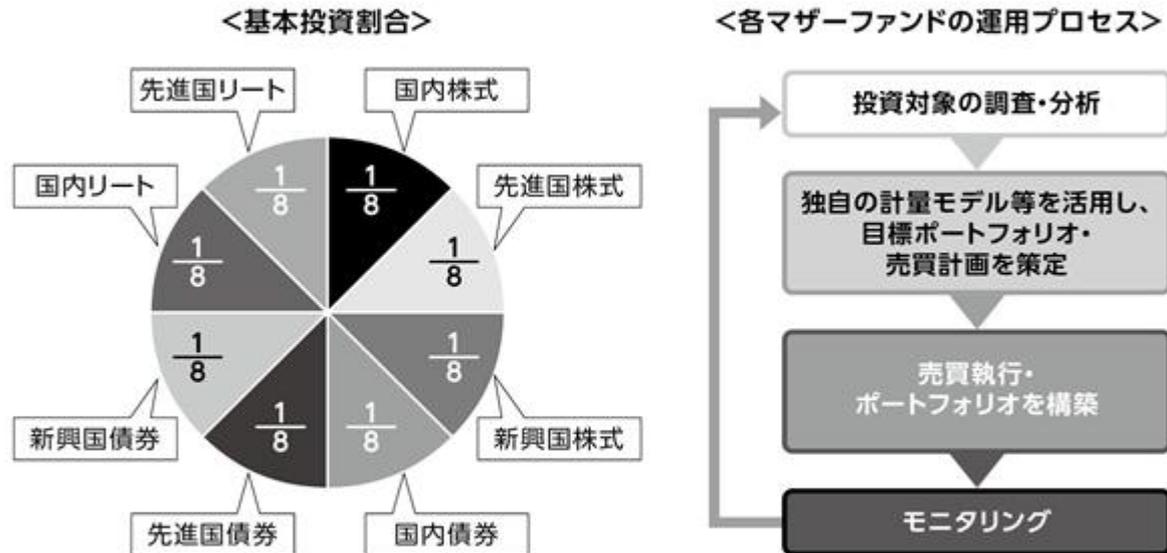
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ<sup>※</sup>を行いません。

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

## 2 8つの資産への投資割合は均等を基本とします。

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

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



### 〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

## 3 購入時および換金時の手数料は無料です。

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

・保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

## 〈各指数について〉

### ●TOPIX(東証株価指数)

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

### ●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)はMSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)はMSCI Inc.が公表している指数であり、世界の新興国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

### ●NOMURA-BPI総合

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

### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

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

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

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

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

なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

### ●東証REIT指数

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

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

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

### <MSCI 指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

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

## ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型	国 内	株 式 債 券	インデックス型
追 加 型	海 外	不動産投信 その他資産 ( )	特 殊 型
	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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)			
債券 一般	年1回	日 本			日経225
公債	年2回	北 米	ファミリー ファンド	あ り ( )	
社債	年4回	欧 州			
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	ア ジ ア			TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 債券・不動産 投信)資産配分 固定型))	日 々	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し	その他 (合成ベンチ マーク)
	その他 ( )	アフリカ			
資産複合 ( )		中近東 (中東)			
資産配分固定型		エマー ジ ング			
資産配分変更型					

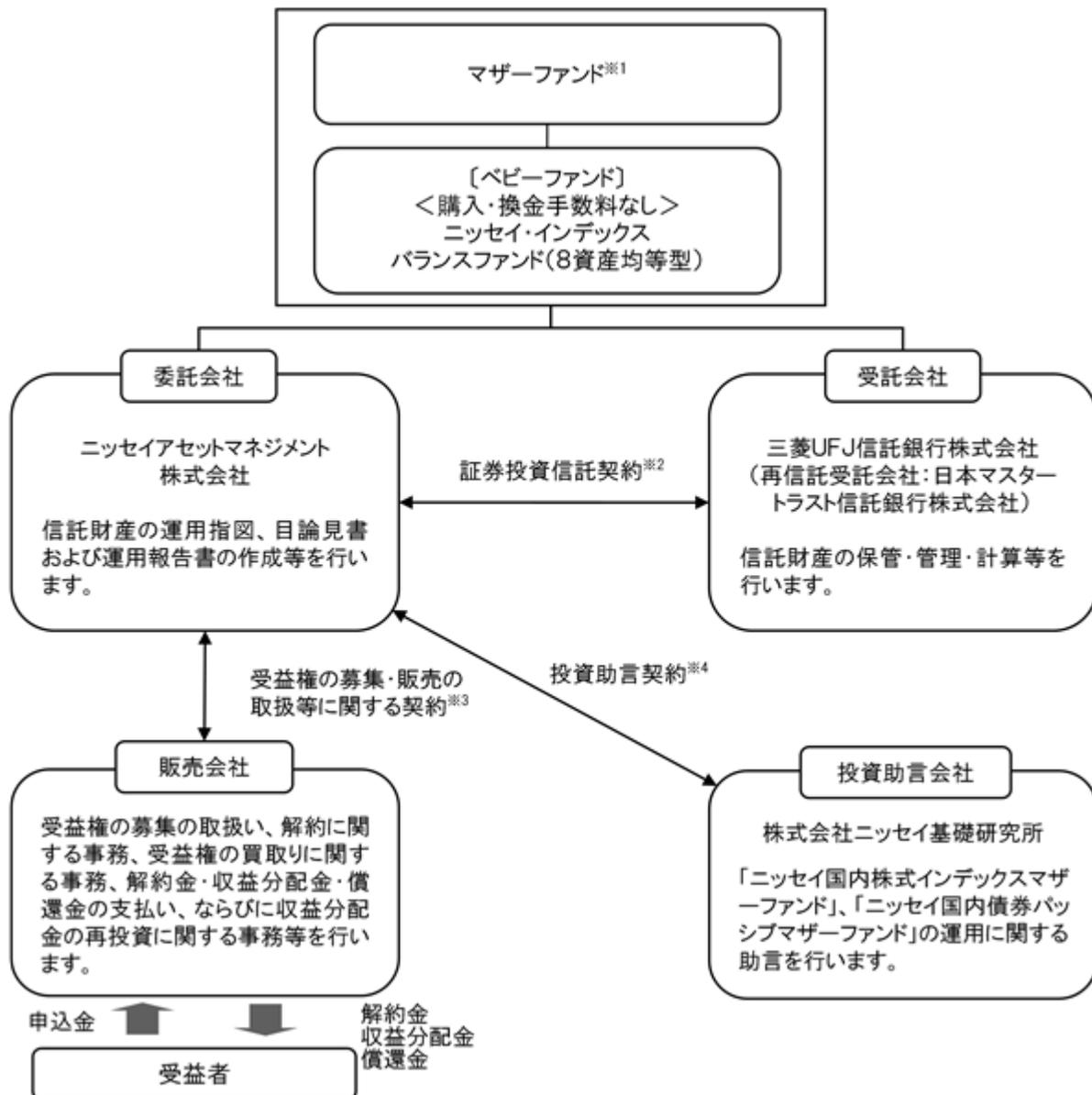
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券・ 不動産投信) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2018年2月13日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



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

## 委託会社の概況（2020年5月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 大関 洋
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 1995年4月4日
7. 沿革
  - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
  - 1995年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
  - 1998年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
  - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

## 8. 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

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

各マザーファンドへの基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の8分の1とします。

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

### (1) 基本方針

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

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

#### b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

## ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

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

## b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

### (1) 基本方針

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

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

#### b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

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

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

## b 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

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

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

## b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品

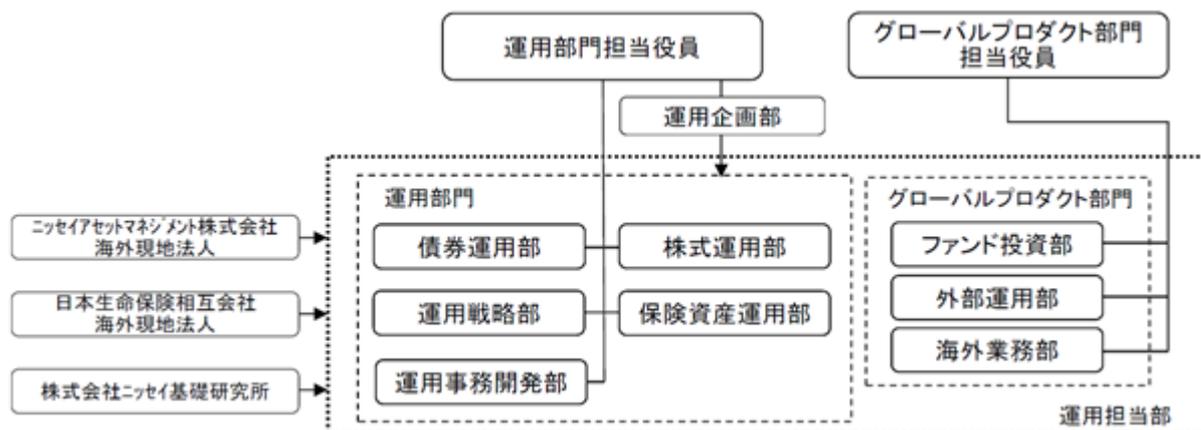
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

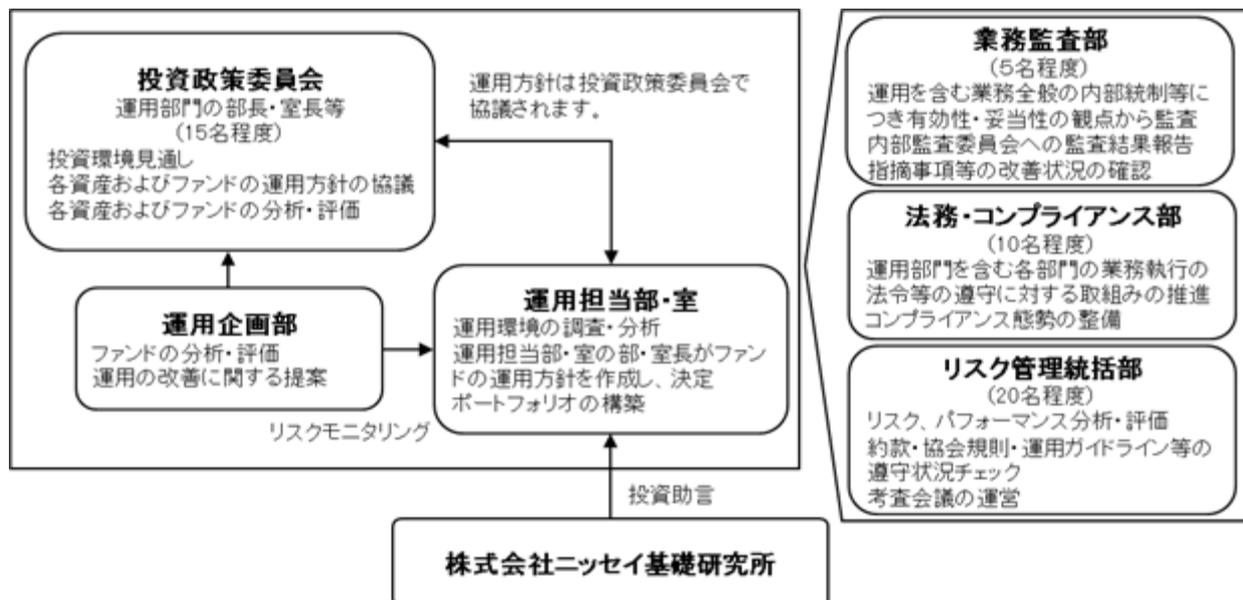
### （3）【運用体制】

#### 委託会社の組織体制



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

## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

**( 5 ) 【投資制限】****a 約款に定める主な投資制限**

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

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

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

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

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

**b 約款に定めるその他の投資制限****投資する株式等の範囲**

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

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

**信用取引の範囲**

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

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

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

**先物取引等**

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

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

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

**スワップ取引**

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

2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとし、
  4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
  5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
  6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとし、  
金利先渡取引および為替先渡取引
    1. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
    2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
    3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
    4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとし、
- 有価証券の貸付けおよび範囲
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
    - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとし、
    - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとし、
  2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとし、
  3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとし、
- 有価証券の空売り
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
  2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとし、
- 有価証券の借入れ
1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとし、
  2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとし、

4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

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

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

### 3【投資リスク】

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

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・不動産投資信託（リート）投資リスク

###### 保有不動産に関するリスク

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

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

###### 金利変動リスク

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

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

###### 信用リスク

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

###### J - R E I T の税制に関するリスク

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

###### リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

##### ・カントリーリスク

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

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・新興国の株式および債券投資に関する留意点

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

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

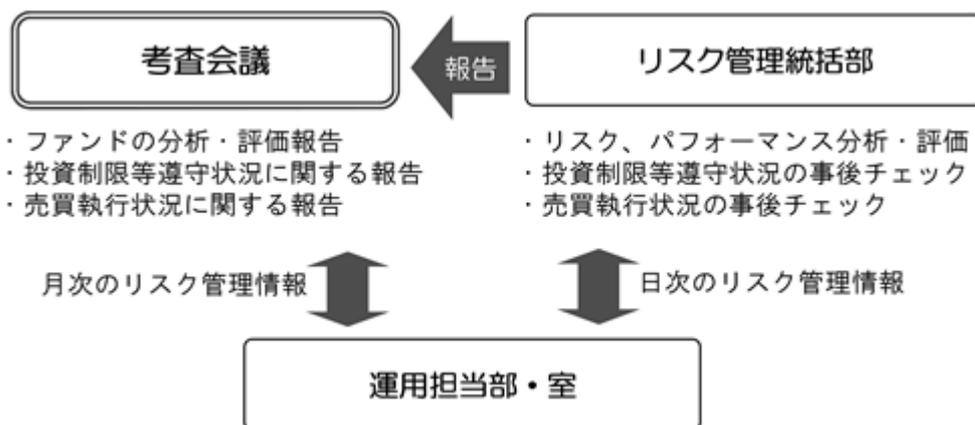
委託会社および委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2019年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に以下の通り保有しています。

当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（％）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	-	10.4
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	35.1	-
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	97.5	-
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	-	87.9

委託会社については実質保有比率が5％超のマザーファンドを記載しています。

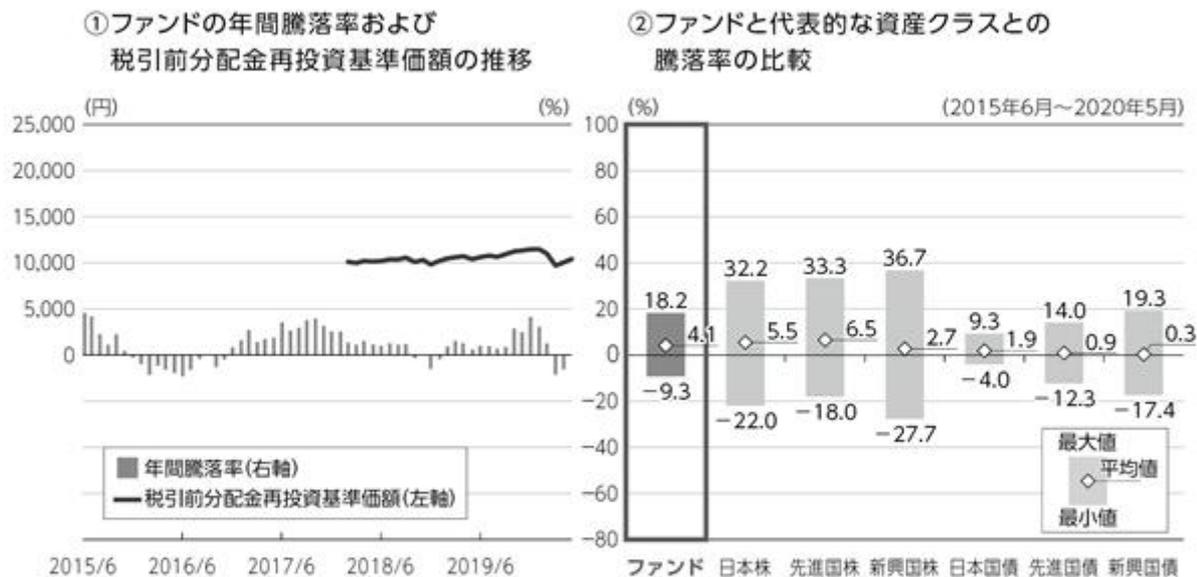
（２）投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

❶ 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。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1749%（税抜0.159%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。

なお、2020年8月21日現在の信託報酬率は年0.1749%（税抜0.159%）であり、その配分は次の通りとします。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

##### (4)【その他の手数料等】

###### 証券取引の手数料等

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

###### 監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.0011%（税抜0.001%）の率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

###### 信託事務の諸費用

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

###### 借入金の利息

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

###### 信託財産留保額

ありません。

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

## &lt;ご参考&gt;

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

## 課税対象

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

## 個人の課税の取扱い

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

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。

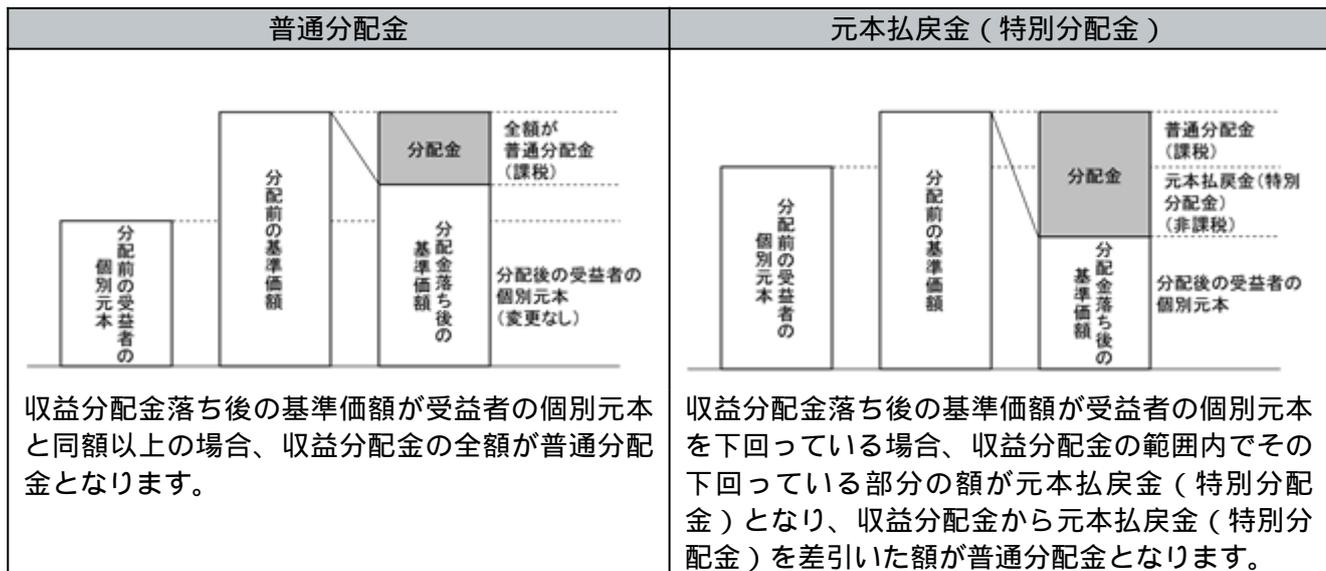
#### 個別元本

- ・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。



投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

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

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	261,509,999	100.00
内 日本	261,509,999	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,256	0.00
純資産総額	261,508,743	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」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	130,160,450,540	95.43
内 日本	130,160,450,540	95.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,237,978,117	4.57
純資産総額	136,398,428,657	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）	7,576,740,000	5.55
内 日本	7,576,740,000	5.55

(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、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」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	59,991,040,940	74.41
内 日本	59,991,040,940	74.41
地方債証券	7,189,076,048	8.92
内 日本	7,189,076,048	8.92
特殊債券	8,225,028,958	10.20
内 日本	8,225,028,958	10.20
社債券	5,712,272,300	7.09
内 日本	5,102,811,900	6.33
内 スウェーデン	409,826,600	0.51
内 フランス	199,633,800	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	500,109,015	0.62
純資産総額	80,617,309,231	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	23,868,576,250	98.67
内 日本	23,868,576,250	98.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	322,511,270	1.33
純資産総額	24,191,087,520	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」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	227,254,476,487	95.32
内 アメリカ	156,845,754,002	65.79
内 イギリス	11,075,167,877	4.65
内 スイス	8,942,966,218	3.75
内 カナダ	8,083,868,902	3.39
内 フランス	7,981,817,798	3.35
内 ドイツ	7,064,620,365	2.96
内 オーストラリア	4,761,428,166	2.00
内 オランダ	4,728,125,671	1.98
内 アイルランド	3,184,349,980	1.34
内 スウェーデン	2,459,196,118	1.03
内 香港	2,090,537,019	0.88
内 スペイン	1,924,220,593	0.81
内 デンマーク	1,863,674,390	0.78
内 イタリア	1,442,465,076	0.61
内 フィンランド	824,269,607	0.35
内 シンガポール	781,793,791	0.33
内 ベルギー	665,211,129	0.28
内 ノルウェー	437,923,655	0.18
内 バミューダ	404,289,445	0.17
内 イスラエル	364,222,827	0.15
内 ジャージー	298,844,949	0.13
内 ケイマン諸島	254,837,128	0.11
内 ニュージーランド	243,444,299	0.10
内 オランダ領キュラソー	162,998,884	0.07
内 ボルトガル	138,565,972	0.06
内 オーストリア	138,515,968	0.06
内 ルクセンブルグ	62,351,410	0.03
内 パプアニューギニア	29,015,248	0.01
投資証券	5,824,246,332	2.44
内 アメリカ	4,934,715,030	2.07
内 オーストラリア	347,314,096	0.15
内 フランス	139,872,945	0.06
内 シンガポール	136,901,004	0.06
内 イギリス	130,431,461	0.05
内 香港	93,899,164	0.04
内 カナダ	41,112,632	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,333,043,814	2.24
純資産総額	238,411,766,633	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）	8,017,460,890	3.36
内 アメリカ	5,880,170,520	2.47
内 ドイツ	1,543,386,332	0.65
内 イギリス	593,904,038	0.25

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

その他資産として、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」

（2020年5月29日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	27,406,985,636	100.90
内 アメリカ	12,589,083,033	46.35
内 フランス	2,737,383,544	10.08
内 イタリア	2,461,947,379	9.06
内 ドイツ	2,041,755,444	7.52
内 イギリス	1,833,431,954	6.75
内 スペイン	1,632,929,181	6.01
内 ベルギー	686,005,120	2.53
内 オーストラリア	555,521,219	2.05
内 カナダ	540,817,469	1.99
内 オランダ	517,664,156	1.91
内 オーストリア	411,805,964	1.52
内 メキシコ	217,288,543	0.80
内 アイルランド	208,676,081	0.77
内 ポーランド	164,636,234	0.61
内 フィンランド	161,896,950	0.60
内 デンマーク	141,537,224	0.52
内 マレーシア	132,538,762	0.49
内 シンガポール	121,530,911	0.45
内 イスラエル	105,004,277	0.39
内 スウェーデン	78,191,145	0.29
内 ノルウェー	67,341,046	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	244,420,697	0.90
純資産総額	27,162,564,939	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	2,062,933,632	98.36
内 アメリカ	1,564,846,087	74.61
内 オーストラリア	139,082,112	6.63
内 イギリス	109,151,907	5.20
内 シンガポール	80,311,392	3.83
内 フランス	46,955,314	2.24
内 カナダ	38,508,431	1.84
内 香港	32,017,091	1.53
内 ベルギー	21,237,697	1.01
内 スペイン	11,277,047	0.54
内 ニュージーランド	8,144,679	0.39
内 オランダ	3,186,005	0.15
内 ドイツ	3,102,049	0.15
内 アイルランド	1,881,852	0.09
内 ガーンジー	1,710,429	0.08
内 イスラエル	709,528	0.03
内 イタリア	435,956	0.02
内 マン島	376,056	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	34,399,794	1.64
純資産総額	2,097,333,426	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,698,659,857	80.01
内 ケイマン諸島	301,115,429	14.18
内 中国	223,352,691	10.52
内 台湾	216,369,481	10.19
内 韓国	214,332,301	10.10
内 インド	143,040,410	6.74
内 香港	123,735,494	5.83
内 ブラジル	91,288,756	4.30
内 南アフリカ	70,041,195	3.30
内 ロシア	60,906,597	2.87
内 タイ	42,659,744	2.01
内 アメリカ	37,959,726	1.79
内 メキシコ	34,545,267	1.63
内 マレーシア	32,409,463	1.53
内 インドネシア	27,897,020	1.31
内 フィリピン	14,547,993	0.69
内 ポーランド	13,658,486	0.64
内 チリ	10,741,722	0.51
内 バミューダ	9,531,358	0.45
内 トルコ	8,269,221	0.39
内 ギリシャ	6,075,400	0.29
内 ハンガリー	4,551,418	0.21
内 コロンビア	4,208,540	0.20
内 イギリス	3,674,873	0.17
内 チェコ	1,895,528	0.09
内 オランダ	1,390,371	0.07
内 ベルギー	461,373	0.02
投資信託受益証券	78,208,172	3.68
内 アメリカ	78,208,172	3.68
投資証券	1,934,532	0.09
内 南アフリカ	1,183,718	0.06
内 メキシコ	750,814	0.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	344,196,004	16.21
純資産総額	2,122,998,565	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)	340,298,578	16.03
内 アメリカ	340,298,578	16.03

(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、先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

(参考情報)

「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」

(2020年5月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	1,135,281,815	97.63
内 メキシコ	190,108,006	16.35
内 インドネシア	169,818,039	14.60
内 ロシア	168,792,751	14.52
内 ブラジル	129,466,334	11.13
内 コロンビア	116,698,598	10.04
内 フィリピン	106,188,473	9.13
内 パナマ	64,597,356	5.56
内 南アフリカ	59,722,377	5.14
内 ペルー	38,526,815	3.31
内 ハンガリー	35,122,136	3.02
内 クロアチア	29,202,137	2.51
内 ルーマニア	27,038,793	2.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	27,575,039	2.37
純資産総額	1,162,856,854	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】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

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

(2020年5月29日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	20,185,961	1.7301 34,924,215	1.7014 34,344,394	- -	13.13%
2	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	22,517,978	1.6847 37,937,888	1.5208 34,245,340	- -	13.10%
3	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	29,200,436	1.1203 32,714,595	1.1393 33,268,056	- -	12.72%
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	18,476,363	1.8097 33,437,475	1.7890 33,054,213	- -	12.64%
5	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	35,439,289	1.0435 36,983,795	0.9003 31,905,991	- -	12.20%
6	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	38,786,274	0.9031 35,029,493	0.8173 31,700,021	- -	12.12%
7	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	22,277,686	1.3885 30,934,742	1.4201 31,636,541	- -	12.10%
8	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	31,797,428	0.9923 31,553,622	0.9861 31,355,443	- -	11.99%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	100.00
	小計		100.00
合計（対純資産総額比）			100.00

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

（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」

（2020年5月29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	661,100	7,061.42 4,668,307,379	6,755.00 4,465,730,500	- -	3.27%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	371,200	6,789.23 2,520,163,040	6,874.00 2,551,628,800	- -	1.87%
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	53,700	35,281.43 1,894,612,813	44,350.00 2,381,595,000	- -	1.75%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	461,300	4,611.87 2,127,459,004	4,832.00 2,229,001,600	- -	1.63%
5	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	493,000	3,704.14 1,826,145,801	4,191.00 2,066,163,000	- -	1.51%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	777,200	2,623.93 2,039,325,576	2,444.00 1,899,476,800	- -	1.39%
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,997,600	490.73 1,961,747,220	444.20 1,775,733,920	- -	1.30%
8	第一三共 日本	株式 医薬品	169,600	7,102.32 1,204,554,026	10,085.00 1,710,416,000	- -	1.25%
9	任天堂 日本	株式 その他製品	36,300	38,362.95 1,392,575,438	43,540.00 1,580,502,000	- -	1.16%
10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	405,600	3,722.28 1,509,756,900	3,710.00 1,504,776,000	- -	1.10%
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	433,300	3,244.16 1,405,698,490	3,136.00 1,358,828,800	- -	1.00%
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	466,500	2,695.72 1,257,555,908	2,784.00 1,298,736,000	- -	0.95%
13	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	404,200	3,246.75 1,312,339,217	3,119.00 1,260,699,800	- -	0.92%
14	信越化学工業 日本	株式 化学	99,600	11,809.41 1,176,218,064	12,620.00 1,256,952,000	- -	0.92%
15	花王 日本	株式 化学	141,900	8,281.50 1,175,145,761	8,647.00 1,227,009,300	- -	0.90%
16	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	415,700	3,137.46 1,304,246,014	2,951.50 1,226,938,550	- -	0.90%
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	75,500	14,066.04 1,061,986,370	15,850.00 1,196,675,000	- -	0.88%
18	HOYA 日本	株式 精密機器	118,300	9,657.94 1,142,534,938	10,110.00 1,196,013,000	- -	0.88%
19	ファナック 日本	株式 電気機器	56,300	17,443.50 982,069,605	19,215.00 1,081,804,500	- -	0.79%

20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	7,940,900	140.38 1,114,782,280	134.50 1,068,051,050	- -	0.78%
21	村田製作所 日本	株式 電気機器	174,000	5,672.05 986,937,289	6,015.00 1,046,610,000	- -	0.77%
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	409,500	2,596.19 1,063,141,119	2,515.00 1,029,892,500	- -	0.76%
23	S M C 日本	株式 機械	18,600	45,041.47 837,771,490	54,370.00 1,011,282,000	- -	0.74%
24	日立製作所 日本	株式 電気機器	284,700	3,589.98 1,022,067,794	3,455.00 983,638,500	- -	0.72%
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	513,700	1,731.94 889,698,859	1,914.50 983,478,650	- -	0.72%
26	中外製薬 日本	株式 医薬品	61,800	11,663.48 720,803,250	15,890.00 982,002,000	- -	0.72%
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	206,600	5,471.49 1,130,409,850	4,668.00 964,408,800	- -	0.71%
28	日本電産 日本	株式 電気機器	142,600	6,308.48 899,589,988	6,622.00 944,297,200	- -	0.69%
29	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	408,200	2,375.50 969,682,894	2,310.00 942,942,000	- -	0.69%
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	60,200	13,499.29 812,657,500	15,615.00 940,023,000	- -	0.69%

(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	13.86
		情報・通信業	9.10
		輸送用機器	6.96
		化学	6.94
		医薬品	6.82
		サービス業	5.13
		機械	4.87
		銀行業	4.85
		小売業	4.71
		卸売業	4.43
		陸運業	4.14
		食料品	3.80
		精密機器	2.50
		建設業	2.50
		その他製品	2.28
		不動産業	2.02
		保険業	1.97
		電気・ガス業	1.52
		その他金融業	1.09
		ガラス・土石製品	0.75
		証券、商品先物取引業	0.73
		非鉄金属	0.66
		ゴム製品	0.61
		鉄鋼	0.55
		金属製品	0.52
		繊維製品	0.49
		石油・石炭製品	0.43
空運業	0.35		
パルプ・紙	0.23		
鉱業	0.21		
倉庫・運輸関連業	0.17		
海運業	0.13		
水産・農林業	0.09		
	小計		95.43
合計（対純資産総額比）			95.43

（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。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

（2020年5月29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)	評価単価 (円)	利率 (%)	投資 比率
				簿価金額 (円)	評価金額 (円)	償還日	
1	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	102.65 1,026,585,000	102.38 1,023,830,000	0.828000 2023/5/19	1.27%
2	第350回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	808,000,000	102.95 831,836,000	101.53 820,378,560	0.100000 2028/3/20	1.02%
3	第349回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	646,000,000	103.06 665,780,520	101.52 655,832,120	0.100000 2027/12/20	0.81%
4	第351回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	640,000,000	102.82 658,048,000	101.49 649,593,600	0.100000 2028/6/20	0.81%
5	第334回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	618,000,000	103.27 638,222,730	103.03 636,762,480	0.600000 2024/6/20	0.79%

6	第348回 利付国債(10年) 日本	国債証券	621,000,000	103.08 640,126,800	101.50 630,364,680	0.100000 2027/9/20	0.78%
7	第347回 利付国債(10年) 日本	国債証券	616,000,000	103.09 635,034,400	101.49 625,190,720	0.100000 2027/6/20	0.78%
8	第352回 利付国債(10年) 日本	国債証券	616,000,000	102.64 632,305,520	101.46 625,005,920	0.100000 2028/9/20	0.78%
9	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	613,000,000	102.36 627,466,800	101.31 621,054,820	0.100000 2026/3/20	0.77%
10	第343回 利付国債(10年) 日本	国債証券	591,000,000	102.49 605,715,900	101.37 599,108,520	0.100000 2026/6/20	0.74%
11	第344回 利付国債(10年) 日本	国債証券	583,000,000	102.66 598,507,800	101.42 591,331,070	0.100000 2026/9/20	0.73%
12	第353回 利付国債(10年) 日本	国債証券	576,000,000	102.40 589,852,800	101.37 583,920,000	0.100000 2028/12/20	0.72%
13	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	566,000,000	103.73 587,117,460	102.83 582,017,800	0.400000 2025/9/20	0.72%
14	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	573,000,000	102.76 588,814,800	101.45 581,325,690	0.100000 2026/12/20	0.72%
15	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	570,000,000	102.94 586,758,000	101.47 578,396,100	0.100000 2027/3/20	0.72%
16	第129回 利付国債(5年) 日本	国債証券	575,000,000	100.52 577,990,000	100.33 576,949,250	0.100000 2021/9/20	0.72%
17	第341回 利付国債(10年) 日本	国債証券	552,000,000	103.37 570,635,520	102.40 565,275,600	0.300000 2025/12/20	0.70%
18	第339回 利付国債(10年) 日本	国債証券	536,000,000	103.50 554,776,080	102.72 550,584,560	0.400000 2025/6/20	0.68%
19	第355回 利付国債(10年) 日本	国債証券	518,000,000	101.92 527,945,600	101.22 524,345,500	0.100000 2029/6/20	0.65%
20	第354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	508,000,000	102.14 518,901,680	101.28 514,507,480	0.100000 2029/3/20	0.64%
21	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	103.16 515,837,000	102.63 513,197,500	0.660000 2024/5/31	0.64%
22	第190回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	102.24 511,223,000	101.80 509,030,000	0.605000 2023/5/31	0.63%
23	第139回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	101.79 508,961,500	101.31 506,591,000	1.100000 2021/7/30	0.63%
24	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	491,000,000	103.30 507,237,370	102.58 503,687,440	0.400000 2025/3/20	0.62%
25	第130回 利付国債(5年) 日本	国債証券	482,000,000	100.62 485,012,500	100.40 483,947,280	0.100000 2021/12/20	0.60%

26	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	473,000,000	101.67 480,941,670	101.11 478,288,140	0.100000 2029/9/20	0.59%
27	第141回 利付国債（5年） 日本	国債証券	470,000,000	101.41 476,659,900	101.03 474,883,300	0.100000 2024/9/20	0.59%
28	第113回 利付国債（20年） 日本	国債証券	389,000,000	120.81 469,974,240	119.76 465,870,290	2.100000 2029/9/20	0.58%
29	第131回 利付国債（5年） 日本	国債証券	460,000,000	100.70 463,220,000	100.46 462,157,400	0.100000 2022/3/20	0.57%
30	第139回 利付国債（5年） 日本	国債証券	434,000,000	101.23 439,363,400	100.95 438,144,700	0.100000 2024/3/20	0.54%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	74.41
		地方債証券	8.92
		特殊債証券	10.20
		社債証券	6.33
	小計	99.86	
	外国	社債証券	0.76
小計	0.76		
合計（対純資産総額比）			100.62

（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。

### （参考情報）

#### 「ニッセイ」- R E I Tインデックス マザーファンド」

（2020年5月29日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	2,629	656,327.01 1,725,483,716	676,000.00 1,777,204,000	- -	7.35%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,715	594,167.09 1,613,163,675	588,000.00 1,596,420,000	- -	6.60%
3	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,086	295,779.50 1,208,555,070	304,000.00 1,242,144,000	- -	5.13%
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	8,765	126,881.60 1,112,117,300	132,500.00 1,161,362,500	- -	4.80%
5	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,874	263,370.47 1,020,297,228	266,400.00 1,032,033,600	- -	4.27%
6	G L P 投資法人 日本	投資証券	6,763	137,481.02 929,784,173	143,700.00 971,843,100	- -	4.02%
7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,575	327,683.00 843,783,740	335,500.00 863,912,500	- -	3.57%
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,410	142,642.89 771,698,081	155,800.00 842,878,000	- -	3.48%
9	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,132	145,221.33 745,275,871	142,200.00 729,770,400	- -	3.02%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,096	123,636.84 753,690,203	114,200.00 696,163,200	- -	2.88%

11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,497	156,273.06 546,486,919	176,700.00 617,919,900	- -	2.55%
12	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	902	613,398.78 553,285,700	653,000.00 589,006,000	- -	2.43%
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,784	322,098.20 574,623,191	329,000.00 586,936,000	- -	2.43%
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	7,939	66,847.96 530,705,972	67,100.00 532,706,900	- -	2.20%
15	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,774	283,487.90 502,907,550	286,500.00 508,251,000	- -	2.10%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	840	583,209.29 489,895,804	598,000.00 502,320,000	- -	2.08%
17	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,361	359,489.96 489,265,846	366,500.00 498,806,500	- -	2.06%
18	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,124	139,541.11 435,926,453	145,500.00 454,542,000	- -	1.88%
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	2,524	154,530.86 390,035,892	160,700.00 405,606,800	- -	1.68%
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	627	622,943.37 390,585,497	629,000.00 394,383,000	- -	1.63%
21	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	8,747	39,446.05 345,034,676	44,850.00 392,302,950	- -	1.62%
22	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,182	314,452.36 371,682,694	326,000.00 385,332,000	- -	1.59%
23	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	773	458,549.45 354,458,729	469,000.00 362,537,000	- -	1.50%
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	964	329,634.91 317,768,056	350,000.00 337,400,000	- -	1.39%
25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,511	123,154.72 309,241,508	133,300.00 334,716,300	- -	1.38%
26	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,930	114,338.65 335,012,273	114,000.00 334,020,000	- -	1.38%
27	日本リート投資法人 日本	投資証券	882	344,238.16 303,618,058	378,500.00 333,837,000	- -	1.38%
28	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	3,324	93,984.08 312,403,108	98,900.00 328,743,600	- -	1.36%
29	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,910	23,940.01 285,125,606	27,280.00 324,904,800	- -	1.34%
30	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	1,771	170,572.51 302,083,926	181,300.00 321,082,300	- -	1.33%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
投資証券	国内	投資証券	98.67
	小計		98.67
合計（対純資産総額比）			98.67

（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。

(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」

(2020年5月29日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面 金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	253,694	33,671.94 8,542,370,211	34,221.42 8,681,769,559	- -	3.64%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	418,950	19,744.87 8,272,116,143	19,505.94 8,172,014,400	- -	3.43%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	24,535	263,317.99 6,460,506,896	258,190.28 6,334,698,593	- -	2.66%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	139,468	23,327.41 3,253,428,005	24,243.71 3,381,222,276	- -	1.42%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	17,940	147,690.84 2,649,573,706	152,340.97 2,732,997,125	- -	1.15%
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	17,233	147,893.83 2,548,654,374	152,503.34 2,628,090,182	- -	1.10%
7	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	152,739	16,022.34 2,447,236,282	15,803.68 2,413,838,905	- -	1.01%
8	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	98,891	20,363.79 2,013,796,196	20,888.77 2,065,712,125	- -	0.87%
9	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	172,458	11,756.72 2,027,541,427	11,468.71 1,977,871,961	- -	0.83%
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	178,185	9,534.68 1,698,937,864	10,737.94 1,913,340,872	- -	0.80%
11	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	54,985	31,095.21 1,709,770,128	32,685.89 1,797,233,887	- -	0.75%
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソ ナル用品	143,209	12,090.67 1,731,493,218	12,479.93 1,787,238,553	- -	0.75%
13	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	51,876	31,267.35 1,622,025,268	32,506.31 1,686,297,804	- -	0.71%
14	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	63,254	25,608.60 1,619,846,865	26,359.90 1,667,369,380	- -	0.70%
15	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造 装置	247,939	6,482.98 1,607,384,495	6,634.60 1,644,976,337	- -	0.69%
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	80,302	18,626.65 1,495,757,733	19,903.80 1,598,315,188	- -	0.67%
17	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	40,709	38,831.30 1,580,783,644	38,056.19 1,549,229,845	- -	0.65%
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	240,068	5,848.52 1,404,044,772	5,991.57 1,438,384,610	- -	0.60%
19	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	416,163	3,114.06 1,295,960,214	3,339.88 1,389,935,229	- -	0.58%

20	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	320,797	4,052.10 1,299,904,528	4,105.49 1,317,030,607	- -	0.55%
21	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	104,694	12,300.43 1,287,781,876	12,554.12 1,314,341,824	- -	0.55%
22	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	35,491	37,795.96 1,341,416,450	36,504.28 1,295,573,557	- -	0.54%
23	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	147,000	8,339.59 1,225,919,915	8,499.17 1,249,378,166	- -	0.52%
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	455,197	2,388.24 1,087,120,275	2,673.19 1,216,830,708	- -	0.51%
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	245,749	4,797.10 1,178,884,783	4,902.83 1,204,865,655	- -	0.51%
26	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	236,348	4,791.63 1,132,494,369	5,063.58 1,196,768,825	- -	0.50%
27	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	245,358	4,725.78 1,159,509,698	4,843.15 1,188,305,892	- -	0.50%
28	NOVARTIS AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	124,514	9,235.40 1,149,937,663	9,298.53 1,157,798,110	- -	0.49%
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	80,578	14,164.86 1,141,376,706	14,225.14 1,146,233,629	- -	0.48%
30	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	27,931	40,025.50 1,117,952,397	40,843.11 1,140,789,181	- -	0.48%

(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	11.56
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
		メディア・娯楽	6.54
		資本財	6.06
		小売	5.61
		銀行	5.49
		ヘルスケア機器・サービス	5.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.16
		食品・飲料・タバコ	4.64
		各種金融	4.26
		素材	4.15
		半導体・半導体製造装置	3.64
		エネルギー	3.53
		公益事業	3.52
		保険	3.08
		電気通信サービス	2.13
		家庭用品・パーソナル用品	2.13
		運輸	1.78
		耐久消費財・アパレル	1.72
		食品・生活必需品小売り	1.54
		消費者サービス	1.52
商業・専門サービス	1.21		
自動車・自動車部品	1.07		
不動産	0.49		
	小計		95.32
投資証券	外国	投資証券	2.44
	小計		2.44
合計(対純資産総額比)			97.76

(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。

(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」

(2020年5月29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	261,297,900	102.70 268,360,782	102.65 268,227,520	2.000000 2021/11/15	0.99%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	229,038,900	108.75 249,086,674	108.69 248,953,832	2.500000 2024/5/15	0.92%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	239,791,900	102.38 245,522,926	102.34 245,410,224	2.125000 2021/8/15	0.90%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	221,511,800	108.67 240,719,088	108.65 240,677,000	2.375000 2024/8/15	0.89%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	207,532,900	108.53 225,237,531	108.50 225,187,723	2.250000 2024/11/15	0.83%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	202,156,400	108.65 219,643,788	108.63 219,614,626	2.125000 2025/5/15	0.81%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	210,758,800	103.12 217,336,582	103.08 217,269,139	2.000000 2022/2/15	0.80%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	198,930,500	108.63 216,102,180	108.60 216,040,512	2.750000 2023/11/15	0.80%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	200,005,800	104.51 209,044,062	104.48 208,974,060	1.750000 2023/5/15	0.77%

10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	190,328,100	107.75 205,091,850	107.72 205,032,849	2.000000 2025/2/15	0.75%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	189,252,800	107.27 203,024,726	107.22 202,928,207	2.500000 2023/8/15	0.75%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	191,403,400	104.85 200,703,691	104.80 200,606,075	2.000000 2023/2/15	0.74%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	183,876,300	103.10 189,578,304	103.06 189,506,592	2.125000 2021/12/31	0.70%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	182,801,000	103.51 189,219,143	103.48 189,177,098	1.625000 2022/11/15	0.70%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	183,876,300	102.31 188,127,520	102.25 188,026,388	2.000000 2021/8/31	0.69%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	178,499,800	103.80 185,297,072	103.74 185,179,262	2.625000 2021/12/15	0.68%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	168,822,100	109.18 184,331,786	109.13 184,252,439	2.750000 2024/2/15	0.68%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	179,575,100	102.62 184,281,763	102.59 184,231,482	2.125000 2021/9/30	0.68%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	179,575,100	102.15 183,439,556	102.08 183,313,853	2.125000 2021/6/30	0.67%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	165,596,200	101.86 168,687,881	101.79 168,576,931	2.000000 2021/5/31	0.62%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	160,219,700	103.14 165,263,416	103.15 165,282,642	1.625000 2022/8/15	0.61%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	158,069,100	103.07 162,934,466	103.04 162,883,884	1.750000 2022/5/15	0.60%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	154,843,200	103.95 160,969,754	103.90 160,891,375	2.375000 2022/3/15	0.59%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	139,789,000	109.86 153,576,389	109.88 153,614,132	2.250000 2025/11/15	0.57%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	143,014,900	106.80 152,745,633	106.83 152,785,677	1.625000 2026/5/15	0.56%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	139,789,000	108.75 152,024,731	108.70 151,964,621	2.250000 2024/12/31	0.56%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	140,864,300	107.81 151,874,253	107.78 151,830,585	2.125000 2024/9/30	0.56%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	139,789,000	106.15 148,393,808	106.19 148,448,928	1.500000 2026/8/15	0.55%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	135,487,800	107.07 145,072,206	107.04 145,034,270	2.125000 2024/3/31	0.53%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	139,789,000	102.89 143,840,085	102.86 143,791,159	1.750000 2022/3/31	0.53%

（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	100.90
	小計		100.90
合計（対純資産総額比）			100.90

（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。

(参考情報)

「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」

(2020年5月29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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	13,468	9,783.12 131,759,116	10,005.66 134,756,316	- -	6.43%
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	1,615	61,681.79 99,616,105	74,555.92 120,407,819	- -	5.74%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	4,842	13,029.67 63,089,702	15,704.75 76,042,430	- -	3.63%
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	2,689	22,936.87 61,677,255	21,633.96 58,173,720	- -	2.77%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	2,519	22,965.72 57,850,656	17,100.49 43,076,149	- -	2.05%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	6,199	9,313.80 57,736,305	6,545.35 40,574,631	- -	1.93%
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	7,269	9,161.03 66,591,554	5,520.59 40,129,170	- -	1.91%
8	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	2,284	17,234.50 39,363,611	16,682.20 38,102,154	- -	1.82%
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	6,119	8,077.43 49,425,824	5,989.42 36,649,267	- -	1.75%
10	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	5,653	15,712.63 88,823,542	6,424.91 36,320,058	- -	1.73%
11	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	29,354	1,058.91 31,083,474	1,099.50 32,274,825	- -	1.54%
12	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,201	34,714.82 41,692,504	26,759.91 32,138,658	- -	1.53%
13	LINK REIT 香港	投資証券	36,000	1,131.79 40,744,512	790.59 28,461,240	- -	1.36%
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	6,968	6,119.25 42,638,999	3,952.80 27,543,129	- -	1.31%
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	9,737	3,130.32 30,480,015	2,817.28 27,431,913	- -	1.31%
16	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証券	6,868	3,784.03 25,988,777	3,745.26 25,722,513	- -	1.23%
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	9,298	3,751.57 34,882,108	2,751.69 25,585,238	- -	1.22%
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	1,956	14,739.03 28,829,550	12,651.97 24,747,272	- -	1.18%
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	2,342	11,345.10 26,570,245	10,454.06 24,483,423	- -	1.17%
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	1,632	17,282.32 28,204,749	14,896.13 24,310,485	- -	1.16%
21	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,529	14,875.74 37,620,758	9,436.83 23,865,750	- -	1.14%
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	20,444	1,150.36 23,518,120	1,123.85 22,976,079	- -	1.10%
23	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	3,270	7,563.40 24,732,331	6,720.62 21,976,443	- -	1.05%
24	UDR INC アメリカ	投資証券	5,091	5,251.61 26,735,966	4,134.52 21,048,884	- -	1.00%
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	3,067	8,982.88 27,550,497	6,696.96 20,539,602	- -	0.98%

26	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	8,869	2,469.03 21,897,865	2,083.93 18,482,387	- -	0.88%
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC アメリカ	投資証券	9,261	2,206.23 20,431,963	1,951.66 18,074,411	- -	0.86%
28	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	99,504	269.73 26,839,678	169.81 16,897,072	- -	0.81%
29	CYRUSONE INC アメリカ	投資証券	2,098	7,089.63 14,874,050	7,907.75 16,590,472	- -	0.79%
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	1,645	12,128.30 19,951,067	9,951.90 16,370,877	- -	0.78%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	外国	投資証券	98.36
	小計		98.36
合計(対純資産総額比)			98.36

(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。

#### (参考情報)

「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」

(2020年5月29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	ALIBABA GROUP HOLDING- SP ADR ケイマン諸島	株式 小売	5,567	20,198.42 112,444,631	21,451.15 119,418,606	- -	5.62%
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	18,300	4,691.55 85,855,538	5,661.73 103,609,732	- -	4.88%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・半導体製造 装置	79,000	1,126.87 89,023,043	1,052.52 83,149,080	- -	3.92%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハー ドウェアおよび機器	15,263	4,652.04 71,004,127	4,379.75 66,848,276	- -	3.15%
5	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	17,200	3,212.62 55,257,086	2,814.06 48,401,833	- -	2.28%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	311,000	88.97 27,671,538	85.71 26,657,862	- -	1.26%
7	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 小売	1,423	13,892.77 19,769,414	17,987.63 25,596,399	- -	1.21%
8	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	9,135	2,130.58 19,462,927	2,105.31 19,232,075	- -	0.91%
9	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	11,146	1,885.38 21,014,455	1,718.32 19,152,499	- -	0.90%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	18,000	1,278.78 23,018,129	1,061.05 19,098,990	- -	0.90%
11	CHINA MOBILE LTD/HK 香港	株式 電気通信サービス	19,500	862.18 16,812,640	750.36 14,632,156	- -	0.69%

12	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	207,000	80.44 16,652,322	69.76 14,441,582	- -	0.68%
13	JD.COM INC-ADR ケイマン諸島	株式 小売	2,350	3,516.18 8,263,035	5,486.18 12,892,524	- -	0.61%
14	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造 装置	1,728	7,412.56 12,808,920	7,290.90 12,598,692	- -	0.59%
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 銀行	5,241	3,163.09 16,577,785	2,321.89 12,169,030	- -	0.57%
16	LUKOIL PJSC-SPON ADR ロシア	株式 エネルギー	1,398	10,097.66 14,116,540	8,226.04 11,500,010	- -	0.54%
17	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サー ビス	10,914	1,020.90 11,142,125	1,011.58 11,040,405	- -	0.52%
18	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	9,704	1,467.58 14,241,492	1,097.88 10,653,840	- -	0.50%
19	PJSC GAZPROM ADR ロシア	株式 エネルギー	17,891	821.95 14,705,661	593.13 10,611,786	- -	0.50%
20	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロジー・ハー ドウェアおよび機器	39,200	332.22 13,023,180	269.57 10,567,300	- -	0.50%
21	SBERBANK PAO - SPONSORED ADR ロシア	株式 銀行	8,219	1,610.79 13,239,160	1,255.95 10,322,656	- -	0.49%
22	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	261,000	44.91 11,722,525	39.52 10,317,199	- -	0.49%
23	VALE SA ブラジル	株式 素材	10,167	953.55 9,694,775	995.28 10,119,096	- -	0.48%
24	BAIDU INC - SPON ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	863	12,440.14 10,735,845	11,432.58 9,866,324	- -	0.46%
25	SAMSUNG ELECTRONICS- PFD 韓国	株式 テクノロジー・ハー ドウェアおよび機器	2,604	3,741.04 9,741,681	3,780.14 9,843,510	- -	0.46%
26	NAVER CORP 韓国	株式 メディア・娯楽	455	14,837.95 6,751,271	20,899.44 9,509,249	- -	0.45%
27	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造 装置	5,000	1,507.18 7,535,900	1,646.80 8,234,000	- -	0.39%
28	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフトウェア・サー ビス	2,825	3,015.58 8,519,024	2,866.14 8,096,870	- -	0.38%
29	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 電気通信サービス	108,100	73.03 7,895,148	72.98 7,889,916	- -	0.37%
30	NETEASE.COM INC -ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	198	31,022.40 6,142,436	39,382.85 7,797,806	- -	0.37%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	銀行	10.69
		小売	9.17
		メディア・娯楽	7.32
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54
		半導体・半導体製造装置	5.77
		素材	5.43
		エネルギー	5.22
		電気通信サービス	3.17
		食品・飲料・タバコ	2.98
		保険	2.92
		資本財	2.61
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.12
		不動産	1.97
		各種金融	1.92
		公益事業	1.84
		ソフトウェア・サービス	1.62
		自動車・自動車部品	1.58
		食品・生活必需品小売り	1.34
		消費者サービス	1.27
		運輸	1.26
		耐久消費財・アパレル	1.11
家庭用品・パーソナル用品	1.01		
ヘルスケア機器・サービス	0.91		
商業・専門サービス	0.26		
	小計		80.01
投資信託受益証券	外国	投資信託受益証券	3.68
	小計		3.68
投資証券	外国	投資証券	0.09
	小計		0.09
合計(対純資産総額比)			83.79

(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。

(参考情報)

「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」

(2020年5月29日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	43,012,000	120.50 51,829,460	134.98 58,061,898	5.250000 2047/6/23	4.99%
2	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	26,882,500	121.34 32,620,300	122.95 33,052,571	5.250000 2047/1/8	2.84%
3	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,506,000	138.87 29,866,672	137.50 29,570,750	7.375000 2037/9/18	2.54%
4	CROATIA クロアチア	国債証券	25,807,200	114.80 29,629,246	113.15 29,202,137	6.000000 2024/1/26	2.51%
5	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,506,000	115.25 24,787,600	125.35 26,957,771	5.100000 2035/3/28	2.32%
6	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,506,000	121.85 26,205,061	120.65 25,949,139	5.125000 2045/1/15	2.23%
7	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証券	21,506,000	125.65 27,022,289	119.30 25,657,733	4.500000 2047/5/15	2.21%
8	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	21,506,000	112.13 24,116,828	114.57 24,640,714	3.700000 2042/2/2	2.12%

9	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,506,000	110.50 23,764,990	114.54 24,634,047	4.750000 2026/5/27	2.12%
10	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,506,000	113.40 24,387,804	113.50 24,409,310	5.000000 2045/6/15	2.10%
11	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,506,000	107.82 23,188,844	112.88 24,276,833	4.250000 2027/6/23	2.09%
12	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	21,506,000	115.65 24,873,409	112.65 24,226,509	6.000000 2026/4/7	2.08%
13	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,506,000	112.57 24,209,519	112.44 24,181,776	5.875000 2024/1/15	2.08%
14	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,506,000	110.46 23,756,387	111.93 24,072,310	4.750000 2026/1/8	2.07%
15	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証券	21,506,000	108.25 23,280,460	111.25 23,925,640	3.875000 2028/3/17	2.06%
16	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,581,300	105.58 23,842,917	105.54 23,834,562	4.000000 2023/10/2	2.05%
17	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,506,000	109.55 23,561,758	110.79 23,828,217	4.875000 2023/9/16	2.05%
18	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,506,000	108.85 23,410,356	110.76 23,820,905	4.350000 2048/1/11	2.05%
19	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	21,506,000	103.61 22,283,441	107.71 23,164,972	3.000000 2028/2/1	1.99%
20	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	21,506,000	105.73 22,739,369	106.35 22,871,631	4.250000 2025/1/7	1.97%
21	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,506,000	106.25 22,850,340	106.35 22,871,631	4.150000 2027/3/28	1.97%
22	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,506,000	101.34 21,796,115	106.10 22,817,866	3.500000 2028/1/11	1.96%
23	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,506,000	105.00 22,581,300	105.65 22,721,304	3.875000 2027/4/25	1.95%
24	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	21,506,000	106.00 22,796,575	105.50 22,688,830	4.625000 2028/1/13	1.95%
25	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	21,506,000	104.81 22,542,589	105.20 22,625,817	4.000000 2024/2/26	1.95%
26	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,506,000	107.25 23,065,185	104.95 22,570,547	4.750000 2044/3/8	1.94%
27	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,506,000	104.25 22,422,155	104.93 22,566,890	3.600000 2025/1/30	1.94%
28	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	21,506,000	100.85 21,688,801	104.50 22,473,985	5.875000 2025/9/16	1.93%
29	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,506,000	105.12 22,608,397	104.21 22,413,123	4.600000 2046/1/23	1.93%
30	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	21,506,000	106.00 22,796,575	104.05 22,376,993	4.600000 2048/2/10	1.92%

（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	97.63
	小計		97.63
合計（対純資産総額比）			97.63

（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】

「<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)」

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」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(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」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

「<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)」

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」

(2020年5月29日現在)

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 0206月	買建	486	6,919,877,300	7,576,740,000	5.55%

(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あります。

(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」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(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」

(2020年5月29日現在)

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数 先物取引	シカゴ商品取引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T U R E 2 0 2 0 0 6	買建	360	5,683,878,806	5,880,170,520	2.47%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 2 0 2 0 0 6	買建	419	1,454,346,426	1,543,386,332	0.65%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E 2 0 2 0 0 6	買建	72	574,371,634	593,904,038	0.25%

(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あります。

(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」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」

(2020年5月29日現在)

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	N Y S E L I F F E U S	M I N I M S C I E M I N D E X F U T U R E 2 0 2 0 0 6	買建	69	313,473,122	340,298,578	16.03%

(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あります。

(注2) 先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

(参考情報)

「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

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

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	123,377,684	123,377,684	1.0166	1.0166
第2計算期間末 (2019年11月20日)	240,300,010	240,300,010	1.1250	1.1250
2019年5月末日	193,211,805	-	1.0388	-
6月末日	207,842,985	-	1.0613	-
7月末日	209,049,117	-	1.0777	-
8月末日	215,198,686	-	1.0643	-
9月末日	219,325,425	-	1.0933	-
10月末日	236,949,178	-	1.1236	-
11月末日	242,443,660	-	1.1335	-
12月末日	256,435,718	-	1.1454	-
2020年1月末日	273,747,913	-	1.1473	-
2月末日	273,901,900	-	1.1003	-
3月末日	234,433,035	-	0.9703	-
4月末日	247,641,752	-	1.0050	-
5月末日	261,508,743	-	1.0412	-

## 【分配の推移】

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

	1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11月21日～ 2020年5月20日	-

## 【収益率の推移】

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

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	10.7
2019年11月21日～ 2020年5月20日	10.0

(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】

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

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	155,808,418	34,441,297	121,367,121
第2計算期間	186,191,794	93,957,053	213,601,862
2019年11月21日～ 2020年5月20日	95,098,650	59,077,902	249,622,610

(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

2020年5月末現在

### ● 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,412円
純資産総額	261百万円

### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
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。

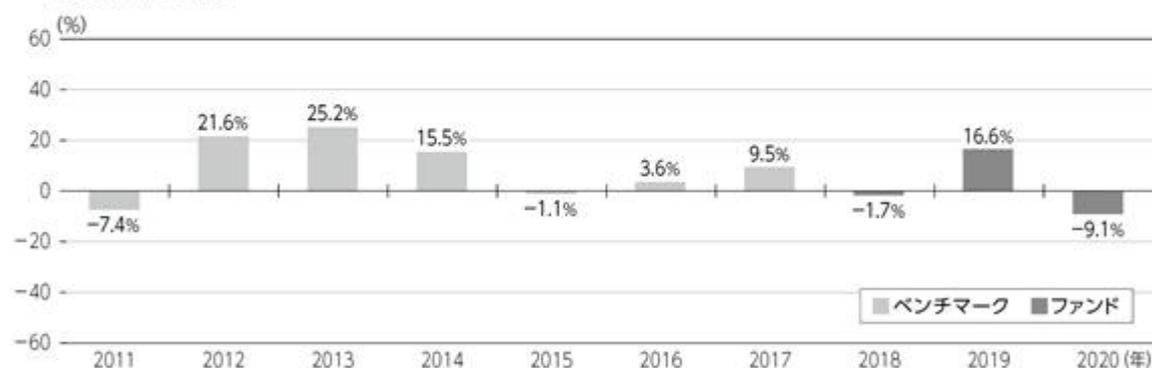
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

### ● 資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

### ● 年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2018年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2020年5月末現在

## 3.運用実績

## ●マザーファンドの状況

## 1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.4%
2	ソニー	2.0%
3	キーエンス	1.8%
4	ソフトバンクグループ	1.7%
5	武田薬品工業	1.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	3.7%
2	マイクロソフト	情報技術	3.5%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.7%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.5%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.2%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 3. ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	6.7%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	5.8%
3	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	4.7%
4	サムスン電子	情報技術	3.8%
5	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	2.7%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。「その他」にはETFを含みます。

## 4. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.3%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第349回 利付国債(10年)	2027/12/20	0.100%	0.8%
4	第351回 利付国債(10年)	2028/06/20	0.100%	0.8%
5	第334回 利付国債(10年)	2024/06/20	0.600%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	14.5%
2	情報・通信業	9.5%
3	輸送用機器	7.3%
4	化学	7.3%
5	医薬品	7.1%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	71.2%
2	イギリス	5.0%
3	フランス	3.7%
4	スイス	3.5%
5	カナダ	3.4%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	38.6%
2	台湾	12.3%
3	韓国	12.0%
4	インド	8.0%
5	ブラジル	5.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入比率

種別	比率
債券	100.6%
債券先物	-
現金、その他	-0.6%

・比率は対純資産総額比です。

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

## 3.運用実績

2020年5月末現在

## 5. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2021/11/15	2.000%	1.0%
2	アメリカ国債	米ドル	2024/05/15	2.500%	0.9%
3	アメリカ国債	米ドル	2021/08/15	2.125%	0.9%
4	アメリカ国債	米ドル	2024/08/15	2.375%	0.9%
5	アメリカ国債	米ドル	2024/11/15	2.250%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	45.9%
2	フランス	10.0%
3	イタリア	9.0%
4	ドイツ	7.4%
5	イギリス	6.7%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

## 6. ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	ロシア国債	米ドル	2047/06/23	5.250%	5.1%
2	インドネシア国債	米ドル	2047/01/08	5.250%	2.9%
3	コロンビア国債	米ドル	2037/09/18	7.375%	2.6%
4	クロアチア国債	米ドル	2024/01/26	6.000%	2.6%
5	ロシア国債	米ドル	2035/03/28	5.100%	2.4%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	メキシコ	16.7%
2	インドネシア	15.0%
3	ロシア	14.9%
4	ブラジル	11.4%
5	コロンビア	10.3%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

## 7. ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.4%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.7%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.2%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	4.9%
5	大和ハウスリート投資法人	4.3%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## 組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.7%
短期金融資産等	1.3%

・比率は対純資産総額比です。

## 8. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.5%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.8%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.7%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.8%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	75.9%
2	オーストラリア	6.7%
3	イギリス	5.4%
4	シンガポール	3.9%
5	フランス	2.3%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

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

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

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

#### 取扱コース

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

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

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

ありません。

#### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

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

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

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

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

#### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

#### 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

#### 信託財産留保額

ありません。

#### 支払開始日

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として8営業日目からお支払いします。

#### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

#### (5)【その他】

繰上償還

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

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

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

#### 約款の変更等

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

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

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

##### (2) 償還金に対する請求権

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

##### (3) 解約請求権

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

##### (4) 帳簿閲覧権

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

##### (5) 書面決議における議決権

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

##### (6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

### 第3【ファンドの経理状況】

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

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

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

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2018年11月20日現在)	第2期 (2019年11月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	18,411	4,373
コール・ローン	25,615	175,878
親投資信託受益証券	123,378,301	240,301,163
未収入金	320,469	1,315,198
流動資産合計	123,742,796	241,796,612
資産合計	123,742,796	241,796,612
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	316,158	1,307,255
未払受託者報酬	5,692	23,645
未払委託者報酬	40,459	164,593
その他未払費用	2,803	1,109
流動負債合計	365,112	1,496,602
負債合計	365,112	1,496,602
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	121,367,121	213,601,862
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,010,563	26,698,148
純資産合計	123,377,684	240,300,010
負債純資産合計	123,742,796	241,796,612

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2018年2月13日 至2018年11月20日)	第2期 (自2018年11月21日 至2019年11月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	121,708	21,197,797
営業収益合計	121,708	21,197,797
営業費用		
支払利息	-	7
受託者報酬	11,849	40,324
委託者報酬	99,124	280,797
その他費用	5,822	1,846
営業費用合計	116,795	322,974
営業利益又は営業損失( )	4,913	20,874,823
経常利益又は経常損失( )	4,913	20,874,823
当期純利益又は当期純損失( )	4,913	20,874,823
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	470,424	3,552,822
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	2,010,563
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,801,481	9,872,808
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,801,481	9,872,808
剰余金減少額又は欠損金増加額	325,407	2,507,224
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	325,407	2,507,224
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,010,563	26,698,148

## ( 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	第2期
	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1 . 受益権総口数	121,367,121口	213,601,862口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0166円 (10,166円)	1.1250円 (11,250円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期	第2期
	自2018年2月13日 至2018年11月20日	自2018年11月21日 至2019年11月20日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,010,563円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は2,010,563円(1口当たり0.016566円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(17,046,606円)、収益調整金(9,651,549円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は26,698,155円(1口当たり0.124990円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自2018年2月13日 至2018年11月20日	第2期 自2018年11月21日 至2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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	第2期
	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	510,559	16,605,006
合計	510,559	16,605,006

(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	第2期
	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
期首元本額	1,000,000円	121,367,121円
期中追加設定元本額	154,808,418円	186,191,794円
期中一部解約元本額	34,441,297円	93,957,053円

(4)【附属明細表】(2019年11月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	16,706,927	30,323,072	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	29,860,218	29,690,014	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	15,250,397	29,573,569	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	16,196,854	30,799,937	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	21,545,383	29,739,092	
	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	25,749,136	29,755,701	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	32,645,881	30,536,957	
	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	26,671,565	29,882,821	
親投資信託受益証券 合計		184,626,361	240,301,163	
合計		184,626,361	240,301,163	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

開示対象ファンド（＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型））は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

### 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

#### 貸借対照表

（単位：円）

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	471,797,753	26,133,173
コール・ローン	656,414,314	1,051,065,921
株式	54,651,417,270	66,020,728,200
派生商品評価勘定	2,849,740	32,833,040
未収配当金	473,077,219	614,918,502
前払金	9,685,000	-
差入委託証拠金	44,625,000	44,640,000
流動資産合計	56,309,866,296	67,790,318,836
資産合計	56,309,866,296	67,790,318,836
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,605,640	7,164,100
前受金	-	29,905,000
未払解約金	118,516,537	222,978,912
その他未払費用	36,709	6,068
流動負債合計	145,158,886	260,054,080
負債合計	145,158,886	260,054,080
純資産の部		
元本等		
元本	33,015,590,469	37,206,074,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,149,116,941	30,324,190,739
純資産合計	56,164,707,410	67,530,264,756
負債純資産合計	56,309,866,296	67,790,318,836

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1 . 受益権総口数	33,015,590,469口	37,206,074,017口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7012円 (17,012円)	1.8150円 (18,150円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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11月20日現在	2019年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,203,418,286	3,259,262,001
合計	4,203,418,286	3,259,262,001

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	2018年11月20日 現在			2019年11月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	1,547,375,000	-	1,573,095,000	25,720,000
合計	1,402,410,000	-	1,378,700,000	23,710,000	1,547,375,000	-	1,573,095,000	25,720,000

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	27,646,429,664円	33,015,590,469円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	11,710,957,645円	14,648,507,258円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	6,341,796,840円	10,458,023,710円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,091,055,877円	6,469,503,110円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	5,174,155,540円	4,561,011,771円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,502,125円	-円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,135,818円	4,059,132円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,126,664,808円	1,460,555,576円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,002,161,723円	5,163,139,062円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,800,194,280円	3,451,105,833円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	12,096,632円	8,469,605円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,290,695円	37,232,083円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,317,865円	44,296,788円
DCニッセイ国内株式インデックス	145,946,565円	313,570,047円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	12,044,346,864円	14,584,098,618円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	407,253,399円	626,761,958円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	17,881,836円	83,670,627円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,201,733円	75,262,010円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,809,183円	55,166,663円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	14,634,712円	111,903,417円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,304,455円	34,041,324円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	14,120,028円	41,445,869円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,504,084円	25,474,150円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,655,590円	3,591,265円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	598,026円	1,026,689円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	880,678円	2,865,527円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	8,877,953円	16,706,927円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	5,863,187円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	5,563,574円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	9,335,459円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	10,353,746円
計	33,015,590,469円	37,206,074,017円

## 附属明細表(2019年11月20日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,300	2,895.00	3,763,500	
日本水産	37,600	618.00	23,236,800	
マルハニチロ	5,400	2,924.00	15,789,600	
カネコ種苗	1,200	1,535.00	1,842,000	
サカタのタネ	4,500	3,625.00	16,312,500	
ホクト	2,900	1,937.00	5,617,300	
ヒノキヤグループ	900	2,220.00	1,998,000	
ショーボンドホールディングス	5,400	4,275.00	23,085,000	
ミライト・ホールディングス	11,200	1,706.00	19,107,200	
タマホーム	1,800	2,010.00	3,618,000	
ファーストコーポレーション	2,500	708.00	1,770,000	
スペースバリューホールディングス	4,600	516.00	2,373,600	
住石ホールディングス	6,200	145.00	899,000	
日鉄鉱業	900	4,570.00	4,113,000	
三井松島ホールディングス	1,500	1,220.00	1,830,000	
国際石油開発帝石	150,600	1,009.00	151,955,400	
石油資源開発	4,900	2,834.00	13,886,600	
K&Oエナジーグループ	1,800	1,567.00	2,820,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	926.00	1,759,400	
安藤・間	22,400	936.00	20,966,400	
東急建設	11,000	810.00	8,910,000	
コムシスホールディングス	13,300	3,255.00	43,291,500	
ミサワホーム	2,600	1,187.00	3,086,200	
ビーアールホールディングス	4,100	474.00	1,943,400	
高松コンストラクショングループ	2,300	2,711.00	6,235,300	
東建コーポレーション	1,200	7,200.00	8,640,000	
ヤマウラ	2,000	875.00	1,750,000	
大成建設	28,900	4,130.00	119,357,000	
大林組	86,700	1,170.00	101,439,000	
清水建設	88,000	1,057.00	93,016,000	
飛鳥建設	2,500	1,401.00	3,502,500	
長谷工コーポレーション	33,600	1,393.00	46,804,800	
松井建設	3,400	786.00	2,672,400	
銭高組	400	4,025.00	1,610,000	
鹿島建設	68,100	1,438.00	97,927,800	
不動テトラ	2,300	1,524.00	3,505,200	
大末建設	1,100	950.00	1,045,000	
鉄建建設	1,900	2,906.00	5,521,400	
西松建設	6,700	2,365.00	15,845,500	
三井住友建設	20,900	596.00	12,456,400	
大豊建設	1,900	2,960.00	5,624,000	
前田建設工業	21,700	970.00	21,049,000	
佐田建設	4,200	403.00	1,692,600	
ナカノフドー建設	3,500	473.00	1,655,500	
奥村組	4,700	2,958.00	13,902,600	
東鉄工業	3,700	3,285.00	12,154,500	
浅沼組	1,000	4,375.00	4,375,000	
戸田建設	36,000	672.00	24,192,000	
熊谷組	4,000	3,235.00	12,940,000	
北野建設	600	2,673.00	1,603,800	
植木組	700	2,561.00	1,792,700	
矢作建設工業	3,800	764.00	2,903,200	
ピーエス三菱	2,900	694.00	2,012,600	
日本ハウスホールディングス	5,900	499.00	2,944,100	

大東建託	10,400	13,620.00	141,648,000
新日本建設	3,700	926.00	3,426,200
NIPPPO	7,200	2,254.00	16,228,800
東亜道路工業	500	3,620.00	1,810,000
前田道路	9,200	2,483.00	22,843,600
日本道路	800	6,940.00	5,552,000
東亜建設工業	2,700	1,519.00	4,101,300
日本国土開発	5,100	632.00	3,223,200
若築建設	1,600	1,680.00	2,688,000
東洋建設	9,700	500.00	4,850,000
五洋建設	34,400	638.00	21,947,200
世紀東急工業	4,200	867.00	3,641,400
福田組	1,000	4,705.00	4,705,000
住友林業	22,000	1,566.00	34,452,000
日本基礎技術	4,600	403.00	1,853,800
巴コーポレーション	4,100	412.00	1,689,200
大和ハウス工業	85,800	3,299.00	283,054,200
ライト工業	5,000	1,591.00	7,955,000
積水ハウス	94,800	2,373.50	225,007,800
日特建設	2,500	805.00	2,012,500
ユアテック	5,000	680.00	3,400,000
四電工	600	2,758.00	1,654,800
中電工	3,500	2,542.00	8,897,000
関電工	12,300	1,065.00	13,099,500
きんでん	20,600	1,682.00	34,649,200
東京エネシス	2,900	929.00	2,694,100
トーエネック	900	3,695.00	3,325,500
住友電設	2,400	2,352.00	5,644,800
日本電設工業	4,800	2,242.00	10,761,600
協和エクシオ	13,100	2,900.00	37,990,000
新日本空調	2,300	2,180.00	5,014,000
日本工営	1,800	3,405.00	6,129,000
九電工	6,100	3,600.00	21,960,000
三機工業	6,200	1,452.00	9,002,400
日揮ホールディングス	26,700	1,633.00	43,601,100
中外炉工業	1,000	1,733.00	1,733,000
ヤマト	2,800	728.00	2,038,400
太平電業	2,100	2,300.00	4,830,000
高砂熱学工業	7,500	1,910.00	14,325,000
三晃金属工業	700	2,559.00	1,791,300
NEC ネットエスアイ	2,600	3,490.00	9,074,000
朝日工業社	600	3,270.00	1,962,000
明星工業	5,600	900.00	5,040,000
大気社	4,200	3,620.00	15,204,000
ダイダン	2,100	2,606.00	5,472,600
日比谷総合設備	2,800	1,917.00	5,367,600
東芝プラントシステム	6,700	2,664.00	17,848,800
日本製粉	8,100	1,723.00	13,956,300
日清製粉グループ本社	31,300	2,157.00	67,514,100
昭和産業	2,500	3,200.00	8,000,000
鳥越製粉	2,500	945.00	2,362,500
中部飼料	3,400	1,299.00	4,416,600
フィード・ワン	18,600	164.00	3,050,400
東洋精糖	1,500	1,132.00	1,698,000
日本甜菜製糖	1,400	2,070.00	2,898,000
三井製糖	2,400	2,322.00	5,572,800
塩水港精糖	8,100	220.00	1,782,000
日新製糖	1,300	1,996.00	2,594,800
LIFULL	9,200	555.00	5,106,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	2,042.00	3,675,600

日本M&Aセンター	19,900	3,600.00	71,640,000
メンバーズ	800	2,485.00	1,988,000
タケエイ	2,500	1,217.00	3,042,500
トラスト・テック	2,900	1,387.00	4,022,300
コシダカホールディングス	6,400	1,617.00	10,348,800
パソナグループ	3,200	1,642.00	5,254,400
C D S	1,200	1,540.00	1,848,000
リンクアンドモチベーション	5,800	739.00	4,286,200
G C A	3,200	955.00	3,056,000
エス・エム・エス	8,200	2,896.00	23,747,200
サニーサイドアップ	1,800	1,059.00	1,906,200
パーソルホールディングス	26,400	2,001.00	52,826,400
リニカル	1,800	1,007.00	1,812,600
クックパッド	9,200	388.00	3,569,600
アイ・ケイ・ケイ	2,500	711.00	1,777,500
森永製菓	6,600	5,710.00	37,686,000
中村屋	700	4,515.00	3,160,500
江崎グリコ	8,200	5,150.00	42,230,000
名糖産業	1,400	1,318.00	1,845,200
井村屋グループ	1,200	2,076.00	2,491,200
不二家	1,500	2,120.00	3,180,000
山崎製パン	20,800	1,956.00	40,684,800
モロゾフ	500	4,955.00	2,477,500
亀田製菓	1,600	5,040.00	8,064,000
寿スピリッツ	2,700	7,770.00	20,979,000
カルビー	12,600	3,600.00	45,360,000
森永乳業	5,100	4,605.00	23,485,500
六甲バター	1,800	1,770.00	3,186,000
ヤクルト本社	19,100	6,300.00	120,330,000
明治ホールディングス	18,300	7,480.00	136,884,000
雪印メグミルク	6,700	2,698.00	18,076,600
プリマハム	4,300	2,565.00	11,029,500
日本ハム	10,600	4,725.00	50,085,000
林兼産業	2,800	719.00	2,013,200
丸大食品	3,000	2,384.00	7,152,000
S F o o d s	2,200	2,984.00	6,564,800
伊藤ハム米久ホールディングス	17,900	704.00	12,601,600
スタジオアリス	1,300	1,898.00	2,467,400
シミックホールディングス	1,500	1,741.00	2,611,500
システナ	9,700	1,748.00	16,955,600
N J S	1,000	1,728.00	1,728,000
デジタルアーツ	1,300	6,020.00	7,826,000
日鉄ソリューションズ	4,100	3,735.00	15,313,500
総合警備保障	10,500	5,610.00	58,905,000
いちご	34,700	422.00	14,643,400
日本駐車場開発	29,900	170.00	5,083,000
コア	1,300	1,420.00	1,846,000
カカクコム	19,800	2,542.00	50,331,600
セントケア・ホールディング	3,400	515.00	1,751,000
ルネサンス	1,500	1,695.00	2,542,500
ディップ	3,700	3,025.00	11,192,500
S B Sホールディングス	2,400	1,946.00	4,670,400
オプトホールディング	1,400	1,770.00	2,478,000
新日本科学	2,900	846.00	2,453,400
ツクイ	6,200	575.00	3,565,000
ベネフィット・ワン	7,200	2,294.00	16,516,800
エムスリー	58,200	2,929.00	170,467,800
ツカダ・グローバルホールディング	2,900	637.00	1,847,300
アウトソーシング	15,100	1,153.00	17,410,300
ウェルネット	2,500	807.00	2,017,500

ワールドホールディングス	1,000	1,850.00	1,850,000
ディー・エヌ・エー	12,900	1,757.00	22,665,300
博報堂DYホールディングス	36,700	1,808.00	66,353,600
ぐるなび	4,600	1,033.00	4,751,800
タカミヤ	2,800	739.00	2,069,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	1,106.00	1,990,800
ファンコミュニケーションズ	7,300	519.00	3,788,700
ライク	1,000	1,714.00	1,714,000
ビジネス・ブレークスルー	4,900	339.00	1,661,100
エスプール	5,100	670.00	3,417,000
WDBホールディングス	1,200	2,738.00	3,285,600
パリュコマース	1,500	1,866.00	2,799,000
インフォマート	14,500	1,922.00	27,869,000
サッポロホールディングス	9,500	2,666.00	25,327,000
アサヒグループホールディングス	58,100	5,350.00	310,835,000
麒麟ホールディングス	117,700	2,505.50	294,897,350
宝ホールディングス	20,800	1,056.00	21,964,800
オエノンホールディングス	7,400	389.00	2,878,600
養命酒製造	900	1,968.00	1,771,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	19,500	2,733.00	53,293,500
サントリー食品インターナショナル	18,600	4,800.00	89,280,000
ダイドーグループホールディングス	1,400	4,595.00	6,433,000
伊藤園	8,400	5,430.00	45,612,000
キーコーヒー	2,700	2,441.00	6,590,700
日清オイリオグループ	3,600	4,005.00	14,418,000
不二製油グループ本社	6,800	3,210.00	21,828,000
かどや製油	500	3,805.00	1,902,500
J-オイルミルズ	1,400	4,540.00	6,356,000
ローソン	6,900	5,980.00	41,262,000
サンエー	2,300	5,130.00	11,799,000
カワチ薬品	2,100	2,330.00	4,893,000
エービーシー・マート	4,300	7,410.00	31,863,000
ハードオフコーポレーション	2,200	806.00	1,773,200
高千穂交易	1,600	1,102.00	1,763,200
アスクル	2,800	2,906.00	8,136,800
ゲオホールディングス	4,900	1,343.00	6,580,700
アダストリア	3,800	2,629.00	9,990,200
ジーフット	2,800	622.00	1,741,600
伊藤忠食品	700	5,210.00	3,647,000
くら寿司	1,400	4,720.00	6,608,000
キャンドウ	1,300	1,644.00	2,137,200
エレマテック	2,500	1,041.00	2,602,500
パルグループホールディングス	1,400	3,480.00	4,872,000
JALUX	800	2,545.00	2,036,000
エディオン	12,500	1,189.00	14,862,500
あらた	2,200	4,305.00	9,471,000
サーラコーポレーション	5,500	639.00	3,514,500
トーマンデバイス	700	2,770.00	1,939,000
ハローズ	1,000	2,518.00	2,518,000
JPホールディングス	8,300	304.00	2,523,200
フジオフードシステム	1,100	3,585.00	3,943,500
あみやき亭	600	3,575.00	2,145,000
東京エレクトロン デバイス	1,000	2,200.00	2,200,000
ひらまつ	5,500	306.00	1,683,000
フィールズ	3,500	488.00	1,708,000
双日	150,400	341.00	51,286,400
アルフレッサ ホールディングス	30,300	2,498.00	75,689,400
大黒天物産	700	3,245.00	2,271,500
ハニーズホールディングス	2,400	1,416.00	3,398,400

キッコーマン	20,000	5,490.00	109,800,000
味の素	61,300	1,833.00	112,362,900
キュービー	15,400	2,489.00	38,330,600
ハウス食品グループ本社	10,400	3,965.00	41,236,000
カゴメ	10,500	2,718.00	28,539,000
アリアケジャパン	2,500	7,910.00	19,775,000
ピエトロ	1,100	1,641.00	1,805,100
エバラ食品工業	800	2,174.00	1,739,200
ニチレイ	13,200	2,523.00	33,303,600
横浜冷凍	7,600	1,105.00	8,398,000
東洋水産	14,300	4,795.00	68,568,500
イトアンド	1,000	1,792.00	1,792,000
大冷	900	1,992.00	1,792,800
日清食品ホールディングス	11,800	8,280.00	97,704,000
永谷園ホールディングス	1,400	2,172.00	3,040,800
一正蒲鉾	1,600	1,097.00	1,755,200
フジッコ	3,000	1,981.00	5,943,000
ロック・フィールド	3,000	1,513.00	4,539,000
日本たばこ産業	160,200	2,465.00	394,893,000
ケンコーマヨネーズ	1,600	2,790.00	4,464,000
わらべや日洋ホールディングス	1,800	1,870.00	3,366,000
なとり	1,500	1,709.00	2,563,500
北の達人コーポレーション	9,700	666.00	6,460,200
ユーグレナ	11,800	779.00	9,192,200
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,754.00	2,455,600
片倉工業	3,900	1,396.00	5,444,400
ゲンゼ	2,000	5,100.00	10,200,000
ヒューリック	58,200	1,183.00	68,850,600
ラサ商事	2,000	874.00	1,748,000
アルペン	2,100	1,798.00	3,775,800
クオールホールディングス	4,000	1,574.00	6,296,000
アルコニックス	2,900	1,513.00	4,387,700
神戸物産	9,400	3,360.00	31,584,000
ジンズホールディングス	1,400	6,600.00	9,240,000
ビックカメラ	16,100	1,210.00	19,481,000
D C Mホールディングス	14,700	1,068.00	15,699,600
ペッパーフードサービス	2,200	1,396.00	3,071,200
Monotaro	19,400	3,100.00	60,140,000
東京一番フーズ	2,900	625.00	1,812,500
DDホールディングス	1,200	1,470.00	1,764,000
あいホールディングス	3,900	2,050.00	7,995,000
ディー・ビー・エックス	1,900	943.00	1,791,700
きちりホールディングス	2,100	874.00	1,835,400
アークランドサービスホールディングス	2,000	1,881.00	3,762,000
J・フロントリテイリング	32,500	1,447.00	47,027,500
ドトール・日レスホールディングス	4,300	2,215.00	9,524,500
マツモトキヨシホールディングス	11,300	4,225.00	47,742,500
ブロンコビリー	1,400	2,677.00	3,747,800
ZOZO	26,700	2,318.00	61,890,600
物語コーポレーション	700	8,560.00	5,992,000
ココカラファイン	2,800	6,570.00	18,396,000
三越伊勢丹ホールディングス	47,600	989.00	47,076,400
東洋紡	10,700	1,608.00	17,205,600
ユニチカ	7,900	364.00	2,875,600
富士紡ホールディングス	1,300	3,275.00	4,257,500
日清紡ホールディングス	18,400	968.00	17,811,200
倉敷紡績	2,800	2,531.00	7,086,800
ダイワボウホールディングス	2,300	5,140.00	11,822,000
シキボウ	1,800	937.00	1,686,600
日東紡績	4,100	3,895.00	15,969,500

トヨタ紡織	8,100	1,715.00	13,891,500
マクニカ・富士エレホールディングス	6,500	1,787.00	11,615,500
H a m e e	1,500	1,319.00	1,978,500
ラクト・ジャパン	1,000	3,500.00	3,500,000
ウエルシアホールディングス	8,100	6,990.00	56,619,000
クリエイトSDホールディングス	4,000	2,688.00	10,752,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,100	1,112.00	5,671,200
八洲電機	2,100	882.00	1,852,200
レスターホールディングス	2,800	1,926.00	5,392,800
ジューテックホールディングス	1,600	1,099.00	1,758,400
丸善CHIホールディングス	4,700	376.00	1,767,200
OCHIホールディングス	1,300	1,390.00	1,807,000
TOKAIホールディングス	14,400	1,078.00	15,523,200
ミサワ	1,900	843.00	1,601,700
ティーライフ	2,000	857.00	1,714,000
C o m i n i x	2,200	820.00	1,804,000
三洋貿易	1,400	2,315.00	3,241,000
チムニー	800	2,342.00	1,873,600
シュッピン	1,900	1,063.00	2,019,700
ビューティガレージ	1,100	1,917.00	2,108,700
ウイン・パートナーズ	2,000	1,518.00	3,036,000
ネクステージ	3,900	1,137.00	4,434,300
ジョイフル本田	8,000	1,465.00	11,720,000
鳥貴族	900	1,978.00	1,780,200
キリン堂ホールディングス	1,100	2,086.00	2,294,600
ホットランド	1,800	1,253.00	2,255,400
すかいらくホールディングス	30,500	2,171.00	66,215,500
SFPホールディングス	1,200	2,278.00	2,733,600
綿半ホールディングス	1,000	2,050.00	2,050,000
日本毛織	8,900	1,085.00	9,656,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,900	983.00	7,765,700
三栄建築設計	1,100	1,571.00	1,728,100
野村不動産ホールディングス	16,500	2,577.00	42,520,500
三重交通グループホールディングス	5,500	607.00	3,338,500
サムティ	3,900	2,122.00	8,275,800
ディア・ライフ	3,500	563.00	1,970,500
コーセーアールイー	2,200	791.00	1,740,200
日本商業開発	1,700	1,555.00	2,643,500
プレサンスコーポレーション	4,300	1,726.00	7,421,800
ユニゾホールディングス	4,100	4,985.00	20,438,500
T H E グローバル社	3,700	469.00	1,735,300
日本管理センター	1,800	1,332.00	2,397,600
サンセイランディック	1,900	858.00	1,630,200
エストラスト	2,200	790.00	1,738,000
フージャースホールディングス	5,400	703.00	3,796,200
オープンハウス	7,900	3,340.00	26,386,000
東急不動産ホールディングス	74,100	700.00	51,870,000
飯田グループホールディングス	22,700	1,867.00	42,380,900
イーグランド	2,200	767.00	1,687,400
ムゲンエステート	2,500	713.00	1,782,500
帝国繊維	3,000	2,022.00	6,066,000
日本コークス工業	23,300	82.00	1,910,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,500	653.00	1,632,500
B E E N O S	1,300	1,702.00	2,212,600
あさひ	2,000	1,240.00	2,480,000
日本調剤	800	3,915.00	3,132,000
コスモス薬品	1,200	22,990.00	27,588,000
シップヘルスケアホールディングス	4,400	4,585.00	20,174,000

ソフトクリエイトホールディングス	1,200	1,820.00	2,184,000
オンリー	2,200	806.00	1,773,200
セブン&アイ・ホールディングス	106,500	4,123.00	439,099,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,300	1,882.00	13,738,600
明治電機工業	1,100	1,534.00	1,687,400
ツルハホールディングス	5,900	12,810.00	75,579,000
サンマルクホールディングス	2,200	2,371.00	5,216,200
フェリシモ	1,700	1,059.00	1,800,300
トリドールホールディングス	3,400	3,105.00	10,557,000
帝人	22,100	2,053.00	45,371,300
東レ	196,000	738.70	144,785,200
クラレ	42,600	1,314.00	55,976,400
旭化成	180,600	1,197.00	216,178,200
サカイオーベックス	900	1,782.00	1,603,800
T O K Y O B A S E	2,500	703.00	1,757,500
稲葉製作所	1,500	1,434.00	2,151,000
宮地エンジニアリンググループ	800	2,091.00	1,672,800
トーカロ	7,600	1,098.00	8,344,800
アルファ	1,300	1,309.00	1,701,700
S U M C O	32,700	1,685.00	55,099,500
川田テクノロジーズ	600	6,610.00	3,966,000
R S T e c h n o l o g i e s	800	3,745.00	2,996,000
ハウズドゥ	1,500	1,612.00	2,418,000
アグレ都市デザイン	3,500	506.00	1,771,000
ジェイ・エス・ビー	400	4,570.00	1,828,000
テンポイノベーション	1,100	1,623.00	1,785,300
住江織物	800	2,855.00	2,284,000
日本フェルト	3,600	498.00	1,792,800
イチカワ	1,100	1,541.00	1,695,100
芦森工業	1,100	1,409.00	1,549,900
アツギ	2,200	818.00	1,799,600
ジャパンミート	1,400	2,160.00	3,024,000
コメダホールディングス	5,900	2,099.00	12,384,100
サツドラホールディングス	1,000	1,791.00	1,791,000
パロックジャパンリミテッド	1,900	939.00	1,784,100
クスリのアオキホールディングス	2,700	8,800.00	23,760,000
スシローグローバルホールディングス	3,000	8,760.00	26,280,000
L I X I L ビバ	2,700	1,874.00	5,059,800
セーレン	6,700	1,513.00	10,137,100
ソトー	1,800	980.00	1,764,000
東海染工	1,600	1,133.00	1,812,800
小松マテーレ	4,400	840.00	3,696,000
ワコールホールディングス	7,100	2,866.00	20,348,600
ホギメディカル	3,100	3,605.00	11,175,500
クラウドシアホールディングス	3,600	484.00	1,742,400
T S I ホールディングス	9,100	566.00	5,150,600
マツオカコーポレーション	400	2,269.00	907,600
ワールド	3,800	2,844.00	10,807,200
T I S	9,000	6,370.00	57,330,000
電算システム	1,000	2,918.00	2,918,000
グリー	18,700	508.00	9,499,600
コーエーテクモホールディングス	5,500	2,558.00	14,069,000
三菱総合研究所	1,200	3,910.00	4,692,000
ボルテージ	3,300	530.00	1,749,000
電算	800	2,133.00	1,706,400
A G S	2,300	732.00	1,683,600
ファインデックス	2,300	936.00	2,152,800
ブレインパッド	500	5,500.00	2,750,000
K L a b	5,200	875.00	4,550,000

ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,300	1,056.00	3,484,800
ネクソン	77,200	1,465.00	113,098,000
アイスタイル	7,000	856.00	5,992,000
エムアップ	900	2,113.00	1,901,700
エイチーム	1,900	1,091.00	2,072,900
エニグモ	1,900	1,027.00	1,951,300
テクノスジャパン	3,600	493.00	1,774,800
コロブラ	8,900	1,279.00	11,383,100
ブロードリーフ	13,400	629.00	8,428,600
クロス・マーケティンググループ	4,700	375.00	1,762,500
デジタルハーツホールディングス	2,000	1,095.00	2,190,000
システム情報	1,800	988.00	1,778,400
メディアドゥホールディングス	900	3,460.00	3,114,000
じげん	6,700	525.00	3,517,500
フィックスターズ	2,900	1,348.00	3,909,200
CARTA HOLDINGS	1,400	1,403.00	1,964,200
オブティム	700	3,260.00	2,282,000
セレス	1,500	1,163.00	1,744,500
特種東海製紙	1,700	4,005.00	6,808,500
ティーガイア	2,400	2,627.00	6,304,800
セック	600	3,340.00	2,004,000
豆蔵ホールディングス	1,800	1,514.00	2,725,200
テクマトリックス	1,900	2,282.00	4,335,800
プロシップ	1,400	1,357.00	1,899,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,500	2,348.00	15,262,000
GMOペイメントゲートウェイ	4,500	7,400.00	33,300,000
ザッパラス	4,600	398.00	1,830,800
インターネットイニシアティブ	4,000	2,536.00	10,144,000
さくらインターネット	2,900	685.00	1,986,500
GMOクラウド	600	2,807.00	1,684,200
SRAホールディングス	1,400	2,552.00	3,572,800
朝日ネット	2,800	623.00	1,744,400
eBASE	1,600	1,203.00	1,924,800
アバント	1,000	2,011.00	2,011,000
アドソル日進	1,000	2,221.00	2,221,000
フリービット	2,100	900.00	1,890,000
コムチュア	3,000	2,385.00	7,155,000
サイバーコム	900	2,159.00	1,943,100
アステリア	2,700	627.00	1,692,900
王子ホールディングス	113,200	606.00	68,599,200
日本製紙	12,000	1,879.00	22,548,000
三菱製紙	1,900	507.00	963,300
北越コーポレーション	18,000	561.00	10,098,000
中越パルプ工業	1,100	1,652.00	1,817,200
大王製紙	11,900	1,488.00	17,707,200
阿波製紙	4,200	464.00	1,948,800
マークライNZ	1,400	2,242.00	3,138,800
メディカル・データ・ビジョン	2,100	1,036.00	2,175,600
gumi	3,500	668.00	2,338,000
モバイルファクトリー	1,200	1,455.00	1,746,000
テラスカイ	1,000	2,674.00	2,674,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,200	1,828.00	2,193,600
PCIホールディングス	800	2,244.00	1,795,200
ランドコンピュータ	1,600	1,146.00	1,833,600
ダブルスタンダード	300	5,810.00	1,743,000
オーブンドア	1,300	1,837.00	2,388,100
アカツキ	1,000	6,230.00	6,230,000

LINE	6,200	5,160.00	31,992,000
レンゴー	25,600	796.00	20,377,600
トーモク	1,700	1,791.00	3,044,700
ザ・パック	2,000	3,760.00	7,520,000
チェンジ	900	2,058.00	1,852,200
シンクロ・フード	3,400	520.00	1,768,000
オークネット	1,700	1,339.00	2,276,300
AOI TYO HOLDINGS	2,700	666.00	1,798,200
マクロミル	4,800	1,024.00	4,915,200
ビーグリー	1,800	1,247.00	2,244,600
オロ	700	4,020.00	2,814,000
昭和電工	19,300	3,075.00	59,347,500
住友化学	198,900	505.00	100,444,500
住友精化	1,200	3,575.00	4,290,000
日産化学	15,100	4,335.00	65,458,500
クレハ	2,300	6,570.00	15,111,000
多木化学	800	4,465.00	3,572,000
テイカ	2,000	1,931.00	3,862,000
石原産業	4,900	1,161.00	5,688,900
片倉コープアグリ	1,500	1,186.00	1,779,000
日本曹達	4,000	2,912.00	11,648,000
東ソー	41,800	1,596.00	66,712,800
トクヤマ	7,800	2,936.00	22,900,800
セントラル硝子	5,500	2,695.00	14,822,500
東亜合成	17,000	1,249.00	21,233,000
大阪ソーダ	2,800	3,010.00	8,428,000
関東電化工業	6,400	1,073.00	6,867,200
デンカ	9,900	3,310.00	32,769,000
イビデン	16,900	2,486.00	42,013,400
信越化学工業	47,700	11,665.00	556,420,500
日本カーバイド工業	1,200	1,460.00	1,752,000
堺化学工業	1,800	2,522.00	4,539,600
第一稀元素化学工業	2,900	835.00	2,421,500
エア・ウォーター	22,200	2,060.00	45,732,000
大陽日酸	26,000	2,534.00	65,884,000
日本化学工業	800	3,205.00	2,564,000
日本パーカライジング	13,700	1,176.00	16,111,200
高压ガス工業	4,300	816.00	3,508,800
四国化成工業	4,200	1,249.00	5,245,800
戸田工業	800	2,238.00	1,790,400
ステラ ケミファ	1,500	3,230.00	4,845,000
保土谷化学工業	1,000	3,700.00	3,700,000
日本触媒	4,200	6,730.00	28,266,000
大日精化工業	2,400	3,225.00	7,740,000
カネカ	7,000	3,600.00	25,200,000
協和キリン	27,800	2,269.00	63,078,200
三菱瓦斯化学	25,600	1,635.00	41,856,000
三井化学	24,600	2,637.00	64,870,200
JSR	25,200	2,014.00	50,752,800
東京応化工業	4,600	3,960.00	18,216,000
大阪有機化学工業	2,500	1,249.00	3,122,500
三菱ケミカルホールディングス	181,000	823.20	148,999,200
KHネオケム	4,800	2,440.00	11,712,000
ダイセル	37,000	1,084.00	40,108,000
住友ベークライト	4,300	4,535.00	19,500,500
積水化学工業	58,200	1,889.00	109,939,800
日本ゼオン	24,400	1,383.00	33,745,200
アイカ工業	8,100	3,370.00	27,297,000
宇部興産	13,700	2,314.00	31,701,800
積水樹脂	4,900	2,335.00	11,441,500

タキロンシーアイ	5,900	668.00	3,941,200
旭有機材	1,500	1,727.00	2,590,500
日立化成	12,500	3,410.00	42,625,000
ニチバン	1,400	1,905.00	2,667,000
リケンテクノス	6,800	509.00	3,461,200
大倉工業	1,300	2,000.00	2,600,000
積水化成成品工業	3,600	799.00	2,876,400
群栄化学工業	700	2,464.00	1,724,800
タイガースポリマー	3,000	585.00	1,755,000
ダイキョーニシカワ	5,700	847.00	4,827,900
竹本容器	1,800	988.00	1,778,400
森六ホールディングス	1,500	2,391.00	3,586,500
日本化薬	16,800	1,361.00	22,864,800
カーリットホールディングス	2,900	611.00	1,771,900
E P Sホールディングス	4,000	1,407.00	5,628,000
プレステージ・インターナショナル	9,900	928.00	9,187,200
プロトコーポレーション	2,400	1,055.00	2,532,000
アミューズ	1,400	2,998.00	4,197,200
野村総合研究所	45,300	2,390.00	108,267,000
クイック	1,600	1,588.00	2,540,800
T A C	7,800	227.00	1,770,600
C Eホールディングス	3,800	454.00	1,725,200
ケネディクス	25,100	576.00	14,457,600
電通	27,200	4,145.00	112,744,000
インテージホールディングス	3,400	942.00	3,202,800
東邦システムサイエンス	1,900	933.00	1,772,700
ぴあ	800	4,840.00	3,872,000
イオンファンタジー	1,000	3,350.00	3,350,000
ソースネクスト	12,900	487.00	6,282,300
シーティーエス	3,000	748.00	2,244,000
ネクシィーズグループ	900	1,978.00	1,780,200
インフォコム	3,000	2,371.00	7,113,000
メディカルシステムネットワーク	3,100	565.00	1,751,500
日本精化	2,200	1,269.00	2,791,800
扶桑化学工業	2,700	3,140.00	8,478,000
トリケミカル研究所	700	8,350.00	5,845,000
ラクスル	1,400	3,360.00	4,704,000
F I G	5,500	311.00	1,710,500
A D E K A	12,500	1,663.00	20,787,500
日油	10,200	3,670.00	37,434,000
ミヨシ油脂	1,400	1,272.00	1,780,800
新日本理化	8,600	215.00	1,849,000
ハリマ化成グループ	2,200	1,192.00	2,622,400
アルテリア・ネットワークス	3,000	1,525.00	4,575,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,100	1,614.00	1,775,400
花王	66,200	8,449.00	559,323,800
第一工業製薬	1,000	3,655.00	3,655,000
日華化学	1,900	902.00	1,713,800
ニイタカ	1,000	1,752.00	1,752,000
三洋化成工業	1,600	5,320.00	8,512,000
武田薬品工業	230,000	4,529.00	1,041,670,000
アステラス製薬	243,200	1,847.50	449,312,000
大日本住友製薬	20,500	2,140.00	43,870,000
塩野義製薬	35,300	6,435.00	227,155,500
田辺三菱製薬	33,700	2,002.00	67,467,400
わかもと製薬	6,400	276.00	1,766,400
あすか製薬	3,200	1,293.00	4,137,600
日本新薬	7,200	9,980.00	71,856,000
ビオフェルミン製薬	800	2,290.00	1,832,000

中外製薬	28,800	9,422.00	271,353,600
科研製薬	4,700	5,870.00	27,589,000
エーザイ	33,100	7,621.00	252,255,100
理研ビタミン	1,300	4,015.00	5,219,500
ロート製薬	14,200	3,500.00	49,700,000
小野薬品工業	65,300	2,443.00	159,527,900
久光製薬	8,200	5,240.00	42,968,000
有機合成薬品工業	6,200	293.00	1,816,600
持田製薬	3,800	4,460.00	16,948,000
参天製薬	51,500	2,060.00	106,090,000
扶桑薬品工業	1,000	2,066.00	2,066,000
ツムラ	8,600	3,250.00	27,950,000
日医工	7,800	1,282.00	9,999,600
テルモ	78,200	3,764.00	294,344,800
みらかホールディングス	7,400	2,758.00	20,409,200
キッセイ薬品工業	4,900	2,886.00	14,141,400
生化学工業	5,400	1,256.00	6,782,400
栄研化学	4,900	1,945.00	9,530,500
日水製薬	1,400	1,295.00	1,813,000
鳥居薬品	1,700	2,898.00	4,926,600
JCRファーマ	1,900	9,210.00	17,499,000
東和薬品	3,500	2,745.00	9,607,500
富士製薬工業	1,900	1,375.00	2,612,500
沢井製薬	5,700	6,500.00	37,050,000
ゼリア新薬工業	5,000	2,115.00	10,575,000
第一三共	79,100	6,765.00	535,111,500
キョーリン製薬ホールディングス	6,100	1,877.00	11,449,700
大幸薬品	1,100	3,040.00	3,344,000
ダイト	1,600	3,225.00	5,160,000
大塚ホールディングス	52,700	4,925.00	259,547,500
大正製薬ホールディングス	5,800	7,980.00	46,284,000
ペプチドリーム	14,000	5,120.00	71,680,000
大日本塗料	3,100	1,132.00	3,509,200
日本ペイントホールディングス	22,300	6,150.00	137,145,000
関西ペイント	30,400	2,773.00	84,299,200
中国塗料	7,700	1,020.00	7,854,000
日本特殊塗料	2,000	1,407.00	2,814,000
藤倉化成	3,700	581.00	2,149,700
太陽ホールディングス	2,000	4,275.00	8,550,000
DIC	11,400	2,970.00	33,858,000
サカタインクス	5,900	1,156.00	6,820,400
東洋インキSCホールディングス	5,700	2,667.00	15,201,900
T&K TOKA	2,100	1,010.00	2,121,000
アルプス技研	2,300	1,723.00	3,962,900
サニックス	4,600	444.00	2,042,400
日本空調サービス	2,800	746.00	2,088,800
オリエンタルランド	28,100	15,385.00	432,318,500
フォーカスシステムズ	2,000	898.00	1,796,000
ダスキン	6,800	2,868.00	19,502,400
パーク24	14,600	2,492.00	36,383,200
明光ネットワークジャパン	3,100	1,003.00	3,109,300
ファルコホールディングス	1,500	1,734.00	2,601,000
クレスコ	800	3,345.00	2,676,000
フジ・メディア・ホールディングス	26,100	1,533.00	40,011,300
秀英予備校	4,000	447.00	1,788,000
ラウンドワン	7,400	1,145.00	8,473,000
リゾートトラスト	12,100	1,816.00	21,973,600
オービック	9,400	14,470.00	136,018,000
ジャストシステム	4,400	5,490.00	24,156,000
TDCソフト	2,400	934.00	2,241,600

Zホールディングス	372,500	383.00	142,667,500
ビー・エム・エル	3,400	3,215.00	10,931,000
トレンドマイクロ	12,100	5,770.00	69,817,000
りらいあコミュニケーションズ	4,800	1,464.00	7,027,200
IDホールディングス	1,300	1,436.00	1,866,800
リソー教育	12,100	409.00	4,948,900
日本オラクル	5,500	9,870.00	54,285,000
アルファシステムズ	800	2,826.00	2,260,800
フューチャー	3,300	1,879.00	6,200,700
CAC Holdings	1,800	1,518.00	2,732,400
SBテクノロジー	1,000	2,081.00	2,081,000
トーセ	2,000	880.00	1,760,000
ユー・エス・エス	29,600	2,091.00	61,893,600
オービックビジネスコンサルタント	2,800	4,665.00	13,062,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,400	2,984.00	37,001,600
アイティフォー	3,300	887.00	2,927,100
東計電算	500	3,395.00	1,697,500
サイバーエージェント	15,200	3,475.00	52,820,000
楽天	123,100	981.00	120,761,100
エクスネット	1,800	963.00	1,733,400
クリーク・アンド・リバー社	1,600	1,124.00	1,798,400
テー・オー・ダブリュー	2,300	833.00	1,915,900
大塚商会	14,700	4,485.00	65,929,500
サイボウズ	3,200	1,099.00	3,516,800
山田コンサルティンググループ	1,300	1,815.00	2,359,500
セントラルスポーツ	1,000	3,290.00	3,290,000
電通国際情報サービス	1,700	3,930.00	6,681,000
デジタルガレージ	4,900	3,940.00	19,306,000
イーエムシステムズ	1,900	2,159.00	4,102,100
ウェザーニューズ	900	3,470.00	3,123,000
C I J	2,000	919.00	1,838,000
ビジネスエンジニアリング	600	3,095.00	1,857,000
日本エンタープライズ	7,700	232.00	1,786,400
WOWOW	1,300	2,714.00	3,528,200
スカラ	2,100	794.00	1,667,400
フルキャストホールディングス	2,600	2,396.00	6,229,600
エン・ジャパン	4,700	5,210.00	24,487,000
富士フイルムホールディングス	53,000	5,127.00	271,731,000
コニカミノルタ	60,400	723.00	43,669,200
資生堂	54,900	8,001.00	439,254,900
ライオン	35,900	2,250.00	80,775,000
高砂香料工業	1,700	2,514.00	4,273,800
マンダム	6,200	2,914.00	18,066,800
ミルボン	3,700	5,940.00	21,978,000
ファンケル	11,200	3,095.00	34,664,000
コーセー	5,200	17,840.00	92,768,000
コタ	1,400	1,390.00	1,946,000
シーボン	700	2,515.00	1,760,500
ポーラ・オルビスホールディングス	11,800	2,600.00	30,680,000
ノエビアホールディングス	2,600	6,080.00	15,808,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	952.00	1,808,800
エステー	1,800	1,654.00	2,977,200
アグロ カネショウ	1,100	1,432.00	1,575,200
コニシ	4,500	1,472.00	6,624,000
長谷川香料	3,700	1,957.00	7,240,900
星光PMC	2,000	964.00	1,928,000
小林製薬	7,700	8,810.00	67,837,000
荒川化学工業	2,500	1,540.00	3,850,000
メック	1,900	1,772.00	3,366,800
日本高純度化学	800	2,630.00	2,104,000

タカラバイオ	7,200	2,200.00	15,840,000
JCU	3,300	2,776.00	9,160,800
新田ゼラチン	2,500	718.00	1,795,000
デクセリアルズ	7,100	1,066.00	7,568,600
アース製薬	2,100	5,690.00	11,949,000
北興化学工業	2,800	596.00	1,668,800
大成ラミック	900	2,920.00	2,628,000
クミアイ化学工業	11,400	1,004.00	11,445,600
日本農薬	4,900	559.00	2,739,100
富士興産	2,400	709.00	1,701,600
ニチレキ	3,300	1,314.00	4,336,200
ユシロ化学工業	1,600	1,394.00	2,230,400
ピーピー・カストロール	1,200	1,526.00	1,831,200
富士石油	7,300	238.00	1,737,400
MORESCO	700	1,352.00	946,400
出光興産	31,100	2,938.00	91,371,800
JXTGホールディングス	428,700	482.10	206,676,270
コスモエネルギーホールディングス	8,000	2,251.00	18,008,000
横浜ゴム	16,000	2,273.00	36,368,000
TOYO TIRE	15,900	1,558.00	24,772,200
ブリヂストン	85,000	4,330.00	368,050,000
住友ゴム工業	24,900	1,388.00	34,561,200
オカモト	1,700	4,165.00	7,080,500
アキレス	1,900	1,839.00	3,494,100
フコク	2,400	718.00	1,723,200
ニッタ	3,100	3,195.00	9,904,500
クリエートメディック	1,700	1,060.00	1,802,000
住友理工	5,400	997.00	5,383,800
三ツ星ベルト	3,600	2,089.00	7,520,400
バンドー化学	4,900	941.00	4,610,900
AGC	27,300	3,865.00	105,514,500
日本板硝子	13,200	632.00	8,342,400
石塚硝子	800	2,243.00	1,794,400
有沢製作所	4,400	985.00	4,334,000
日本山村硝子	1,300	1,252.00	1,627,600
日本電気硝子	11,100	2,387.00	26,495,700
オハラ	1,200	1,486.00	1,783,200
住友大阪セメント	5,200	4,780.00	24,856,000
太平洋セメント	17,500	3,195.00	55,912,500
リソルホールディングス	400	4,035.00	1,614,000
日本ヒューム	2,800	794.00	2,223,200
日本コンクリート工業	6,000	267.00	1,602,000
三谷セキサン	1,300	3,570.00	4,641,000
アジアパイルホールディングス	3,900	561.00	2,187,900
東海カーボン	29,000	1,043.00	30,247,000
日本カーボン	1,400	4,175.00	5,845,000
東洋炭素	1,600	2,368.00	3,788,800
ノリタケカンパニーリミテド	1,500	4,545.00	6,817,500
TOTO	19,700	4,615.00	90,915,500
日本碍子	33,700	1,788.00	60,255,600
日本特殊陶業	21,500	2,153.00	46,289,500
MARUWA	1,100	7,510.00	8,261,000
品川リフラクトリーズ	700	3,115.00	2,180,500
黒崎播磨	500	5,870.00	2,935,000
ヨータイ	2,500	713.00	1,782,500
イソライト工業	1,800	673.00	1,211,400
ニッカトー	2,200	754.00	1,658,800
フジミインコーポレーテッド	2,500	2,913.00	7,282,500
クニミネ工業	1,500	1,242.00	1,863,000
ニチアス	7,600	2,502.00	19,015,200

日本製鉄	122,300	1,584.50	193,784,350
神戸製鋼所	50,000	549.00	27,450,000
中山製鋼所	3,800	484.00	1,839,200
合同製鐵	1,500	2,566.00	3,849,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	73,800	1,291.00	95,275,800
東京製鐵	13,300	813.00	10,812,900
共英製鋼	3,100	1,968.00	6,100,800
大和工業	5,800	2,681.00	15,549,800
東京鐵鋼	1,100	1,552.00	1,707,200
大阪製鐵	1,500	1,414.00	2,121,000
淀川製鋼所	3,700	2,127.00	7,869,900
丸一鋼管	8,900	3,240.00	28,836,000
モリ工業	800	2,300.00	1,840,000
大同特殊鋼	4,500	5,010.00	22,545,000
日本高周波鋼業	4,000	425.00	1,700,000
日本冶金工業	2,300	2,286.00	5,257,800
山陽特殊製鋼	2,000	1,462.00	2,924,000
愛知製鋼	1,500	3,540.00	5,310,000
日立金属	29,400	1,453.00	42,718,200
日本金属	1,700	926.00	1,574,200
大平洋金属	1,800	2,293.00	4,127,400
新日本電工	17,600	168.00	2,956,800
栗本鐵工所	1,400	1,875.00	2,625,000
日本製鋼所	8,300	2,260.00	18,758,000
三菱製鋼	2,000	1,091.00	2,182,000
日垂鋼業	3,600	347.00	1,249,200
日本精線	600	2,944.00	1,766,400
大紀アルミニウム工業所	4,500	774.00	3,483,000
日本輕金属ホールディングス	69,200	226.00	15,639,200
三井金属鋁業	7,400	2,733.00	20,224,200
東邦亜鉛	1,400	2,023.00	2,832,200
三菱マテリアル	18,100	2,998.00	54,263,800
住友金属鋁山	34,900	3,358.00	117,194,200
DOWAホールディングス	6,900	4,005.00	27,634,500
古河機械金属	4,900	1,530.00	7,497,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	1,623.00	4,544,400
東邦チタニウム	4,900	929.00	4,552,100
UACJ	4,100	2,457.00	10,073,700
古河電気工業	8,500	2,969.00	25,236,500
住友電気工業	102,200	1,539.00	157,285,800
フジクラ	33,000	455.00	15,015,000
昭和電線ホールディングス	3,200	1,011.00	3,235,200
東京特殊電線	800	2,128.00	1,702,400
タツタ電線	5,500	565.00	3,107,500
カナレ電気	900	1,870.00	1,683,000
平河ヒューテック	1,400	1,250.00	1,750,000
リョービ	3,400	2,089.00	7,102,600
アーレスティ	3,600	541.00	1,947,600
アサヒホールディングス	4,800	2,526.00	12,124,800
東洋製罐グループホールディングス	17,400	1,877.00	32,659,800
ホッカンホールディングス	1,500	1,898.00	2,847,000
コロナ	1,500	1,168.00	1,752,000
横河ブリッジホールディングス	5,100	1,896.00	9,669,600
OSJBホールディングス	13,700	271.00	3,712,700
三和ホールディングス	26,200	1,262.00	33,064,400
文化シャッター	8,100	998.00	8,083,800
三協立山	3,800	1,226.00	4,658,800
アルインコ	2,000	1,167.00	2,334,000
LIXILグループ	40,300	1,987.00	80,076,100
日本フィルコン	3,300	563.00	1,857,900

ノーリツ	5,700	1,432.00	8,162,400
長府製作所	2,800	2,401.00	6,722,800
リンナイ	5,300	8,580.00	45,474,000
ユニプレス	5,400	1,659.00	8,958,600
ダイニチ工業	2,600	693.00	1,801,800
日東精工	3,800	551.00	2,093,800
三洋工業	900	2,045.00	1,840,500
岡部	5,500	917.00	5,043,500
ジーテクト	3,400	1,858.00	6,317,200
東プレ	5,100	1,794.00	9,149,400
高周波熱錬	5,300	895.00	4,743,500
東京製綱	2,000	1,127.00	2,254,000
サンコール	3,500	485.00	1,697,500
モリテックスチール	3,900	426.00	1,661,400
パイオラックス	4,000	2,168.00	8,672,000
エイチワン	2,700	729.00	1,968,300
日本発条	29,300	960.00	28,128,000
三浦工業	11,800	3,650.00	43,070,000
タクマ	9,300	1,233.00	11,466,900
テクノプロ・ホールディングス	5,300	7,020.00	37,206,000
インターワークス	3,500	514.00	1,799,000
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	4,515.00	4,966,500
Keeper 技研	1,200	1,381.00	1,657,200
三機サービス	1,800	1,000.00	1,800,000
Gunosy	1,800	1,731.00	3,115,800
イー・ガーディアン	1,300	2,187.00	2,843,100
リブセンス	4,800	309.00	1,483,200
ジャパンマテリアル	8,100	1,626.00	13,170,600
ベクトル	3,300	947.00	3,125,100
ウチヤマホールディングス	3,300	572.00	1,887,600
チャーム・ケア・コーポレーション	800	1,983.00	1,586,400
キャリアリンク	3,100	545.00	1,689,500
I B J	1,800	1,023.00	1,841,400
アサンテ	1,100	2,072.00	2,279,200
N・フィールド	2,700	718.00	1,938,600
バリューHR	500	3,660.00	1,830,000
M&Aキャピタルパートナーズ	900	8,720.00	7,848,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,300	1,675.00	2,177,500
E R Iホールディングス	2,200	804.00	1,768,800
アピスト	700	2,655.00	1,858,500
シグマクス	1,800	2,159.00	3,886,200
ウィルグループ	1,700	1,038.00	1,764,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,800	234.00	1,825,200
リクルートホールディングス	189,200	3,922.00	742,042,400
エラン	1,600	1,658.00	2,652,800
ツガミ	5,700	1,025.00	5,842,500
オークマ	3,200	6,070.00	19,424,000
東芝機械	3,100	2,666.00	8,264,600
アマダホールディングス	34,800	1,218.00	42,386,400
アイダエンジニアリング	7,400	971.00	7,185,400
滝澤鉄工所	1,300	1,399.00	1,818,700
F U J I	11,800	1,976.00	23,316,800
牧野フライス製作所	3,200	5,260.00	16,832,000
オーエスジー	12,600	2,250.00	28,350,000
ダイジェット工業	1,100	1,492.00	1,641,200
旭ダイヤモンド工業	7,200	648.00	4,665,600
D M G 森精機	17,300	1,706.00	29,513,800
ソディック	6,400	953.00	6,099,200
ディスコ	3,700	22,800.00	84,360,000

日東工器	1,500	2,352.00	3,528,000
日進工具	800	2,276.00	1,820,800
パンチ工業	3,200	546.00	1,747,200
日本郵政	216,500	1,016.00	219,964,000
ベルシステム24ホールディングス	4,400	1,801.00	7,924,400
鎌倉新書	2,000	1,682.00	3,364,000
一蔵	2,500	714.00	1,785,000
LITALICO	900	2,441.00	2,196,900
エポラブルアジア	1,200	2,125.00	2,550,000
アトラエ	700	3,620.00	2,534,000
ストライク	1,000	4,500.00	4,500,000
ソラスト	7,300	1,239.00	9,044,700
セラク	2,400	823.00	1,975,200
インソース	1,300	3,295.00	4,283,500
豊田自動織機	22,400	6,370.00	142,688,000
豊和工業	2,400	757.00	1,816,800
OKK	2,300	677.00	1,557,100
東洋機械金属	3,000	565.00	1,695,000
島精機製作所	4,400	2,725.00	11,990,000
オプトラン	3,000	2,870.00	8,610,000
NCホールディングス	3,600	546.00	1,965,600
イワキ	1,700	1,125.00	1,912,500
フリー	2,700	1,032.00	2,786,400
ヤマシンフィルタ	5,900	927.00	5,469,300
日阪製作所	3,400	977.00	3,321,800
やまびこ	5,300	1,128.00	5,978,400
平田機工	1,300	7,350.00	9,555,000
ペガサスミシン製造	3,400	509.00	1,730,600
ナプテスコ	16,100	3,305.00	53,210,500
三井海洋開発	2,900	2,457.00	7,125,300
レオン自動機	2,700	1,685.00	4,549,500
SMC	8,700	48,710.00	423,777,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	3,100	543.00	1,683,300
ホソカワミクロン	1,000	4,275.00	4,275,000
ユニオンツール	1,000	3,220.00	3,220,000
オイレス工業	3,500	1,688.00	5,908,000
日精エー・エス・ピー機械	900	4,530.00	4,077,000
サトーホールディングス	3,900	3,305.00	12,889,500
技研製作所	2,400	4,065.00	9,756,000
日本エアテック	2,500	700.00	1,750,000
カワタ	1,100	1,155.00	1,270,500
日精樹脂工業	2,300	1,000.00	2,300,000
オカダアイヨン	1,300	1,274.00	1,656,200
小松製作所	125,200	2,564.00	321,012,800
住友重機械工業	15,800	3,110.00	49,138,000
日立建機	11,100	2,730.00	30,303,000
日工	3,800	709.00	2,694,200
巴工業	1,200	2,315.00	2,778,000
井関農機	2,800	1,600.00	4,480,000
TOWA	2,800	1,209.00	3,385,200
丸山製作所	1,400	1,237.00	1,731,800
北川鉄工所	1,200	2,203.00	2,643,600
シンニッタン	4,200	450.00	1,890,000
ローツェ	1,200	3,820.00	4,584,000
タカキタ	3,100	559.00	1,732,900
クボタ	146,700	1,670.50	245,062,350
荏原実業	800	2,108.00	1,686,400
東洋エンジニアリング	3,600	677.00	2,437,200
三菱化工機	1,000	1,960.00	1,960,000

月島機械	5,100	1,682.00	8,578,200
帝国電機製作所	2,300	1,314.00	3,022,200
新東工業	6,600	1,037.00	6,844,200
澁谷工業	2,400	3,025.00	7,260,000
アイチコーポレーション	4,800	682.00	3,273,600
小森コーポレーション	7,000	1,163.00	8,141,000
鶴見製作所	2,100	2,052.00	4,309,200
荏原製作所	12,300	3,275.00	40,282,500
西島製作所	2,800	980.00	2,744,000
北越工業	2,800	1,279.00	3,581,200
ダイキン工業	35,200	15,395.00	541,904,000
オルガノ	1,000	6,780.00	6,780,000
トーヨーカネツ	1,200	2,310.00	2,772,000
栗田工業	15,000	3,090.00	46,350,000
椿本チエイン	3,900	3,785.00	14,761,500
日機装	7,100	1,219.00	8,654,900
木村化工機	100	622.00	62,200
レイズネクスト	4,600	1,193.00	5,487,800
アネスト岩田	4,300	989.00	4,252,700
ダイフク	14,100	6,140.00	86,574,000
サムコ	1,600	1,132.00	1,811,200
加藤製作所	1,500	1,810.00	2,715,000
油研工業	1,100	1,686.00	1,854,600
タダノ	13,300	1,015.00	13,499,500
フジテック	10,000	1,690.00	16,900,000
C K D	7,700	1,797.00	13,836,900
キトー	2,100	1,615.00	3,391,500
平和	7,700	2,305.00	17,748,500
理想科学工業	2,400	1,917.00	4,600,800
S A N K Y O	6,200	3,750.00	23,250,000
日本金銭機械	3,100	933.00	2,892,300
マースグループホールディングス	1,800	2,022.00	3,639,600
福島工業	1,700	3,545.00	6,026,500
ダイコク電機	1,300	1,625.00	2,112,500
竹内製作所	4,600	1,674.00	7,700,400
アマノ	7,200	3,270.00	23,544,000
J U K I	3,800	913.00	3,469,400
サンデンホールディングス	3,600	814.00	2,930,400
蛇の目ミシン工業	4,300	406.00	1,745,800
ブラザー工業	33,800	2,196.00	74,224,800
マックス	4,200	2,233.00	9,378,600
モリタホールディングス	4,800	1,743.00	8,366,400
グローリー	7,700	3,320.00	25,564,000
新晃工業	2,600	1,997.00	5,192,200
大和冷機工業	4,000	1,278.00	5,112,000
セガサミーホールディングス	27,400	1,587.00	43,483,800
日本ピストンリング	1,300	1,417.00	1,842,100
リケン	1,300	4,220.00	5,486,000
T P R	3,700	2,089.00	7,729,300
ツバキ・ナカシマ	5,600	1,744.00	9,766,400
ホシザキ	8,100	9,570.00	77,517,000
大豊工業	2,300	852.00	1,959,600
日本精工	52,000	1,030.00	53,560,000
N T N	64,000	325.00	20,800,000
ジェイテクト	26,500	1,372.00	36,358,000
不二越	2,600	4,985.00	12,961,000
ミネベアミツミ	51,300	2,085.00	106,960,500
日本トムソン	8,200	491.00	4,026,200
T H K	16,100	2,933.00	47,221,300
ユーシン精機	2,100	1,009.00	2,118,900

前澤給装工業	1,000	2,091.00	2,091,000
イーグル工業	3,400	1,102.00	3,746,800
日本ピラー工業	2,800	1,426.00	3,992,800
キット	11,200	748.00	8,377,600
日立製作所	132,800	4,090.00	543,152,000
三菱電機	276,400	1,509.50	417,225,800
富士電機	16,700	3,305.00	55,193,500
東洋電機製造	1,100	1,507.00	1,657,700
安川電機	29,800	4,060.00	120,988,000
シンフォニア テクノロジー	3,600	1,342.00	4,831,200
明電舎	5,100	2,080.00	10,608,000
オリジン	1,100	1,452.00	1,597,200
山洋電気	1,300	5,140.00	6,682,000
デンヨー	2,400	2,072.00	4,972,800
ベイカレント・コンサルティング	1,600	5,860.00	9,376,000
MS - J a p a n	1,300	1,365.00	1,774,500
グレイステクノロジー	1,200	2,964.00	3,556,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,800	2,768.00	7,750,400
フルテック	1,300	1,402.00	1,822,600
日総工産	1,700	1,111.00	1,888,700
キュービーネットホールディングス	1,600	2,498.00	3,996,800
R P Aホールディングス	1,500	1,224.00	1,836,000
三櫻工業	3,500	1,422.00	4,977,000
マキタ	36,000	3,630.00	130,680,000
東芝テック	3,500	4,185.00	14,647,500
芝浦メカトロニクス	500	3,920.00	1,960,000
マブチモーター	7,600	4,385.00	33,326,000
日本電産	33,300	16,100.00	536,130,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,800	534.00	961,200
トレックス・セミコンダクター	1,600	1,447.00	2,315,200
東光高岳	1,500	1,138.00	1,707,000
ダブル・スコープ	4,000	620.00	2,480,000
ダイヘン	3,000	3,525.00	10,575,000
ヤーマン	4,000	681.00	2,724,000
J V Cケンウッド	22,500	271.00	6,097,500
ミマキエンジニアリング	3,000	529.00	1,587,000
第一精工	1,000	2,630.00	2,630,000
日新電機	6,500	1,135.00	7,377,500
大崎電気工業	5,500	726.00	3,993,000
オムロン	25,700	6,480.00	166,536,000
日東工業	4,100	2,359.00	9,671,900
I D E C	4,000	2,277.00	9,108,000
不二電機工業	1,400	1,257.00	1,759,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,200	2,250.00	20,700,000
サクサホールディングス	900	2,000.00	1,800,000
メルコホールディングス	1,000	3,015.00	3,015,000
日本電気	33,500	4,480.00	150,080,000
富士通	26,600	9,860.00	262,276,000
沖電気工業	11,200	1,507.00	16,878,400
電気興業	1,300	3,200.00	4,160,000
サンケン電気	3,000	3,125.00	9,375,000
アイホン	1,600	1,914.00	3,062,400
ルネサスエレクトロニクス	131,800	710.00	93,578,000
セイコーエプソン	34,300	1,558.00	53,439,400
ワコム	18,600	436.00	8,109,600
アルバック	5,500	4,240.00	23,320,000
E I Z O	2,100	4,150.00	8,715,000
ジャパンディスプレイ	79,900	73.00	5,832,700
日本信号	7,000	1,263.00	8,841,000

京三製作所	6,500	499.00	3,243,500
能美防災	3,700	2,264.00	8,376,800
ホーチキ	2,000	1,537.00	3,074,000
エレコム	3,000	4,210.00	12,630,000
パナソニック	315,800	1,002.00	316,431,600
シャープ	32,000	1,690.00	54,080,000
アンリツ	17,800	2,090.00	37,202,000
富士通ゼネラル	7,500	2,060.00	15,450,000
ソニー	174,700	6,697.00	1,169,965,900
T D K	13,300	11,100.00	147,630,000
帝国通信工業	1,500	1,182.00	1,773,000
タムラ製作所	9,200	650.00	5,980,000
アルプスアルパイン	24,500	2,371.00	58,089,500
池上通信機	1,600	1,053.00	1,684,800
日本電波工業	3,800	477.00	1,812,600
鈴木	2,200	781.00	1,718,200
日本トリム	400	5,050.00	2,020,000
ローランド ディー・ジー	1,500	2,128.00	3,192,000
フォスター電機	2,900	1,980.00	5,742,000
S M K	700	2,992.00	2,094,400
ヨコオ	1,800	3,165.00	5,697,000
ホシデン	7,600	1,264.00	9,606,400
ヒロセ電機	4,300	13,770.00	59,211,000
日本航空電子工業	6,300	2,074.00	13,066,200
T O A	3,000	1,093.00	3,279,000
マクセルホールディングス	6,000	1,483.00	8,898,000
古野電気	3,600	1,241.00	4,467,600
ユニデンホールディングス	900	1,804.00	1,623,600
スミダコーポレーション	2,100	1,302.00	2,734,200
アイコム	1,500	2,661.00	3,991,500
リオン	1,200	2,599.00	3,118,800
船井電機	2,800	658.00	1,842,400
横河電機	25,400	1,860.00	47,244,000
新電元工業	1,000	3,630.00	3,630,000
アズビル	17,400	3,200.00	55,680,000
東亜ディーケーケー	2,000	876.00	1,752,000
日本光電工業	11,400	2,936.00	33,470,400
共和電業	4,100	427.00	1,750,700
日本電子材料	2,400	777.00	1,864,800
堀場製作所	5,500	7,230.00	39,765,000
アドバンテスト	20,600	5,410.00	111,446,000
小野測器	3,400	527.00	1,791,800
エスベック	2,400	1,979.00	4,749,600
キーエンス	25,000	36,700.00	917,500,000
日置電機	1,400	3,745.00	5,243,000
シスメックス	19,700	7,674.00	151,177,800
日本マイクロニクス	4,800	1,150.00	5,520,000
メガチップス	2,600	2,404.00	6,250,400
O B A R A G R O U P	1,400	3,890.00	5,446,000
I M A G I C A G R O U P	2,700	653.00	1,763,100
澤藤電機	1,000	2,398.00	2,398,000
デンソー	60,900	4,948.00	301,333,200
原田工業	1,900	931.00	1,768,900
コーセル	3,400	1,262.00	4,290,800
イリソ電子工業	2,300	5,140.00	11,822,000
オブテックグループ	4,500	1,563.00	7,033,500
千代田インテグレ	1,300	2,309.00	3,001,700
アイ・オー・データ機器	1,900	944.00	1,793,600
レーザーテック	5,700	8,720.00	49,704,000
スタンレー電気	19,500	2,991.00	58,324,500

岩崎電気	1,200	1,405.00	1,686,000
ウシオ電機	16,100	1,642.00	26,436,200
岡谷電機産業	4,400	377.00	1,658,800
ヘリオス テクノ ホールディング	3,600	481.00	1,731,600
日本セラミック	2,800	2,733.00	7,652,400
遠藤照明	2,600	692.00	1,799,200
古河電池	2,300	762.00	1,752,600
山一電機	2,000	1,596.00	3,192,000
図研	1,800	2,315.00	4,167,000
日本電子	5,500	2,911.00	16,010,500
カシオ計算機	24,500	2,025.00	49,612,500
ファナック	26,300	20,645.00	542,963,500
日本シイエムケイ	6,500	682.00	4,433,000
エンプラス	1,400	3,540.00	4,956,000
ローム	12,300	9,050.00	111,315,000
浜松ホトニクス	19,800	4,595.00	90,981,000
三井ハイテック	3,000	2,037.00	6,111,000
新光電気工業	9,300	1,077.00	10,016,100
京セラ	38,900	7,075.00	275,217,500
協栄産業	1,200	1,527.00	1,832,400
太陽誘電	12,300	2,805.00	34,501,500
村田製作所	81,200	6,069.00	492,802,800
双葉電子工業	4,400	1,380.00	6,072,000
日東電工	19,100	6,120.00	116,892,000
北陸電気工業	1,500	1,104.00	1,656,000
東海理化電機製作所	7,300	2,055.00	15,001,500
ニチコン	9,400	1,147.00	10,781,800
日本ケミコン	2,100	1,921.00	4,034,100
K O A	4,200	1,395.00	5,859,000
三井E & Sホールディングス	10,000	851.00	8,510,000
日立造船	21,900	418.00	9,154,200
三菱重工業	46,300	4,234.00	196,034,200
川崎重工業	21,500	2,455.00	52,782,500
I H I	19,900	2,489.00	49,531,100
名村造船所	8,900	280.00	2,492,000
スプリックス	1,100	1,249.00	1,373,900
日本車輛製造	1,000	3,010.00	3,010,000
三菱ロジスネクスト	3,700	1,068.00	3,951,600
近畿車輛	1,100	1,425.00	1,567,500
F P G	8,600	1,175.00	10,105,000
島根銀行	2,500	710.00	1,775,000
じもとホールディングス	18,400	111.00	2,042,400
全国保証	7,700	4,295.00	33,071,500
めぶきフィナンシャルグループ	141,700	283.00	40,101,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,700	1,511.00	5,590,700
九州フィナンシャルグループ	44,700	487.00	21,768,900
かんぽ生命保険	9,700	1,805.00	17,508,500
ゆうちょ銀行	77,200	1,043.00	80,519,600
富山第一銀行	6,500	347.00	2,255,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	160,400	445.00	71,378,000
西日本フィナンシャルホールディングス	18,600	848.00	15,772,800
日本モーゲージサービス	1,300	1,552.00	2,017,600
アルヒ	4,300	2,539.00	10,917,700
プレミアグループ	1,500	2,519.00	3,778,500
日産自動車	326,000	670.80	218,680,800
いすゞ自動車	80,100	1,285.50	102,968,550
トヨタ自動車	308,000	7,688.00	2,367,904,000
日野自動車	34,500	1,053.00	36,328,500
三菱自動車工業	102,300	487.00	49,820,100

エフテック	2,400	711.00	1,706,400
武蔵精密工業	6,200	1,522.00	9,436,400
日産車体	5,400	1,042.00	5,626,800
新明和工業	7,400	1,373.00	10,160,200
極東開発工業	5,100	1,559.00	7,950,900
日信工業	5,600	2,230.00	12,488,000
トビー工業	2,300	2,114.00	4,862,200
ティラド	1,000	2,137.00	2,137,000
曙ブレーキ工業	15,200	255.00	3,876,000
タチエス	4,500	1,420.00	6,390,000
N O K	14,900	1,662.00	24,763,800
フタバ産業	7,700	810.00	6,237,000
K Y B	3,100	3,360.00	10,416,000
市光工業	4,100	812.00	3,329,200
大同メタル工業	5,300	695.00	3,683,500
プレス工業	13,700	457.00	6,260,900
ミクニ	4,800	336.00	1,612,800
太平洋工業	5,800	1,543.00	8,949,400
ケーヒン	6,300	2,574.00	16,216,200
河西工業	3,700	863.00	3,193,100
アイシン精機	22,800	4,155.00	94,734,000
マツダ	81,300	952.00	77,397,600
今仙電機製作所	2,600	930.00	2,418,000
本田技研工業	217,700	3,092.00	673,128,400
スズキ	54,800	4,946.00	271,040,800
S U B A R U	85,800	2,903.00	249,077,400
安永	1,300	1,266.00	1,645,800
ヤマハ発動機	36,000	2,263.00	81,468,000
ショーワ	6,500	2,274.00	14,781,000
小糸製作所	16,600	5,580.00	92,628,000
T B K	3,800	421.00	1,599,800
エクセディ	3,800	2,401.00	9,123,800
ミツバ	5,100	726.00	3,702,600
豊田合成	8,900	2,499.00	22,241,100
愛三工業	4,300	885.00	3,805,500
日本プラスト	2,400	695.00	1,668,000
ヨロズ	2,600	1,444.00	3,754,400
エフ・シー・シー	4,500	2,285.00	10,282,500
シマノ	10,300	17,520.00	180,456,000
テイ・エス テック	6,400	3,440.00	22,016,000
関西みらいフィナンシャルグループ	16,000	709.00	11,344,000
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,694.00	4,235,000
第四北越フィナンシャルグループ	4,700	2,884.00	13,554,800
ジャムコ	1,400	1,419.00	1,986,600
小野建	2,400	1,328.00	3,187,200
ノジマ	4,800	2,282.00	10,953,600
佐鳥電機	2,000	918.00	1,836,000
カップ・クリエイト	3,800	1,467.00	5,574,600
伯東	1,700	1,255.00	2,133,500
コンドーテック	2,100	1,079.00	2,265,900
ライトオン	3,100	584.00	1,810,400
ナガイレーベン	3,900	2,569.00	10,019,100
三菱食品	3,000	2,930.00	8,790,000
良品計画	36,100	2,422.00	87,434,200
松田産業	2,000	1,550.00	3,100,000
第一興商	4,100	5,450.00	22,345,000
メディバルホールディングス	29,400	2,544.00	74,793,600
アドヴァン	4,200	1,293.00	5,430,600
S P K	100	2,827.00	282,700
萩原電気ホールディングス	1,000	2,839.00	2,839,000

アルビス	1,000	2,292.00	2,292,000
アズワン	1,800	9,020.00	16,236,000
スズデン	1,200	1,413.00	1,695,600
シモジマ	1,700	1,254.00	2,131,800
ドウシシャ	2,600	1,753.00	4,557,800
小津産業	1,000	1,847.00	1,847,000
コナカ	4,300	399.00	1,715,700
高速	1,600	1,237.00	1,979,200
G-7ホールディングス	800	3,895.00	3,116,000
イオン北海道	2,700	792.00	2,138,400
コジマ	4,700	458.00	2,152,600
ヒマラヤ	2,100	842.00	1,768,200
コーナン商事	3,900	2,542.00	9,913,800
ネットワンシステムズ	10,300	3,050.00	31,415,000
エコス	1,100	1,681.00	1,849,100
ワタミ	3,200	1,276.00	4,083,200
マルシェ	2,300	784.00	1,803,200
システムソフト	15,800	112.00	1,769,600
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	65,200	1,740.00	113,448,000
丸文	2,900	576.00	1,670,400
西松屋チェーン	6,000	938.00	5,628,000
ゼンショーホールディングス	13,000	2,529.00	32,877,000
ハビネット	2,300	1,412.00	3,247,600
幸楽苑ホールディングス	1,700	2,087.00	3,547,900
日本ライフライン	8,100	1,529.00	12,384,900
サイゼリヤ	4,500	2,534.00	11,403,000
エクセル	1,400	1,244.00	1,741,600
V Tホールディングス	11,300	478.00	5,401,400
マルカ	1,000	2,430.00	2,430,000
アルゴグラフィックス	2,300	3,100.00	7,130,000
IDOM	7,300	463.00	3,379,900
日本エム・ディ・エム	1,600	2,183.00	3,492,800
ユナイテッドアローズ	2,900	3,380.00	9,802,000
進和	1,600	2,403.00	3,844,800
ダイトロン	1,200	1,556.00	1,867,200
ハイデイ日高	3,900	2,173.00	8,474,700
シークス	3,500	1,526.00	5,341,000
京都きもの友禅	4,800	354.00	1,699,200
コロワイド	9,000	2,197.00	19,773,000
ピーシーデポコーポレーション	3,600	458.00	1,648,800
田中商事	2,600	715.00	1,859,000
オーハシテクニカ	1,500	1,464.00	2,196,000
壱番屋	1,900	5,010.00	9,519,000
白銅	1,300	1,441.00	1,873,300
PLANT	2,600	660.00	1,716,000
スギホールディングス	5,400	6,400.00	34,560,000
薬王堂ホールディングス	1,200	2,559.00	3,070,800
島津製作所	33,000	3,170.00	104,610,000
JMS	2,600	713.00	1,853,800
長野計器	400	708.00	283,200
ブイ・テクノロジー	1,300	5,750.00	7,475,000
スター精密	4,300	1,519.00	6,531,700
東京計器	1,800	1,007.00	1,812,600
インターアクション	1,500	2,277.00	3,415,500
オーバル	6,900	252.00	1,738,800
東京精密	5,000	3,850.00	19,250,000
マニー	11,000	2,893.00	31,823,000
ニコン	44,700	1,486.00	66,424,200
トプコン	13,900	1,431.00	19,890,900

オリンパス	152,900	1,702.50	260,312,250
理研計器	2,400	2,415.00	5,796,000
S C R E E Nホールディングス	4,800	7,430.00	35,664,000
キヤノン電子	2,900	2,016.00	5,846,400
タムロン	2,200	2,448.00	5,385,600
H O Y A	55,700	9,769.00	544,133,300
シード	2,000	1,024.00	2,048,000
ノーリツ鋼機	1,900	1,699.00	3,228,100
エー・アンド・デイ	2,500	788.00	1,970,000
朝日インテック	23,500	3,155.00	74,142,500
キヤノン	148,800	2,982.50	443,796,000
リコー	70,300	1,115.00	78,384,500
シチズン時計	32,400	588.00	19,051,200
リズム時計工業	1,800	901.00	1,621,800
大研医器	3,300	521.00	1,719,300
メニコン	3,800	4,335.00	16,473,000
スノーピーク	1,700	1,062.00	1,805,400
パラマウントベッドホールディングス	2,900	4,175.00	12,107,500
トランザクション	1,900	978.00	1,858,200
S H O B I	4,200	394.00	1,654,800
ニホンフラッシュ	1,300	2,485.00	3,230,500
前田工織	3,000	1,806.00	5,418,000
永大産業	4,900	348.00	1,705,200
アートネイチャー	3,000	729.00	2,187,000
バンダイナムコホールディングス	28,600	6,692.00	191,391,200
共立印刷	100	164.00	16,400
S H O E I	1,300	5,080.00	6,604,000
フランスベッドホールディングス	3,900	1,012.00	3,946,800
マーベラス	4,100	771.00	3,161,100
パイロットコーポレーション	4,800	4,200.00	20,160,000
萩原工業	1,500	1,628.00	2,442,000
エイベックス	4,700	1,330.00	6,251,000
トッパン・フォームズ	5,900	1,101.00	6,495,900
フジシールインターナショナル	6,200	2,454.00	15,214,800
タカラトミー	12,400	1,279.00	15,859,600
廣済堂	2,500	781.00	1,952,500
アーク	18,800	94.00	1,767,200
レック	2,900	1,253.00	3,633,700
三光合成	4,400	422.00	1,856,800
プロネクス	2,400	1,226.00	2,942,400
ホクシン	10,500	167.00	1,753,500
大建工業	1,900	1,934.00	3,674,600
凸版印刷	39,000	2,187.00	85,293,000
大日本印刷	36,200	2,998.00	108,527,600
共同印刷	900	2,892.00	2,602,800
N I S S H A	5,700	1,145.00	6,526,500
光村印刷	1,000	1,719.00	1,719,000
藤森工業	2,500	3,490.00	8,725,000
ヴィア・ホールディングス	3,300	662.00	2,184,600
宝印刷	1,300	1,741.00	2,263,300
前澤化成工業	1,800	1,222.00	2,199,600
未来工業	1,500	2,166.00	3,249,000
アシックス	22,800	1,682.00	38,349,600
ツツミ	900	2,118.00	1,906,200
J S P	1,600	1,909.00	3,054,400
ニチハ	3,800	2,954.00	11,225,200
エフピコ	3,000	6,510.00	19,530,000
小松ウオール工業	800	2,408.00	1,926,400
ヤマハ	16,400	6,060.00	99,384,000
河合楽器製作所	900	3,590.00	3,231,000

ビジョン	16,700	5,110.00	85,337,000
天馬	1,800	1,983.00	3,569,400
キングジム	2,300	889.00	2,044,700
象印マホービン	8,100	1,741.00	14,102,100
リンテック	6,600	2,374.00	15,668,400
信越ポリマー	5,000	956.00	4,780,000
東リ	6,900	298.00	2,056,200
イトーキ	5,900	501.00	2,955,900
任天堂	17,000	42,970.00	730,490,000
三菱鉛筆	4,600	1,730.00	7,958,000
松風	1,200	1,678.00	2,013,600
タカラスタANDARD	5,700	1,975.00	11,257,500
コクヨ	13,300	1,602.00	21,306,600
ニフコ	10,100	2,978.00	30,077,800
立川ブラインド工業	1,200	1,438.00	1,725,600
グロープライド	1,200	2,785.00	3,342,000
オカムラ	9,600	1,055.00	10,128,000
バルカー	2,200	2,557.00	5,625,400
伊藤忠商事	190,400	2,414.50	459,720,800
丸紅	283,400	793.80	224,962,920
スクロール	5,200	346.00	1,799,200
ヨンドシーホールディングス	2,800	2,559.00	7,165,200
三陽商会	1,400	1,428.00	1,999,200
長瀬産業	15,300	1,593.00	24,372,900
蝶理	1,700	1,897.00	3,224,900
豊田通商	30,400	3,820.00	116,128,000
オンワードホールディングス	16,300	629.00	10,252,700
三共生興	4,100	591.00	2,423,100
兼松	10,200	1,420.00	14,484,000
美津濃	2,500	2,876.00	7,190,000
ファミリーマート	21,700	2,648.00	57,461,600
三井物産	239,300	1,928.00	461,370,400
日本紙バルブ商事	1,500	3,990.00	5,985,000
東京エレクトロン	18,400	22,510.00	414,184,000
日立ハイテクノロジーズ	9,500	6,820.00	64,790,000
カメイ	3,500	1,203.00	4,210,500
東都水産	700	2,574.00	1,801,800
OUGホールディングス	700	2,736.00	1,915,200
スターゼン	1,000	4,515.00	4,515,000
セイコーホールディングス	3,900	2,751.00	10,728,900
山善	10,600	1,019.00	10,801,400
椿本興業	500	3,920.00	1,960,000
住友商事	171,800	1,637.50	281,322,500
日本ユニシス	8,500	3,500.00	29,750,000
内田洋行	1,200	4,285.00	5,142,000
三菱商事	191,000	2,829.50	540,434,500
第一実業	1,300	3,650.00	4,745,000
キヤノンマーケティングジャパン	7,800	2,444.00	19,063,200
西華産業	1,500	1,400.00	2,100,000
佐藤商事	2,200	906.00	1,993,200
菱洋エレクトロ	2,800	1,927.00	5,395,600
東京産業	3,100	548.00	1,698,800
ユアサ商事	2,600	3,515.00	9,139,000
神鋼商事	700	2,625.00	1,837,500
阪和興業	5,100	2,752.00	14,035,200
正栄食品工業	1,800	3,195.00	5,751,000
カナデン	2,200	1,322.00	2,908,400
菱電商事	2,000	1,676.00	3,352,000
ニプロ	19,100	1,290.00	24,639,000
フルサト工業	1,500	1,631.00	2,446,500

岩谷産業	6,000	3,675.00	22,050,000
すてきナイスグループ	1,800	1,096.00	1,972,800
昭光通商	2,700	659.00	1,779,300
イワキ	3,800	463.00	1,759,400
兼松エレクトロニクス	1,500	3,380.00	5,070,000
三愛石油	6,700	1,059.00	7,095,300
稲畑産業	6,000	1,512.00	9,072,000
ゴールドウイン	4,900	7,460.00	36,554,000
ユニ・チャーム	53,300	3,489.00	185,963,700
デサント	5,300	1,520.00	8,056,000
ワキタ	5,800	1,100.00	6,380,000
ヤマトインターナショナル	4,400	394.00	1,733,600
東邦ホールディングス	8,700	2,661.00	23,150,700
サンゲツ	7,500	2,100.00	15,750,000
ミツウロコグループホールディングス	4,000	1,397.00	5,588,000
シナネンホールディングス	1,100	1,931.00	2,124,100
伊藤忠エネクス	6,000	878.00	5,268,000
サンリオ	7,600	2,162.00	16,431,200
サンワテクノス	1,900	1,150.00	2,185,000
リョーサン	3,000	2,873.00	8,619,000
新光商事	4,300	882.00	3,792,600
トーホー	1,200	1,791.00	2,149,200
三信電気	1,500	1,634.00	2,451,000
東陽テクニカ	3,100	1,121.00	3,475,100
モスフードサービス	3,600	3,040.00	10,944,000
加賀電子	2,700	2,440.00	6,588,000
三益半導体工業	2,400	2,042.00	4,900,800
ソーダニッカ	2,800	603.00	1,688,400
立花エレテック	2,000	1,723.00	3,446,000
木曽路	3,600	2,817.00	10,141,200
S R Sホールディングス	3,200	1,047.00	3,350,400
千趣会	4,900	385.00	1,886,500
ケーヨー	5,600	534.00	2,990,400
上新電機	3,200	2,416.00	7,731,200
日本瓦斯	4,300	3,155.00	13,566,500
ロイヤルホールディングス	4,800	2,482.00	11,913,600
東天紅	1,400	1,265.00	1,771,000
いなげや	3,400	1,491.00	5,069,400
島忠	5,800	3,085.00	17,893,000
チヨダ	2,900	1,635.00	4,741,500
ライフコーポレーション	2,100	2,465.00	5,176,500
リンガーハット	3,400	2,466.00	8,384,400
MrMaxHD	3,700	497.00	1,838,900
テナアライド	4,000	443.00	1,772,000
AOKIホールディングス	5,400	1,137.00	6,139,800
オークワ	4,300	1,382.00	5,942,600
コメリ	4,200	2,327.00	9,773,400
青山商事	5,600	1,653.00	9,256,800
しまむら	3,200	9,410.00	30,112,000
はせがわ	4,300	407.00	1,750,100
高島屋	19,800	1,304.00	25,819,200
松屋	5,500	859.00	4,724,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	12,900	1,213.00	15,647,700
近鉄百貨店	1,000	3,560.00	3,560,000
パルコ	2,600	1,354.00	3,520,400
丸井グループ	25,000	2,652.00	66,300,000
クレディセゾン	19,100	1,807.00	34,513,700
アクシアルリテイリング	2,300	3,920.00	9,016,000
イオン	104,800	2,248.00	235,590,400
イズミ	5,500	4,220.00	23,210,000

平和堂	5,500	2,093.00	11,511,500
フジ	3,300	1,956.00	6,454,800
ヤオコー	3,100	5,130.00	15,903,000
ゼビオホールディングス	3,300	1,261.00	4,161,300
ケーズホールディングス	26,300	1,328.00	34,926,400
PALTA C	4,400	5,380.00	23,672,000
三谷産業	5,300	341.00	1,807,300
新生銀行	20,000	1,723.00	34,460,000
あおぞら銀行	16,200	2,820.00	45,684,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,876,800	572.20	1,073,904,960
りそなホールディングス	299,200	468.70	140,235,040
三井住友トラスト・ホールディングス	51,600	4,197.00	216,565,200
三井住友フィナンシャルグループ	188,600	3,967.00	748,176,200
千葉銀行	93,800	619.00	58,062,200
群馬銀行	53,600	386.00	20,689,600
武蔵野銀行	4,100	1,974.00	8,093,400
千葉興業銀行	7,500	344.00	2,580,000
筑波銀行	11,300	250.00	2,825,000
七十七銀行	9,300	1,718.00	15,977,400
青森銀行	2,200	2,751.00	6,052,200
秋田銀行	1,700	2,206.00	3,750,200
山形銀行	3,100	1,582.00	4,904,200
岩手銀行	1,800	2,867.00	5,160,600
東邦銀行	24,400	274.00	6,685,600
みちのく銀行	1,800	1,587.00	2,856,600
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	2,033.00	46,759,000
静岡銀行	67,500	822.00	55,485,000
十六銀行	3,400	2,592.00	8,812,800
スルガ銀行	27,900	579.00	16,154,100
八十二銀行	65,800	463.00	30,465,400
山梨中央銀行	3,200	1,113.00	3,561,600
大垣共立銀行	5,400	2,522.00	13,618,800
福井銀行	2,300	1,549.00	3,562,700
北國銀行	2,900	3,315.00	9,613,500
清水銀行	1,100	2,063.00	2,269,300
富山銀行	700	2,587.00	1,810,900
滋賀銀行	5,500	2,633.00	14,481,500
南都銀行	4,500	2,765.00	12,442,500
百五銀行	24,500	355.00	8,697,500
京都銀行	9,800	4,480.00	43,904,000
紀陽銀行	9,700	1,656.00	16,063,200
ほくほくフィナンシャルグループ	18,100	1,114.00	20,163,400
広島銀行	40,200	536.00	21,547,200
山陰合同銀行	16,200	669.00	10,837,800
中国銀行	23,500	1,055.00	24,792,500
鳥取銀行	1,300	1,376.00	1,788,800
伊予銀行	38,900	592.00	23,028,800
百十四銀行	2,900	2,253.00	6,533,700
四国銀行	4,100	999.00	4,095,900
阿波銀行	4,500	2,661.00	11,974,500
大分銀行	1,600	2,817.00	4,507,200
宮崎銀行	1,800	2,607.00	4,692,600
佐賀銀行	1,700	1,627.00	2,765,900
沖縄銀行	2,500	3,590.00	8,975,000
琉球銀行	6,300	1,199.00	7,553,700
セブン銀行	91,100	332.00	30,245,200
みずほフィナンシャルグループ	3,704,700	168.80	625,353,360
山口フィナンシャルグループ	34,000	748.00	25,432,000
芙蓉総合リース	2,900	7,130.00	20,677,000
みずほリース	4,200	3,125.00	13,125,000

東京センチュリー	5,500	5,900.00	32,450,000
SBIホールディングス	30,500	2,237.00	68,228,500
日本証券金融	12,000	525.00	6,300,000
アイフル	41,600	239.00	9,942,400
長野銀行	1,100	1,666.00	1,832,600
名古屋銀行	2,300	3,255.00	7,486,500
北洋銀行	41,100	237.00	9,740,700
愛知銀行	1,000	3,765.00	3,765,000
中京銀行	1,100	2,242.00	2,466,200
大光銀行	1,000	1,731.00	1,731,000
愛媛銀行	3,800	1,215.00	4,617,000
京葉銀行	11,600	645.00	7,482,000
栃木銀行	13,200	232.00	3,062,400
北日本銀行	900	2,097.00	1,887,300
東和銀行	4,800	905.00	4,344,000
リコーリース	2,200	3,745.00	8,239,000
イオンフィナンシャルサービス	16,700	1,659.00	27,705,300
アコム	54,800	446.00	24,440,800
ジャックス	3,000	2,673.00	8,019,000
オリエン特コーポレーション	73,800	172.00	12,693,600
日立キャピタル	6,400	2,568.00	16,435,200
アプラスフィナンシャル	18,100	88.00	1,592,800
オリックス	170,500	1,756.00	299,398,000
三菱UFJリース	69,200	698.00	48,301,600
ジャフコ	4,200	4,160.00	17,472,000
トモニホールディングス	21,100	391.00	8,250,100
大和証券グループ本社	218,800	534.40	116,926,720
野村ホールディングス	479,700	543.90	260,908,830
岡三証券グループ	23,200	402.00	9,326,400
丸三証券	8,100	536.00	4,341,600
東洋証券	10,200	168.00	1,713,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	31,300	335.00	10,485,500
光世証券	2,300	688.00	1,582,400
水戸証券	7,900	265.00	2,093,500
いちよし証券	5,100	689.00	3,513,900
松井証券	15,600	893.00	13,930,800
SOMPOホールディングス	51,300	4,417.00	226,592,100
だいがく証券ビジネス	3,000	603.00	1,809,000
日本取引所グループ	78,300	1,884.00	147,517,200
マネックスグループ	20,600	279.00	5,747,400
極東証券	3,700	800.00	2,960,000
岩井コスモホールディングス	2,600	1,218.00	3,166,800
藍澤證券	4,900	726.00	3,557,400
フィデアホールディングス	26,500	134.00	3,551,000
池田泉州ホールディングス	31,400	203.00	6,374,200
アニコムホールディングス	2,300	3,765.00	8,659,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	71,300	3,515.00	250,619,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	22,400	2,400.00	53,760,000
スパークス・グループ	9,400	252.00	2,368,800
第一生命ホールディングス	154,300	1,739.00	268,327,700
東京海上ホールディングス	97,500	5,934.00	578,565,000
イー・ギャランティ	2,900	1,505.00	4,364,500
アサックス	2,800	648.00	1,814,400
NECキャピタルソリューション	1,100	2,457.00	2,702,700
T&Dホールディングス	84,300	1,266.00	106,723,800
アドバンスクリエイト	400	1,874.00	749,600
三井不動産	136,100	2,755.50	375,023,550
三菱地所	191,000	2,013.00	384,483,000

平和不動産	5,000	2,550.00	12,750,000
東京建物	29,800	1,538.00	45,832,400
ダイビル	7,000	1,155.00	8,085,000
京阪神ビルディング	4,400	1,378.00	6,063,200
住友不動産	61,300	3,828.00	234,656,400
テーオーシー	5,300	842.00	4,462,600
東京楽天地	400	6,170.00	2,468,000
レオパレス21	35,700	307.00	10,959,900
スターツコーポレーション	3,700	2,703.00	10,001,100
フジ住宅	3,200	670.00	2,144,000
空港施設	3,100	560.00	1,736,000
明和地所	3,000	588.00	1,764,000
ゴールドクレスト	2,100	2,202.00	4,624,200
リログループ	14,400	2,864.00	41,241,600
エスリード	1,100	2,140.00	2,354,000
日神不動産	4,100	501.00	2,054,100
日本エスコン	4,900	965.00	4,728,500
タカラレーベン	12,500	497.00	6,212,500
サンヨーハウジング名古屋	1,800	975.00	1,755,000
イオンモール	13,700	1,732.00	23,728,400
毎日コムネット	2,200	819.00	1,801,800
ファースト住建	1,300	1,280.00	1,664,000
カチタス	3,400	5,140.00	17,476,000
東祥	1,600	2,406.00	3,849,600
トーセイ	3,800	1,430.00	5,434,000
穴吹興産	600	2,872.00	1,723,200
サンフロンティア不動産	3,800	1,312.00	4,985,600
エフ・ジェー・ネクスト	2,400	1,058.00	2,539,200
グランディハウス	3,500	470.00	1,645,000
東武鉄道	29,200	4,000.00	116,800,000
相鉄ホールディングス	8,800	3,035.00	26,708,000
東急	69,700	2,171.00	151,318,700
京浜急行電鉄	35,500	2,275.00	80,762,500
小田急電鉄	41,100	2,725.00	111,997,500
京王電鉄	14,300	7,000.00	100,100,000
京成電鉄	19,200	4,565.00	87,648,000
富士急行	3,800	4,320.00	16,416,000
新京成電鉄	400	2,285.00	914,000
東日本旅客鉄道	48,700	10,115.00	492,600,500
西日本旅客鉄道	24,600	9,841.00	242,088,600
東海旅客鉄道	23,000	22,440.00	516,120,000
西武ホールディングス	37,100	1,932.00	71,677,200
鴻池運輸	4,400	1,661.00	7,308,400
西日本鉄道	7,700	2,535.00	19,519,500
ハマキョウレックス	2,100	3,725.00	7,822,500
サカイ引越センター	1,500	6,750.00	10,125,000
近鉄グループホールディングス	26,200	6,210.00	162,702,000
阪急阪神ホールディングス	34,900	4,750.00	165,775,000
南海電気鉄道	12,400	2,963.00	36,741,200
京阪ホールディングス	11,700	5,370.00	62,829,000
神戸電鉄	600	3,975.00	2,385,000
名古屋鉄道	21,500	3,585.00	77,077,500
山陽電気鉄道	1,900	2,240.00	4,256,000
トランコム	700	7,270.00	5,089,000
日本通運	9,300	6,770.00	62,961,000
ヤマトホールディングス	45,900	1,819.00	83,492,100
山九	7,300	5,800.00	42,340,000
日新	2,300	1,728.00	3,974,400
丸全昭和運輸	2,100	3,100.00	6,510,000
センコーグループホールディングス	14,400	917.00	13,204,800

トナミホールディングス	600	5,070.00	3,042,000
ニッコンホールディングス	9,400	2,694.00	25,323,600
福山通運	3,400	4,055.00	13,787,000
セイノーホールディングス	19,600	1,520.00	29,792,000
エスライン	1,800	998.00	1,796,400
神奈川中央交通	600	3,960.00	2,376,000
日立物流	4,800	3,120.00	14,976,000
丸和運輸機関	2,800	2,557.00	7,159,600
C & F ロジホールディングス	2,600	1,388.00	3,608,800
日本郵船	21,900	1,905.00	41,719,500
商船三井	16,600	2,927.00	48,588,200
川崎汽船	8,100	1,794.00	14,531,400
NSユニテッド海運	1,500	2,278.00	3,417,000
飯野海運	12,400	355.00	4,402,000
九州旅客鉄道	23,300	3,780.00	88,074,000
SGホールディングス	27,500	2,712.00	74,580,000
日本航空	47,900	3,358.00	160,848,200
ANAホールディングス	47,900	3,749.00	179,577,100
パスコ	400	1,599.00	639,600
西本Wismettacホールディングス	500	3,785.00	1,892,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,465.00	1,758,000
Genky DrugStores	1,300	2,523.00	3,279,900
国際紙バルブ商事	6,400	301.00	1,926,400
総合メディカルホールディングス	2,400	1,972.00	4,732,800
ブックオフグループホールディングス	1,600	1,096.00	1,753,600
三菱倉庫	8,300	2,834.00	23,522,200
三井倉庫ホールディングス	3,000	1,946.00	5,838,000
住友倉庫	9,600	1,509.00	14,486,400
澁澤倉庫	1,400	2,159.00	3,022,600
ヤマタネ	1,400	1,514.00	2,119,600
東陽倉庫	5,200	336.00	1,747,200
乾汽船	1,600	1,197.00	1,915,200
日本トランスシティ	5,800	535.00	3,103,000
ケイヒン	500	1,363.00	681,500
中央倉庫	1,600	1,250.00	2,000,000
安田倉庫	2,100	1,001.00	2,102,100
東洋埠頭	1,200	1,405.00	1,686,000
宇徳	3,300	528.00	1,742,400
上組	15,000	2,523.00	37,845,000
キューソー流通システム	900	1,990.00	1,791,000
近鉄エクスプレス	5,600	1,931.00	10,813,600
東海運	6,200	290.00	1,798,000
エーアイティー	1,900	955.00	1,814,500
日本コンセプト	1,200	1,439.00	1,726,800
東京放送ホールディングス	16,500	1,811.00	29,881,500
日本テレビホールディングス	22,600	1,469.00	33,199,400
朝日放送グループホールディングス	2,700	758.00	2,046,600
テレビ朝日ホールディングス	7,500	1,805.00	13,537,500
スカパーJ S A Tホールディングス	17,800	472.00	8,401,600
テレビ東京ホールディングス	2,200	2,319.00	5,101,800
日本BS放送	1,600	1,085.00	1,736,000
ビジョン	2,500	1,642.00	4,105,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	995.00	1,691,500
コネクシオ	1,500	1,502.00	2,253,000
日本通信	21,000	233.00	4,893,000
日本電信電話	181,300	5,500.00	997,150,000
KDDI	202,100	3,118.00	630,147,800
ソフトバンク	246,500	1,482.00	365,313,000
光通信	2,800	25,170.00	70,476,000

NTTドコモ	200,400	2,977.00	596,590,800
エムティーアイ	2,600	698.00	1,814,800
GMOインターネット	10,700	2,162.00	23,133,400
KADOKAWA	7,300	1,731.00	12,636,300
学研ホールディングス	900	7,070.00	6,363,000
ゼンリン	5,400	1,909.00	10,308,600
インプレスホールディングス	11,200	165.00	1,848,000
東京電力ホールディングス	220,700	479.00	105,715,300
中部電力	84,600	1,506.00	127,407,600
関西電力	104,700	1,225.00	128,257,500
中国電力	38,200	1,447.00	55,275,400
北陸電力	25,300	761.00	19,253,300
東北電力	69,100	1,071.00	74,006,100
四国電力	24,900	1,026.00	25,547,400
九州電力	57,000	926.00	52,782,000
北海道電力	25,900	520.00	13,468,000
沖縄電力	5,100	1,976.00	10,077,600
電源開発	22,000	2,560.00	56,320,000
エフオン	1,300	768.00	998,400
イーレックス	3,900	1,720.00	6,708,000
レノバ	4,600	1,231.00	5,662,600
東京瓦斯	53,200	2,575.50	137,016,600
大阪瓦斯	53,600	2,030.00	108,808,000
東邦瓦斯	13,700	4,000.00	54,800,000
北海道瓦斯	1,500	1,592.00	2,388,000
広島ガス	5,700	357.00	2,034,900
西部瓦斯	3,100	2,464.00	7,638,400
静岡ガス	7,800	889.00	6,934,200
メタウォーター	1,300	3,985.00	5,180,500
アイネット	1,400	1,413.00	1,978,200
松竹	1,800	16,030.00	28,854,000
東宝	16,200	4,475.00	72,495,000
エイチ・アイ・エス	4,100	2,922.00	11,980,200
東映	1,000	17,670.00	17,670,000
ラックランド	700	2,517.00	1,761,900
エヌ・ティ・ティ・データ	72,200	1,507.00	108,805,400
共立メンテナンス	4,400	5,300.00	23,320,000
イチネンホールディングス	3,000	1,442.00	4,326,000
建設技術研究所	1,800	2,053.00	3,695,400
スペース	1,700	1,292.00	2,196,400
アインホールディングス	3,600	6,680.00	24,048,000
燦ホールディングス	1,400	1,307.00	1,829,800
東京テアトル	1,200	1,391.00	1,669,200
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,360.00	1,652,000
ナガワ	900	7,500.00	6,750,000
よみうりランド	600	4,505.00	2,703,000
東京都競馬	1,700	3,330.00	5,661,000
常盤興産	1,100	1,691.00	1,860,100
カナモト	4,300	3,165.00	13,609,500
東京ドーム	10,700	996.00	10,657,200
DTS	6,100	2,256.00	13,761,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,600	5,160.00	59,856,000
シーイーシー	2,900	2,189.00	6,348,100
カプコン	12,800	2,591.00	33,164,800
西尾レントオール	2,700	3,165.00	8,545,500
アイ・エス・ビー	900	1,829.00	1,646,100
日本空港ビルデング	8,700	5,500.00	47,850,000
トランス・コスモス	2,500	3,005.00	7,512,500
乃村工藝社	11,300	1,414.00	15,978,200

ジャステック	1,700	1,161.00	1,973,700
S C S K	6,300	5,790.00	36,477,000
藤田観光	1,200	2,906.00	3,487,200
K N T - C Tホールディングス	1,600	1,472.00	2,355,200
日本管財	2,800	1,930.00	5,404,000
トーカイ	2,600	2,599.00	6,757,400
白洋舎	600	2,984.00	1,790,400
セコム	28,000	9,581.00	268,268,000
日本システムウエア	900	2,466.00	2,219,400
セントラル警備保障	1,300	6,360.00	8,268,000
アイネス	2,700	1,258.00	3,396,600
丹青社	5,000	1,200.00	6,000,000
メイテック	3,300	5,800.00	19,140,000
T K C	2,300	5,060.00	11,638,000
富士ソフト	3,500	4,220.00	14,770,000
応用地質	2,800	1,401.00	3,922,800
船井総研ホールディングス	5,500	2,562.00	14,091,000
N S D	4,500	3,600.00	16,200,000
進学会ホールディングス	3,200	568.00	1,817,600
丸紅建材リース	1,000	1,734.00	1,734,000
コナミホールディングス	9,900	4,880.00	48,312,000
学究社	1,400	1,341.00	1,877,400
ベネッセホールディングス	8,800	2,957.00	26,021,600
イオンディライト	3,300	3,875.00	12,787,500
ナック	1,600	1,064.00	1,702,400
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,675.00	4,042,500
ニチイ学館	3,800	1,724.00	6,551,200
ダイセキ	4,400	3,210.00	14,124,000
ステップ	1,200	1,504.00	1,804,800
日鉄物産	1,900	4,990.00	9,481,000
泉州電業	800	2,924.00	2,339,200
元気寿司	700	3,135.00	2,194,500
トラスコ中山	5,700	2,772.00	15,800,400
ヤマダ電機	82,900	556.00	46,092,400
オートバックスセブン	10,100	1,806.00	18,240,600
モリト	2,200	820.00	1,804,000
アークランドサカモト	4,300	1,281.00	5,508,300
ニトリホールディングス	11,800	17,090.00	201,662,000
グルメ杵屋	1,900	1,183.00	2,247,700
愛眼	6,900	248.00	1,711,200
吉野家ホールディングス	8,900	2,756.00	24,528,400
加藤産業	4,300	3,695.00	15,888,500
イノテック	1,700	1,028.00	1,747,600
イエローハット	5,100	1,872.00	9,547,200
松屋フーズホールディングス	1,300	4,180.00	5,434,000
J B C Cホールディングス	1,800	1,751.00	3,151,800
J Kホールディングス	2,900	640.00	1,856,000
サガミホールディングス	3,600	1,374.00	4,946,400
日伝	2,500	2,047.00	5,117,500
関西スーパーマーケット	2,300	1,054.00	2,424,200
ミロク情報サービス	2,400	3,060.00	7,344,000
北沢産業	6,400	289.00	1,849,600
杉本商事	1,500	2,025.00	3,037,500
因幡電機産業	3,900	5,110.00	19,929,000
王将フードサービス	2,000	6,570.00	13,140,000
プレナス	3,000	1,909.00	5,727,000
ミニストップ	2,000	1,484.00	2,968,000
アークス	5,600	2,342.00	13,115,200
パローホールディングス	6,000	2,052.00	12,312,000
東テク	900	2,457.00	2,211,300

ミスミグループ本社	34,100	2,722.00	92,820,200	
ベルク	1,300	5,100.00	6,630,000	
大 庄	1,500	1,601.00	2,401,500	
タキヒヨー	900	1,928.00	1,735,200	
ファーストリテイリング	3,600	66,090.00	237,924,000	
ソフトバンクグループ	215,200	4,220.00	908,144,000	
蔵王産業	1,200	1,465.00	1,758,000	
スズケン	11,500	5,100.00	58,650,000	
サンドラッグ	10,200	3,855.00	39,321,000	
サックスパー ホールディングス	2,300	901.00	2,072,300	
ジェコス	1,900	936.00	1,778,400	
やまや	800	2,203.00	1,762,400	
ベルーナ	5,800	717.00	4,158,600	
合計	32,397,800		66,020,728,200	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	276,927,062	17,896,530
コール・ローン	385,289,854	719,791,373
国債証券	61,070,828,590	57,768,627,800
地方債証券	8,962,582,824	7,218,000,954
特殊債券	10,327,688,820	8,348,131,578
社債券	7,228,130,800	5,745,638,100
未収利息	227,564,980	185,554,319
前払費用	1,137,409	1,594,822
流動資産合計	88,480,150,339	80,005,235,476
資産合計	88,480,150,339	80,005,235,476
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,989,115	5,369,510
その他未払費用	12,309	3,824
流動負債合計	3,001,424	5,373,334
負債合計	3,001,424	5,373,334
純資産の部		
元本等		
元本	91,553,091,806	80,458,265,938
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,075,942,891	458,403,796
純資産合計	88,477,148,915	79,999,862,142
負債純資産合計	88,480,150,339	80,005,235,476

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	91,553,091,806口	80,458,265,938口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	3,075,942,891円	458,403,796円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9664円 (9,664円)	0.9943円 (9,943円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月20日現在	2019年11月20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	683,058,940	501,204,720
地方債証券	47,932,410	35,879,623
特殊債券	40,211,543	32,516,691
社債券	37,580,000	26,464,200
合計	808,782,893	406,344,206

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	130,618,054,372円	91,553,091,806円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	2,178,212,374円	7,229,627,282円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	41,243,174,940円	18,324,453,150円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB（適格機関投資家限定）	90,032,868,109円	76,296,408,816円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,198,123,874円	1,851,878,712円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	6,925,913円	34,686,709円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	196,812,753円	1,648,815,407円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	5,784,972円	34,894,519円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	13,759,679円	117,890,150円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,804,002円	300,648,162円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（6資産均等型）	25,017,328円	75,145,871円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リー ト/債券）	2,688,418円	4,591,102円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リー ト/債券）	7,329,823円	24,364,655円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（8資産均等型）	15,976,935円	29,860,218円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	1,990,783円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	2,897,961円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	7,036,801円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	27,156,072円
計	91,553,091,806円	80,458,265,938円

附属明細表（2019年11月20日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
国債証券	第395回 利付国債（2年）	198,000,000	198,631,620	
	第396回 利付国債（2年）	528,000,000	529,821,600	
	第397回 利付国債（2年）	460,000,000	461,711,200	
	第398回 利付国債（2年）	448,000,000	449,827,840	
	第399回 利付国債（2年）	520,000,000	522,267,200	
	第400回 利付国債（2年）	492,000,000	494,273,040	
	第401回 利付国債（2年）	501,000,000	503,414,820	
	第402回 利付国債（2年）	140,000,000	140,711,200	
	第403回 利付国債（2年）	53,000,000	53,283,550	
	第126回 利付国債（5年）	332,000,000	333,112,200	
	第127回 利付国債（5年）	491,000,000	493,052,380	
	第128回 利付国債（5年）	350,000,000	351,743,000	
	第129回 利付国債（5年）	278,000,000	279,581,820	
	第130回 利付国債（5年）	272,000,000	273,787,040	
	第131回 利付国債（5年）	516,000,000	519,859,680	
	第132回 利付国債（5年）	221,000,000	222,832,090	
	第133回 利付国債（5年）	322,000,000	324,978,500	
	第134回 利付国債（5年）	270,000,000	272,718,900	
	第135回 利付国債（5年）	324,000,000	327,528,360	

第137回 利付国債(5年)	229,000,000	231,830,440
第138回 利付国債(5年)	539,000,000	546,098,630
第1回 利付国債(40年)	110,000,000	169,423,100
第2回 利付国債(40年)	142,000,000	212,716,000
第3回 利付国債(40年)	133,000,000	200,731,580
第4回 利付国債(40年)	182,000,000	277,444,440
第5回 利付国債(40年)	182,000,000	268,817,640
第6回 利付国債(40年)	163,000,000	237,693,120
第7回 利付国債(40年)	138,000,000	193,901,040
第8回 利付国債(40年)	149,000,000	196,028,870
第9回 利付国債(40年)	176,000,000	173,794,720
第10回 利付国債(40年)	269,000,000	311,668,780
第11回 利付国債(40年)	162,000,000	182,321,280
第312回 利付国債(10年)	762,000,000	773,620,500
第313回 利付国債(10年)	291,000,000	296,860,740
第314回 利付国債(10年)	106,000,000	107,852,880
第315回 利付国債(10年)	109,000,000	111,441,600
第316回 利付国債(10年)	91,000,000	92,894,620
第318回 利付国債(10年)	55,000,000	56,222,650
第320回 利付国債(10年)	65,000,000	66,642,550
第321回 利付国債(10年)	69,000,000	70,959,600
第323回 利付国債(10年)	32,000,000	32,924,800
第324回 利付国債(10年)	99,000,000	101,604,690
第325回 利付国債(10年)	116,000,000	119,368,640
第327回 利付国債(10年)	28,000,000	28,889,840
第328回 利付国債(10年)	24,000,000	24,663,360
第329回 利付国債(10年)	105,000,000	108,861,900
第330回 利付国債(10年)	3,000,000	3,117,570
第332回 利付国債(10年)	196,000,000	202,573,840
第333回 利付国債(10年)	193,000,000	199,866,940
第334回 利付国債(10年)	257,000,000	266,745,440
第335回 利付国債(10年)	289,000,000	299,158,350
第336回 利付国債(10年)	53,000,000	54,988,030
第337回 利付国債(10年)	303,000,000	311,250,690
第338回 利付国債(10年)	491,000,000	507,679,270
第339回 利付国債(10年)	536,000,000	555,076,240
第340回 利付国債(10年)	566,000,000	587,066,520
第341回 利付国債(10年)	552,000,000	570,033,840
第342回 利付国債(10年)	557,000,000	568,613,450
第343回 利付国債(10年)	564,000,000	576,233,160
第344回 利付国債(10年)	672,000,000	687,146,880
第345回 利付国債(10年)	532,000,000	544,438,160
第346回 利付国債(10年)	647,000,000	662,657,400
第347回 利付国債(10年)	616,000,000	631,190,560
第348回 利付国債(10年)	624,000,000	639,649,920
第349回 利付国債(10年)	646,000,000	662,182,300
第350回 利付国債(10年)	814,000,000	834,317,440
第351回 利付国債(10年)	650,000,000	666,146,000
第352回 利付国債(10年)	616,000,000	631,190,560
第353回 利付国債(10年)	576,000,000	589,795,200
第354回 利付国債(10年)	372,000,000	380,615,520
第355回 利付国債(10年)	196,000,000	200,370,800
第356回 利付国債(10年)	224,000,000	228,786,880
第1回 利付国債(30年)	10,000,000	12,885,400
第2回 利付国債(30年)	83,000,000	104,379,140
第3回 利付国債(30年)	17,000,000	21,281,450
第4回 利付国債(30年)	54,000,000	71,694,720
第5回 利付国債(30年)	33,000,000	41,534,790
第6回 利付国債(30年)	47,000,000	60,714,600
第7回 利付国債(30年)	45,000,000	57,966,300

第8回 利付国債(30年)	40,000,000	49,265,600	
第9回 利付国債(30年)	37,000,000	43,660,740	
第10回 利付国債(30年)	59,000,000	67,379,180	
第11回 利付国債(30年)	50,000,000	61,250,000	
第12回 利付国債(30年)	57,000,000	73,099,650	
第13回 利付国債(30年)	61,000,000	77,576,140	
第14回 利付国債(30年)	63,000,000	83,939,310	
第15回 利付国債(30年)	78,000,000	105,427,920	
第16回 利付国債(30年)	69,000,000	93,541,230	
第17回 利付国債(30年)	68,000,000	91,437,560	
第18回 利付国債(30年)	108,000,000	143,972,640	
第19回 利付国債(30年)	89,000,000	118,942,270	
第20回 利付国債(30年)	93,000,000	127,582,980	
第21回 利付国債(30年)	93,000,000	124,981,770	
第22回 利付国債(30年)	104,000,000	143,403,520	
第23回 利付国債(30年)	122,000,000	168,784,560	
第24回 利付国債(30年)	99,000,000	137,303,100	
第25回 利付国債(30年)	112,000,000	151,972,800	
第26回 利付国債(30年)	192,000,000	264,504,960	
第27回 利付国債(30年)	187,000,000	262,174,000	
第28回 利付国債(30年)	229,000,000	322,965,570	
第29回 利付国債(30年)	233,000,000	326,018,260	
第30回 利付国債(30年)	232,000,000	321,753,840	
第31回 利付国債(30年)	215,000,000	295,605,650	
第32回 利付国債(30年)	280,000,000	392,546,000	
第33回 利付国債(30年)	307,000,000	414,189,050	
第34回 利付国債(30年)	284,000,000	396,926,920	
第35回 利付国債(30年)	294,000,000	400,501,500	
第36回 利付国債(30年)	350,000,000	479,010,000	
第37回 利付国債(30年)	362,000,000	489,413,140	
第38回 利付国債(30年)	245,000,000	327,256,300	
第39回 利付国債(30年)	202,000,000	274,986,640	
第40回 利付国債(30年)	182,000,000	244,071,100	
第41回 利付国債(30年)	189,000,000	249,542,370	
第42回 利付国債(30年)	203,000,000	268,343,670	
第43回 利付国債(30年)	198,000,000	262,051,020	
第44回 利付国債(30年)	196,000,000	260,009,680	
第45回 利付国債(30年)	218,000,000	279,016,020	
第46回 利付国債(30年)	247,000,000	316,765,150	
第47回 利付国債(30年)	239,000,000	312,805,590	
第48回 利付国債(30年)	246,000,000	310,124,820	
第49回 利付国債(30年)	245,000,000	309,062,600	
第50回 利付国債(30年)	241,000,000	267,787,150	
第51回 利付国債(30年)	174,000,000	171,259,500	
第52回 利付国債(30年)	197,000,000	203,747,250	
第53回 利付国債(30年)	199,000,000	210,782,790	
第54回 利付国債(30年)	240,000,000	266,601,600	
第55回 利付国債(30年)	232,000,000	257,608,160	
第56回 利付国債(30年)	220,000,000	244,175,800	
第57回 利付国債(30年)	227,000,000	252,149,330	
第58回 利付国債(30年)	282,000,000	313,087,680	
第59回 利付国債(30年)	189,000,000	204,853,320	
第60回 利付国債(30年)	186,000,000	211,681,020	
第61回 利付国債(30年)	164,000,000	177,508,680	
第62回 利付国債(30年)	156,000,000	160,304,040	
第63回 利付国債(30年)	112,000,000	111,851,040	
第48回 利付国債(20年)	57,000,000	58,675,230	
第49回 利付国債(20年)	35,000,000	36,081,850	
第50回 利付国債(20年)	45,000,000	46,270,800	
第52回 利付国債(20年)	4,000,000	4,170,000	

第53回	利付国債(20年)	4,000,000	4,192,960
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,050,330
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,115,100
第68回	利付国債(20年)	109,000,000	120,467,890
第70回	利付国債(20年)	40,000,000	44,856,800
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	71,248,640
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,429,600
第76回	利付国債(20年)	8,000,000	8,916,400
第78回	利付国債(20年)	13,000,000	14,560,520
第80回	利付国債(20年)	13,000,000	14,707,290
第81回	利付国債(20年)	64,000,000	72,391,040
第82回	利付国債(20年)	104,000,000	118,249,040
第83回	利付国債(20年)	69,000,000	78,863,550
第84回	利付国債(20年)	124,000,000	140,961,960
第85回	利付国債(20年)	89,000,000	102,212,940
第86回	利付国債(20年)	74,000,000	85,935,460
第87回	利付国債(20年)	71,000,000	81,996,480
第88回	利付国債(20年)	129,000,000	150,647,490
第89回	利付国債(20年)	73,000,000	84,762,490
第90回	利付国債(20年)	237,000,000	276,673,800
第91回	利付国債(20年)	167,000,000	196,113,110
第92回	利付国債(20年)	297,000,000	346,426,740
第93回	利付国債(20年)	189,000,000	220,158,540
第94回	利付国債(20年)	237,000,000	277,837,470
第95回	利付国債(20年)	242,000,000	288,773,760
第96回	利付国債(20年)	169,000,000	199,061,720
第97回	利付国債(20年)	233,000,000	277,591,540
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	203,548,240
第99回	利付国債(20年)	306,000,000	363,647,340
第100回	利付国債(20年)	250,000,000	300,420,000
第101回	利付国債(20年)	182,000,000	221,783,380
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	221,589,250
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	205,426,260
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	161,746,200
第105回	利付国債(20年)	223,000,000	268,257,850
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	184,211,840
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	183,479,200
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	240,115,380
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	191,944,200
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	222,840,560
第111回	利付国債(20年)	176,000,000	215,563,040
第112回	利付国債(20年)	249,000,000	302,559,900
第113回	利付国債(20年)	389,000,000	474,432,180
第114回	利付国債(20年)	161,000,000	197,064,000
第115回	利付国債(20年)	172,000,000	212,278,960
第116回	利付国債(20年)	194,000,000	240,303,920
第117回	利付国債(20年)	266,000,000	326,717,160
第118回	利付国債(20年)	188,000,000	229,595,000
第119回	利付国債(20年)	103,000,000	123,591,760
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	103,715,920
第121回	利付国債(20年)	181,000,000	219,791,920
第122回	利付国債(20年)	117,000,000	140,798,970
第123回	利付国債(20年)	193,000,000	239,362,460
第124回	利付国債(20年)	115,000,000	141,343,050
第125回	利付国債(20年)	125,000,000	156,946,250
第126回	利付国債(20年)	114,000,000	140,539,200
第127回	利付国債(20年)	108,000,000	131,912,280
第128回	利付国債(20年)	187,000,000	229,063,780
第129回	利付国債(20年)	108,000,000	131,038,560
第130回	利付国債(20年)	180,000,000	219,106,800

第131回	利付国債（20年）	95,000,000	114,512,050	
第132回	利付国債（20年）	126,000,000	152,240,760	
第133回	利付国債（20年）	165,000,000	201,361,050	
第134回	利付国債（20年）	145,000,000	177,388,650	
第135回	利付国債（20年）	89,000,000	107,781,670	
第136回	利付国債（20年）	93,000,000	111,478,170	
第137回	利付国債（20年）	103,000,000	125,023,460	
第138回	利付国債（20年）	112,000,000	133,131,040	
第139回	利付国債（20年）	121,000,000	145,350,040	
第140回	利付国債（20年）	292,000,000	355,232,600	
第141回	利付国債（20年）	213,000,000	259,681,080	
第142回	利付国債（20年）	134,000,000	165,114,800	
第143回	利付国債（20年）	209,000,000	252,551,420	
第144回	利付国債（20年）	139,000,000	166,120,290	
第145回	利付国債（20年）	309,000,000	378,525,000	
第146回	利付国債（20年）	249,000,000	305,640,030	
第147回	利付国債（20年）	277,000,000	336,790,450	
第148回	利付国債（20年）	245,000,000	294,901,600	
第149回	利付国債（20年）	267,000,000	322,098,120	
第150回	利付国債（20年）	278,000,000	331,781,880	
第151回	利付国債（20年）	254,000,000	295,945,560	
第152回	利付国債（20年）	246,000,000	286,845,840	
第153回	利付国債（20年）	259,000,000	306,202,750	
第154回	利付国債（20年）	247,000,000	288,439,190	
第155回	利付国債（20年）	267,000,000	303,584,340	
第156回	利付国債（20年）	232,000,000	241,433,120	
第157回	利付国債（20年）	242,000,000	243,759,340	
第158回	利付国債（20年）	279,000,000	294,545,880	
第159回	利付国債（20年）	310,000,000	332,121,600	
第160回	利付国債（20年）	275,000,000	299,277,000	
第161回	利付国債（20年）	278,000,000	297,640,700	
第162回	利付国債（20年）	273,000,000	292,049,940	
第163回	利付国債（20年）	284,000,000	303,820,360	
第164回	利付国債（20年）	353,000,000	371,063,010	
第165回	利付国債（20年）	284,000,000	298,191,480	
第166回	利付国債（20年）	289,000,000	313,796,200	
第167回	利付国債（20年）	305,000,000	319,758,950	
第168回	利付国債（20年）	253,000,000	260,235,800	
第169回	利付国債（20年）	246,000,000	248,295,180	
第170回	利付国債（20年）	54,000,000	54,458,460	
国債証券 合計		51,039,000,000	57,768,627,800	
地方債証券	第707回 東京都公募公債	200,000,000	203,785,800	
	第708回 東京都公募公債	300,000,000	306,408,300	
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	307,473,300	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	305,655,000	
	第30回 神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	113,649,500	
	第360回 大阪府公募公債（10年）	300,000,000	306,287,100	
	第378回 大阪府公募公債（10年）	144,000,000	147,484,512	
	第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	117,106,900	
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	306,849,600	
	第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	118,169,500	
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	306,286,800	
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	305,733,600	
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	103,074,700	
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	121,929,542	
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	305,993,100	
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	306,574,800	
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	307,079,700	
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	306,929,400	
	第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,193,200	

	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,533,500	
	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,950,000	
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	153,983,850	
	第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,819,200	
	第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	133,817,700	
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	331,448,400	
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	102,531,300	
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	203,876,000	
	第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,888,500	
	第4回 川崎市30年公募公債	100,000,000	135,798,100	
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	153,901,650	
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,877,000	
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	203,617,600	
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	102,163,500	
	平成29年度第1回 仙台市公募公債（20年）	100,000,000	105,130,300	
地方債証券 合計		6,913,000,000	7,218,000,954	
特殊債券	第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	204,593,600	
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	323,754,300	
	第139回 政保道路機構債券	500,000,000	509,651,000	
	第155回 政保道路機構債券	300,000,000	306,156,600	
	第163回 政保道路機構債券	300,000,000	307,052,700	
	第190回 政保道路機構債券	500,000,000	510,911,000	
	第212回 政保道路機構債券	100,000,000	118,949,000	
	第218回 政保道路機構債券	500,000,000	514,863,500	
	第233回 政府道路機構債券	100,000,000	116,880,500	
	第249回 政保道路機構債券	179,000,000	183,879,361	
	第278回 政保道路機構債券	100,000,000	100,175,200	
	第316回 政保道路機構債券	100,000,000	105,431,700	
	第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,645,600	
	第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,486,300	
	第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	410,424,400	
	第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,637,000	
	第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,131,943	
	第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,919,000	
	第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	199,843,000	
	第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,026,449,000	
	第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,173,000	33,429,925	
	第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	84,992,000	90,813,952	
	第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	101,196,000	109,504,191	
	第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,378,000	88,053,844	
	第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	91,368,000	97,544,476	
	第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	92,588,000	98,559,926	
	第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,727,000	47,410,620	
	第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	379,608,000	401,587,303	
	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	238,225,000	250,755,635	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	152,748,000	162,279,475	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	137,154,000	143,915,692	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	253,392,000	256,711,435	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	99,812,100	
第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,048,500		
第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,096,600		
第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,096,200		
第45回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,096,200		
第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,580,800		
特殊債券 合計		8,071,549,000	8,348,131,578	

社債券	第26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	200,000,000	201,402,800	
	第3回 ノルデア・バンク	200,000,000	208,305,800	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	204,360,000	
	第33回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,570,100	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	205,341,600	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	102,250,300	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	102,520,100	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	204,298,200	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	205,411,200	
	第14回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,436,500	
	第12回 オリエンタルランド	100,000,000	100,753,700	
	第3回 富士フイルムホールディングス	300,000,000	307,577,100	
	第68回 新日本製鐵	200,000,000	203,734,000	
	第19回 豊田自動織機	200,000,000	203,693,200	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	102,454,000	
	第71回 伊藤忠商事	200,000,000	204,879,600	
	第39回 住友商事	100,000,000	103,760,800	
	第45回 住友商事	100,000,000	102,483,300	
	第46回 住友商事	100,000,000	102,385,600	
	第79回 三菱商事	100,000,000	102,394,900	
	第1回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	102,009,500	
	第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	204,199,600	
	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	102,027,800	
	第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	103,244,800	
	第46回 三井不動産	100,000,000	102,498,400	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,283,500	
	第111回 三菱地所	100,000,000	102,430,600	
	第75回 東京急行電鉄	100,000,000	102,363,900	
	第77回 東京急行電鉄	100,000,000	103,223,100	
	第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,565,600	
	第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,327,900	
	第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	204,787,400	
	第381回 中国電力	200,000,000	206,898,600	
第304回 北陸電力	100,000,000	103,280,900		
第306回 北陸電力	100,000,000	103,160,000		
第253回 四国電力	200,000,000	206,427,400		
第429回 九州電力	200,000,000	206,838,200		
第13回 電源開発	100,000,000	110,058,100		
社債券 合計	5,600,000,000	5,745,638,100		
合計	71,623,549,000	79,080,398,432		

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表  
該当事項はありません。

第8 借入金明細表  
該当事項はありません。

## 「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	112,422,984	23,671,023
コール・ローン	156,414,598	952,039,197
投資証券	17,146,099,070	31,416,451,100
未収入金	-	30,846,954
未収配当金	91,860,624	148,501,553
流動資産合計	17,506,797,276	32,571,509,827
資産合計	17,506,797,276	32,571,509,827
負債の部		
流動負債		
未払金	77,893,800	524,172,847
未払解約金	40,589,882	247,460,838
その他未払費用	4,427	5,218
流動負債合計	118,488,109	771,638,903
負債合計	118,488,109	771,638,903
純資産の部		
元本等		
元本	11,518,929,567	16,398,065,583
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,869,379,600	15,401,805,341
純資産合計	17,388,309,167	31,799,870,924
負債純資産合計	17,506,797,276	32,571,509,827

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 . 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1 . 受益権総口数	11,518,929,567口	16,398,065,583口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5095円 (15,095円)	1.9392円 (19,392円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月20日現在	2019年11月20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)
投資証券	87,179,958	1,436,964,806
合計	87,179,958	1,436,964,806

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,094,614,072円	11,518,929,567円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	3,509,722,093円	12,025,469,621円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	3,085,406,598円	7,146,333,605円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,702,001,026円	1,589,859,033円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,029,916,722円	1,501,629,877円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	5,938,188,472円	8,117,494,358円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,915,320,160円	1,858,643,446円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	654,619,964円	2,484,924,690円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	248,488,740円	785,204,355円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	16,289,044円	38,195,777円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,945,644円	3,282,914円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	702,607円	938,090円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	1,022,448円	2,642,646円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	10,434,740円	15,250,397円
計	11,518,929,567円	16,398,065,583円

附属明細表(2019年11月20日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド投資法人	389	53,526,400	
	GLP投資法人	6,899	970,689,300	
	MCUBS MidCity投資法人	3,553	433,110,700	
	Oneリート投資法人	432	150,984,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,145	242,599,500	
	いちごホテルリート投資法人	459	62,194,500	
	さくら総合リート投資法人	599	57,024,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,388	799,488,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,627	937,839,000	
	イオンリート投資法人	2,989	448,648,900	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,795	376,542,200	
	インヴィンシブル投資法人	12,150	793,395,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	284	35,954,400	
	オリックス不動産投資法人	5,519	1,333,390,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,923	281,142,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	857	719,023,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,724	374,970,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,070	304,950,000	

コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,153	404,703,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	554	65,482,800	
サンケイリアルエステート投資法人	401	50,004,700	
ザイマックス・リート投資法人	402	52,983,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,923	789,685,500	
ジャパンエクセレント投資法人	2,480	455,080,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,770	2,052,570,000	
スターアジア不動産投資法人	919	105,685,000	
スターツプロシード投資法人	431	87,234,400	
タカラレーベン不動産投資法人	786	95,263,200	
トーセイ・リート投資法人	603	82,671,300	
ヒューリックリート投資法人	2,356	482,980,000	
フロンティア不動産投資法人	984	479,208,000	
プレミア投資法人	2,502	403,822,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	591	80,198,700	
マリモ地方創生リート投資法人	238	31,868,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,219	1,360,095,300	
ラサールロジポート投資法人	2,575	420,497,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	428	51,659,600	
阪急阪神リート投資法人	1,251	218,799,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	682	314,402,000	
三菱地所物流リート投資法人	545	195,655,000	
産業ファンド投資法人	3,408	592,651,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	650	93,665,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,980	383,130,000	
森ヒルズリート投資法人	3,187	566,329,900	
星野リゾート・リート投資法人	421	245,022,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,099	788,842,600	
大江戸温泉リート投資法人	471	46,299,300	
大和ハウスリート投資法人	3,734	1,138,870,000	
大和証券オフィス投資法人	639	531,648,000	
投資法人みらい	3,004	185,647,200	
東急リアル・エステート投資法人	1,857	379,756,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	920	638,480,000	
日本ビルファンド投資法人	2,682	2,209,968,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,753	885,265,000	
日本プロロジスリート投資法人	3,980	1,191,612,000	
日本ヘルスケア投資法人	134	29,145,000	
日本リート投資法人	900	449,550,000	
日本リテールファンド投資法人	5,235	1,315,032,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,810	510,601,000	
日本賃貸住宅投資法人	3,115	334,551,000	
福岡リート投資法人	1,432	264,204,000	
平和不動産リート投資法人	1,725	240,465,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,638	1,739,693,200	
投資証券 合計	160,369	31,416,451,100	
合計	160,369	31,416,451,100	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	465,602,430	785,869,477
金銭信託	1,475,219,625	98,970,113
コール・ローン	2,052,479,632	3,980,538,915
株式	140,969,194,066	199,297,460,924
投資証券	3,569,453,040	5,434,364,911
派生商品評価勘定	15,686,337	212,899,978
未収入金	128,523,528	48,299,571
未収配当金	227,585,194	290,269,135
差入委託証拠金	1,285,508,197	1,858,544,563
流動資産合計	150,189,252,049	212,007,217,587
資産合計	150,189,252,049	212,007,217,587
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	91,327,346	8,913,084
未払金	66,447,914	3,148,485
未払解約金	313,161,773	951,945,848
その他未払費用	53,264	23,905
流動負債合計	470,990,297	964,031,322
負債合計	470,990,297	964,031,322
純資産の部		
元本等		
元本	88,596,175,879	110,982,930,759
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	61,122,085,873	100,060,255,506
純資産合計	149,718,261,752	211,043,186,265
負債純資産合計	150,189,252,049	212,007,217,587

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	88,596,175,879口	110,982,930,759口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6899円 (16,899円)	1.9016円 (19,016円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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11月20日現在	2019年11月20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	6,309,143,648	14,047,876,149
投資証券	237,194,371	257,545,307
合計	6,071,949,277	14,305,421,456

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2018年11月20日 現在				2019年11月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	17,712,427	-	17,725,213	12,786	280,684,290	-	281,182,580	498,290
アメリカ・ドル	17,712,427	-	17,725,213	12,786	210,740,750	-	210,896,350	155,600
イギリス・ポンド	-	-	-	-	21,234,187	-	21,311,920	77,733
ユーロ	-	-	-	-	48,709,353	-	48,974,310	264,957
買 建	3,104,436,814	-	3,082,215,620	22,221,194	3,217,946,194	-	3,211,968,970	5,977,224
アメリカ・ドル	2,224,128,384	-	2,202,953,420	21,174,964	2,243,779,726	-	2,236,585,610	7,194,116
イギリス・ポンド	261,185,981	-	257,530,400	3,655,581	266,133,660	-	266,399,000	265,340
ユーロ	619,122,449	-	621,731,800	2,609,351	708,032,808	-	708,984,360	951,552
合計	3,122,149,241	-	3,099,940,833	22,233,980	3,498,630,484	-	3,493,151,550	6,475,514

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	2018年11月20日 現在				2019年11月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028	5,816,144,283	-	6,026,606,691	210,462,408
合計	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028	5,816,144,283	-	6,026,606,691	210,462,408

## (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11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	69,768,494,357円	88,596,175,879円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	28,563,949,383円	43,121,658,246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	9,736,267,861円	20,734,903,366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)	562,227,597円	705,419,292円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,650,340,512円	3,284,755,401円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,084,617,874円	2,471,314,789円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	- 円	1,485,332,737円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	4,090,937円
ニッセイインデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	23,976,047円
ニッセイインデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	32,048,288円
ニッセイ外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	11,709,845,155円	11,371,888,952円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	60,295,944,002円	75,325,693,121円
D Cニッセイ外国株式インデックス	10,792,141,547円	15,291,138,731円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	406,450,400円	605,358,530円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	13,254,832円	59,931,201円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,183,684円	72,703,499円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	7,256,656円	39,305,684円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	10,766,461円	79,667,845円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	5,134,713円	22,747,558円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	14,090,128円	40,031,114円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,703,740円	24,696,756円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,668,453円	3,481,454円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	602,496円	995,057円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	8,947,629円	16,196,854円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	- 円	4,212,091円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	- 円	3,974,678円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	- 円	6,685,873円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	- 円	7,284,270円
計	88,596,175,879円	110,982,930,759円

## 附属明細表（2019年11月20日現在）

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	27,434	170.68	4,682,435.12	
	ABBOTT LABORATORIES	84,059	84.29	7,085,333.11	
	ABBVIE INC	70,451	89.02	6,271,548.02	
	ABIOMED INC	2,144	184.34	395,224.96	
	ACCENTURE PLC	30,332	198.34	6,016,048.88	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	36,483	53.28	1,943,814.24	
	ACUITY BRANDS INC	1,880	128.00	240,640.00	
	ADOBE INC	23,230	300.60	6,982,938.00	
	ADVANCE AUTO PARTS	3,409	161.98	552,189.82	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	48,967	41.29	2,021,847.43	
	AERCAP HOLDINGS NV	5,959	59.06	351,938.54	
	AES CORP	31,637	18.48	584,651.76	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,323	84.89	197,199.47	
	AFLAC INC	35,506	54.08	1,920,164.48	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,976	79.29	1,187,447.04	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,505	241.31	2,534,961.55	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,778	88.51	688,430.78	
	ALBEMARLE CORP	5,029	66.46	334,227.34	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,651	110.65	1,178,533.15	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	3,609	271.60	980,204.40	
	ALKERMES PLC	7,469	19.95	149,006.55	
	ALLEGHANY CORP	689	785.11	540,940.79	
	ALLEGION PLC	4,479	119.21	533,941.59	
	ALLERGAN PLC	15,623	185.22	2,893,692.06	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,087	103.54	216,087.98	
	ALLIANT ENERGY CORP	11,227	52.58	590,315.66	
	ALLSTATE CORP	15,824	111.03	1,756,938.72	
	ALLY FINANCIAL INC	18,899	30.73	580,766.27	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,285	97.93	517,560.05	
	ALPHABET INC-CL A	14,237	1,312.59	18,687,343.83	
	ALPHABET INC-CL C	14,950	1,315.46	19,666,127.00	
	ALTICE USA INC- A	7,192	26.80	192,745.60	
	ALTRIA GROUP INC	89,135	46.93	4,183,105.55	
	AMAZON.COM INC	19,931	1,752.79	34,934,857.49	
	AMCOR PLC	78,021	10.14	791,132.94	
	AMERCO	482	363.23	175,076.86	
	AMEREN CORPORATION	11,615	75.45	876,351.75	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,234	29.29	153,303.86	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	23,519	90.67	2,132,467.73	
	AMERICAN EXPRESS CO	33,808	120.00	4,056,960.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,627	107.99	391,679.73		

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,455	53.41	2,214,111.55	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,623	119.13	1,027,257.99	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,291	159.01	1,000,331.91	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,538	87.81	661,911.78	
AMERITRADE HOLDING CORP	13,147	40.64	534,294.08	
AMETEK INC	10,798	99.18	1,070,945.64	
AMGEN INC	29,056	224.50	6,523,072.00	
AMPHENOL CORP-CL A	14,237	103.26	1,470,112.62	
ANALOG DEVICES INC	17,662	111.71	1,973,022.02	
ANSYS INC	3,961	242.42	960,225.62	
ANTHEM INC	12,245	292.72	3,584,356.40	
AON PLC	11,439	199.62	2,283,453.18	
APACHE CORP	17,960	22.37	401,765.20	
APPLE INC	219,141	266.29	58,355,056.89	
APPLIED MATERIALS INC	44,488	60.94	2,711,098.72	
APTIV PLC	12,292	91.14	1,120,292.88	
ARAMARK	11,739	45.12	529,663.68	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,168	41.50	795,472.00	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,541	43.08	1,143,386.28	
ARCONIC INC	18,859	31.01	584,817.59	
ARISTA NETWORKS INC	2,546	194.00	493,924.00	
ARROW ELECTRONICS INC	3,967	79.25	314,384.75	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,856	92.43	818,560.08	
ASSURANT INC	2,932	132.28	387,844.96	
AT&T INC	348,001	38.00	13,224,038.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	7,467	44.07	329,070.69	
ATMOS ENERGY CORP	5,533	108.64	601,105.12	
AUTODESK INC	10,484	164.53	1,724,932.52	
AUTOLIV INC	3,996	80.15	320,279.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	20,749	171.09	3,549,946.41	
AUTOZONE INC	1,174	1,173.98	1,378,252.52	
AVERY DENNISON CORP	4,015	131.54	528,133.10	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	13,845	23.75	328,818.75	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,173	29.20	297,051.60	
BAKER HUGHES COMPANY	24,593	22.01	541,291.93	
BALL CORP	15,246	67.25	1,025,293.50	
BANK OF AMERICA CORP	429,947	32.94	14,162,454.18	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	41,010	48.69	1,996,776.90	
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,082	81.67	1,885,106.94	
BB&T CORPORATION	36,486	54.69	1,995,419.34	
BECTON DICKINSON & CO	12,858	245.78	3,160,239.24	
BEIGENE LTD-ADR	1,732	203.90	353,154.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	61,909	219.03	13,559,928.27	
BEST BUY CO INC	11,419	75.36	860,535.84	
BIOGEN INC	9,207	285.43	2,627,954.01	

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,539	77.73	663,736.47	
BLACKROCK INC	5,496	492.80	2,708,428.80	
BOEING CO	25,467	367.00	9,346,389.00	
BOOKING HOLDINGS INC	2,060	1,845.30	3,801,318.00	
BORGWARNER INC	9,813	43.51	426,963.63	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,255	42.63	2,824,450.65	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,774	40.41	192,917.34	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,909	56.48	4,400,300.32	
BROADCOM INC	18,874	317.70	5,996,269.80	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	5,554	122.05	677,865.70	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	14,660	66.14	969,612.40	
BUNGE LIMITED	6,764	55.66	376,484.24	
BURLINGTON STORES INC	3,170	205.04	649,976.80	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,881	75.90	522,267.90	
CABOT OIL & GAS CORP	20,140	16.90	340,366.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	13,315	68.48	911,877.77	
CAMPBELL SOUP CO	7,947	48.16	382,727.52	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,286	97.07	2,163,302.02	
CAPRI HOLDINGS LIMITED	7,141	36.52	260,789.32	
CARDINAL HEALTH INC	14,226	55.68	792,103.68	
CARMAX INC	7,943	100.15	795,491.45	
CARNIVAL CORP	19,955	44.49	887,797.95	
CATERPILLAR INC	27,224	143.18	3,897,932.32	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,347	122.50	655,007.50	
CBRE GROUP INC	15,051	55.87	840,899.37	
CBS CORP-CL B	16,098	39.38	633,939.24	
CDK GLOBAL INC	5,829	52.26	304,623.54	
CDW CORP/DE	6,974	137.80	961,017.20	
CELANESE CORP-SERIES A	6,022	125.89	758,109.58	
CELGENE CORP	33,574	108.13	3,630,356.62	
CENTENE CORP	19,687	59.39	1,169,210.93	
CENTERPOINT ENERGY INC	24,059	25.34	609,655.06	
CENTURYLINK INC	47,468	15.08	715,817.44	
CERNER CORP	15,451	68.14	1,052,831.14	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,626	45.76	486,245.76	
CHARLES SCHWAB CORP	57,181	44.40	2,538,836.40	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	7,539	478.97	3,610,954.83	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,775	117.31	677,465.25	
CHENIERE ENERGY INC	11,218	59.80	670,836.40	
CHEVRON CORP	90,712	116.45	10,563,412.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,253	766.78	960,775.34	
CHUBB LTD	21,822	152.83	3,335,056.26	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,769	68.90	810,884.10	
CIGNA CORP	18,078	200.02	3,615,961.56	
CIMAREX ENERGY CO	4,719	45.19	213,251.61	

CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,372	107.90	795,438.80	
CINTAS CORP	4,227	257.90	1,090,143.30	
CISCO SYSTEMS INC	203,796	45.47	9,266,604.12	
CIT GROUP INC	4,492	44.66	200,612.72	
CITIGROUP INC	110,002	74.82	8,230,349.64	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,724	38.03	826,163.72	
CITRIX SYSTEMS INC	6,232	113.33	706,272.56	
CLOROX CO	6,090	146.51	892,245.90	
CME GROUP INC	17,075	206.18	3,520,523.50	
CMS ENERGY CORP	13,609	61.44	836,136.96	
COCA-COLA CO	193,151	53.08	10,252,455.08	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,335	50.99	577,971.65	
COGNEX CORP	8,110	50.54	409,879.40	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	27,053	63.92	1,729,227.76	
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,858	67.16	2,609,703.28	
COMCAST CORP	216,016	44.81	9,679,676.96	
COMERICA INC	7,269	69.45	504,832.05	
CONAGRA BRANDS INC	23,182	29.32	679,696.24	
CONCHO RESOURCES INC	9,525	70.92	675,513.00	
CONOCOPHILLIPS	53,716	57.17	3,070,943.72	
CONSOLIDATED EDISON INC	15,583	86.88	1,353,851.04	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,959	180.96	1,440,260.64	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,372	29.61	129,454.92	
COOPER COS INC/THE	2,357	309.07	728,477.99	
COPART INC	9,809	86.38	847,301.42	
CORNING INC	37,289	28.95	1,079,516.55	
CORTEVA INC	35,921	25.70	923,169.70	
COSTAR GROUP INC	1,740	590.70	1,027,818.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	20,932	302.24	6,326,487.68	
COTY INC-CL A	14,540	11.97	174,043.80	
CROWN HOLDINGS INC	6,470	74.41	481,432.70	
CSX CORP	36,978	71.01	2,625,807.78	
CUMMINS INC	7,103	182.96	1,299,564.88	
CVS HEALTH CORP	61,891	75.35	4,663,486.85	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,808	116.93	211,409.44	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	16,800	5.99	100,632.00	
DANAHER CORP	30,675	143.60	4,404,930.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,859	113.49	664,937.91	
DAVITA INC	4,940	72.41	357,705.40	
DEERE & CO	14,355	173.65	2,492,745.75	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,483	56.21	420,619.43	
DELTA AIR LINES INC	7,822	57.07	446,401.54	
DENTSPLY SIRONA INC	11,203	56.39	631,737.17	
DEVON ENERGY CORPORATION	19,495	21.49	418,947.55	
DEXCOM INC	4,352	217.58	946,908.16	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,447	74.19	552,492.93	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,407	83.91	1,292,801.37	
DISCOVERY INC-A	7,526	31.57	237,595.82	

DISCOVERY INC-C	17,399	29.22	508,485.77
DISH NETWORK CORP	11,069	35.83	396,602.27
DOCUSIGN INC	4,988	66.57	332,051.16
DOLLAR GENERAL CORP	12,301	158.43	1,948,847.43
DOLLAR TREE INC	11,343	106.88	1,212,339.84
DOMINION ENERGY INC	38,382	82.42	3,163,444.44
DOMINO'S PIZZA INC	1,862	285.74	532,047.88
DOVER CORP	6,903	109.10	753,117.30
DOW INC	35,784	53.39	1,910,507.76
DR HORTON INC	16,927	54.14	916,427.78
DROPBOX INC-CLASS A	9,174	19.03	174,581.22
DTE ENERGY COMPANY	8,760	123.63	1,082,998.80
DUKE ENERGY CORP	34,711	87.03	3,020,898.33
DUPONT DE NEMOURS INC	35,767	66.01	2,360,979.67
DXC TECHNOLOGY CO	12,741	36.98	471,162.18
E*TRADE FINANCIAL	11,459	45.00	515,655.00
EAST WEST BANCORP INC	6,692	44.37	296,924.04
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,531	78.46	512,422.26
EATON CORP PLC	20,127	90.21	1,815,656.67
EATON VANCE CORP	5,207	48.27	251,341.89
EBAY INC	39,356	35.06	1,379,821.36
ECOLAB INC	12,369	189.43	2,343,059.67
EDISON INTERNATIONAL	16,882	68.86	1,162,494.52
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,927	243.56	2,417,820.12
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,970	26.27	445,801.90
ELECTRONIC ARTS INC	14,145	96.69	1,367,680.05
ELI LILLY & CO	41,639	115.10	4,792,648.90
EMERSON ELECTRIC CO	29,163	73.28	2,137,064.64
ENTERGY CORP	9,132	116.19	1,061,047.08
EOG RESOURCES INC	27,576	70.40	1,941,350.40
EPAM SYSTEMS INC	2,585	209.70	542,074.50
EQUIFAX INC	5,768	141.34	815,249.12
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,219	177.29	216,116.51
ESTEE LAUDER COS INC	10,434	196.10	2,046,107.40
EVEREST RE GROUP LTD	1,946	267.02	519,620.92
EVERGY INC	11,737	64.77	760,205.49
EVERSOURCE ENERGY	15,130	82.20	1,243,686.00
EXACT SCIENCES CORP	6,165	83.80	516,627.00
EXELON CORP	46,185	45.37	2,095,413.45
EXPEDIA GROUP INC	6,665	94.88	632,375.20
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	8,600	75.88	652,568.00
EXXON MOBIL CORP	201,444	67.82	13,661,932.08
F5 NETWORKS INC	2,774	144.29	400,260.46
FACEBOOK INC-A	114,419	199.32	22,805,995.08
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,813	259.80	471,017.40
FASTENAL CO	27,128	35.73	969,283.44
FEDEX CORP	11,893	155.52	1,849,599.36
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,073	48.09	628,680.57
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,256	137.66	4,027,380.96

FIFTH THIRD BANCORP	34,854	29.87	1,041,088.98
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,014	108.97	873,285.58
FIRSTENERGY CORP	25,433	46.43	1,180,854.19
FISERV INC	27,423	116.04	3,182,164.92
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,113	301.92	1,241,796.96
FLEX LTD	24,475	11.94	292,231.50
FLIR SYSTEMS INC	6,416	53.50	343,256.00
FLOWSERVE CORP	6,218	48.15	299,396.70
FLUOR CORP	6,730	17.46	117,505.80
FMC CORP	6,280	97.45	611,986.00
FORD MOTOR CO	187,147	8.90	1,665,608.30
FORTINET INC	6,923	105.07	727,399.61
FORTIVE CORP	14,300	71.10	1,016,730.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,601	62.24	410,846.24
FOX CORP - CLASS A	16,563	36.26	600,574.38
FOX CORP- CLASS B	8,728	35.43	309,233.04
FRANKLIN RESOURCES INC	14,165	27.73	392,795.45
FREEPORT-MCMORAN INC	68,791	11.28	775,962.48
GAP INC	10,692	16.78	179,411.76
GARMIN LTD	6,325	96.92	613,019.00
GARTNER INC	4,322	160.25	692,600.50
GENERAL DYNAMICS CORP	11,685	184.95	2,161,140.75
GENERAL ELECTRIC CO	415,747	11.50	4,781,090.50
GENERAL MILLS INC	28,572	52.91	1,511,744.52
GENERAL MOTORS CO	60,857	36.38	2,213,977.66
GENUINE PARTS CO	6,958	104.57	727,598.06
GILEAD SCIENCES INC	60,538	65.00	3,934,970.00
GLOBAL PAYMENTS INC	13,998	181.72	2,543,716.56
GLOBE LIFE INC	4,853	99.39	482,339.67
GODADDY INC - CLASS A	8,422	68.24	574,717.28
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,658	220.04	3,445,386.32
GRUBHUB INC	4,338	40.06	173,780.28
H&R BLOCK INC	9,682	24.65	238,661.30
HALLIBURTON CO	41,357	19.90	823,004.30
HANESBRANDS INC	17,285	14.97	258,756.45
HARLEY-DAVIDSON INC	7,586	36.86	279,619.96
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	17,122	62.15	1,064,132.30
HASBRO INC	5,717	95.25	544,544.25
HCA HEALTHCARE INC	13,036	138.81	1,809,527.16
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,040	39.98	321,439.20
HEICO CORP	2,065	132.28	273,158.20
HEICO CORP-CLASS A	3,620	102.12	369,674.40
HELMERICH & PAYNE	5,193	38.41	199,463.13
HENRY SCHEIN INC	7,065	69.50	491,017.50
HERSHEY CO/THE	7,091	147.56	1,046,347.96
HESS CORP	12,986	66.20	859,673.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	63,492	17.44	1,107,300.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,154	100.21	1,318,162.34
HOLLYFRONTIER CORP	7,690	52.30	402,187.00
HOLOGIC INC	12,792	47.15	603,142.80
HOME DEPOT INC	52,390	225.86	11,832,805.40

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	34,653	180.12	6,241,698.36	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	56,300	5.43	305,709.00	
HORMEL FOODS CORP	14,003	42.74	598,488.22	
HP INC	71,589	20.11	1,439,654.79	
HUMANA INC	6,425	336.13	2,159,635.25	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,914	14.79	738,228.06	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,962	257.31	504,842.22	
IAC/INTERACTIVECORP	3,741	226.68	848,009.88	
IDEX CORP	3,591	162.56	583,752.96	
IDEX LABORATORIES INC	4,096	264.60	1,083,801.60	
IHS MARKIT LTD	18,197	71.88	1,308,000.36	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	15,510	174.46	2,705,874.60	
ILLUMINA INC	6,992	311.01	2,174,581.92	
INCYTE CORP	8,696	87.94	764,726.24	
INGERSOLL-RAND PLC	11,503	130.26	1,498,380.78	
INGREDION INC	3,131	83.66	261,939.46	
INTEL CORP	213,198	58.35	12,440,103.30	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	26,892	93.98	2,527,310.16	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	42,239	134.52	5,681,990.28	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	4,866	136.88	666,058.08	
INTERNATIONAL PAPER CO	17,939	45.97	824,655.83	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,849	22.41	422,406.09	
INTUIT INC	12,317	272.26	3,353,426.42	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,484	577.80	3,168,655.20	
INVESCO LTD	18,860	17.52	330,427.20	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,377	58.09	370,439.93	
IPG PHOTONICS CORP	1,754	137.55	241,262.70	
IQVIA HOLDINGS INC	8,016	142.86	1,145,165.76	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,655	151.11	552,307.05	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,475	94.51	611,952.25	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,700	56.02	599,414.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	10,700	32.27	345,289.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,683	138.90	372,668.70	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,366	116.14	507,067.24	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	11,639	20.37	237,086.43	
JM SMUCKER CO	5,423	104.15	564,805.45	
JOHNSON & JOHNSON	126,451	134.82	17,048,123.82	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	37,981	42.91	1,629,764.71	
JONES LANG LASALLE INC	2,428	163.45	396,856.60	
JPMORGAN CHASE & CO	154,443	130.58	20,167,166.94	
JUNIPER NETWORKS INC	16,264	26.12	424,815.68	

KANSAS CITY SOUTHERN	5,022	154.16	774,191.52
KELLOGG CO	12,216	65.32	797,949.12
KEYCORP	47,912	19.11	915,598.32
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,969	108.13	969,817.97
KIMBERLY-CLARK CORP	16,429	132.94	2,184,071.26
KINDER MORGAN INC	97,555	20.01	1,952,075.55
KKR & CO INC -A	23,350	29.13	680,185.50
KLA CORPORATION	7,695	175.99	1,354,243.05
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,621	36.91	244,381.11
KOHL'S CORP	7,764	47.02	365,063.28
KRAFT HEINZ CO/THE	32,090	31.30	1,004,417.00
KROGER CO	38,328	26.87	1,029,873.36
L BRANDS INC	11,163	17.18	191,780.34
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,554	203.15	2,144,045.10
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	4,691	171.24	803,286.84
LAM RESEARCH CORP	7,115	276.76	1,969,147.40
LAMB WESTON HOLDING INC	6,992	83.75	585,580.00
LAS VEGAS SANDS CORP	16,481	61.91	1,020,338.71
LEAR CORP	2,802	120.90	338,761.80
LEGGETT & PLATT INC	6,312	52.71	332,705.52
LEIDOS HOLDINGS INC	6,584	91.71	603,818.64
LENNAR CORP-CL A	13,622	59.64	812,416.08
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,682	254.17	427,513.94
LIBERTY BROADBAND-C	5,219	118.63	619,129.97
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,411	22.82	191,939.02
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	24,262	21.82	529,396.84
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	3,083	47.20	145,517.60
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	9,152	47.09	430,967.68
LIBERTY MEDIA GROUP-C	9,866	44.92	443,180.72
LINCOLN NATIONAL CORP	9,323	57.84	539,242.32
LINDE PLC	25,888	207.43	5,369,947.84
LIVE NATION INC	7,181	68.22	489,887.82
LKQ CORP	14,786	35.21	520,615.06
LOCKHEED MARTIN CORP	12,140	390.81	4,744,433.40
LOEWS CORP	12,987	50.18	651,687.66
LOWE'S COS INC	37,862	113.40	4,293,550.80
LULULEMON ATHLETICA INC	5,269	216.88	1,142,740.72
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,717	93.06	1,183,444.02
M&T BANK CORP	6,178	162.88	1,006,272.64
MACY'S INC	14,656	15.04	220,426.24
MANPOWER GROUP	2,757	93.32	257,283.24
MARATHON OIL CORP	38,577	11.46	442,092.42
MARATHON PETROLEUM CORP	31,576	61.85	1,952,975.60
MARKEL CORP	659	1,122.59	739,786.81
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,798	400.17	719,505.66

MARRIOTT INTERNATIONAL INC	13,487	135.47	1,827,083.89	
MARSH & MCLENNAN COS INC	24,352	107.18	2,610,047.36	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,981	261.66	780,008.46	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	29,995	26.36	790,668.20	
MASCO CORP	13,947	45.61	636,122.67	
MASTERCARD INC-CLASS A	43,275	285.31	12,346,790.25	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,968	56.00	726,208.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,851	165.96	971,031.96	
MCDONALD'S CORP	36,397	193.44	7,040,635.68	
MCKESSON CORP	9,056	150.25	1,360,664.00	
MEDTRONIC PLC	63,884	111.07	7,095,595.88	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	10,012	21.89	219,162.68	
MERCADOLIBRE INC	2,118	536.33	1,135,946.94	
MERCK & CO INC	122,658	84.65	10,382,999.70	
METLIFE INC	38,264	49.15	1,880,675.60	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,176	732.96	861,960.96	
MGM MIRAGE	24,213	31.81	770,215.53	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,383	92.64	1,054,521.12	
MICRON TECHNOLOGY INC	52,634	46.58	2,451,691.72	
MICROSOFT CORP	346,714	150.39	52,142,318.46	
MIDDLEBY CORP	2,659	114.51	304,482.09	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,921	138.73	405,230.33	
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,007	52.41	472,056.87	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	68,513	52.71	3,611,320.23	
MONGODB INC	2,011	140.99	283,530.89	
MONSTER BEVERAGE CORP	19,354	58.56	1,133,370.24	
MOODY'S CORP	8,134	223.87	1,820,958.58	
MORGAN STANLEY	59,882	49.33	2,953,979.06	
MOSAIC CO/THE	17,407	18.81	327,425.67	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,874	166.00	1,307,084.00	
MSCI INC	4,033	257.50	1,038,497.50	
MYLAN NV	24,440	17.27	422,078.80	
NASDAQ INC	5,531	105.07	581,142.17	
NATIONAL-OILWELL INC	18,326	21.11	386,861.86	
NEKTAR THERAPEUTICS	8,386	18.31	153,547.66	
NETAPP INC	11,748	62.90	738,949.20	
NETFLIX INC	20,836	302.60	6,304,973.60	
NEWELL BRANDS INC	19,268	19.56	376,882.08	
NEWMONT GOLDCORP CORP	38,933	38.35	1,493,080.55	
NEWS CORP - CLASS A	18,483	12.88	238,061.04	
NEXTERA ENERGY INC	22,819	232.66	5,309,068.54	
NIELSEN HOLDINGS PLC	17,174	20.33	349,147.42	
NIKE INC	59,804	93.61	5,598,252.44	
NISOURCE INC	17,886	26.04	465,751.44	
NOBLE ENERGY INC	22,799	19.49	444,352.51	
NORDSTROM INC	5,167	35.50	183,428.50	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,874	192.60	2,479,532.40	

NORTHERN TRUST CORP	9,819	107.06	1,051,222.14
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,694	353.54	2,720,136.76
NORTONLIFELOCK INC	29,425	24.70	726,797.50
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,167	53.66	545,561.22
NRG ENERGY INC	12,661	39.39	498,716.79
NUCOR CORP	14,384	54.80	788,243.20
NVIDIA CORP	27,547	207.99	5,729,500.53
NVR INC	163	3,657.30	596,139.90
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,602	114.01	1,550,764.02
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,732	444.57	1,659,135.24
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,632	38.14	1,625,984.48
OGE ENERGY CORP	9,457	42.74	404,192.18
OKTA INC	4,969	126.08	626,491.52
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,214	193.99	623,483.86
OMNICOM GROUP	10,670	78.67	839,408.90
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	19,606	21.12	414,078.72
ONEOK INC	19,729	69.76	1,376,295.04
ORACLE CORP	113,941	56.27	6,411,460.07
OWENS CORNING	5,159	66.47	342,918.73
PACCAR INC	16,503	79.43	1,310,833.29
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,469	113.68	508,035.92
PALO ALTO NETWORKS INC	4,595	248.18	1,140,387.10
PARKER HANNIFIN CORP	6,076	196.25	1,192,415.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	13,372	15.03	200,981.16
PAYCHEX INC	15,401	85.79	1,321,251.79
PAYCOM SOFTWARE INC	2,383	239.49	570,704.67
PAYPAL HOLDINGS INC	53,175	104.95	5,580,716.25
PENTAIR PLC	7,674	43.30	332,284.20
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	18,715	16.36	306,177.40
PEPSICO INC	66,766	134.57	8,984,700.62
PERKINELMER INC	5,247	91.18	478,421.46
PERRIGO CO PLC	6,159	48.72	300,066.48
PFIZER INC	264,437	37.66	9,958,697.42
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	74,103	83.46	6,184,636.38
PHILLIPS 66	21,585	117.42	2,534,510.70
PINNACLE WEST CAPITAL	5,306	86.75	460,295.50
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,004	129.62	1,037,478.48
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,616	17.12	130,385.92
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,500	151.72	3,261,980.00
POLARIS INC	2,770	101.60	281,432.00
PPG INDUSTRIES INC	11,244	128.79	1,448,114.76
PPL CORPORATION	34,374	33.57	1,153,935.18
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,207	54.79	723,611.53
PROCTER & GAMBLE CO	119,518	121.42	14,511,875.56
PROGRESSIVE CORP	27,769	71.56	1,987,149.64

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,203	93.46	1,794,712.38
PTC INC	5,202	73.50	382,347.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,055	60.50	1,455,327.50
PULTE GROUP INC	12,594	39.38	495,951.72
PVH CORP	3,500	98.20	343,700.00
QORVO INC	5,694	102.84	585,570.96
QUALCOMM INC	57,939	87.96	5,096,314.44
QUEST DIAGNOSTICS	6,397	104.48	668,358.56
QURATE RETAIL INC	18,986	9.88	187,581.68
RALPH LAUREN CORP	2,473	110.47	273,192.31
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,949	89.25	530,948.25
RAYTHEON CO	13,322	218.09	2,905,394.98
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,835	344.46	1,321,004.10
REGIONS FINANCIAL CORP	47,866	16.52	790,746.32
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,942	163.90	482,193.80
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,125	186.80	396,950.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,827	87.59	948,336.93
RESMED INC	6,848	149.39	1,023,022.72
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	5,469	58.83	321,741.27
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,616	196.67	1,104,498.72
ROKU INC	3,914	153.91	602,403.74
ROLLINS INC	6,948	36.62	254,435.76
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,949	349.96	1,731,952.04
ROSS STORES INC	17,458	112.42	1,962,628.36
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,441	118.86	1,003,297.26
S&P GLOBAL INC	11,731	267.87	3,142,382.97
SABRE CORP	13,197	22.48	296,668.56
SALESFORCE.COM INC	39,600	163.96	6,492,816.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,550	98.04	348,042.00
SCHLUMBERGER LTD	65,913	34.31	2,261,475.03
SEAGATE TECHNOLOGY	11,867	59.65	707,866.55
SEALED AIR CORP	7,459	38.10	284,187.90
SEATTLE GENETICS INC	5,387	117.88	635,019.56
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,921	62.99	372,963.79
SEMPRA ENERGY	13,086	147.21	1,926,390.06
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,657	52.34	400,767.38
SERVICENOW INC	8,811	277.74	2,447,167.14
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,966	584.20	2,316,937.20
SIGNATURE BANK	2,626	125.43	329,379.18
SIRIUS XM HOLDINGS INC	78,375	6.97	546,273.75
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,209	96.61	793,071.49
SMITH (A.O.) CORP	6,632	48.27	320,126.64
SNAP INC - A	33,102	15.16	501,826.32
SNAP-ON INC	2,611	161.41	421,441.51
SOUTHERN CO	49,714	62.21	3,092,707.94
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,397	57.55	368,147.35

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	4,895	90.70	443,976.50	
SPLUNK INC	7,162	124.66	892,814.92	
SPRINT CORP	40,076	5.74	230,036.24	
SQUARE INC - A	16,030	66.37	1,063,911.10	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,916	59.61	650,702.76	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,193	156.43	1,125,200.99	
STARBUCKS CORP	57,713	83.66	4,828,269.58	
STATE STREET CORP	17,663	73.39	1,296,287.57	
STEEL DYNAMICS INC	10,504	31.46	330,455.84	
STERIS PLC	4,035	151.89	612,876.15	
STRYKER CORP	16,028	207.12	3,319,719.36	
SUNTRUST BANKS INC	21,118	70.69	1,492,831.42	
SVB FINANCIAL GROUP	2,447	229.50	561,586.50	
SYNCHRONY FINANCIAL	29,546	36.92	1,090,838.32	
SYNOPSIS INC	7,093	141.75	1,005,432.75	
SYSCO CORP	23,278	80.29	1,868,990.62	
T ROWE PRICE GROUP INC	11,079	121.97	1,351,305.63	
T-MOBILE US INC	16,426	77.16	1,267,430.16	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,375	123.65	664,618.75	
TAPESTRY INC	13,841	26.95	373,014.95	
TARGA RESOURCES CORP	11,425	37.11	423,981.75	
TARGET CORP	24,416	110.85	2,706,513.60	
TE CONNECTIVITY LTD	15,992	92.60	1,480,859.20	
TECHNIPFMC PLC	20,424	19.28	393,774.72	
TELEFLEX INC	2,206	353.83	780,548.98	
TESLA, INC.	6,253	359.52	2,248,078.56	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	52,065	10.29	535,748.85	
TEXAS INSTRUMENTS INC	44,676	117.84	5,264,619.84	
TEXTRON INC	10,926	46.62	509,370.12	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,043	306.42	5,835,156.06	
TIFFANY & CO	5,159	123.50	637,136.50	
TJX COS INC	57,663	60.64	3,496,684.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,723	96.54	552,498.42	
TRANSDIGM GROUP INC	2,287	568.16	1,299,381.92	
TRANSUNION	8,964	85.88	769,828.32	
TRAVELERS COS INC/THE	12,443	135.46	1,685,528.78	
TRIMBLE INC	11,911	39.37	468,936.07	
TRIPADVISOR INC	5,053	28.38	143,404.14	
TWILIO INC - A	5,319	103.00	547,857.00	
TWITTER INC	34,787	29.44	1,024,129.28	
TYSON FOODS INC-CL A	14,035	90.54	1,270,728.90	
UBER TECHNOLOGIES INC	9,256	27.05	250,374.80	
UGI CORP	9,997	43.72	437,068.84	
ULTA BEAUTY INC	2,642	239.60	633,023.20	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,920	17.33	154,583.60	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	9,360	15.61	146,109.60	
UNION PACIFIC CORP	33,922	177.17	6,009,960.74	
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	3,095	93.29	288,732.55	
UNITED PARCEL SERVICE INC	33,350	120.54	4,020,009.00	

UNITED RENTALS INC	3,711	152.27	565,073.97	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	39,018	148.37	5,789,100.66	
UNITEDHEALTH GROUP INC	45,250	274.23	12,408,907.50	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3,927	141.79	556,809.33	
UNUM GROUP	9,662	29.27	282,806.74	
US BANCORP	71,966	59.42	4,276,219.72	
VAIL RESORTS INC	1,919	240.47	461,461.93	
VALERO ENERGY CORP	19,854	97.62	1,938,147.48	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,297	128.48	552,078.56	
VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	6,084	152.24	926,228.16	
VERISIGN INC	5,097	193.46	986,065.62	
VERISK ANALYTICS INC	7,419	143.98	1,068,187.62	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	197,326	59.50	11,740,897.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,197	215.00	2,622,355.00	
VF CORP	16,072	86.33	1,387,495.76	
VIACOM INC-CLASS B	17,049	23.55	401,503.95	
VISA INC-CLASS A SHARES	82,797	182.77	15,132,807.69	
VISTRA ENERGY CORP	17,262	26.44	456,407.28	
VMWARE INC-CLASS A	3,940	172.82	680,910.80	
VOYA FINANCIAL INC	6,730	57.75	388,657.50	
VULCAN MATERIALS CO	6,297	141.15	888,821.55	
WABCO HOLDINGS INC	2,448	134.58	329,451.84	
WABTEC CORP	8,692	79.17	688,145.64	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,904	61.45	2,267,750.80	
WALMART INC	68,267	119.89	8,184,530.63	
WALT DISNEY CO	85,747	148.38	12,723,139.86	
WASTE CONNECTIONS INC	12,681	90.18	1,143,572.58	
WASTE MANAGEMENT INC	20,302	112.53	2,284,584.06	
WATERS CORP	3,288	219.72	722,439.36	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,913	83.90	244,400.70	
WEC ENERGY GROUP INC	15,118	88.13	1,332,349.34	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,396	318.22	762,455.12	
WELLS FARGO & CO	203,335	54.03	10,986,190.05	
WESTERN DIGITAL CORP	13,983	47.52	664,472.16	
WESTERN UNION CO	20,758	27.35	567,731.30	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,822	69.65	126,902.30	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	12,212	39.94	487,747.28	
WEYERHAEUSER CO	35,512	29.72	1,055,416.64	
WHIRLPOOL CORP	3,012	140.98	424,631.76	
WILLIAMS COS INC	58,225	22.14	1,289,101.50	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,159	190.20	1,171,441.80	
WIX.COM LTD	2,280	127.06	289,696.80	
WORKDAY INC-CLASS A	7,732	166.89	1,290,393.48	
WR BERKLEY CORP	7,010	69.55	487,545.50	
WW GRAINGER INC	2,241	315.90	707,931.90	
WYNN RESORTS LTD	4,596	120.25	552,669.00	
XCEL ENERGY INC	24,515	61.32	1,503,259.80	
XEROX HOLDINGS CORP	9,572	38.69	370,340.68	

	XILINX INC	12,106	92.80	1,123,436.80	
	XPO LOGISTICS INC	4,517	83.52	377,259.84	
	XYLEM INC	8,507	78.00	663,546.00	
	YUM! BRANDS INC	14,591	98.08	1,431,085.28	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,482	34.34	394,291.88	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,570	235.91	606,288.70	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	6,063	37.79	229,120.77	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,771	144.54	1,412,300.34	
	ZIONS BANCORP, N.A.	8,532	49.30	420,627.60	
	ZOETIS INC	22,827	120.33	2,746,772.91	
アメリカ・ドル	小計	14,399,603		1,265,667,064.62 (137,464,099,888)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	45,895	10.55	484,192.25	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,119	20.64	188,216.16	
	ANGLO AMERICAN PLC	49,597	20.45	1,014,506.63	
	ANTOFAGASTA PLC	18,091	8.95	162,059.17	
	ASHTREAD GROUP PLC	22,167	23.50	520,924.50	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,831	24.36	410,003.16	
	ASTRAZENECA PLC	62,539	73.12	4,572,851.68	
	AUTO TRADER GROUP PLC- WI	44,242	5.36	237,225.60	
	AVIVA PLC	185,517	4.18	776,017.61	
	BAE SYSTEMS PLC	152,693	5.78	883,481.69	
	BARCLAYS PLC	819,774	1.70	1,396,894.89	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	48,614	6.52	317,060.50	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	5,816	45.29	263,406.64	
	BHP GROUP PLC	100,276	17.04	1,708,903.59	
	BP PLC	969,932	5.01	4,868,088.70	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	109,281	28.89	3,157,674.49	
	BT GROUP PLC	405,822	1.90	771,467.62	
	BUNZL PLC	16,122	20.55	331,307.10	
	BURBERRY GROUP PLC	19,508	20.78	405,376.24	
	CARNIVAL PLC	7,676	32.20	247,167.20	
	CENTRICA PLC	277,272	0.73	203,794.92	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	9,439	24.28	229,178.92	
	COMPASS GROUP PLC	75,601	20.25	1,530,920.25	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,099	48.00	292,752.00	
	DCC PLC	4,651	66.56	309,570.56	
	DIAGEO PLC	113,201	31.18	3,530,173.18	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	64,888	2.76	179,155.76	
	EASYJET PLC	7,720	13.44	103,795.40	
	EVRAZ PLC	24,688	3.60	89,000.24	
	EXPERIAN PLC	43,317	24.80	1,074,261.60	
	FERGUSON PLC	11,016	67.40	742,478.40	
	FRESNILLO PLC	10,605	6.27	66,493.35	
	G4S PLC	74,808	2.08	155,600.64	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	237,936	17.16	4,083,933.50	
	GLENCORE PLC	522,177	2.40	1,257,924.39	

GVC HOLDINGS PLC	27,702	8.57	237,516.94
HALMA PLC	18,040	20.59	371,443.60
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,448	18.17	244,417.40
HSBC HOLDINGS PLC	965,394	5.80	5,606,042.95
IMPERIAL BRANDS PLC	45,665	17.75	810,553.75
INFORMA PLC	60,485	7.87	476,016.95
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,235	48.07	395,856.45
INTERTEK GROUP PLC	7,698	55.02	423,543.96
INVESTEC PLC	32,163	4.36	140,455.82
ITV PLC	175,274	1.36	239,249.01
JOHNSON MATTHEY PLC	9,086	32.00	290,752.00
KINGFISHER PLC	98,716	2.08	206,119.00
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	283,967	2.79	792,835.86
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,382,885	0.59	2,009,433.69
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	15,050	68.96	1,037,848.00
M&G PLC	121,373	2.33	283,284.58
MARKS & SPENCER GROUP PLC	92,324	1.86	171,722.64
MEGGITT PLC	36,881	6.37	235,227.01
MELROSE INDUSTRIES PLC	233,258	2.24	522,497.92
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	16,411	10.41	170,936.97
MONDI PLC/WI	22,799	16.70	380,743.30
MORRISON WM SUPERMARKETS	112,308	2.00	224,616.00
NATIONAL GRID PLC	162,621	8.98	1,461,637.54
NEXT PLC	6,440	66.40	427,616.00
NMC HEALTH PLC	4,494	25.94	116,574.36
OCADO GROUP PLC	21,733	11.66	253,515.44
PEARSON PLC	37,236	6.67	248,438.59
PERSIMMON PLC	15,115	24.74	373,945.10
PRUDENTIAL PLC	121,373	13.18	1,600,303.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,754	59.23	1,999,249.42
RELX PLC	93,125	18.72	1,743,300.00
RENTOKIL INITIAL PLC	88,965	4.45	396,161.14
RIO TINTO PLC	53,903	42.14	2,271,741.93
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	82,139	7.29	598,957.58
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	3,778,394	0.00	3,778.39
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	229,590	2.22	511,296.93
ROYAL DUTCH SHELL PLC- A SHS	206,881	22.86	4,729,299.66
ROYAL DUTCH SHELL PLC- B SHS	178,776	22.67	4,053,745.80
RSA INSURANCE GROUP PLC	48,969	5.41	265,020.22
SAGE GROUP PLC	51,729	7.42	383,829.18
SAINSBURY (J) PLC	83,476	2.12	177,219.54
SCHRODERS PLC	5,855	32.52	190,404.60
SEVERN TRENT PLC	11,387	23.52	267,822.24
SMITH & NEPHEW PLC	41,754	16.63	694,369.02

	SMITHS GROUP PLC	18,803	16.58	311,847.75	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,520	85.50	300,960.00	
	SSE PLC	49,492	13.16	651,314.72	
	ST JAMES'S PLACE PLC	25,780	10.61	273,654.70	
	STANDARD CHARTERED PLC	133,111	6.96	927,251.22	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	115,753	3.14	364,158.93	
	TAYLOR WIMPEY PLC	156,403	1.73	271,984.81	
	TESCO PLC	466,301	2.35	1,096,273.65	
	TUI AG-DI	21,081	10.62	223,985.62	
	UNILEVER PLC	52,915	45.57	2,411,601.12	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,622	8.77	286,160.18	
	VODAFONE GROUP PLC	1,278,533	1.53	1,958,712.55	
	WEIR GROUP PLC/THE	12,280	14.13	173,516.40	
	WHITBREAD PLC	6,272	44.37	278,288.64	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,636	3.51	114,650.26	
	WPP PLC	60,549	9.78	592,411.41	
イギリス・ポンド 小計		18,195,852		84,841,969.97 (11,905,873,646)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	2,075	262.20	544,065.00	
	BANK HAPOLIM BM	54,254	28.45	1,543,526.30	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	71,443	25.03	1,788,218.29	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,171	553.00	647,563.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	33,763	15.56	525,352.28	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	55,585	15.47	859,899.95	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,883	88.66	610,246.78	
	NICE LTD	2,983	514.80	1,535,648.40	
イスラエル・シュケル 小計		228,157		8,054,520.00 (252,509,202)	
オーストラリ ア・ドル	AGL ENERGY LTD	33,290	20.25	674,122.50	
	ALUMINA LTD	128,180	2.47	316,604.60	
	AMP LTD	171,997	2.02	347,433.94	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	28,271	31.80	899,017.80	
	ASX LTD	10,378	81.14	842,070.92	
	AURIZON HOLDINGS LTD	110,331	5.78	637,713.18	
	AUSNET SERVICES	129,110	1.76	227,879.15	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	137,395	25.42	3,492,580.90	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,038	8.63	207,447.94	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	27,598	10.72	295,850.56	
	BHP GROUP LIMITED	142,426	37.47	5,336,702.22	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,916	14.08	364,897.28	
	BORAL LTD	61,275	5.03	308,213.25	
	BRAMBLES LTD	79,828	12.43	992,262.04	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,385	28.32	379,063.20	
	CHALLENGER LTD	28,183	8.34	235,046.22	
	CIMIC GROUP LIMITED	5,386	33.31	179,407.66	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	28,284	11.48	324,700.32	
	COCHLEAR LTD	2,874	227.39	653,518.86	
	COLES GROUP LTD	55,663	15.72	875,022.36	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	85,467	80.67	6,894,622.89	
	COMPUTERSHARE LIMITED	25,924	16.81	435,782.44	
	CROWN RESORTS LTD	21,437	12.81	274,607.97	
	CSL LIMITED	21,795	274.27	5,977,714.65	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,942	42.74	125,741.08	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	68,671	9.29	637,953.59	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	29,975	4.32	129,492.00	
	INCITEC PIVOT LTD	87,516	3.33	291,428.28	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	115,374	7.88	909,147.12	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	22,215	28.51	633,349.65	
	MACQUARIE GROUP LTD	15,991	137.81	2,203,719.71	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,201	51.72	320,715.72	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	139,518	3.20	446,457.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	137,458	27.26	3,747,105.08	
	NEWCREST MINING LIMITED	37,591	31.30	1,176,598.30	
	OIL SEARCH LTD	71,365	7.36	525,246.40	
	ORICA LTD	20,148	23.80	479,522.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	86,918	8.29	720,550.22	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	65,998	12.71	838,834.58	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	7,452	73.64	548,765.28	
	REA GROUP LTD	2,751	104.36	287,094.36	
	RIO TINTO LTD	18,148	95.20	1,727,689.60	
	SANTOS LTD	88,259	8.14	718,428.26	
	SEEK LTD	17,547	23.17	406,563.99	
	SONIC HEALTHCARE LTD	23,764	29.74	706,741.36	
	SOUTH32 LTD	245,343	2.69	659,972.67	
	SUNCORP GROUP LTD	64,739	13.35	864,265.65	
	TABCORP HOLDINGS LTD	106,684	4.87	519,551.08	
	TELSTRA CORP LTD	211,523	3.60	761,482.80	
	TPG TELECOM LTD	21,256	6.61	140,502.16	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	35,202	18.64	656,165.28	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,109	21.69	154,194.21	
	WESFARMERS LIMITED	55,889	42.58	2,379,753.62	
	WESTPAC BANKING CORP	167,157	26.55	4,438,018.35	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,511	34.43	1,601,373.73	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	61,797	39.37	2,432,947.89	
	WORLEY LIMITED	17,253	13.84	238,781.52	
	オーストラリア・ドル 小計	3,504,696		63,600,436.39 (4,715,336,354)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,225	79.83	896,091.75	
	AIR CANADA	6,328	49.88	315,640.64	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	41,647	42.06	1,751,672.82	
	ALTAGAS LTD	13,407	19.96	267,603.72	
	ATCO LTD -CL 'I'	3,750	49.71	186,412.50	
	AURORA CANNABIS INC	34,070	3.11	105,957.70	

BANK OF MONTREAL	30,426	101.35	3,083,675.10
BANK OF NOVA SCOTIA	58,204	76.50	4,452,606.00
BARRICK GOLD CORP	83,468	22.64	1,889,715.52
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	15,068	37.43	563,995.24
BCE INC	7,995	64.21	513,358.95
BLACKBERRY LTD	24,632	7.09	174,640.88
BOMBARDIER INC	102,747	2.07	212,686.29
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	40,547	75.95	3,079,544.65
CAE INC	12,870	35.20	453,024.00
CAMECO CORP	18,923	12.50	236,537.50
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	21,173	115.17	2,438,494.41
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	34,799	122.65	4,268,097.35
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	56,932	37.03	2,108,191.96
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,832	315.96	2,158,638.72
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,771	156.43	433,467.53
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,504	39.54	257,168.16
CANOPY GROWTH CORP	9,941	20.31	201,901.71
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,195	56.92	409,539.40
CENOVUS ENERGY INC	49,677	11.81	586,685.37
CGI INC	11,590	109.46	1,268,641.40
CI FINANCIAL CORP	10,844	21.00	227,724.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	959	1,362.95	1,307,069.05
CRONOS GROUP INC	8,806	8.89	78,285.34
DOLLARAMA INC	14,300	47.21	675,103.00
EMERA INC	11,746	54.59	641,214.14
EMPIRE CO LTD 'A'	8,315	34.18	284,206.70
ENBRIDGE INC	96,634	49.94	4,825,901.96
ENCANA CORP	66,240	5.26	348,422.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,318	599.58	790,246.44
FIRST CAPITAL REALTY INC	9,094	21.65	196,885.10
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,521	12.02	390,902.42
FORTIS INC	20,981	53.44	1,121,224.64
FRANCO-NEVADA CORP	8,888	130.92	1,163,616.96
GEORGE WESTON LTD	3,719	105.08	390,792.52
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,898	35.83	354,645.34
GREAT-WEST LIFECO INC	13,453	33.10	445,294.30
HUSKY ENERGY INC	16,482	9.60	158,227.20
HYDRO ONE LTD	16,138	24.86	401,190.68
IA FINANCIAL CORP INC	5,082	67.48	342,933.36
IGM FINANCIAL INC	4,244	38.57	163,691.08
IMPERIAL OIL LTD	12,730	33.02	420,344.60
INTACT FINANCIAL CORP	6,689	134.90	902,346.10
INTER PIPELINE LTD	19,753	22.23	439,109.19
KEYERA CORP	10,279	33.86	348,046.94
KINROSS GOLD CORP	59,649	5.68	338,806.32
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,482	64.63	612,821.66

LOBLAW COS LTD	8,814	70.26	619,271.64	
LUNDIN MINING CORP	31,053	7.40	229,792.20	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,611	73.70	1,076,830.70	
MANULIFE FINANCIAL CORP	93,473	26.08	2,437,775.84	
METHANEX CORP	3,104	50.22	155,882.88	
METRO INC	12,192	55.24	673,486.08	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,284	69.86	1,137,600.24	
NUTRIEN LTD	27,901	63.24	1,764,459.24	
ONEX CORPORATION	4,113	81.28	334,304.64	
OPEN TEXT CORP	12,929	57.77	746,908.33	
PEMBINA PIPELINE CORP	24,551	48.07	1,180,166.57	
POWER CORP OF CANADA	14,648	32.34	473,716.32	
POWER FINANCIAL CORP	12,916	32.92	425,194.72	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	10,133	13.56	137,403.48	
QUEBECOR INC -CL B	9,281	33.47	310,635.07	
RESTAURANT BRANDS INTERN	11,591	87.31	1,012,010.21	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	17,640	63.47	1,119,610.80	
ROYAL BANK OF CANADA	68,368	108.86	7,442,540.48	
SAPUTO INC	11,197	40.14	449,447.58	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,198	27.50	637,945.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,738	419.65	1,988,301.70	
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,609	25.04	215,569.36	
STARS GROUP INC/THE	10,983	30.33	333,114.39	
SUN LIFE FINANCIAL INC	28,194	61.19	1,725,190.86	
SUNCOR ENERGY INC	74,603	41.73	3,113,183.19	
TC ENERGY CORP	44,412	67.98	3,019,127.76	
TECK RESOURCES LTD-CL B	23,508	21.40	503,071.20	
THOMSON REUTERS CORP	9,696	94.92	920,344.32	
TORONTO-DOMINION BANK	87,104	76.98	6,705,265.92	
TOURMALINE OIL CORP	12,271	12.55	154,001.05	
VERMILION ENERGY INC	7,389	19.05	140,760.45	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,524	60.27	152,121.48	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	21,233	36.90	783,497.70	
WSP GLOBAL INC	5,005	86.08	430,830.40	
カナダ・ドル 小計	1,959,231		92,232,402.51 (7,546,455,173)	
シンガポール・ドル				
CAPITALAND LTD	121,800	3.68	448,224.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,600	10.85	223,510.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	107,600	2.36	253,936.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	85,300	26.44	2,255,332.00	
GENTING SINGAPORE LTD	281,200	0.94	265,734.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	309,000	0.24	74,160.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	31.74	149,178.00	
KEPPEL CORP LTD	69,200	6.85	474,020.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	151,400	11.12	1,683,568.00	
SATS LTD	36,000	5.05	181,800.00	

	SEBMCORP INDUSTRIES LTD	47,600	2.26	107,576.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,500	9.15	242,475.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	38,400	8.86	340,224.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	79,900	2.22	177,378.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	77,000	4.18	321,860.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	395,300	3.19	1,261,007.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,800	26.67	1,594,866.00	
	UOL Group Limited	20,900	7.99	166,991.00	
	VENTURE CORP LTD	13,100	15.88	208,028.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,700	4.14	383,778.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	113,200	1.06	119,992.00	
	シンガポール・ドル 小計	2,151,200		10,933,637.00 (872,504,233)	
スイス・フラン	ABB LTD	87,871	21.71	1,907,679.41	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,424	61.32	455,239.68	
	ALCON INC	19,737	58.33	1,151,259.21	
	BALOISE HOLDING AG	2,328	176.30	410,426.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	104	1,974.00	205,296.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	51	7,385.00	376,635.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	82,800.00	414,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	24,834	75.08	1,864,536.72	
	CLARIANT AG	9,508	20.68	196,625.44	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	121,590	12.95	1,575,198.45	
	DUFREY AG-REG	2,063	96.64	199,368.32	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	386	617.00	238,162.00	
	GEBERIT AG-REG	1,763	524.20	924,164.60	
	GIVAUDAN-REG	442	2,900.00	1,281,800.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,633	46.46	494,009.18	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,707	162.50	439,887.50	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	23,079	51.60	1,190,876.40	
	LONZA GROUP AG	3,547	332.50	1,179,377.50	
	NESTLE SA	145,900	104.08	15,185,272.00	
	NOVARTIS AG	102,346	89.21	9,130,286.66	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,825	79.85	145,726.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	886	813.20	720,495.20	
	ROCHE HOLDING AG	33,456	301.90	10,100,366.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,038	235.40	244,345.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,863	244.60	455,689.80	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	252	2,566.00	646,632.00	
	SIKA AG-BEARER	6,089	172.00	1,047,308.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,649	217.10	575,097.90	
	STRAUMANN HOLDING AG	487	911.40	443,851.80	
	SWATCH GROUP AG	1,324	276.20	365,688.80	

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,634	496.60	811,444.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,745	106.30	398,093.50	
	SWISS RE AG	14,611	106.60	1,557,532.60	
	SWISSCOM AG	1,283	514.40	659,975.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,098	145.25	449,984.50	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,957	52.80	156,129.60	
	UBS GROUP AG	184,022	11.99	2,207,343.89	
	VIFOR PHARMA AG	2,165	161.40	349,431.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,229	391.90	2,833,045.10	
スイス・フラン	小計	836,931		62,988,281.61 (6,904,145,547)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	15,041	231.50	3,481,991.50	
	ASSA ABLOY AB	47,919	229.00	10,973,451.00	
	ATLAS COPCO AB	18,490	315.20	5,828,048.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	31,934	360.20	11,502,626.80	
	BOLIDEN AB	12,700	261.75	3,324,225.00	
	ELECTROLUX AB	10,842	244.80	2,654,121.60	
	EPIROC AB-A	31,760	110.50	3,509,480.00	
	EPIROC AB-B	18,508	107.10	1,982,206.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,175	305.00	8,898,375.00	
	HENNES & MAURITZ AB	38,353	183.28	7,029,337.84	
	HEXAGON AB-B SHS	12,417	525.00	6,518,925.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	20,192	76.12	1,537,015.04	
	ICA GRUPPEN AB	4,534	415.00	1,881,610.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,783	227.00	1,766,741.00	
	INVESTOR AB	21,755	504.60	10,977,573.00	
	KINNEVIK AB - B	11,741	219.00	2,571,279.00	
	KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE	11,741	56.00	657,496.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,598	385.40	1,386,669.20	
	LUNDIN PETROLEUM AB	9,073	297.80	2,701,939.40	
	NORDEA BANK ABP	155,496	70.22	10,918,929.12	
	SANDVIK AB	53,540	174.50	9,342,730.00	
	SECURITAS AB	15,267	159.75	2,438,903.25	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	79,098	81.96	6,482,872.08	
	SKANSKA AB-B SHS	16,396	212.60	3,485,789.60	
	SKF AB	18,124	181.05	3,281,350.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	74,227	95.84	7,113,915.68	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,629	130.30	5,684,858.70	
	SWEDISH MATCH AB	8,120	456.90	3,710,028.00	
	TELE2 AB	25,047	140.60	3,521,608.20	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	146,959	88.06	12,941,209.54	
	TELIA CO AB	136,737	42.27	5,779,872.99	
	VOLVO AB	70,888	148.05	10,494,968.40	
スウェーデン・クローナ	小計	1,201,084		174,380,146.94 (1,963,520,454)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	300	9,606.00	2,881,800.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	204	9,015.00	1,839,060.00	
	CARLSBERG AS-B	5,094	969.00	4,936,086.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,033	512.20	2,577,902.60	

	COLOPLAST-B	5,632	806.60	4,542,771.20	
	DANSKE BANK A/S	30,867	91.12	2,812,601.04	
	DEMANT A/S	5,183	198.25	1,027,529.75	
	DSV PANALPINA A/S	10,554	734.80	7,755,079.20	
	GENMAB A/S	3,091	1,508.50	4,662,773.50	
	H LUNDBECK A/S	3,308	241.20	797,889.60	
	ISS A/S	7,540	151.50	1,142,310.00	
	NOVO-NORDISK A/S	84,152	384.50	32,356,444.00	
	NOVOZYMES A/S	10,099	312.40	3,154,927.60	
	ORSTED A/S	9,040	610.60	5,519,824.00	
	PANDORA A/S	4,763	276.50	1,316,969.50	
	TRYGVESTA AS	5,964	181.40	1,081,869.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,005	639.60	5,759,598.00	
デンマーク・クローネ 小計		199,829		84,165,435.59 (1,355,063,513)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	35,036	14.12	494,708.32	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,444	8.98	444,007.12	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	27,328	20.50	560,224.00	
	FLETCHER BUILDING LTD	41,594	5.21	216,704.74	
	MERIDIAN ENERGY LTD	63,171	4.45	281,110.95	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	19,568	14.14	276,691.52	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,162	4.45	410,120.90	
ニュージーランド・ドル 小計		328,303		2,683,567.55 (187,339,850)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	5,200	265.50	1,380,600.00	
	DNB ASA	46,291	165.60	7,665,789.60	
	EQUINOR ASA	47,533	173.85	8,263,612.05	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,898	169.60	1,678,700.80	
	MOWI ASA	21,087	223.20	4,706,618.40	
	NORSK HYDRO ASA	63,662	33.18	2,112,305.16	
	ORKLA ASA	36,801	88.00	3,238,488.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,762	248.60	1,183,833.20	
	TELENOR ASA	36,085	167.45	6,042,433.25	
YARA INTERNATIONAL ASA	8,518	341.30	2,907,193.40		
ノルウェー・クローネ 小計		279,837		39,179,573.86 (465,845,133)	
ユーロ	1 AND 1 DRILLISCH AG	2,644	25.18	66,575.92	
	ABN AMRO BANK NV	20,328	16.20	329,415.24	
	ACCOR	8,775	39.80	349,245.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,441	34.88	433,942.08	
	ADIDAS AG	8,595	272.15	2,339,129.25	
	ADP	1,497	175.20	262,274.40	
	ADYEN NV	496	653.00	323,888.00	
	AEGON NV	84,122	4.16	350,536.37	
	AENA SME SA	3,328	168.35	560,268.80	
	AGEAS	8,467	53.38	451,968.46	
	AIB GROUP PLC	38,335	2.81	107,721.35	
	AIR LIQUIDE	22,578	121.35	2,739,840.30	
	AIRBUS SE	27,818	135.30	3,763,775.40	
	AKZO NOBEL NV	10,883	87.98	957,486.34	
	ALLIANZ SE	20,158	218.70	4,408,554.60	
	ALSTOM RGPT	7,583	38.70	293,462.10	

AMADEUS IT GROUP SA	20,870	71.88	1,500,135.60
AMUNDI SA	2,900	68.70	199,230.00
ANDRITZ AG	3,509	38.90	136,500.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,291	71.72	2,602,790.52
ARCELORMITTAL	31,235	14.77	461,340.95
ARKEMA	3,243	95.00	308,085.00
AROUNDTOWN SA	44,337	7.79	345,739.92
ASML HOLDING NV	20,254	244.95	4,961,217.30
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	52,139	18.70	974,999.30
ATLANTIA SPA	24,171	22.50	543,847.50
ATOS SE	4,671	72.50	338,647.50
AXA	92,397	25.13	2,321,936.61
AXEL SPRINGER SE	2,329	63.20	147,192.80
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	315,036	4.76	1,500,201.43
BANCO DE SABADELL SA	264,599	0.98	261,688.41
BANCO SANTANDER SA	769,612	3.55	2,734,431.43
BANK OF IRELAND GROUP PLC	45,415	4.30	195,556.99
BANKIA SA	58,026	1.72	99,978.79
BANKINTER SA	32,141	6.15	197,924.27
BASF SE	43,604	69.78	3,042,687.12
BAYER AG	44,411	70.19	3,117,208.09
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,627	73.52	1,148,897.04
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,819	55.70	157,018.30
BEIERSDORF AG	4,789	106.00	507,634.00
BIOMERIEUX	1,971	79.25	156,201.75
BNP PARIBAS	53,482	50.75	2,714,211.50
BOLLORE	45,382	3.94	179,168.13
BOUYGUES	10,682	37.12	396,515.84
BRENNTAG AG	7,269	47.46	344,986.74
BUREAU VERITAS SA	13,883	23.24	322,640.92
CAIXABANK	170,209	2.66	453,436.77
CAPGEMINI SA	7,557	108.00	816,156.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,924	104.50	201,058.00
CARREFOUR SA	28,230	15.26	430,789.80
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,681	44.11	118,258.91
CELLNEX TELECOM SAU	9,548	36.92	352,512.16
CIE DE SAINT-GOBAIN	23,359	36.97	863,582.23
CNH INDUSTRIAL NV	48,501	9.88	479,383.88
CNP ASSURANCES	8,311	17.76	147,603.36
COLRUYT NV	2,605	47.98	124,987.90
COMMERZBANK AG	46,401	5.13	238,222.73
CONTINENTAL AG	5,200	123.40	641,680.00
COVESTRO AG	8,148	43.65	355,660.20
CREDIT AGRICOLE SA	54,716	12.56	687,232.96
CRH PLC	38,141	33.63	1,282,681.83
DAIMLER AG	43,337	50.16	2,173,783.92
DANONE	29,452	74.64	2,198,297.28
DASSAULT AVIATION SA	121	1,246.00	150,766.00
DASSAULT SYSTEMES SA	6,264	139.70	875,080.80
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	27,645	8.26	228,347.70

DELIVERY HERO SE	5,419	44.17	239,357.23	
DEUTSCHE BANK AG	93,472	6.58	615,793.53	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,083	138.10	1,254,362.30	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	11,244	17.71	199,131.24	
DEUTSCHE POST AG	47,317	34.43	1,629,360.89	
DEUTSCHE TELEKOM AG	160,612	15.15	2,434,235.47	
DEUTSCHE WOHNEN SE	17,122	35.45	606,974.90	
E.ON SE	104,848	9.11	956,004.06	
EDENRED	11,544	47.59	549,378.96	
EDF	28,824	9.26	266,910.24	
EIFFAGE	3,790	100.75	381,842.50	
ELISA OYJ	6,980	48.87	341,112.60	
ENAGAS SA	10,941	22.90	250,548.90	
ENDESA SA	15,193	24.35	369,949.55	
ENEL SPA	387,486	6.83	2,646,529.38	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	122,377	3.72	456,099.07	
ENGIE	86,974	14.20	1,235,030.80	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	120,779	13.97	1,687,282.63	
ERSTE GROUP BANK AG	14,321	32.69	468,153.49	
ESSILORLUXOTTICA	13,550	140.05	1,897,677.50	
EURAZEO	1,963	62.00	121,706.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	552	462.60	255,355.20	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,621	16.24	140,048.14	
EVONIK INDUSTRIES AG	8,729	25.93	226,342.97	
EXOR NV	5,101	71.14	362,885.14	
FAURECIA	3,629	47.11	170,962.19	
FERRARI NV	5,825	147.90	861,517.50	
FERROVIAL S.A.	23,400	26.46	619,164.00	
FERROVIAL SA-RTS	23,400	0.41	9,781.20	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	51,518	14.13	728,155.41	
FINECOBANK SPA	28,814	11.23	323,581.22	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	3,689	99.16	365,801.24	
FORTUM OYJ	21,120	21.21	447,955.20	
FRAPORT AG	2,142	77.90	166,861.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,212	67.14	685,633.68	
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,850	48.66	966,000.25	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	3,167	39.72	125,793.24	
GALP ENERGIA SGPS SA	23,702	15.25	361,455.50	
GEA GROUP AG	7,316	28.85	211,066.60	
GETLINK SE - REGR	22,727	15.60	354,541.20	
GRIFOLS SA	14,218	29.71	422,416.78	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,782	93.26	352,709.32	
HANNOVER RUECK SE	2,852	166.60	475,143.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	6,978	67.00	467,526.00	
HEINEKEN HOLDING NV	5,489	87.65	481,110.85	
HEINEKEN NV	12,335	93.78	1,156,776.30	
HENKEL AG & CO KGAA	5,009	87.65	439,038.85	
HENKEL KGAA-VORZUG	8,387	94.96	796,429.52	
HERMES INTERNATIONAL	1,509	661.60	998,354.40	
HOCHTIEF AG	1,170	111.50	130,455.00	
HUGO BOSS AG	2,957	41.27	122,035.39	
IBERDROLA SA	285,973	8.91	2,549,163.32	

ILIAD SA	1,304	114.65	149,503.60
IMERYS SA	1,709	37.14	63,472.26
INDITEX SA	51,865	27.64	1,433,548.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	59,292	19.27	1,142,912.59
ING GROEP NV-CVA	184,999	10.53	1,948,409.46
INGENICO GROUP	2,872	97.94	281,283.68
INTESA SANPAOLO	709,593	2.34	1,665,414.77
IPSEN	1,792	97.30	174,361.60
JC DECAUX SA	3,732	26.34	98,300.88
JERONIMO MARTINS	11,907	14.87	177,116.62
KBC GROEP NV	11,827	67.52	798,559.04
KERING	3,609	549.50	1,983,145.50
KERRY GROUP PLC-A	7,575	115.40	874,155.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,307	49.74	363,450.18
KION GROUP AG	3,064	60.60	185,678.40
KNORR-BREMSE AG	2,329	85.98	200,247.42
KONE OYJ	16,179	56.74	917,996.46
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	56,413	24.02	1,355,040.26
KONINKLIJKE DSM NV	8,621	116.75	1,006,501.75
KONINKLIJKE PHILIPS NV	44,091	41.10	1,812,360.55
L'OREAL SA	12,016	260.80	3,133,772.80
LANXESS	4,075	62.20	253,465.00
LEGRAND SA	12,739	71.84	915,169.76
LEONARDO SPA	19,099	11.13	212,571.87
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	13,230	398.20	5,268,186.00
MAPFRE SA	49,666	2.52	125,158.32
MEDIOBANCA SPA	29,577	10.27	303,755.79
MERCK KGAA	6,139	108.20	664,239.80
METRO AG	8,677	14.78	128,246.06
METSO OYJ	4,913	34.18	167,926.34
MICHELIN (C.G.D.E.)	8,147	112.45	916,130.15
MONCLER SPA	8,538	37.10	316,759.80
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	2,476	247.00	611,572.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	6,853	256.70	1,759,165.10
NATIXIS	46,218	3.99	184,548.47
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,577	23.73	345,912.21
NESTE OYJ	20,170	31.32	631,724.40
NN GROUP NV	14,345	35.24	505,517.80
NOKIA OYJ	268,896	3.10	835,459.87
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,816	26.40	153,542.40
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	3,226	44.20	142,589.20
OMV AG	6,951	52.96	368,124.96
ORANGE S.A.	96,860	14.63	1,417,546.10
ORION OYJ-CLASS B	4,927	39.78	195,996.06
PERNOD-RICARD	10,120	170.45	1,724,954.00
PEUGEOT SA	28,023	22.70	636,122.10
PIRELLI & C SPA	19,624	5.21	102,319.53
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	7,153	67.54	483,113.62
POSTE ITALIANE SPA	25,385	10.87	276,061.87
PROXIMUS	7,750	27.50	213,125.00
PRYSMIAN SPA	11,557	19.89	229,926.51

PUBLICIS GROUPE	10,289	39.51	406,518.39
PUMA AG	3,980	67.35	268,053.00
QIAGEN NV	10,764	37.25	400,959.00
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	6,997	21.85	152,884.45
RANDSTAD NV	5,547	51.32	284,672.04
RECORDATI SPA	5,003	37.00	185,111.00
RED ELECTRICA DE ESPANA	20,532	17.21	353,458.38
REMY COINTREAU	1,077	122.00	131,394.00
RENAULT SA	9,177	44.06	404,338.62
REPSOL SA	68,917	14.61	1,007,221.95
ROYAL KPN NV	175,486	2.77	487,500.10
RTL GROUP	1,969	42.84	84,351.96
RWE AG	26,056	26.41	688,138.96
SAFRAN SA	15,610	148.65	2,320,426.50
SAMPO OYJ	21,226	36.77	780,480.02
SANOFI	53,613	83.11	4,455,776.43
SAP SE	46,782	122.66	5,738,280.12
SARTORIUS AG-VORZUG	1,695	182.20	308,829.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,327	135.40	179,675.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,174	87.28	2,284,466.72
SCOR REGROUPE	7,577	37.59	284,819.43
SEB SA	1,081	140.40	151,772.40
SIEMENS AG	36,389	114.44	4,164,357.16
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,470	13.53	155,246.45
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,130	43.40	309,477.65
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,760	31.58	339,800.80
SNAM SPA	98,841	4.54	449,430.02
SOCIETE BIC SA	1,215	61.75	75,026.25
SOCIETE GENERALE	36,585	28.37	1,038,099.37
SODEXO	4,244	105.85	449,227.40
SOLVAY SA	3,500	102.40	358,400.00
STMICROELECTRONICS NV	32,480	21.86	710,012.80
STORA ENSO OYJ	27,010	12.43	335,734.30
SUEZ	16,571	12.97	214,925.87
SYMRISE AG	6,145	85.32	524,291.40
TELECOM ITALIA SPA	713,212	0.55	392,979.81
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	48,793	2.74	133,692.82
TELEFONICA SA	224,645	6.72	1,511,411.56
TELENET GROUP HOLDING NV	2,367	42.70	101,070.90
TELEPERFORMANCE	2,815	213.00	599,595.00
TENARIS SA	21,972	9.60	210,975.14
TERNA SPA	67,450	5.80	391,479.80
THALES SA	5,091	90.74	461,957.34
THYSSENKRUPP AG	19,463	13.34	259,636.42
TOTAL SA	113,791	48.86	5,559,828.26
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,993	50.06	199,889.58
UCB SA	5,987	72.68	435,135.16
UMICORE	9,367	39.75	372,338.25
UNICREDIT SPA	95,013	12.37	1,175,880.88
UNILEVER NV	69,518	53.54	3,721,993.72
UNIPER SE	9,541	28.89	275,639.49

	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,904	30.11	177,769.44	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,075	30.55	766,041.25	
	VALEO SA	11,528	35.93	414,201.04	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,730	22.86	588,187.80	
	VINCI SA	24,391	101.25	2,469,588.75	
	VIVENDI SA	43,976	24.78	1,089,725.28	
	VOESTALPINE AG	5,391	23.52	126,796.32	
	VOLKSWAGEN AG	8,725	177.32	1,547,117.00	
	VOLKSWAGEN AG	1,650	177.45	292,792.50	
	VONOVIA SE	24,372	47.88	1,166,931.36	
	VOPAK	3,380	49.94	168,797.20	
	WARTSILA OYJ	20,924	9.11	190,617.64	
	WENDEL	1,371	122.40	167,810.40	
	WIRECARD AG	5,601	121.25	679,121.25	
	WOLTERS KLUWER NV	13,377	64.80	866,829.60	
	WORLDLINE SA	3,929	55.40	217,666.60	
	ZALANDO SE	5,965	38.55	229,950.75	
ユーロ	小計	9,230,853		194,158,489.30 (23,361,149,433)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	576,675	79.50	45,845,662.50	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	14,700	105.90	1,556,730.00	
	BANK OF EAST ASIA	64,400	18.06	1,163,064.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	178,039	27.10	4,824,856.90	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	122,909	53.90	6,624,795.10	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	130,409	73.15	9,539,418.35	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	32,500	55.30	1,797,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	79,143	81.35	6,438,283.05	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	102,810	53.65	5,515,756.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	99,157	16.54	1,640,056.78	
	HANG SENG BANK LTD	36,912	163.80	6,046,185.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	71,641	38.25	2,740,268.25	
	HONG KONG & CHINA GAS	490,048	15.18	7,438,928.64	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	57,211	251.80	14,405,729.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	30,000	30.80	924,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	32,000	25.95	830,400.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	46,400	11.92	553,088.00	
	MTR CORP	77,255	43.85	3,387,631.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	294,669	10.78	3,176,531.82	
	NWS HOLDINGS LTD	78,000	11.70	912,600.00	
	PCCW LTD	249,000	4.63	1,152,870.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	67,087	55.45	3,719,974.15	
	SANDS CHINA LTD	116,180	38.30	4,449,694.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	62,000	8.31	515,220.00	
	SINO LAND CO	148,000	11.66	1,725,680.00	
	SJM HOLDINGS LTD	96,000	8.36	802,560.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	76,023	110.80	8,423,348.40	
	SWIRE PACIFIC LTD	23,866	70.15	1,674,199.90	
	SWIRE PROPERTIES LTD	56,000	23.90	1,338,400.00	

TECHTRONIC INDUSTRIES CO	65,500	61.55	4,031,525.00	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	34,000	32.60	1,108,400.00	
WH GROUP LTD	456,000	8.58	3,912,480.00	
WHARF HOLDINGS LTD	59,733	18.48	1,103,865.84	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	57,733	44.55	2,572,005.15	
WHEELLOCK & CO LTD	39,000	49.30	1,922,700.00	
WYNN MACAU LTD	74,903	17.36	1,300,316.08	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	36,500	23.35	852,275.00	
香港・ドル 小計	4,332,403		165,966,750.56 (2,303,618,498)	
合計	56,847,979		199,297,460,924 (199,297,460,924)	

## 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	26,769.00	463,103.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,354.00	853,106.36	
		AMERICAN TOWER REIT INC	21,088.00	4,545,940.16	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	72,062.00	661,529.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,599.00	1,432,378.94	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,279.00	1,006,467.33	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,551.00	513,307.29	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	19,847.00	2,665,849.04	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,935.00	1,211,970.65	
		DUKE REALTY CORP	16,794.00	593,332.02	
		EQUINIX INC	4,011.00	2,266,054.56	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,340.00	594,058.20	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,603.00	1,532,693.21	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,153.00	1,016,810.97	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,109.00	652,441.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,504.00	461,757.12	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,661.00	793,135.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,777.00	597,816.63	
		INVITATION HOMES INC	21,560.00	645,290.80	
		IRON MOUNTAIN INC	13,803.00	468,749.88	
		KIMCO REALTY CORP	19,865.00	430,474.55	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,933.00	424,992.90	
		MACERICH CO/THE	5,444.00	148,131.24	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,512.00	757,293.68	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,644.00	437,542.56	
		PROLOGIS INC	29,911.00	2,722,798.33	
		PUBLIC STORAGE	7,476.00	1,597,920.24	
REALTY INCOME CORP	15,007.00	1,167,394.53			

	REGENCY CENTERS CORP	7,861.00	512,930.25	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,412.00	1,298,825.88	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,704.00	2,217,951.36	
	SL GREEN REALTY CORP	3,916.00	331,841.84	
	SUN COMMUNITIES INC	4,418.00	723,094.06	
	UDR INC	13,634.00	666,429.92	
	VENTAS INC	17,065.00	1,000,862.25	
	VEREIT	46,148.00	446,251.16	
	VORNADO REALTY TRUST	8,009.00	516,820.77	
	WELLTOWER INC	19,283.00	1,640,983.30	
	WP CAREY INC	8,297.00	711,384.78	
アメリカ・ドル	小計	572,338.00	40,729,715.82 (4,423,654,435)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,327.00	239,062.89	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	33,117.00	305,537.44	
	SEGRO PLC	51,150.00	443,982.00	
イギリス・ポンド	小計	126,594.00	988,582.33 (138,727,758)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	56,825.00	684,173.00	
	GOODMAN GROUP	81,332.00	1,203,713.60	
	GPT GROUP	103,552.00	629,596.16	
	MIRVAC GROUP	202,999.00	667,866.71	
	SCENTRE GROUP	268,536.00	1,071,458.64	
	STOCKLAND	122,352.00	609,312.96	
	VICINITY CENTRES	176,551.00	474,922.19	
オーストラリア・ドル	小計	1,012,147.00	5,341,043.26 (395,984,947)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	7,043.00	153,044.39	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,370.00	197,737.10	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,538.00	112,897.58	
カナダ・ドル	小計	17,951.00	463,679.07 (37,938,222)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,900.00	354,237.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	124,300.00	249,843.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	123,900.00	314,706.00	
	SUNTEC REIT	91,900.00	168,177.00	
シンガポール・ドル	小計	461,000.00	1,086,963.00 (86,739,647)	
ユーロ	COVIVIO	2,304.00	236,390.40	
	GECINA SA	2,154.00	335,377.80	
	ICADE	1,495.00	133,354.00	
	KLEPIERRE	9,583.00	317,772.28	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,591.00	947,456.25	
ユーロ	小計	22,127.00	1,970,350.73 (237,072,600)	
香港・ドル	LINK REIT	100,871.00	8,231,073.60	
香港・ドル	小計	100,871.00	8,231,073.60 (114,247,302)	
投資証券	合計		5,434,364,911 (5,434,364,911)	
合計			5,434,364,911	

- (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 610銘柄	65.14%	-%	69.30%
	投資証券 39銘柄	-%	2.10%	
イギリス・ポンド	株式 95銘柄	5.64%	-%	5.88%
	投資証券 3銘柄	-%	0.07%	
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	0.12%	-%	0.12%
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	2.23%	-%	2.50%
	投資証券 7銘柄	-%	0.19%	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.58%	-%	3.70%
	投資証券 3銘柄	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.41%	-%	0.47%
	投資証券 4銘柄	-%	0.04%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.27%	-%	3.37%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.93%	-%	0.96%
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	0.22%	-%	0.23%
ユーロ	株式 237銘柄	11.07%	-%	11.53%
	投資証券 5銘柄	-%	0.11%	
香港・ドル	株式 37銘柄	1.09%	-%	1.18%
	投資証券 1銘柄	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	76,842,988	111,069,596
金銭信託	23,080,139	2,091,577
コール・ローン	32,111,499	84,122,383
国債証券	17,613,140,774	24,640,272,641
派生商品評価勘定	72	1,123
未収入金	665,973	737,601
未収利息	113,252,488	139,580,909
前払費用	7,551,171	12,891,736
流動資産合計	17,866,645,104	24,990,767,566
資産合計	17,866,645,104	24,990,767,566
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	374,889	78,201
未払金	78,852,405	72,688,119
未払解約金	18,722,533	45,922,806
その他未払費用	2,464	733
流動負債合計	97,952,291	118,689,859
負債合計	97,952,291	118,689,859
純資産の部		
元本等		
元本	13,426,526,479	18,019,497,917
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,342,166,334	6,852,579,790
純資産合計	17,768,692,813	24,872,077,707
負債純資産合計	17,866,645,104	24,990,767,566

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	13,426,526,479口	18,019,497,917口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3234円 (13,234円)	1.3803円 (13,803円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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11月20日現在	2019年11月20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	173,435,958	635,054,816
合計	173,435,958	635,054,816

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2018年11月20日 現在				2019年11月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	49,345,189	-	48,970,372	374,817	54,671,804	-	54,594,726	77,078
アメリカ・ドル	41,561,341	-	41,186,717	374,624	39,192,886	-	39,118,884	74,002
イギリス・ポンド	-	-	-	-	1,456,184	-	1,456,288	104
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	3,221,592	-	3,221,852	260
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	1,885,873	-	1,885,371	502
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	1,886,204	-	1,882,507	3,697
ユーロ	7,783,848	-	7,783,655	193	7,029,065	-	7,029,824	759
合計	49,345,189	-	48,970,372	374,817	54,671,804	-	54,594,726	77,078

## （注）１．時価の算定方法

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

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

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

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,298,147,706円	13,426,526,479円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,211,379,155円	7,559,583,314円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,083,000,382円	2,966,611,876円
元本の内訳		
ファンド名		
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,461,969,133円	1,913,723,452円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,584,015,447円	3,342,592,527円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	903,148,588円	1,117,994,429円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	-円	695,278,547円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	-円	5,548,187円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	-円	16,265,029円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	-円	15,522,663円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	7,278,919,564円	8,537,605,753円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	528,387,080円	821,539,249円
DCニッセイ外国債券インデックス	561,411,674円	870,914,843円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	5,967,897円	28,348,797円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	59,712,782円	492,962,365円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	3,292,189円	18,637,530円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	4,935,002円	38,575,285円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	2,849,336円	14,055,660円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	18,318,542円	54,322,993円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,959,566円	3,312,314円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	11,639,679円	21,545,383円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	1,986,946円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	1,882,158円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	3,194,198円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	3,689,609円
計	13,426,526,479円	18,019,497,917円

## 附属明細表（2019年11月20日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	100,000.00	128,882.00	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	70,000.00	90,729.10	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	160,000.00	217,862.40	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	80,000.00	104,165.60	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	80,000.00	100,396.80	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	120,000.00	159,384.00	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	60,000.00	78,942.00	
		US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	2,110,000.00	2,103,226.90	
		US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	1,050,000.00	1,041,789.00	
		US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	1,140,000.00	1,129,933.80	
		US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	1,030,000.00	1,026,734.90	
		US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	1,230,000.00	1,213,518.00	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,490,000.00	1,491,326.10	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/31	1,190,000.00	1,190,975.80	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,660,000.00	1,661,543.80	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	1,230,000.00	1,224,809.40	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	1,230,000.00	1,224,083.70	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/09/30	680,000.00	676,280.40	
		US TREASURY N/B 1.625 2029/08/15	910,000.00	896,313.60	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	1,200,000.00	1,204,260.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,470,000.00	1,475,791.80	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/06/15	1,180,000.00	1,185,015.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	1,560,000.00	1,566,817.20	
		US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	1,910,000.00	1,919,091.60	
US TREASURY N/B 1.875 2020/12/15	1,440,000.00	1,443,369.60			
US TREASURY N/B 1.875 2026/06/30	650,000.00	656,903.00			

US TREASURY N/B 2 2021/02/28	1,450,000.00	1,456,510.50	
US TREASURY N/B 2 2021/05/31	1,600,000.00	1,608,560.00	
US TREASURY N/B 2 2021/08/31	1,670,000.00	1,680,821.60	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	2,040,000.00	2,055,524.40	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,630,000.00	1,643,871.30	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,880,000.00	1,902,973.60	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	1,180,000.00	1,199,352.00	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	1,210,000.00	1,231,175.00	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	1,360,000.00	1,384,004.00	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	1,150,000.00	1,172,183.50	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	1,550,000.00	1,562,105.50	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	2,080,000.00	2,097,305.60	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	1,620,000.00	1,634,612.40	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	1,170,000.00	1,182,378.60	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	1,180,000.00	1,196,083.40	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	970,000.00	985,413.30	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	1,200,000.00	1,225,068.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	1,110,000.00	1,135,363.50	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	1,280,000.00	1,310,848.00	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	1,490,000.00	1,502,039.20	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	1,280,000.00	1,312,192.00	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	1,640,000.00	1,688,035.60	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	670,000.00	689,966.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	1,360,000.00	1,403,452.00	
US TREASURY N/B 2.25 2026/03/31	680,000.00	702,603.20	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	750,000.00	777,420.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	760,000.00	789,001.60	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	750,000.00	778,972.50	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	460,000.00	458,776.40	
US TREASURY N/B 2.25 2049/08/15	620,000.00	619,001.80	

US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	1,460,000.00	1,471,402.60	
US TREASURY N/B 2.375 2022/03/15	1,180,000.00	1,201,157.40	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	2,080,000.00	2,150,116.80	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	750,000.00	784,830.00	
US TREASURY N/B 2.375 2029/05/15	890,000.00	935,398.90	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	1,860,000.00	1,919,780.40	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	2,030,000.00	2,106,348.30	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	500,000.00	523,320.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	460,000.00	481,882.20	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	490,000.00	513,387.70	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	2,080,000.00	2,099,656.00	
US TREASURY N/B 2.625 2021/12/15	1,230,000.00	1,255,694.70	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	600,000.00	629,760.00	
US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	680,000.00	716,788.00	
US TREASURY N/B 2.625 2029/02/15	900,000.00	964,539.00	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	1,910,000.00	1,993,027.70	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	1,870,000.00	1,956,263.10	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	570,000.00	602,906.10	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	780,000.00	840,231.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	290,000.00	316,720.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	350,000.00	382,154.50	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	480,000.00	528,446.40	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	460,000.00	506,786.60	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	840,000.00	914,281.20	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	860,000.00	937,090.40	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	510,000.00	568,986.60	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	510,000.00	572,016.00	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	470,000.00	529,205.90	
US TREASURY N/B 2.875 2049/05/15	610,000.00	691,300.80	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	570,000.00	611,832.30	

US TREASURY N/B 3 2042/05/15	180,000.00	204,699.60	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	500,000.00	571,660.00	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	500,000.00	572,965.00	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	500,000.00	574,120.00	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	460,000.00	530,453.60	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	460,000.00	530,416.80	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	500,000.00	577,285.00	
US TREASURY N/B 3 2048/08/15	580,000.00	670,891.80	
US TREASURY N/B 3 2049/02/15	610,000.00	707,051.00	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	1,780,000.00	1,818,448.00	
US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	880,000.00	978,516.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	170,000.00	197,193.20	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	220,000.00	255,301.20	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	350,000.00	406,311.50	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	500,000.00	583,160.00	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	550,000.00	650,331.00	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	500,000.00	606,345.00	
US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	620,000.00	768,700.80	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	150,000.00	183,486.00	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	400,000.00	502,312.00	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	500,000.00	629,355.00	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	490,000.00	627,675.30	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	200,000.00	257,554.00	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	140,000.00	188,185.20	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	200,000.00	270,460.00	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	80,000.00	108,512.00	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	170,000.00	232,633.10	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	170,000.00	229,838.30	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	90,000.00	124,048.80	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	140,000.00	194,178.60	

	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	250,000.00	352,947.50	
	US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	230,000.00	331,413.90	
	US TREASURY N/B 5 2037/05/15	90,000.00	129,996.90	
	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	100,000.00	142,535.00	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	190,000.00	241,032.10	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	220,000.00	301,708.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	180,000.00	247,885.20	
アメリカ・ドル 小計		104,940,000.00	109,802,678.20 (11,925,668,879)	
イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	170,000.00	179,690.00	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	200,000.00	296,172.00	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	230,000.00	380,507.40	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	230,000.00	339,330.50	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	220,000.00	370,427.20	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	160,000.00	206,534.40	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	190,000.00	265,720.70	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	170,000.00	262,418.80	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	200,000.00	313,044.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	210,000.00	396,629.10	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	170,000.00	241,876.00	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	160,000.00	172,732.80	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	180,000.00	341,899.20	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	190,000.00	307,874.10	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	200,000.00	246,790.00	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	160,000.00	178,312.00	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	130,000.00	191,539.40	
	UK TSY 0 5/8% 2025 0.625 2025/06/07	140,000.00	140,602.00	
	UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	310,000.00	313,003.90	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	200,000.00	212,912.00	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	260,000.00	274,105.00	
	UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	190,000.00	199,743.20	
UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	320,000.00	347,328.00		

	UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22	100,000.00	111,123.00	
	UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	120,000.00	142,147.20	
	UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	320,000.00	326,720.00	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	280,000.00	289,601.20	
	UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	90,000.00	100,490.40	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	200,000.00	233,686.00	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	200,000.00	213,100.00	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	140,000.00	154,802.20	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	110,000.00	119,570.00	
	UK TSY 2029 0.875 2029/10/22	130,000.00	131,787.50	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	200,000.00	371,194.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	280,000.00	395,892.00	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	200,000.00	335,338.00	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	270,000.00	400,023.90	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	170,000.00	296,820.00	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	310,000.00	309,953.50	
	UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	330,000.00	332,795.10	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	300,000.00	328,638.00	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	230,000.00	337,297.30	
	イギリス・ボンド 小計	8,570,000.00	11,110,171.00 (1,559,090,296)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.5 2031/06/21	140,000.00	144,830.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2020/11/21	230,000.00	232,109.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	220,000.00	225,660.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	190,000.00	198,561.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	330,000.00	361,099.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	290,000.00	328,668.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	340,000.00	368,852.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	340,000.00	384,172.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	320,000.00	364,672.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	310,000.00	357,253.30	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	100,000.00	119,051.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	50,000.00	59,888.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	160,000.00	202,964.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	330,000.00	371,616.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	350,000.00	416,255.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	110,000.00	141,148.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	140,000.00	188,774.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	390,000.00	470,281.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	170,000.00	238,161.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	360,000.00	456,181.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	300,000.00	348,054.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	320,000.00	343,376.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	310,000.00	350,783.60	
	オーストラリア・ドル 小計	5,800,000.00	6,672,415.60 (494,692,893)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	60,000.00	82,773.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	230,000.00	224,769.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	310,000.00	306,630.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	220,000.00	216,992.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	300,000.00	295,800.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	180,000.00	174,160.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2021/11/01	150,000.00	149,227.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2025/03/01	50,000.00	49,475.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2030/06/01	80,000.00	78,261.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2021/08/01	150,000.00	149,880.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	180,000.00	180,054.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2024/09/01	190,000.00	190,399.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	160,000.00	160,435.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2021/05/01	140,000.00	140,337.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	210,000.00	211,612.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2020/11/01	120,000.00	120,380.40	

	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	130,000.00	132,447.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	170,000.00	177,383.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	100,000.00	110,687.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2021/02/01	150,000.00	151,108.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	150,000.00	154,783.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	170,000.00	177,160.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	140,000.00	149,912.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	160,000.00	167,262.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	150,000.00	154,570.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	170,000.00	215,985.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	140,000.00	143,532.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	200,000.00	280,744.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	170,000.00	243,980.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	150,000.00	228,331.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	140,000.00	192,795.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	150,000.00	227,044.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	40,000.00	58,417.60	
	カナダ・ドル 小計	5,210,000.00	5,697,336.00 (466,156,032)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.25 2021/10/01	100,000.00	99,605.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	50,000.00	51,425.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	100,000.00	101,159.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	50,000.00	52,450.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	30,000.00	31,185.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2039/07/01	20,000.00	21,261.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	60,000.00	64,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	150,000.00	156,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	60,000.00	67,470.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	80,000.00	90,720.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	50,000.00	54,957.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	40,000.00	44,228.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	120,000.00	127,700.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	100,000.00	104,480.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	70,000.00	82,838.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	90,000.00	101,160.00	
シンガポール・ドル	小計	1,170,000.00	1,251,140.00 (99,840,972)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	530,000.00	569,262.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	540,000.00	581,320.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	720,000.00	780,984.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	980,000.00	1,052,872.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	880,000.00	1,016,479.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,300,000.00	1,428,700.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	510,000.00	810,951.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	1,140,000.00	1,202,985.00	
スウェーデン・クローナ	小計	6,600,000.00	7,443,555.20 (83,814,432)	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2020/11/15	600,000.00	606,132.00	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	1,040,000.00	1,121,068.00	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2029/11/15	470,000.00	508,939.50	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	770,000.00	837,167.10	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	760,000.00	866,286.00	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	870,000.00	935,328.30	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,600,000.00	3,089,232.00	
デンマーク・クローネ	小計	6,110,000.00	7,964,152.90 (128,222,862)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	420,000.00	425,741.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	390,000.00	400,299.90	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	440,000.00	452,390.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2029/09/06	320,000.00	329,308.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	1,140,000.00	1,168,978.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	430,000.00	450,923.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	560,000.00	601,143.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	1,020,000.00	1,058,352.00	

ノルウェー・クローネ 小計		4,720,000.00	4,887,138.30 (58,108,074)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 2 2021/04/25	310,000.00	313,301.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.25 2022/04/25	130,000.00	132,251.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2023/01/25	160,000.00	164,219.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	510,000.00	525,192.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	450,000.00	464,562.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	360,000.00	371,563.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	350,000.00	367,822.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2029/10/25	210,000.00	222,173.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	330,000.00	353,416.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	550,000.00	597,404.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	770,000.00	833,501.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	523,692.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	130,000.00	172,970.20	
	ポーランド・ズロチ 小計		4,730,000.00	5,042,072.30 (141,228,445)
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	390,000.00	393,104.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	330,000.00	333,184.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.62 2021/11/30	200,000.00	202,174.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	140,000.00	142,944.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	280,000.00	285,283.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.885 2029/08/15	140,000.00	145,168.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	300,000.00	309,270.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	240,000.00	247,524.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	200,000.00	206,360.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	100,000.00	104,718.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	310,000.00	315,412.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	290,000.00	301,089.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	120,000.00	126,732.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	70,000.00	74,230.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	120,000.00	127,010.40	

	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	150,000.00	162,283.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	100,000.00	111,240.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	140,000.00	159,367.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	130,000.00	148,882.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.921 2048/07/06	120,000.00	138,058.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	114,580.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	68,232.60	
マレーシア・リンギット 小計		4,030,000.00	4,216,851.90 (110,059,835)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	4,270,000.00	4,856,698.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	900,000.00	1,147,203.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	2,240,000.00	2,116,979.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	3,800,000.00	3,792,932.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	3,550,000.00	3,540,024.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.25 2021/12/09	1,850,000.00	1,870,849.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	3,340,000.00	3,458,703.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,750,000.00	1,849,260.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	1,220,000.00	1,288,442.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	2,230,000.00	2,336,906.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	3,840,000.00	4,013,337.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	1,690,000.00	1,825,419.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	2,540,000.00	2,815,437.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	1,960,000.00	2,208,704.40	
	メキシコ・ペソ 小計		35,180,000.00	37,120,897.30 (208,248,234)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	120,000.00	123,286.80	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	130,000.00	135,795.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	200,000.00	212,940.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	160,000.00	172,224.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	180,000.00	194,463.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	160,000.00	174,627.20	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	190,000.00	206,205.10	

BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	140,000.00	154,835.80	
BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	80,000.00	91,296.80	
BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	60,000.00	70,420.80	
BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	130,000.00	159,712.80	
BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22	70,000.00	87,495.80	
BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	100,000.00	125,827.00	
BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	60,000.00	86,162.40	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	160,000.00	176,265.60	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	60,000.00	85,777.20	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	180,000.00	205,333.20	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	90,000.00	125,766.00	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	120,000.00	208,308.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	160,000.00	177,547.20	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	100,000.00	147,970.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	200,000.00	218,278.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	200,000.00	227,940.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	210,000.00	366,670.50	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	120,000.00	156,964.80	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	240,000.00	409,768.80	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	220,000.00	325,344.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	230,000.00	231,278.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/10/31	240,000.00	241,963.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2024/07/30	140,000.00	142,151.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	240,000.00	244,668.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	250,000.00	254,527.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	220,000.00	224,763.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.6 2029/10/31	190,000.00	193,216.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	260,000.00	265,093.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	270,000.00	291,027.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	250,000.00	272,655.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	260,000.00	283,636.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	260,000.00	284,060.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	270,000.00	296,346.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	240,000.00	262,492.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	270,000.00	293,490.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.85 2035/07/30	120,000.00	138,073.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	230,000.00	256,926.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	290,000.00	334,181.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	260,000.00	292,133.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	220,000.00	267,689.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	150,000.00	200,679.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	280,000.00	318,962.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	210,000.00	288,882.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	130,000.00	207,162.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	250,000.00	293,277.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	240,000.00	369,055.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	260,000.00	306,779.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	270,000.00	340,605.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	250,000.00	426,027.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	210,000.00	253,419.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.85 2020/10/31	210,000.00	220,605.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	230,000.00	396,846.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	220,000.00	312,901.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	170,000.00	316,575.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	260,000.00	306,953.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	300,000.00	325,623.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	270,000.00	441,045.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	270,000.00	307,006.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	280,000.00	387,142.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	300,000.00	453,015.00	

BUNDESobligation 0 2021/04/09	250,000.00	252,255.00	
BUNDESobligation 0 2021/10/08	220,000.00	222,723.60	
BUNDESobligation 0 2022/04/08	210,000.00	213,362.10	
BUNDESobligation 0 2022/10/07	210,000.00	214,076.10	
BUNDESobligation 0 2023/10/13	190,000.00	194,833.60	
BUNDESobligation 0 2024/10/18	170,000.00	174,941.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	310,000.00	321,051.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2029/08/15	190,000.00	196,448.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2050/08/15	50,000.00	47,375.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	310,000.00	327,186.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	260,000.00	275,420.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	270,000.00	286,029.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	280,000.00	296,091.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	310,000.00	330,518.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	300,000.00	323,259.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	240,000.00	259,221.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	210,000.00	226,144.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	270,000.00	294,626.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	210,000.00	275,064.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	310,000.00	329,030.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	220,000.00	235,591.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	400,000.00	430,360.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	460,000.00	504,155.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	210,000.00	223,477.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	360,000.00	396,612.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	230,000.00	243,291.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	200,000.00	220,028.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2021/09/04	190,000.00	199,942.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	230,000.00	238,376.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	330,000.00	525,317.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	340,000.00	553,472.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	220,000.00	233,989.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	180,000.00	311,490.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	270,000.00	462,329.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	170,000.00	314,542.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	240,000.00	416,570.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	190,000.00	378,544.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	110,000.00	185,139.90	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/12/11	150,000.00	151,023.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/03/12	160,000.00	161,353.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/06/11	180,000.00	181,805.40	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/09/10	160,000.00	161,870.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2021/04/15	190,000.00	190,355.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	220,000.00	221,652.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2020/11/01	180,000.00	181,384.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	410,000.00	414,276.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	420,000.00	428,706.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1 2022/07/15	210,000.00	214,632.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	240,000.00	245,788.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	670,000.00	689,510.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2030/04/01	90,000.00	90,259.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	430,000.00	445,153.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	420,000.00	437,404.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	420,000.00	440,231.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	260,000.00	265,642.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	380,000.00	402,119.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	440,000.00	471,345.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	260,000.00	279,609.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	220,000.00	237,032.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	390,000.00	406,887.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	220,000.00	239,329.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	180,000.00	191,592.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.3 2021/10/15	190,000.00	198,120.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	190,000.00	209,245.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	430,000.00	469,216.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	200,000.00	221,446.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	240,000.00	274,132.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	120,000.00	129,100.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	180,000.00	207,613.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3 2029/08/01	230,000.00	267,043.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.1 2040/03/01	90,000.00	105,351.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	200,000.00	242,218.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	160,000.00	193,598.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	190,000.00	237,826.80	

BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	310,000.00	374,793.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	280,000.00	293,907.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	200,000.00	211,076.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	340,000.00	361,576.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	240,000.00	275,203.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.85 2049/09/01	150,000.00	199,299.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	330,000.00	431,026.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	240,000.00	273,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	280,000.00	326,961.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	260,000.00	318,715.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2021/09/01	300,000.00	325,203.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	290,000.00	336,255.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	300,000.00	391,779.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	210,000.00	311,514.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	330,000.00	403,652.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	300,000.00	427,134.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	270,000.00	400,642.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	260,000.00	386,521.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	340,000.00	465,888.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	230,000.00	263,902.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	320,000.00	369,286.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	250,000.00	373,022.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	360,000.00	534,042.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	320,000.00	452,835.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	150,000.00	200,365.50	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	140,000.00	203,754.60	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	200,000.00	332,166.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	180,000.00	270,811.80	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	130,000.00	200,564.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2022/04/15	50,000.00	50,728.00	

FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	70,000.00	71,437.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	70,000.00	73,693.90	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	60,000.00	63,392.40	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2029/09/15	50,000.00	52,915.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	60,000.00	65,074.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	60,000.00	64,375.80	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	40,000.00	45,604.40	
FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	40,000.00	50,157.20	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	50,000.00	53,564.50	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	70,000.00	74,425.40	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	90,000.00	99,980.10	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	50,000.00	75,611.00	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	100,000.00	125,444.00	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	80,000.00	84,664.00	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	70,000.00	87,654.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	380,000.00	383,032.40	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	360,000.00	363,452.40	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	350,000.00	354,812.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	370,000.00	375,857.10	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	400,000.00	407,896.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	360,000.00	367,815.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2025/03/25	300,000.00	306,288.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2029/11/25	90,000.00	90,276.30	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	240,000.00	242,128.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	400,000.00	414,776.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	450,000.00	472,621.50	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	430,000.00	452,944.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2029/05/25	400,000.00	421,924.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	400,000.00	431,472.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	410,000.00	442,324.40	

FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	390,000.00	422,038.50	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	360,000.00	393,753.60	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	300,000.00	343,455.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	370,000.00	423,875.70	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	550,000.00	641,289.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2050/05/25	260,000.00	312,390.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	650,000.00	703,807.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	450,000.00	499,963.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	250,000.00	311,072.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	130,000.00	170,692.60	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	320,000.00	427,081.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	470,000.00	509,841.90	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	410,000.00	461,282.80	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	500,000.00	632,570.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	500,000.00	619,485.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	560,000.00	609,772.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	460,000.00	494,642.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	320,000.00	517,820.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	460,000.00	574,894.20	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	450,000.00	478,332.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	320,000.00	530,844.80	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	200,000.00	395,990.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	150,000.00	310,923.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	540,000.00	643,140.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	430,000.00	782,385.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	350,000.00	588,658.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	430,000.00	659,073.90	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	390,000.00	673,526.10	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	370,000.00	511,110.60	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	70,000.00	72,086.70	

IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	140,000.00	150,358.60	
IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	100,000.00	109,813.00	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	50,000.00	56,244.50	
IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	70,000.00	78,957.90	
IRISH TSY 1.5% 2050 1.5 2050/05/15	50,000.00	57,915.50	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	70,000.00	83,204.80	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	100,000.00	128,745.00	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	110,000.00	136,031.50	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	70,000.00	70,926.10	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	100,000.00	107,803.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	100,000.00	116,338.00	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	80,000.00	91,623.20	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	140,000.00	199,516.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	190,000.00	192,570.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	190,000.00	194,328.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	190,000.00	197,655.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2029/07/15	130,000.00	135,742.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	170,000.00	180,279.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2040/01/15	70,000.00	74,869.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	190,000.00	205,815.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	150,000.00	163,482.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	210,000.00	228,280.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	180,000.00	201,360.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	190,000.00	204,785.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	170,000.00	227,528.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	180,000.00	302,070.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	190,000.00	202,291.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	170,000.00	193,844.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	190,000.00	341,118.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	190,000.00	318,650.90	

	NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	150,000.00	221,893.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	80,000.00	81,333.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2023/07/15	70,000.00	71,364.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	100,000.00	105,523.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2029/02/20	100,000.00	105,647.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	140,000.00	150,122.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	120,000.00	129,266.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	120,000.00	131,208.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	80,000.00	101,157.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	40,000.00	53,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	150,000.00	165,507.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	210,000.00	228,921.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	60,000.00	103,231.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	90,000.00	118,997.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	80,000.00	132,067.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	110,000.00	123,267.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	180,000.00	193,521.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	110,000.00	121,392.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	50,000.00	108,993.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	170,000.00	283,191.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	110,000.00	146,443.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	110,000.00	165,132.00	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	130,000.00	169,001.30	
	ユーロ 小計	63,910,000.00	76,668,071.40 (9,224,702,351)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	2,940,000.00	3,274,866.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	1,440,000.00	1,034,251.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	1,160,000.00	806,432.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	600,000.00	601,140.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	1,220,000.00	1,027,484.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	1,490,000.00	1,510,711.00	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	2,070,000.00	1,925,244.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	1,330,000.00	1,218,612.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	1,560,000.00	1,386,590.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	1,760,000.00	1,547,585.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	2,780,000.00	2,441,118.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	1,310,000.00	1,221,339.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	1,220,000.00	1,112,017.80	
	南アフリカ・ランド 小計	20,880,000.00	19,107,392.60 (140,439,336)	
国債証券 合計			24,640,272,641 (24,640,272,641)	
合計			24,640,272,641 (24,640,272,641)	

(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 123銘柄	47.95%	48.40%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	6.27%	6.33%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	1.99%	2.01%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	1.87%	1.89%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.40%	0.41%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.34%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.52%	0.52%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.23%	0.24%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.57%	0.57%
マレーシア・リングギット	国債証券 22銘柄	0.44%	0.45%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.84%	0.85%
ユーロ	国債証券 284銘柄	37.09%	37.44%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.56%	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。



## 「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	13,079,208	10,428,921
金銭信託	37,276,284	2,397,162
コール・ローン	51,862,661	96,412,913
投資証券	1,984,027,628	2,413,971,912
未収入金	7,660,389	104,316
未収配当金	4,155,320	4,487,833
流動資産合計	2,098,061,490	2,527,803,057
資産合計	2,098,061,490	2,527,803,057
負債の部		
流動負債		
未払解約金	80,146,262	56,919,231
その他未払費用	500	325
流動負債合計	80,146,762	56,919,556
負債合計	80,146,762	56,919,556
純資産の部		
元本等		
元本	1,958,293,015	2,138,126,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,621,713	332,756,766
純資産合計	2,017,914,728	2,470,883,501
負債純資産合計	2,098,061,490	2,527,803,057

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	1,958,293,015口	2,138,126,735口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0304円 (10,304円)	1.1556円 (11,556円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月20日現在	2019年11月20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)
投資証券	1,849,537	247,250,811
合計	1,849,537	247,250,811

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	2,012,602,409円	1,958,293,015円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	44,790,636円	322,424,011円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	99,100,030円	142,590,291円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ先進国リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,915,161,338円	1,859,238,576円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	24,070,947円	64,798,652円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,834,846円	5,538,910円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,023,046円	1,584,230円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	15,202,838円	25,749,136円
DCニッセイ先進国リートインデックス	-円	181,217,231円
計	1,958,293,015円	2,138,126,735円

## 附属明細表（2019年11月20日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	1,299.00	35,709.51	
		AGREE REALTY CORP	655.00	49,229.80	
		ALEXANDER'S INC	18.00	5,854.86	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,935.00	308,322.90	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	759.00	35,688.18	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,306.00	109,396.64	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	1,261.00	18,952.83	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,234.00	111,735.26	
		AMERICOLD REALTY TRUST	3,291.00	124,268.16	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2,511.00	137,326.59	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	2,850.00	45,913.50	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	25,200.00	21,924.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,168.00	5,788.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,335.00	506,835.10	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	185.00	2,160.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,532.00	350,099.64	
		BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	866.00	8,365.56	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	2,724.00	41,568.24	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,583.00	125,617.50	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	1,326.00	25,737.66	
		BRT APARTMENTS CORP	345.00	5,923.65	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,645.00	185,539.55	
		CARETRUST REIT INC	1,988.00	40,754.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,898.00	6,906.18	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,217.00	3,358.92	
		CHATHAM LODGING TRUST	700.00	12,621.00	
		CITY OFFICE REIT INC	423.00	5,672.43	
		CLIPPER REALTY INC	93.00	866.76	
		COLONY CAPITAL INC	8,445.00	41,042.70	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1,883.00	38,413.20	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	244.00	11,399.68	
		CORECIVIC INC	2,136.00	32,808.96	
		COREPOINT LODGING INC	1,013.00	10,130.00	
		CORESITE REALTY CORP	672.00	77,582.40	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,941.00	56,890.71			
COUSINS PROPERTIES INC	2,683.00	108,554.18			

CUBESMART	3,082.00	96,589.88	
CYRUSONE INC	1,971.00	129,218.76	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3,111.00	31,421.10	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,545.00	432,454.55	
DOUGLAS EMMETT INC	2,809.00	124,944.32	
DUKE REALTY CORP	6,291.00	222,261.03	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	677.00	15,543.92	
EASTGROUP PROPERTIES	731.00	97,668.91	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	1,983.00	28,059.45	
EPR PROPERTIES	1,266.00	94,089.12	
EQUINIX INC	1,430.00	807,892.80	
EQUITY COMMONWEALTH	1,388.00	45,706.84	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,950.00	210,128.50	
EQUITY RESIDENTIAL	5,910.00	514,583.70	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	1,287.00	34,221.33	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,092.00	352,159.08	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,139.00	228,445.20	
FARMLAND PARTNERS INC	604.00	3,823.32	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,207.00	159,058.46	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2,390.00	100,929.70	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	951.00	26,599.47	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,666.00	14,477.54	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	491.00	5,322.44	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	2,991.00	127,984.89	
GEO GROUP INC/THE	2,109.00	30,580.50	
GETTY REALTY CORP	454.00	15,131.82	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	224.00	5,064.64	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	215.00	2,844.45	
GLOBAL NET LEASE INC	1,456.00	28,974.40	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,217.00	72,274.20	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	3,411.00	101,988.90	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	8,441.00	295,435.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	611.00	8,688.42	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,119.00	101,394.15	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12,479.00	214,514.01	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2,703.00	96,416.01	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1,269.00	18,717.75	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	807.00	17,358.57	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	224.00	18,536.00	

INVESTORS REAL ESTATE TRUST	187.00	13,970.77	
INVITATION HOMES INC	8,174.00	244,647.82	
IRON MOUNTAIN INC	4,837.00	164,264.52	
JBG SMITH PROPERTIES	1,796.00	71,714.28	
KILROY REALTY CORP	1,613.00	133,717.70	
KIMCO REALTY CORP	7,404.00	160,444.68	
KITE REALTY GROUP TRUST	1,573.00	30,956.64	
LEXINGTON REALTY TRUST	4,500.00	49,365.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,824.00	173,111.20	
LIFE STORAGE INC	717.00	78,941.70	
LTC PROPERTIES INC	615.00	29,200.20	
MACERICH CO/THE	1,691.00	46,012.11	
MACK-CALI REALTY CORP	1,534.00	33,287.80	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	4,800.00	4,560.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,165.00	166,974.25	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,870.00	256,919.30	
MONMOUTH REIT -CL A	1,155.00	17,151.75	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,782.00	159,241.68	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,026.00	33,375.78	
NATL HEALTH INVESTORS INC	637.00	51,329.46	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1,276.00	10,144.20	
NEXPOINT RESIDENTIAL	298.00	14,238.44	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	707.00	22,744.19	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3,583.00	149,697.74	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	27.00	732.24	
PARAMOUNT GROUP INC	3,153.00	42,943.86	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	4,388.00	98,993.28	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2,490.00	63,694.20	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,608.00	9,326.40	
PHYSICIANS REALTY TRUST	3,148.00	58,899.08	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2,260.00	49,132.40	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	508.00	6,918.96	
PROLOGIS INC	10,867.00	989,223.01	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	309.00	54,609.57	
PUBLIC STORAGE	2,445.00	522,594.30	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,047.00	54,224.13	
REALTY INCOME CORP	5,332.00	414,776.28	
REGENCY CENTERS CORP	2,836.00	185,049.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1,704.00	31,106.52	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	3,587.00	50,469.09	
RETAIL VALUE INC	326.00	12,603.16	

REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	2,385.00	111,618.00	
RLJ LODGING TRUST	3,105.00	52,008.75	
RPT REALTY	1,233.00	18,038.79	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	897.00	79,465.23	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3,309.00	73,856.88	
SAFEHOLD INC	156.00	5,397.60	
SAUL CENTERS INC	186.00	9,761.28	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	3,690.00	27,195.30	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	390.00	16,551.60	
SERVICE PROPERTIES TRUST	2,898.00	68,074.02	
SIMON PROPERTY GROUP INC	5,152.00	777,127.68	
SITE CENTERS CORP	2,371.00	35,161.93	
SL GREEN REALTY CORP	1,433.00	121,432.42	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1,658.00	84,856.44	
STAG INDUSTRIAL INC	2,108.00	65,959.32	
STORE CAPITAL CORP	3,491.00	139,779.64	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,602.00	18,919.62	
SUN COMMUNITIES INC	1,487.00	243,377.29	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3,500.00	48,685.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,475.00	23,275.50	
TAUBMAN CENTERS INC	943.00	31,826.25	
TERRENO REALTY CORP	1,035.00	58,684.50	
UDR INC	4,843.00	236,725.84	
UMH PROPERTIES INC	479.00	7,137.10	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	194.00	23,068.54	
URBAN EDGE PROPERTIES	2,793.00	58,234.05	
URSTADT BIDDLE - CL A	422.00	10,279.92	
VENTAS INC	6,318.00	370,550.70	
VEREIT	19,677.00	190,276.59	
VICI PROPERTIES INC	7,641.00	187,051.68	
VORNADO REALTY TRUST	2,742.00	176,941.26	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	4,308.00	18,179.76	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,195.00	37,021.10	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	2,158.00	68,516.50	
WELLTOWER INC	6,889.00	586,253.90	
WHITESTONE REIT	599.00	8,391.99	
WP CAREY INC	2,735.00	234,498.90	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	2,019.00	42,459.57	
アメリカ・ドル 小計	404,380.00	16,768,409.87 (1,821,216,996)	
イギリス・ポンド			
AEW UK REIT PLC	3,378.00	3,195.58	
ASSURA PLC	37,412.00	26,936.64	
BIG YELLOW GROUP PLC	2,305.00	26,438.35	
BRITISH LAND CO PLC	17,699.00	99,963.95	
CAPITAL & REGIONAL PLC	8,029.00	2,127.68	

	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	6,585.00	5,636.76	
	DERWENT LONDON PLC	1,956.00	71,706.96	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	2,988.00	2,820.67	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	5,746.00	46,783.93	
	HAMMERSON PLC	12,928.00	37,982.46	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	8,111.00	8,305.66	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	7,482.23	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	6,989.00	3,878.89	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	13,108.00	120,934.40	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	14,805.00	35,532.00	
	LXI REIT PLC	2,150.00	2,709.00	
	NEWRIVER REIT PLC	4,756.00	9,188.59	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	2,826.00	2,588.61	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	9,264.00	13,228.99	
	RDI REIT PLC	3,941.00	5,343.99	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	3,251.00	24,041.14	
	SEGRO PLC	20,138.00	174,797.84	
	SHAFTESBURY PLC	3,432.00	32,535.36	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,251.00	8,959.37	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	26,910.00	41,199.21	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	3,183.00	2,756.47	
	UNITE GROUP PLC	4,867.00	58,160.65	
	WORKSPACE GROUP PLC	2,888.00	32,114.56	
	イギリス・ポンド 小計	259,483.00	907,349.94 (127,328,417)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	1,529.00	34,540.11	
	イスラエル・シュケル 小計	1,529.00	34,540.11 (1,082,832)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	5,006.00	19,122.92	
	ARENA REIT	3,295.00	9,621.40	
	BWP TRUST	7,508.00	31,833.92	
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	5,538.00	17,444.70	
	CHARTER HALL GROUP	9,129.00	99,414.81	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	8,152.00	44,672.96	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	4,711.00	21,152.39	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	3,279.00	11,738.82	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	24,522.00	31,020.33	
	DEXUS	18,824.00	226,640.96	
	GDI PROPERTY GROUP	5,939.00	9,027.28	
	GOODMAN GROUP	27,738.00	410,522.40	
	GPT GROUP	34,468.00	209,565.44	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	3,574.00	15,511.16	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,170.00	14,169.90	

	MIRVAC GROUP	68,538.00	225,490.02	
	NATIONAL STORAGE REIT	13,788.00	26,610.84	
	RURAL FUNDS GROUP	3,891.00	7,334.53	
	SCENTRE GROUP	90,966.00	362,954.34	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	11,207.00	30,819.25	
	STOCKLAND	42,335.00	210,828.30	
	VICINITY CENTRES	53,252.00	143,247.88	
	VIVA ENERGY REIT	6,754.00	18,100.72	
オーストラリア・ドル 小計		455,584.00	2,196,845.27 (162,874,108)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	700.00	38,059.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,100.00	12,980.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	300.00	14,256.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,100.00	59,565.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	1,748.00	23,737.84	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,200.00	17,292.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	400.00	6,360.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,400.00	21,406.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2,600.00	36,114.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	500.00	14,845.00	
	Dream Global Real Estate Investment Trust	1,300.00	21,762.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	300.00	20,490.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	2,000.00	43,460.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	600.00	9,708.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	500.00	9,795.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	500.00	11,370.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	200.00	3,764.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	300.00	8,988.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1,400.00	17,150.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,900.00	50,977.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,400.00	44,674.00		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,400.00	17,836.00		
カナダ・ドル 小計		22,848.00	504,588.84 (41,285,459)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	10,000.00	11,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	37,200.00	108,996.00	

	ASCOTT RESIDENCE TRUST	15,700.00	20,881.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	5,000.00	3,550.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	47,400.00	95,274.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	46,200.00	117,348.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	8,400.00	12,936.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	10,100.00	16,059.00	
	ESR REIT	17,200.00	9,116.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	8,000.00	5,760.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	8,800.00	8,976.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	5,500.00	15,400.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	8,200.00	13,366.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	25,900.00	32,116.00	
	KEPPEL DC REIT	26,300.00	52,074.00	
	KEPPEL REIT	27,400.00	33,428.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	29,800.00	7,152.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	25,100.00	58,232.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	17,100.00	42,921.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	44,000.00	73,040.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	35,000.00	40,250.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	57,100.00	31,119.50	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	300.00	975.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	14,600.00	12,410.00	
	SUNTEC REIT	45,400.00	83,082.00	
シンガポール・ドル	小計	575,700.00	905,461.50 (72,255,828)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	7,666.00	10,579.08	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	10,983.00	22,899.55	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	14,340.00	22,155.30	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	8,030.00	14,012.35	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	1,750.00	4,646.25	
ニュージーランド・ドル	小計	42,769.00	74,292.53 (5,186,361)	
ユーロ	AEDIFICA	355.00	41,180.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,936.00	32,466.72	
	BEFIMMO S.C.A.	137.00	8,110.40	
	COFINIMMO	327.00	43,687.20	
	COVIVIO	651.00	66,792.60	
	EUROCOMMERCIAL-CVA	759.00	20,477.82	
	GECINA SA	968.00	150,717.60	
	HIBERNIA REIT PLC-W/I	6,800.00	9,411.20	
	ICADE	596.00	53,163.20	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	6,834.82	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	4,545.00	54,085.50	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	257.00	459.00	
	KLEPIERRE	3,673.00	121,796.68	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1,218.00	9,585.66	
	MERCIALYS	500.00	6,195.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	5,826.00	78,126.66	
	MONTEA	135.00	11,245.50	
	NSI NV	124.00	5,022.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,382.00	342,412.50	
	VASTNED RETAIL NV	245.00	7,129.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	251.00	42,067.60	
	WERELDHAVE NV	626.00	13,571.68	
	ユーロ 小計	33,437.00	1,124,538.84 (135,304,513)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	31,000.00	156,240.00	
	FORTUNE REIT	18,000.00	163,260.00	
	LINK REIT	36,000.00	2,937,600.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	31,000.00	160,580.00	
	香港・ドル 小計	116,000.00	3,417,680.00 (47,437,398)	
投資証券	合計		2,413,971,912 (2,413,971,912)	
合計			2,413,971,912 (2,413,971,912)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 154銘柄	73.71%	75.44%
イギリス・ポンド	投資証券 28銘柄	5.15%	5.27%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	0.04%	0.04%
オーストラリア・ドル	投資証券 23銘柄	6.59%	6.75%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	1.67%	1.71%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	2.92%	2.99%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	0.21%	0.21%
ユーロ	投資証券 22銘柄	5.48%	5.61%
香港・ドル	投資証券 4銘柄	1.92%	1.97%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	30,054,694	71,199,703
金銭信託	39,227,272	2,081,042
コール・ローン	54,577,078	83,698,699
株式	1,453,862,370	1,850,663,620
投資信託受益証券	31,654,646	84,830,276
投資証券	4,797,246	5,384,789
派生商品評価勘定	1,617,697	5,466,152
未収入金	2,944,034	1,096,470
未収配当金	964,063	1,291,471
差入委託証拠金	42,137,115	69,546,063
流動資産合計	1,661,836,215	2,175,258,285
資産合計	1,661,836,215	2,175,258,285
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,465,541	409,423
未払金	2,216,650	17,248
未払解約金	16,580,249	14,311,923
その他未払費用	1,401	658
流動負債合計	20,263,841	14,739,252
負債合計	20,263,841	14,739,252
純資産の部		
元本等		
元本	1,844,866,571	2,309,692,542
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	203,294,197	149,173,509
純資産合計	1,641,572,374	2,160,519,033
負債純資産合計	1,661,836,215	2,175,258,285

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	1,844,866,571口	2,309,692,542口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	203,294,197円	149,173,509円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8898円 (8,898円)	0.9354円 (9,354円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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11月20日現在	2019年11月20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	127,663,938	149,505,319
投資信託受益証券	869,462	5,124,959
投資証券	1,368,636	337,833
合計	128,163,112	144,718,193

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2018年11月20日 現在				2019年11月20日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	11,813,763	-	11,808,376	5,387	36,863,086	-	36,870,106	7,020
アメリカ・ドル	11,810,532	-	11,805,150	5,382	36,859,164	-	36,866,200	7,036
ブラジル・リアル	-	-	-	-	3,922	-	3,906	16
マレーシア・リンギット	3,231	-	3,226	5	-	-	-	-
買 建	85,895,742	-	85,000,313	895,429	74,649,899	-	74,386,870	263,029
アメリカ・ドル	85,895,742	-	85,000,313	895,429	74,649,899	-	74,386,870	263,029
合計	97,709,505	-	96,808,689	890,042	111,512,985	-	111,256,976	270,049

## （注）1．時価の算定方法

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

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	2018年11月20日 現在				2019年11月20日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	143,158,502	-	144,200,699	1,042,197	178,059,035	-	183,385,812	5,326,777
合計	143,158,502	-	144,200,699	1,042,197	178,059,035	-	183,385,812	5,326,777

## （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11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,299,927,274円	1,844,866,571円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	764,471,127円	1,061,417,332円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	219,531,830円	596,591,361円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	995,014,308円	787,226,995円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	781,520,587円	1,413,724,632円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	46,427,320円	49,901,389円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	3,257,038円	7,015,043円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	1,176,052円	2,005,205円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（8資産均等型）	17,471,266円	32,645,881円
DCニッセイ新興国株式インデックス	- 円	17,173,397円
計	1,844,866,571円	2,309,692,542円

附属明細表（2019年11月20日現在）

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	51JOB INC-ADR	100	75.99	7,599.00	
	58.COM INC-ADR	339	57.20	19,390.80	
	ALIBABA GROUP HOLDING- SP ADR	4,467	185.25	827,511.75	
	AUTOHOME INC-ADR	234	71.05	16,625.70	
	BAIDU INC - SPON ADR	863	115.69	99,840.47	
	BAOZUN INC-SPN ADR	100	43.77	4,377.00	
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	1,100	3.28	3,608.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	14.86	7,920.38	
	CREDICORP LTD	182	208.19	37,890.58	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	200	45.25	9,050.00	
	GLOBANT SA	100	95.93	9,593.00	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	300	11.84	3,552.00	
	HUAZHU GROUP LIMITED ADR	400	36.40	14,560.00	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	200	23.87	4,774.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	2,100	0.87	1,843.80	
	IQIYI INC-ADR	400	17.95	7,180.00	
	JD.COM INC-ADR	2,250	32.44	72,990.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,285	95.54	122,768.90	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,208	12.13	14,659.08	

	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	870	7.77	6,759.90	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC	1,682	9.48	15,945.36	
	MOMO INC-SPON ADR	466	37.94	17,680.04	
	NETEASE.COM INC -ADR	198	288.50	57,123.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	433	121.97	52,813.01	
	NIO INC - ADR	2,100	1.83	3,843.00	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	100	28.29	2,829.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	308	207.00	63,756.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	449	20.04	8,997.96	
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	500	13.33	6,665.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	556	12.60	7,005.60	
	PINDUODUO INC-ADR	600	40.72	24,432.00	
	PJSC GAZPROM ADR	16,685	7.76	129,475.60	
	PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	2,128	27.60	58,732.80	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	149	54.65	8,142.85	
	ROSNEFT OJSC-GDR	3,874	7.08	27,443.41	
	SBERBANK PAO - SPONSORED ADR	8,219	14.98	123,120.62	
	SEVERSTAL PAO - GDR REG S	791	14.15	11,192.65	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	2,280	1.03	2,362.08	
	SINA CORP	234	32.58	7,623.72	
	SOUTHERN COPPER CORP	234	37.59	8,796.06	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	4,865	7.25	35,295.57	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,124	44.38	49,883.12	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	822	71.32	58,625.04	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	300	8.97	2,691.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	300	12.11	3,633.00	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	207	6.21	1,285.47	
	TRIP.COM GROUP LTD	1,427	31.61	45,107.47	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1,415	12.26	17,347.90	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	1.44	9,546.04	
	WEIBO CORP-SPON ADR	134	41.67	5,583.78	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	34.13	14,402.86	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,091	43.27	47,207.57	
	YY INC-ADR	134	62.39	8,360.26	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	1,100	21.03	23,133.00	
アメリカ・ドル	小計	79,178		2,252,576.20 (244,652,301)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	717	11.78	8,446.26	

イギリス・ボンド 小計		717		8,446.26 (1,185,264)	
インド・ルピー	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	1,512	364.05	550,443.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	1,139	201.40	229,394.60	
	ASHOK LEYLAND LTD	2,247	82.00	184,254.00	
	ASIAN PAINTS LTD	922	1,721.35	1,587,084.70	
	AUROBINDO PHARMA LTD	802	431.20	345,822.40	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	275	1,841.65	506,453.75	
	AXIS BANK LTD	6,107	747.80	4,566,814.60	
	BAJAJ AUTO LTD	269	3,161.05	850,322.45	
	BAJAJ FINANCE LTD	564	4,135.75	2,332,563.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	119	9,152.80	1,089,183.20	
	BHARAT FORGE LTD	429	454.75	195,087.75	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	2,261	518.95	1,173,345.95	
	BHARTI AIRTEL LTD	7,047	439.35	3,096,099.45	
	BHARTI INFRA TEL LTD	733	250.55	183,653.15	
	BOSCH LTD	15	14,972.75	224,591.25	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	303	3,120.35	945,466.05	
	CIPLA LIMITED	1,072	472.10	506,091.20	
	COAL INDIA LTD	3,906	199.60	779,637.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	611	568.15	347,139.65	
	DABUR INDIA LTD	1,654	453.70	750,419.80	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	245	1,732.70	424,511.50	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	348	2,743.00	954,564.00	
	EICHER MOTORS LTD	35	21,747.35	761,157.25	
	GAIL INDIA LTD	4,264	125.10	533,426.40	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	289	350.50	101,294.50	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	1,109	703.30	779,959.70	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	864	786.15	679,233.60	
	HAVELLS INDIA LTD	799	665.75	531,934.25	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	1,718	1,134.65	1,949,328.70	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	2,013	570.70	1,148,819.10	
	HERO MOTOCORP LTD	409	2,468.95	1,009,800.55	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	3,542	192.35	681,303.70	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	290.20	560,086.00		
HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,113	2,037.75	4,305,765.75		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	5,230	2,212.10	11,569,283.00		
ICICI BANK LTD	7,685	493.50	3,792,547.50		
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	438	1,340.25	587,029.50		
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	666	212.70	141,658.20		
INDIAN OIL CORPORATION LTD	5,990	133.00	796,670.00		
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	11,231	712.85	8,006,018.35		

INTERGLOBE AVIATION LTD	203	1,425.75	289,427.25	
ITC LTD	10,481	249.30	2,612,913.30	
JSW STEEL LTD	2,559	247.90	634,376.10	
LARSEN & TOUBRO LTD	1,529	1,365.75	2,088,231.75	
LIC HOUSING FINANCE LTD	589	422.20	248,675.80	
LUPIN LTD	477	747.70	356,652.90	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,019	327.85	661,929.15	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	3,115	560.65	1,746,424.75	
MARICO LTD	1,422	357.25	508,009.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	330	7,045.45	2,324,998.50	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2,044	134.15	274,202.60	
NESTLE INDIA LTD	62	14,117.10	875,260.20	
NTPC LTD	10,161	117.35	1,192,393.35	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	7,934	133.25	1,057,205.50	
PAGE INDUSTRIES LTD	14	23,017.65	322,247.10	
PETRONET LNG LTD	1,873	272.00	509,456.00	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	274	1,298.15	355,693.10	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	268	1,761.35	472,041.80	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	5,845	195.45	1,142,405.25	
REC LTD	1,368	142.95	195,555.60	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	9,134	1,509.75	13,790,056.50	
SHREE CEMENT LTD	26	20,006.80	520,176.80	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	755	1,126.10	850,205.50	
STATE BANK OF INDIA	5,790	330.40	1,913,016.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	2,759	425.90	1,175,058.10	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	2,825	2,108.80	5,957,360.00	
TATA MOTORS LTD	4,240	167.75	711,260.00	
TATA POWER CO LTD	2,139	55.75	119,249.25	
TATA STEEL LTD	1,159	401.75	465,628.25	
TECH MAHINDRA LTD	1,520	763.15	1,159,988.00	
TITAN CO LTD	952	1,163.20	1,107,366.40	
ULTRATECH CEMENT LTD	302	4,100.15	1,238,245.30	
UNITED SPIRITS LTD	610	609.65	371,886.50	
UPL LTD	1,612	551.25	888,615.00	
VEDANTA LTD	5,757	141.70	815,766.90	
VODAFONE IDEA LTD	21,362	6.05	129,240.10	
WIPRO LTD	3,890	250.40	974,056.00	
YES BANK LTD	5,512	64.15	353,594.80	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	1,659	285.85	474,225.15	
インド・ルピー 小計	207,475		110,641,353.75 (168,174,858)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY TBK PT	27,100	1,320.00	35,772,000.00

	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	64,800	6,650.00	430,920,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	34,700	31,575.00	1,095,652,500.00	
	BANK MANDIRI TBK	60,400	7,150.00	431,860,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	23,200	7,600.00	176,320,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	179,400	4,190.00	751,686,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	8,300	2,070.00	17,181,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	88,500	1,245.00	110,182,500.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	16,300	1,390.00	22,657,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	22,600	7,150.00	161,590,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	1,100	53,650.00	59,015,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	19,900	2,060.00	40,994,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	7,925.00	47,550,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	3,800	19,975.00	75,905,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	4,600	11,425.00	52,555,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	20,800	7,950.00	165,360,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	4,100	5,200.00	21,320,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	115,200	1,520.00	175,104,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	4,300	12,200.00	52,460,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	45,300	595.00	26,953,500.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	21,500	2,010.00	43,215,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	12,425.00	116,795,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	11,100	1,310.00	14,541,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	158,100	4,020.00	635,562,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,700	42,800.00	201,160,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	5,000	22,450.00	112,250,000.00	
	インドネシア・ルピア 小計	960,200		5,074,560,500.00 (39,074,115)	
オフショア・人 民元	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,000	3.60	28,800.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	44.85	44,850.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	8,600	5.61	48,246.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	4,500	3.63	16,335.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,700	5.55	20,535.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	1,700	29.00	49,300.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	9.21	41,445.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	11,000	3.73	41,030.00	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	9,700	4.33	42,001.00	

CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	500	86.95	43,475.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	3,700	37.52	138,824.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,700	16.49	44,523.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	18.47	35,093.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,500	6.13	21,455.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	11,300	3.46	39,098.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	4.80	50,880.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	600	35.59	21,354.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	8,400	4.90	41,160.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8,800	5.57	49,016.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	7,800	5.28	41,184.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	4,100	5.02	20,582.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	9,200	5.88	54,096.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	900	26.72	24,048.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	4,500	18.07	81,315.00	
CITIC SECURITIES CO-A	1,000	22.15	22,150.00	
CRRG CORP LTD-A	2,300	6.94	15,962.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	2,900	14.44	41,876.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	200	113.68	22,736.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	2,600	16.08	41,808.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	13.45	49,765.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	800	59.46	47,568.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	16.96	55,968.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,900	14.12	40,948.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	2,200	33.99	74,778.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	2,800	14.36	40,208.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	2,100	17.22	36,162.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	7.52	46,624.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	500	76.60	38,300.00	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	33.87	40,644.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	5,600	5.85	32,760.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	2,200	19.84	43,648.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.28	41,472.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	600	29.81	17,886.00	

	JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	500	95.63	47,815.00	
	JIANGSU YANGHE BREWERY -A	400	98.00	39,200.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	1,232.32	246,464.00	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,800	35.42	63,756.00	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD- A	400	85.52	34,208.00	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	2.61	53,505.00	
	MIDEA GROUP CO LTD-A	300	57.83	17,349.00	
	MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	500	95.68	47,840.00	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	46.46	41,814.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	6,900	5.54	38,226.00	
	PING AN BANK CO LTD-A	1,800	16.41	29,538.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	1,900	88.89	168,891.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	14.50	39,150.00	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	4.14	41,400.00	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	800	22.82	18,256.00	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	14.65	43,950.00	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	3,100	12.23	37,913.00	
	SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	4.76	52,360.00	
	SUNING.COM CO LTD-A	4,400	10.18	44,792.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	900	46.13	41,517.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	3,400	13.05	44,370.00	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	500	36.60	18,300.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	700	133.50	93,450.00	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	93.99	46,995.00	
	ZTE CORP-A	700	31.89	22,323.00	
	オフショア・人民元 小計	284,500		3,163,290.00 (48,841,197)	
コロンビア・ペ ソ	BANCOLOMBIA SA	764	41,960.00	32,057,440.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,664	43,960.00	73,149,440.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	871	6,810.00	5,931,510.00	
	ECOPETROL SA	12,689	3,100.00	39,335,900.00	
	GRUPO ARGOS SA	540	18,300.00	9,882,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	7,675	1,385.00	10,629,875.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	1,278	33,240.00	42,480,720.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	239	28,120.00	6,720,680.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	19,220.00	28,099,640.00	
	コロンビア・ペソ 小計	27,182		248,287,205.00	

タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE- FOR RG	3,800	227.00	862,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	13,700	81.00	1,109,700.00	
	BANGKOK BANK PCL- FOREIGN REG	1,600	174.00	278,400.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	29,600	24.10	713,360.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	23,600	10.80	254,880.00	
	BANPU PUBLIC CO LTD- FOR REG	13,400	11.50	154,100.00	
	BERLI JUCKER PUB CO- FORGN	6,000	46.50	279,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	19,500	14.00	273,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL- FOREIGN	1,300	132.00	171,600.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	7,200	64.75	466,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD- FORGN	10,200	25.50	260,100.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	18,500	76.75	1,419,875.00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	1,000	354.00	354,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL- FOREIGN	4,200	44.25	185,850.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM- FOREIGN	1,500	174.00	261,000.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	18,400	17.00	312,800.00	
	INDORAMA VENTURES- FOREIGN	5,100	32.00	163,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	64.00	403,200.00	
	IRPC PCL - FOREIGN	70,100	3.40	238,340.00	
	KASIKORNBANK PCL- FOREIGN	7,200	149.00	1,072,800.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	11,400	16.50	188,100.00	
	LAND & HOUSES PUB CO- FOR REG	21,300	9.95	211,935.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	7,100	36.75	260,925.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL- FOREIG	2,100	60.75	127,575.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	3,700	120.00	444,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	7,200	53.00	381,600.00	
	PTT PCL/FOREIGN	36,000	43.75	1,575,000.00	
	RATCH GROUP PCL- FOREIGN	2,300	74.00	170,200.00	
	ROBINSON PCL-FOREIGN	1,000	65.25	65,250.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	2,500	386.00	965,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK- FOR REG	2,800	116.00	324,800.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	2,400	68.00	163,200.00	
	THAI UNION GROUP PCL-F	9,800	13.50	132,300.00	

	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	27,100	1.40	37,940.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	2,200	59.75	131,450.00	
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	36,400	4.36	158,704.00	
タイ・パーツ 小計		437,500		14,571,984.00 (52,167,703)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	571	517.00	295,207.00	
	KOMERCNI BANKA AS	188	787.00	147,956.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	79.60	89,470.40	
チェコ・コルナ 小計		1,883		532,633.40 (2,508,703)	
チリ・ペソ	AGUAS ANDINAS SA-A	4,650	343.50	1,597,275.00	
	BANCO DE CHILE	178,957	91.50	16,374,565.50	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	154	39,479.00	6,079,766.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	219,753	47.38	10,411,897.14	
	CENCOSUD SA	4,383	1,032.50	4,525,447.50	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	7,269.00	1,984,437.00	
	COLBUN SA	13,714	121.40	1,664,879.60	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	470	2,115.00	994,050.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	269	5,668.00	1,524,692.00	
	EMPRESAS CMPC SA	3,736	1,850.00	6,911,600.00	
	EMPRESAS COPEC SA	1,242	7,030.00	8,731,260.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	61.25	5,542,267.50	
	ENERSIS SA	136,473	151.00	20,607,423.00	
	ITAU CORPBANCA	1,000,818	4.37	4,375,576.29	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	950	8,699.00	8,264,050.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	2,406	3,725.00	8,962,350.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	314	18,899.00	5,934,286.00	
チリ・ペソ 小計		1,659,048		114,485,822.53 (15,787,594)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	9,369	7.77	72,797.13	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	403	22.08	8,898.24	
	ARCELIK AS	433	20.10	8,703.30	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	1,050	19.42	20,391.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,292	45.78	59,147.76	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	7.62	61,988.70	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	66.35	10,416.95	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	6,512	9.20	59,910.40	
	KOC HOLDING AS	2,509	20.84	52,287.56	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	294	28.48	8,373.12	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	396	127.50	50,490.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	997	14.12	14,077.64	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	1,339	4.74	6,346.86	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	3,509	13.46	47,231.14	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	7,135	10.25	73,133.75	
	TURKIYE IS BANKASI-C	3,028	6.41	19,409.48	
トルコ・リラ 小計		46,558		573,603.03 (10,915,666)	
ハンガリー・ フォロント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	968	3,002.00	2,905,936.00	
	OTP BANK RT	665	13,950.00	9,276,750.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	639	5,850.00	3,738,150.00	
ハンガリー・フォロント 小計		2,272		15,920,836.00 (5,755,382)	
フィリピン・ペ ソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	51.20	323,072.00	
	ABOITIZ POWER CORP	2,800	36.50	102,200.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	7,500	11.40	85,500.00	
	AYALA CORPORATION	1,175	827.00	971,725.00	
	AYALA LAND INC	23,900	45.00	1,075,500.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	4,840	94.00	454,960.00	
	BDO UNIBANK INC	6,370	157.40	1,002,638.00	
	DMCI HOLDINGS INC	7,100	7.62	54,102.00	
	GLOBE TELECOM INC	65	1,929.00	125,385.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	190	900.00	171,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,800	122.10	341,880.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	9,150	78.00	713,700.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,380	204.40	282,072.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	330.20	452,374.00	
	MEGAWORLD CORP	22,900	4.76	109,004.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	28,100	4.65	130,665.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	5,537	67.90	375,962.30	
	PLDT INC	265	1,112.00	294,680.00	
	ROBINSONS LAND CO	3,400	26.00	88,400.00	
	SECURITY BANK CORP	450	203.80	91,710.00	
SM INVESTMENTS CORP	735	1,069.00	785,715.00		
SM PRIME HOLDINGS INC	32,900	39.80	1,309,420.00		
UNIVERSAL ROBINA CORP	2,810	152.40	428,244.00		
フィリピン・ペソ 小計		172,047		9,769,908.30 (20,809,905)	
ブラジル・レ アル	AMBEV SA	15,100	17.67	266,817.00	
	ATACADA0 SA	1,900	18.42	34,998.00	
	B2W CIA DIGITAL	600	53.96	32,376.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	3,948	31.10	122,782.80	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	13,008	33.07	430,174.56	
	BANCO BTG PACTUAL SA- UNIT	600	68.79	41,274.00	
	BANCO DO BRASIL SA	2,800	45.79	128,212.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	1,300	45.48	59,124.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	2,200	34.03	74,866.00	

BM&FBOVESPA SA	6,700	47.94	321,198.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	2,700	15.50	41,850.00	
BRASKEM SA-PREF A	500	28.06	14,030.00	
BRF SA	1,600	33.56	53,696.00	
CCR SA	3,800	17.00	64,600.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	700	35.80	25,060.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	143	0.40	57.20	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	143	0.19	27.17	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	700	34.90	24,430.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	500	79.47	39,735.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	2,900	12.55	36,395.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	1,000	51.61	51,610.00	
CIELO SA	3,900	7.65	29,835.00	
COGNA EDUCACAO	4,200	10.26	43,092.00	
COSAN SA	800	60.35	48,280.00	
EMBRAER SA	2,000	17.40	34,800.00	
ENERGISA SA-UNITS	600	47.52	28,512.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	44.70	30,172.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	500	102.63	51,315.00	
GERDAU SA-PREF	3,100	15.30	47,430.00	
HYPERA S.A	1,100	33.71	37,081.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	2,400	36.80	88,320.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	15,650	35.13	549,784.50	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	13,730	13.42	184,256.60	
JBS SA	3,500	26.50	92,750.00	
KLABIN SA - UNIT	1,900	17.61	33,459.00	
LOCALIZA RENT A CAR	1,900	41.02	77,938.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	2,300	19.97	45,931.00	
LOJAS RENNER S.A.	2,420	50.58	122,403.60	
M DIAS BRANCO SA	200	33.56	6,712.00	
MAGAZINE LUIZA SA	1,600	44.52	71,232.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	600	28.71	17,226.00	
NATURA COSMETICOS SA	1,200	31.18	37,416.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	900	57.00	51,300.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	9,500	31.25	296,875.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	13,200	28.78	379,896.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	2,600	27.68	71,968.00	
PORTO SEGURO SA	200	58.55	11,710.00	
RAIA DROGASIL SA	800	111.80	89,440.00	
RUMO SA	3,400	23.80	80,920.00	

	SUL AMERICA SA - UNITS	700	51.50	36,050.00	
	SUZANO S.A.	1,522	37.92	57,714.24	
	TELEF BRASIL	1,400	55.78	78,092.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	3,500	13.34	46,690.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	2,200	20.66	45,452.00	
	VALE SA	10,167	48.17	489,744.39	
	WEG SA	2,260	29.20	65,992.00	
ブラジル・リアル 小計		179,466		5,343,102.56 (138,172,632)	
ポーランド・ズロチ	ALIOR BANK SA	185	30.78	5,694.30	
	BANK MILLENNIUM SA	4,739	5.93	28,102.27	
	BANK PEKAO SA	472	103.60	48,899.20	
	CCC SA	57	113.00	6,441.00	
	CD PROJEKT SA	218	265.50	57,879.00	
	CYFROWY POLSAT SA	430	28.70	12,341.00	
	DINO POLSKA SA	96	141.50	13,584.00	
	GRUPA LOTOS SA	296	88.62	26,231.52	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	101	20.56	2,076.56	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	426	94.50	40,257.00	
	LPP SA	4	8,560.00	34,240.00	
	MBANK SA	110	381.40	41,954.00	
	ORANGE POLSKA SA	1,329	6.68	8,884.36	
	PGE SA	1,780	8.69	15,475.32	
	PKO BANK POLSKI SA	2,716	37.72	102,447.52	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	855	97.24	83,140.20	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	5,402	4.75	25,691.91	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	1,940	38.90	75,466.00		
SANTANDER BANK POLSKA S.A.	113	296.80	33,538.40		
ポーランド・ズロチ 小計		21,269		662,343.56 (18,552,243)	
マレーシア・リングギット	AIRASIA GROUP BERHAD	2,500	1.86	4,650.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	2,000	2.85	5,700.00	
	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	4.18	40,546.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	8,700	4.36	37,932.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	300	16.40	4,920.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	15,500	5.38	83,390.00	
	DIALOG GROUP BHD	9,900	3.45	34,155.00	
	DIGI.COM BHD	9,600	4.63	44,448.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	300	34.84	10,452.00	
	GAMUDA BHD	3,100	3.80	11,780.00	
	GENTING BHD	6,700	6.13	41,071.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	5,900	3.25	19,175.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	500	10.22	5,110.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	1,100	9.95	10,945.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,700	5.37	25,239.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	2,200	17.00	37,400.00		

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.78	31,882.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	6,300	5.45	34,335.00	
	IJM CORP BHD	5,200	2.11	10,972.00	
	IOI CORPORATION BHD	4,400	4.43	19,492.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,100	22.50	24,750.00	
	MALAYAN BANKING BHD	12,200	8.65	105,530.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	8.30	40,670.00	
	MAXIS BHD	6,200	5.34	33,108.00	
	MISC BHD	2,400	8.30	19,920.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	144.20	28,840.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	7,800	7.36	57,408.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,600	24.22	38,752.00	
	PETRONAS GAS BHD	2,200	16.70	36,740.00	
	PPB GROUP BERHAD	1,880	18.16	34,140.80	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	7,000	4.75	33,250.00	
	PUBLIC BANK BHD	9,900	20.00	198,000.00	
	QL RESOURCES BHD	2,000	7.40	14,800.00	
	RHB BANK BHD	8,700	5.80	50,460.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.35	11,280.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	7,700	5.14	39,578.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	4,800	0.82	3,936.00	
	SP SETIA BHD	2,300	1.40	3,220.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	2,200	3.79	8,338.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	9,700	13.76	133,472.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	3,000	4.59	13,770.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,800	4.30	7,740.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	8,340	0.89	7,464.30	
	マレーシア・リンギット 小計	213,220		1,458,761.10 (38,073,665)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	9,600	15.67	150,432.00	
	ALSEA SAB DE CV	1,100	53.65	59,015.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	108,100	15.09	1,631,229.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	2,200	106.23	233,706.00	
	CEMEX SAB-CPO	47,800	7.11	339,858.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	1,600	112.12	179,392.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	300	98.46	29,538.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	6,000	179.52	1,077,120.00	
	GRUMA S.A.B.-B	995	203.64	202,621.80	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	645	338.75	218,493.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	900	206.10	185,490.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	5,300	34.62	183,486.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	69.14	62,226.00	

	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	8,100	105.85	857,385.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	7,500	24.14	181,050.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	10,700	53.53	572,771.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	6,900	43.35	299,115.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	360	231.82	83,455.20	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	1,800	82.88	149,184.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	4,900	38.24	187,376.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	800	75.93	60,744.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	3,300	43.70	144,210.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,130	183.91	207,818.30	
	WALMART DE MEXICO-SER V	16,800	54.93	922,824.00	
メキシコ・ペソ	小計	247,730		8,218,540.05 (46,106,010)	
ユーロ	FF GROUP	129	4.80	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,282	13.50	17,307.00	
	JUMBO SA	592	18.58	10,999.36	
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	250	21.84	5,460.00	
	OPAP SA	1,339	9.81	13,142.28	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	360	18.56	6,681.60	
ユーロ	小計	3,952		54,209.44 (6,522,479)	
韓国・ウォン	AMOREPACIFIC CORP	105	182,000.00	19,110,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	17	88,600.00	1,506,200.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	60	78,600.00	4,716,000.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	180,000.00	2,700,000.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	1,573	7,130.00	11,215,490.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	153	51,200.00	7,833,600.00	
	CELLTRION INC	277	183,500.00	50,829,500.00	
	CELLTRION PHARM INC	34	38,700.00	1,315,800.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	24,100.00	3,181,200.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	26	249,500.00	6,487,000.00	
	CJ CORP	130	92,500.00	12,025,000.00	
	CJ ENM CO LTD	28	150,700.00	4,219,600.00	
	CJ LOGISTICS	16	160,000.00	2,560,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	89	93,800.00	8,348,200.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	241	4,680.00	1,127,880.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	114	27,350.00	3,117,900.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	158	156,500.00	24,727,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	161	54,900.00	8,838,900.00	

DOOSAN BOBCAT INC	272	32,450.00	8,826,400.00	
E-MART CO LTD	63	132,000.00	8,316,000.00	
FILA KOREA LTD	150	57,800.00	8,670,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	188	32,200.00	6,053,600.00	
GS HOLDINGS CORP	318	50,100.00	15,931,800.00	
GS RETAIL CO LTD	52	40,000.00	2,080,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	969	36,400.00	35,271,600.00	
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	401	34,650.00	13,894,650.00	
HANMI PHARM CO LTD	21	329,500.00	6,919,500.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	25	39,550.00	988,750.00	
HANON SYSTEMS	960	11,000.00	10,560,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	221	18,750.00	4,143,750.00	
HANWHA CORPORATION	430	25,950.00	11,158,500.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	521	2,280.00	1,187,880.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	67	29,200.00	1,956,400.00	
HELIXMITH CO LTD	53	100,200.00	5,310,600.00	
HLB INC	69	136,300.00	9,404,700.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	99	81,700.00	8,088,300.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	26	79,400.00	2,064,400.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	207	44,400.00	9,190,800.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	59	151,500.00	8,938,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	31	340,000.00	10,540,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	123	27,850.00	3,425,550.00	
HYUNDAI MOBIS	218	257,000.00	56,026,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	476	125,000.00	59,500,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PRF	167	82,000.00	13,694,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD- PRF	45	74,900.00	3,370,500.00	
HYUNDAI STEEL CO	260	31,950.00	8,307,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	787	12,100.00	9,522,700.00	
KANGWON LAND INC	358	31,450.00	11,259,100.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	1,388	44,900.00	62,321,200.00	
KCC CORP	11	220,500.00	2,425,500.00	
KIA MOTORS CORPORATION	812	43,500.00	35,322,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	144	37,600.00	5,414,400.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	790	28,100.00	22,199,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	54	40,250.00	2,173,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	139	71,400.00	9,924,600.00	
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	101	116,000.00	11,716,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	26	424,000.00	11,024,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	87	26,300.00	2,288,100.00	
KT&G CORP	371	98,900.00	36,691,900.00	

KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	35	74,100.00	2,593,500.00	
LG CHEM LTD	147	317,500.00	46,672,500.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	15	175,500.00	2,632,500.00	
LG CORP	307	73,900.00	22,687,300.00	
LG DISPLAY CO LTD	707	14,500.00	10,251,500.00	
LG ELECTRONICS INC	323	71,900.00	23,223,700.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	36	1,215,000.00	43,740,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	4	749,000.00	2,996,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	28	119,500.00	3,346,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	926	12,550.00	11,621,300.00	
LG UPLUS CORP	341	14,000.00	4,774,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	45	223,000.00	10,035,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	57	36,700.00	2,091,900.00	
LOTTE SHOPPING CO	22	133,500.00	2,937,000.00	
MEDY-TOX INC	8	296,000.00	2,368,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,040	4,340.00	4,513,600.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	1,312	7,360.00	9,656,320.00	
NAVER CORP	427	170,500.00	72,803,500.00	
NCSOFT CORPORATION	56	561,000.00	31,416,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	87,800.00	5,092,400.00	
OCI CO LTD	32	64,300.00	2,057,600.00	
ORANGE LIFE INSURANCE, LTD.	65	28,700.00	1,865,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	43	108,500.00	4,665,500.00	
OTTOGI CORPORATION	2	564,000.00	1,128,000.00	
PEARL ABYSS CORP	13	187,500.00	2,437,500.00	
POSCO	252	225,500.00	56,826,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	74	48,250.00	3,570,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	69	19,300.00	1,331,700.00	
S-1 CORPORATION	32	96,200.00	3,078,400.00	
S-OIL CORPORATION	136	96,100.00	13,069,600.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	53	399,000.00	21,147,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	268	103,000.00	27,604,000.00	
SAMSUNG CARD CO	58	37,050.00	2,148,900.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	172	111,500.00	19,178,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	15,081	53,500.00	806,833,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	2,604	43,050.00	112,102,200.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	349	18,750.00	6,543,750.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	89	233,500.00	20,781,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1,171	6,870.00	8,044,770.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	225	73,500.00	16,537,500.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	177	242,500.00	42,922,500.00	

	SAMSUNG SDS CO LTD	113	201,500.00	22,769,500.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	372	35,700.00	13,280,400.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,435	43,750.00	62,781,250.00	
	SHINSEGAE CO LTD	14	267,500.00	3,745,000.00	
	SILLAJEN INC	181	18,850.00	3,411,850.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	112	272,500.00	30,520,000.00	
	SK HYNIX INC	1,728	85,300.00	147,398,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	174	158,500.00	27,579,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	62	245,500.00	15,221,000.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	417	4,345.00	1,811,865.00	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	158	91,200.00	14,409,600.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	1,534	12,200.00	18,714,800.00	
	YUHAN CORP	28	217,000.00	6,076,000.00	
韓国・ウォン 小計		48,075		2,587,005,055.00 (240,332,770)	
香港・ドル	3SBIO INC	4,000	12.42	49,680.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2,000	56.50	113,000.00	
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	4,000	11.20	44,800.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	90,000	3.26	293,400.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	7.22	72,200.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	10,000	8.16	81,600.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	40,000	1.31	52,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	2.34	56,160.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	2,600	2.62	6,812.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,000	49.35	197,400.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	4,000	76.90	307,600.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	3.53	14,120.00	
	BAIC MOTOR CORP LTD-H	4,000	4.75	19,000.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	256,000	3.25	832,000.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	29,000	5.28	153,120.00	
	BBMG CORPORATION - H	27,000	2.14	57,780.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	7.71	30,840.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,500	35.65	53,475.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	3.91	62,560.00	
	BOC AVIATION LTD	500	77.30	38,650.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.85	61,600.00	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	8,000	8.49	67,920.00	
	BYD CO LTD	2,000	38.00	76,000.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	1,000	15.36	15,360.00	
	CGN POWER CO LTD-H	34,000	2.00	68,000.00	

CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	23,000	3.07	70,610.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	4,000	11.04	44,160.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	1.66	46,480.00	
CHINA CITIC BANK	29,000	4.54	131,660.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	14,000	6.05	84,700.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	5.32	42,560.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	6,000	30.75	184,500.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	305,000	6.42	1,958,100.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	5,500	2.97	16,335.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,000	4.01	16,040.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	2,000	10.64	21,280.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	3.60	43,200.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	9,000	6.02	54,180.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	13.10	104,800.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	6,000	19.88	119,280.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	8,000	2.13	17,040.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4.17	47,955.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	5,200	33.45	173,940.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	6,500	4.38	28,470.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	21,000	1.17	24,570.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	4,000	14.32	57,280.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	18,000	5.57	100,260.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	23,000	20.95	481,850.00	
CHINA LITERATURE LTD	400	32.70	13,080.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	10,000	4.20	42,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	3,000	12.40	37,200.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	9,000	30.00	270,000.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	12,000	39.10	469,200.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	4,000	12.48	49,920.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	22,900	5.55	127,095.00	
CHINA MOBILE LTD/HK	19,500	62.20	1,212,900.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,000	2.54	15,240.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	12,000	7.18	86,160.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	4,000	10.80	43,200.00	

CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	12,000	26.50	318,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	8,600	29.50	253,700.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	78,000	4.45	347,100.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	14,000	21.30	298,200.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	10,000	1.64	16,400.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	9,000	4.71	42,390.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	4,000	4.35	17,400.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION-H	6,500	8.46	54,990.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	13,000	1.26	16,380.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	6,000	45.20	271,200.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	6,000	9.00	54,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	4,000	44.60	178,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	10,000	34.25	342,500.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	4,000	7.06	28,240.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	6,000	10.14	60,840.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	10,000	15.26	152,600.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	4,000	5.03	20,120.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	4,000	6.82	27,280.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	19.20	126,720.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	42,000	3.15	132,300.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	134,000	1.66	222,440.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.76	22,560.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	18,000	7.38	132,840.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	4,700	28.90	135,830.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	5,000	4.07	20,350.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	8,000	5.88	47,040.00	
CITIC LTD	19,000	10.26	194,940.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	7,000	15.22	106,540.00	
CNOOC LTD	57,000	12.02	685,140.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	6.58	39,480.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	28,000	11.18	313,040.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	3,000	27.50	82,500.00	
CRRC CORP LTD H	13,000	5.15	66,950.00	

DALI FOODS GROUP CO LTD	4,500	5.29	23,805.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	10,000	1.50	15,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	8,000	7.99	63,920.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2,400	86.00	206,400.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	7.00	49,000.00	
FOSUN INTERNATIONAL	13,000	10.92	141,960.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	23.25	74,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	15,000	15.46	231,900.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	2,000	18.76	37,520.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	8.58	41,184.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	20,000	0.70	14,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	6,500	6.30	40,950.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	6,000	9.05	54,300.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	8,000	16.94	135,520.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	9,600	8.52	81,792.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	3,200	13.02	41,664.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	1,400	12.20	17,080.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	2,000	35.00	70,000.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	22.20	111,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1,000	18.06	18,060.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	8.18	81,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	2,000	51.20	102,400.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1,000	13.90	13,900.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	3.67	51,380.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	8,000	2.99	23,920.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	12.36	66,744.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	207,000	5.80	1,200,600.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	10.60	21,200.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	2,000	9.14	18,280.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	7,000	3.36	23,520.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	2,000	22.75	45,500.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	9.25	23,125.00	

KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	7,000	8.42	58,940.00	
KINGSOFT CORP LTD	3,000	18.46	55,380.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	10,000	6.95	69,500.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	8.65	34,600.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	3,000	5.46	16,380.00	
LEGEND GROUP LTD	22,000	5.78	127,160.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	1,000	16.20	16,200.00	
LI NING CO LTD	6,000	26.05	156,300.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	4,000	12.32	49,280.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	5,500	32.70	179,850.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	2,500	6.47	16,175.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	6,000	2.78	16,680.00	
MEITU INC	2,500	1.64	4,100.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	3,200	96.00	307,200.00	
MMG LTD	4,000	1.73	6,920.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	2,200	32.00	70,400.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	2,000	7.17	14,340.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	7.90	23,700.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	3.24	74,520.00	
PETROCHINA CO LTD-H	64,000	3.72	238,080.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	23,000	9.68	222,640.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	17,500	92.35	1,616,125.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	26,000	5.21	135,460.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	4,000	8.39	33,560.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	9,500	10.18	96,710.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	4,000	10.08	40,320.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	4,000	2.45	9,800.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	3,000	23.60	70,800.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	1,000	14.38	14,380.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	14.36	38,772.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	5,500	16.80	92,400.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	8,000	3.11	24,880.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2,400	107.00	256,800.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	3,000	28.45	85,350.00	
SHUI ON LAND LTD	11,500	1.57	18,055.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	8,000	1.02	8,160.00	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	22,000	11.68	256,960.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	6,000	3.01	18,060.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	3,000	4.61	13,830.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	24,000	2.16	51,840.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	3,600	26.95	97,020.00	
SINOTRANS LTD	6,000	2.45	14,700.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	2,000	13.56	27,120.00	
SOHO CHINA LTD	4,500	2.84	12,780.00	
SSY GROUP LTD	4,000	6.44	25,760.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	5,500	9.00	49,500.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	8,000	37.30	298,400.00	
SUNNY OPTICAL TECH	2,500	129.80	324,500.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	18,000	336.60	6,058,800.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	6,000	12.22	73,320.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3,000	17.74	53,220.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	50.55	101,100.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	7.88	23,640.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	15,000	6.68	100,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	6,000	13.72	82,320.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	560	98.55	55,188.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,000	88.50	177,000.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	27,400	8.56	234,544.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,400	9.20	22,080.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	6,000	4.64	27,840.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	4,000	6.78	27,120.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1,000	50.40	50,400.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	16,000	1.68	26,880.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	13,000	3.61	46,930.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	3,500	8.31	29,085.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	7.21	14,420.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	700	25.75	18,025.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	1,000	27.90	27,900.00	
ZHUZHOU CRRc TIMES ELECTRIC-H	1,700	27.50	46,750.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	2.86	51,480.00	
ZTE CORP-H	2,800	22.20	62,160.00	
香港・ドル 小計	2,780,160		29,931,745.00 (415,452,621)	
台湾・ドル				
ACER INC	5,000	18.10	90,500.00	
ADVANTECH CO LTD	1,000	317.00	317,000.00	

AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	444.50	444,500.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	10,000	79.00	790,000.00	
ASIA CEMENT CORP	7,000	45.05	315,350.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	2,000	237.50	475,000.00	
AU OPTRONICS CORP	26,000	7.95	206,700.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	278.00	556,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	25,000	42.70	1,067,500.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	4,161	144.00	599,184.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	18,808	22.90	430,703.20	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	4,000	42.45	169,800.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	1,005	91.90	92,359.50	
CHINA AIRLINES LTD	4,000	9.09	36,360.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	37,000	9.92	367,040.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	5,300	25.70	136,210.00	
CHINA STEEL CORP	37,000	23.50	869,500.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	12,000	113.00	1,356,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	13,000	18.90	245,700.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	60,000	22.25	1,335,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	6,000	139.50	837,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	33,379	27.65	922,929.35	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	401.50	401,500.00	
EVA AIRWAYS CORP	3,243	14.15	45,888.45	
EVERGREEN MARINE	3,150	12.50	39,375.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	10,000	30.05	300,500.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	4,000	73.60	294,400.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,100	196.50	216,150.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	32,592	22.90	746,356.80	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	11,000	87.00	957,000.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	4,000	96.30	385,200.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	14,000	97.40	1,363,600.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	1,000	34.00	34,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	2,000	67.20	134,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	20,000	45.55	911,000.00	
GIANT MANUFACTURING	1,000	218.50	218,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	340.50	340,500.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	2,000	46.90	93,800.00	

HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,030	258.50	266,255.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	39,200	92.80	3,637,760.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	579.00	579,000.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	22,903	21.90	501,575.70	
INNOLUX CORPORATION	28,000	6.97	195,160.00	
INVENTEC CO LTD	8,000	23.25	186,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	7,000	50.40	352,800.00	
MEDIA TEK INC	5,000	421.00	2,105,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	35,000	30.70	1,074,500.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	2,000	85.70	171,400.00	
NAN YA PLASTICS CORP	17,000	71.90	1,222,300.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	4,000	71.20	284,800.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	282.50	282,500.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	2,000	219.00	438,000.00	
PEGATRON CORP	6,000	70.70	424,200.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	295.50	295,500.00	
POU CHEN	7,000	40.45	283,150.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	2,000	95.70	191,400.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	312.00	624,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	9,000	63.50	571,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	234.00	468,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,200	47.40	56,880.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	600	77.30	46,380.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	31,244	10.15	317,126.60	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	34,480	12.90	444,792.00	
STANDARD FOODS CORP	1,000	62.60	62,600.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	4,000	37.25	149,000.00	
TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	130.50	130,500.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	28,511	14.40	410,558.40	
TAIWAN BUSINESS BANK	8,736	12.50	109,200.00	
TAIWAN CEMENT	15,837	42.10	666,737.70	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	29,365	21.00	616,665.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	36.00	216,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	5,000	115.00	575,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	78,000	315.00	24,570,000.00	
TATUNG CO LTD	6,000	20.95	125,700.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	10,000	52.10	521,000.00	

	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	15,000	74.00	1,110,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	37,000	14.55	538,350.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	2,000	66.50	133,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	1,000	167.50	167,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	1,000	325.00	325,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	5,000	17.00	85,000.00	
	WISTRON CORP	9,146	29.25	267,520.50	
	WPG HOLDINGS LTD	2,760	38.30	105,708.00	
	YAGEO CORPORATION	1,000	323.50	323,500.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	30,000	19.85	595,500.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	1,000	140.00	140,000.00	
台湾・ドル	小計	993,750		65,106,525.20 (231,779,229)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	2,216	163.39	362,072.24	
	ANGLO PLATINUM LTD	240	1,212.00	290,880.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	1,292	291.54	376,669.68	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	961	122.36	117,587.96	
	BID CORP LTD	1,065	344.17	366,541.05	
	BIDVEST GROUP LTD	883	218.65	193,067.95	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	131	1,473.00	192,963.00	
	CLICKS GROUP LTD	796	257.98	205,352.08	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	1,109	130.36	144,569.24	
	EXXARO RESOURCES LTD	783	130.92	102,510.36	
	FIRSTRAND LTD	10,343	68.55	709,012.65	
	GOLD FIELDS LTD	3,120	80.43	250,941.60	
	INVESTEC LTD	921	84.98	78,266.58	
	KUMBA IRON ORE LTD	214	379.72	81,260.08	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	231	115.00	26,565.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	4,021	24.83	99,841.43	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	1,761	21.15	37,245.15	
	MR PRICE GROUP LTD	673	164.20	110,506.60	
	MTN GROUP LTD	5,409	96.40	521,427.60	
	MULTICHOICE GROUP LTD	1,332	124.87	166,326.84	
	NASPERS LTD-N SHS	1,897	2,248.02	4,264,493.94	
	NEDBANK GROUP LTD	1,237	238.76	295,346.12	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	1,158	126.93	146,984.94	
	NETWORK HEALTHCARE HOLDINGS	3,569	19.26	68,738.94	
	OLD MUTUAL LTD	15,106	19.97	301,666.82	
	PICK N PAY STORES LTD	671	70.41	47,245.11	
	PSG GROUP LTD	405	238.61	96,637.05	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,152	31.10	160,227.20	
	REINET INVESTMENTS SCA	328	291.77	95,700.56	
	REMGRO LTD	1,616	184.70	298,475.20	
	RMB HOLDINGS LTD	2,186	83.16	181,787.76	

SANLAM LIMITED	6,848	82.64	565,918.72	
SAPPI LIMITED	1,124	39.92	44,870.08	
SASOL LTD	1,791	285.00	510,435.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	1,476	136.51	201,488.76	
SPAR GROUP LIMITED/THE	596	210.85	125,666.60	
STANDARD BANK GROUP LTD	4,192	177.57	744,373.44	
TELKOM SA SOC LTD	465	52.63	24,472.95	
THE FOSCHINI GROUP LTD	712	161.00	114,632.00	
TIGER BRANDS LTD	508	235.79	119,781.32	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	891	53.45	47,623.95	
VODACOM GROUP LTD	2,030	130.27	264,448.10	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	2,935	58.73	172,372.55	
南アフリカ・ランド 小計	94,394		13,326,994.20 (97,953,407)	
合計	8,460,576		1,850,663,620 (1,850,663,620)	

## 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	10,846.00	191,355.97	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	15,100.00	456,171.00	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	9,704.00	133,527.04	
	アメリカ・ドル 小計		35,650.00	781,054.01 (84,830,276)	
投資信託受益証券 合計			84,830,276 (84,830,276)		
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8,900.00	266,466.00	
		メキシコ・ペソ 小計	8,900.00	266,466.00 (1,494,874)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-A	3,798.00	77,517.18	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	9,053.00	205,955.75	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	29,258.00	245,767.20	
南アフリカ・ランド 小計		42,109.00	529,240.13 (3,889,915)		
投資証券 合計			5,384,789 (5,384,789)		
合計			90,215,065 (90,215,065)		

- (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 投資信託 受益証券 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 54銘柄 投資信託 3銘柄 受益証券	11.32% -%	-% 3.93%	-% -%	16.98%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.05%	-%	-%	0.06%
インド・ルピー	株式 79銘柄	7.78%	-%	-%	8.66%
インドネシア・ルピア	株式 26銘柄	1.81%	-%	-%	2.01%
オフショア・人民元	株式 68銘柄	2.26%	-%	-%	2.52%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.36%	-%	-%	0.40%
タイ・バーツ	株式 36銘柄	2.41%	-%	-%	2.69%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.12%	-%	-%	0.13%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.73%	-%	-%	0.81%
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.51%	-%	-%	0.56%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	0.96%	-%	-%	1.07%
ブラジル・レアル	株式 56銘柄	6.40%	-%	-%	7.12%
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	0.86%	-%	-%	0.96%
マレーシア・リングgit	株式 43銘柄	1.76%	-%	-%	1.96%
メキシコ・ペソ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	2.13% -%	-% -%	-% 0.07%	2.45%
ユーロ	株式 6銘柄	0.30%	-%	-%	0.34%
韓国・ウォン	株式 113銘柄	11.12%	-%	-%	12.38%
香港・ドル	株式 195銘柄	19.23%	-%	-%	21.41%
台湾・ドル	株式 86銘柄	10.73%	-%	-%	11.94%
南アフリカ・ランド	株式 43銘柄 投資証券 3銘柄	4.53% -%	-% -%	-% 0.18%	5.25%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	12,770,048	4,513,004
金銭信託	998,162	78,080
コール・ローン	1,388,748	3,140,362
国債証券	966,387,788	1,121,414,233
未収入金	40,041	61,378
未収利息	13,352,115	13,320,720
前払費用	316,884	607,564
流動資産合計	995,253,786	1,143,135,341
資産合計	995,253,786	1,143,135,341
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,528	6,053
未払金	-	487
未払解約金	89,792	221,467
その他未払費用	42	18
流動負債合計	112,362	228,025
負債合計	112,362	228,025
純資産の部		
元本等		
元本	1,012,672,810	1,020,060,445
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	17,531,386	122,846,871
純資産合計	995,141,424	1,142,907,316
負債純資産合計	995,253,786	1,143,135,341

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 受益権総口数	1,012,672,810口	1,020,060,445口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	17,531,386円	
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9827円 (9,827円)	1.1204円 (11,204円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年2月13日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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11月20日現在	2019年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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11月20日現在	2019年11月20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	91,377,247	116,529,413
合計	91,377,247	116,529,413

(デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2018年11月20日 現在			2019年11月20日 現在			時価 (円)	評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	2,093,042	-	2,070,514	22,528	2,955,871	-	2,949,818	6,053
アメリカ カ・ドル	2,093,042	-	2,070,514	22,528	2,955,871	-	2,949,818	6,053
合計	2,093,042	-	2,070,514	22,528	2,955,871	-	2,949,818	6,053

(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11月20日現在	2019年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	999,909,334円	1,012,672,810円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	20,717,858円	24,980,838円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	7,954,382円	17,593,203円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	997,054,316円	993,388,880円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	15,618,494円	26,671,565円
計	1,012,672,810円	1,020,060,445円

附属明細表（2019年11月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	CROATIA 6 2024/01/26	240,000.00	275,544.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 4.25 2025/01/07	200,000.00	211,470.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 4.625 2028/01/13	200,000.00	212,002.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.625 2041/01/07	100,000.00	109,376.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.625 2047/02/21	200,000.00	218,502.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 6 2026/04/07	200,000.00	231,316.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 7.125 2037/01/20	100,000.00	126,001.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 8.25 2034/01/20	100,000.00	136,126.00	
		HUNGARY 5.375 2023/02/21	60,000.00	65,445.00	
		HUNGARY 5.375 2024/03/25	70,000.00	78,407.00	
		HUNGARY 5.75 2023/11/22	130,000.00	146,022.50	
		HUNGARY 6.375 2021/03/29	80,000.00	84,609.60	
		HUNGARY 7.625 2041/03/29	50,000.00	80,750.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 3.875 2027/04/25	200,000.00	210,000.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 4 2024/02/26	200,000.00	209,640.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA 5 2045/06/15	200,000.00	226,800.00	

REPUBLIC OF COLOMBIA 6.125 2041/01/18	100,000.00	126,126.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 7.375 2037/09/18	200,000.00	277,752.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 8.125 2024/05/21	30,000.00	36,712.80	
REPUBLIC OF INDONESIA 4.35 2048/01/11	200,000.00	217,710.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 4.75 2026/01/08	200,000.00	220,928.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 4.875 2021/05/05	200,000.00	207,202.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 5.25 2047/01/08	250,000.00	303,360.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 5.875 2024/01/15	200,000.00	225,142.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 7.75 2038/01/17	200,000.00	296,212.00	
REPUBLIC OF PANAMA 3.875 2028/03/17	200,000.00	216,502.00	
REPUBLIC OF PANAMA 6.7 2036/01/26	200,000.00	278,002.00	
REPUBLIC OF PERU 4.125 2027/08/25	110,000.00	122,513.60	
REPUBLIC OF PERU 5.625 2050/11/18	110,000.00	158,401.10	
REPUBLIC OF PERU 6.55 2037/03/14	40,000.00	57,840.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 3 2028/02/01	200,000.00	207,230.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 3.7 2042/02/02	200,000.00	224,280.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 6.375 2032/01/15	100,000.00	134,481.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 6.375 2034/10/23	100,000.00	140,450.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 7.75 2031/01/14	100,000.00	146,912.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 9.5 2030/02/02	70,000.00	110,631.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.3 2028/10/12	200,000.00	194,000.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.665 2024/01/17	110,000.00	114,539.70	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5 2046/10/12	200,000.00	182,380.00	
ROMANIA 4.375 2023/08/22	50,000.00	52,975.00	
ROMANIA 4.875 2024/01/22	30,000.00	32,660.70	
ROMANIA 5.125 2048/06/15	50,000.00	56,178.50	
ROMANIA 6.125 2044/01/22	30,000.00	38,102.40	
ROMANIA 6.75 2022/02/07	70,000.00	76,241.20	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 2027/06/23	200,000.00	215,650.00	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 2026/05/27	200,000.00	221,008.00	

	RUSSIAN FEDERATION 4.875 2023/09/16	200,000.00	219,118.00	
	RUSSIAN FEDERATION 5.1 2035/03/28	200,000.00	230,518.00	
	RUSSIAN FEDERATION 5.25 2047/06/23	400,000.00	482,000.00	
	RUSSIAN FEDERATION 7.5 2030/03/31	100,500.00	114,763.96	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 2025/01/30	200,000.00	208,520.00	
	UNITED MEXICAN STATES 4 2023/10/02	210,000.00	221,732.70	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 2027/03/28	200,000.00	212,502.00	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 2046/01/23	200,000.00	210,252.00	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 2048/02/10	200,000.00	212,002.00	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 2044/03/08	200,000.00	214,500.00	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 2045/01/21	100,000.00	120,001.00	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 2110/10/12	90,000.00	102,600.90	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 2040/01/11	100,000.00	127,126.00	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 2034/09/27	100,000.00	135,376.00	
	アメリカ・ドル 小計	8,980,500.00	10,325,147.16 (1,121,414,233)	
国債証券 合計			1,121,414,233 (1,121,414,233)	
合計			1,121,414,233 (1,121,414,233)	

(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 60銘柄	98.12%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年11月21日から2020年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2019年11月20日現在)	第3期中間計算期間 (2020年5月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,373	7,344
コール・ローン	175,878	204,225
親投資信託受益証券	240,301,163	252,689,957
未収入金	1,315,198	3,138,009
流動資産合計	241,796,612	256,039,535
資産合計		
	241,796,612	256,039,535
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,307,255	3,129,679
未払受託者報酬	23,645	27,617
未払委託者報酬	164,593	192,184
その他未払費用	1,109	1,303
流動負債合計	1,496,602	3,350,783
負債合計		
	1,496,602	3,350,783
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	213,601,862	249,622,610
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	26,698,148	3,066,142
純資産合計	240,300,010	252,688,752
負債純資産合計	241,796,612	256,039,535

## (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11月21日 至2019年5月20日)	第3期中間計算期間 (自2019年11月21日 至2020年5月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	5,948,410	26,249,556
営業収益合計	5,948,410	26,249,556
営業費用		
支払利息	7	-
受託者報酬	16,679	27,617
委託者報酬	116,204	192,184
その他費用	737	1,303
営業費用合計	133,627	221,104
営業利益又は営業損失( )	5,814,783	26,470,660
経常利益又は経常損失( )	5,814,783	26,470,660
中間純利益又は中間純損失( )	5,814,783	26,470,660
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( )	453,603	2,985,758
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,010,563	26,698,148
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,008,964	7,192,636
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	3,008,964	7,192,636
剰余金減少額又は欠損金増加額	467,094	7,339,740
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	467,094	7,339,740
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( )	9,913,613	3,066,142

## (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11月20日現在	第3期中間計算期間 2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	213,601,862口	249,622,610口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1250円 (11,250円)	1.0123円 (10,123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11月20日現在	第3期中間計算期間 2020年5月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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ぬ。
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)

## 元本額の変動

項目	第2期	第3期中間計算期間
	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
期首元本額	121,367,121円	213,601,862円
期中追加設定元本額	186,191,794円	95,098,650円
期中一部解約元本額	93,957,053円	59,077,902円

## &lt;参考&gt;

開示対象ファンド（＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型））は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	26,133,173	152,201,358
コール・ローン	1,051,065,921	4,232,362,288
株式	66,020,728,200	124,423,567,490
派生商品評価勘定	32,833,040	396,977,150
未収配当金	614,918,502	1,454,120,313
差入委託証拠金	44,640,000	243,810,000
流動資産合計	67,790,318,836	130,903,038,599
資産合計	67,790,318,836	130,903,038,599
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,164,100	-
前受金	29,905,000	397,190,000
未払解約金	222,978,912	370,460,174
その他未払費用	6,068	3,732
流動負債合計	260,054,080	767,653,906
負債合計	260,054,080	767,653,906
純資産の部		
元本等		
元本	37,206,074,017	80,014,868,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,324,190,739	50,120,516,635
純資産合計	67,530,264,756	130,135,384,693
負債純資産合計	67,790,318,836	130,903,038,599

## 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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	37,206,074,017口	80,014,868,058口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8150円 (18,150円)	1.6264円 (16,264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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （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
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。 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

## （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11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	1,547,375,000	-	1,573,095,000	25,720,000	5,371,045,000	-	5,768,235,000	397,190,000
合計	1,547,375,000	-	1,573,095,000	25,720,000	5,371,045,000	-	5,768,235,000	397,190,000

(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11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	33,015,590,469円	37,206,074,017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	14,648,507,258円	51,125,057,736円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,458,023,710円	8,316,263,695円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,469,503,110円	6,333,985,133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)	4,561,011,771円	4,243,726,774円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,059,132円	4,240,978円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,460,555,576円	1,761,683,680円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,163,139,062円	5,889,555,637円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,451,105,833円	3,837,231,844円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	8,469,605円	7,101,736円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	37,232,083円	34,365,182円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	44,296,788円	35,696,818円
DCニッセイ国内株式インデックス	313,570,047円	354,434,874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	14,584,098,618円	16,688,459,649円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	626,761,958円	884,556,811円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	83,670,627円	107,772,774円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	75,262,010円	110,259,811円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	55,166,663円	82,536,182円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	111,903,417円	148,124,366円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,041,324円	38,794,733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)	41,445,869円	57,072,696円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	25,474,150円	6,408,096円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,591,265円	4,895,220円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,026,689円	1,371,803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)	2,865,527円	4,435,277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)	16,706,927円	20,069,847円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,863,187円	13,212,462円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,563,574円	10,688,709円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	9,335,459円	19,565,516円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	10,353,746円	17,140,015円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	-円	39,297,481,435円
計	37,206,074,017円	80,014,868,058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11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17,896,530	24,147,888
コール・ローン	719,791,373	671,496,056
国債証券	57,768,627,800	59,480,236,920
地方債証券	7,218,000,954	7,192,891,115
特殊債券	8,348,131,578	8,226,371,926
社債券	5,745,638,100	5,711,394,000
未収利息	185,554,319	186,272,897
前払費用	1,594,822	4,562,884
流動資産合計	80,005,235,476	81,497,373,686
資産合計	80,005,235,476	81,497,373,686
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,369,510	6,842,182
その他未払費用	3,824	602
流動負債合計	5,373,334	6,842,784
負債合計	5,373,334	6,842,784
純資産の部		
元本等		
元本	80,458,265,938	82,538,536,672
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	458,403,796	1,048,005,770
純資産合計	79,999,862,142	81,490,530,902
負債純資産合計	80,005,235,476	81,497,373,686

## 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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	80,458,265,938口	82,538,536,672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	458,403,796円	1,048,005,770円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9943円 (9,943円)	0.9873円 (9,873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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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)

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11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	91,553,091,806円	80,458,265,938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	7,229,627,282円	4,520,152,946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	18,324,453,150円	2,439,882,212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)	76,296,408,816円	77,502,678,202円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,851,878,712円	2,094,008,484円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	34,686,709円	40,233,292円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,648,815,407円	2,079,752,346円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	34,894,519円	46,593,052円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	117,890,150円	146,623,580円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	300,648,162円	399,151,645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)	75,145,871円	89,324,308円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リー ト/債券)	4,591,102円	5,400,163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)	24,364,655円	32,542,002円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド(8資産均等型)	29,860,218円	31,599,634円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	1,990,783円	3,878,492円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,897,961円	4,993,515円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,036,801円	13,166,151円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	27,156,072円	48,591,806円
計	80,458,265,938円	82,538,536,672円

## 「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,671,023	9,661,482
コール・ローン	952,039,197	268,663,120
投資証券	31,416,451,100	22,182,278,890
未収入金	30,846,954	-
未収配当金	148,501,553	194,085,395
流動資産合計	32,571,509,827	22,654,688,887
資産合計	32,571,509,827	22,654,688,887
負債の部		
流動負債		
未払金	524,172,847	-
未払解約金	247,460,838	97,386,213
その他未払費用	5,218	278
流動負債合計	771,638,903	97,386,491
負債合計	771,638,903	97,386,491
純資産の部		
元本等		
元本	16,398,065,583	15,699,844,890
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	15,401,805,341	6,857,457,506
純資産合計	31,799,870,924	22,557,302,396
負債純資産合計	32,571,509,827	22,654,688,887

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	16,398,065,583口	15,699,844,890口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9392円 (19,392円)	1.4368円 (14,368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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,518,929,567円	16,398,065,583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	12,025,469,621円	6,475,095,131円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	7,146,333,605円	7,173,315,824円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,589,859,033円	1,432,873,480円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,501,629,877円	1,341,958,109円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	8,117,494,358円	7,692,339,726円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,858,643,446円	1,828,411,691円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,484,924,690円	2,422,235,045円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	785,204,355円	884,389,177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)	38,195,777円	63,304,567円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,282,914円	5,458,221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)	938,090円	1,529,592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)	2,642,646円	4,957,250円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	15,250,397円	22,388,032円
計	16,398,065,583円	15,699,844,890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11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	785,869,477	766,947,152
金銭信託	98,970,113	65,565,020
コール・ローン	3,980,538,915	1,823,209,221
株式	199,297,460,924	216,512,580,974
投資証券	5,434,364,911	5,370,691,754
派生商品評価勘定	212,899,978	137,337,523
未収入金	48,299,571	6,309,110
未収配当金	290,269,135	304,874,042
差入委託証拠金	1,858,544,563	3,379,556,946
流動資産合計	212,007,217,587	228,367,071,742
資産合計	212,007,217,587	228,367,071,742
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,913,084	55,969,410
未払金	3,148,485	472,421
未払解約金	951,945,848	631,858,645
その他未払費用	23,905	2,794
流動負債合計	964,031,322	688,303,270
負債合計	964,031,322	688,303,270
純資産の部		
元本等		
元本	110,982,930,759	131,943,832,341
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,060,255,506	95,734,936,131
純資産合計	211,043,186,265	227,678,768,472
負債純資産合計	212,007,217,587	228,367,071,742

## 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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	110,982,930,759口	131,943,832,341口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9016円 (19,016円)	1.7256円 (17,256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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	280,684,290	-	281,182,580	498,290	3,853,936,770	-	3,901,707,750	47,770,980
アメリカ・ ドル	210,740,750	-	210,896,350	155,600	2,898,712,023	-	2,928,788,480	30,076,457
イギリス・ ポンド	21,234,187	-	21,311,920	77,733	280,740,732	-	284,219,860	3,479,128
ユーロ	48,709,353	-	48,974,310	264,957	674,484,015	-	688,699,410	14,215,395
買 建	3,217,946,194	-	3,211,968,970	5,977,224	4,875,931,329	-	4,910,067,130	34,135,801
アメリカ・ ドル	2,243,779,726	-	2,236,585,610	7,194,116	3,451,492,950	-	3,468,546,410	17,053,460
イギリス・ ポンド	266,133,660	-	266,399,000	265,340	441,518,005	-	442,546,340	1,028,335
ユーロ	708,032,808	-	708,984,360	951,552	982,920,374	-	998,974,380	16,054,006
合計	3,498,630,484	-	3,493,151,550	6,475,514	8,729,868,099	-	8,811,774,880	13,635,179

## (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11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,816,144,283	-	6,026,606,691	210,462,408	5,141,139,267	-	5,236,142,560	95,003,293
合計	5,816,144,283	-	6,026,606,691	210,462,408	5,141,139,267	-	5,236,142,560	95,003,293

## (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11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	88,596,175,879円	110,982,930,759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	43,121,658,246円	37,212,252,880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	20,734,903,366円	16,251,351,298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)	705,419,292円	804,860,629円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,284,755,401円	3,582,008,125円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,471,314,789円	2,630,576,326円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	1,485,332,737円	1,609,087,161円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	4,090,937円	3,247,159円
ニッセイインデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	23,976,047円	20,950,179円
ニッセイインデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	32,048,288円	24,567,720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)	11,371,888,952円	11,144,597,263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	75,325,693,121円	92,669,132,645円
D Cニッセイ外国株式インデックス	15,291,138,731円	17,902,532,429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)	605,358,530円	809,422,048円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	59,931,201円	73,226,608円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	72,703,499円	100,785,073円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	39,305,684円	55,945,101円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	79,667,845円	100,200,023円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	22,747,558円	23,628,520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)	40,031,114円	52,233,322円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,696,756円	5,867,305円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,481,454円	4,488,130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)	995,057円	1,255,550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)	16,196,854円	18,365,013円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	4,212,091円	9,018,482円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	3,974,678円	7,267,377円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	6,685,873円	13,266,947円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	7,284,270円	11,401,595円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	-円	265,901,611円
計	110,982,930,759円	131,943,832,341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11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	111,069,596	86,240,710
金銭信託	2,091,577	2,930,181
コール・ローン	84,122,383	81,481,449
国債証券	24,640,272,641	26,620,966,279
派生商品評価勘定	1,123	377,337
未収入金	737,601	-
未収利息	139,580,909	147,815,389
前払費用	12,891,736	16,425,576
流動資産合計	24,990,767,566	26,956,236,921
資産合計	24,990,767,566	26,956,236,921
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	78,201	-
未払金	72,688,119	45,482,242
未払解約金	45,922,806	27,651,884
その他未払費用	733	273
流動負債合計	118,689,859	73,134,399
負債合計	118,689,859	73,134,399
純資産の部		
元本等		
元本	18,019,497,917	19,013,517,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,852,579,790	7,869,584,698
純資産合計	24,872,077,707	26,883,102,522
負債純資産合計	24,990,767,566	26,956,236,921

## 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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	18,019,497,917口	19,013,517,824口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3803円 (13,803円)	1.4139円 (14,139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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	54,671,804	-	54,594,726	77,078	52,126,451	-	52,503,788	377,337
アメリカ・ドル	39,192,886	-	39,118,884	74,002	42,963,959	-	43,264,570	300,611
イギリス・ポンド	1,456,184	-	1,456,288	104	2,262,397	-	2,285,246	22,849
オーストラリア・ドル	3,221,592	-	3,221,852	260	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	1,885,873	-	1,885,371	502	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	1,886,204	-	1,882,507	3,697	-	-	-	-
ユーロ	7,029,065	-	7,029,824	759	6,900,095	-	6,953,972	53,877
合計	54,671,804	-	54,594,726	77,078	52,126,451	-	52,503,788	377,337

## (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11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	13,426,526,479円	18,019,497,917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	7,559,583,314円	4,502,247,569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	2,966,611,876円	3,508,227,662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)	1,913,723,452円	1,939,618,277円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,342,592,527円	3,238,337,679円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,117,994,429円	1,057,371,471円
ニッセイ外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定)	695,278,547円	711,237,738円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	5,548,187円	3,913,879円
ニッセイインデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	16,265,029円	12,626,110円
ニッセイインデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	15,522,663円	10,576,160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	8,537,605,753円	9,233,650,815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)	821,539,249円	975,663,058円
D Cニッセイ外国債券インデックス	870,914,843円	1,005,534,486円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	28,348,797円	30,587,893円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	492,962,365円	606,930,143円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	18,637,530円	23,631,617円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	38,575,285円	42,986,751円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	14,055,660円	14,232,959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)	54,322,993円	62,991,692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)	3,312,314円	3,783,585円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	21,545,383円	22,139,543円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	1,986,946円	3,775,330円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	1,882,158円	3,065,894円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	3,194,198円	5,609,153円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	3,689,609円	5,253,591円
計	18,019,497,917円	19,013,517,824円

## 「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	10,428,921	5,010,837
金銭信託	2,397,162	1,750,994
コール・ローン	96,412,913	48,691,027
投資証券	2,413,971,912	1,905,474,364
未収入金	104,316	156,780
未収配当金	4,487,833	4,089,371
流動資産合計	2,527,803,057	1,965,173,373
資産合計	2,527,803,057	1,965,173,373
負債の部		
流動負債		
未払解約金	56,919,231	3,224,851
その他未払費用	325	47
流動負債合計	56,919,556	3,224,898
負債合計	56,919,556	3,224,898
純資産の部		
元本等		
元本	2,138,126,735	2,322,620,718
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	332,756,766	360,672,243
純資産合計	2,470,883,501	1,961,948,475
負債純資産合計	2,527,803,057	1,965,173,373

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	2,138,126,735口	2,322,620,718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		360,672,243円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1556円 (11,556円)	0.8447円 (8,447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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,958,293,015円	2,138,126,735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	322,424,011円	319,759,905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	142,590,291円	135,265,922円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ先進国リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,859,238,576円	1,855,884,298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)	64,798,652円	100,214,978円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	5,538,910円	8,631,380円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,584,230円	2,409,891円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	25,749,136円	35,217,272円
DCニッセイ先進国リートインデックス	181,217,231円	320,262,899円
計	2,138,126,735円	2,322,620,718円

## 「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	71,199,703	25,970,141
金銭信託	2,081,042	5,767,307
コール・ローン	83,698,699	160,375,263
株式	1,850,663,620	1,706,742,792
投資信託受益証券	84,830,276	77,833,811
投資証券	5,384,789	1,875,411
派生商品評価勘定	5,466,152	28,289,842
未収入金	1,096,470	13,908
未収配当金	1,291,471	1,669,841
差入委託証拠金	69,546,063	80,272,350
流動資産合計	2,175,258,285	2,088,810,666
資産合計	2,175,258,285	2,088,810,666
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	409,423	129,036
未払金	17,248	-
未払解約金	14,311,923	2,285,826
その他未払費用	658	155
流動負債合計	14,739,252	2,415,017
負債合計	14,739,252	2,415,017
純資産の部		
元本等		
元本	2,309,692,542	2,542,798,163
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	149,173,509	456,402,514
純資産合計	2,160,519,033	2,086,395,649
負債純資産合計	2,175,258,285	2,088,810,666

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	2,309,692,542口	2,542,798,163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	149,173,509円	456,402,514円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9354円 (9,354円)	0.8205円 (8,205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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	36,863,086	-	36,870,106	7,020	-	-	-	-
アメリカ・ ドル	36,859,164	-	36,866,200	7,036	-	-	-	-
ブラジル・ レアル	3,922	-	3,906	16	-	-	-	-
買 建	74,649,899	-	74,386,870	263,029	161,672,689	-	162,434,650	761,961
アメリカ・ ドル	74,649,899	-	74,386,870	263,029	161,672,689	-	162,434,650	761,961
合計	111,512,985	-	111,256,976	270,049	161,672,689	-	162,434,650	761,961

## (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11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	178,059,035	-	183,385,812	5,326,777	270,042,862	-	297,441,708	27,398,846
合計	178,059,035	-	183,385,812	5,326,777	270,042,862	-	297,441,708	27,398,846

## (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11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,844,866,571円	2,309,692,542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	1,061,417,332円	793,374,822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	596,591,361円	560,269,201円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	787,226,995円	602,829,822円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	1,413,724,632円	1,842,033,125円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	49,901,389円	12,355,399円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	7,015,043円	9,428,173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)	2,005,205円	2,635,809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)	32,645,881円	38,543,312円
DCニッセイ新興国株式インデックス	17,173,397円	34,972,523円
計	2,309,692,542円	2,542,798,163円

## 「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,513,004	8,355,748
金銭信託	78,080	164,309
コール・ローン	3,140,362	4,569,038
国債証券	1,121,414,233	1,109,791,454
派生商品評価勘定	-	25,703
未収入金	61,378	-
未収利息	13,320,720	13,061,958
前払費用	607,564	618,545
流動資産合計	1,143,135,341	1,136,586,755
資産合計	1,143,135,341	1,136,586,755
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,053	-
未払金	487	-
未払解約金	221,467	447,280
その他未払費用	18	1
流動負債合計	228,025	447,281
負債合計	228,025	447,281
純資産の部		
元本等		
元本	1,020,060,445	1,020,571,564
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	122,846,871	115,567,910
純資産合計	1,142,907,316	1,136,139,474
負債純資産合計	1,143,135,341	1,136,586,755

## 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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 受益権総口数	1,020,060,445口	1,020,571,564口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1204円 (11,204円)	1.1132円 (11,132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11月20日現在	2020年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （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
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。 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

## （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11月20日 現在				2020年5月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	2,955,871	-	2,949,818	6,053	3,866,022	-	3,891,725	25,703
アメリカ・ ドル	2,955,871	-	2,949,818	6,053	3,866,022	-	3,891,725	25,703
合計	2,955,871	-	2,949,818	6,053	3,866,022	-	3,891,725	25,703

## （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11月20日現在	2020年5月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,012,672,810円	1,020,060,445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	24,980,838円	13,334,676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	17,593,203円	12,823,557円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	993,388,880円	991,541,439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）	26,671,565円	29,030,125円
計	1,020,060,445円	1,020,571,564円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

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

(2020年5月29日現在)

資産総額	261,589,499円
負債総額	80,756円
純資産総額( - )	261,508,743円
発行済数量	251,148,969口
1口当たり純資産額( / )	1.0412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

2020年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年5月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	400	63,097
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	127	26,378
単位型公社債投資信託	0	0
合計	527	89,476

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25期事業年度（自2019年4月1日 至 2020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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		18,401,863		28,674,230
有価証券		8,008,550		6,301,326
前払費用		608,442		546,666
未収委託者報酬		4,705,229		4,882,250
未収運用受託報酬		1,911,554		2,039,974
未収投資助言報酬		168,445		174,892
その他		31,744		50,572
流動資産合計		33,835,830		42,669,914
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	72,641	1	98,471
車両	1	3,268	1	2,180
器具備品	1	95,277	1	142,866
有形固定資産合計		171,187		243,517
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		968,052		969,528
ソフトウェア仮勘定		24,478		216,033
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,000,545		1,193,575
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		36,902,679		33,634,499
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		167,886		-
差入保証金		293,513		303,875
繰延税金資産		1,066,925		1,292,446
その他		87,940		17,821
投資その他の資産合計		38,585,168		35,314,867
固定資産合計		39,756,901		36,751,960
資産合計		73,592,732		79,421,875

## 負債の部

## 流動負債

預り金	65,641	45,856
未払収益分配金	6,368	5,643
未払手数料	1,736,084	1,633,415
未払運用委託報酬	702,648	810,981
未払投資助言報酬	723,039	852,782
その他未払金	461,392	3,591,122
未払費用	113,233	146,706
未払法人税等	1,996,248	686,983
賞与引当金	853,083	975,373
その他	289,152	544,366
流動負債合計	6,946,893	9,293,232

## 固定負債

退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
役員退職慰労引当金	22,500	22,700
固定負債合計	1,824,248	1,973,446

## 負債合計

負債合計	8,771,142	11,266,679
------	-----------	------------

## 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	45,192,421	48,745,315
利益剰余金合計	45,872,228	49,425,122
株主資本合計	64,154,068	67,706,962

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	711,399	512,183
繰延ヘッジ損益	43,878	63,949
評価・換算差額等合計	667,521	448,234

## 純資産合計

純資産合計	64,821,590	68,155,196
-------	------------	------------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計	73,592,732	79,421,875
----------	------------	------------

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,471,631	27,088,982
運用受託報酬	11,784,292	13,165,624
投資助言報酬	610,372	677,248
その他営業収益	16,907	2,000
営業収益計	38,883,204	40,933,856
営業費用		
支払手数料	11,518,158	11,090,478
広告宣伝費	23,965	25,032
公告費	130	-
調査費	5,954,296	6,466,222
支払運用委託報酬	1,695,119	1,866,932
支払投資助言報酬	3,019,717	3,238,306
委託調査費	106,467	125,262
調査費	1,132,991	1,235,721
委託計算費	229,936	249,653
営業雑経費	812,655	929,200
通信費	49,932	47,749
印刷費	190,576	189,820
協会費	34,445	38,958
その他営業雑経費	537,701	652,672
営業費用計	18,539,142	18,760,587
一般管理費		
役員報酬	137,828	142,108
給料・手当	3,685,286	3,934,995
賞与引当金繰入額	851,086	974,031
賞与	279,376	285,503
福利厚生費	710,135	762,163
退職給付費用	311,969	307,637
役員退職慰労引当金繰入額	8,350	7,000
役員退職慰労金	150	30
その他人件費	151,765	172,763
不動産賃借料	673,220	682,105
その他不動産経費	30,378	31,283
交際費	29,832	28,014
旅費交通費	209,373	170,993
固定資産減価償却費	405,606	442,697
租税公課	325,740	341,195
業務委託費	261,111	291,579
器具備品費	332,440	354,221
保険料	52,393	46,549
諸経費	189,822	225,408
一般管理費計	8,645,865	9,200,283
営業利益	11,698,196	12,972,984
営業外収益		
受取利息	573	1,176
有価証券利息	24,008	12,651
受取配当金	124,674	200,028

金融派生商品収益	35,286		14,042
為替差益	22,977		-
その他営業外収益	14,395		13,606
営業外収益計	221,915		241,504
営業外費用			
為替差損	-		27,288
金融派生商品費用	20,127		9,593
控除対象外消費税	17,501		5,453
その他営業外費用	1,080		8,493
営業外費用計	38,709		50,829
経常利益	11,881,403		13,163,659
特別利益			
投資有価証券売却益	655,395		4,459
投資有価証券償還益	46,876		1,744
特別利益計	702,272		6,204
特別損失			
投資有価証券売却損	81,265		72,045
投資有価証券償還損	68,047		4,115
固定資産除却損	1	1,089	1
事故損失賠償金	2	511	2
特別損失計	150,913		88,934
税引前当期純利益	12,432,761		13,080,929
法人税、住民税及び事業税	3,862,523		4,134,957
法人税等調整額	43,320		106,970
法人税等合計	3,905,844		4,027,986
当期純利益	8,526,917		9,052,942

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020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	45,192,421	45,872,228	64,154,068	
当期変動額											
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,500,048	5,500,048	5,500,048	
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	9,052,942	9,052,942	9,052,942	
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,552,893	3,552,893	3,552,893	
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962	

	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	711,399	43,878	667,521	64,821,590
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
当期純利益	-	-	-	9,052,942
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	199,216	20,071	219,287	219,287
当期変動額合計	199,216	20,071	219,287	3,333,606
当期末残高	512,183	63,949	448,234	68,155,196

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020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3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5．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	日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日 企業会計基準委員会 実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

（会計上の見積りの変更）

（退職給付債務の計算方法に係る見積りの変更）

年俸制適用者について、退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法へ変更しております。この変更は、従業員数が増加したことに伴い、退職給付債務の金額の算定の精度を高め、退職給付費用の期間損益計算を適正化するために行ったものであります。

この変更に伴い、当事業年度末における退職給付引当金が54,100千円減少し、同額を一般管理費の退職給付費用より減額しております。

（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 2020年3月31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 2020年3月31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日以後開始する事業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。

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

#### (1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてはほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまでわが国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

#### (2) 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物附属設備	325,809千円	310,385千円
車両	3,460	4,549
器具備品	474,339	394,258
計	803,609	709,193

## （損益計算書関係）

1．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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
建物附属設備	- 千円	4,181千円
器具備品	623	4,240
ソフトウェア	465	-
計	1,089	8,422

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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	-

当事業年度(自2019年4月1日 至2020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

2019年6月28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	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	50,716円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28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

2020年6月29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	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	50,716円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月29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(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 示しております。

当事業年度(2020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	28,674,230	28,674,230	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	-
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	10,218	10,218	-

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

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
関係会社株式	66,222	66,222

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、記載していません。

(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(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。

当事業年度(2020年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	28,674,230	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,300,000	11,550,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	6,148,442	12,928,752	2,006,497	-
合計	41,122,673	24,478,752	2,006,497	-

(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(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

当事業年度(2020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	11,798,934	11,806,740	7,805
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	11,798,934	11,806,740	7,805
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	6,049,621	6,047,560	2,061
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,049,621	6,047,560	2,061
合計		17,848,556	17,854,300	5,743

## 2. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2020年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等			
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	14,350,630	13,532,359	818,270
	小計	14,350,630	13,532,359	818,270
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）	7,736,640	8,140,850	404,209
	小計	7,736,640	8,140,850	404,209
	合計	22,087,270	21,673,209	414,060

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,650,233	4,459	72,045
合計	1,650,233	4,459	72,045

## (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(2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度(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。

当事業年度(2020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	1,860,993	-	10,218
合計			1,860,993	-	10,218

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職及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、従来まで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したが、対象従業員が300人を超えたため、当事業年度末より原則法に変更しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表(簡便法を適用した制度を除く)

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	- 千円	- 千円
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	1,887,492
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	-	54,100
退職給付債務の期末残高	-	1,833,391

## (2) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,682,532 千円	1,801,748 千円
退職給付費用	229,805	274,595
退職給付の支払額	110,589	71,495
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	1,887,492
退職給付引当金の期末残高	1,801,748	117,355

## (3) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,801,748 千円	1,950,746 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,801,748	1,950,746
退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,801,748	1,950,746

## ( 4 ) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	229,805 千円	274,595 千円
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	-	54,100
確定給付制度に係る退職給付費用	229,805	220,494

## ( 5 ) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
割引率	- %	0.32 %

## 3 . 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において58,788千円、当事業年度において62,535千円であり、退職給付費用に計上しております。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	261,214 千円	298,659 千円
未払事業税	119,420	130,502
退職給付引当金	551,695	597,318
税務上の繰延資産償却超過額	6,126	4,337
役員退職慰労引当金	6,889	6,950
投資有価証券評価差額	88,160	254,174
その他	62,896	82,112
小計	1,096,402	1,374,055
評価性引当額	9	19
繰延税金資産合計	1,096,393	1,374,036
繰延税金負債		
特別分配金否認	5,022	3,682
投資有価証券評価差額	24,444	77,906
繰延税金負債合計	29,467	81,589
繰延税金資産(は負債)の純額	1,066,925	1,292,446

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。

当事業年度（自2019年4月1日 至2020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

当事業年度(自2019年4月1日 至2020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	3,360,908	未収運用受託報酬	802,463
								投資助言報酬の受取	130,557	未収投資助言報酬	11,984
								連結納税	3,123,434	その他未払金	3,123,434

(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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	597,720円47銭	628,459円68銭
1株当たり当期純利益金額	78,626円78銭	83,477円26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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
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

2020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

2020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：2020年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
株式会社SBI証券	48,323	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。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
エイチ・エス証券株式会社	3,000	
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
楽天証券株式会社	7,495	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
株式会社ジャパネット銀行	37,250	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。

(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  
2020年3月末現在、450百万円
- c. 事業の内容  
「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社  
信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。
- (2) 販売会社  
証券投資信託の募集の取扱いおよび販売を行い、一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を代行します。
- (3) 投資助言会社(参考情報)  
委託会社に対し、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

3【資本関係】

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

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

### 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

2020年5月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

2019年12月25日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2018年11月21日から2019年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2019年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年7月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2019年11月21日から2020年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2020年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年11月21日から2020年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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