

**【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11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>	DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）
<b>【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)

(以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

### (7)【申込期間】

継続申込期間：2020年11月21日(土)～2021年5月21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)

( 9 ) 【払込期日】

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

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時~午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

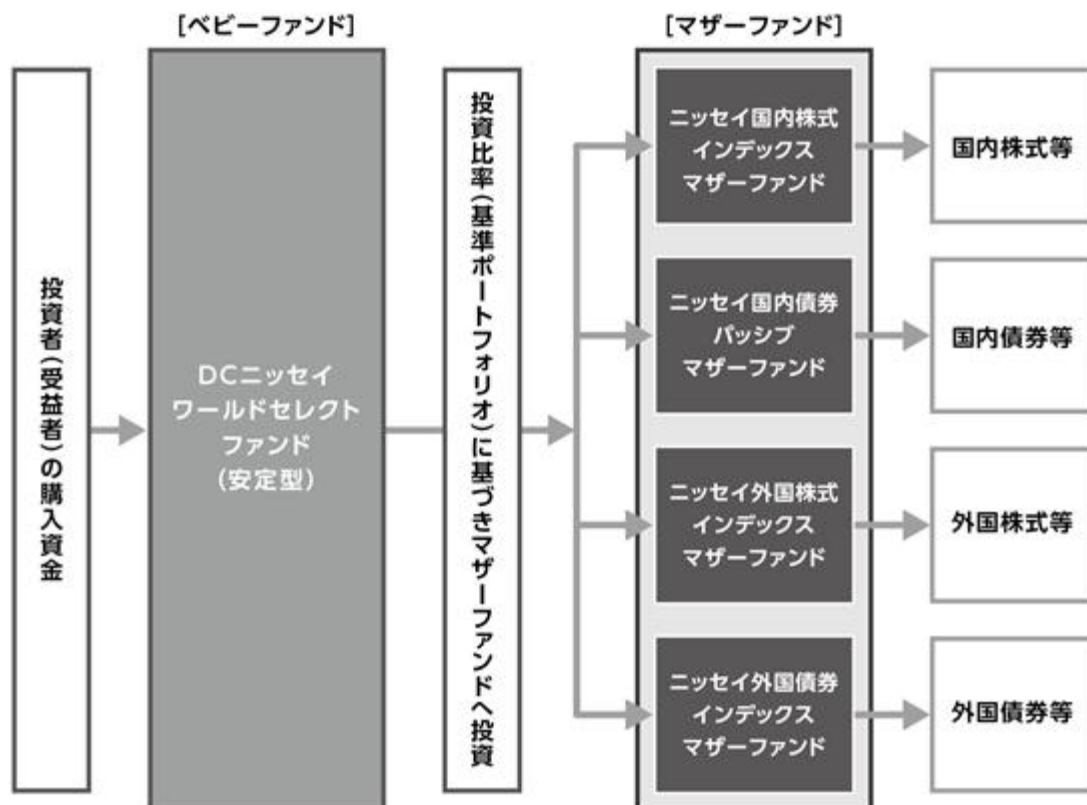
###### 基本方針

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

###### ファンドの特色

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

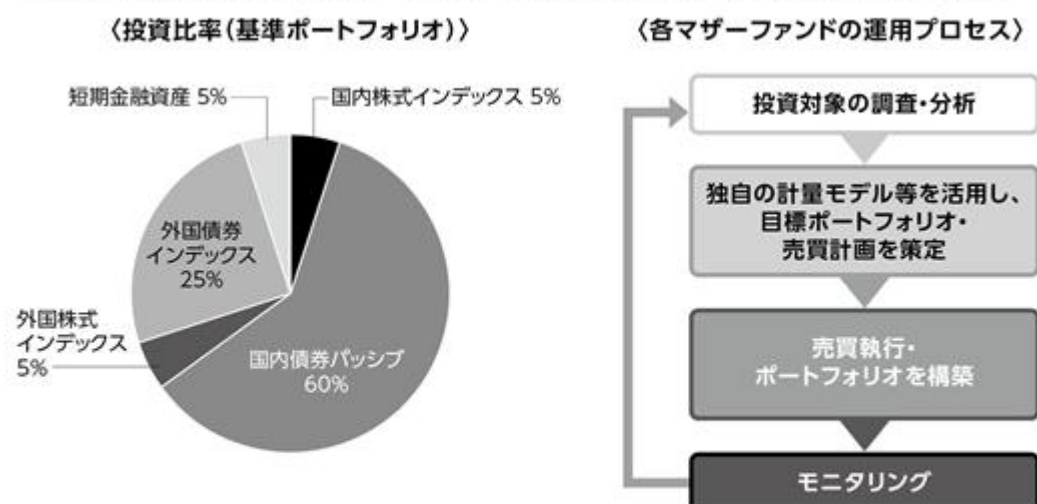
※1 TOPIX(東証株価指数)は、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの高標または標準に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の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

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

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

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

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



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

### <MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc. の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc. に問合せることなく、当ファンドを保証、推奨、売買または宣伝するためにいかなるMSCI Inc. のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc. の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc. との関係を一切主張することはできません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

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

## ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本含む)		
債券 一般	年2回	日 本	ファミリー ファンド	あ り ( )
公債	年4回	北 米		
社債	年6回 (隔月)	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ( )		アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・債券) 資産配分固定型))	日 々	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
	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。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

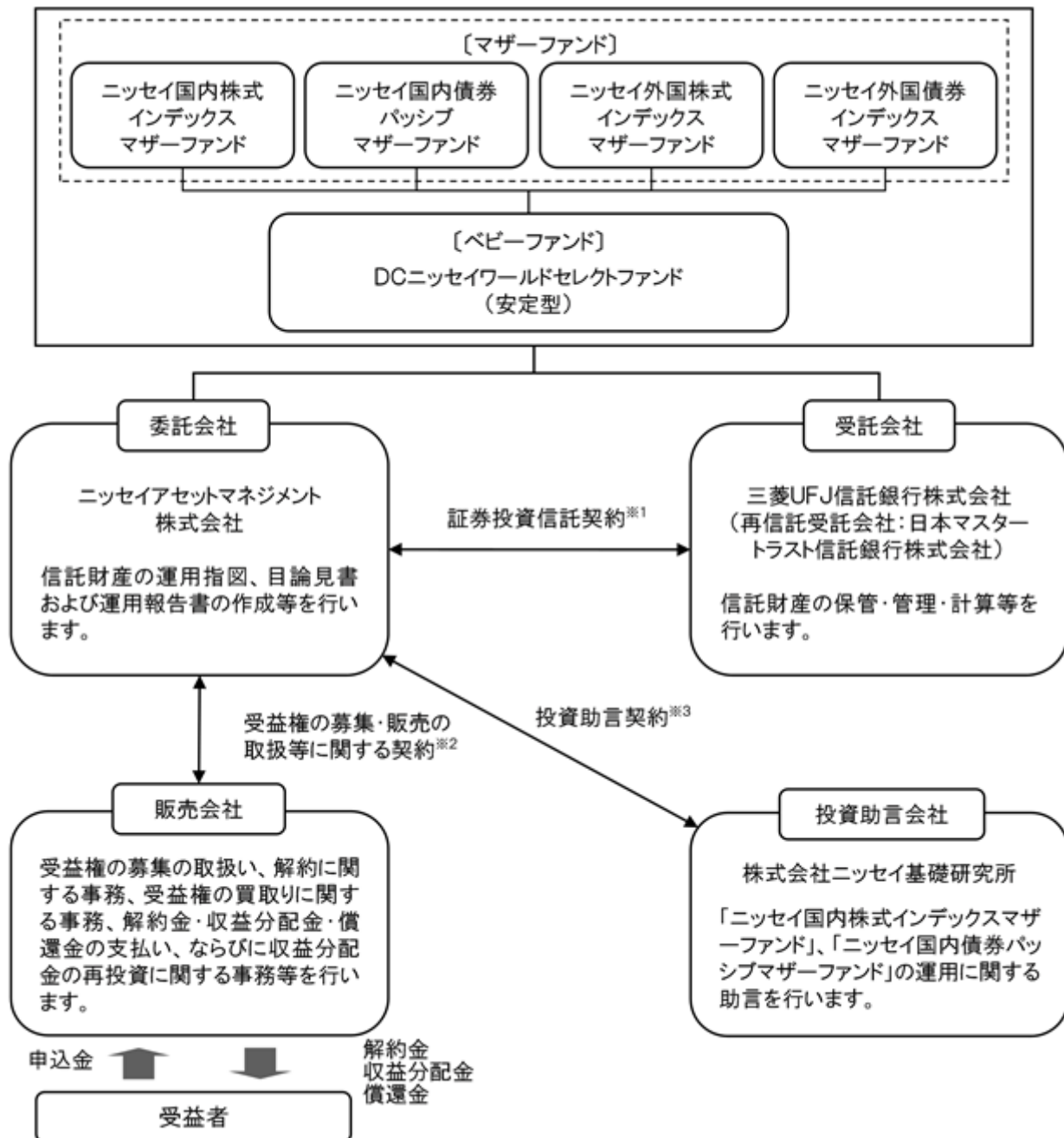
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、  
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年7月14日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始



## (3) 【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

## 委託会社の概況（2020年8月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 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】

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （参考）マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## （１）基本方針

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

## （２）運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、

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

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

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

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

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

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

## b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

#### 金融商品

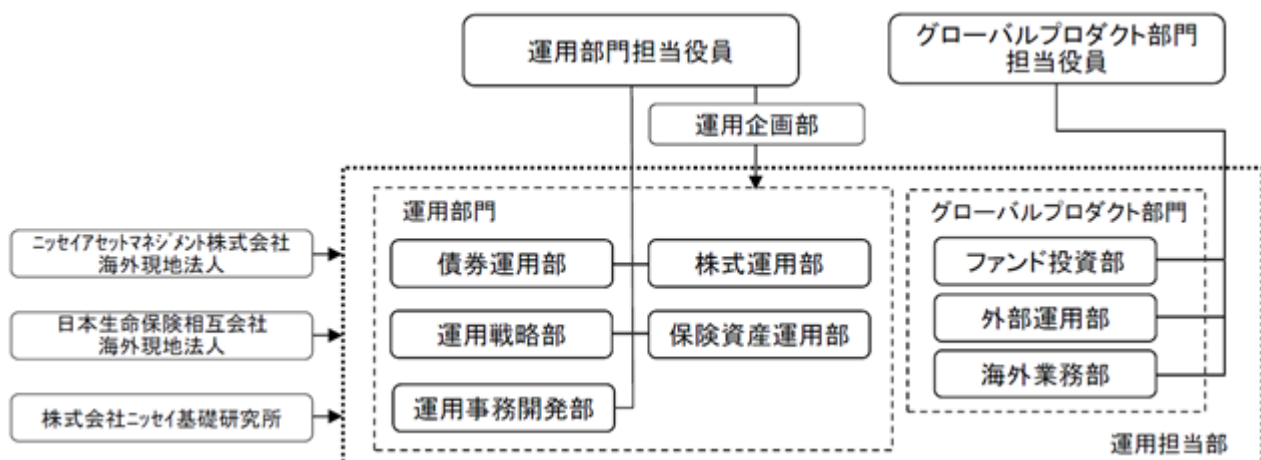
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

### （3）【運用体制】

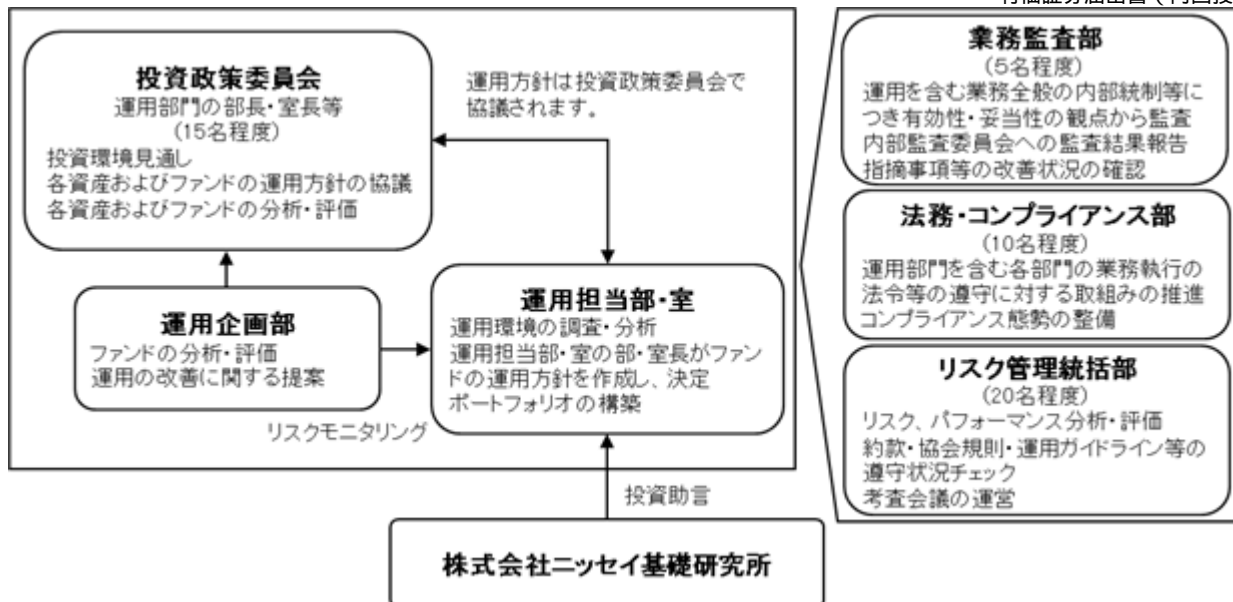
#### 委託会社の組織体制



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

#### 内部管理体制および意思決定を監督する組織





#### < 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

##### 分配時期

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

##### 支払方法

#### < 分配金受取コースの場合 >

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

#### < 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。

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

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

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

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

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

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

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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

#### 有価証券の貸付けおよび範囲

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

#### 有価証券の空売り

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

#### 有価証券の借入れ

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

#### 外国為替予約等

- 1．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
- 2．前記1．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。

3. 前記2.の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。
4. 予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 資金の借入れ

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

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

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

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

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

#### 同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

### 3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

##### ・流動性リスク

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

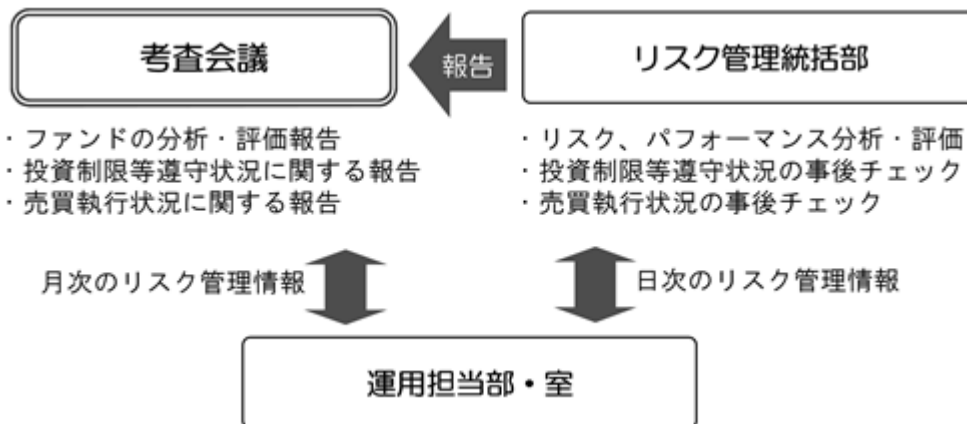
##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2020年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に9.8%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

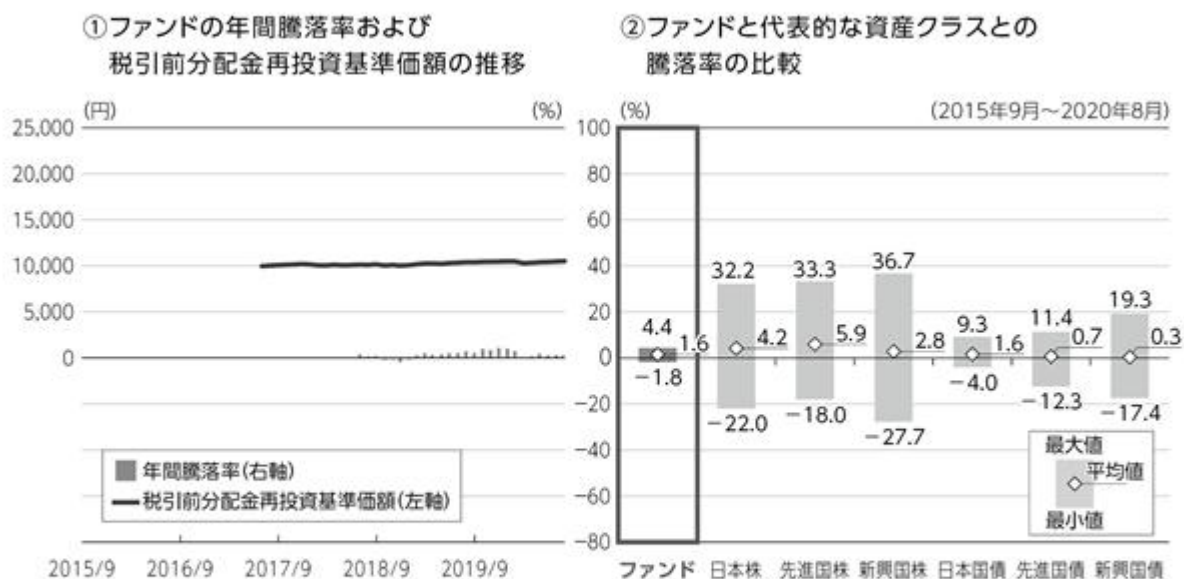
(2) 投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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



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

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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の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・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

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

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

##### (4)【その他の手数料等】

###### 証券取引の手数料等

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

###### 監査費用

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

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

###### 信託事務の諸費用

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

###### 借入金の利息

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

###### 信託財産留保額

ありません。

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



## &lt;ご参考&gt;

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

### 確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

### 確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

#### 課税対象

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

#### 個人の課税の取扱い

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

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

(2020年8月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,515,372,349	95.10
内 日本	4,515,372,349	95.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	232,878,338	4.90
純資産総額	4,748,250,687	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8月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	139,007,765,680	96.74
内 日本	139,007,765,680	96.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,681,399,773	3.26
純資産総額	143,689,165,453	100.00

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

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	4,557,120,000	3.17
内 日本	4,557,120,000	3.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価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8月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	56,889,287,880	72.33
内 日本	56,889,287,880	72.33
地方債証券	7,442,821,345	9.46
内 日本	7,442,821,345	9.46
特殊債券	8,509,639,101	10.82
内 日本	8,509,639,101	10.82
社債券	5,104,167,900	6.49
内 日本	4,396,288,000	5.59
内 スウェーデン	408,572,600	0.52
内 フランス	299,307,300	0.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	705,068,757	0.90
純資産総額	78,650,984,983	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8月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	266,705,623,773	94.18
内 アメリカ	186,672,837,164	65.92
内 イギリス	11,605,740,470	4.10
内 スイス	9,905,259,215	3.50
内 カナダ	9,411,617,288	3.32
内 フランス	9,129,743,263	3.22
内 ドイツ	8,380,086,705	2.96
内 オーストラリア	5,583,041,327	1.97
内 オランダ	5,501,886,462	1.94
内 アイルランド	3,727,048,084	1.32
内 スウェーデン	2,987,211,780	1.05
内 香港	2,502,499,134	0.88
内 デンマーク	2,190,805,428	0.77
内 スペイン	2,051,664,033	0.72
内 イタリア	1,652,800,909	0.58
内 フィンランド	948,712,567	0.34
内 シンガポール	829,021,017	0.29
内 ベルギー	770,300,733	0.27
内 ノルウェー	511,470,470	0.18
内 バミューダ	467,424,802	0.17
内 イスラエル	375,167,997	0.13
内 ジャージー	352,509,191	0.12
内 ニューゼーランド	302,088,412	0.11
内 ケイマン諸島	280,177,102	0.10
内 オランダ領キュラソー	171,073,685	0.06
内 オーストリア	149,641,613	0.05
内 ポルトガル	142,634,985	0.05
内 ルクセンブルグ	73,258,306	0.03
内 パプアニューギニア	29,901,631	0.01
投資証券	6,224,896,530	2.20
内 アメリカ	5,244,314,975	1.85
内 オーストラリア	396,310,521	0.14
内 イギリス	149,383,163	0.05
内 シンガポール	149,244,522	0.05
内 フランス	138,313,523	0.05
内 香港	102,852,896	0.04
内 カナダ	44,476,930	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,259,827,299	3.62
純資産総額	283,190,347,602	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）	9,427,360,939	3.33
内 アメリカ	7,052,371,692	2.49
内 ドイツ	1,704,296,651	0.60
内 イギリス	670,692,596	0.24

（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8月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	30,532,059,517	99.49
内 アメリカ	13,399,428,472	43.66
内 フランス	3,210,823,300	10.46
内 イタリア	2,918,626,824	9.51
内 ドイツ	2,338,301,040	7.62
内 イギリス	2,029,729,251	6.61
内 スペイン	1,865,231,451	6.08
内 ベルギー	796,223,811	2.59
内 オーストラリア	721,857,908	2.35
内 オランダ	591,656,148	1.93
内 カナダ	585,445,373	1.91
内 オーストリア	486,354,697	1.58
内 アイルランド	252,870,901	0.82
内 メキシコ	231,976,646	0.76
内 フィンランド	187,586,034	0.61
内 ポーランド	183,787,705	0.60
内 デンマーク	164,603,220	0.54
内 マレーシア	152,984,877	0.50
内 シンガポール	132,538,807	0.43
内 イスラエル	121,864,032	0.40
内 スウェーデン	92,229,563	0.30
内 ノルウェー	67,939,457	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	155,701,280	0.51
純資産総額	30,687,760,797	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】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

（2020年8月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（％） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,897,524,693	0.9923 2,875,420,154	0.9810 2,842,471,723	- -	59.86%
2	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	808,283,909	1.4326 1,158,023,012	1.4551 1,176,133,915	- -	24.77%
3	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	122,939,115	1.8585 228,491,198	2.0306 249,640,166	- -	5.26%
4	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	140,134,134	1.6861 236,293,355	1.7635 247,126,545	- -	5.20%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	95.10
	小計		95.10
合 計（対純資産総額比）			95.10

（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8月31日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（％） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	683,900	7,056.25 4,825,773,979	7,006.00 4,791,403,400	- -	3.33%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	383,900	6,802.07 2,611,317,920	8,309.00 3,189,825,100	- -	2.22%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信 業	477,200	4,630.37 2,209,613,854	6,598.00 3,148,565,600	- -	2.19%
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,500	35,619.76 1,976,896,933	43,680.00 2,424,240,000	- -	1.69%
5	任天堂 日本	株式 その他製品	37,600	38,580.08 1,450,611,338	56,740.00 2,133,424,000	- -	1.48%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	509,900	3,718.15 1,895,886,501	3,959.00 2,018,694,100	- -	1.40%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信 業	803,900	2,618.37 2,104,912,446	2,411.50 1,938,604,850	- -	1.35%
8	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	4,135,100	489.16 2,022,762,460	442.50 1,829,781,750	- -	1.27%
9	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービス業	419,600	3,725.86 1,563,374,180	4,026.00 1,689,309,600	- -	1.18%
10	第一三共 日本	株式 医薬品	175,400	7,171.26 1,257,839,186	9,447.00 1,657,003,800	- -	1.15%
11	ダイキン工業 日本	株式 機械	78,100	14,149.15 1,105,048,620	19,965.00 1,559,266,500	- -	1.09%

12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	438,500	3,241.63 1,421,456,881	3,078.00 1,349,703,000	- -	0.94%
13	信越化学工業 日本	株式 化学	103,100	11,839.71 1,220,674,484	12,885.00 1,328,443,500	- -	0.92%
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	482,600	2,702.29 1,304,125,218	2,729.00 1,317,015,400	- -	0.92%
15	日本電産 日本	株式 電気機器	147,500	6,329.02 933,530,868	8,911.00 1,314,372,500	- -	0.91%
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	418,100	3,244.12 1,356,370,047	3,118.00 1,303,635,800	- -	0.91%
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	430,100	3,130.86 1,346,585,614	2,959.00 1,272,665,900	- -	0.89%
18	HOYA 日本	株式 精密機器	121,600	9,671.51 1,176,055,681	10,415.00 1,266,464,000	- -	0.88%
19	花王 日本	株式 化学	146,700	8,303.71 1,218,155,151	8,069.00 1,183,722,300	- -	0.82%
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	8,214,100	140.20 1,151,687,050	143.80 1,181,187,580	- -	0.82%
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	422,200	2,375.76 1,003,048,034	2,723.50 1,149,861,700	- -	0.80%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	180,000	5,691.29 1,024,433,589	6,280.00 1,130,400,000	- -	0.79%
23	SMC 日本	株式 機械	19,200	45,435.39 872,359,630	58,250.00 1,118,400,000	- -	0.78%
24	ファナック 日本	株式 電気機器	57,600	17,515.89 1,008,915,591	18,605.00 1,071,648,000	- -	0.75%
25	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	38,900	22,298.69 867,419,410	27,150.00 1,056,135,000	- -	0.74%
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	213,700	5,446.42 1,163,901,150	4,890.00 1,044,993,000	- -	0.73%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	294,500	3,592.03 1,057,855,194	3,530.00 1,039,585,000	- -	0.72%
28	三井物産 日本	株式 卸売業	522,700	1,725.11 901,719,432	1,914.00 1,000,447,800	- -	0.70%
29	三菱商事 日本	株式 卸売業	395,800	2,593.50 1,026,508,929	2,512.50 994,447,500	- -	0.69%
30	中外製薬 日本	株式 医薬品	191,700	3,936.16 754,563,250	4,721.00 905,015,700	- -	0.63%

(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	14.55
		情報・通信業	9.84
		輸送用機器	7.07
		化学	6.93
		医薬品	6.35
		サービス業	5.33
		機械	5.27
		小売業	4.83
		銀行業	4.81
		卸売業	4.61
		陸運業	3.72
		食料品	3.65
		その他製品	2.61
		精密機器	2.53
		建設業	2.45
		保険業	1.93
		不動産業	1.93
		電気・ガス業	1.39
		その他金融業	1.08
		証券、商品先物取引業	0.80
		ガラス・土石製品	0.74
		非鉄金属	0.66
		鉄鋼	0.56
		ゴム製品	0.54
		金属製品	0.53
		繊維製品	0.47
		石油・石炭製品	0.42
空運業	0.35		
パルプ・紙	0.21		
倉庫・運輸関連業	0.18		
鉱業	0.17		
海運業	0.13		
水産・農林業	0.09		
	小計		96.74
合計（対純資産総額比）			96.74

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

（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8月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価 (円)	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	102.12 1,021,249,000	0.828000 2023/5/19	1.30%
2	第334回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	618,000,000	103.27 638,222,730	102.68 634,618,020	0.600000 2024/6/20	0.81%
3	第350回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	605,000,000	102.95 622,847,500	101.05 611,406,950	0.100000 2028/3/20	0.78%
4	第352回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	576,000,000	102.36 589,633,780	100.96 581,569,920	0.100000 2028/9/20	0.74%
5	第340回 利付国債 (1 0年) 日本	国債証券	566,000,000	103.73 587,117,460	102.40 579,629,280	0.400000 2025/9/20	0.74%

6	第341回 利付国債（10年） 日本	国債証券	552,000,000	103.37 570,635,520	101.99 563,012,400	0.300000 2025/12/20	0.72%
7	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	536,000,000	103.50 554,776,080	102.28 548,263,680	0.400000 2025/6/20	0.70%
8	第353回 利付国債（10年） 日本	国債証券	543,000,000	102.16 554,782,920	100.91 547,957,590	0.100000 2028/12/20	0.70%
9	第351回 利付国債（10年） 日本	国債証券	540,000,000	102.62 554,163,640	101.01 545,486,400	0.100000 2028/6/20	0.69%
10	第344回 利付国債（10年） 日本	国債証券	533,000,000	102.66 547,177,800	101.03 538,505,890	0.100000 2026/9/20	0.68%
11	第345回 利付国債（10年） 日本	国債証券	532,000,000	102.76 546,683,200	101.04 537,554,080	0.100000 2026/12/20	0.68%
12	第346回 利付国債（10年） 日本	国債証券	523,000,000	102.94 538,376,200	101.08 528,674,550	0.100000 2027/3/20	0.67%
13	第357回 利付国債（10年） 日本	国債証券	520,000,000	100.91 524,734,400	100.64 523,374,800	0.100000 2029/12/20	0.67%
14	第358回 利付国債（10年） 日本	国債証券	518,000,000	100.75 521,890,620	100.61 521,201,240	0.100000 2030/3/20	0.66%
15	第354回 利付国債（10年） 日本	国債証券	512,000,000	101.95 521,992,300	100.85 516,372,480	0.100000 2029/3/20	0.66%
16	第355回 利付国債（10年） 日本	国債証券	511,000,000	101.75 519,975,740	100.79 515,042,010	0.100000 2029/6/20	0.65%
17	第342回 利付国債（10年） 日本	国債証券	510,000,000	102.36 522,036,000	100.97 514,967,400	0.100000 2026/3/20	0.65%
18	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	102.29 511,486,000	0.660000 2024/5/31	0.65%
19	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	505,000,000	101.44 512,295,900	100.72 508,646,100	0.100000 2029/9/20	0.65%
20	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	101.50 507,546,500	0.605000 2023/5/31	0.65%
21	第348回 利付国債（10年） 日本	国債証券	499,000,000	102.94 513,674,800	101.09 504,474,030	0.100000 2027/9/20	0.64%
22	第338回 利付国債（10年） 日本	国債証券	491,000,000	103.30 507,237,370	102.21 501,870,740	0.400000 2025/3/20	0.64%
23	第349回 利付国債（10年） 日本	国債証券	481,000,000	103.06 495,718,600	101.06 486,108,220	0.100000 2027/12/20	0.62%
24	第131回 利付国債（5年） 日本	国債証券	477,000,000	100.62 479,970,440	100.35 478,698,120	0.100000 2022/3/20	0.61%
25	第141回 利付国債（5年） 日本	国債証券	470,000,000	101.41 476,659,900	100.81 473,821,100	0.100000 2024/9/20	0.60%

26	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	461,000,000	102.49 472,478,900	101.01 465,697,590	0.100000 2026/6/20	0.59%
27	第359回 利付国債（10年） 日本	国債証券	438,000,000	100.72 441,179,630	100.53 440,347,680	0.100000 2030/6/20	0.56%
28	第139回 利付国債（5年） 日本	国債証券	434,000,000	101.23 439,363,400	100.73 437,168,200	0.100000 2024/3/20	0.56%
29	第347回 利付国債（10年） 日本	国債証券	426,000,000	103.09 439,163,400	101.09 430,651,920	0.100000 2027/6/20	0.55%
30	第113回 利付国債（20年） 日本	国債証券	360,000,000	120.81 434,916,000	118.79 427,658,400	2.100000 2029/9/20	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	72.33
		地方債証券	9.46
		特殊債券	10.82
		社債券	5.59
	小計	98.20	
	外国	社債券	0.90
	小計	0.90	
合 計（対純資産総額比）			99.10

（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8月31日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面 金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	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	262,928	33,228.73 8,736,766,064	52,598.87 13,829,716,427	- -	4.88%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	434,200	19,418.09 8,431,335,503	24,117.95 10,472,017,189	- -	3.70%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	25,428	259,638.69 6,602,092,719	358,413.64 9,113,742,241	- -	3.22%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	144,544	22,947.70 3,316,953,360	30,940.01 4,472,193,903	- -	1.58%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	18,593	145,152.97 2,698,829,355	173,255.03 3,221,330,914	- -	1.14%
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	17,861	145,338.64 2,595,893,574	172,730.34 3,085,136,688	- -	1.09%
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	158,299	15,688.93 2,483,542,473	16,187.51 2,562,466,708	- -	0.90%
8	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	102,490	19,975.81 2,047,320,952	22,727.20 2,329,311,301	- -	0.82%
9	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	178,736	12,300.99 2,198,630,101	12,693.07 2,268,709,631	- -	0.80%

10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	148,422	11,880.18 1,763,280,208	14,620.80 2,170,049,446	- -	0.77%
11	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	53,764	30,681.07 1,649,537,109	38,574.40 2,073,914,213	- -	0.73%
12	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	8,873	86,819.21 770,346,863	233,203.82 2,069,217,530	- -	0.73%
13	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	36,783	37,185.57 1,367,797,104	55,409.87 2,038,141,527	- -	0.72%
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	184,671	9,380.66 1,732,336,781	10,827.84 1,999,589,370	- -	0.71%
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	65,557	25,152.22 1,648,904,349	30,163.51 1,977,429,513	- -	0.70%
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	83,226	18,299.40 1,522,986,503	23,026.42 1,916,397,496	- -	0.68%
17	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	56,987	30,517.81 1,739,118,782	33,122.02 1,887,524,736	- -	0.67%
18	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	28,948	39,442.48 1,141,781,147	54,412.11 1,575,122,003	- -	0.56%
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	248,807	5,734.20 1,426,711,268	6,243.63 1,553,459,745	- -	0.55%
20	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	108,505	12,065.98 1,309,219,170	14,280.49 1,549,505,044	- -	0.55%
21	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	42,191	40,567.97 1,711,603,475	36,554.09 1,542,254,033	- -	0.54%
22	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	26,382	47,666.94 1,257,549,232	55,197.05 1,456,208,583	- -	0.51%
23	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	50,642	18,598.19 941,849,908	28,563.09 1,446,492,307	- -	0.51%
24	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	66,971	15,415.95 1,032,421,979	21,544.01 1,442,824,081	- -	0.51%
25	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	152,351	8,174.20 1,245,347,998	9,024.08 1,374,828,221	- -	0.49%
26	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	256,964	6,349.24 1,631,528,190	5,313.30 1,365,328,054	- -	0.48%
27	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	431,312	3,056.27 1,318,210,157	3,165.01 1,365,108,690	- -	0.48%
28	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	332,474	3,957.75 1,315,852,104	3,994.19 1,327,966,852	- -	0.47%
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	471,767	2,347.89 1,107,658,696	2,770.96 1,307,251,260	- -	0.46%
30	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	244,952	4,699.94 1,151,262,149	5,250.08 1,286,019,751	- -	0.45%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	12.13
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.97
		メディア・娯楽	6.68
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.28
		小売	6.19
		資本財	5.93
		ヘルスケア機器・サービス	5.05
		銀行	5.02
		食品・飲料・タバコ	4.24
		素材	4.19
		各種金融	4.07
		半導体・半導体製造装置	3.79
		公益事業	3.12
		保険	2.97
		エネルギー	2.91
		家庭用品・パーソナル用品	2.08
		電気通信サービス	1.91
		運輸	1.90
		耐久消費財・アパレル	1.69
		自動車・自動車部品	1.49
		消費者サービス	1.47
		食品・生活必需品小売り	1.47
	商業・専門サービス	1.16	
不動産	0.48		
	小計		94.18
投資証券	外国	投資証券	2.20
	小計		2.20
合 計（対純資産総額比）			96.38

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

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

(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8月31日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	259,185,600	102.69 266,177,921	102.25 265,035,418	2.000000 2021/11/15	0.86%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	243,381,600	103.10 250,938,534	102.90 250,464,004	1.625000 2022/8/15	0.82%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	224,416,800	108.66 243,871,036	108.67 243,893,934	2.125000 2025/5/15	0.79%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	223,363,200	108.67 242,732,197	108.49 242,340,137	2.375000 2024/8/15	0.79%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	232,845,600	103.06 239,973,733	102.74 239,239,540	1.750000 2022/5/15	0.78%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	219,148,800	108.54 237,866,299	108.45 237,673,448	2.250000 2024/11/15	0.77%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	227,577,600	104.51 237,850,189	104.30 237,372,539	1.750000 2023/5/15	0.77%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	218,095,200	107.78 235,078,005	107.76 235,039,016	2.000000 2025/2/15	0.77%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	215,988,000	108.75 234,893,429	108.49 234,338,340	2.500000 2024/5/15	0.76%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	205,452,000	108.62 223,168,494	108.22 222,344,263	2.750000 2023/11/15	0.72%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	215,988,000	103.10 222,703,003	102.71 221,849,914	2.000000 2022/2/15	0.72%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	206,505,600	103.17 213,063,344	102.88 212,457,091	1.750000 2022/6/15	0.69%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	203,344,800	103.99 211,462,018	103.64 210,762,818	2.125000 2022/6/30	0.69%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	192,808,800	109.17 210,507,642	108.83 209,851,169	2.750000 2024/2/15	0.68%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	185,433,600	107.27 198,927,603	106.88 198,202,557	2.500000 2023/8/15	0.65%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	187,540,800	104.85 196,653,407	104.51 196,000,765	2.000000 2023/2/15	0.64%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	186,487,200	103.77 193,530,684	103.22 192,495,817	2.625000 2021/12/15	0.63%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	181,219,200	103.91 188,313,777	103.44 187,462,201	2.375000 2022/3/15	0.61%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	180,165,600	103.10 185,752,535	102.65 184,958,004	2.125000 2021/12/31	0.60%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	179,112,000	103.51 185,400,622	103.25 184,933,140	1.625000 2022/11/15	0.60%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	180,165,600	102.61 184,869,744	102.15 184,057,176	2.125000 2021/9/30	0.60%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	164,361,600	108.34 178,071,108	108.45 178,261,660	2.000000 2025/8/15	0.58%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	158,040,000	112.73 178,164,662	112.57 177,911,949	2.375000 2027/5/15	0.58%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	169,629,600	102.31 173,551,436	101.87 172,810,155	2.000000 2021/8/31	0.56%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	167,522,400	102.38 171,526,185	101.90 170,722,077	2.125000 2021/8/15	0.56%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	151,718,400	112.10 170,088,479	111.89 169,763,786	2.750000 2025/6/30	0.55%

27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	150,664,800	111.00 167,238,117	110.79 166,930,571	2.625000 2025/3/31	0.54%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	147,504,000	108.75 160,420,082	108.64 160,260,145	2.250000 2024/12/31	0.52%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	158,040,000	100.22 158,393,351	100.27 158,471,449	0.250000 2023/6/15	0.52%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	146,450,400	106.82 156,440,234	107.09 156,838,126	1.625000 2026/5/15	0.51%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	外国	国債証券	99.49
	小計		99.49
合計(対純資産総額比)			99.49

(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】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

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。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

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8月31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 0209月	買建	282	4,445,195,100	4,557,120,000	3.17%

(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)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

(2020年8月31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 9	買建	382	6,430,828,555	7,052,371,692	2.49%
	EUREX取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 2 0 2 0 0 9	買建	410	1,676,356,991	1,704,296,651	0.60%
	ICE-EU	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E 2 0 2 0 0 9	買建	80	687,562,570	670,692,596	0.24%

(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。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

	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2月21日)	27,072,959	27,072,959	1.0066	1.0066
第2計算期間末 (2019年2月21日)	459,363,791	459,363,791	1.0190	1.0190
第3計算期間末 (2020年2月21日)	3,187,112,052	3,187,112,052	1.0590	1.0590
2019年8月末日	2,513,282,049	-	1.0409	-
9月末日	2,568,041,959	-	1.0399	-
10月末日	2,689,793,635	-	1.0442	-
11月末日	2,766,051,551	-	1.0453	-
12月末日	2,921,478,258	-	1.0469	-
2020年1月末日	3,069,924,072	-	1.0506	-
2月末日	3,165,836,847	-	1.0492	-
3月末日	3,167,274,677	-	1.0303	-
4月末日	3,300,419,932	-	1.0343	-
5月末日	3,481,402,324	-	1.0409	-
6月末日	4,421,980,136	-	1.0436	-
7月末日	4,624,022,413	-	1.0478	-
8月末日	4,748,250,687	-	1.0527	-



## 【分配の推移】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

	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
第3計算期間	0.0000
2020年2月22日～ 2020年8月21日	-

## 【収益率の推移】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	1.2
第3計算期間	3.9
2020年2月22日～ 2020年8月21日	0.6

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1計算期間	32,130,976	5,235,210	26,895,766
第2計算期間	452,842,888	28,932,225	450,806,429
第3計算期間	2,737,365,208	178,488,494	3,009,683,143
2020年2月22日～ 2020年8月21日	1,694,401,801	214,961,930	4,489,123,014

(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8月末現在

### ●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,527円
純資産総額	47億円

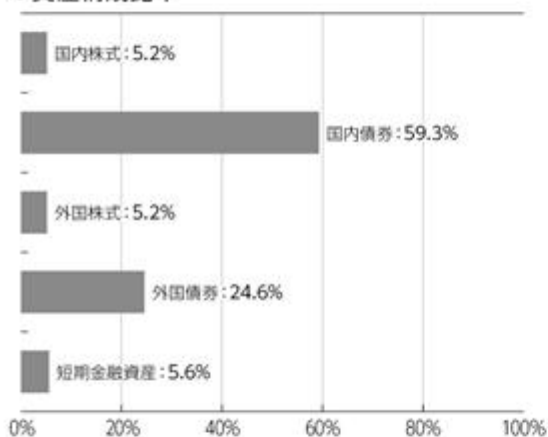
### ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

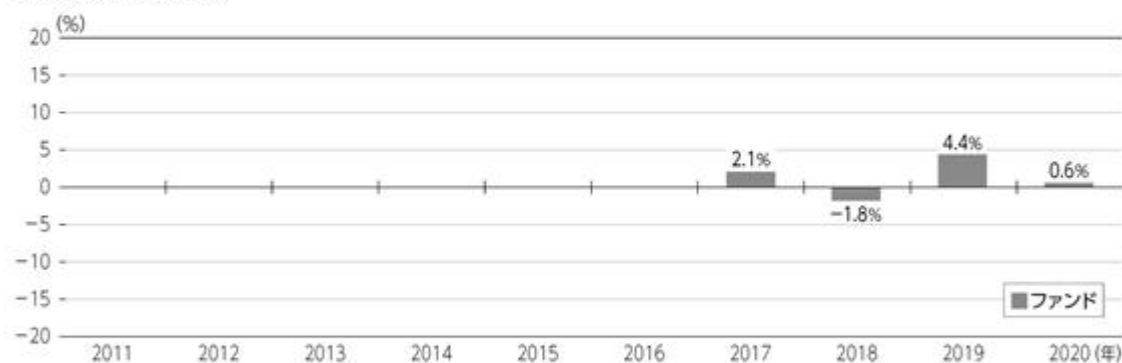
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

### ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

### ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2017年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

#### 取扱コース

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

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

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

ありません。

#### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

#### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

**換金単位**

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

**換金価額****< 解約請求の場合 >**

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

**< 買取請求の場合 >**

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

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

換金手数料はありません。

**信託財産留保額**

ありません。

**支払開始日**

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

**その他**

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

#### (5)【その他】

繰上償還

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

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

7. 前記1. から6. までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1. から7. までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

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

## (3) 解約請求権

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

## (4) 帳簿閲覧権

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

## (5) 書面決議における議決権

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

## (6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容



### 第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2019年2月22日から2020年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2019年2月21日現在)	第3期 (2020年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,079,152	3,581,120
コール・ローン	22,028,580	153,741,532
親投資信託受益証券	436,627,664	3,032,107,808
未収入金	1,488,995	371,078
流動資産合計	461,224,391	3,189,801,538
資産合計	461,224,391	3,189,801,538
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,562,905	362,482
未払受託者報酬	34,992	306,165
未払委託者報酬	245,258	1,896,986
その他未払費用	17,445	123,853
流動負債合計	1,860,600	2,689,486
負債合計	1,860,600	2,689,486
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	450,806,429	3,009,683,143
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,557,362	177,428,909
純資産合計	459,363,791	3,187,112,052
負債純資産合計	461,224,391	3,189,801,538

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期 (自2018年2月22日 至2019年2月21日)	第3期 (自2019年2月22日 至2020年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	85	2,348
有価証券売買等損益	4,875,365	82,144,386
営業収益合計	4,875,450	82,146,734
<b>営業費用</b>		
支払利息	8,158	63,497
受託者報酬	44,819	422,054
委託者報酬	314,281	2,708,419
その他費用	24,355	179,444
営業費用合計	391,613	3,373,414
営業利益又は営業損失( )	4,483,837	78,773,320
経常利益又は経常損失( )	4,483,837	78,773,320
当期純利益又は当期純損失( )	4,483,837	78,773,320
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( )	39,841	1,729,597
期首剰余金又は期首欠損金( )	177,193	8,557,362
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,209,896	97,065,414
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	4,209,896	97,065,414
剰余金減少額又は欠損金増加額	273,723	5,237,590
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	273,723	5,237,590
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( )	8,557,362	177,428,909

## ( 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2期 2019年2月21日現在	第3期 2020年2月21日現在
1 . 受益権総口数	450,806,429口	3,009,683,143口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0190円 (10,190円)	1.0590円 (10,590円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期 自2018年2月22日 至2019年2月21日	第3期 自2019年2月22日 至2020年2月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(4,192,793円)、収益調整金(4,382,083円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は8,574,876円(1口当たり0.019021円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(77,095,740円)、収益調整金(96,625,470円)及び分配準備積立金(3,766,695円)より分配対象収益は177,487,905円(1口当たり0.058972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2期 自2018年2月22日 至2019年2月21日	第3期 自2019年2月22日 至2020年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	4,927,737	77,359,060
合計	4,927,737	77,359,060

(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2期	第3期
	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
期首元本額	26,895,766円	450,806,429円
期中追加設定元本額	452,842,888円	2,737,365,208円
期中一部解約元本額	28,932,225円	178,488,494円

(4)【附属明細表】(2020年2月21日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	86,348,383	155,401,184	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	1,913,782,404	1,906,701,409	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	78,409,740	164,942,729	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	559,809,809	805,062,486	
親投資信託受益証券 合計		2,638,350,336	3,032,107,808	
合計		2,638,350,336	3,032,107,808	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

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

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

（単位：円）

	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	47,564,462	30,140,529
コール・ローン	970,926,881	1,293,967,064
株式	57,385,765,970	67,022,069,250
派生商品評価勘定	39,356,380	-
未収入金	-	4,810,000
未収配当金	91,169,006	108,315,429
前払金	-	17,845,000
差入委託証拠金	24,645,000	31,680,000
流動資産合計	58,559,427,699	68,508,827,272
資産合計	58,559,427,699	68,508,827,272
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	23,161,300
前受金	41,505,000	-
未払解約金	194,719,481	272,526,243
その他未払費用	801	3,324
流動負債合計	236,225,282	295,690,867
負債合計	236,225,282	295,690,867
純資産の部		
元本等		
元本	34,479,781,252	37,902,386,971
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,843,421,165	30,310,749,434
純資産合計	58,323,202,417	68,213,136,405
負債純資産合計	58,559,427,699	68,508,827,272



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1 . 受益権総口数	34,479,781,252口	37,902,386,971口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6915円 (16,915円)	1.7997円 (17,997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22日 至 2019年2月21日	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	990,360	19,228,350
合計	990,360	19,228,350

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	2019年2月21日 現在			2020年2月21日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000	1,125,325,000	-	1,102,200,000	23,125,000
合計	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000	1,125,325,000	-	1,102,200,000	23,125,000

(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	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	28,178,885,286円	34,479,781,252円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	15,224,610,246円	14,213,392,764円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	8,923,714,280円	10,790,787,045円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,998,062,126円	6,328,670,873円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	5,016,960,919円	4,348,214,857円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,238,783円	-円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,210,362円	4,064,002円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,206,781,976円	1,533,758,682円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,302,209,365円	5,400,151,642円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,930,765,501円	3,650,003,285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)	12,596,798円	8,429,921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)	44,117,130円	35,456,926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)	51,034,232円	33,985,099円
DCニッセイ国内株式インデックス	158,510,666円	308,609,717円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	13,120,980,625円	15,005,800,254円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	474,668,180円	708,961,084円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	26,528,689円	95,260,690円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,748,346円	86,348,383円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	16,200,912円	69,517,201円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	26,018,748円	127,166,977円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,123,269円	32,079,078円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	22,218,183円	49,538,445円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	25,051,252円	5,858,143円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,050,565円	4,166,589円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	703,909円	1,136,629円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	1,345,741円	3,601,646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)	11,655,177円	19,343,945円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	286,258円	10,022,746円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	274,453円	7,973,243円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	258,941円	12,208,615円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	180,146円	12,058,299円
計	34,479,781,252円	37,902,386,971円

## 附属明細表(2020年2月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,400	2,798.00	3,917,200	
日本水産	38,600	594.00	22,928,400	
マルハニチロ	5,600	2,544.00	14,246,400	
カネコ種苗	1,400	1,272.00	1,780,800	
サカタのタネ	4,600	3,335.00	15,341,000	
ホクト	2,900	1,970.00	5,713,000	
ヒノキヤグループ	1,000	2,044.00	2,044,000	
ショーボンドホールディングス	6,000	4,285.00	25,710,000	
ミライト・ホールディングス	11,500	1,527.00	17,560,500	
タマホーム	2,100	1,391.00	2,921,100	
ファーストコーポレーション	3,100	585.00	1,813,500	
ベステラ	1,300	1,093.00	1,420,900	
スペースバリューホールディングス	4,700	535.00	2,514,500	
住石ホールディングス	12,600	141.00	1,776,600	
日鉄鉱業	900	4,255.00	3,829,500	
三井松島ホールディングス	900	1,119.00	1,007,100	
国際石油開発帝石	154,800	1,069.50	165,558,600	
石油資源開発	5,000	2,766.00	13,830,000	
K&Oエナジーグループ	1,900	1,688.00	3,207,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	983.00	1,671,100	
安藤・間	23,000	862.00	19,826,000	
東急建設	11,300	749.00	8,463,700	
コムシスホールディングス	13,700	2,855.00	39,113,500	
ビーアールホールディングス	4,200	499.00	2,095,800	
高松コンストラクショングループ	2,400	2,600.00	6,240,000	
東建コーポレーション	1,200	8,190.00	9,828,000	
ヤマウラ	1,900	939.00	1,784,100	
大成建設	29,700	4,010.00	119,097,000	
大林組	89,100	1,209.00	107,721,900	
清水建設	90,400	1,064.00	96,185,600	
飛鳥建設	2,600	1,342.00	3,489,200	
長谷工コーポレーション	34,500	1,408.00	48,576,000	
松井建設	3,500	733.00	2,565,500	
銭高組	400	3,905.00	1,562,000	
鹿島建設	70,000	1,260.00	88,200,000	
不動テトラ	2,300	1,614.00	3,712,200	
大末建設	1,900	946.00	1,797,400	
鉄建建設	1,900	2,624.00	4,985,600	
西松建設	6,900	2,411.00	16,635,900	
三井住友建設	21,500	603.00	12,964,500	
大豊建設	2,000	2,601.00	5,202,000	
前田建設工業	22,300	1,054.00	23,504,200	
佐田建設	4,500	392.00	1,764,000	
ナカノフドー建設	3,800	455.00	1,729,000	
奥村組	4,800	2,828.00	13,574,400	
東鉄工業	3,800	3,010.00	11,438,000	
浅沼組	1,000	4,995.00	4,995,000	
戸田建設	37,000	713.00	26,381,000	
熊谷組	4,100	3,180.00	13,038,000	
北野建設	700	2,513.00	1,759,100	
植木組	700	2,555.00	1,788,500	
矢作建設工業	3,900	845.00	3,295,500	
ピーエス三菱	2,900	662.00	1,919,800	
日本ハウスホールディングス	6,100	445.00	2,714,500	

大東建託	10,700	12,555.00	134,338,500
新日本建設	3,800	853.00	3,241,400
N I P P O	7,400	2,670.00	19,758,000
東亜道路工業	600	3,365.00	2,019,000
前田道路	9,400	3,390.00	31,866,000
日本道路	900	7,130.00	6,417,000
東亜建設工業	2,800	1,750.00	4,900,000
日本国土開発	6,500	590.00	3,835,000
若築建設	1,600	1,596.00	2,553,600
東洋建設	10,000	507.00	5,070,000
五洋建設	35,300	650.00	22,945,000
世紀東急工業	4,300	875.00	3,762,500
福田組	1,000	4,330.00	4,330,000
住友林業	22,600	1,741.00	39,346,600
日本基礎技術	4,500	364.00	1,638,000
巴コーポレーション	4,600	374.00	1,720,400
大和ハウス工業	88,200	3,337.00	294,323,400
ライト工業	5,100	1,462.00	7,456,200
積水ハウス	97,500	2,343.00	228,442,500
日特建設	2,300	831.00	1,911,300
ユアテック	5,100	633.00	3,228,300
四電工	700	2,560.00	1,792,000
中電工	3,600	2,430.00	8,748,000
関電工	12,700	997.00	12,661,900
きんでん	21,200	1,784.00	37,820,800
東京エネシス	3,000	856.00	2,568,000
トーエネック	900	3,680.00	3,312,000
住友電設	2,500	2,410.00	6,025,000
日本電設工業	4,900	2,183.00	10,696,700
協和エクシオ	13,500	2,625.00	35,437,500
新日本空調	2,400	2,005.00	4,812,000
日本工営	1,800	3,300.00	5,940,000
九電工	6,300	3,160.00	19,908,000
三機工業	6,400	1,355.00	8,672,000
日揮ホールディングス	27,400	1,566.00	42,908,400
中外炉工業	1,000	1,708.00	1,708,000
ヤマト	2,900	719.00	2,085,100
太平電業	2,200	2,533.00	5,572,600
高砂熱学工業	7,700	1,860.00	14,322,000
三晃金属工業	700	2,614.00	1,829,800
N E C ネットエスアイ	2,600	4,210.00	10,946,000
朝日工業社	600	3,195.00	1,917,000
明星工業	5,800	788.00	4,570,400
大気社	4,300	3,415.00	14,684,500
ダイダン	2,100	2,736.00	5,745,600
日比谷総合設備	2,900	1,943.00	5,634,700
日本製粉	8,300	1,644.00	13,645,200
日清製粉グループ本社	32,200	1,931.00	62,178,200
昭和産業	2,600	3,040.00	7,904,000
鳥越製粉	2,500	824.00	2,060,000
中部飼料	3,500	1,636.00	5,726,000
フィード・ワン	19,200	179.00	3,436,800
東洋精糖	1,500	1,192.00	1,788,000
日本甜菜製糖	1,500	1,871.00	2,806,500
三井製糖	2,500	2,082.00	5,205,000
塩水港精糖	7,800	224.00	1,747,200
日新製糖	1,400	2,017.00	2,823,800
L I F U L L	9,500	485.00	4,607,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	1,594.00	2,869,200
日本M&Aセンター	20,500	3,675.00	75,337,500

メンバーズ	1,100	1,592.00	1,751,200
UTグループ	3,200	2,583.00	8,265,600
タケエイ	2,600	1,000.00	2,600,000
ビーネックスグループ	3,400	965.00	3,281,000
コシダカホールディングス	6,500	1,466.00	9,529,000
パソナグループ	2,900	1,284.00	3,723,600
CDS	1,300	1,383.00	1,797,900
リンクアンドモチベーション	6,000	540.00	3,240,000
GCA	3,300	798.00	2,633,400
エス・エム・エス	8,400	2,293.00	19,261,200
サニーサイドアップグループ	1,700	894.00	1,519,800
パーソルホールディングス	27,100	1,682.00	45,582,200
リニカル	1,700	987.00	1,677,900
クックパッド	9,500	318.00	3,021,000
アイ・ケイ・ケイ	2,500	736.00	1,840,000
森永製菓	6,700	4,630.00	31,021,000
中村屋	700	4,020.00	2,814,000
江崎グリコ	8,500	4,660.00	39,610,000
名糖産業	1,400	1,404.00	1,965,600
井村屋グループ	1,200	1,892.00	2,270,400
不二家	1,600	2,256.00	3,609,600
山崎製パン	21,400	2,016.00	43,142,400
モロゾフ	500	4,920.00	2,460,000
亀田製菓	1,600	4,770.00	7,632,000
寿スピリッツ	2,700	6,070.00	16,389,000
カルビー	13,000	3,025.00	39,325,000
森永乳業	5,300	4,020.00	21,306,000
六甲バター	1,900	1,546.00	2,937,400
ヤクルト本社	19,600	5,410.00	106,036,000
明治ホールディングス	18,900	7,040.00	133,056,000
雪印メグミルク	6,900	2,449.00	16,898,100
プリマハム	4,500	2,456.00	11,052,000
日本ハム	10,900	4,560.00	49,704,000
丸大食品	3,000	1,990.00	5,970,000
S Foods	2,300	2,612.00	6,007,600
柿安本店	1,000	3,085.00	3,085,000
伊藤ハム米久ホールディングス	18,400	660.00	12,144,000
学情	1,000	1,950.00	1,950,000
スタジオアリス	1,400	1,836.00	2,570,400
クロスキャット	1,500	1,195.00	1,792,500
シミックホールディングス	1,500	1,603.00	2,404,500
システナ	9,900	1,663.00	16,463,700
NJS	1,000	1,748.00	1,748,000
デジタルアーツ	1,400	5,580.00	7,812,000
日鉄ソリューションズ	4,200	3,360.00	14,112,000
総合警備保障	10,800	5,530.00	59,724,000
いちご	35,700	393.00	14,030,100
日本駐車場開発	30,700	146.00	4,482,200
コア	1,300	1,328.00	1,726,400
カカクコム	20,300	2,815.00	57,144,500
セントケア・ホールディング	3,800	463.00	1,759,400
ルネサンス	1,500	1,667.00	2,500,500
ディップ	3,800	3,055.00	11,609,000
SBSホールディングス	2,500	1,826.00	4,565,000
オプトホールディング	1,500	1,920.00	2,880,000
新日本科学	2,900	679.00	1,969,100
ツクイ	6,400	630.00	4,032,000
ベネフィット・ワン	7,400	1,894.00	14,015,600
エムスリー	59,900	3,055.00	182,994,500
ツカダ・グローバルホールディング	3,200	536.00	1,715,200

アウトソーシング	15,500	979.00	15,174,500
ウェルネット	2,700	663.00	1,790,100
ワールドホールディングス	1,000	1,942.00	1,942,000
ディー・エヌ・エー	13,300	1,582.00	21,040,600
博報堂DYホールディングス	37,800	1,426.00	53,902,800
ぐるなび	4,700	844.00	3,966,800
タカミヤ	2,900	597.00	1,731,300
ジャパンベストレスキューシステム	2,100	849.00	1,782,900
ファンコミュニケーションズ	7,500	436.00	3,270,000
ライク	900	1,882.00	1,693,800
ビジネス・ブレークスルー	4,600	403.00	1,853,800
エスプール	5,200	763.00	3,967,600
WDBホールディングス	1,200	2,580.00	3,096,000
バリューコマース	1,500	2,365.00	3,547,500
インフォマート	29,800	720.00	21,456,000
サッポロホールディングス	9,700	2,436.00	23,629,200
アサヒグループホールディングス	59,700	4,800.00	286,560,000
麒麟ホールディングス	120,900	2,235.00	270,211,500
宝ホールディングス	21,400	934.00	19,987,600
オエノンホールディングス	7,500	388.00	2,910,000
養命酒製造	900	1,937.00	1,743,300
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	20,000	2,920.00	58,400,000
サントリー食品インターナショナル	19,100	4,595.00	87,764,500
ダイドーグループホールディングス	1,500	3,940.00	5,910,000
伊藤園	8,700	5,430.00	47,241,000
キーコーヒー	2,800	2,238.00	6,266,400
日清オイリオグループ	3,700	3,715.00	13,745,500
不二製油グループ本社	7,000	2,752.00	19,264,000
かどや製油	500	3,810.00	1,905,000
J・オイルミルズ	1,500	4,250.00	6,375,000
ローソン	7,100	6,210.00	44,091,000
サンエー	2,300	4,590.00	10,557,000
カワチ薬品	2,200	2,097.00	4,613,400
エービーシー・マート	4,400	6,800.00	29,920,000
ハードオフコーポレーション	2,200	801.00	1,762,200
高千穂交易	1,600	1,129.00	1,806,400
アスクル	2,900	3,320.00	9,628,000
ゲオホールディングス	5,000	1,221.00	6,105,000
アダストリア	3,900	2,109.00	8,225,100
ジーフット	2,900	613.00	1,777,700
伊藤忠食品	700	4,940.00	3,458,000
くら寿司	1,500	5,330.00	7,995,000
キャンドゥ	1,300	1,634.00	2,124,200
エレマテック	2,600	1,025.00	2,665,000
パルグループホールディングス	1,400	3,500.00	4,900,000
JALUX	800	2,233.00	1,786,400
エディオン	12,800	1,001.00	12,812,800
あらた	2,200	4,510.00	9,922,000
サーラコーポレーション	5,700	593.00	3,380,100
トーメンデバイス	500	3,930.00	1,965,000
ハローズ	1,100	2,764.00	3,040,400
J Pホールディングス	8,500	308.00	2,618,000
フジオフードシステム	2,400	1,654.00	3,969,600
あみやき亭	600	3,420.00	2,052,000
東京エレクトロン デバイス	1,000	2,838.00	2,838,000
ひらまつ	6,700	247.00	1,654,900
フィールズ	3,300	474.00	1,564,200
双日	154,600	342.00	52,873,200
アルフレッサ ホールディングス	31,100	2,173.00	67,580,300



大黒天物産	700	3,395.00	2,376,500
ハニーズホールディングス	2,500	1,336.00	3,340,000
キッコーマン	20,500	5,740.00	117,670,000
味の素	63,000	1,969.00	124,047,000
キュービー	15,900	2,135.00	33,946,500
ハウス食品グループ本社	10,700	3,415.00	36,540,500
カゴメ	10,800	2,628.00	28,382,400
アリアケジャパン	2,600	7,420.00	19,292,000
ピエトロ	1,100	1,649.00	1,813,900
エバラ食品工業	800	2,193.00	1,754,400
ニチレイ	13,600	2,816.00	38,297,600
横浜冷凍	7,800	932.00	7,269,600
東洋水産	14,700	4,535.00	66,664,500
イトアンド	1,000	1,826.00	1,826,000
大冷	900	1,973.00	1,775,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,600	1,121.00	1,793,600
日清食品ホールディングス	12,100	8,820.00	106,722,000
永谷園ホールディングス	1,400	2,117.00	2,963,800
一正蒲鉾	1,900	955.00	1,814,500
フジッコ	3,100	1,876.00	5,815,600
ロック・フィールド	3,000	1,410.00	4,230,000
日本たばこ産業	164,700	2,268.50	373,621,950
ケンコーマヨネーズ	1,600	2,192.00	3,507,200
わらべや日洋ホールディングス	1,900	1,850.00	3,515,000
なとり	1,600	1,707.00	2,731,200
北の達人コーポレーション	10,000	641.00	6,410,000
ユーグレナ	12,200	827.00	10,089,400
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,618.00	2,265,200
片倉工業	4,000	1,321.00	5,284,000
グンゼ	2,000	4,165.00	8,330,000
ヒューリック	59,800	1,329.00	79,474,200
ラサ商事	2,000	920.00	1,840,000
アルペン	2,100	1,892.00	3,973,200
クオールホールディングス	4,100	1,380.00	5,658,000
アルコニックス	3,000	1,247.00	3,741,000
神戸物産	9,700	4,455.00	43,213,500
ジーンズホールディングス	1,500	7,300.00	10,950,000
ビックカメラ	16,600	1,072.00	17,795,200
D C Mホールディングス	15,100	1,041.00	15,719,100
ペッパーフードサービス	2,200	868.00	1,909,600
Monotaro	19,900	2,638.00	52,496,200
東京一番フーズ	3,000	601.00	1,803,000
DDホールディングス	1,100	1,645.00	1,809,500
あいホールディングス	4,000	1,717.00	6,868,000
ディービーエックス	1,900	925.00	1,757,500
きちりホールディングス	2,500	713.00	1,782,500
アークランドサービスホールディングス	2,000	1,983.00	3,966,000
J.フロント リテイリング	33,400	1,287.00	42,985,800
ドトール・日レスホールディングス	4,500	2,077.00	9,346,500
マツモトキヨシホールディングス	11,600	3,810.00	44,196,000
ブロンコビリー	1,500	2,500.00	3,750,000
Z O Z O	19,200	1,687.00	32,390,400
物語コーポレーション	700	8,430.00	5,901,000
ココカラファイン	2,900	5,140.00	14,906,000
三越伊勢丹ホールディングス	48,900	797.00	38,973,300
東洋紡	11,000	1,510.00	16,610,000
ユニチカ	8,200	345.00	2,829,000
富士紡ホールディングス	1,300	3,385.00	4,400,500
日清紡ホールディングス	18,900	1,051.00	19,863,900
倉敷紡績	2,800	2,298.00	6,434,400

ダイワボウホールディングス	2,400	6,260.00	15,024,000
シキボウ	1,200	1,267.00	1,520,400
日東紡績	4,200	5,130.00	21,546,000
トヨタ紡織	8,300	1,628.00	13,512,400
マクニカ・富士エレホールディングス	6,700	1,710.00	11,457,000
Hamee	600	1,628.00	976,800
ラクト・ジャパン	1,000	3,890.00	3,890,000
ウエルシアホールディングス	8,300	6,430.00	53,369,000
クリエイトSDホールディングス	4,700	2,684.00	12,614,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,300	1,050.00	5,565,000
八洲電機	2,200	886.00	1,949,200
レスターホールディングス	2,900	1,829.00	5,304,100
ジュテックホールディングス	1,600	1,163.00	1,860,800
丸善CHIホールディングス	5,000	366.00	1,830,000
OCHIホールディングス	1,200	1,475.00	1,770,000
TOKAIホールディングス	14,800	994.00	14,711,200
黒谷	3,600	485.00	1,746,000
ミサワ	2,600	714.00	1,856,400
ティーライフ	2,000	843.00	1,686,000
Cominix	2,200	813.00	1,788,600
三洋貿易	2,800	1,189.00	3,329,200
チムニー	900	2,206.00	1,985,400
シュッピン	1,900	970.00	1,843,000
ビューティガレージ	900	2,004.00	1,803,600
ウイン・パートナーズ	2,000	1,061.00	2,122,000
ネクステージ	4,000	1,003.00	4,012,000
ジョイフル本田	8,200	1,242.00	10,184,400
鳥貴族	900	2,643.00	2,378,700
キリン堂ホールディングス	1,100	1,696.00	1,865,600
ホットランド	1,900	1,258.00	2,390,200
すかいらーくホールディングス	31,400	1,836.00	57,650,400
SFPホールディングス	1,200	2,093.00	2,511,600
綿半ホールディングス	1,000	1,817.00	1,817,000
日本毛織	9,200	999.00	9,190,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8,100	962.00	7,792,200
三栄建築設計	1,200	1,513.00	1,815,600
野村不動産ホールディングス	17,000	2,725.00	46,325,000
三重交通グループホールディングス	5,700	575.00	3,277,500
サムティ	4,000	1,818.00	7,272,000
ディア・ライフ	3,600	577.00	2,077,200
コーセーアールイー	2,900	612.00	1,774,800
日本商業開発	1,800	1,773.00	3,191,400
プレサンスコーポレーション	4,600	1,273.00	5,855,800
ユニゾホールディングス	4,200	5,850.00	24,570,000
THEグローバル社	3,900	437.00	1,704,300
日本管理センター	1,800	1,387.00	2,496,600
サンセイランディック	2,000	823.00	1,646,000
エストラスト	2,100	823.00	1,728,300
フージャースホールディングス	5,600	695.00	3,892,000
オープンハウス	8,100	3,275.00	26,527,500
東急不動産ホールディングス	76,200	777.00	59,207,400
飯田グループホールディングス	23,400	1,631.00	38,165,400
イーランド	2,100	815.00	1,711,500
ムゲンエステート	2,600	596.00	1,549,600
帝国繊維	3,100	2,128.00	6,596,800
日本コークス工業	24,000	75.00	1,800,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,600	677.00	1,760,200
BEE NOS	1,600	1,115.00	1,784,000

あさひ	2,100	1,226.00	2,574,600
日本調剤	800	3,820.00	3,056,000
コスモス薬品	1,200	23,840.00	28,608,000
シップヘルスケアホールディングス	4,500	4,620.00	20,790,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,200	1,765.00	2,118,000
オンリー	2,300	778.00	1,789,400
セブン&アイ・ホールディングス	109,500	3,937.00	431,101,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,500	2,129.00	15,967,500
明治電機工業	1,200	1,452.00	1,742,400
ツルハホールディングス	6,100	12,720.00	77,592,000
サンマルクホールディングス	2,200	2,152.00	4,734,400
フェリシモ	1,800	939.00	1,690,200
トリドールホールディングス	3,500	2,810.00	9,835,000
帝人	22,700	1,979.00	44,923,300
東レ	201,500	704.60	141,976,900
クラレ	43,800	1,262.00	55,275,600
旭化成	184,500	1,018.50	187,913,250
サカイオーベックス	1,000	1,930.00	1,930,000
T O K Y O B A S E	3,600	452.00	1,627,200
稲葉製作所	1,600	1,337.00	2,139,200
宮地エンジニアリンググループ	900	1,988.00	1,789,200
トーカロ	7,800	1,110.00	8,658,000
アルファ	1,400	1,179.00	1,650,600
S U M C O	33,600	1,967.00	66,091,200
川田テクノロジーズ	600	6,140.00	3,684,000
R S T e c h n o l o g i e s	800	2,815.00	2,252,000
ハウスドゥ	1,500	1,158.00	1,737,000
アグレ都市デザイン	3,500	516.00	1,806,000
ジェイ・エス・ビー	300	5,180.00	1,554,000
テンポイノベーション	1,900	913.00	1,734,700
住江織物	800	2,346.00	1,876,800
日本フェルト	3,700	485.00	1,794,500
イチカワ	1,300	1,463.00	1,901,900
芦森工業	1,300	1,266.00	1,645,800
アツギ	2,400	781.00	1,874,400
J Mホールディングス	1,400	2,255.00	3,157,000
コメダホールディングス	6,100	2,131.00	12,999,100
サツドラホールディングス	1,000	1,807.00	1,807,000
パロックジャパンリミテッド	1,900	965.00	1,833,500
クスリのアオキホールディングス	2,500	6,700.00	16,750,000
スシローグローバルホールディングス	3,100	9,010.00	27,931,000
L I X I L ビバ	2,800	2,324.00	6,507,200
セーレン	6,800	1,587.00	10,791,600
ソトー	1,900	971.00	1,844,900
東海染工	1,600	1,136.00	1,817,600
小松マテーレ	4,600	802.00	3,689,200
ワコールホールディングス	7,300	2,777.00	20,272,100
ホギメディカル	3,200	3,295.00	10,544,000
クラウドシアホールディングス	3,800	464.00	1,763,200
T S I ホールディングス	9,300	494.00	4,594,200
マツオカコーポレーション	900	2,025.00	1,822,500
ワールド	3,900	2,306.00	8,993,400
T I S	9,300	7,130.00	66,309,000
電算システム	1,100	2,576.00	2,833,600
グリー	17,100	463.00	7,917,300
コーエーテクモホールディングス	5,700	3,000.00	17,100,000
三菱総合研究所	1,200	4,255.00	5,106,000
ボルテージ	3,500	512.00	1,792,000
電算	800	2,242.00	1,793,600

A G S	2,200	790.00	1,738,000
ファインデックス	2,300	879.00	2,021,700
ブレインパッド	700	5,060.00	3,542,000
K L a b	5,400	762.00	4,114,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,400	977.00	3,321,800
ネクソン	79,400	1,840.00	146,096,000
アイスタイル	7,800	341.00	2,659,800
エムアップ	800	2,700.00	2,160,000
エイチーム	1,900	897.00	1,704,300
エニゲモ	2,000	829.00	1,658,000
テクノスジャパン	3,500	496.00	1,736,000
コロプラ	9,100	928.00	8,444,800
オルトプラス	2,100	926.00	1,944,600
ブロードリーフ	13,800	515.00	7,107,000
クロス・マーケティンググループ	5,000	436.00	2,180,000
デジタルハーツホールディングス	1,800	963.00	1,733,400
システム情報	2,000	840.00	1,680,000
メディアドゥホールディングス	900	3,095.00	2,785,500
じげん	6,900	441.00	3,042,900
フィックスターズ	3,000	1,346.00	4,038,000
C A R T A H O L D I N G S	1,600	1,087.00	1,739,200
オブティム	700	4,440.00	3,108,000
セレス	1,400	1,281.00	1,793,400
S H I F T	700	7,390.00	5,173,000
特種東海製紙	1,800	4,005.00	7,209,000
ティーガイア	2,500	2,293.00	5,732,500
セック	500	3,625.00	1,812,500
豆蔵ホールディングス	1,900	1,881.00	3,573,900
テクマトリックス	2,000	2,850.00	5,700,000
プロシップ	1,300	1,382.00	1,796,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,700	1,889.00	12,656,300
G M O ペイメントゲートウェイ	4,600	7,570.00	34,822,000
ザッパラス	4,700	365.00	1,715,500
インターネットイニシアティブ	4,100	3,370.00	13,817,000
さくらインターネット	3,000	617.00	1,851,000
G M O クラウド	700	2,495.00	1,746,500
S R A ホールディングス	1,500	2,567.00	3,850,500
朝日ネット	2,600	721.00	1,874,600
e B A S E	1,700	1,700.00	2,890,000
アバント	2,000	981.00	1,962,000
アドソル日進	1,000	2,539.00	2,539,000
フリービット	2,100	813.00	1,707,300
コムチュア	3,100	2,236.00	6,931,600
サイバーコム	900	1,892.00	1,702,800
アステリア	3,100	532.00	1,649,200
アイル	1,000	1,803.00	1,803,000
王子ホールディングス	116,300	567.00	65,942,100
日本製紙	12,300	1,705.00	20,971,500
三菱製紙	4,000	438.00	1,752,000
北越コーポレーション	18,500	492.00	9,102,000
中越パルプ工業	1,200	1,472.00	1,766,400
大王製紙	12,200	1,438.00	17,543,600
阿波製紙	1,100	523.00	575,300
マークライズ	1,400	2,002.00	2,802,800
メディカル・データ・ビジョン	2,100	896.00	1,881,600
g u m i	3,600	724.00	2,606,400
モバイルファクトリー	1,000	1,828.00	1,828,000
テラスカイ	1,000	3,440.00	3,440,000

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,640.00	1,804,000
PCIホールディングス	800	2,254.00	1,803,200
PR TIMES	500	2,542.00	1,271,000
ランドコンピュータ	1,500	1,211.00	1,816,500
ダブルスタンダード	400	4,085.00	1,634,000
オーブンドア	1,400	1,190.00	1,666,000
アカツキ	1,000	4,760.00	4,760,000
Ubicomホールディングス	1,200	1,315.00	1,578,000
LINE	6,400	5,370.00	34,368,000
レンゴー	26,300	819.00	21,539,700
トーモク	1,700	1,686.00	2,866,200
ザ・パック	2,100	4,210.00	8,841,000
チェンジ	600	4,105.00	2,463,000
シンクロ・フード	3,300	410.00	1,353,000
オークネット	1,700	1,198.00	2,036,600
AOI TYO HOLDINGS	2,800	740.00	2,072,000
マクロミル	5,700	1,025.00	5,842,500
ビーグリー	1,400	1,480.00	2,072,000
オロ	700	3,195.00	2,236,500
昭和電工	19,800	2,654.00	52,549,200
住友化学	204,500	446.00	91,207,000
住友精化	1,200	3,130.00	3,756,000
日産化学	15,600	5,010.00	78,156,000
クレハ	2,400	6,130.00	14,712,000
多木化学	800	4,445.00	3,556,000
テイカ	2,000	1,659.00	3,318,000
石原産業	5,000	819.00	4,095,000
片倉コープアグリ	1,500	1,219.00	1,828,500
日本曹達	4,100	3,140.00	12,874,000
東ソー	43,000	1,631.00	70,133,000
トクヤマ	8,000	2,693.00	21,544,000
セントラル硝子	5,700	2,292.00	13,064,400
東亜合成	17,500	1,221.00	21,367,500
大阪ソーダ	2,800	2,720.00	7,616,000
関東電化工業	6,600	1,026.00	6,771,600
デンカ	10,200	2,948.00	30,069,600
イビデン	17,400	2,750.00	47,850,000
信越化学工業	47,800	13,755.00	657,489,000
日本カーバイド工業	1,400	1,264.00	1,769,600
堺化学工業	1,800	2,187.00	3,936,600
第一稀元素化学工業	3,000	855.00	2,565,000
エア・ウォーター	25,900	1,513.00	39,186,700
大陽日酸	26,700	2,167.00	57,858,900
日本化学工業	900	2,672.00	2,404,800
日本パーカライジング	14,000	1,105.00	15,470,000
高圧ガス工業	4,400	761.00	3,348,400
四国化成工業	4,300	1,230.00	5,289,000
ステラ ケミファ	1,500	3,250.00	4,875,000
保土谷化学工業	1,000	4,305.00	4,305,000
日本触媒	4,300	6,030.00	25,929,000
大日精化工業	2,500	2,633.00	6,582,500
カネカ	7,200	3,315.00	23,868,000
協和キリン	28,600	2,702.00	77,277,200
三菱瓦斯化学	26,300	1,824.00	47,971,200
三井化学	25,300	2,546.00	64,413,800
JSR	25,900	2,167.00	56,125,300
東京応化工業	4,800	4,480.00	21,504,000
大阪有機化学工業	2,600	1,726.00	4,487,600
三菱ケミカルホールディングス	186,000	789.30	146,809,800

KHネオケム	4,900	2,465.00	12,078,500
ダイセル	38,100	989.00	37,680,900
住友ベークライト	4,400	3,610.00	15,884,000
積水化学工業	59,800	1,793.00	107,221,400
日本ゼオン	25,100	1,225.00	30,747,500
アイカ工業	8,300	3,465.00	28,759,500
宇部興産	14,100	2,169.00	30,582,900
積水樹脂	5,000	2,359.00	11,795,000
タキロンシーアイ	6,000	635.00	3,810,000
旭有機材	1,600	1,620.00	2,592,000
日立化成	12,900	4,610.00	59,469,000
ニチバン	1,500	1,675.00	2,512,500
リケンテクノス	7,000	469.00	3,283,000
大倉工業	1,300	1,654.00	2,150,200
積水化成品工業	3,700	685.00	2,534,500
群栄化学工業	700	2,449.00	1,714,300
タイガースポリマー	3,200	582.00	1,862,400
ダイキョーニシカワ	5,900	723.00	4,265,700
竹本容器	2,100	856.00	1,797,600
森六ホールディングス	1,500	2,149.00	3,223,500
日本化薬	17,200	1,274.00	21,912,800
カーリットホールディングス	3,100	558.00	1,729,800
E P Sホールディングス	4,100	1,269.00	5,202,900
プレステージ・インターナショナル	10,200	971.00	9,904,200
プロトコーポレーション	2,500	1,359.00	3,397,500
アミューズ	1,500	2,639.00	3,958,500
野村総合研究所	39,500	2,696.00	106,492,000
クイック	1,700	1,431.00	2,432,700
T A C	8,900	198.00	1,762,200
C Eホールディングス	3,600	469.00	1,688,400
ケネディクス	25,300	678.00	17,153,400
電通グループ	28,000	3,325.00	93,100,000
インテージホールディングス	3,500	841.00	2,943,500
東邦システムサイエンス	2,000	907.00	1,814,000
ぴあ	800	3,840.00	3,072,000
イオンファンタジー	1,000	2,186.00	2,186,000
ソースネクスト	13,200	401.00	5,293,200
シーティーエス	3,100	689.00	2,135,900
ネクシィーズグループ	1,100	1,578.00	1,735,800
インフォコム	3,000	2,807.00	8,421,000
メディカルシステムネットワーク	3,700	476.00	1,761,200
日本精化	2,200	1,394.00	3,066,800
扶桑化学工業	2,800	3,360.00	9,408,000
トリケミカル研究所	600	9,530.00	5,718,000
ラクスル	1,500	3,435.00	5,152,500
F I G	6,300	288.00	1,814,400
A D E K A	12,800	1,557.00	19,929,600
日油	10,500	3,735.00	39,217,500
ミヨシ油脂	1,500	1,077.00	1,615,500
新日本理化	8,600	197.00	1,694,200
ハリマ化成グループ	2,300	1,053.00	2,421,900
イーソル	1,000	1,871.00	1,871,000
アルテリア・ネットワークス	3,100	1,890.00	5,859,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,100	1,514.00	1,665,400
花王	68,000	8,407.00	571,676,000
第一工業製薬	1,000	4,240.00	4,240,000
日華化学	2,100	777.00	1,631,700
ニイタカ	800	2,670.00	2,136,000
三洋化成工業	1,700	4,835.00	8,219,500

武田薬品工業	236,400	4,229.00	999,735,600
アステラス製薬	249,900	1,915.50	478,683,450
大日本住友製薬	21,100	1,712.00	36,123,200
塩野義製薬	36,300	6,460.00	234,498,000
わかもと製薬	7,000	265.00	1,855,000
あすか製薬	3,200	1,118.00	3,577,600
日本新薬	7,400	9,160.00	67,784,000
ビオフェルミン製薬	800	2,383.00	1,906,400
中外製薬	29,600	12,255.00	362,748,000
科研製薬	4,900	5,820.00	28,518,000
エーザイ	34,000	8,997.00	305,898,000
理研ビタミン	1,300	4,020.00	5,226,000
ロート製薬	14,600	3,340.00	48,764,000
小野薬品工業	65,300	2,566.00	167,559,800
久光製薬	7,600	5,570.00	42,332,000
有機合成薬品工業	6,900	415.00	2,863,500
持田製薬	3,900	4,275.00	16,672,500
参天製薬	52,900	1,963.00	103,842,700
扶桑薬品工業	1,000	2,028.00	2,028,000
ツムラ	8,800	2,806.00	24,692,800
日医工	8,000	1,331.00	10,648,000
テルモ	80,400	3,775.00	303,510,000
みらかホールディングス	7,600	2,775.00	21,090,000
キッセイ薬品工業	5,000	2,862.00	14,310,000
生化学工業	5,500	1,235.00	6,792,500
栄研化学	5,000	2,240.00	11,200,000
日水製薬	1,400	1,313.00	1,838,200
鳥居薬品	1,800	3,625.00	6,525,000
JCRファーマ	2,000	11,060.00	22,120,000
東和薬品	3,600	2,408.00	8,668,800
富士製薬工業	1,900	1,235.00	2,346,500
沢井製薬	5,800	7,000.00	40,600,000
ゼリア新薬工業	5,200	1,952.00	10,150,400
第一三共	81,300	7,655.00	622,351,500
キョーリン製薬ホールディングス	6,300	2,136.00	13,456,800
大幸薬品	1,100	4,985.00	5,483,500
ダイト	1,700	3,315.00	5,635,500
大塚ホールディングス	54,100	4,492.00	243,017,200
大正製薬ホールディングス	6,000	7,250.00	43,500,000
ペプチドリーム	14,400	5,070.00	73,008,000
大日本塗料	3,100	1,060.00	3,286,000
日本ペイントホールディングス	23,000	5,070.00	116,610,000
関西ペイント	31,300	2,556.00	80,002,800
中国塗料	7,900	945.00	7,465,500
日本特殊塗料	2,100	1,201.00	2,522,100
藤倉化成	3,800	531.00	2,017,800
太陽ホールディングス	2,000	4,710.00	9,420,000
DIC	11,800	2,909.00	34,326,200
サカタインクス	6,100	1,160.00	7,076,000
東洋インキSCホールディングス	5,900	2,410.00	14,219,000
T&K TOKA	2,200	930.00	2,046,000
アルプス技研	2,400	1,939.00	4,653,600
日本空調サービス	2,800	770.00	2,156,000
オリエンタルランド	28,900	13,455.00	388,849,500
フォーカスシステムズ	1,900	899.00	1,708,100
ダスキン	7,000	2,999.00	20,993,000
パーク24	15,000	2,579.00	38,685,000
明光ネットワークジャパン	3,200	918.00	2,937,600
ファルコホールディングス	1,500	1,928.00	2,892,000
クレスコ	1,700	1,894.00	3,219,800

フジ・メディア・ホールディングス	26,900	1,411.00	37,955,900
秀英予備校	4,000	444.00	1,776,000
ラウンドワン	7,600	950.00	7,220,000
リゾートトラスト	12,400	1,603.00	19,877,200
オービック	9,700	14,780.00	143,366,000
ジャストシステム	4,500	5,100.00	22,950,000
TDCソフト	2,400	920.00	2,208,000
Zホールディングス	382,900	442.00	169,241,800
ビー・エム・エル	3,500	3,215.00	11,252,500
トレンドマイクロ	12,400	5,890.00	73,036,000
りらいあコミュニケーションズ	4,900	1,405.00	6,884,500
IDホールディングス	1,100	1,630.00	1,793,000
リソー教育	12,400	381.00	4,724,400
日本オラクル	5,700	9,680.00	55,176,000
アルファシステムズ	900	2,829.00	2,546,100
フューチャー	3,400	1,778.00	6,045,200
CAC Holdings	1,800	1,301.00	2,341,800
SBテクノロジー	1,000	2,379.00	2,379,000
トーセ	1,900	889.00	1,689,100
ユー・エス・エス	30,400	1,852.00	56,300,800
オービックビジネスコンサルタント	2,800	4,220.00	11,816,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,700	3,365.00	42,735,500
アイティフォー	3,400	749.00	2,546,600
東京個別指導学院	1,700	656.00	1,115,200
東計電算	400	4,485.00	1,794,000
サイバーエージェント	15,600	4,350.00	67,860,000
楽天	126,600	987.00	124,954,200
エクスネット	1,900	976.00	1,854,400
クリーク・アンド・リバー社	1,700	1,044.00	1,774,800
テー・オー・ダブリュー	2,200	864.00	1,900,800
大塚商会	15,100	4,920.00	74,292,000
サイボウズ	3,300	2,106.00	6,949,800
山田コンサルティンググループ	1,300	1,501.00	1,951,300
セントラルスポーツ	1,000	2,975.00	2,975,000
電通国際情報サービス	1,700	5,050.00	8,585,000
デジタルガレージ	5,000	4,000.00	20,000,000
イーエムシステムズ	3,900	903.00	3,521,700
ウェザーニューズ	900	3,885.00	3,496,500
C I J	2,200	816.00	1,795,200
ビジネスエンジニアリング	500	3,200.00	1,600,000
日本エンタープライズ	6,900	258.00	1,780,200
WOWOW	1,300	2,660.00	3,458,000
スカラ	2,400	707.00	1,696,800
フルキャストホールディングス	2,700	2,300.00	6,210,000
エン・ジャパン	4,800	3,435.00	16,488,000
富士フイルムホールディングス	54,500	5,414.00	295,063,000
コニカミノルタ	62,100	645.00	40,054,500
資生堂	56,500	6,938.00	391,997,000
ライオン	36,900	1,989.00	73,394,100
高砂香料工業	1,800	2,296.00	4,132,800
マンダム	6,400	2,548.00	16,307,200
ミルボン	3,800	5,770.00	21,926,000
ファンケル	11,500	3,060.00	35,190,000
コーセー	5,300	14,240.00	75,472,000
コタ	1,500	1,486.00	2,229,000
シーボン	700	2,438.00	1,706,600
ポーラ・オルビスホールディングス	12,100	2,254.00	27,273,400
ノエビアホールディングス	2,700	5,160.00	13,932,000
アジュバンコスメジャパン	1,800	991.00	1,783,800
エステー	1,800	1,607.00	2,892,600



アグロ カネショウ	1,200	1,384.00	1,660,800
コニシ	4,700	1,536.00	7,219,200
長谷川香料	3,800	2,166.00	8,230,800
星光PMC	2,000	876.00	1,752,000
小林製薬	8,000	8,500.00	68,000,000
荒川化学工業	2,600	1,507.00	3,918,200
メック	2,000	1,522.00	3,044,000
日本高純度化学	800	2,675.00	2,140,000
タカラバイオ	7,400	2,278.00	16,857,200
JCU	3,400	2,970.00	10,098,000
新田ゼラチン	2,700	643.00	1,736,100
デクセリアルズ	7,300	910.00	6,643,000
アース製薬	2,100	6,080.00	12,768,000
北興化学工業	2,900	612.00	1,774,800
大成ラミック	900	2,866.00	2,579,400
クミアイ化学工業	11,700	834.00	9,757,800
日本農薬	5,100	552.00	2,815,200
富士興産	2,700	667.00	1,800,900
ニチレキ	3,400	1,392.00	4,732,800
ユシロ化学工業	1,600	1,340.00	2,144,000
ピーピー・カストロール	1,300	1,392.00	1,809,600
富士石油	3,600	233.00	838,800
MORESCO	1,300	1,340.00	1,742,000
出光興産	32,000	2,922.00	93,504,000
JXTGホールディングス	427,500	473.60	202,464,000
コスモエネルギーホールディングス	8,200	2,027.00	16,621,400
横浜ゴム	16,500	2,014.00	33,231,000
TOYO TIRE	16,300	1,642.00	26,764,600
ブリヂストン	87,300	3,954.00	345,184,200
住友ゴム工業	25,600	1,258.00	32,204,800
オカモト	1,800	3,630.00	6,534,000
アキレス	2,000	1,941.00	3,882,000
フコク	2,600	670.00	1,742,000
ニッタ	3,200	2,829.00	9,052,800
クリエートメディック	1,600	1,121.00	1,793,600
住友理工	5,500	829.00	4,559,500
三ツ星ベルト	3,700	1,754.00	6,489,800
パンドー化学	5,000	826.00	4,130,000
AGC	28,100	3,470.00	97,507,000
日本板硝子	13,600	561.00	7,629,600
有沢製作所	4,500	913.00	4,108,500
日本山村硝子	1,500	1,163.00	1,744,500
日本電気硝子	11,400	2,043.00	23,290,200
オハラ	1,400	1,264.00	1,769,600
住友大阪セメント	5,400	4,145.00	22,383,000
太平洋セメント	17,900	2,913.00	52,142,700
リソルホールディングス	400	4,135.00	1,654,000
日本ヒューム	2,800	758.00	2,122,400
日本コンクリート工業	6,500	281.00	1,826,500
三谷セキサン	1,300	3,825.00	4,972,500
アジアパイルホールディングス	4,100	531.00	2,177,100
東海カーボン	29,800	1,016.00	30,276,800
日本カーボン	1,500	4,045.00	6,067,500
東洋炭素	1,700	2,001.00	3,401,700
ノリタケカンパニーリミテド	1,600	4,195.00	6,712,000
TOTO	20,300	4,545.00	92,263,500
日本碍子	34,700	1,896.00	65,791,200
日本特殊陶業	22,100	1,934.00	42,741,400
MARUWA	1,100	7,710.00	8,481,000
品川リフラクトリーズ	700	2,902.00	2,031,400

黒崎播磨	600	6,390.00	3,834,000
ヨータイ	2,700	670.00	1,809,000
イソライト工業	3,100	555.00	1,720,500
ニッカトー	2,700	659.00	1,779,300
フジインコーポレーテッド	2,500	3,120.00	7,800,000
クニミネ工業	1,200	1,206.00	1,447,200
ニチアス	7,800	2,570.00	20,046,000
日本製鉄	125,800	1,349.50	169,767,100
神戸製鋼所	51,400	448.00	23,027,200
中山製鋼所	3,900	455.00	1,774,500
合同製鐵	1,500	2,748.00	4,122,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	75,900	1,106.00	83,945,400
東京製鐵	13,700	787.00	10,781,900
共英製鋼	3,200	1,864.00	5,964,800
大和工業	6,000	2,501.00	15,006,000
東京鐵鋼	1,200	1,385.00	1,662,000
大阪製鐵	1,500	1,615.00	2,422,500
淀川製鋼所	3,800	1,988.00	7,554,400
丸一鋼管	9,100	2,843.00	25,871,300
モリ工業	800	2,607.00	2,085,600
大同特殊鋼	4,600	4,250.00	19,550,000
日本高周波鋼業	4,300	401.00	1,724,300
日本冶金工業	2,300	2,004.00	4,609,200
山陽特殊製鋼	1,900	1,426.00	2,709,400
愛知製鋼	1,600	3,400.00	5,440,000
日立金属	30,300	1,700.00	51,510,000
日本金属	2,200	806.00	1,773,200
大平洋金属	1,900	2,300.00	4,370,000
新日本電工	18,100	172.00	3,113,200
栗本鐵工所	1,400	2,099.00	2,938,600
日本製鋼所	8,500	1,785.00	15,172,500
三菱製鋼	2,100	982.00	2,062,200
日亜鋼業	5,700	307.00	1,749,900
日本精線	300	3,555.00	1,066,500
大紀アルミニウム工業所	4,600	663.00	3,049,800
日本軽金属ホールディングス	71,100	217.00	15,428,700
三井金属鉱業	7,600	2,990.00	22,724,000
東邦亜鉛	1,400	1,808.00	2,531,200
三菱マテリアル	18,600	2,779.00	51,689,400
住友金属鉱山	35,900	3,050.00	109,495,000
DOWAホールディングス	7,100	3,925.00	27,867,500
古河機械金属	5,000	1,342.00	6,710,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	1,285.00	3,726,500
東邦チタニウム	5,000	853.00	4,265,000
UACJ	4,300	2,107.00	9,060,100
CKサンエツ	600	3,345.00	2,007,000
古河電気工業	8,700	2,552.00	22,202,400
住友電気工業	105,100	1,453.00	152,710,300
フジクラ	33,900	387.00	13,119,300
昭和電線ホールディングス	3,300	1,290.00	4,257,000
東京特殊電線	100	2,568.00	256,800
タツタ電線	5,600	572.00	3,203,200
カナレ電気	1,000	1,786.00	1,786,000
平河ヒューテック	1,300	1,303.00	1,693,900
リョービ	3,500	1,646.00	5,761,000
アーレスティ	3,700	510.00	1,887,000
アサヒホールディングス	4,900	2,736.00	13,406,400
東洋製罐グループホールディングス	17,900	1,962.00	35,119,800
ホッカンホールディングス	1,500	1,814.00	2,721,000
コロナ	1,800	1,009.00	1,816,200

横河ブリッジホールディングス	5,200	2,175.00	11,310,000
OSJBホールディングス	14,100	264.00	3,722,400
三和ホールディングス	27,000	1,099.00	29,673,000
文化シャッター	8,300	836.00	6,938,800
三協立山	3,600	1,294.00	4,658,400
アルインコ	2,000	1,075.00	2,150,000
LIXILグループ	41,500	1,910.00	79,265,000
日本ファイルコン	3,500	514.00	1,799,000
ノーリツ	5,800	1,310.00	7,598,000
長府製作所	2,900	2,250.00	6,525,000
リンナイ	5,500	8,190.00	45,045,000
ユニプレス	5,500	1,292.00	7,106,000
ダイニチ工業	2,600	653.00	1,697,800
日東精工	3,900	538.00	2,098,200
三洋工業	900	1,983.00	1,784,700
岡部	5,700	856.00	4,879,200
ジーテクト	3,500	1,467.00	5,134,500
東プレ	5,200	1,599.00	8,314,800
高周波熱錬	5,400	817.00	4,411,800
東京製網	2,000	948.00	1,896,000
サンコール	1,400	548.00	767,200
モリテックスチール	5,100	336.00	1,713,600
パイオラックス	4,200	1,787.00	7,505,400
エイチワン	2,800	680.00	1,904,000
日本発条	30,100	905.00	27,240,500
三浦工業	12,200	3,765.00	45,933,000
タクマ	9,500	1,249.00	11,865,500
テクノプロ・ホールディングス	5,400	7,630.00	41,202,000
インターワークス	3,300	539.00	1,778,700
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	7,540.00	8,294,000
Keeper 技研	1,500	1,157.00	1,735,500
三機サービス	1,800	999.00	1,798,200
Gunosy	1,700	1,155.00	1,963,500
イー・ガーディアン	1,400	1,915.00	2,681,000
リブセンス	6,400	281.00	1,798,400
ジャパンマテリアル	8,300	1,483.00	12,308,900
ベクトル	3,400	1,139.00	3,872,600
ウチヤマホールディングス	3,800	442.00	1,679,600
チャーム・ケア・コーポレーション	2,300	933.00	2,145,900
キャリアリンク	3,200	567.00	1,814,400
IBJ	1,900	1,164.00	2,211,600
アサンテ	1,100	1,875.00	2,062,500
N・フィールド	3,000	562.00	1,686,000
バリュール	600	3,440.00	2,064,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	3,710.00	7,049,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,000	1,666.00	1,666,000
E R Iホールディングス	2,300	771.00	1,773,300
アビスト	700	2,520.00	1,764,000
シグマクシス	1,900	1,663.00	3,159,700
ウィルグループ	1,800	987.00	1,776,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	212.00	1,823,200
リクルートホールディングス	194,500	4,488.00	872,916,000
エラン	1,600	1,624.00	2,598,400
ツガミ	5,800	994.00	5,765,200
オークマ	3,300	4,950.00	16,335,000
東芝機械	3,200	3,200.00	10,240,000
アマダホールディングス	35,700	1,070.00	38,199,000
アイダエンジニアリング	7,400	882.00	6,526,800
滝澤鉄工所	1,400	1,277.00	1,787,800

F U J I	12,100	1,870.00	22,627,000
牧野フライス製作所	3,300	4,040.00	13,332,000
オーエスジー	13,000	1,763.00	22,919,000
ダイジェット工業	1,300	1,343.00	1,745,900
旭ダイヤモンド工業	7,400	574.00	4,247,600
D M G 森精機	17,800	1,519.00	27,038,200
ソディック	6,600	821.00	5,418,600
ディスコ	3,800	24,710.00	93,898,000
日東工器	1,500	2,444.00	3,666,000
日進工具	800	2,778.00	2,222,400
パンチ工業	4,100	407.00	1,668,700
日本郵政	222,500	1,003.50	223,278,750
ベルシステム24ホールディングス	4,500	1,485.00	6,682,500
鎌倉新書	2,000	1,644.00	3,288,000
一蔵	2,700	611.00	1,649,700
L I T A L I C O	900	2,433.00	2,189,700
エアトリ	1,200	1,336.00	1,603,200
アトラエ	700	2,847.00	1,992,900
ストライク	1,000	4,640.00	4,640,000
ソラスト	7,500	1,073.00	8,047,500
セラク	1,500	1,231.00	1,846,500
インソース	1,300	2,879.00	3,742,700
豊田自動織機	23,000	6,370.00	146,510,000
豊和工業	2,300	773.00	1,777,900
O K K	2,900	595.00	1,725,500
東洋機械金属	3,500	504.00	1,764,000
エンシュウ	1,000	1,103.00	1,103,000
島精機製作所	4,500	1,907.00	8,581,500
オプトラ	3,100	3,315.00	10,276,500
N C ホールディングス	2,600	655.00	1,703,000
イワキ	1,500	1,058.00	1,587,000
フリー	2,700	1,143.00	3,086,100
ヤマシンフィルタ	6,100	710.00	4,331,000
日阪製作所	3,500	935.00	3,272,500
やまびこ	5,400	997.00	5,383,800
平田機工	1,300	5,750.00	7,475,000
ペガサスミシン製造	3,900	452.00	1,762,800
ナブテスコ	16,600	3,225.00	53,535,000
三井海洋開発	3,000	2,009.00	6,027,000
レオン自動機	2,800	1,318.00	3,690,400
S M C	8,900	49,020.00	436,278,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	2,900	748.00	2,169,200
ホソカワミクロン	1,000	5,370.00	5,370,000
ユニオンツール	1,000	2,985.00	2,985,000
オイレス工業	3,600	1,529.00	5,504,400
日精エー・エス・ピー機械	900	4,090.00	3,681,000
サトーホールディングス	4,000	2,738.00	10,952,000
技研製作所	2,500	4,315.00	10,787,500
日本エアーテック	1,900	1,139.00	2,164,100
カワタ	1,800	995.00	1,791,000
日精樹脂工業	2,400	931.00	2,234,400
オカダアイヨン	1,500	1,058.00	1,587,000
小松製作所	128,700	2,283.00	293,822,100
住友重機械工業	16,300	2,636.00	42,966,800
日立建機	11,400	2,953.00	33,664,200
日工	3,900	761.00	2,967,900
巴工業	1,200	2,120.00	2,544,000
井関農機	2,800	1,361.00	3,810,800
T O W A	2,900	1,103.00	3,198,700

丸山製作所	1,100	1,632.00	1,795,200
北川鉄工所	1,300	1,980.00	2,574,000
シンニッタン	4,400	382.00	1,680,800
ローツェ	1,200	3,935.00	4,722,000
タカキタ	3,400	531.00	1,805,400
クボタ	150,800	1,592.00	240,073,600
荏原実業	900	2,007.00	1,806,300
東洋エンジニアリング	3,700	575.00	2,127,500
三菱化工機	1,000	1,902.00	1,902,000
月島機械	5,200	1,357.00	7,056,400
帝国電機製作所	2,300	1,459.00	3,355,700
新東工業	6,700	900.00	6,030,000
澁谷工業	2,500	2,703.00	6,757,500
アイチコーポレーション	4,900	684.00	3,351,600
小森コーポレーション	7,200	925.00	6,660,000
鶴見製作所	2,200	1,928.00	4,241,600
荏原製作所	11,700	2,855.00	33,403,500
西島製作所	2,900	844.00	2,447,600
北越工業	2,900	1,295.00	3,755,500
ダイキン工業	36,200	15,455.00	559,471,000
オルガノ	1,000	6,920.00	6,920,000
トーヨーカネツ	1,200	2,449.00	2,938,800
栗田工業	15,400	3,220.00	49,588,000
橋本チエイン	4,100	3,215.00	13,181,500
日機装	8,500	1,093.00	9,290,500
木村化工機	3,200	556.00	1,779,200
レイズネクスト	4,800	1,281.00	6,148,800
アネスト岩田	4,400	1,035.00	4,554,000
ダイフク	14,500	7,040.00	102,080,000
サムコ	900	1,886.00	1,697,400
加藤製作所	1,600	1,466.00	2,345,600
油研工業	1,100	1,672.00	1,839,200
タダノ	13,700	1,018.00	13,946,600
フジテック	10,300	1,691.00	17,417,300
C K D	7,900	1,931.00	15,254,900
キトー	2,100	1,652.00	3,469,200
平和	7,900	2,267.00	17,909,300
理想科学工業	2,500	1,899.00	4,747,500
SANKYO	6,300	3,940.00	24,822,000
日本金銭機械	3,100	771.00	2,390,100
マースグループホールディングス	1,800	2,011.00	3,619,800
フクシマガリレイ	1,800	4,095.00	7,371,000
ダイコク電機	1,300	1,391.00	1,808,300
竹内製作所	4,800	1,904.00	9,139,200
アマノ	7,400	2,890.00	21,386,000
JUKI	4,000	827.00	3,308,000
サンデンホールディングス	3,700	640.00	2,368,000
蛇の目マシン工業	4,600	392.00	1,803,200
ブラザー工業	34,700	2,134.00	74,049,800
マックス	4,300	2,006.00	8,625,800
モリタホールディングス	5,000	1,796.00	8,980,000
グローリー	7,300	3,220.00	23,506,000
新晃工業	2,600	1,664.00	4,326,400
大和冷機工業	4,100	1,050.00	4,305,000
セガサミーホールディングス	28,200	1,676.00	47,263,200
日本ピストンリング	1,300	1,487.00	1,933,100
リケン	1,300	3,420.00	4,446,000
T P R	3,800	1,671.00	6,349,800
ツバキ・ナカシマ	5,800	1,197.00	6,942,600
ホシザキ	8,300	10,310.00	85,573,000

大豊工業	2,600	672.00	1,747,200
日本精工	53,500	901.00	48,203,500
NTN	65,800	291.00	19,147,800
ジェイテクト	27,300	1,156.00	31,558,800
不二越	2,600	3,995.00	10,387,000
ミネベアミツミ	52,700	2,189.00	115,360,300
日本トムソン	8,400	431.00	3,620,400
THK	16,500	2,755.00	45,457,500
ユーション精機	2,200	893.00	1,964,600
前澤給装工業	1,000	2,215.00	2,215,000
イーグル工業	3,500	933.00	3,265,500
日本ピラー工業	2,900	1,475.00	4,277,500
キッツ	11,500	700.00	8,050,000
日立製作所	136,500	4,178.00	570,297,000
三菱電機	284,100	1,556.00	442,059,600
富士電機	17,100	3,355.00	57,370,500
東洋電機製造	1,200	1,384.00	1,660,800
安川電機	30,600	3,705.00	113,373,000
シンフォニアテクノロジー	3,700	1,187.00	4,391,900
明電舎	5,200	1,960.00	10,192,000
オリジン	1,200	1,476.00	1,771,200
山洋電気	1,400	5,100.00	7,140,000
デンヨー	2,400	2,032.00	4,876,800
ベイカレント・コンサルティング	1,600	7,640.00	12,224,000
MS - J a p a n	1,300	1,262.00	1,640,600
グレイステクノロジー	1,200	3,050.00	3,660,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,900	2,160.00	6,264,000
フルテック	1,600	1,125.00	1,800,000
日総工産	2,000	807.00	1,614,000
キュービーネットホールディングス	1,100	2,229.00	2,451,900
R P Aホールディングス	1,700	1,133.00	1,926,100
三櫻工業	3,600	1,045.00	3,762,000
マキタ	37,100	4,105.00	152,295,500
東芝テック	3,600	4,140.00	14,904,000
芝浦メカトロニクス	500	3,325.00	1,662,500
マブチモーター	7,900	4,120.00	32,548,000
日本電産	34,200	14,070.00	481,194,000
トレックス・セミコンダクター	1,600	1,508.00	2,412,800
東光高岳	1,600	1,145.00	1,832,000
ダブル・スコープ	4,500	780.00	3,510,000
ダイヘン	3,100	3,285.00	10,183,500
ヤーマン	4,600	620.00	2,852,000
J V Cケンウッド	23,100	256.00	5,913,600
ミマキエンジニアリング	3,600	502.00	1,807,200
第一精工	1,200	2,389.00	2,866,800
日新電機	6,700	1,118.00	7,490,600
大崎電気工業	5,700	610.00	3,477,000
オムロン	25,500	6,660.00	169,830,000
日東工業	4,200	2,135.00	8,967,000
I D E C	4,100	1,846.00	7,568,600
不二電機工業	1,500	1,210.00	1,815,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	9,500	2,118.00	20,121,000
サクサホールディングス	1,000	1,839.00	1,839,000
メルコホールディングス	1,000	2,549.00	2,549,000
日本電気	34,500	4,780.00	164,910,000
富士通	27,400	12,485.00	342,089,000
沖電気工業	11,500	1,324.00	15,226,000
電気興業	1,400	3,300.00	4,620,000
サンケン電気	3,100	3,050.00	9,455,000

アイホン	1,600	1,708.00	2,732,800
ルネサスエレクトロニクス	135,800	772.00	104,837,600
セイコーエプソン	35,300	1,696.00	59,868,800
ワコム	19,100	388.00	7,410,800
アルパック	5,200	3,605.00	18,746,000
E I Z O	2,200	3,810.00	8,382,000
ジャパンディスプレイ	82,100	73.00	5,993,300
日本信号	7,200	1,340.00	9,648,000
京三製作所	6,700	544.00	3,644,800
能美防災	3,800	2,317.00	8,804,600
ホーチキ	2,100	1,377.00	2,891,700
エレコム	3,100	3,885.00	12,043,500
パナソニック	324,600	1,195.00	387,897,000
シャープ	32,900	1,483.00	48,790,700
アンリツ	18,300	2,002.00	36,636,600
富士通ゼネラル	7,700	2,414.00	18,587,800
ソニー	179,700	7,479.00	1,343,976,300
T D K	13,700	11,310.00	154,947,000
帝国通信工業	1,500	1,234.00	1,851,000
タムラ製作所	9,500	567.00	5,386,500
アルプスアルパイン	25,100	1,842.00	46,234,200
池上通信機	1,700	1,029.00	1,749,300
日本電波工業	3,700	481.00	1,779,700
鈴木	2,100	875.00	1,837,500
日本トリム	400	3,735.00	1,494,000
ローランド ディー・ジー	1,600	1,844.00	2,950,400
フォスター電機	3,000	1,602.00	4,806,000
S M K	700	2,816.00	1,971,200
ヨコオ	1,800	2,923.00	5,261,400
ホシデン	7,800	1,079.00	8,416,200
ヒロセ電機	4,400	12,840.00	56,496,000
日本航空電子工業	6,500	1,911.00	12,421,500
T O A	3,000	1,017.00	3,051,000
マクセルホールディングス	6,100	1,419.00	8,655,900
古野電気	3,700	1,060.00	3,922,000
ユニデンホールディングス	900	2,084.00	1,875,600
スミダコーポレーション	2,200	1,116.00	2,455,200
アイコム	1,600	2,564.00	4,102,400
リオン	1,200	2,747.00	3,296,400
船井電機	2,900	706.00	2,047,400
横河電機	26,100	1,951.00	50,921,100
新電元工業	1,000	3,425.00	3,425,000
アズビル	17,900	2,952.00	52,840,800
東亜ディーケーケー	1,800	968.00	1,742,400
日本光電工業	11,700	3,505.00	41,008,500
共和電業	4,000	428.00	1,712,000
日本電子材料	1,600	999.00	1,598,400
堀場製作所	5,600	6,660.00	37,296,000
アドバンテスト	21,100	5,560.00	117,316,000
小野測器	3,000	578.00	1,734,000
エスベック	2,500	2,183.00	5,457,500
キーエンス	25,700	38,540.00	990,478,000
日置電機	1,500	3,630.00	5,445,000
シスメックス	20,300	7,409.00	150,402,700
日本マイクロニクス	4,900	1,081.00	5,296,900
メガチップス	2,600	1,816.00	4,721,600
O B A R A G R O U P	1,500	3,130.00	4,695,000
I M A G I C A G R O U P	3,800	457.00	1,736,600
澤藤電機	900	1,954.00	1,758,600
デンソー	62,600	4,452.00	278,695,200

原田工業	1,900	963.00	1,829,700
コーセル	3,800	1,146.00	4,354,800
イリソ電子工業	2,400	4,065.00	9,756,000
オブテックスグループ	4,700	1,504.00	7,068,800
千代田インテグレ	1,300	2,121.00	2,757,300
アイ・オー・データ機器	1,900	903.00	1,715,700
レーザーテック	12,500	5,520.00	69,000,000
スタンレー電気	20,000	2,901.00	58,020,000
岩崎電気	1,100	1,668.00	1,834,800
ウシオ電機	16,500	1,464.00	24,156,000
岡谷電機産業	4,900	363.00	1,778,700
ヘリオス テクノ ホールディング	4,300	392.00	1,685,600
エノモト	1,400	1,224.00	1,713,600
日本セラミック	2,900	2,480.00	7,192,000
遠藤照明	2,600	686.00	1,783,600
古河電池	2,400	704.00	1,689,600
山一電機	2,100	1,843.00	3,870,300
図研	1,800	2,400.00	4,320,000
日本電子	5,600	3,275.00	18,340,000
カシオ計算機	25,100	2,079.00	52,182,900
ファナック	27,000	20,180.00	544,860,000
日本シイエムケイ	6,700	561.00	3,758,700
エンプラス	1,400	3,020.00	4,228,000
ローム	12,600	8,300.00	104,580,000
浜松ホトニクス	20,400	4,605.00	93,942,000
三井ハイテック	3,100	1,630.00	5,053,000
新光電気工業	9,500	1,384.00	13,148,000
京セラ	40,000	7,452.00	298,080,000
協栄産業	1,300	1,370.00	1,781,000
太陽誘電	12,600	3,535.00	44,541,000
村田製作所	83,500	6,256.00	522,376,000
双葉電子工業	4,500	1,165.00	5,242,500
日東電工	19,600	5,920.00	116,032,000
北陸電気工業	1,600	1,048.00	1,676,800
東海理化電機製作所	7,500	1,810.00	13,575,000
ニチコン	9,600	873.00	8,380,800
日本ケミコン	2,200	1,821.00	4,006,200
K O A	4,300	1,197.00	5,147,100
三井E & Sホールディングス	10,300	865.00	8,909,500
日立造船	22,500	424.00	9,540,000
三菱重工業	47,600	3,768.00	179,356,800
川崎重工業	22,100	2,205.00	48,730,500
I H I	20,500	2,729.00	55,944,500
名村造船所	9,200	241.00	2,217,200
スプリックス	1,700	983.00	1,671,100
日本車輛製造	1,000	2,861.00	2,861,000
三菱ロジスネクスト	3,800	1,633.00	6,205,400
近畿車輛	1,300	1,367.00	1,777,100
F P G	8,600	955.00	8,213,000
島根銀行	2,800	612.00	1,713,600
じもとホールディングス	18,900	102.00	1,927,800
全国保証	7,900	4,520.00	35,708,000
めぶきフィナンシャルグループ	145,600	233.00	33,924,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,800	1,219.00	4,632,200
九州フィナンシャルグループ	46,000	408.00	18,768,000
かんぽ生命保険	9,900	1,836.00	18,176,400
ゆうちょ銀行	79,400	1,009.00	80,114,600
富山第一銀行	6,700	312.00	2,090,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	164,800	420.00	69,216,000



西日本フィナンシャルホールディングス	19,100	679.00	12,968,900
日本モーゲージサービス	800	2,223.00	1,778,400
アルヒ	4,500	1,777.00	7,996,500
プレミアグループ	1,500	2,040.00	3,060,000
日産自動車	335,100	504.10	168,923,910
いすゞ自動車	82,300	1,139.50	93,780,850
トヨタ自動車	317,100	7,837.00	2,485,112,700
日野自動車	35,500	1,008.00	35,784,000
三菱自動車工業	105,200	404.00	42,500,800
エフテック	900	750.00	675,000
武蔵精密工業	6,300	1,346.00	8,479,800
日産車体	5,500	1,066.00	5,863,000
新明和工業	7,700	1,291.00	9,940,700
極東開発工業	5,300	1,387.00	7,351,100
日信工業	5,800	2,241.00	12,997,800
トビー工業	2,300	1,725.00	3,967,500
ティラド	1,000	1,757.00	1,757,000
曙ブレーキ工業	15,600	235.00	3,666,000
タチエス	4,700	1,266.00	5,950,200
NOK	15,300	1,570.00	24,021,000
フタバ産業	7,900	625.00	4,937,500
KYB	3,200	2,743.00	8,777,600
市光工業	4,200	714.00	2,998,800
大同メタル工業	5,400	670.00	3,618,000
プレス工業	14,100	360.00	5,076,000
ミクニ	5,500	321.00	1,765,500
太平洋工業	5,900	1,303.00	7,687,700
ケーヒン	6,500	2,587.00	16,815,500
河西工業	3,800	741.00	2,815,800
アイシン精機	23,400	3,940.00	92,196,000
マツダ	83,600	897.00	74,989,200
今仙電機製作所	2,600	852.00	2,215,200
本田技研工業	223,700	3,039.00	679,824,300
スズキ	56,300	4,835.00	272,210,500
SUBARU	88,200	2,905.50	256,265,100
安永	1,500	1,194.00	1,791,000
ヤマハ発動機	37,100	1,932.00	71,677,200
ショーワ	6,700	2,286.00	15,316,200
小糸製作所	17,000	4,640.00	78,880,000
TBK	4,000	464.00	1,856,000
エクセディ	3,900	2,223.00	8,669,700
ミツバ	5,200	723.00	3,759,600
豊田合成	9,200	2,535.00	23,322,000
愛三工業	4,400	696.00	3,062,400
日本プラスト	2,700	666.00	1,798,200
ヨロズ	2,700	1,450.00	3,915,000
エフ・シー・シー	4,600	2,123.00	9,765,800
シマノ	10,600	15,550.00	164,830,000
テイ・エス テック	6,600	3,105.00	20,493,000
関西みらいフィナンシャルグループ	16,400	571.00	9,364,400
三十三フィナンシャルグループ	2,600	1,581.00	4,110,600
第四北越フィナンシャルグループ	4,900	2,566.00	12,573,400
ジャムコ	1,400	1,297.00	1,815,800
小野建	2,500	1,280.00	3,200,000
ノジマ	5,000	2,123.00	10,615,000
佐鳥電機	2,100	853.00	1,791,300
カッパ・クリエイト	3,900	1,449.00	5,651,100
伯東	1,700	1,195.00	2,031,500
コンドーテック	2,200	1,173.00	2,580,600
ライトオン	3,100	573.00	1,776,300

ナガイレーベン	4,000	2,341.00	9,364,000
三菱食品	3,100	2,894.00	8,971,400
良品計画	37,200	1,726.00	64,207,200
松田産業	2,000	1,535.00	3,070,000
第一興商	4,200	4,750.00	19,950,000
メディバルホールディングス	30,200	2,186.00	66,017,200
アドヴァン	4,300	1,219.00	5,241,700
S P K	700	2,638.00	1,846,600
萩原電気ホールディングス	1,000	2,550.00	2,550,000
アルビス	1,100	2,160.00	2,376,000
アズワン	1,900	8,890.00	16,891,000
スズデン	1,300	1,423.00	1,849,900
シモジマ	1,700	1,128.00	1,917,600
ドウシシャ	2,600	1,555.00	4,043,000
小津産業	1,000	1,685.00	1,685,000
コナカ	4,500	402.00	1,809,000
高速	1,700	1,218.00	2,070,600
G - 7ホールディングス	1,600	2,542.00	4,067,200
イオン北海道	2,800	831.00	2,326,800
コジマ	4,800	482.00	2,313,600
ヒマラヤ	2,200	831.00	1,828,200
コーナン商事	4,000	2,423.00	9,692,000
ネットワンシステムズ	10,600	2,440.00	25,864,000
エコス	1,100	1,697.00	1,866,700
ワタミ	3,300	1,133.00	3,738,900
マルシェ	2,400	766.00	1,838,400
システムソフト	18,600	94.00	1,748,400
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	61,500	1,957.00	120,355,500
丸文	2,900	605.00	1,754,500
西松屋チェーン	6,100	900.00	5,490,000
ゼンショーホールディングス	13,400	2,424.00	32,481,600
ハビネット	2,300	1,282.00	2,948,600
幸楽苑ホールディングス	1,800	1,825.00	3,285,000
日本ライフライン	8,300	1,414.00	11,736,200
サイゼリヤ	4,600	2,257.00	10,382,200
V Tホールディングス	11,600	412.00	4,779,200
マルカ	1,000	2,083.00	2,083,000
アルゴグラフィックス	2,400	3,720.00	8,928,000
I D O M	7,500	617.00	4,627,500
日本エム・ディ・エム	1,600	1,866.00	2,985,600
ユナイテッドアローズ	2,900	2,754.00	7,986,600
進和	1,700	2,169.00	3,687,300
ダイトロン	1,200	1,943.00	2,331,600
ハイデイ日高	4,000	1,895.00	7,580,000
シークス	3,600	1,363.00	4,906,800
京都きもの友禅	5,500	326.00	1,793,000
コロワイド	9,300	2,193.00	20,394,900
ピーシーデポコーポレーション	3,700	578.00	2,138,600
田中商事	2,500	709.00	1,772,500
オーハシテクニカ	1,600	1,476.00	2,361,600
壱番屋	2,000	5,340.00	10,680,000
白銅	1,200	1,423.00	1,707,600
P L A N T	3,200	550.00	1,760,000
スギホールディングス	5,600	5,430.00	30,408,000
薬王堂ホールディングス	1,200	2,227.00	2,672,400
島津製作所	34,000	2,878.00	97,852,000
J M S	2,400	822.00	1,972,800
長野計器	2,100	954.00	2,003,400
ブイ・テクノロジ	1,300	4,445.00	5,778,500

スター精密	4,400	1,313.00	5,777,200
東京計器	1,900	893.00	1,696,700
インターアクション	1,500	2,722.00	4,083,000
オーバル	7,500	234.00	1,755,000
東京精密	5,100	3,865.00	19,711,500
マニー	11,300	2,548.00	28,792,400
ニコン	46,000	1,186.00	54,556,000
トプコン	14,300	1,217.00	17,403,100
オリンパス	157,200	2,076.00	326,347,200
理研計器	2,500	2,235.00	5,587,500
S C R E E Nホールディングス	4,900	6,040.00	29,596,000
キヤノン電子	3,000	2,004.00	6,012,000
タムロン	2,300	2,698.00	6,205,400
H O Y A	56,700	10,175.00	576,922,500
シード	1,800	941.00	1,693,800
ノーリツ鋼機	1,900	1,499.00	2,848,100
エー・アンド・デイ	2,600	983.00	2,555,800
朝日インテック	24,100	2,739.00	66,009,900
キヤノン	153,000	2,776.00	424,728,000
リコー	72,300	1,114.00	80,542,200
シチズン時計	33,300	480.00	15,984,000
リズム時計工業	2,000	882.00	1,764,000
大研医器	1,000	669.00	669,000
メニコン	3,900	4,955.00	19,324,500
スノーピーク	1,700	821.00	1,395,700
パラマウントベッドホールディングス	3,000	4,565.00	13,695,000
トランザクション	1,800	1,055.00	1,899,000
粧美堂	4,600	391.00	1,798,600
ニホンフラッシュ	1,300	2,529.00	3,287,700
前田工織	3,100	2,222.00	6,888,200
永大産業	5,500	326.00	1,793,000
アートネイチャー	3,000	738.00	2,214,000
バンダイナムコホールディングス	29,400	5,920.00	174,048,000
共立印刷	11,000	169.00	1,859,000
S H O E I	1,400	5,540.00	7,756,000
フランスベッドホールディングス	4,000	921.00	3,684,000
マーベラス	4,300	675.00	2,902,500
パイロットコーポレーション	4,700	4,140.00	19,458,000
萩原工業	1,600	1,644.00	2,630,400
エイベックス	4,800	1,228.00	5,894,400
トッパン・フォームズ	6,100	1,153.00	7,033,300
フジシールインターナショナル	6,400	2,127.00	13,612,800
タカラトミー	12,700	1,043.00	13,246,100
廣濟堂	2,000	939.00	1,878,000
アーク	19,800	89.00	1,762,200
レック	3,000	1,189.00	3,567,000
三光合成	5,200	335.00	1,742,000
プロネクス	2,400	1,129.00	2,709,600
ホクシン	11,900	144.00	1,713,600
大建工業	1,900	1,857.00	3,528,300
凸版印刷	40,100	2,029.00	81,362,900
大日本印刷	37,200	2,914.00	108,400,800
共同印刷	900	2,890.00	2,601,000
N I S S H A	5,800	960.00	5,568,000
光村印刷	1,100	1,627.00	1,789,700
藤森工業	2,500	3,315.00	8,287,500
ヴィア・ホールディングス	3,400	659.00	2,240,600
T A K A R A & C O M P A N Y	1,400	1,664.00	2,329,600
前澤化成工業	1,800	1,144.00	2,059,200
未来工業	1,500	2,057.00	3,085,500

アシックス	23,500	1,325.00	31,137,500
ツツミ	900	1,927.00	1,734,300
JSP	1,700	1,768.00	3,005,600
ニチハ	4,000	2,541.00	10,164,000
エフピコ	3,200	6,880.00	22,016,000
小松ウオール工業	900	2,065.00	1,858,500
ヤマハ	16,900	5,740.00	97,006,000
河合楽器製作所	900	2,957.00	2,661,300
ビジョン	17,200	3,910.00	67,252,000
天馬	1,900	1,900.00	3,610,000
オリバー	700	3,645.00	2,551,500
キングジム	2,400	825.00	1,980,000
象印マホービン	8,300	1,917.00	15,911,100
リンテック	6,800	2,531.00	17,210,800
信越ポリマー	5,100	969.00	4,941,900
東リ	7,100	295.00	2,094,500
イトーキ	6,100	423.00	2,580,300
任天堂	17,400	39,950.00	695,130,000
三菱鉛筆	4,700	1,588.00	7,463,600
松風	1,300	1,937.00	2,518,100
タカラスタANDARD	5,900	1,700.00	10,030,000
コクヨ	13,600	1,594.00	21,678,400
ニフコ	10,400	2,894.00	30,097,600
立川ブラインド工業	1,400	1,234.00	1,727,600
グローブライド	1,300	2,173.00	2,824,900
オカムラ	9,900	995.00	9,850,500
バルカー	2,300	2,295.00	5,278,500
MUTOHホールディングス	1,000	1,718.00	1,718,000
伊藤忠商事	195,700	2,651.50	518,898,550
丸紅	291,300	788.80	229,777,440
スクロール	5,200	348.00	1,809,600
高島	900	1,897.00	1,707,300
ヨンドシーホールディングス	2,800	2,290.00	6,412,000
三陽商会	1,400	1,473.00	2,062,200
長瀬産業	15,700	1,440.00	22,608,000
蝶理	1,800	2,092.00	3,765,600
豊田通商	31,200	3,640.00	113,568,000
オンワードホールディングス	16,700	609.00	10,170,300
三共生興	4,200	556.00	2,335,200
兼松	10,400	1,311.00	13,634,400
美津濃	2,600	2,541.00	6,606,600
ファミリーマート	22,400	2,542.00	56,940,800
三井物産	246,000	1,942.00	477,732,000
日本紙パルプ商事	1,600	3,935.00	6,296,000
東京エレクトロン	18,900	24,845.00	469,570,500
日立ハイテク	9,700	8,010.00	77,697,000
カメイ	3,600	1,105.00	3,978,000
東都水産	600	2,880.00	1,728,000
OUGホールディングス	700	2,612.00	1,828,400
スターゼン	1,000	4,425.00	4,425,000
セイコーホールディングス	4,000	2,260.00	9,040,000
山善	10,900	998.00	10,878,200
椿本興業	500	3,920.00	1,960,000
住友商事	176,600	1,648.00	291,036,800
日本ユニシス	8,700	3,750.00	32,625,000
内田洋行	1,200	5,860.00	7,032,000
三菱商事	196,400	2,865.00	562,686,000
第一実業	1,400	3,560.00	4,984,000
キヤノンマーケティングジャパン	8,000	2,710.00	21,680,000
西華産業	1,600	1,297.00	2,075,200

佐藤商事	2,300	931.00	2,141,300
菱洋エレクトロ	2,800	1,925.00	5,390,000
東京産業	3,000	581.00	1,743,000
ユアサ商事	2,700	3,330.00	8,991,000
神鋼商事	700	2,401.00	1,680,700
阪和興業	5,200	2,519.00	13,098,800
正栄食品工業	1,800	3,665.00	6,597,000
カナデン	2,300	1,300.00	2,990,000
菱電商事	2,000	1,656.00	3,312,000
ニプロ	19,700	1,237.00	24,368,900
フルサト工業	1,500	1,618.00	2,427,000
岩谷産業	6,200	3,655.00	22,661,000
昭光通商	2,500	682.00	1,705,000
イワキ	3,700	505.00	1,868,500
兼松エレクトロニクス	1,500	3,370.00	5,055,000
三愛石油	6,900	1,079.00	7,445,100
稲畑産業	6,200	1,449.00	8,983,800
ゴールドウイン	5,000	7,150.00	35,750,000
ユニ・チャーム	54,800	3,855.00	211,254,000
デサント	5,400	1,612.00	8,704,800
ワキタ	6,000	1,012.00	6,072,000
ヤマトインターナショナル	4,400	406.00	1,786,400
東邦ホールディングス	9,000	2,250.00	20,250,000
サンゲツ	7,700	1,790.00	13,783,000
ミツロコグループホールディングス	4,100	1,128.00	4,624,800
シナネンホールディングス	1,200	2,155.00	2,586,000
伊藤忠エネクス	6,200	918.00	5,691,600
サンリオ	7,900	1,902.00	15,025,800
サンワテクノス	2,000	929.00	1,858,000
リョーサン	3,100	2,411.00	7,474,100
新光商事	4,400	794.00	3,493,600
トーヨー	1,300	1,737.00	2,258,100
三信電気	1,500	1,619.00	2,428,500
東陽テクニカ	3,200	1,042.00	3,334,400
モスフードサービス	3,700	2,992.00	11,070,400
加賀電子	2,800	2,257.00	6,319,600
三益半導体工業	2,200	2,226.00	4,897,200
ソーダニッカ	2,900	597.00	1,731,300
立花エレテック	2,100	1,724.00	3,620,400
木曽路	3,700	2,860.00	10,582,000
S R S ホールディングス	3,300	1,040.00	3,432,000
千趣会	5,100	513.00	2,616,300
ケーヨー	5,700	547.00	3,117,900
上新電機	3,300	2,004.00	6,613,200
日本瓦斯	4,400	3,740.00	16,456,000
ロイヤルホールディングス	4,900	2,106.00	10,319,400
東天紅	1,400	1,251.00	1,751,400
いなげや	3,500	1,366.00	4,781,000
島忠	5,300	2,991.00	15,852,300
チヨダ	2,900	1,428.00	4,141,200
ライフコーポレーション	2,100	2,624.00	5,510,400
リンガーハット	3,400	2,397.00	8,149,800
MrMaxHD	3,800	475.00	1,805,000
テンアライド	4,100	438.00	1,795,800
AOKIホールディングス	5,600	1,017.00	5,695,200
オークワ	4,400	1,476.00	6,494,400
コメリ	4,300	2,197.00	9,447,100
青山商事	5,800	1,296.00	7,516,800
しまむら	3,300	7,770.00	25,641,000
はせがわ	4,600	398.00	1,830,800

高島屋	20,400	1,098.00	22,399,200
松屋	5,600	790.00	4,424,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	13,300	944.00	12,555,200
近鉄百貨店	1,100	3,325.00	3,657,500
丸井グループ	25,700	2,345.00	60,266,500
クレディセゾン	19,600	1,816.00	35,593,600
アクシアル リテイリング	2,300	3,695.00	8,498,500
イオン	107,700	2,296.50	247,333,050
イズミ	5,700	3,310.00	18,867,000
平和堂	5,700	1,874.00	10,681,800
フジ	3,400	1,825.00	6,205,000
ヤオコー	3,200	5,870.00	18,784,000
ゼビオホールディングス	3,400	1,100.00	3,740,000
ケーズホールディングス	27,000	1,294.00	34,938,000
PALTA C	4,500	5,000.00	22,500,000
三谷産業	5,100	354.00	1,805,400
新生銀行	20,600	1,668.00	34,360,800
あおぞら銀行	16,700	3,030.00	50,601,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,929,200	566.30	1,092,505,960
りそなホールディングス	307,600	441.00	135,651,600
三井住友トラスト・ホールディングス	53,000	4,053.00	214,809,000
三井住友フィナンシャルグループ	193,900	3,754.00	727,900,600
千葉銀行	96,400	611.00	58,900,400
群馬銀行	55,100	356.00	19,615,600
武蔵野銀行	4,200	1,647.00	6,917,400
千葉興業銀行	7,700	335.00	2,579,500
筑波銀行	11,700	199.00	2,328,300
七十七銀行	9,500	1,555.00	14,772,500
青森銀行	2,200	2,569.00	5,651,800
秋田銀行	1,800	1,891.00	3,403,800
山形銀行	3,100	1,353.00	4,194,300
岩手銀行	1,800	2,573.00	4,631,400
東邦銀行	25,100	244.00	6,124,400
みちのく銀行	1,800	1,345.00	2,421,000
ふくおかフィナンシャルグループ	23,600	1,855.00	43,778,000
静岡銀行	69,400	752.00	52,188,800
十六銀行	3,500	2,075.00	7,262,500
スルガ銀行	28,700	448.00	12,857,600
八十二銀行	67,600	401.00	27,107,600
山梨中央銀行	3,300	925.00	3,052,500
大垣共立銀行	5,500	2,233.00	12,281,500
福井銀行	2,400	1,553.00	3,727,200
北國銀行	2,900	3,150.00	9,135,000
清水銀行	1,200	1,976.00	2,371,200
富山銀行	800	1,969.00	1,575,200
滋賀銀行	5,600	2,628.00	14,716,800
南都銀行	4,700	2,475.00	11,632,500
百五銀行	25,200	318.00	8,013,600
京都銀行	10,100	4,215.00	42,571,500
紀陽銀行	9,900	1,608.00	15,919,200
ほくほくフィナンシャルグループ	18,700	1,013.00	18,943,100
広島銀行	41,400	521.00	21,569,400
山陰合同銀行	16,600	609.00	10,109,400
中国銀行	24,100	944.00	22,750,400
鳥取銀行	1,400	1,324.00	1,853,600
伊予銀行	40,000	537.00	21,480,000
百十四銀行	3,000	2,007.00	6,021,000
四国銀行	4,300	930.00	3,999,000
阿波銀行	4,600	2,391.00	10,998,600
大分銀行	1,600	2,280.00	3,648,000

宮崎銀行	1,900	2,350.00	4,465,000
佐賀銀行	1,700	1,532.00	2,604,400
沖縄銀行	2,600	3,335.00	8,671,000
琉球銀行	6,500	1,052.00	6,838,000
セブン銀行	93,600	321.00	30,045,600
みずほフィナンシャルグループ	3,808,300	159.10	605,900,530
山口フィナンシャルグループ	35,000	648.00	22,680,000
芙蓉総合リース	2,900	6,940.00	20,126,000
みずほリース	4,400	3,230.00	14,212,000
東京センチュリー	5,600	5,110.00	28,616,000
SBIホールディングス	31,300	2,436.00	76,246,800
日本証券金融	12,400	496.00	6,150,400
アイフル	42,800	300.00	12,840,000
長野銀行	1,200	1,455.00	1,746,000
名古屋銀行	2,300	3,390.00	7,797,000
北洋銀行	42,200	228.00	9,621,600
愛知銀行	1,000	3,485.00	3,485,000
中京銀行	1,200	2,210.00	2,652,000
大光銀行	1,100	1,614.00	1,775,400
愛媛銀行	4,000	1,077.00	4,308,000
京葉銀行	11,900	585.00	6,961,500
栃木銀行	13,500	195.00	2,632,500
北日本銀行	900	2,086.00	1,877,400
東和銀行	4,900	784.00	3,841,600
リコーリース	2,200	4,245.00	9,339,000
イオンフィナンシャルサービス	17,200	1,779.00	30,598,800
アコム	56,300	517.00	29,107,100
ジャックス	3,100	2,432.00	7,539,200
オリエン트コーポレーション	75,900	161.00	12,219,900
日立キャピタル	6,600	3,060.00	20,196,000
アプラスフィナンシャル	21,300	82.00	1,746,600
オリックス	175,300	1,911.00	334,998,300
三菱UFJリース	71,100	697.00	49,556,700
ジャフコ	4,300	4,665.00	20,059,500
九州リースサービス	3,000	604.00	1,812,000
トモニホールディングス	21,700	338.00	7,334,600
大和証券グループ本社	224,900	539.00	121,221,100
野村ホールディングス	493,200	561.80	277,079,760
岡三証券グループ	23,900	391.00	9,344,900
丸三証券	8,300	506.00	4,199,800
東洋証券	12,000	150.00	1,800,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	32,200	322.00	10,368,400
光世証券	3,100	586.00	1,816,600
水戸証券	8,100	223.00	1,806,300
いちよし証券	5,200	611.00	3,177,200
松井証券	16,000	893.00	14,288,000
SOMPOホールディングス	52,700	4,387.00	231,194,900
だいこう証券ビジネス	2,700	674.00	1,819,800
日本取引所グループ	80,400	1,973.00	158,629,200
マネックスグループ	21,100	248.00	5,232,800
極東証券	3,800	755.00	2,869,000
岩井コスモホールディングス	2,600	1,267.00	3,294,200
藍澤証券	5,000	709.00	3,545,000
フィデアホールディングス	27,200	122.00	3,318,400
池田泉州ホールディングス	32,200	189.00	6,085,800
アニコムホールディングス	2,300	3,910.00	8,993,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	73,300	3,748.00	274,728,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	23,000	2,388.00	54,924,000

スパークス・グループ	9,700	258.00	2,502,600
第一生命ホールディングス	158,600	1,644.00	260,738,400
東京海上ホールディングス	100,200	6,269.00	628,153,800
イー・ギャランティ	3,000	1,300.00	3,900,000
アサックス	2,500	719.00	1,797,500
NECキャピタルソリューション	1,100	2,461.00	2,707,100
T&Dホールディングス	83,800	1,220.00	102,236,000
アドバンスクリエイト	700	1,790.00	1,253,000
三井不動産	138,200	2,924.00	404,096,800
三菱地所	196,400	2,170.00	426,188,000
平和不動産	5,100	3,435.00	17,518,500
東京建物	30,600	1,697.00	51,928,200
ダイビル	7,200	1,363.00	9,813,600
京阪神ビルディング	4,500	1,469.00	6,610,500
住友不動産	63,000	3,852.00	242,676,000
テーオーシー	5,500	845.00	4,647,500
東京楽天地	500	5,730.00	2,865,000
レオパレス21	36,700	415.00	15,230,500
スターツコーポレーション	3,800	2,572.00	9,773,600
フジ住宅	3,300	661.00	2,181,300
空港施設	3,400	531.00	1,805,400
明和地所	2,800	629.00	1,761,200
ゴールドクレスト	2,200	1,889.00	4,155,800
リログループ	14,800	2,664.00	39,427,200
エスリード	1,100	1,872.00	2,059,200
日神グループホールディングス	4,100	530.00	2,173,000
日本エスコン	5,100	907.00	4,625,700
タカラレーベン	12,800	494.00	6,323,200
A V A N T I A	1,800	953.00	1,715,400
イオンモール	14,000	1,823.00	25,522,000
毎日コムネット	1,900	912.00	1,732,800
ファースト住建	1,500	1,245.00	1,867,500
カチタス	3,500	3,945.00	13,807,500
東祥	1,700	1,928.00	3,277,600
トーセイ	3,900	1,363.00	5,315,700
穴吹興産	1,000	1,636.00	1,636,000
サンフロンティア不動産	3,900	1,266.00	4,937,400
エフ・ジェー・ネクスト	2,400	1,105.00	2,652,000
グランディハウス	3,900	443.00	1,727,700
東武鉄道	30,000	3,575.00	107,250,000
相鉄ホールディングス	9,100	2,712.00	24,679,200
東急	71,700	1,842.00	132,071,400
京浜急行電鉄	36,500	1,812.00	66,138,000
小田急電鉄	42,300	2,282.00	96,528,600
京王電鉄	14,700	5,770.00	84,819,000
京成電鉄	19,800	3,845.00	76,131,000
富士急行	3,900	3,315.00	12,928,500
新京成電鉄	700	2,432.00	1,702,400
東日本旅客鉄道	50,000	9,089.00	454,450,000
西日本旅客鉄道	25,300	8,657.00	219,022,100
東海旅客鉄道	23,600	20,690.00	488,284,000
西武ホールディングス	38,100	1,682.00	64,084,200
鴻池運輸	4,500	1,464.00	6,588,000
西日本鉄道	7,900	2,586.00	20,429,400
ハマキョウレックス	2,200	3,170.00	6,974,000
サカイ引越センター	1,500	6,140.00	9,210,000
近鉄グループホールディングス	26,900	5,200.00	139,880,000
阪急阪神ホールディングス	35,900	4,020.00	144,318,000
南海電気鉄道	12,800	2,660.00	34,048,000
京阪ホールディングス	12,000	4,750.00	57,000,000



神戸電鉄	600	3,965.00	2,379,000
名古屋鉄道	22,100	3,080.00	68,068,000
山陽電気鉄道	1,900	2,106.00	4,001,400
トランコム	800	7,940.00	6,352,000
日本通運	9,500	5,800.00	55,100,000
ヤマトホールディングス	47,200	1,931.00	91,143,200
山九	7,500	5,040.00	37,800,000
日新	2,300	1,699.00	3,907,700
丸全昭和運輸	2,200	2,751.00	6,052,200
センコーグループホールディングス	14,800	867.00	12,831,600
トナミホールディングス	600	4,945.00	2,967,000
ニッコンホールディングス	9,600	2,397.00	23,011,200
日本石油輸送	500	3,120.00	1,560,000
福山通運	3,400	3,620.00	12,308,000
セイノーホールディングス	20,200	1,330.00	26,866,000
エスライン	1,700	984.00	1,672,800
神奈川中央交通	700	3,935.00	2,754,500
日立物流	4,900	3,125.00	15,312,500
丸和運輸機関	2,800	1,960.00	5,488,000
C & F ロジホールディングス	2,700	1,284.00	3,466,800
日本郵船	22,600	1,732.00	39,143,200
商船三井	17,100	2,555.00	43,690,500
川崎汽船	8,300	1,464.00	12,151,200
NSユニテッド海運	1,500	1,847.00	2,770,500
飯野海運	12,800	358.00	4,582,400
九州旅客鉄道	24,000	3,645.00	87,480,000
SGホールディングス	28,200	2,224.00	62,716,800
日本航空	48,400	3,000.00	145,200,000
ANAホールディングス	49,200	3,246.00	159,703,200
パスコ	600	1,898.00	1,138,800
西本Wismettacホールディングス	500	3,145.00	1,572,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	2,195.00	1,756,000
Genky DrugStores	1,200	1,946.00	2,335,200
国際紙パルプ商事	6,600	290.00	1,914,000
総合メディカルホールディングス	2,400	2,548.00	6,115,200
ブックオフグループホールディングス	1,800	912.00	1,641,600
三菱倉庫	8,500	2,870.00	24,395,000
三井倉庫ホールディングス	3,100	1,737.00	5,384,700
住友倉庫	9,900	1,433.00	14,186,700
澁澤倉庫	1,500	2,065.00	3,097,500
ヤマタネ	1,400	1,466.00	2,052,400
東陽倉庫	5,800	315.00	1,827,000
乾汽船	1,600	1,152.00	1,843,200
日本トランスシティ	5,900	479.00	2,826,100
ケイヒン	1,400	1,332.00	1,864,800
中央倉庫	1,600	1,148.00	1,836,800
安田倉庫	2,200	1,009.00	2,219,800
東洋埠頭	1,300	1,357.00	1,764,100
宇徳	3,500	517.00	1,809,500
上組	15,400	2,276.00	35,050,400
キューソー流通システム	900	1,899.00	1,709,100
近鉄エクスプレス	5,700	1,894.00	10,795,800
東海運	5,900	280.00	1,652,000
エーアイティー	1,900	947.00	1,799,300
東京放送ホールディングス	17,000	1,904.00	32,368,000
日本テレビホールディングス	23,300	1,468.00	34,204,400
朝日放送グループホールディングス	2,800	728.00	2,038,400
テレビ朝日ホールディングス	7,700	2,013.00	15,500,100
スカパーJ S A Tホールディングス	18,300	484.00	8,857,200

テレビ東京ホールディングス	2,300	2,386.00	5,487,800
日本BS放送	1,400	1,241.00	1,737,400
ビジョン	2,600	1,140.00	2,964,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,100	1,700.00	1,870,000
コネクシオ	1,600	1,552.00	2,483,200
日本通信	21,700	211.00	4,578,700
日本電信電話	372,700	2,811.50	1,047,846,050
KDDI	207,800	3,425.00	711,715,000
ソフトバンク	253,400	1,502.50	380,733,500
光通信	2,900	23,680.00	68,672,000
NTTドコモ	206,000	3,145.00	647,870,000
エムティーアイ	2,700	648.00	1,749,600
GMOインターネット	11,000	2,069.00	22,759,000
KADOKAWA	7,500	1,629.00	12,217,500
学研ホールディングス	900	7,230.00	6,507,000
ゼンリン	5,600	1,474.00	8,254,400
インプレスホールディングス	10,500	166.00	1,743,000
東京電力ホールディングス	226,800	435.00	98,658,000
中部電力	86,900	1,520.50	132,131,450
関西電力	107,700	1,276.00	137,425,200
中国電力	39,300	1,478.00	58,085,400
北陸電力	26,000	829.00	21,554,000
東北電力	71,000	1,022.00	72,562,000
四国電力	25,600	881.00	22,553,600
九州電力	58,600	854.00	50,044,400
北海道電力	26,600	517.00	13,752,200
沖縄電力	5,300	2,001.00	10,605,300
電源開発	22,600	2,533.00	57,245,800
エフオン	1,400	653.00	914,200
イーレックス	4,000	1,433.00	5,732,000
レノバ	4,700	1,113.00	5,231,100
東京瓦斯	54,600	2,388.50	130,412,100
大阪瓦斯	55,100	1,893.00	104,304,300
東邦瓦斯	14,000	4,075.00	57,050,000
北海道瓦斯	1,500	1,604.00	2,406,000
広島ガス	5,800	344.00	1,995,200
西部瓦斯	3,200	2,366.00	7,571,200
静岡ガス	8,100	954.00	7,727,400
メタウォーター	1,400	4,125.00	5,775,000
アイネット	1,400	1,446.00	2,024,400
松竹	1,800	13,840.00	24,912,000
東宝	16,700	3,830.00	63,961,000
エイチ・アイ・エス	4,200	2,475.00	10,395,000
東映	1,000	13,730.00	13,730,000
ラックランド	800	2,117.00	1,693,600
エヌ・ティ・ティ・データ	74,200	1,443.00	107,070,600
共立メンテナンス	4,500	4,070.00	18,315,000
イチネンホールディングス	3,000	1,346.00	4,038,000
建設技術研究所	1,900	2,155.00	4,094,500
スペース	1,800	1,156.00	2,080,800
アインホールディングス	3,400	6,790.00	23,086,000
燦ホールディングス	1,200	1,552.00	1,862,400
東京テアトル	1,300	1,330.00	1,729,000
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,868.00	1,720,800
ナガワ	900	6,370.00	5,733,000
よみうりランド	600	4,090.00	2,454,000
東京都競馬	1,800	3,705.00	6,669,000
常磐興産	1,100	1,630.00	1,793,000
カナモト	4,400	2,651.00	11,664,400
東京ドーム	11,000	928.00	10,208,000

D T S	6,200	2,178.00	13,503,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,900	4,945.00	58,845,500
シーイーシー	3,000	1,974.00	5,922,000
カブコン	13,100	3,390.00	44,409,000
西尾レントオール	2,800	2,920.00	8,176,000
アイ・エス・ビー	900	2,315.00	2,083,500
日本空港ビルディング	8,900	5,120.00	45,568,000
トランス・コスモス	2,600	2,652.00	6,895,200
乃村工藝社	11,600	1,166.00	13,525,600
ジャステック	1,800	1,036.00	1,864,800
S C S K	6,400	6,240.00	39,936,000
藤田観光	1,200	2,418.00	2,901,600
K N T - C Tホールディングス	1,700	1,157.00	1,966,900
日本管財	2,900	1,900.00	5,510,000
トーカイ	2,600	2,458.00	6,390,800
白洋舎	700	2,780.00	1,946,000
セコム	28,800	9,502.00	273,657,600
日本システムウエア	900	2,264.00	2,037,600
セントラル警備保障	1,300	5,270.00	6,851,000
アイネス	2,700	1,691.00	4,565,700
丹青社	5,100	1,132.00	5,773,200
メイテック	3,400	5,600.00	19,040,000
T K C	2,400	5,300.00	12,720,000
富士ソフト	3,600	4,120.00	14,832,000
応用地質	2,900	1,424.00	4,129,600
船井総研ホールディングス	5,600	2,914.00	16,318,400
N S D	9,000	1,893.00	17,037,000
進学会ホールディングス	3,600	508.00	1,828,800
丸紅建材リース	1,000	1,823.00	1,823,000
コナミホールディングス	10,100	4,335.00	43,783,500
学究社	1,300	1,350.00	1,755,000
ベネッセホールディングス	9,000	2,925.00	26,325,000
イオンディライト	3,300	3,670.00	12,111,000
ナック	1,700	1,021.00	1,735,700
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,090.00	3,399,000
ニチイ学館	3,900	1,288.00	5,023,200
ダイセキ	4,600	2,899.00	13,335,400
ステップ	1,100	1,628.00	1,790,800
日鉄物産	2,000	4,615.00	9,230,000
泉州電業	900	3,015.00	2,713,500
元気寿司	700	2,916.00	2,041,200
トラスコ中山	5,800	2,371.00	13,751,800
ヤマダ電機	85,300	588.00	50,156,400
オートバックスセブン	10,400	1,525.00	15,860,000
モリト	2,300	789.00	1,814,700
アークランドサカモト	4,400	1,199.00	5,275,600
ニトリホールディングス	12,100	16,455.00	199,105,500
グルメ杵屋	2,000	1,161.00	2,322,000
愛眼	7,300	247.00	1,803,100
吉野家ホールディングス	9,200	2,536.00	23,331,200
加藤産業	4,400	3,440.00	15,136,000
イノテック	1,700	1,146.00	1,948,200
イエローハット	5,300	1,649.00	8,739,700
松屋フーズホールディングス	1,300	4,470.00	5,811,000
J B C Cホールディングス	1,900	1,937.00	3,680,300
J Kホールディングス	2,500	735.00	1,837,500
サガミホールディングス	3,700	1,318.00	4,876,600
日伝	2,500	1,926.00	4,815,000
関西スーパーマーケット	2,300	1,001.00	2,302,300

ミロク情報サービス	2,500	2,655.00	6,637,500
北沢産業	6,600	251.00	1,656,600
杉本商事	1,500	1,903.00	2,854,500
因幡電機産業	8,000	2,621.00	20,968,000
王将フードサービス	2,100	6,460.00	13,566,000
ブレナス	3,100	1,914.00	5,933,400
ミニストップ	2,100	1,497.00	3,143,700
アークス	5,700	1,920.00	10,944,000
バローホールディングス	6,200	1,806.00	11,197,200
東テク	900	2,456.00	2,210,400
ミスミグループ本社	35,100	2,626.00	92,172,600
ベルク	1,400	5,570.00	7,798,000
大 庄	1,500	1,609.00	2,413,500
タキヒヨー	1,000	1,784.00	1,784,000
ファーストリテイリング	3,700	58,860.00	217,782,000
ソフトバンクグループ	221,200	5,664.00	1,252,876,800
蔵王産業	1,200	1,458.00	1,749,600
スズケン	11,900	3,945.00	46,945,500
サンドラッグ	10,500	3,315.00	34,807,500
サックスパー ホールディングス	2,400	806.00	1,934,400
ジェコス	1,900	1,041.00	1,977,900
やまや	800	2,219.00	1,775,200
ペルーナ	6,000	614.00	3,684,000
合計	33,485,100		67,022,069,250

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)

	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,799,524	14,133,745
コール・ローン	628,706,474	606,777,680
国債証券	65,768,216,770	60,286,981,030
地方債証券	8,658,947,780	7,236,402,821
特殊債券	9,851,727,173	8,307,495,386
社債券	6,505,142,700	5,744,449,000
未収利息	264,056,612	218,630,794
前払費用	4,671,465	6,634,696
流動資産合計	91,712,268,498	82,421,505,152
資産合計	91,712,268,498	82,421,505,152
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,101,294	14,663,143
その他未払費用	480	801
流動負債合計	3,101,774	14,663,944
負債合計	3,101,774	14,663,944
純資産の部		
元本等		
元本	93,246,832,729	82,709,590,673
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,537,666,005	302,749,465
純資産合計	91,709,166,724	82,406,841,208
負債純資産合計	91,712,268,498	82,421,505,152

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 受益権総口数	93,246,832,729口	82,709,590,673口
2. 投資信託財産の計算に関する規 則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	1,537,666,005円	302,749,465円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9835円 (9,835円)	0.9963円 (9,963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22日 至 2019年2月21日	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	683,620,430	470,833,190
地方債証券	43,645,654	17,477,756
特殊債券	26,259,478	33,594,185
社債券	40,936,500	27,653,300
合計	572,778,798	392,107,949

(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	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	130,621,929,148円	93,246,832,729円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,833,282,961円	7,513,852,343円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	42,208,379,380円	18,051,094,399円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB（適格機関投資家限定）	91,430,070,853円	77,960,275,163円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,345,859,235円	1,993,604,676円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	10,189,726円	41,659,580円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	279,529,696円	1,913,782,404円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	9,489,530円	45,960,871円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25,399,457円	147,466,511円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	74,779,556円	387,230,112円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（6資産均等型）	37,376,874円	90,813,280円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リー ト/債券）	2,973,401円	5,174,232円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リー ト/債券）	10,630,035円	30,971,907円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（8資産均等型）	19,693,743円	35,248,815円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	90,231円	3,441,982円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	132,231円	4,361,447円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	180,429円	9,618,706円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	437,732円	39,980,987円
計	93,246,832,729円	82,709,590,673円

附属明細表（2020年2月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
国債証券	第398回 利付国債（2年）	448,000,000	449,178,240	
	第399回 利付国債（2年）	520,000,000	521,482,000	
	第400回 利付国債（2年）	492,000,000	493,505,520	
	第401回 利付国債（2年）	501,000,000	502,648,290	
	第402回 利付国債（2年）	140,000,000	140,490,000	
	第403回 利付国債（2年）	53,000,000	53,197,160	
	第404回 利付国債（2年）	341,000,000	342,343,540	
	第405回 利付国債（2年）	269,000,000	270,140,560	
	第406回 利付国債（2年）	151,000,000	151,674,970	
	第127回 利付国債（5年）	491,000,000	492,355,160	
	第128回 利付国債（5年）	350,000,000	351,197,000	
	第129回 利付国債（5年）	639,000,000	641,658,240	
	第130回 利付国債（5年）	482,000,000	484,323,240	
	第131回 利付国債（5年）	516,000,000	518,879,280	
	第132回 利付国債（5年）	221,000,000	222,385,670	
	第133回 利付国債（5年）	322,000,000	324,282,980	
	第134回 利付国債（5年）	270,000,000	272,100,600	
	第135回 利付国債（5年）	324,000,000	326,741,040	
	第137回 利付国債（5年）	229,000,000	231,260,230	

第138回	利付国債(5年)	539,000,000	544,691,840
第141回	利付国債(5年)	470,000,000	475,837,400
第142回	利付国債(5年)	150,000,000	151,929,000
第1回	利付国債(40年)	110,000,000	171,343,700
第2回	利付国債(40年)	142,000,000	215,273,420
第3回	利付国債(40年)	133,000,000	203,525,910
第4回	利付国債(40年)	182,000,000	281,457,540
第5回	利付国債(40年)	182,000,000	273,296,660
第6回	利付国債(40年)	175,000,000	259,612,500
第7回	利付国債(40年)	187,000,000	267,907,420
第8回	利付国債(40年)	212,000,000	285,078,520
第9回	利付国債(40年)	176,000,000	178,530,880
第10回	利付国債(40年)	269,000,000	319,633,870
第11回	利付国債(40年)	162,000,000	187,113,240
第313回	利付国債(10年)	291,000,000	295,507,590
第314回	利付国債(10年)	106,000,000	107,416,160
第315回	利付国債(10年)	109,000,000	110,945,650
第316回	利付国債(10年)	91,000,000	92,504,230
第318回	利付国債(10年)	55,000,000	56,002,100
第320回	利付国債(10年)	65,000,000	66,373,450
第321回	利付国債(10年)	69,000,000	70,663,590
第323回	利付国債(10年)	32,000,000	32,792,000
第324回	利付国債(10年)	99,000,000	101,219,580
第325回	利付国債(10年)	116,000,000	118,901,160
第327回	利付国債(10年)	28,000,000	28,772,520
第328回	利付国債(10年)	24,000,000	24,572,640
第329回	利付国債(10年)	105,000,000	108,413,550
第330回	利付国債(10年)	3,000,000	3,104,970
第332回	利付国債(10年)	196,000,000	201,834,920
第333回	利付国債(10年)	193,000,000	199,120,030
第334回	利付国債(10年)	257,000,000	265,658,330
第335回	利付国債(10年)	289,000,000	297,979,230
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	54,763,840
第337回	利付国債(10年)	303,000,000	310,065,960
第338回	利付国債(10年)	491,000,000	505,548,330
第339回	利付国債(10年)	536,000,000	552,680,320
第340回	利付国債(10年)	566,000,000	584,457,260
第341回	利付国債(10年)	552,000,000	567,571,920
第342回	利付国債(10年)	613,000,000	623,329,050
第343回	利付国債(10年)	620,000,000	630,887,200
第344回	利付国債(10年)	672,000,000	684,270,720
第345回	利付国債(10年)	593,000,000	604,249,210
第346回	利付国債(10年)	647,000,000	659,720,020
第347回	利付国債(10年)	616,000,000	628,313,840
第348回	利付国債(10年)	624,000,000	636,667,200
第349回	利付国債(10年)	646,000,000	659,294,680
第350回	利付国債(10年)	814,000,000	830,605,600
第351回	利付国債(10年)	650,000,000	662,844,000
第352回	利付国債(10年)	616,000,000	627,999,680
第353回	利付国債(10年)	576,000,000	587,024,640
第354回	利付国債(10年)	508,000,000	517,291,320
第355回	利付国債(10年)	518,000,000	527,241,120
第356回	利付国債(10年)	473,000,000	481,206,550
第357回	利付国債(10年)	165,000,000	167,689,500
第1回	利付国債(30年)	10,000,000	12,758,100
第2回	利付国債(30年)	83,000,000	103,460,330
第3回	利付国債(30年)	17,000,000	21,097,000
第4回	利付国債(30年)	80,000,000	105,241,600
第5回	利付国債(30年)	33,000,000	41,222,280
第6回	利付国債(30年)	65,000,000	83,305,300

第7回 利付国債(30年)	60,000,000	76,736,400
第8回 利付国債(30年)	52,000,000	63,680,760
第9回 利付国債(30年)	50,000,000	58,708,000
第10回 利付国債(30年)	90,000,000	102,396,600
第11回 利付国債(30年)	70,000,000	85,276,800
第12回 利付国債(30年)	72,000,000	91,828,080
第13回 利付国債(30年)	83,000,000	105,063,890
第14回 利付国債(30年)	64,000,000	84,824,960
第15回 利付国債(30年)	78,000,000	104,863,200
第16回 利付国債(30年)	69,000,000	93,043,740
第17回 利付国債(30年)	68,000,000	91,033,640
第18回 利付国債(30年)	108,000,000	143,364,600
第19回 利付国債(30年)	89,000,000	118,533,760
第20回 利付国債(30年)	93,000,000	127,212,840
第21回 利付国債(30年)	93,000,000	124,758,570
第22回 利付国債(30年)	98,000,000	134,969,520
第23回 利付国債(30年)	108,000,000	149,249,520
第24回 利付国債(30年)	86,000,000	119,151,280
第25回 利付国債(30年)	99,000,000	134,352,900
第26回 利付国債(30年)	176,000,000	242,487,520
第27回 利付国債(30年)	165,000,000	231,564,300
第28回 利付国債(30年)	209,000,000	295,116,360
第29回 利付国債(30年)	221,000,000	309,983,440
第30回 利付国債(30年)	232,000,000	322,647,040
第31回 利付国債(30年)	215,000,000	296,807,500
第32回 利付国債(30年)	262,000,000	368,838,360
第33回 利付国債(30年)	295,000,000	399,896,100
第34回 利付国債(30年)	259,000,000	363,327,790
第35回 利付国債(30年)	276,000,000	377,543,160
第36回 利付国債(30年)	314,000,000	431,605,560
第37回 利付国債(30年)	327,000,000	444,631,710
第38回 利付国債(30年)	220,000,000	295,644,800
第39回 利付国債(30年)	184,000,000	251,995,360
第40回 利付国債(30年)	165,000,000	222,662,550
第41回 利付国債(30年)	174,000,000	231,230,340
第42回 利付国債(30年)	189,000,000	251,772,570
第43回 利付国債(30年)	180,000,000	240,100,200
第44回 利付国債(30年)	178,000,000	238,012,700
第45回 利付国債(30年)	202,000,000	261,000,160
第46回 利付国債(30年)	238,000,000	307,803,020
第47回 利付国債(30年)	222,000,000	293,004,480
第48回 利付国債(30年)	230,000,000	292,856,700
第49回 利付国債(30年)	229,000,000	292,155,910
第50回 利付国債(30年)	241,000,000	271,440,710
第51回 利付国債(30年)	236,000,000	236,000,000
第52回 利付国債(30年)	243,000,000	255,271,500
第53回 利付国債(30年)	222,000,000	238,825,380
第54回 利付国債(30年)	240,000,000	270,712,800
第55回 利付国債(30年)	232,000,000	261,614,800
第56回 利付国債(30年)	225,000,000	253,966,500
第57回 利付国債(30年)	232,000,000	261,779,520
第58回 利付国債(30年)	283,000,000	319,209,850
第59回 利付国債(30年)	217,000,000	239,027,670
第60回 利付国債(30年)	199,000,000	230,113,650
第61回 利付国債(30年)	201,000,000	221,150,250
第62回 利付国債(30年)	184,000,000	192,294,720
第63回 利付国債(30年)	196,000,000	199,400,600
第64回 利付国債(30年)	204,000,000	207,286,440
第65回 利付国債(30年)	76,000,000	77,234,240
第49回 利付国債(20年)	35,000,000	35,846,300

第50回	利付国債(20年)	45,000,000	45,991,800
第51回	利付国債(20年)	31,000,000	31,884,120
第52回	利付国債(20年)	4,000,000	4,142,560
第53回	利付国債(20年)	4,000,000	4,165,040
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,043,080
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,100,860
第68回	利付国債(20年)	109,000,000	119,617,690
第70回	利付国債(20年)	40,000,000	44,478,000
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	70,702,720
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,169,200
第75回	利付国債(20年)	87,000,000	97,110,270
第76回	利付国債(20年)	115,000,000	127,188,850
第77回	利付国債(20年)	88,000,000	97,776,800
第78回	利付国債(20年)	13,000,000	14,447,160
第80回	利付国債(20年)	13,000,000	14,586,650
第81回	利付国債(20年)	64,000,000	71,825,280
第82回	利付国債(20年)	104,000,000	117,300,560
第83回	利付国債(20年)	69,000,000	78,223,920
第84回	利付国債(20年)	124,000,000	139,847,200
第85回	利付国債(20年)	89,000,000	101,376,340
第86回	利付国債(20年)	74,000,000	85,196,940
第87回	利付国債(20年)	71,000,000	81,307,780
第88回	利付国債(20年)	129,000,000	149,339,430
第89回	利付国債(20年)	73,000,000	84,044,170
第90回	利付国債(20年)	237,000,000	274,301,430
第91回	利付国債(20年)	167,000,000	194,393,010
第92回	利付国債(20年)	297,000,000	343,492,380
第93回	利付国債(20年)	189,000,000	218,319,570
第94回	利付国債(20年)	237,000,000	275,457,990
第95回	利付国債(20年)	242,000,000	286,167,420
第96回	利付国債(20年)	169,000,000	197,342,990
第97回	利付国債(20年)	233,000,000	275,119,410
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	201,774,920
第99回	利付国債(20年)	306,000,000	360,452,700
第100回	利付国債(20年)	250,000,000	297,705,000
第101回	利付国債(20年)	182,000,000	219,697,660
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	219,493,270
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	203,519,940
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	160,305,750
第105回	利付国債(20年)	223,000,000	265,851,680
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	182,524,640
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	181,906,000
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	238,145,880
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	190,361,570
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	220,921,440
第111回	利付国債(20年)	176,000,000	213,759,040
第112回	利付国債(20年)	249,000,000	300,082,350
第113回	利付国債(20年)	389,000,000	470,526,620
第114回	利付国債(20年)	200,000,000	242,778,000
第115回	利付国債(20年)	172,000,000	210,488,440
第116回	利付国債(20年)	194,000,000	238,266,920
第117回	利付国債(20年)	266,000,000	324,003,960
第118回	利付国債(20年)	188,000,000	227,840,960
第119回	利付国債(20年)	103,000,000	122,693,600
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	103,001,360
第121回	利付国債(20年)	181,000,000	218,262,470
第122回	利付国債(20年)	117,000,000	139,845,420
第123回	利付国債(20年)	193,000,000	237,610,020
第124回	利付国債(20年)	115,000,000	140,332,200
第125回	利付国債(20年)	125,000,000	155,767,500

第126回	利付国債(20年)	114,000,000	139,531,440	
第127回	利付国債(20年)	108,000,000	130,991,040	
第128回	利付国債(20年)	187,000,000	227,459,320	
第129回	利付国債(20年)	108,000,000	130,143,240	
第130回	利付国債(20年)	180,000,000	217,602,000	
第131回	利付国債(20年)	95,000,000	113,746,350	
第132回	利付国債(20年)	126,000,000	151,221,420	
第133回	利付国債(20年)	175,000,000	212,094,750	
第134回	利付国債(20年)	161,000,000	195,721,260	
第135回	利付国債(20年)	100,000,000	120,361,000	
第136回	利付国債(20年)	104,000,000	123,923,280	
第137回	利付国債(20年)	115,000,000	138,733,700	
第138回	利付国債(20年)	125,000,000	147,726,250	
第139回	利付国債(20年)	134,000,000	160,009,400	
第140回	利付国債(20年)	310,000,000	375,050,400	
第141回	利付国債(20年)	221,000,000	267,949,240	
第142回	利付国債(20年)	134,000,000	164,175,460	
第143回	利付国債(20年)	228,000,000	274,220,160	
第144回	利付国債(20年)	153,000,000	182,027,160	
第145回	利付国債(20年)	340,000,000	414,201,600	
第146回	利付国債(20年)	323,000,000	394,550,960	
第147回	利付国債(20年)	352,000,000	426,279,040	
第148回	利付国債(20年)	271,000,000	324,966,940	
第149回	利付国債(20年)	299,000,000	359,344,180	
第150回	利付国債(20年)	314,000,000	373,411,940	
第151回	利付国債(20年)	301,000,000	349,849,290	
第152回	利付国債(20年)	308,000,000	358,274,840	
第153回	利付国債(20年)	317,000,000	374,094,870	
第154回	利付国債(20年)	290,000,000	338,377,800	
第155回	利付国債(20年)	322,000,000	366,265,340	
第156回	利付国債(20年)	282,000,000	294,210,600	
第157回	利付国債(20年)	293,000,000	296,038,410	
第158回	利付国債(20年)	288,000,000	304,784,640	
第159回	利付国債(20年)	290,000,000	311,660,100	
第160回	利付国債(20年)	256,000,000	279,424,000	
第161回	利付国債(20年)	268,000,000	287,866,840	
第162回	利付国債(20年)	262,000,000	281,456,120	
第163回	利付国債(20年)	263,000,000	282,554,050	
第164回	利付国債(20年)	337,000,000	356,175,300	
第165回	利付国債(20年)	270,000,000	285,317,100	
第166回	利付国債(20年)	276,000,000	301,513,440	
第167回	利付国債(20年)	286,000,000	301,830,100	
第168回	利付国債(20年)	253,000,000	262,049,810	
第169回	利付国債(20年)	246,000,000	250,108,200	
第170回	利付国債(20年)	265,000,000	269,229,400	
第171回	利付国債(20年)	99,000,000	100,503,810	
国債証券 合計		53,462,000,000	60,286,981,030	
地方債証券	第707回	東京都公募公債	200,000,000	203,796,400
	第708回	東京都公募公債	300,000,000	306,545,400
	第730回	東京都公募公債	300,000,000	308,876,700
	平成27年度第1回	北海道公募公債	300,000,000	307,471,500
	第30回	神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,379,900
	第360回	大阪府公募公債(10年)	300,000,000	306,361,200
	第378回	大阪府公募公債(10年)	144,000,000	148,064,976
	第12回	大阪府公募公債(20年)	100,000,000	117,639,800
	平成24年度第1回	兵庫県公募公債	300,000,000	306,777,300
	第21回	兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,724,700
	平成24年度第3回	静岡県公募公債	300,000,000	306,358,800
	平成24年度第19回	愛知県公募公債	300,000,000	306,274,200
	平成25年度第4回	埼玉県公募公債	100,000,000	103,325,700

平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	122,475,395	
平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	306,460,800	
平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	306,531,600	
平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	307,485,600	
第10回 群馬県公募公債	300,000,000	308,139,900	
第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,303,300	
第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,197,100	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,334,500	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	154,279,950	
第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	101,821,900	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	134,310,600	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	331,980,600	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	102,978,400	
平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	203,706,800	
第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,362,500	
第4回 川崎市30年公募公債	100,000,000	137,146,100	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	154,506,150	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	153,732,750	
平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	203,467,000	
平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	102,262,900	
平成29年度第1回 仙台市公募公債(20年)	100,000,000	106,322,400	
地方債証券 合計	6,913,000,000	7,236,402,821	
特殊債券			
第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	204,290,600	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	322,478,100	
第139回 政保道路機構債券	500,000,000	508,355,500	
第155回 政保道路機構債券	300,000,000	305,554,800	
第163回 政保道路機構債券	300,000,000	306,514,800	
第190回 政保道路機構債券	500,000,000	510,727,000	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	118,846,100	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	515,327,500	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	116,869,000	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	184,219,819	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	100,713,000	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	106,124,500	
第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,281,000	
第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,328,500	
第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,051,200	
第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,992,400	
第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,476,684	
第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,065,300	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	201,024,400	
第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,027,595,000	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,458,000	32,605,289	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,634,000	88,137,424	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	98,160,000	105,973,536	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,592,000	85,975,545	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	88,914,000	94,737,867	
第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	90,532,000	96,199,302	
第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,742,000	46,283,410	
第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	371,384,000	392,218,642	
第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	232,920,000	244,775,628	
第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	149,364,000	158,445,331	
第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	133,701,000	140,051,797	
第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	249,561,000	252,680,512	
い第822号 利付農林債券	100,000,000	100,267,000	
第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,228,300	
第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,276,000	
第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,291,300	

	第45回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	203,874,600	
	第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,638,700	
特殊債券 合計		8,033,962,000	8,307,495,386	
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	201,449,800	
	第3回 ノルデア・バンク	200,000,000	207,502,800	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンク	200,000,000	204,286,400	
	第33回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,167,200	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	205,920,200	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	102,694,100	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	102,774,600	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	205,204,600	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	206,399,400	
	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	102,194,200	
	第12回 オリエンタルランド	100,000,000	100,750,200	
	第3回 富士フィルムホールディングス	300,000,000	306,966,900	
	第68回 新日本製鐵	200,000,000	203,367,000	
	第19回 豊田自動織機	200,000,000	203,306,400	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	102,398,800	
	第71回 伊藤忠商事	200,000,000	204,646,400	
	第39回 住友商事	100,000,000	103,437,600	
	第45回 住友商事	100,000,000	102,312,000	
	第46回 住友商事	100,000,000	102,286,300	
	第79回 三菱商事	100,000,000	102,233,100	
	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	102,173,000	
	第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	203,679,400	
	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	102,192,000	
	第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	103,032,300	
	第46回 三井不動産	100,000,000	102,326,600	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,771,500	
	第111回 三菱地所	100,000,000	102,277,500	
	第75回 東京急行電鉄	100,000,000	102,214,000	
	第77回 東京急行電鉄	100,000,000	103,155,800	
	第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,347,000	
	第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,096,300	
	第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	204,441,200	
	第381回 中国電力	200,000,000	207,149,000	
第304回 北陸電力	100,000,000	103,386,600		
第306回 北陸電力	100,000,000	103,307,600		
第253回 四国電力	200,000,000	206,393,200		
第429回 九州電力	200,000,000	207,204,200		
第13回 電源開発	100,000,000	110,003,800		
社債券 合計		5,600,000,000	5,744,449,000	
合計		74,008,962,000	81,575,328,237	

## 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)

	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	388,094,903	1,119,682,869
金銭信託	111,174,221	146,850,868
コール・ローン	2,269,384,208	6,304,474,246
株式	156,190,082,429	231,824,581,396
投資証券	4,073,157,868	6,540,003,766
派生商品評価勘定	134,259,059	234,248,770
未収入金	32,983	937,275
未収配当金	222,399,264	300,938,345
差入委託証拠金	1,479,571,172	2,400,932,652
流動資産合計	164,868,156,107	248,872,650,187
資産合計	164,868,156,107	248,872,650,187
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,018,478	15,814,319
未払解約金	421,904,508	665,847,583
その他未払費用	1,521	6,030
流動負債合計	422,924,507	681,667,932
負債合計	422,924,507	681,667,932
純資産の部		
元本等		
元本	94,844,967,281	117,983,458,933
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	69,600,264,319	130,207,523,322
純資産合計	164,445,231,600	248,190,982,255
負債純資産合計	164,868,156,107	248,872,650,187

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 受益権総口数	94,844,967,281口	117,983,458,933口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7338円 (17,338円)	2.1036円 (21,036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22日 至 2019年2月21日	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	6,368,984,989	15,236,825,699
投資証券	183,691,569	409,353,240
合計	6,552,676,558	15,646,178,939

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年2月21日 現在				2020年2月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343	5,803,139,733	-	5,893,526,850	90,387,117
アメリカ・ドル	1,181,436,898	-	1,183,137,060	1,700,162	3,967,053,862	-	4,038,994,050	71,940,188
イギリス・ポンド	151,340,332	-	153,482,000	2,141,668	535,591,504	-	541,632,960	6,041,456
ユーロ	397,018,667	-	399,309,180	2,290,513	1,300,494,367	-	1,312,899,840	12,405,473
合計	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343	5,803,139,733	-	5,893,526,850	90,387,117

## （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	2019年2月21日 現在				2020年2月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買建	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236	9,369,455,136	-	9,497,502,470	128,047,334
合計	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236	9,369,455,136	-	9,497,502,470	128,047,334

## （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	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	70,849,080,074円	94,844,967,281円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	37,550,145,965円	46,386,791,267円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	13,554,258,758円	23,248,299,615円
元本の内訳		
ファンド名		
D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	595,531,315円	696,655,998円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,819,138,551円	3,224,381,334円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,160,421,182円	2,452,973,512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	1,513,732,410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	3,829,046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	21,474,187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	22,999,716円
ニッセイ外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	11,698,042,919円	11,360,289,899円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	65,072,270,014円	80,906,577,165円
D Cニッセイ外国株式インデックス	11,899,518,770円	16,474,845,579円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	468,264,447円	643,991,640円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	19,393,803円	64,268,965円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,566,941円	78,409,740円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	11,777,271円	46,775,884円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	18,901,250円	85,402,524円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	6,227,388円	19,418,185円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	21,917,060円	44,985,994円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,928,154円	5,390,457円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,040,927円	3,830,933円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	700,329円	1,044,944円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	11,598,689円	17,772,213円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	210,461円	6,776,594円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	199,701円	5,379,134円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	188,906円	8,209,983円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	129,203円	7,956,127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	266,086,770円
計	94,844,967,281円	117,983,458,933円

附属明細表(2020年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	28,869	158.56	4,577,468.64	
	ABBOTT LABORATORIES	88,791	88.46	7,854,451.86	
	ABBVIE INC	74,304	94.23	7,001,665.92	
	ABIOMED INC	2,275	168.08	382,382.00	

ACCENTURE PLC	31,946	213.90	6,833,249.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,506	64.00	2,464,384.00
ACUITY BRANDS INC	1,979	115.85	229,267.15
ADOBE INC	24,368	378.96	9,234,497.28
ADVANCE AUTO PARTS	3,578	142.48	509,793.44
ADVANCED MICRO DEVICES INC	51,839	57.27	2,968,819.53
AERCAP HOLDINGS NV	6,151	62.60	385,052.60
AES CORP	33,372	20.80	694,137.60
AFLAC INC	37,085	51.49	1,909,506.65
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,451	84.34	1,303,137.34
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,096	255.40	2,833,918.40
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	8,255	101.47	837,634.85
ALBEMARLE CORP	5,305	94.31	500,314.55
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,222	102.54	1,150,703.88
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,807	272.49	1,037,369.43
ALLEGHANY CORP	736	800.43	589,116.48
ALLEGION PLC	4,718	129.85	612,632.30
ALLERGAN PLC	16,492	198.74	3,277,620.08
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,189	103.06	225,598.34
ALLIANT ENERGY CORP	11,959	59.57	712,397.63
ALLSTATE CORP	16,485	123.46	2,035,238.10
ALLY FINANCIAL INC	19,625	29.40	576,975.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,597	133.12	745,072.64
ALPHABET INC-CL A	14,970	1,516.99	22,709,340.30
ALPHABET INC-CL C	15,777	1,518.15	23,951,852.55
ALTICE USA INC- A	7,284	29.01	211,308.84
ALTRIA GROUP INC	93,907	45.56	4,278,402.92
AMAZON.COM INC	21,123	2,153.10	45,479,931.30
AMCOR PLC	82,350	10.27	845,734.50
AMERCO	495	343.02	169,794.90
AMEREN CORPORATION	12,286	85.66	1,052,418.76
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,474	28.51	156,063.74
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	24,860	102.38	2,545,166.80
AMERICAN EXPRESS CO	35,416	136.58	4,837,117.28
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,827	112.30	429,772.10
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	43,809	49.80	2,181,688.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,158	137.30	1,257,393.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,513	179.72	1,170,516.36
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,875	96.53	760,173.75
AMERITRADE HOLDING CORP	13,734	51.01	700,571.34
AMETEK INC	11,420	100.55	1,148,281.00
AMGEN INC	30,129	222.14	6,692,856.06
AMPHENOL CORP-CL A	14,919	103.71	1,547,249.49
ANALOG DEVICES INC	18,616	124.55	2,318,622.80



ANSYS INC	4,192	294.02	1,232,531.84
ANTHEM INC	12,846	293.94	3,775,953.24
AON PLC	11,833	234.33	2,772,826.89
APACHE CORP	18,907	28.58	540,362.06
APPLE INC	227,016	320.30	72,713,224.80
APPLIED MATERIALS INC	46,348	66.40	3,077,507.20
APTIV PLC	12,886	91.09	1,173,785.74
ARAMARK	12,439	42.86	533,135.54
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,276	47.90	971,220.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,790	44.23	1,229,151.70
ARCONIC INC	19,899	33.70	670,596.30
ARISTA NETWORKS INC	2,688	228.28	613,616.64
ARROW ELECTRONICS INC	4,065	80.00	325,200.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,371	108.17	1,013,661.07
ASSURANT INC	3,063	141.57	433,628.91
AT&T INC	367,447	38.61	14,187,128.67
ATHENE HOLDING LTD- CLASS A	7,431	49.75	369,692.25
ATMOS ENERGY CORP	5,883	119.23	701,430.09
AUTODESK INC	11,045	206.67	2,282,670.15
AUTOLIV INC	4,204	75.22	316,224.88
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	21,818	180.77	3,944,039.86
AUTOZONE INC	1,233	1,082.52	1,334,747.16
AVERY DENNISON CORP	4,240	136.77	579,904.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,654	29.65	315,891.10
BAKER HUGHES COMPANY	31,819	20.66	657,380.54
BALL CORP	15,972	76.60	1,223,455.20
BANK OF AMERICA CORP	443,981	34.85	15,472,737.85
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	42,582	45.83	1,951,533.06
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,363	93.06	2,267,220.78
BECTON DICKINSON & CO	13,567	253.46	3,438,691.82
BEIGENE LTD-ADR	1,829	171.00	312,759.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	66,130	228.17	15,088,882.10
BEST BUY CO INC	12,004	91.93	1,103,527.72
BIO-RAD LABORATORIES- CL A	1,116	409.07	456,522.12
BIOGEN INC	9,246	336.64	3,112,573.44
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,005	89.66	807,388.30
BLACK KNIGHT INC	7,549	75.01	566,250.49
BLACKROCK INC	5,803	566.92	3,289,836.76
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	33,275	62.45	2,078,023.75
BOEING CO	26,863	336.28	9,033,489.64
BOOKING HOLDINGS INC	2,133	1,970.91	4,203,951.03
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,103	74.49	529,102.47
BORGWARNER INC	10,350	35.15	363,802.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,984	42.50	2,974,320.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	117,792	65.17	7,676,504.64
BROADCOM INC	20,020	309.24	6,190,984.80

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	5,769	121.38	700,241.22	
BROWN & BROWN INC	11,940	48.51	579,209.40	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	15,478	71.55	1,107,450.90	
BUNGE LIMITED	7,168	53.98	386,928.64	
BURLINGTON STORES INC	3,335	245.80	819,743.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,107	74.82	531,745.74	
CABOT OIL & GAS CORP	21,088	15.35	323,700.80	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	13,968	76.97	1,075,116.96	
CAMPBELL SOUP CO	8,375	47.74	399,822.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,550	103.54	2,438,367.00	
CAPRI HOLDINGS LIMITED	7,541	28.86	217,633.26	
CARDINAL HEALTH INC	15,037	60.42	908,535.54	
CARMAX INC	8,352	101.90	851,068.80	
CARNIVAL CORP	21,050	42.50	894,625.00	
CATERPILLAR INC	28,240	136.93	3,866,903.20	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,640	122.83	692,761.20	
CBRE GROUP INC	15,967	63.70	1,017,097.90	
CDK GLOBAL INC	6,101	51.49	314,140.49	
CDW CORP/DE	7,297	138.24	1,008,737.28	
CELANESE CORP-SERIES A	6,201	108.90	675,288.90	
CENTENE CORP	29,314	65.73	1,926,809.22	
CENTERPOINT ENERGY INC	25,354	25.72	652,104.88	
CENTURYLINK INC	50,023	13.37	668,807.51	
CERNER CORP	15,947	76.71	1,223,294.37	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,148	39.48	440,123.04	
CHARLES SCHWAB CORP	59,038	48.58	2,868,066.04	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	7,830	539.22	4,222,092.60	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,073	117.54	713,820.42	
CHENIERE ENERGY INC	11,791	54.87	646,972.17	
CHEVRON CORP	95,325	109.81	10,467,638.25	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,327	927.59	1,230,911.93	
CHUBB LTD	22,896	163.15	3,735,482.40	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,459	76.31	950,746.29	
CIGNA CORP	18,970	220.41	4,181,177.70	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,809	112.12	875,545.08	
CINTAS CORP	4,383	297.70	1,304,819.10	
CISCO SYSTEMS INC	214,886	46.85	10,067,409.10	
CITIGROUP INC	113,415	78.22	8,871,321.30	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	22,355	38.78	866,926.90	
CITRIX SYSTEMS INC	6,517	119.57	779,237.69	
CLOROX CO	6,326	164.17	1,038,539.42	
CME GROUP INC	18,017	209.00	3,765,553.00	
CMS ENERGY CORP	14,483	68.59	993,388.97	
COCA-COLA CO	204,152	59.72	12,191,957.44	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,704	55.91	654,370.64	
COGNEX CORP	8,532	52.75	450,063.00	

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	27,627	69.56	1,921,734.12	
COLGATE-PALMOLIVE CO	40,947	75.16	3,077,576.52	
COMCAST CORP	228,105	46.02	10,497,392.10	
COMERICA INC	7,422	63.43	470,777.46	
CONAGRA BRANDS INC	24,467	29.88	731,073.96	
CONCHO RESOURCES INC	10,050	81.34	817,467.00	
CONOCOPHILLIPS	55,612	58.88	3,274,434.56	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,717	94.58	1,581,093.86	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,399	208.34	1,749,847.66	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,569	25.75	117,651.75	
COOPER COS INC/THE	2,482	354.83	880,688.06	
COPART INC	10,364	97.30	1,008,417.20	
CORNING INC	39,159	28.29	1,107,808.11	
CORTEVA INC	37,767	31.57	1,192,304.19	
COSTAR GROUP INC	1,841	721.51	1,328,299.91	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,077	324.08	7,154,714.16	
COTY INC-CL A	15,474	11.42	176,713.08	
CROWN HOLDINGS INC	6,836	78.89	539,292.04	
CSX CORP	38,460	80.45	3,094,107.00	
CUMMINS INC	7,516	167.12	1,256,073.92	
CVS HEALTH CORP	65,349	71.94	4,701,207.06	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,914	122.65	234,752.10	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,600	5.17	90,992.00	
DANAHER CORP	32,425	160.26	5,196,430.50	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,173	120.68	744,957.64	
DAVITA INC	5,197	84.65	439,926.05	
DEERE & CO	15,042	165.83	2,494,414.86	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,952	52.95	421,058.40	
DELTA AIR LINES INC	8,117	58.38	473,870.46	
DENTSPLY SIRONA INC	11,325	57.44	650,508.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	19,910	22.15	441,006.50	
DEXCOM INC	4,609	302.51	1,394,268.59	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,767	78.48	609,554.16	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,969	75.79	1,210,290.51	
DISCOVERY INC-A	9,025	29.98	270,569.50	
DISCOVERY INC-C	17,635	28.60	504,361.00	
DISH NETWORK CORP	12,138	41.00	497,658.00	
DOCUSIGN INC	5,284	90.31	477,198.04	
DOLLAR GENERAL CORP	12,916	165.73	2,140,568.68	
DOLLAR TREE INC	11,909	93.22	1,110,156.98	
DOMINION ENERGY INC	41,433	89.25	3,697,895.25	
DOMINO'S PIZZA INC	1,969	373.16	734,752.04	
DOVER CORP	7,306	119.02	869,560.12	
DOW INC	37,405	48.76	1,823,867.80	
DR HORTON INC	17,705	62.05	1,098,595.25	
DROPBOX INC-CLASS A	11,986	18.71	224,317.99	
DTE ENERGY COMPANY	9,246	133.95	1,238,501.70	
DUKE ENERGY CORP	36,682	101.43	3,720,655.26	
DUPONT DE NEMOURS INC	37,425	52.55	1,966,683.75	
DXC TECHNOLOGY CO	13,145	30.40	399,608.00	
E*TRADE FINANCIAL	11,837	54.73	647,839.01	

EAST WEST BANCORP INC	7,103	47.67	338,600.01
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,835	74.13	506,678.55
EATON CORP PLC	21,115	105.10	2,219,186.50
EATON VANCE CORP	5,468	51.68	282,586.24
EBAY INC	39,948	37.69	1,505,640.12
ECOLAB INC	13,032	206.31	2,688,631.92
EDISON INTERNATIONAL	18,037	77.32	1,394,620.84
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,446	233.91	2,443,423.86
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,857	30.23	539,817.11
ELECTRONIC ARTS INC	14,774	109.20	1,613,320.80
ELI LILLY & CO	43,664	142.00	6,200,288.00
EMERSON ELECTRIC CO	30,790	72.02	2,217,495.80
ENTERGY CORP	10,114	131.45	1,329,485.30
EOG RESOURCES INC	29,051	75.99	2,207,585.49
EPAM SYSTEMS INC	2,749	238.05	654,399.45
EQUIFAX INC	6,092	161.43	983,431.56
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,883	27.15	566,973.45
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,289	160.58	206,987.62
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,936	53.50	585,076.00
ESTEE LAUDER COS INC	11,108	211.32	2,347,342.56
EVEREST RE GROUP LTD	2,072	287.93	596,590.96
EVERGY INC	11,907	73.56	875,878.92
EVERSOURCE ENERGY	16,335	95.65	1,562,442.75
EXACT SCIENCES CORP	7,370	102.64	756,456.80
EXELON CORP	48,763	49.85	2,430,835.55
EXPEDIA GROUP INC	7,053	121.66	858,067.98
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	8,946	75.47	675,154.62
EXXON MOBIL CORP	212,430	59.86	12,716,059.80
F5 NETWORKS INC	2,932	132.85	389,516.20
FACEBOOK INC-A	120,847	214.58	25,931,349.26
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,908	302.65	577,456.20
FASTENAL CO	28,763	39.02	1,122,332.26
FEDEX CORP	12,559	164.91	2,071,104.69
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,788	44.02	606,947.76
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	30,842	156.78	4,835,408.76
FIFTH THIRD BANCORP	36,429	29.83	1,086,677.07
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,447	117.69	994,127.43
FIRSTENERGY CORP	27,142	51.79	1,405,684.18
FISERV INC	29,084	121.84	3,543,594.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,355	317.39	1,382,233.45
FLEX LTD	25,894	13.82	357,855.08
FLIR SYSTEMS INC	6,729	58.19	391,560.51
FLOWSERVE CORP	6,569	46.35	304,473.15
FMC CORP	6,549	108.29	709,191.21
FORD MOTOR CO	197,356	8.03	1,584,768.68
FORTINET INC	7,311	118.00	862,698.00
FORTIVE CORP	15,105	76.79	1,159,912.95

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	7,048	72.99	514,433.52	
FOX CORP - CLASS A	17,504	37.03	648,173.12	
FOX CORP- CLASS B	9,094	36.54	332,294.76	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,711	25.67	377,631.37	
FREEMPORT-MCMORAN INC	72,676	12.08	877,926.08	
GAP INC	11,088	17.47	193,707.36	
GARMIN LTD	6,686	99.81	667,329.66	
GARTNER INC	4,537	154.95	703,008.15	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,308	185.95	2,288,672.60	
GENERAL ELECTRIC CO	438,631	12.53	5,496,046.43	
GENERAL MILLS INC	30,381	54.13	1,644,523.53	
GENERAL MOTORS CO	64,547	35.29	2,277,863.63	
GENUINE PARTS CO	7,328	99.61	729,942.08	
GILEAD SCIENCES INC	63,549	67.00	4,257,783.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,092	208.47	3,146,229.24	
GLOBE LIFE INC	5,075	111.16	564,137.00	
GODADDY INC - CLASS A	8,987	77.20	693,796.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,227	232.73	3,776,509.71	
GRUBHUB INC	4,548	58.29	265,102.92	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,131	122.07	504,271.17	
HALLIBURTON CO	43,673	21.95	958,622.35	
HANESBRANDS INC	18,220	14.72	268,198.40	
HARLEY-DAVIDSON INC	7,912	35.87	283,803.44	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	18,121	58.08	1,052,467.68	
HASBRO INC	6,489	98.88	641,632.32	
HCA HEALTHCARE INC	13,686	148.11	2,027,033.46	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,396	43.02	361,195.92	
HEICO CORP	2,184	127.23	277,870.32	
HEICO CORP-CLASS A	3,827	101.88	389,894.76	
HENRY SCHEIN INC	7,385	68.92	508,974.20	
HERSHEY CO/THE	7,532	160.11	1,205,948.52	
HESS CORP	13,739	64.72	889,188.08	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	65,318	14.47	945,151.46	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,687	112.00	1,532,944.00	
HOLLYFRONTIER CORP	7,736	42.61	329,630.96	
HOLOGIC INC	13,441	52.70	708,340.70	
HOME DEPOT INC	55,002	247.02	13,586,594.04	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,128	180.70	6,528,329.60	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	59,700	5.48	327,156.00	
HORMEL FOODS CORP	14,651	45.53	667,060.03	
HP INC	74,183	22.64	1,679,503.12	
HUMANA INC	6,779	370.99	2,514,941.21	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	52,123	14.14	737,019.22	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,047	237.42	485,998.74	
IAC/INTERACTIVECORP	3,961	233.56	925,131.16	
IDEX CORP	3,790	173.58	657,868.20	
IDEXX LABORATORIES INC	4,333	281.45	1,219,522.85	
IHS MARKIT LTD	19,220	80.44	1,546,056.80	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	16,267	190.00	3,090,730.00	

ILLUMINA INC	7,378	300.46	2,216,793.88
INCYTE CORP	9,217	82.77	762,891.09
INGERSOLL-RAND PLC	12,156	146.01	1,774,897.56
INGREDION INC	3,298	94.94	313,112.12
INSULET CORP	3,056	216.44	661,440.64
INTEL CORP	222,505	65.45	14,562,952.25
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,207	95.21	2,685,588.47
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	44,496	151.22	6,728,685.12
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	5,112	132.69	678,311.28
INTERNATIONAL PAPER CO	18,744	42.95	805,054.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,746	24.93	492,267.78
INTUIT INC	13,035	301.24	3,926,663.40
INTUITIVE SURGICAL INC	5,776	618.29	3,571,243.04
INVESCO LTD	19,931	18.03	359,355.93
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,757	61.29	414,136.53
IPG PHOTONICS CORP	1,847	140.87	260,186.89
IQVIA HOLDINGS INC	8,432	164.14	1,384,028.48
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,833	174.46	668,705.18
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,809	102.03	694,722.27
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,200	58.00	649,600.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	11,200	31.35	351,120.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,818	135.50	381,839.00
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,490	109.96	493,720.40
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,657	23.72	300,224.04
JM SMUCKER CO	5,733	110.56	633,840.48
JOHNSON & JOHNSON	132,570	148.37	19,669,410.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,098	42.24	1,693,739.52
JONES LANG LASALLE INC	2,565	165.85	425,405.25
JPMORGAN CHASE & CO	160,594	137.49	22,080,069.06
JUNIPER NETWORKS INC	17,192	24.32	418,109.44
KANSAS CITY SOUTHERN	5,217	175.97	918,035.49
KELLOGG CO	12,870	65.67	845,172.90
KEYCORP	50,337	20.02	1,007,746.74
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,448	98.46	930,250.08
KIMBERLY-CLARK CORP	17,351	142.17	2,466,791.67
KINDER MORGAN INC	102,718	22.24	2,284,448.32
KKR & CO INC -A	24,659	33.70	831,008.30
KLA CORPORATION	8,010	167.30	1,340,073.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,794	39.66	269,450.04
KOHL'S CORP	8,127	44.77	363,845.79
KRAFT HEINZ CO/THE	33,845	27.42	928,029.90
KROGER CO	40,039	29.78	1,192,361.42
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,241	223.80	2,515,735.80

LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	4,899	188.81	924,980.19	
LAM RESEARCH CORP	7,256	328.49	2,383,523.44	
LAMB WESTON HOLDING INC	7,341	94.92	696,807.72	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,336	67.44	1,169,139.84	
LEAR CORP	2,889	124.70	360,258.30	
LEGGETT & PLATT INC	6,677	45.19	301,733.63	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,901	119.27	823,082.27	
LENNAR CORP-CL A	14,334	71.03	1,018,144.02	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,766	248.71	439,221.86	
LIBERTY BROADBAND-C	5,428	138.27	750,529.56	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,833	21.41	167,704.53	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,574	20.29	437,736.46	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,356	50.93	221,851.08	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	8,332	51.14	426,098.48	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	10,342	46.81	484,109.02	
LINCOLN NATIONAL CORP	9,827	61.03	599,741.81	
LINDE PLC	27,186	221.20	6,013,543.20	
LIVE NATION INC	7,624	75.66	576,831.84	
LKQ CORP	15,428	34.02	524,860.56	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,792	425.97	5,449,008.24	
LOEWS CORP	13,551	53.89	730,263.39	
LOWE'S COS INC	38,983	126.57	4,934,078.31	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,564	263.68	1,467,115.52	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,432	83.35	1,119,557.20	
M&T BANK CORP	6,360	169.53	1,078,210.80	
MANPOWER GROUP	2,907	92.38	268,548.66	
MARATHON OIL CORP	40,024	10.25	410,246.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,030	60.26	1,990,387.80	
MARKEL CORP	691	1,341.08	926,686.28	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,905	344.60	656,463.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	14,030	146.84	2,060,165.20	
MARSH & MCLENNAN COS INC	25,440	117.08	2,978,515.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,151	258.08	813,210.08	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,702	25.13	796,671.26	
MASCO CORP	14,582	45.40	662,022.80	
MASTERCARD INC-CLASS A	45,341	344.45	15,617,707.45	
MATCH GROUP INC	2,886	75.15	216,882.90	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,609	62.43	849,609.87	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,200	163.83	1,015,746.00	
MCDONALD'S CORP	38,179	215.08	8,211,539.32	
MCKESSON CORP	9,303	170.78	1,588,766.34	
MEDTRONIC PLC	67,423	113.86	7,676,782.78	

MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	10,619	20.91	222,043.29	
MERCADOLIBRE INC	2,254	742.59	1,673,797.86	
MERCK & CO INC	128,660	82.49	10,613,163.40	
METLIFE INC	39,694	52.28	2,075,202.32	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,229	755.39	928,374.31	
MGM MIRAGE	24,924	32.34	806,042.16	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,009	108.13	1,298,533.17	
MICRON TECHNOLOGY INC	55,420	59.00	3,269,780.00	
MICROSOFT CORP	364,360	184.42	67,195,271.20	
MIDDLEBY CORP	2,805	112.01	314,188.05	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,072	134.17	412,170.24	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	9,536	55.41	528,389.76	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	72,359	59.04	4,272,075.36	
MONGODB INC	2,132	178.10	379,709.20	
MONSTER BEVERAGE CORP	20,441	70.40	1,439,046.40	
MOODY'S CORP	8,559	278.87	2,386,848.33	
MORGAN STANLEY	62,130	53.75	3,339,487.50	
MOSAIC CO/THE	18,200	18.47	336,154.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,356	185.60	1,550,873.60	
MSCI INC	4,264	321.71	1,371,771.44	
MYLAN NV	25,727	20.92	538,337.47	
NASDAQ INC	5,796	114.49	663,584.04	
NATIONAL-OILWELL INC	19,171	23.62	452,819.02	
NETAPP INC	11,912	53.71	639,793.52	
NETFLIX INC	22,009	386.00	8,495,474.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,400	103.15	453,860.00	
NEWELL BRANDS INC	20,337	19.89	404,502.93	
NEWMONT CORP	41,018	48.10	1,972,965.80	
NEWS CORP - CLASS A	19,552	14.54	284,383.84	
NEXTERA ENERGY INC	24,100	277.03	6,676,423.00	
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,093	22.25	402,569.25	
NIKE INC	62,873	102.53	6,446,368.69	
NISOURCE INC	18,812	30.05	565,300.60	
NOBLE ENERGY INC	24,008	18.55	445,348.40	
NORDSTROM INC	5,458	41.08	224,214.64	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,412	210.81	2,827,383.72	
NORTHERN TRUST CORP	10,233	102.70	1,050,929.10	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,085	363.25	2,936,876.25	
NORTONLIFELOCK INC	31,019	20.79	644,885.01	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,720	48.51	520,027.20	
NRG ENERGY INC	12,576	39.04	490,967.04	
NUCOR CORP	15,033	47.85	719,329.05	
NVIDIA CORP	29,054	308.70	8,968,969.80	
NVR INC	176	4,037.77	710,647.52	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,039	134.80	1,892,457.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,847	395.18	1,520,257.46	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	44,969	42.97	1,932,317.93	
OGE ENERGY CORP	9,940	44.92	446,504.80	
OKTA INC	5,388	138.55	746,507.40	



OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,335	225.72	752,776.20	
OMNICOM GROUP	11,069	78.78	872,015.82	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	20,558	20.60	423,494.80	
ONEOK INC	20,804	77.52	1,612,726.08	
ORACLE CORP	117,259	55.51	6,509,047.09	
OWENS CORNING	5,482	66.85	366,471.70	
PACCAR INC	17,403	75.54	1,314,622.62	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,725	99.10	468,247.50	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,839	249.14	1,205,588.46	
PARKER HANNIFIN CORP	6,436	215.28	1,385,542.08	
PAYCHEX INC	16,233	90.23	1,464,703.59	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,513	310.33	779,859.29	
PAYPAL HOLDINGS INC	56,173	122.43	6,877,260.39	
PENTAIR PLC	7,904	44.55	352,123.20	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	22,074	16.35	360,909.90	
PEPSICO INC	70,235	145.16	10,195,312.60	
PERKINELMER INC	5,540	93.30	516,882.00	
PERRIGO CO PLC	6,494	59.61	387,107.34	
PFIZER INC	277,800	35.85	9,959,130.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	78,171	87.44	6,835,272.24	
PHILLIPS 66	22,455	90.19	2,025,216.45	
PINNACLE WEST CAPITAL	5,621	101.09	568,226.89	
PINTEREST INC- CLASS A	7,469	23.54	175,820.26	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,400	142.53	1,197,252.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,370	154.48	3,455,717.60	
POLARIS INC	2,923	94.52	276,281.96	
PPG INDUSTRIES INC	11,879	119.36	1,417,877.44	
PPL CORPORATION	36,283	35.41	1,284,781.03	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,943	55.98	780,529.14	
PROCTER & GAMBLE CO	125,782	126.58	15,921,485.56	
PROGRESSIVE CORP	29,297	80.84	2,368,369.48	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,088	93.78	1,883,852.64	
PTC INC	5,491	88.38	485,294.58	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	25,377	59.18	1,501,810.86	
PULTE GROUP INC	13,176	46.67	614,923.92	
PVH CORP	3,715	86.88	322,759.20	
QORVO INC	5,947	101.56	603,977.32	
QUALCOMM INC	61,097	89.47	5,466,348.59	
QUEST DIAGNOSTICS	6,750	112.84	761,670.00	
RALPH LAUREN CORP	2,584	121.86	314,886.24	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,158	101.26	623,559.08	
RAYTHEON CO	13,987	220.44	3,083,294.28	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,054	399.14	1,618,113.56	
REGIONS FINANCIAL CORP	49,805	16.54	823,774.70	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,102	153.20	475,226.40	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,249	196.77	442,535.73	
REPUBLIC SERVICES INC	11,426	99.12	1,132,545.12	
RESMED INC	7,259	176.00	1,277,584.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,629	243.76	884,605.04	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	5,696	59.26	337,544.96	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,885	205.31	1,208,249.35	
ROKU INC	4,307	124.08	534,412.56	
ROLLINS INC	7,343	39.97	293,499.71	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,220	384.01	2,004,532.20	
ROSS STORES INC	18,262	123.81	2,261,018.22	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,905	109.80	977,769.00	
RPM INTERNATIONAL INC	6,572	74.32	488,431.04	
S&P GLOBAL INC	12,378	303.41	3,755,608.98	
SABRE CORP	13,834	22.25	307,806.50	
SALESFORCE.COM INC	41,850	193.36	8,092,116.00	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,757	123.09	462,449.13	
SCHLUMBERGER LTD	69,619	33.83	2,355,210.77	
SEAGATE TECHNOLOGY	12,168	54.75	666,198.00	
SEALED AIR CORP	7,854	34.94	274,418.76	
SEATTLE GENETICS INC	5,953	118.33	704,418.49	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,212	69.24	430,118.88	
SEMPRA ENERGY	13,832	159.89	2,211,598.48	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,067	48.35	390,039.45	
SERVICENOW INC	9,434	352.94	3,329,635.96	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,181	584.08	2,442,038.48	
SIGNATURE BANK	2,776	146.47	406,600.72	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	79,576	7.34	584,087.84	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,624	117.50	1,013,320.00	
SMITH (A.O.) CORP	6,943	44.52	309,102.36	
SNAP INC - A	36,281	16.92	613,874.52	
SNAP-ON INC	2,743	159.95	438,742.85	
SOUTHERN CO	52,727	69.81	3,680,871.87	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,657	56.94	379,049.58	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5,172	65.03	336,335.16	
SPLUNK INC	7,563	173.41	1,311,499.83	
SPRINT CORP	42,229	9.48	400,330.92	
SQUARE INC - A	17,232	85.70	1,476,782.40	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,526	64.89	747,922.14	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,617	162.05	1,234,334.85	
STARBUCKS CORP	60,156	88.60	5,329,821.60	
STATE STREET CORP	18,663	77.89	1,453,661.07	
STEEL DYNAMICS INC	10,848	29.35	318,388.80	
STERIS PLC	4,258	168.28	716,536.24	
STRYKER CORP	16,923	224.47	3,798,705.81	
SVB FINANCIAL GROUP	2,551	270.79	690,785.29	
SYNCHRONY FINANCIAL	29,994	33.64	1,008,998.16	
SYNOPSIS INC	7,510	155.08	1,164,650.80	

SYSCO CORP	24,493	76.71	1,878,858.03
T ROWE PRICE GROUP INC	11,662	137.74	1,606,323.88
T-MOBILE US INC	17,334	99.50	1,724,733.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,694	115.13	655,550.22
TAPESTRY INC	14,422	28.81	415,497.82
TARGA RESOURCES CORP	12,003	39.45	473,518.35
TARGET CORP	25,679	118.26	3,036,798.54
TE CONNECTIVITY LTD	16,820	92.92	1,562,914.40
TECHNIPFMC PLC	21,566	17.24	371,797.84
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,821	392.15	714,105.15
TELEFLEX INC	2,331	384.36	895,943.16
TERADYNE INC	8,511	67.89	577,811.79
TESLA, INC.	6,763	899.41	6,082,709.83
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	54,918	13.31	730,958.58
TEXAS INSTRUMENTS INC	46,906	131.47	6,166,731.82
TEXTRON INC	11,377	47.63	541,886.51
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,114	336.06	6,759,510.84
TIFFANY & CO	5,457	134.19	732,274.83
TJX COS INC	60,628	63.87	3,872,310.36
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,963	99.00	590,337.00
TRANSDIGM GROUP INC	2,421	634.32	1,535,688.72
TRANSUNION	9,485	100.35	951,819.75
TRAVELERS COS INC/THE	13,057	133.98	1,749,376.86
TRIMBLE INC	12,530	46.13	578,008.90
TRIPADVISOR INC	5,332	28.97	154,468.04
TRUIST FINANCIAL CORP	67,416	55.31	3,728,778.96
TWILIO INC - A	5,819	126.71	737,325.49
TWITTER INC	36,911	39.05	1,441,374.55
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,952	334.16	652,280.32
TYSON FOODS INC-CL A	14,815	78.80	1,167,422.00
UBER TECHNOLOGIES INC	9,925	40.92	406,131.00
UGI CORP	10,472	41.00	429,352.00
ULTA BEAUTY INC	2,806	301.34	845,560.04
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	9,326	16.50	153,879.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	10,008	14.94	149,519.52
UNION PACIFIC CORP	35,602	183.40	6,529,406.80
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	3,129	79.91	250,038.39
UNITED PARCEL SERVICE INC	35,184	106.48	3,746,392.32
UNITED RENTALS INC	3,851	155.72	599,677.72
UNITED TECHNOLOGIES CORP	41,170	149.90	6,171,383.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	47,603	302.13	14,382,294.39
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4,050	140.03	567,121.50
UNUM GROUP	9,993	30.12	300,989.16
US BANCORP	75,196	54.80	4,120,740.80
VAIL RESORTS INC	2,023	248.54	502,796.42
VALERO ENERGY CORP	20,764	84.17	1,747,705.88
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,538	145.07	658,327.66

VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	6,541	164.97	1,079,068.77	
VERISIGN INC	5,328	209.06	1,113,871.68	
VERISK ANALYTICS INC	7,833	169.39	1,326,831.87	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	208,117	58.09	12,089,516.53	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,924	245.10	3,167,672.40	
VF CORP	16,991	83.99	1,427,074.09	
VIACOMCBS INC	27,473	29.29	804,684.17	
VISA INC-CLASS A SHARES	86,717	211.45	18,336,309.65	
VISTRA ENERGY CORP	18,589	22.91	425,873.99	
VMWARE INC-CLASS A	4,109	162.20	666,479.80	
VOYA FINANCIAL INC	6,962	63.62	442,922.44	
VULCAN MATERIALS CO	6,671	135.79	905,855.09	
WABCO HOLDINGS INC	2,589	135.96	352,000.44	
WABTEC CORP	9,161	78.84	722,253.24	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	38,448	51.87	1,994,297.76	
WALMART INC	71,657	117.69	8,433,312.33	
WALT DISNEY CO	90,512	140.37	12,705,169.44	
WASTE CONNECTIONS INC	13,330	102.57	1,367,258.10	
WASTE MANAGEMENT INC	21,412	124.05	2,656,158.60	
WATERS CORP	3,329	217.34	723,524.86	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,119	82.33	256,787.27	
WEC ENERGY GROUP INC	16,001	102.39	1,638,342.39	
WELLS FARGO & CO	210,290	47.34	9,955,128.60	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,699	171.67	635,007.33	
WESTERN DIGITAL CORP	14,909	69.06	1,029,615.54	
WESTERN UNION CO	21,465	26.50	568,822.50	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,929	63.40	122,298.60	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	12,905	40.55	523,297.75	
WEYERHAEUSER CO	37,192	30.87	1,148,117.04	
WHIRLPOOL CORP	3,196	149.08	476,459.68	
WILLIAMS COS INC	61,180	22.05	1,349,019.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,466	209.50	1,354,627.00	
WIX.COM LTD	2,423	141.68	343,290.64	
WORKDAY INC-CLASS A	8,260	190.56	1,574,025.60	
WR BERKLEY CORP	7,398	78.07	577,561.86	
WW GRAINGER INC	2,326	310.29	721,734.54	
WYNN RESORTS LTD	4,856	133.33	647,450.48	
XCEL ENERGY INC	25,944	70.67	1,833,462.48	
XEROX HOLDINGS CORP	9,982	36.78	367,137.96	
XILINX INC	12,682	89.79	1,138,716.78	
XPO LOGISTICS INC	4,778	99.11	473,547.58	
XYLEM INC	9,050	88.66	802,373.00	
YUM! BRANDS INC	15,310	103.87	1,590,249.70	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	12,227	35.00	427,945.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,721	242.72	660,441.12	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	6,440	63.63	409,777.20	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,322	158.39	1,634,901.58	

	ZIONS BANCORP, N.A.	8,718	46.25	403,207.50	
	ZOETIS INC	24,031	143.55	3,449,650.05	
アメリカ・ドル	小計	15,130,935		1,448,006,222.65 (162,335,977,621)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	48,498	11.74	569,366.52	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,534	22.98	219,091.32	
	ANGLO AMERICAN PLC	51,657	21.22	1,096,419.82	
	ANTOFAGASTA PLC	19,293	8.56	165,186.66	
	ASHTREAD GROUP PLC	23,130	27.74	641,626.20	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	17,758	26.34	467,745.72	
	ASTRAZENECA PLC	65,974	75.74	4,996,870.76	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	46,565	5.69	265,141.11	
	AVEVA GROUP PLC	3,259	49.92	162,689.28	
	AVIVA PLC	195,832	4.06	795,469.58	
	BAE SYSTEMS PLC	160,907	6.56	1,056,193.54	
	BARCLAYS PLC	866,516	1.81	1,570,993.50	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	51,374	8.63	443,563.11	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	5,982	53.52	320,156.64	
	BHP GROUP PLC	105,746	16.77	1,773,571.91	
	BP PLC	1,024,477	4.66	4,776,111.77	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	115,265	33.43	3,853,885.27	
	BT GROUP PLC	425,231	1.56	663,785.59	
	BUNZL PLC	16,925	19.27	326,229.37	
	BURBERRY GROUP PLC	20,595	19.20	395,424.00	
	CARNIVAL PLC	7,915	30.62	242,357.30	
	CENTRICA PLC	296,333	0.78	231,139.74	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	9,972	28.06	279,814.32	
	COMPASS GROUP PLC	79,774	19.48	1,554,396.39	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,413	51.00	327,063.00	
	DCC PLC	4,905	62.62	307,151.10	
	DIAGEO PLC	118,871	31.23	3,712,341.33	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	67,374	3.36	226,376.64	
	EASYJET PLC	8,060	15.17	122,270.20	
	EVRAZ PLC	26,055	3.87	101,015.23	
	EXPERIAN PLC	45,822	28.69	1,314,633.18	
	FERGUSON PLC	11,499	75.80	871,624.20	
	G4S PLC	78,834	2.04	161,530.86	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	250,942	16.50	4,140,543.00	
	GLENCORE PLC	542,495	2.28	1,241,771.05	
	GVC HOLDINGS PLC	29,273	8.50	248,820.50	
	HALMA PLC	19,004	22.17	421,318.68	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,178	17.10	242,443.80	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,015,488	5.59	5,683,686.33	
	IMPERIAL BRANDS PLC	47,975	17.09	819,892.75	
	INFORMA PLC	63,435	7.79	494,666.13	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,689	51.21	444,963.69	
	INTERTEK GROUP PLC	8,127	58.86	478,355.22	
	ITV PLC	183,168	1.31	241,415.42	
	JD SPORTS FASHION PLC	22,003	8.67	190,854.02	

JOHNSON MATTHEY PLC	9,544	27.78	265,132.32	
KINGFISHER PLC	104,431	2.19	228,703.89	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	298,973	3.14	941,465.97	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,526,465	0.56	1,992,452.72	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	15,886	84.16	1,336,965.76	
M&G PLC	127,512	2.49	318,524.97	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	97,429	1.86	181,412.79	
MEGGITT PLC	38,970	6.12	238,496.40	
MELROSE INDUSTRIES PLC	244,910	2.44	598,560.04	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	17,135	7.96	136,531.68	
MONDI PLC/WI	24,045	16.96	407,923.42	
MORRISON WM SUPERMARKETS	119,285	1.86	222,108.67	
NATIONAL GRID PLC	175,054	10.57	1,850,320.78	
NEXT PLC	6,686	71.26	476,444.36	
NMC HEALTH PLC	4,758	8.57	40,795.09	
OCADO GROUP PLC	23,280	11.45	266,556.00	
PEARSON PLC	39,025	5.84	227,906.00	
PERSIMMON PLC	16,007	32.61	521,988.27	
PRUDENTIAL PLC	130,092	15.00	1,951,380.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	35,653	64.92	2,314,592.76	
RELX PLC	97,855	20.82	2,037,341.10	
RENTOKIL INITIAL PLC	94,177	5.03	473,898.66	
RIO TINTO PLC	56,602	42.09	2,382,661.19	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	87,616	6.64	582,295.93	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	243,562	2.07	505,878.27	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	213,724	19.26	4,118,034.03	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,722	19.21	3,625,349.62	
RSA INSURANCE GROUP PLC	51,555	5.70	294,275.94	
SAGE GROUP PLC	54,446	7.79	424,134.34	
SAINSBURY (J) PLC	88,494	2.09	184,952.46	
SCHRODERS PLC	6,157	33.87	208,537.59	
SEVERN TRENT PLC	12,033	26.83	322,845.39	
SMITH & NEPHEW PLC	44,006	19.79	870,878.74	
SMITHS GROUP PLC	19,775	17.57	347,446.75	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,706	94.15	348,919.90	
SSE PLC	51,722	16.76	866,860.72	
ST JAMES'S PLACE PLC	27,153	11.68	317,147.04	
STANDARD CHARTERED PLC	137,153	6.21	851,994.43	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	120,434	3.25	391,651.36	
TAYLOR WIMPEY PLC	165,458	2.30	380,718.85	
TESCO PLC	492,059	2.54	1,254,258.39	
TUI AG-DI	22,186	8.53	189,335.32	
UNILEVER PLC	55,785	45.96	2,563,878.60	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,448	10.46	360,498.32	

	VODAFONE GROUP PLC	1,351,749	1.55	2,095,210.95	
	WEIR GROUP PLC/THE	12,966	13.67	177,245.22	
	WHITBREAD PLC	6,630	47.32	313,731.60	
	WPP PLC	63,804	9.84	627,958.96	
イギリス・ポンド	小計	15,100,239		90,296,167.31 (13,042,378,406)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	2,210	278.40	615,264.00	
	BANK HAPOLIM BM	57,320	28.60	1,639,352.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	74,509	23.93	1,783,000.37	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,232	547.30	674,273.60	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	35,131	12.98	456,000.38	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	58,483	15.32	895,959.56	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7,341	92.32	677,721.12	
	NICE LTD	3,136	612.00	1,919,232.00	
イスラエル・シュケル	小計	239,362		8,660,803.03 (283,294,867)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	35,276	21.13	745,381.88	
	ALUMINA LTD	137,382	2.21	303,614.22	
	AMP LTD	177,865	2.05	364,623.25	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,761	37.69	1,121,692.09	
	ASX LTD	10,956	81.47	892,585.32	
	AURIZON HOLDINGS LTD	116,807	5.54	647,110.78	
	AUSNET SERVICES	137,857	1.76	243,317.60	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	145,180	27.03	3,924,215.40	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	29,783	10.00	297,830.00	
	BHP GROUP LIMITED	150,285	38.52	5,788,978.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	26,738	14.01	374,599.38	
	BORAL LTD	64,684	4.83	312,423.72	
	BRAMBLES LTD	82,743	12.95	1,071,521.85	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,713	34.70	475,841.10	
	CHALLENGER LTD	29,408	10.38	305,255.04	
	CIMIC GROUP LIMITED	5,750	27.19	156,342.50	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	29,514	13.07	385,747.98	
	COCHLEAR LTD	3,049	242.35	738,925.15	
	COLES GROUP LTD	58,837	16.15	950,217.55	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	90,221	87.85	7,925,914.85	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,115	17.40	471,801.00	
	CROWN RESORTS LTD	22,654	11.90	269,582.60	
	CSL LIMITED	22,995	338.68	7,787,946.60	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,143	39.47	124,054.21	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	71,545	11.34	811,320.30	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	34,268	4.78	163,801.04	
	INCITEC PIVOT LTD	91,943	3.05	280,426.15	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	122,252	6.67	815,420.84	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	23,235	30.39	706,111.65	

	MACQUARIE GROUP LTD	16,892	151.77	2,563,698.84	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,751	71.90	485,396.90	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	147,273	2.92	430,037.16	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	148,385	27.40	4,065,749.00	
	NEWCREST MINING LIMITED	39,547	28.31	1,119,575.57	
	OIL SEARCH LTD	75,202	6.38	479,788.76	
	ORICA LTD	21,583	21.50	464,034.50	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	92,294	7.97	735,583.18	
	QANTAS AIRWAYS LTD	41,484	6.67	276,698.28	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	69,852	15.11	1,055,463.72	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	8,834	79.37	701,154.58	
	REA GROUP LTD	2,950	113.96	336,182.00	
	RIO TINTO LTD	19,157	98.14	1,880,067.98	
	SANTOS LTD	93,428	8.07	753,963.96	
	SEEK LTD	18,512	23.16	428,737.92	
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,321	31.29	792,294.09	
	SOUTH32 LTD	257,940	2.61	673,223.40	
	SUNCORP GROUP LTD	69,026	12.33	851,090.58	
	TABCORP HOLDINGS LTD	112,882	4.27	482,006.14	
	TELSTRA CORP LTD	225,237	3.79	853,648.23	
	TPG TELECOM LTD	22,236	8.10	180,111.60	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	37,314	12.13	452,618.82	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,430	23.07	171,410.10	
	WESFARMERS LIMITED	58,764	46.94	2,758,382.16	
	WESTPAC BANKING CORP	178,836	25.69	4,594,296.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,562	18.88	142,770.56	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,925	33.25	1,626,756.25	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,125	43.60	2,839,450.00	
	WORLEY LIMITED	18,328	14.40	263,923.20	
	オーストラリア・ドル 小計	3,732,029		70,914,716.57 (5,262,581,116)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	12,017	68.15	818,958.55	
	AIR CANADA	6,687	44.45	297,237.15	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,371	21.94	600,519.74	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	43,933	44.21	1,942,277.93	
	ALTAGAS LTD	14,169	22.48	318,519.12	
	ATCO LTD -CL 'I'	3,948	54.40	214,771.20	
	AURORA CANNABIS INC	36,637	2.23	81,700.51	
	BANK OF MONTREAL	32,098	101.25	3,249,922.50	
	BANK OF NOVA SCOTIA	61,355	74.63	4,578,923.65	
	BARRICK GOLD CORP	89,369	27.54	2,461,222.26	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	15,917	34.94	556,139.98	
	BCE INC	8,390	64.87	544,259.30	
	BLACKBERRY LTD	25,964	8.16	211,866.24	
	BOMBARDIER INC	107,955	1.40	151,137.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	44,976	90.52	4,071,227.52	
	CAE INC	13,626	40.34	549,672.84	
	CAMECO CORP	19,813	12.03	238,350.39	



CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	22,374	109.24	2,444,135.76	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	36,542	124.14	4,536,323.88	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	59,615	40.45	2,411,426.75	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,096	358.30	2,542,496.80	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,921	149.53	436,777.13	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,847	42.24	289,217.28	
CANOPY GROWTH CORP	10,620	29.59	314,245.80	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,624	57.09	435,254.16	
CENOVUS ENERGY INC	52,294	12.23	639,555.62	
CGI INC	11,963	100.21	1,198,812.23	
CI FINANCIAL CORP	11,171	25.46	284,413.66	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,014	1,457.08	1,477,479.12	
CRONOS GROUP INC	9,410	9.72	91,465.20	
DOLLARAMA INC	15,112	40.83	617,022.96	
EMERA INC	12,454	59.94	746,492.76	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,797	31.68	278,688.96	
ENBRIDGE INC	101,811	55.41	5,641,347.51	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,355	632.67	857,267.85	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	34,634	12.04	416,993.36	
FORTIS INC	22,426	58.34	1,308,332.84	
FRANCO-NEVADA CORP	9,402	154.08	1,448,660.16	
GEORGE WESTON LTD	3,918	110.91	434,545.38	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,387	36.92	383,488.04	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,289	34.40	491,541.60	
HUSKY ENERGY INC	17,406	8.32	144,817.92	
HYDRO ONE LTD	17,236	29.00	499,844.00	
IA FINANCIAL CORP INC	5,373	70.64	379,548.72	
IGM FINANCIAL INC	4,523	40.36	182,548.28	
IMPERIAL OIL LTD	13,088	32.16	420,910.08	
INTACT FINANCIAL CORP	7,083	154.71	1,095,810.93	
INTER PIPELINE LTD	21,038	22.10	464,939.80	
KEYERA CORP	10,842	36.18	392,263.56	
KINROSS GOLD CORP	61,908	7.42	459,357.36	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,996	46.22	462,015.12	
LOBLAW COS LTD	9,210	69.92	643,963.20	
LUNDIN MINING CORP	33,431	7.16	239,365.96	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,884	69.63	1,036,372.92	
MANULIFE FINANCIAL CORP	98,165	26.59	2,610,207.35	
METHANEX CORP	3,288	45.61	149,965.68	
METRO INC	12,793	55.05	704,254.65	
NATIONAL BANK OF CANADA	17,185	74.69	1,283,547.65	
NUTRIEN LTD	28,934	57.40	1,660,811.60	
ONEX CORPORATION	4,399	85.99	378,270.01	
OPEN TEXT CORP	13,554	62.76	850,649.04	
OVINTIV INC	12,898	21.64	279,112.72	
PARKLAND FUEL CORP	7,509	47.00	352,923.00	

PEMBINA PIPELINE CORP	25,787	53.22	1,372,384.14	
POWER CORP OF CANADA	30,062	34.29	1,030,825.98	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	10,754	14.70	158,083.80	
QUEBECOR INC -CL B	9,495	33.13	314,569.35	
RESTAURANT BRANDS INTERN	13,499	88.03	1,188,316.97	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	18,498	66.00	1,220,868.00	
ROYAL BANK OF CANADA	72,052	108.00	7,781,616.00	
SAPUTO INC	11,807	41.27	487,274.89	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,370	25.74	627,283.80	
SHOPIFY INC - CLASS A	5,065	711.04	3,601,417.60	
STARS GROUP INC/THE	11,585	33.42	387,170.70	
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,715	65.65	1,950,789.75	
SUNCOR ENERGY INC	78,108	40.46	3,160,249.68	
TC ENERGY CORP	46,880	76.06	3,565,692.80	
TECK RESOURCES LTD-CL B	24,478	17.09	418,329.02	
THOMSON REUTERS CORP	10,414	108.36	1,128,461.04	
TORONTO-DOMINION BANK	91,397	75.98	6,944,344.06	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,704	61.15	165,349.60	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22,488	43.03	967,658.64	
WSP GLOBAL INC	5,395	94.88	511,877.60	
カナダ・ドル 小計	2,007,597		102,286,753.66 (8,653,459,360)	
シンガポール・ ドル				
CAPITALAND LTD	133,600	3.73	498,328.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	10.88	239,360.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.05	233,495.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	89,900	25.10	2,256,490.00	
GENTING SINGAPORE LTD	297,300	0.88	261,624.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,900	29.15	142,835.00	
KEPPEL CORP LTD	73,200	6.70	490,440.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	162,200	11.04	1,790,688.00	
SATS LTD	38,100	4.51	171,831.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	47,900	2.02	96,758.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	28,000	8.55	239,400.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	40,500	9.26	375,030.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	84,100	2.01	169,041.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	81,400	4.27	347,578.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	417,700	3.13	1,307,401.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	63,200	25.87	1,634,984.00	
UOL Group Limited	23,600	8.13	191,868.00	
VENTURE CORP LTD	13,700	16.92	231,804.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	97,200	4.04	392,688.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	117,500	1.04	122,200.00	
シンガポール・ドル 小計	1,949,900		11,193,843.00	

(896,291,010)

スイス・フラン	ABB LTD	92,793	23.90	2,217,752.70	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,701	58.42	449,892.42	
	ALCON INC	20,839	62.17	1,295,560.63	
	BALOISE HOLDING AG	2,454	177.60	435,830.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	152	2,222.00	337,744.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	53	8,600.00	455,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	93,500.00	467,500.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	26,193	72.22	1,891,658.46	
	CLARIANT AG	9,890	23.37	231,129.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	128,128	13.56	1,738,056.32	
	DUFREY AG-REG	2,035	84.50	171,957.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	408	636.00	259,488.00	
	GEBERIT AG-REG	1,865	537.40	1,002,251.00	
	GIVAUDAN-REG	467	3,387.00	1,581,729.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,238	48.36	543,469.68	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,770	158.85	440,014.50	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	24,709	49.08	1,212,717.72	
	LONZA GROUP AG	3,739	420.40	1,571,875.60	
	NESTLE SA	149,517	109.36	16,351,179.12	
	NOVARTIS AG	107,925	94.56	10,205,388.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,934	79.90	154,526.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	936	958.00	896,688.00	
	ROCHE HOLDING AG	35,281	345.65	12,194,877.65	
	SCHINDLER HOLDING AG- REG	1,087	227.40	247,183.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,968	234.40	461,299.20	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	264	2,644.00	698,016.00	
	SIKA AG-BEARER	6,444	187.75	1,209,861.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,797	256.40	717,150.80	
	STRAUMANN HOLDING AG	514	1,039.50	534,303.00	
	SWATCH GROUP AG	1,363	247.20	336,933.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG- REG	1,681	512.60	861,680.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,996	123.00	491,508.00	
	SWISS RE AG	15,014	107.30	1,611,002.20	
	SWISSCOM AG	1,342	574.40	770,844.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,283	159.65	524,130.95	
	THE SWATCH GROUP AG- REG	2,961	47.70	141,239.70	
	UBS GROUP AG	193,963	13.02	2,526,368.07	
	VIFOR PHARMA AG	2,288	181.15	414,471.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,532	434.30	3,271,147.60	
スイス・フラン	小計	877,529		70,924,227.12 (8,081,106,437)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	15,831	252.70	4,000,493.70	
	ASSA ABLOY AB	50,653	246.50	12,485,964.50	
	ATLAS COPCO AB	19,493	323.90	6,313,782.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	33,759	368.20	12,430,063.80	

	BOLIDEN AB	13,527	230.90	3,123,384.30	
	ELECTROLUX AB	11,438	219.20	2,507,209.60	
	EPIROC AB-A	33,516	119.70	4,011,865.20	
	EPIROC AB-B	19,540	116.20	2,270,548.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	30,753	316.20	9,724,098.60	
	HENNES & MAURITZ AB	40,487	203.90	8,255,299.30	
	HEXAGON AB-B SHS	13,172	573.20	7,550,190.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,098	72.54	1,530,448.92	
	ICA GRUPPEN AB	4,802	393.40	1,889,106.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,196	252.60	2,070,309.60	
	INVESTOR AB	22,931	563.60	12,923,911.60	
	KINNEVIK AB - B	12,273	230.10	2,824,017.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,747	441.80	1,655,424.60	
	LUNDIN PETROLEUM AB	9,606	312.90	3,005,717.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,683	458.00	770,814.00	
	NORDEA BANK ABP	164,012	86.38	14,167,356.56	
	SANDVIK AB	56,580	183.20	10,365,456.00	
	SECURITAS AB	15,879	149.30	2,370,734.70	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	82,925	104.05	8,628,346.25	
	SKANSKA AB-B SHS	17,355	237.70	4,125,283.50	
	SKF AB	19,045	191.15	3,640,451.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	78,217	110.95	8,678,176.15	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,840	161.90	7,421,496.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,556	618.00	5,287,608.00	
	TELE2 AB	26,436	154.10	4,073,787.60	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	155,181	87.50	13,578,337.50	
	TELIA CO AB	142,629	42.34	6,038,911.86	
	VOLVO AB	74,559	173.45	12,932,258.55	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,253,719		200,650,854.74 (2,291,432,761)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	321	8,228.00	2,641,188.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	210	7,715.00	1,620,150.00	
	CARLSBERG AS-B	5,384	1,027.50	5,532,060.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,302	546.20	2,895,952.40	
	COLOPLAST-B	5,944	980.00	5,825,120.00	
	DANSKE BANK A/S	32,620	122.25	3,987,795.00	
	DEMANT A/S	5,420	232.50	1,260,150.00	
	DSV PANALPINA A/S	11,053	782.40	8,647,867.20	
	GENMAB A/S	3,262	1,698.00	5,538,876.00	
	H LUNDBECK A/S	3,502	268.50	940,287.00	
	ISS A/S	7,984	164.95	1,316,960.80	
	NOVO-NORDISK A/S	88,800	442.65	39,307,320.00	
	NOVOZYMES A/S	10,644	376.00	4,002,144.00	
	ORSTED A/S	9,506	761.00	7,234,066.00	
	PANDORA A/S	5,034	335.50	1,688,907.00	
	TRYGVESTA AS	6,345	209.60	1,329,912.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,499	717.20	6,812,682.80	
	デンマーク・クローネ 小計	210,830		100,581,438.20 (1,628,413,484)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	36,887	16.58	611,586.46	

	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	51,330	8.60	441,438.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	28,888	25.20	727,977.60	
	FLETCHER BUILDING LTD	43,395	5.59	242,578.05	
	MERCURY NZ LTD	36,249	5.46	197,919.54	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,482	5.64	375,290.89	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	20,690	16.94	350,488.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,385	4.84	471,343.40	
ニュージーランド・ドル 小計		381,306		3,418,622.54 (242,858,945)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	5,484	256.50	1,406,646.00	
	DNB ASA	47,928	177.00	8,483,256.00	
	EQUINOR ASA	49,938	160.40	8,010,055.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,448	206.80	2,160,646.40	
	MOWI ASA	22,250	226.60	5,041,850.00	
	NORSK HYDRO ASA	67,095	29.96	2,010,166.20	
	ORKLA ASA	38,183	87.14	3,327,266.62	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,074	252.00	1,278,648.00	
	TELENOR ASA	37,626	162.55	6,116,106.30	
YARA INTERNATIONAL ASA	9,041	384.50	3,476,264.50		
ノルウェー・クローネ 小計		293,067		41,310,905.22 (496,970,190)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	21,320	15.00	319,800.00	
	ACCOR	8,781	38.99	342,371.19	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,237	30.77	407,302.49	
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	13,237	0.45	6,022.83	
	ADIDAS AG	9,066	285.00	2,583,810.00	
	ADP	1,553	166.50	258,574.50	
	ADYEN NV	524	869.80	455,775.20	
	AEGON NV	88,633	3.71	328,917.06	
	AENA SME SA	3,505	167.95	588,664.75	
	AGEAS	8,917	48.78	434,971.26	
	AIB GROUP PLC	40,295	2.27	91,469.65	
	AIR LIQUIDE	23,751	138.50	3,289,513.50	
	AIRBUS SE	29,338	131.78	3,866,161.64	
	AKZO NOBEL NV	11,526	85.50	985,473.00	
	ALLIANZ SE	21,271	228.00	4,849,788.00	
	ALSTOM RGPT	9,663	46.65	450,778.95	
	ALTICE NV - A-W/I	34,388	6.49	223,246.89	
	AMADEUS IT GROUP SA	21,588	71.62	1,546,132.56	
	AMUNDI SA	3,052	77.10	235,309.20	
	ANDRITZ AG	3,706	34.84	129,117.04	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	38,279	67.48	2,583,066.92	
	ARCELORMITTAL	32,740	15.33	501,969.68	
	ARKEMA	3,403	86.50	294,359.50	
	AROUNDTOWN SA	47,442	8.70	413,030.05	
	ASML HOLDING NV	21,367	287.70	6,147,285.90	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	55,008	18.59	1,022,873.76	
	ATLANTIA SPA	25,401	22.07	560,600.07	
	ATOS SE	4,908	74.72	366,725.76	
	AXA	97,053	24.48	2,376,342.70	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	333,308	5.10	1,701,204.03	
BANCO DE SABADELL SA	284,210	0.86	245,841.65	
BANCO SANTANDER SA	831,656	3.84	3,201,043.94	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	48,008	3.97	190,975.82	
BANKIA SA	61,807	1.70	105,504.54	
BANKINTER SA	33,741	6.13	206,967.29	
BASF SE	45,959	61.40	2,821,882.60	
BAYER AG	46,844	74.66	3,497,373.04	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,480	65.31	1,076,308.80	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,930	51.90	152,067.00	
BEIERSDORF AG	5,033	107.05	538,782.65	
BIOMERIEUX	2,084	95.15	198,292.60	
BNP PARIBAS	56,461	53.26	3,007,112.86	
BOLLORE	49,205	3.74	184,321.93	
BOUYGUES	11,365	41.20	468,238.00	
BRENTAG AG	7,641	49.33	376,930.53	
BUREAU VERITAS SA	14,903	24.82	369,892.46	
CAIXABANK	179,964	2.70	485,902.80	
CAPGEMINI SA	7,950	113.35	901,132.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,030	110.40	224,112.00	
CARREFOUR SA	30,320	16.12	488,910.00	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,785	35.81	99,730.85	
CELLNEX TELECOM SAU	12,866	48.36	622,199.76	
CIE DE SAINT-GOBAIN	24,769	35.78	886,234.82	
CNH INDUSTRIAL NV	50,993	8.79	448,432.44	
CNP ASSURANCES	8,628	16.15	139,342.20	
COLRUYT NV	2,717	46.13	125,335.21	
COMMERZBANK AG	49,030	6.75	330,952.50	
CONTINENTAL AG	5,507	112.70	620,638.90	
COVESTRO AG	8,558	41.18	352,418.44	
CREDIT AGRICOLE SA	58,072	13.15	763,937.16	
CRH PLC	39,940	34.87	1,392,707.80	
DAIMLER AG	45,800	43.74	2,003,521.00	
DANONE	31,064	71.46	2,219,833.44	
DASSAULT AVIATION SA	126	1,065.00	134,190.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	6,598	155.75	1,027,638.50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	29,039	8.52	247,412.28	
DELIVERY HERO SE	5,734	78.16	448,169.44	
DEUTSCHE BANK AG	98,621	9.86	972,994.78	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,590	154.40	1,480,696.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	11,770	15.01	176,726.55	
DEUTSCHE POST AG	49,999	32.28	1,614,217.71	
DEUTSCHE TELEKOM AG	169,143	16.62	2,812,171.51	
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,212	38.72	705,168.64	
E.ON SE	112,691	11.24	1,266,646.84	
EDENRED	12,397	49.77	616,998.69	
EDF	30,775	13.40	412,538.87	
EIFFAGE	4,022	110.05	442,621.10	
ELISA OYJ	7,351	57.82	425,034.82	
ENAGAS SA	11,496	25.61	294,412.56	
ENDESA SA	16,160	25.82	417,251.20	
ENEL SPA	409,353	8.43	3,452,073.84	

ENERGIAS DE PORTUGAL SA	129,570	4.87	631,524.18	
ENGIE	91,959	16.48	1,515,484.32	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	127,227	12.90	1,641,228.30	
ERSTE GROUP BANK AG	15,117	34.78	525,769.26	
ESSILORLUXOTTICA	14,273	141.40	2,018,202.20	
EURAZEO	2,043	65.30	133,407.90	
EUROFINS SCIENTIFIC	586	477.00	279,522.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,081	12.99	117,962.19	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,056	26.54	240,346.24	
EXOR NV	5,373	73.34	394,055.82	
FAURECIA	3,817	45.84	174,971.28	
FERRARI NV	6,070	164.15	996,390.50	
FERROVIAL S.A.	25,137	29.76	748,077.12	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	54,358	12.27	667,298.80	
FINCOBANK SPA	30,397	11.09	337,102.73	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	3,904	108.00	421,632.00	
FORTUM OYJ	22,399	22.08	494,569.92	
FRAPORT AG	2,174	69.34	150,745.16	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,649	77.58	826,149.42	
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,942	49.74	1,041,655.08	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	3,377	40.40	136,430.80	
GALAPAGOS NV	2,185	242.70	530,299.50	
GALP ENERGIA SGPS SA	24,908	14.54	362,286.86	
GEA GROUP AG	7,771	27.90	216,810.90	
GETLINK SE - REGR	23,700	16.75	396,975.00	
GRIFOLS SA	14,999	33.91	508,616.09	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,985	93.66	373,235.10	
HANNOVER RUECK SE	3,014	189.90	572,358.60	
HEIDELBERGCEMENT AG	7,402	61.44	454,778.88	
HEINEKEN HOLDING NV	5,768	93.55	539,596.40	
HEINEKEN NV	12,991	104.00	1,351,064.00	
HENKEL AG & CO KGAA	5,284	84.45	446,233.80	
HENKEL KGAA-VORZUG	8,832	93.04	821,729.28	
HERMES INTERNATIONAL	1,587	699.80	1,110,582.60	
HOCHTIEF AG	1,256	108.40	136,150.40	
IBERDROLA SA	303,954	11.03	3,354,132.39	
ILIAD SA	1,371	136.10	186,593.10	
INDITEX SA	54,729	31.58	1,728,341.82	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	62,597	21.72	1,359,919.82	
ING GROEP NV-CVA	195,206	10.05	1,962,210.71	
INGENICO GROUP	3,063	139.60	427,594.80	
INTESA SANPAOLO	749,162	2.55	1,910,363.10	
IPSEN	1,879	66.35	124,671.65	
JC DECAUX SA	4,434	22.86	101,361.24	
JERONIMO MARTINS	12,366	16.87	208,614.42	
KBC GROEP NV	12,461	70.14	874,014.54	
KERING	3,805	566.50	2,155,532.50	
KERRY GROUP PLC-A	7,958	123.90	985,996.20	
KINGSPAN GROUP PLC	7,730	63.60	491,628.00	
KION GROUP AG	3,239	58.60	189,805.40	
KNORR-BREMSE AG	2,443	98.39	240,366.77	

KONE OYJ	17,092	54.90	938,350.80
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,354	23.56	1,398,380.24
KONINKLIJKE DSM NV	9,102	115.10	1,047,640.20
KONINKLIJKE PHILIPS NV	45,455	44.38	2,017,292.90
L'OREAL SA	12,673	265.70	3,367,216.10
LANXESS	4,106	56.54	232,153.24
LEGRAND SA	13,427	77.24	1,037,101.48
LEONARDO SPA	20,032	11.05	221,353.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	13,957	409.80	5,719,578.60
MAPFRE SA	51,832	2.37	123,101.00
MEDIOBANCA SPA	31,316	9.59	300,320.44
MERCK KGAA	6,486	122.75	796,156.50
METRO AG	9,099	12.20	111,007.80
METSO OYJ	5,225	33.05	172,686.25
MICHELIN (C.G.D.E.)	8,602	110.35	949,230.70
MONCLER SPA	9,015	38.25	344,823.75
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	2,612	264.10	689,829.20
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,238	274.50	1,986,831.00
NATIXIS	48,141	4.33	208,594.95
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,093	24.28	366,458.04
NESTE OYJ	21,170	38.91	823,724.70
NN GROUP NV	15,338	37.41	573,794.58
NOKIA OYJ	283,805	3.80	1,081,013.24
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,220	26.97	167,753.40
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	3,420	48.32	165,254.40
OMV AG	7,322	43.89	321,362.58
ORANGE S.A.	101,975	13.44	1,370,544.00
ORION OYJ-CLASS B	5,222	38.45	200,785.90
PERNOD-RICARD	10,673	165.35	1,764,780.55
PEUGEOT SA	29,568	19.43	574,654.08
PIRELLI & C SPA	20,402	4.84	98,847.69
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	7,536	64.16	483,509.76
POSTE ITALIANE SPA	27,609	11.28	311,567.56
PROSUS	24,469	71.47	1,748,799.43
PROXIMUS	8,121	26.16	212,445.36
PRYSMIAN SPA	12,284	24.08	295,798.72
PUBLICIS GROUPE	11,029	41.75	460,460.75
PUMA AG	4,208	80.45	338,533.60
QIAGEN NV	11,420	34.20	390,564.00
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	7,374	22.05	162,596.70
RANDSTAD NV	5,862	54.82	321,354.84
RECORDATI SPA	5,274	41.00	216,234.00
RED ELECTRICA DE ESPANA	21,599	19.55	422,368.44
REMY COINTREAU	1,129	103.10	116,399.90
RENAULT SA	9,658	32.66	315,430.28
REPSOL SA	72,061	12.29	885,989.99
ROYAL KPN NV	187,634	2.53	476,027.45
RWE AG	29,465	34.05	1,003,283.25
SAFRAN SA	16,456	145.55	2,395,170.80
SAMPO OYJ	22,327	41.20	919,872.40



SANOFI	56,641	93.50	5,295,933.50
SAP SE	49,344	127.80	6,306,163.20
SARTORIUS AG-VORZUG	1,788	239.40	428,047.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,396	186.70	260,633.20
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,757	102.90	2,856,195.30
SCOR REGROUPE	8,060	36.77	296,366.20
SEB SA	1,136	117.20	133,139.20
SIEMENS AG	38,397	106.24	4,079,297.28
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,079	16.07	194,169.92
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,519	40.32	303,203.67
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,340	34.20	387,828.00
SNAM SPA	103,483	5.01	518,863.76
SOCIETE GENERALE	40,692	31.22	1,270,404.24
SODEXO	4,468	101.45	453,278.60
SOLVAY SA	3,708	95.66	354,707.28
STMICROELECTRONICS NV	34,294	28.71	984,580.74
STORA ENSO OYJ	28,434	12.19	346,752.63
SUEZ	17,594	15.84	278,688.96
SYMRISE AG	6,494	98.36	638,749.84
TELECOM ITALIA SPA	756,196	0.51	388,684.74
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	49,315	2.60	128,662.83
TELEFONICA SA	236,841	6.29	1,489,729.89
TELENET GROUP HOLDING NV	2,497	39.60	98,881.20
TELEPERFORMANCE	2,970	241.00	715,770.00
TENARIS SA	23,019	9.81	225,816.39
TERNA SPA	71,170	6.67	475,273.26
THALES SA	5,346	96.98	518,455.08
THYSSENKRUPP AG	20,527	9.80	201,287.76
TOTAL SA	120,400	44.75	5,387,900.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,252	74.84	318,219.68
UCB SA	6,297	92.28	581,087.16
UMICORE	9,868	44.57	439,816.76
UNICREDIT SPA	100,034	13.71	1,372,266.41
UNILEVER NV	73,749	54.05	3,986,133.45
UNIPER SE	10,082	29.54	297,822.28
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,245	32.05	200,152.25
UPM-KYMMENE OYJ	26,456	30.63	810,347.28
VALEO SA	12,208	27.55	336,330.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	27,233	28.87	786,216.71
VINCI SA	25,775	105.20	2,711,530.00
VIVENDI SA	43,305	24.92	1,079,160.60
VOESTALPINE AG	5,742	22.47	129,022.74
VOLKSWAGEN AG	1,816	170.45	309,537.20
VOLKSWAGEN AG	9,187	169.44	1,556,645.28
VONOVIA SE	26,199	53.36	1,397,978.64
VOPAK	3,531	50.20	177,256.20
WARTSILA OYJ	22,113	10.61	234,618.93
WENDEL	1,448	124.80	180,710.40
WIRECARD AG	5,907	135.40	799,807.80
WOLTERS KLUWER NV	14,113	70.06	988,756.78
WORLDLINE SA	5,045	75.45	380,645.25
ZALANDO SE	6,990	47.51	332,094.90

ユーロ 小計		9,817,232		215,739,538.14 (26,089,382,347)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	608,675	79.65	48,480,963.75	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15,400	98.55	1,517,670.00	
	BANK OF EAST ASIA	66,400	17.28	1,147,392.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	186,039	27.65	5,143,978.35	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,500	24.85	1,677,375.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	130,909	50.75	6,643,631.75	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	137,409	69.95	9,611,759.55	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	33,500	54.75	1,834,125.00	
	CLP HOLDINGS LTD	83,643	82.35	6,888,001.05	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	106,810	57.35	6,125,553.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	104,157	18.06	1,881,075.42	
	HANG SENG BANK LTD	38,612	164.40	6,347,812.80	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	75,641	36.45	2,757,114.45	
	HONG KONG & CHINA GAS	513,048	15.14	7,767,546.72	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	60,111	271.40	16,314,125.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	36,000	22.95	826,200.00	
	MTR CORP	82,755	44.65	3,695,010.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	318,669	10.18	3,244,050.42	
	NWS HOLDINGS LTD	83,000	10.12	839,960.00	
	PCCW LTD	265,000	4.80	1,272,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	70,087	56.55	3,963,419.85	
	SANDS CHINA LTD	122,580	39.85	4,884,813.00	
	SINO LAND CO	164,000	10.92	1,790,880.00	
	SJM HOLDINGS LTD	99,000	9.32	922,680.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	80,523	113.70	9,155,465.10	
	SWIRE PACIFIC LTD	25,366	73.70	1,869,474.20	
	SWIRE PROPERTIES LTD	61,600	24.85	1,530,760.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	70.00	4,830,000.00	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	36,000	31.00	1,116,000.00		
WH GROUP LTD	481,000	8.65	4,160,650.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,733	41.15	2,540,312.95		
WHEELLOCK & CO LTD	43,000	48.20	2,072,600.00		
WYNN MACAU LTD	78,503	17.32	1,359,671.96		
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	38,500	21.25	818,125.00		
香港・ドル 小計		4,444,170		175,030,197.97 (2,520,434,852)	
合計		55,437,915		231,824,581,396 (231,824,581,396)	

## 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	28,489.00	558,954.18	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,664.00	955,630.08	
		AMERICAN TOWER REIT INC	22,297.00	5,519,399.38	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	75,727.00	795,133.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,966.00	1,582,326.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,690.00	1,129,814.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,774.00	571,447.80	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	20,959.00	3,499,943.41	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,470.00	1,427,061.00	
		DUKE REALTY CORP	17,823.00	689,215.41	
		EQUINIX INC	4,272.00	2,769,922.08	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,748.00	676,045.44	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,535.00	1,601,424.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,303.00	1,077,141.33	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,522.00	699,875.82	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,692.00	471,283.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,610.00	917,706.90	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	36,032.00	619,029.76	
		INVITATION HOMES INC	24,775.00	781,403.50	
		IRON MOUNTAIN INC	14,558.00	499,776.14	
		KIMCO REALTY CORP	21,055.00	399,202.80	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,882.00	600,651.48	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,702.00	842,185.40	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,132.00	472,631.84	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,042.00	491,921.10	
		PROLOGIS INC	36,911.00	3,652,343.45	
		PUBLIC STORAGE	7,896.00	1,755,912.48	
		REALTY INCOME CORP	15,904.00	1,302,696.64	
		REGENCY CENTERS CORP	8,266.00	529,519.96	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,713.00	1,668,938.69	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,461.00	2,172,734.33	
		SL GREEN REALTY CORP	4,046.00	380,971.36	
		SUN COMMUNITIES INC	4,595.00	792,637.50	
		UDR INC	14,725.00	746,999.25	
		VENTAS INC	18,726.00	1,168,502.40	
		VEREIT	53,538.00	536,450.76	
		VICI PROPERTIES INC	23,430.00	659,085.90	
		VORNADO REALTY TRUST	8,320.00	534,809.60	
		WELLTOWER INC	20,373.00	1,793,231.46	
		WP CAREY INC	8,592.00	729,031.20	
			アメリカ・ドル 小計		663,215.00

イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,218.00	250,892.93	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,149.00	340,101.72	
	SEGRO PLC	53,814.00	495,088.80	
イギリス・ポンド 小計		133,181.00	1,086,083.45 (156,873,893)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	60,324.00	809,548.08	
	GOODMAN GROUP	85,998.00	1,416,387.06	
	GPT GROUP	109,111.00	677,579.31	
	MIRVAC GROUP	214,839.00	726,155.82	
	SCENTRE GROUP	282,364.00	1,053,217.72	
	STOCKLAND	129,146.00	699,971.32	
	VICINITY CENTRES	185,963.00	442,591.94	
オーストラリア・ドル 小計		1,067,745.00	5,825,451.25 (432,306,737)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,805.00	227,120.45	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	9,710.00	213,037.40	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	7,377.00	159,933.36	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,671.00	211,873.02	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,656.00	114,176.88	
カナダ・ドル 小計		32,219.00	926,141.11 (78,351,538)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	147,000.00	485,100.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	132,500.00	272,950.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	129,600.00	326,592.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	101,500.00	241,570.00	
	SUNTEC REIT	96,600.00	175,812.00	
シンガポール・ドル 小計		607,200.00	1,502,024.00 (120,267,062)	
ユーロ	COVIVIO	2,433.00	268,603.20	
	GECINA SA	2,257.00	410,322.60	
	ICADE	1,553.00	161,512.00	
	KLEPIERRE	9,905.00	307,946.45	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,955.00	872,852.50	
ユーロ 小計		23,103.00	2,021,236.75 (244,428,161)	
香港・ドル	LINK REIT	105,471.00	8,216,190.90	
香港・ドル 小計		105,471.00	8,216,190.90 (118,313,149)	
投資証券 合計			6,540,003,766 (6,540,003,766)	
合計			6,540,003,766 (6,540,003,766)	

(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 609銘柄 投資証券 40銘柄	65.41% -%	-% 2.17%	70.37%
イギリス・ポンド	株式 93銘柄 投資証券 3銘柄	5.25% -%	-% 0.06%	5.54%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11%	-%	0.12%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄 投資証券 7銘柄	2.12% -%	-% 0.17%	2.39%
カナダ・ドル	株式 83銘柄 投資証券 5銘柄	3.49% -%	-% 0.03%	3.66%
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資証券 5銘柄	0.36% -%	-% 0.05%	0.43%
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.26%	-%	3.39%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.92%	-%	0.96%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.66%	-%	0.68%
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	0.10%	-%	0.10%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.20%	-%	0.21%
ユーロ	株式 234銘柄 投資証券 5銘柄	10.51% -%	-% 0.10%	11.05%
香港・ドル	株式 34銘柄 投資証券 1銘柄	1.02% -%	-% 0.05%	1.11%

(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)

	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	42,879,632	114,682,539
金銭信託	3,632,937	2,528,832
コール・ローン	74,158,657	108,565,603
国債証券	18,552,550,153	27,243,250,522
派生商品評価勘定	27,062	666,326
未収利息	126,320,979	164,229,827
前払費用	9,531,810	13,271,686
流動資産合計	18,809,101,230	27,647,195,335
資産合計	18,809,101,230	27,647,195,335
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,847
未払金	60,842,044	111,089,592
未払解約金	27,415,629	54,292,395
その他未払費用	87	159
流動負債合計	88,257,760	165,385,993
負債合計	88,257,760	165,385,993
純資産の部		
元本等		
元本	14,029,005,797	19,109,600,573
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,691,837,673	8,372,208,769
純資産合計	18,720,843,470	27,481,809,342
負債純資産合計	18,809,101,230	27,647,195,335

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 受益権総口数	14,029,005,797口	19,109,600,573口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3344円 (13,344円)	1.4381円 (14,381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22日 至 2019年2月21日	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	400,241,003	401,034,542
合計	400,241,003	401,034,542

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年2月21日 現在				2020年2月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	63,756,714	-	63,783,776	27,062	87,053,586	-	87,716,065	662,479
アメリカ・ドル	46,857,170	-	46,882,796	25,626	62,894,184	-	63,560,510	666,326
イギリス・ポンド	2,961,702	-	2,961,805	103	3,936,513	-	3,936,458	55
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	2,325,358	-	2,323,220	2,138
ユーロ	13,937,842	-	13,939,175	1,333	15,834,244	-	15,833,982	262
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	2,063,287	-	2,061,895	1,392
合計	63,756,714	-	63,783,776	27,062	87,053,586	-	87,716,065	662,479

(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	2019年2月21日現在	2020年2月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,229,834,925円	14,029,005,797円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	5,563,822,764円	8,074,443,613円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,764,651,892円	2,993,848,837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)	1,511,175,019円	1,988,607,958円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,682,173,293円	3,451,344,594円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	913,366,571円	1,166,961,336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	721,056,120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	5,464,511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	15,323,186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	11,703,617円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	7,539,991,502円	9,095,999,668円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	594,022,813円	919,264,826円
DCニッセイ外国債券インデックス	631,268,627円	954,327,693円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	8,572,161円	31,780,455円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,130,485円	559,809,809円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	5,218,659円	23,386,677円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	8,555,537円	43,381,851円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	3,599,749円	13,861,914円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	27,811,628円	64,239,238円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	2,202,592円	3,659,287円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	14,590,750円	24,931,873円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	92,162円	3,359,097円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	88,320円	2,686,625円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	84,480円	4,111,612円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	61,449円	4,338,626円
計	14,029,005,797円	19,109,600,573円

附属明細表(2020年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	120,000.00	156,871.20	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	90,000.00	118,350.00	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	170,000.00	235,614.90	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	80,000.00	105,624.80	

US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	100,000.00	126,449.00	
US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	120,000.00	161,202.00	
US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	60,000.00	79,598.40	
US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	2,160,000.00	2,157,300.00	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	1,140,000.00	1,140,524.40	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	1,160,000.00	1,160,498.80	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	1,160,000.00	1,164,802.40	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	1,330,000.00	1,334,827.90	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,490,000.00	1,499,312.50	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/31	1,190,000.00	1,197,151.90	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	2,070,000.00	2,083,889.70	
US TREASURY N/B 1.625 2022/12/15	1,310,000.00	1,319,209.30	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	1,350,000.00	1,365,444.00	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	1,230,000.00	1,244,169.60	
US TREASURY N/B 1.625 2026/09/30	680,000.00	687,752.00	
US TREASURY N/B 1.625 2029/08/15	950,000.00	958,341.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	1,200,000.00	1,208,808.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,470,000.00	1,481,877.60	
US TREASURY N/B 1.75 2022/06/15	1,180,000.00	1,189,947.40	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	1,760,000.00	1,776,843.20	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	2,040,000.00	2,064,541.20	
US TREASURY N/B 1.75 2026/12/31	590,000.00	601,475.50	
US TREASURY N/B 1.75 2029/11/15	960,000.00	978,969.60	
US TREASURY N/B 1.875 2026/06/30	770,000.00	790,628.30	
US TREASURY N/B 2 2021/02/28	1,530,000.00	1,537,695.90	
US TREASURY N/B 2 2021/05/31	1,680,000.00	1,691,020.80	
US TREASURY N/B 2 2021/08/31	1,710,000.00	1,724,022.00	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	2,430,000.00	2,453,911.20	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,710,000.00	1,730,024.10	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,880,000.00	1,914,648.40	

US TREASURY N/B 2 2024/06/30	1,240,000.00	1,272,984.00	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	1,730,000.00	1,781,484.80	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	1,410,000.00	1,454,612.40	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	1,380,000.00	1,428,451.80	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	1,670,000.00	1,684,662.60	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	2,230,000.00	2,251,764.80	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	1,770,000.00	1,788,939.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	1,390,000.00	1,407,861.50	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	1,180,000.00	1,200,272.40	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	1,310,000.00	1,337,523.10	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	1,260,000.00	1,297,699.20	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	1,310,000.00	1,353,649.20	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	1,380,000.00	1,430,991.00	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	1,690,000.00	1,703,993.20	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	1,280,000.00	1,322,598.40	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	2,140,000.00	2,225,514.40	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	1,220,000.00	1,269,885.80	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	1,430,000.00	1,495,737.10	
US TREASURY N/B 2.25 2026/03/31	710,000.00	744,250.40	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	790,000.00	831,751.50	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	780,000.00	823,539.60	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	790,000.00	834,990.50	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	500,000.00	526,910.00	
US TREASURY N/B 2.25 2049/08/15	640,000.00	679,296.00	
US TREASURY N/B 2.375 2022/03/15	1,250,000.00	1,274,950.00	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	2,210,000.00	2,306,068.70	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	790,000.00	839,770.00	
US TREASURY N/B 2.375 2029/05/15	940,000.00	1,009,137.00	
US TREASURY N/B 2.375 2049/11/15	660,000.00	719,782.80	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	1,940,000.00	2,015,175.00	

US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	2,100,000.00	2,196,957.00	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	540,000.00	594,712.80	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	490,000.00	540,817.90	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	490,000.00	541,293.20	
US TREASURY N/B 2.625 2021/12/15	1,760,000.00	1,797,664.00	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	700,000.00	742,707.00	
US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	630,000.00	672,795.90	
US TREASURY N/B 2.625 2029/02/15	940,000.00	1,027,720.80	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	2,000,000.00	2,100,380.00	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	1,960,000.00	2,064,722.80	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	600,000.00	641,976.00	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	820,000.00	898,539.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	290,000.00	332,966.40	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	370,000.00	424,674.90	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	460,000.00	535,035.20	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	480,000.00	558,729.60	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	880,000.00	974,494.40	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	900,000.00	998,712.00	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	530,000.00	620,990.40	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	530,000.00	624,509.60	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	500,000.00	592,890.00	
US TREASURY N/B 2.875 2049/05/15	630,000.00	756,195.30	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	620,000.00	673,208.40	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	200,000.00	238,960.00	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	520,000.00	623,958.40	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	530,000.00	637,075.90	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	520,000.00	626,719.60	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	480,000.00	582,993.60	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	490,000.00	595,403.90	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	540,000.00	658,524.60	

US TREASURY N/B 3 2048/08/15	600,000.00	733,824.00	
US TREASURY N/B 3 2049/02/15	650,000.00	797,387.50	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	2,040,000.00	2,080,718.40	
US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	940,000.00	1,064,362.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	190,000.00	231,243.30	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	240,000.00	292,404.00	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	370,000.00	450,634.10	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	540,000.00	660,738.60	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	570,000.00	711,627.90	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	520,000.00	661,050.00	
US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	660,000.00	863,669.40	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	150,000.00	191,383.50	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	430,000.00	565,785.40	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	530,000.00	698,873.90	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	510,000.00	683,915.10	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	200,000.00	268,968.00	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	140,000.00	196,004.20	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	220,000.00	310,490.40	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	80,000.00	112,568.00	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	170,000.00	242,188.80	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	180,000.00	250,713.00	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	110,000.00	157,192.20	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	160,000.00	231,017.60	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	270,000.00	397,237.50	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	230,000.00	345,637.10	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	90,000.00	134,117.10	
US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	100,000.00	144,730.00	
WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	210,000.00	278,831.70	
WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	240,000.00	343,161.60	
WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	180,000.00	258,805.80	
アメリカ・ドル 小計	111,910,000.00	118,991,202.50	

イギリス・ボンド	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	180,000.00	188,951.40	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	180,000.00	271,261.80	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	240,000.00	409,543.20	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	250,000.00	376,212.50	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	230,000.00	401,561.60	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	180,000.00	232,027.20	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	210,000.00	297,620.40	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	180,000.00	285,435.00	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	220,000.00	354,092.20	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	230,000.00	457,060.60	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	170,000.00	243,661.00	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	180,000.00	192,924.00	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	190,000.00	382,962.10	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	200,000.00	331,776.00	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	200,000.00	245,274.00	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	160,000.00	175,390.40	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	130,000.00	191,405.50	
	UK TSY 0 5/8% 2025 0.625 2025/06/07	240,000.00	241,936.80	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	180,000.00	192,108.60	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	280,000.00	309,814.40	
	UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	190,000.00	200,860.40	
	UK TSY 1 1/4% 2041 1.25 2041/10/22	30,000.00	31,185.60	
	UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	340,000.00	372,021.20	
	UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22	110,000.00	130,194.90	
	UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	120,000.00	156,080.40	
	UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	340,000.00	347,646.60	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	300,000.00	309,906.00	
	UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	150,000.00	176,053.50	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	210,000.00	262,264.80	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	220,000.00	233,915.00	



	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	160,000.00	176,532.80	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	150,000.00	163,098.00	
	UK TSY 2029 0.875 2029/10/22	270,000.00	277,530.30	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	220,000.00	440,129.80	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	300,000.00	439,209.00	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	210,000.00	369,064.50	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	290,000.00	445,393.60	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	180,000.00	327,711.60	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	330,000.00	330,452.10	
	UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	350,000.00	353,493.00	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	320,000.00	361,376.00	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	230,000.00	363,427.60	
	イギリス・ポンド 小計	9,050,000.00	12,048,565.40 (1,740,294,786)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.25 2032/05/21	40,000.00	40,822.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.5 2031/06/21	200,000.00	209,894.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	240,000.00	245,608.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	210,000.00	218,964.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	370,000.00	408,620.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	330,000.00	378,021.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	360,000.00	390,078.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	360,000.00	409,759.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	320,000.00	368,073.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	340,000.00	395,505.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	100,000.00	121,532.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	60,000.00	73,778.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	180,000.00	235,620.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	350,000.00	394,152.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	370,000.00	443,648.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	110,000.00	144,552.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	150,000.00	206,551.50	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	410,000.00	494,747.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	170,000.00	241,087.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	380,000.00	482,463.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	320,000.00	368,092.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	330,000.00	350,057.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	310,000.00	347,100.80	
オーストラリア・ドル 小計		6,010,000.00	6,968,731.10 (517,149,535)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	60,000.00	86,847.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	230,000.00	225,648.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	310,000.00	307,467.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	240,000.00	237,348.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	320,000.00	316,620.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	180,000.00	175,869.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2021/11/01	150,000.00	149,416.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2025/03/01	110,000.00	109,560.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2030/06/01	120,000.00	119,250.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2021/08/01	150,000.00	149,974.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/02/01	150,000.00	150,135.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/05/01	50,000.00	50,067.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	180,000.00	180,568.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2024/09/01	190,000.00	191,221.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	160,000.00	161,641.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2021/05/01	150,000.00	150,361.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	260,000.00	262,589.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	150,000.00	153,120.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	170,000.00	178,885.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	130,000.00	149,653.40	
CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2021/02/01	150,000.00	150,921.00		
CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	150,000.00	155,169.00		
CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	170,000.00	177,967.90		

	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	160,000.00	173,008.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	180,000.00	188,526.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	170,000.00	174,923.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	180,000.00	236,070.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	140,000.00	142,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	210,000.00	303,183.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	180,000.00	264,526.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	160,000.00	247,787.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	140,000.00	193,383.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	170,000.00	260,042.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	60,000.00	87,426.00	
	カナダ・ドル 小計	5,680,000.00	6,262,176.00 (529,780,090)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.25 2021/10/01	100,000.00	99,623.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	70,000.00	72,422.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	100,000.00	100,980.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	50,000.00	53,275.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	50,000.00	52,165.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2039/07/01	20,000.00	21,889.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	60,000.00	64,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	150,000.00	156,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	60,000.00	69,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	80,000.00	92,039.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	60,000.00	66,363.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	50,000.00	55,725.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	130,000.00	138,528.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	120,000.00	124,860.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	80,000.00	95,409.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	90,000.00	101,475.00	
	シンガポール・ドル 小計	1,270,000.00	1,364,705.20 (109,271,945)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	530,000.00	571,843.50	

	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	660,000.00	714,740.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	720,000.00	783,201.60	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	1,090,000.00	1,166,845.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	880,000.00	1,012,651.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,300,000.00	1,416,090.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	600,000.00	957,954.00	
スウェーデン・クローナ 小計		5,780,000.00	6,623,325.70 (75,638,379)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2022/11/15	260,000.00	266,650.80	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	1,110,000.00	1,199,688.00	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2029/11/15	610,000.00	665,955.30	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	770,000.00	832,654.90	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	870,000.00	989,233.50	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	870,000.00	925,888.80	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,650,000.00	3,204,712.50	
デンマーク・クローネ 小計		6,140,000.00	8,084,783.80 (130,892,650)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	420,000.00	424,363.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	480,000.00	490,123.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	440,000.00	452,122.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2029/09/06	480,000.00	496,276.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	1,140,000.00	1,164,510.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	430,000.00	451,534.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	560,000.00	597,172.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	1,020,000.00	1,049,784.00	
ノルウェー・クローネ 小計		4,970,000.00	5,125,887.00 (61,664,421)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 2 2021/04/25	310,000.00	312,501.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.25 2022/04/25	250,000.00	253,797.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2023/01/25	240,000.00	246,127.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	660,000.00	680,671.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	450,000.00	463,567.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	410,000.00	422,341.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	410,000.00	429,483.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2029/10/25	210,000.00	221,629.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	390,000.00	417,374.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	550,000.00	595,507.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	770,000.00	824,700.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	519,373.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	130,000.00	171,216.50	
ポーランド・ズロチ	小計	5,250,000.00	5,558,291.00 (157,132,887)	
マレーシア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	390,000.00	396,544.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	330,000.00	337,365.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.62 2021/11/30	200,000.00	203,074.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	140,000.00	147,777.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.828 2034/07/05	80,000.00	86,035.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	280,000.00	300,160.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.885 2029/08/15	140,000.00	150,817.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	390,000.00	414,546.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	240,000.00	254,880.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	260,000.00	275,581.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	100,000.00	109,507.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	310,000.00	315,688.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	410,000.00	433,501.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	150,000.00	166,200.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	110,000.00	122,974.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	140,000.00	151,540.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	150,000.00	168,000.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	130,000.00	152,594.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	140,000.00	165,890.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	130,000.00	157,820.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.921 2048/07/06	120,000.00	146,806.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	121,128.00	

	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	70,171.80	
マレーシア・リンギット 小計		4,500,000.00	4,848,604.40 (129,700,168)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	5,640,000.00	6,462,086.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	1,100,000.00	1,466,113.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	2,240,000.00	2,159,785.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	3,800,000.00	3,796,466.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	3,550,000.00	3,547,337.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.25 2021/12/09	2,350,000.00	2,381,513.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	3,740,000.00	3,956,695.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,750,000.00	1,911,210.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	1,220,000.00	1,347,721.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	2,580,000.00	2,864,599.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	3,840,000.00	4,038,720.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	1,690,000.00	1,941,725.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	3,340,000.00	3,794,407.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	1,960,000.00	2,326,010.40	
	メキシコ・ペソ 小計		38,800,000.00	41,994,392.10 (249,866,633)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.1 2030/06/22	70,000.00	71,782.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	120,000.00	123,415.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	150,000.00	157,149.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	200,000.00	213,706.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	180,000.00	195,201.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	180,000.00	196,520.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	180,000.00	199,042.20	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	190,000.00	207,113.30	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	150,000.00	168,649.50	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	90,000.00	104,924.70	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	60,000.00	72,496.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	140,000.00	179,669.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22	80,000.00	105,291.20	

BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	120,000.00	155,362.80	
BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	70,000.00	109,564.70	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	180,000.00	197,211.60	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	60,000.00	91,731.60	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	190,000.00	216,136.40	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	100,000.00	142,363.00	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	120,000.00	215,602.80	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	180,000.00	197,587.80	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	100,000.00	149,572.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	200,000.00	215,572.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	200,000.00	225,496.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	220,000.00	395,111.20	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	140,000.00	182,775.60	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	240,000.00	416,678.40	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	240,000.00	354,636.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2023/04/30	30,000.00	30,334.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	230,000.00	231,140.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/10/31	280,000.00	282,405.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2024/07/30	210,000.00	214,777.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	260,000.00	266,232.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	270,000.00	275,062.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	240,000.00	245,666.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5 2030/04/30	130,000.00	133,564.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.6 2029/10/31	270,000.00	280,875.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	280,000.00	285,028.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	290,000.00	316,520.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	270,000.00	299,403.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	260,000.00	288,670.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	280,000.00	310,576.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	270,000.00	302,027.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	240,000.00	266,073.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	270,000.00	295,274.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.85 2035/07/30	170,000.00	202,199.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	250,000.00	281,755.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	290,000.00	341,216.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	300,000.00	339,270.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	240,000.00	299,896.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	180,000.00	254,419.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	300,000.00	342,381.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	220,000.00	318,775.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	150,000.00	262,669.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	280,000.00	328,036.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	250,000.00	395,200.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	260,000.00	305,419.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	290,000.00	366,084.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	260,000.00	459,654.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	230,000.00	276,326.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	240,000.00	428,551.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	240,000.00	344,640.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	180,000.00	349,308.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	270,000.00	316,175.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	300,000.00	321,150.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	290,000.00	481,997.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	290,000.00	325,603.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	280,000.00	387,774.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	320,000.00	487,363.20	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/04/09	270,000.00	271,922.40	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/10/08	240,000.00	242,515.20	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/04/08	230,000.00	233,220.00	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/10/07	210,000.00	213,649.80	



BUNDESobligation 0 2023/10/13	210,000.00	215,159.70	
BUNDESobligation 0 2024/10/18	240,000.00	247,368.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	310,000.00	322,409.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2029/08/15	280,000.00	292,832.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/02/15	70,000.00	73,145.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2050/08/15	90,000.00	88,576.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	330,000.00	349,783.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	260,000.00	277,555.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	260,000.00	278,049.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	300,000.00	317,463.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	330,000.00	352,591.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	320,000.00	346,176.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	280,000.00	303,996.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	230,000.00	247,360.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	290,000.00	316,503.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	220,000.00	296,557.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	230,000.00	242,785.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	240,000.00	255,727.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	420,000.00	449,832.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	480,000.00	524,596.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	310,000.00	327,759.90	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	380,000.00	417,103.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	250,000.00	262,572.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	220,000.00	240,719.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2021/09/04	210,000.00	219,336.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	340,000.00	552,897.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	360,000.00	599,914.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	240,000.00	252,770.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	190,000.00	333,890.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	290,000.00	500,740.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	170,000.00	318,025.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	260,000.00	454,038.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	210,000.00	423,181.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	130,000.00	218,440.30	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/03/12	160,000.00	161,057.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/06/11	180,000.00	181,481.40	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/09/10	160,000.00	161,585.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/12/10	160,000.00	161,881.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2021/04/15	190,000.00	190,704.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2021/11/01	50,000.00	50,477.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	200,000.00	201,810.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	430,000.00	439,378.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	400,000.00	411,728.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1 2022/07/15	230,000.00	236,161.70	

BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	300,000.00	314,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	710,000.00	732,499.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2030/04/01	200,000.00	208,514.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	450,000.00	467,725.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	440,000.00	466,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	440,000.00	471,284.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	290,000.00	308,815.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	420,000.00	449,765.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	470,000.00	512,925.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	290,000.00	319,681.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	240,000.00	264,648.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	360,000.00	375,354.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	220,000.00	244,765.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	180,000.00	202,527.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.3 2021/10/15	210,000.00	218,696.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	200,000.00	230,808.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2050/09/01	90,000.00	101,123.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	450,000.00	497,889.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	220,000.00	261,542.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	250,000.00	292,877.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	120,000.00	144,366.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	190,000.00	232,803.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3 2029/08/01	260,000.00	310,993.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.1 2040/03/01	90,000.00	112,417.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	200,000.00	260,358.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	180,000.00	228,936.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	210,000.00	283,649.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	330,000.00	411,915.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	310,000.00	322,865.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	200,000.00	209,548.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	360,000.00	380,696.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	250,000.00	289,615.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.85 2049/09/01	170,000.00	245,021.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	350,000.00	482,888.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	260,000.00	297,042.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	290,000.00	340,735.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	290,000.00	359,988.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2021/09/01	320,000.00	344,262.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	310,000.00	360,142.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	300,000.00	399,270.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	220,000.00	349,333.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	430,000.00	530,882.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	320,000.00	476,211.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	290,000.00	455,639.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	290,000.00	458,014.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	360,000.00	506,185.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	250,000.00	285,202.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	400,000.00	459,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	260,000.00	401,853.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	370,000.00	564,719.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	340,000.00	488,257.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	160,000.00	212,537.60	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	140,000.00	203,385.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	210,000.00	348,839.40	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	180,000.00	269,508.60	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	140,000.00	214,473.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2022/04/15	50,000.00	50,685.50	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	70,000.00	71,531.60	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	70,000.00	74,165.70	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	60,000.00	64,010.40	

FINNISH GOVERNMENT 0.5 2029/09/15	50,000.00	53,663.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	60,000.00	66,226.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	60,000.00	64,636.20	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	60,000.00	69,828.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	40,000.00	52,100.80	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	70,000.00	74,704.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	70,000.00	74,061.40	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	90,000.00	99,773.10	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	60,000.00	92,892.60	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	110,000.00	138,871.70	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	80,000.00	83,803.20	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	70,000.00	87,264.10	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	350,000.00	352,093.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	310,000.00	312,393.20	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	370,000.00	374,650.90	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	410,000.00	415,887.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	500,000.00	509,490.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	430,000.00	440,281.30	
FRANCE (GOVT OF) 0 2025/03/25	400,000.00	410,388.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2029/11/25	250,000.00	255,270.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	420,000.00	438,908.40	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	490,000.00	516,626.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	450,000.00	476,820.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2029/05/25	420,000.00	449,677.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	450,000.00	490,464.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	430,000.00	469,787.90	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	430,000.00	466,949.90	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	430,000.00	473,636.40	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	330,000.00	387,024.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	420,000.00	494,781.00	

FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	580,000.00	687,079.60	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2050/05/25	350,000.00	442,792.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	690,000.00	743,606.10	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	470,000.00	522,024.30	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	270,000.00	346,542.30	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	150,000.00	213,253.50	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	330,000.00	460,264.20	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	490,000.00	528,048.50	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	440,000.00	493,609.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	540,000.00	690,795.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	520,000.00	646,666.80	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	580,000.00	626,150.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	480,000.00	511,272.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	330,000.00	553,707.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	490,000.00	611,363.20	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	470,000.00	494,059.30	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	340,000.00	576,901.80	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	210,000.00	436,743.30	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	180,000.00	394,815.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	560,000.00	661,046.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	450,000.00	839,160.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	370,000.00	633,240.20	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	480,000.00	738,336.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	400,000.00	697,996.00	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	380,000.00	521,926.20	
IRISH TSY 0.4% 2035 0.4 2035/05/15	50,000.00	51,541.00	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	90,000.00	92,458.80	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	140,000.00	151,799.20	
IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	100,000.00	111,769.00	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	50,000.00	58,182.00	

IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	70,000.00	80,959.20	
IRISH TSY 1.5% 2050 1.5 2050/05/15	50,000.00	62,307.00	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	70,000.00	87,012.10	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	110,000.00	149,893.70	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	120,000.00	151,083.60	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	70,000.00	70,977.20	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	100,000.00	109,531.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	100,000.00	115,911.00	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	90,000.00	102,310.20	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	170,000.00	245,029.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	190,000.00	192,255.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	190,000.00	194,620.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	190,000.00	198,386.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2029/07/15	160,000.00	169,224.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	190,000.00	202,479.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2040/01/15	90,000.00	99,064.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	190,000.00	207,274.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	170,000.00	187,006.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	230,000.00	248,899.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	200,000.00	223,150.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	190,000.00	203,292.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	170,000.00	230,574.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	190,000.00	327,924.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	210,000.00	221,398.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	170,000.00	191,906.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	200,000.00	365,816.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	210,000.00	357,088.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	160,000.00	236,465.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	100,000.00	101,636.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2023/07/15	70,000.00	71,427.30	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	130,000.00	138,468.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2029/02/20	140,000.00	149,989.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	160,000.00	172,652.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	120,000.00	130,670.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	120,000.00	131,612.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	80,000.00	105,056.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	40,000.00	58,894.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	180,000.00	198,673.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	210,000.00	228,225.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	70,000.00	136,430.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	100,000.00	134,577.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	90,000.00	152,804.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	130,000.00	144,521.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	200,000.00	212,940.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	110,000.00	120,230.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	50,000.00	114,399.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	170,000.00	288,539.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	110,000.00	145,977.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	110,000.00	164,995.60	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	140,000.00	181,487.60	
	ユーロ 小計	68,370,000.00	83,069,063.90 (10,045,541,897)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	3,100,000.00	3,511,990.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	1,440,000.00	1,037,793.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	1,160,000.00	811,768.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	600,000.00	602,670.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	1,220,000.00	1,047,553.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	1,570,000.00	1,623,851.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	2,470,000.00	2,335,706.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	1,660,000.00	1,541,393.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	1,560,000.00	1,388,493.60	



	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	1,980,000.00	1,753,488.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	3,050,000.00	2,681,560.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	1,510,000.00	1,417,029.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	1,420,000.00	1,299,726.00	
	南アフリカ・ランド 小計	22,740,000.00	21,053,021.60 (156,213,420)	
国債証券 合計			27,243,250,522 (27,243,250,522)	
合計			27,243,250,522 (27,243,250,522)	

(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 124銘柄	48.54%	48.97%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	6.33%	6.39%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	1.88%	1.90%
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	1.93%	1.94%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.40%	0.40%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.28%	0.28%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.48%	0.48%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.22%	0.23%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.57%	0.58%
マレーシア・リングギット	国債証券 23銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.91%	0.92%
ユーロ	国債証券 287銘柄	36.55%	36.87%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.57%	0.57%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年2月22日から2020年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年2月21日現在)	第4期中間計算期間 (2020年8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,581,120	2,277,640
コール・ローン	153,741,532	232,819,051
親投資信託受益証券	3,032,107,808	4,494,872,176
未収入金	371,078	4,828,813
流動資産合計	3,189,801,538	4,734,797,680
資産合計	3,189,801,538	4,734,797,680
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	362,482	5,040,985
未払受託者報酬	306,165	418,519
未払委託者報酬	1,896,986	2,511,347
その他未払費用	123,853	163,133
流動負債合計	2,689,486	8,133,984
負債合計	2,689,486	8,133,984
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,009,683,143	4,489,123,014
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	177,428,909	237,540,682
純資産合計	3,187,112,052	4,726,663,696
負債純資産合計	3,189,801,538	4,734,797,680

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 (自2019年2月22日 至2019年8月21日)	第4期中間計算期間 (自2020年2月22日 至2020年8月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	436	3,802
有価証券売買等損益	18,567,919	3,668,035
営業収益合計	18,568,355	3,671,837
<b>営業費用</b>		
支払利息	20,498	55,387
受託者報酬	115,889	418,519
委託者報酬	811,433	2,511,347
その他費用	53,407	164,380
営業費用合計	1,001,227	3,149,633
営業利益又は営業損失( )	17,567,128	522,204
経常利益又は経常損失( )	17,567,128	522,204
中間純利益又は中間純損失( )	17,567,128	522,204
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( )	265,410	3,435,649
期首剰余金又は期首欠損金( )	8,557,362	177,428,909
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,099,730	68,169,469
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	64,099,730	68,169,469
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,552,751	12,015,549
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,552,751	12,015,549
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( )	88,406,059	237,540,682

## (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3期 2020年2月21日現在	第4期中間計算期間 2020年8月21日現在
1. 受益権総口数	3,009,683,143口	4,489,123,014口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0590円 (10,590円)	1.0529円 (10,529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3期 2020年2月21日現在	第4期中間計算期間 2020年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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3期 2020年2月21日現在	第4期中間計算期間 2020年8月21日現在
期首元本額	450,806,429円	3,009,683,143円
期中追加設定元本額	2,737,365,208円	1,694,401,801円
期中一部解約元本額	178,488,494円	214,961,930円

## &lt; 参考 &gt;

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

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,140,529	42,015,295
コール・ローン	1,293,967,064	4,294,778,821
株式	67,022,069,250	137,796,373,350
派生商品評価勘定	-	90,208,700
未収入金	4,810,000	-
未収配当金	108,315,429	176,610,358
前払金	17,845,000	-
差入委託証拠金	31,680,000	177,525,000
流動資産合計	68,508,827,272	142,577,511,524
資産合計	68,508,827,272	142,577,511,524
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,161,300	16,353,800
前受金	-	66,405,000
未払解約金	272,526,243	193,755,489
その他未払費用	3,324	5,441
流動負債合計	295,690,867	276,519,730
負債合計	295,690,867	276,519,730
純資産の部		
元本等		
元本	37,902,386,971	81,420,887,582
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,310,749,434	60,880,104,212
純資産合計	68,213,136,405	142,300,991,794
負債純資産合計	68,508,827,272	142,577,511,524

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 受益権総口数	37,902,386,971口	81,420,887,582口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7997円 (17,997円)	1.7477円 (17,477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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （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	2020年2月21日 現在				2020年8月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,125,325,000	-	1,102,200,000	23,125,000	4,445,040,000	-	4,519,050,000	74,010,000
合計	1,125,325,000	-	1,102,200,000	23,125,000	4,445,040,000	-	4,519,050,000	74,010,000

(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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	34,479,781,252円	37,902,386,971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	14,213,392,764円	53,184,739,578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	10,790,787,045円	9,666,238,967円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,328,670,873円	6,137,620,394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)	4,348,214,857円	4,142,123,889円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,064,002円	4,193,929円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,533,758,682円	1,902,600,363円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,400,151,642円	6,306,004,336円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,650,003,285円	4,215,042,264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)	8,429,921円	6,706,751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)	35,456,926円	31,422,458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)	33,985,099円	35,034,142円
DCニッセイ国内株式インデックス	308,609,717円	372,350,934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	15,005,800,254円	17,112,380,345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)	708,961,084円	992,460,554円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	95,260,690円	132,430,898円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,348,383円	139,491,572円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	69,517,201円	133,946,936円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	127,166,977円	308,632,782円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	32,079,078円	75,648,548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)	49,538,445円	59,838,035円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,858,143円	7,098,013円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	4,166,589円	5,689,050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)	1,136,629円	1,563,536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)	3,601,646円	4,659,010円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	19,343,945円	20,759,804円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	10,022,746円	32,650,084円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	7,973,243円	25,489,977円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	12,208,615円	96,112,656円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	12,058,299円	151,578,781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	38,963,545,015円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	-円	3,812,526円
計	37,902,386,971円	81,420,887,582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)

	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	14,133,745	7,549,475
コール・ローン	606,777,680	771,702,933
国債証券	60,286,981,030	56,866,601,400
地方債証券	7,236,402,821	7,441,437,209
特殊債券	8,307,495,386	8,512,278,852
社債券	5,744,449,000	5,102,370,300
未収利息	218,630,794	213,564,475
前払費用	6,634,696	6,413,450
流動資産合計	82,421,505,152	78,921,918,094
資産合計	82,421,505,152	78,921,918,094
負債の部		
流動負債		
未払金	-	332,866,900
未払解約金	14,663,143	7,708,280
その他未払費用	801	927
流動負債合計	14,663,944	340,576,107
負債合計	14,663,944	340,576,107
純資産の部		
元本等		
元本	82,709,590,673	80,097,320,581
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	302,749,465	1,515,978,594
純資産合計	82,406,841,208	78,581,341,987
負債純資産合計	82,421,505,152	78,921,918,094

## 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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 受益権総口数	82,709,590,673口	80,097,320,581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	302,749,465円	1,515,978,594円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9963円 (9,963円)	0.9811円 (9,811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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	93,246,832,729円	82,709,590,673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	7,513,852,343円	4,514,606,115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	18,051,094,399円	7,126,876,207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)	77,960,275,163円	72,911,226,172円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,993,604,676円	2,223,705,357円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	41,659,580円	54,063,049円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,913,782,404円	2,883,720,906円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	45,960,871円	82,769,646円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	147,466,511円	334,861,643円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	387,230,112円	857,789,725円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド(6資産均等型)	90,813,280円	102,306,968円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リー ト/債券)	5,174,232円	6,733,164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)	30,971,907円	37,403,837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)	35,248,815円	35,728,814円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	3,441,982円	10,444,335円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,361,447円	13,038,942円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	9,618,706円	70,837,304円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	39,980,987円	472,690,719円
計	82,709,590,673円	80,097,320,581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)

	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,119,682,869	932,579,220
金銭信託	146,850,868	39,407,980
コール・ローン	6,304,474,246	4,028,260,626
株式	231,824,581,396	259,929,677,624
投資証券	6,540,003,766	6,124,309,940
派生商品評価勘定	234,248,770	393,680,892
未収入金	937,275	1,256,674
未収配当金	300,938,345	352,124,741
差入委託証拠金	2,400,932,652	4,220,466,328
流動資産合計	248,872,650,187	276,021,764,025
資産合計	248,872,650,187	276,021,764,025
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,814,319	39,489,716
未払解約金	665,847,583	626,244,141
その他未払費用	6,030	4,031
流動負債合計	681,667,932	665,737,888
負債合計	681,667,932	665,737,888
純資産の部		
元本等		
元本	117,983,458,933	139,148,093,308
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	130,207,523,322	136,207,932,829
純資産合計	248,190,982,255	275,356,026,137
負債純資産合計	248,872,650,187	276,021,764,025

## 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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 受益権総口数	117,983,458,933口	139,148,093,308口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1036円 (21,036円)	1.9789円 (19,789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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2020年2月21日 現在				2020年8月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	5,803,139,733	-	5,893,526,850	90,387,117	3,363,451,725	-	3,346,432,730	17,018,995
アメリカ・ ドル	3,967,053,862	-	4,038,994,050	71,940,188	2,326,136,737	-	2,310,044,580	16,092,157
イギリス・ ポンド	535,591,504	-	541,632,960	6,041,456	370,341,024	-	371,528,310	1,187,286
ユーロ	1,300,494,367	-	1,312,899,840	12,405,473	666,973,964	-	664,859,840	2,114,124
合計	5,803,139,733	-	5,893,526,850	90,387,117	3,363,451,725	-	3,346,432,730	17,018,995

## （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	2020年2月21日 現在				2020年8月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	9,369,455,136	-	9,497,502,470	128,047,334	8,071,466,729	-	8,442,676,899	371,210,170
合計	9,369,455,136	-	9,497,502,470	128,047,334	8,071,466,729	-	8,442,676,899	371,210,170

## （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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	94,844,967,281円	117,983,458,933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	46,386,791,267円	38,572,693,154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	23,248,299,615円	17,408,058,779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)	696,655,998円	834,607,114円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,224,381,334円	3,649,652,172円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,452,973,512円	2,748,164,797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)	1,513,732,410円	1,627,190,012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)	3,829,046円	2,941,692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)	21,474,187円	18,376,118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)	22,999,716円	22,928,436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)	11,360,289,899円	11,133,213,301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	80,906,577,165円	97,149,806,515円
D Cニッセイ外国株式インデックス	16,474,845,579円	19,668,216,012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)	643,991,640円	870,919,116円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	64,268,965円	86,313,157円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	78,409,740円	122,375,357円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	46,775,884円	87,065,679円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	85,402,524円	200,373,655円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	19,418,185円	44,308,256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)	44,985,994円	52,508,486円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,390,457円	6,229,169円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,830,933円	4,990,624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)	1,044,944円	1,371,928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)	17,772,213円	18,211,705円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	6,776,594円	21,306,274円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	5,379,134円	16,612,909円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	8,209,983円	62,466,090円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	7,956,127円	96,755,655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)	266,086,770円	265,725,975円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定)	- 円	305,306,698円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	- 円	30,156,406円
計	117,983,458,933円	139,148,093,308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)

	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	114,682,539	59,323,900
金銭信託	2,528,832	1,029,254
コール・ローン	108,565,603	105,209,782
国債証券	27,243,250,522	30,518,526,650
派生商品評価勘定	666,326	1,594
未収利息	164,229,827	156,179,631
前払費用	13,271,686	14,337,425
流動資産合計	27,647,195,335	30,854,608,236
資産合計	27,647,195,335	30,854,608,236
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,847	396,556
未払金	111,089,592	42,089,399
未払解約金	54,292,395	55,837,569
その他未払費用	159	172
流動負債合計	165,385,993	98,323,696
負債合計	165,385,993	98,323,696
純資産の部		
元本等		
元本	19,109,600,573	20,972,581,515
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,372,208,769	9,783,703,025
純資産合計	27,481,809,342	30,756,284,540
負債純資産合計	27,647,195,335	30,854,608,236

## 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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 受益権総口数	19,109,600,573口	20,972,581,515口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4381円 (14,381円)	1.4665円 (14,665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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2020年2月21日 現在				2020年8月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	87,053,586	-	87,716,065	662,479	73,232,105	-	72,837,143	394,962
アメリカ・ドル	62,894,184	-	63,560,510	666,326	49,397,661	-	49,004,265	393,396
イギリス・ポンド	3,936,513	-	3,936,458	55	3,597,396	-	3,597,396	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,583,000	-	2,582,678	322
ポーランド・ズロチ	2,325,358	-	2,323,220	2,138	2,260,015	-	2,257,177	2,838
ユーロ	15,834,244	-	15,833,982	262	15,394,033	-	15,395,627	1,594
南アフリカ・ランド	2,063,287	-	2,061,895	1,392	-	-	-	-
合計	87,053,586	-	87,716,065	662,479	73,232,105	-	72,837,143	394,962

(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	2020年2月21日現在	2020年8月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	14,029,005,797円	19,109,600,573円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	8,074,443,613円	5,489,508,100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	2,993,848,837円	3,626,527,158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)	1,988,607,958円	2,194,443,612円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,451,344,594円	3,598,561,774円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,166,961,336円	1,204,365,073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)	721,056,120円	731,914,184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)	5,464,511円	3,867,130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)	15,323,186円	12,071,644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)	11,703,617円	10,765,123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	9,095,999,668円	9,741,323,602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)	919,264,826円	1,145,403,502円
D Cニッセイ外国債券インデックス	954,327,693円	1,130,055,090円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	31,780,455円	39,329,479円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	559,809,809円	804,429,310円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	23,386,677円	40,163,077円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	43,381,851円	93,946,641円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	13,861,914円	29,280,855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)	64,239,238円	69,019,472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)	3,659,287円	4,515,015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)	24,931,873円	23,958,840円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	3,359,097円	9,722,260円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	2,686,625円	7,658,109円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	4,111,612円	28,875,489円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	4,338,626円	48,912,234円
計	19,109,600,573円	20,972,581,515円



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

(2020年8月31日現在)

資産総額	4,755,482,732円
負債総額	7,232,045円
純資産総額( - )	4,748,250,687円
発行済数量	4,510,716,592口
1口当たり純資産額( / )	1.0527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8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年8月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	403	67,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	130	26,028
単位型公社債投資信託	0	0
合計	533	93,243

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	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	64,821,590	68,155,196
-------	------------	------------

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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余 金合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	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 〇 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
auカブコム証券株式会社	7,196	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。
株式会社SBI証券	48,323	
楽天証券株式会社	7,495	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
日本生命保険相互会社	1,400,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

#### (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】

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

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

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



### 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

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

2020年3月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2019年2月22日から2020年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2020年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年10月1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 百瀬和政 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2020年2月22日から2020年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2020年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年2月22日から2020年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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