【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年2月19日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　大関　洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部　　茶木　健
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額　上限１兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）
上記ファンドの愛称として「ファンドパック７」ということがあります。
（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】

① 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。

② 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：2021年2月20日（土）～ 2021年8月20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
（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ https://www.nam.co.jp/

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【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

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（１１）【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

（１２）【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】

① 基本方針

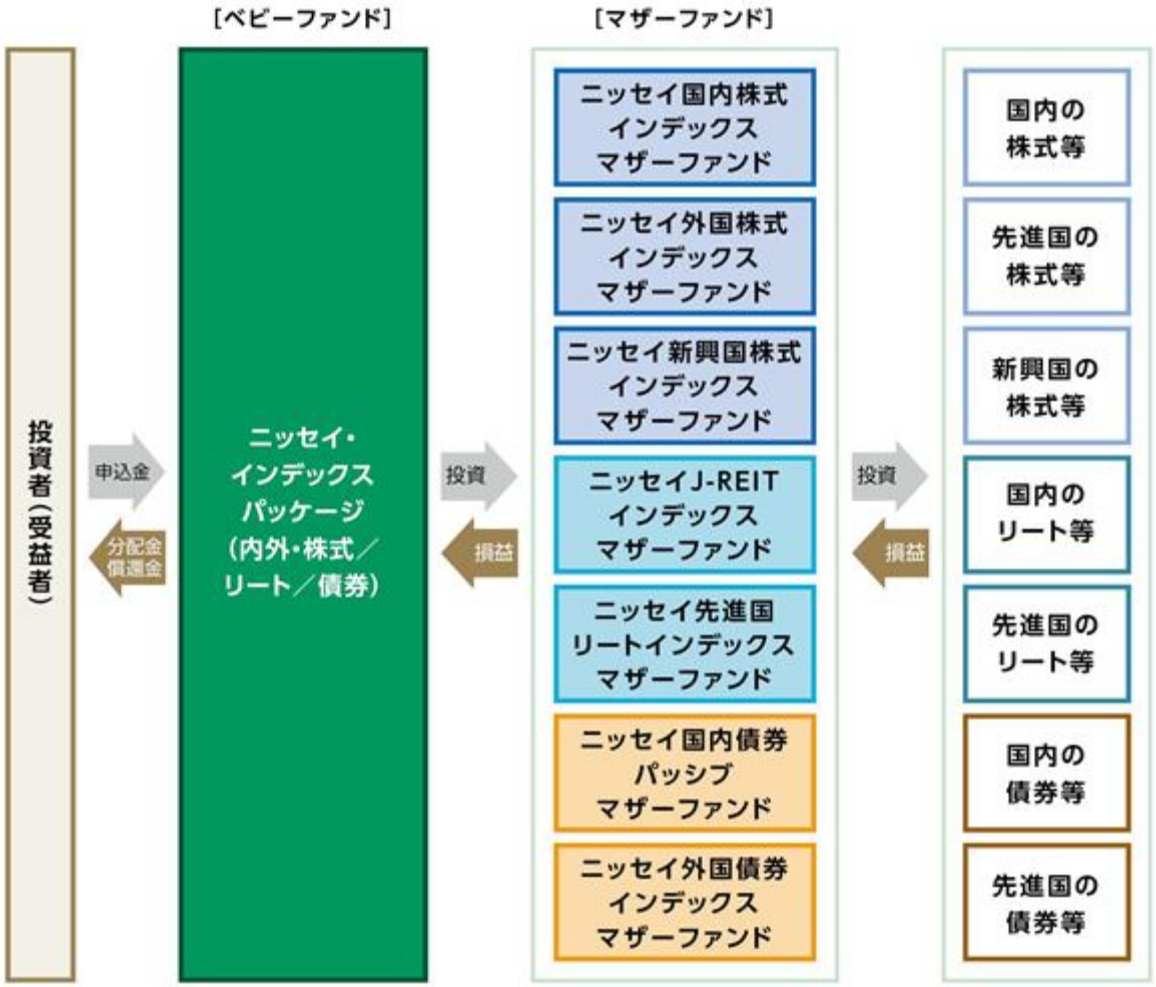
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



③　ファンドの特色

1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

- 投資対象とするマザーファンドは、各投資対象資産の指数の動きに連動する投資成果をめざします。
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ※を行いません。

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

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

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

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

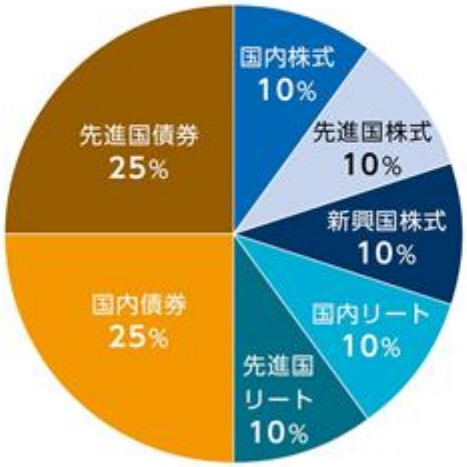
〈各マザーファンドの運用プロセス〉

2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

● ファンドは、各投資対象資産の指数を基本投資割合で組合せた合成ベンチマーク*の動きに連動する投資成果をめざします。

※各投資対象資産の指数の騰落率を基本投資割合で加重平均し、委託会社が独自に指数化したもの(以下「ベンチマーク」ということがあります)。各投資対象資産の指数は、国内株式:TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、先進国株式:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、新興国株式:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、国内リート:東証REIT指数(配当込み)、先進国リート:S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)、国内債券:NOMURA-BPI総合、先進国債券:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)。

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

〈各指数について〉

●TOPIX（東証株価指数）

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

●MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●東証REIT指数

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

●S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

●NOMURA−BPI総合

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

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

＜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。

④　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。

⑤　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）	補足分類
単　位　型 追　加　型	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特　殊　型

属性区分表

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

商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

属性区分表

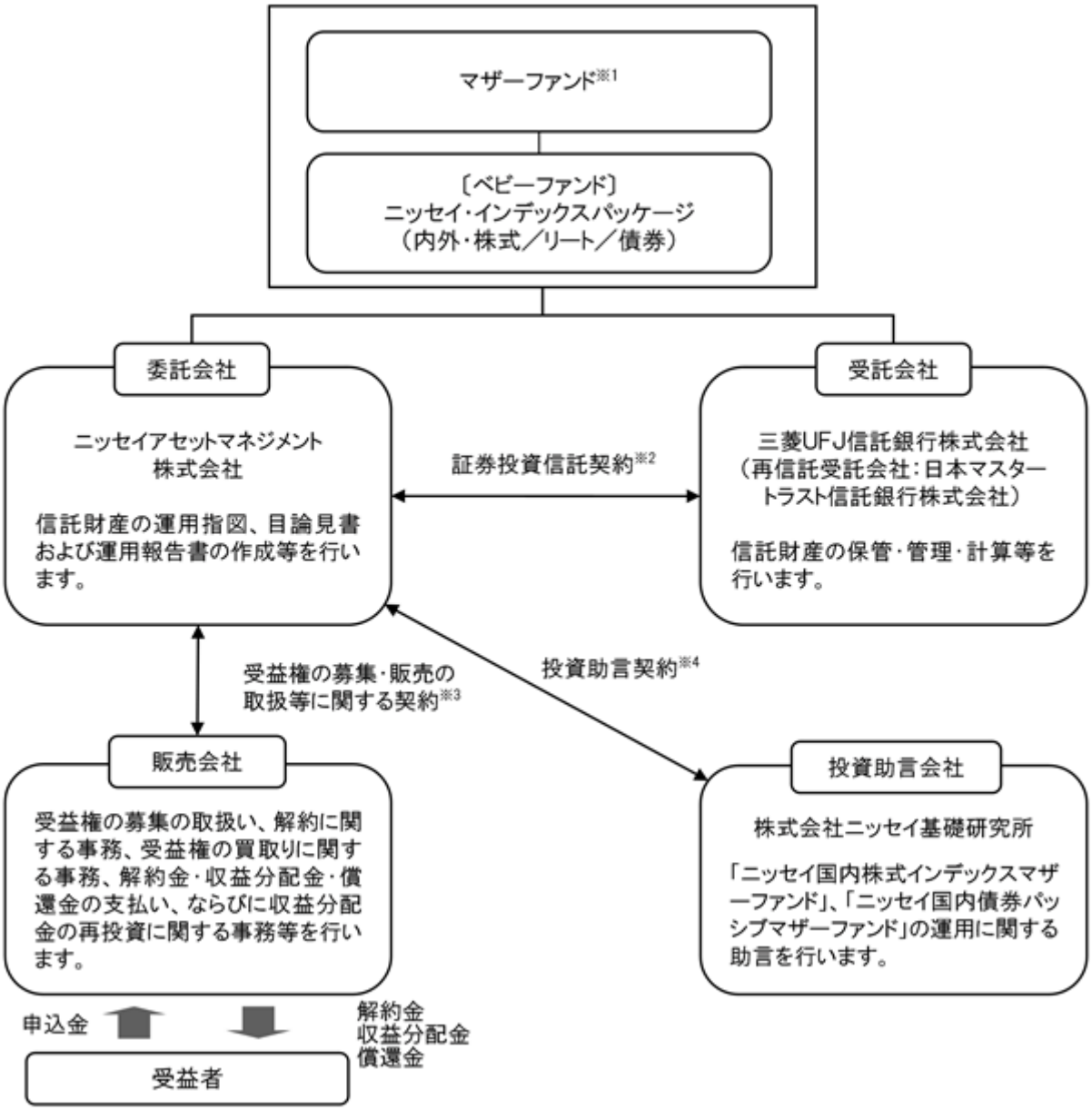
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式・ 不動産投信・債券） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	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。
その他の指数 （合成ベンチマーク）	目論見書または約款において、合成ベンチマークの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

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

（２）【ファンドの沿革】

2017年11月17日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



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

※２　委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。

※３　委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

※４　委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（2020年11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】

① 複数のマザーファンド※への投資を通じ、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）およびＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）をそれぞれ10%、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合およびＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をそれぞれ25%ずつ組合せた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

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

② 各マザーファンドへの基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンドおよびニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドへそれぞれ10%、ニッセイ国内債券パッシブ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へそれぞれ25%とします。

③ 各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

ｂ　投資態度

①　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。

②　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。

③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

④　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

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

⑧　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。

⑨　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。

⑩　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

①　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。

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　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。

④　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

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑧　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。

⑨　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。

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

ニッセイ新興国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エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

（2）運用方法

a　投資対象

新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます）を主要投資対象とします。

b　投資態度

① 主として新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます）に投資することにより、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
② 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
③ 株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。
④ 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。
⑤ 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

① 株式への投資割合には、制限を設けません。
② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
③ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
⑦ 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。
⑧ 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。
⑨ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

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

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。

②　不動産投資信託証券への投資にあたっては、東証ＲＥＩＴ指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証ＲＥＩＴ指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜不動産投資信託証券の追加・見直しを行います。

③　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

④　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

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　デリバティブの直接利用は行いません。

⑥　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

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

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

ｂ　投資態度

①　主として、世界各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国の不動産投資信託証券に投資することにより、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

②　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　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。

④　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

①　投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

②　株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。

③　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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

①　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。

②　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。

③　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。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤　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

①　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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限ります。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を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

①　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、ＦＴＳＥ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。

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　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。

④　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

①　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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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

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

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

ｂ　約款に定める投資対象

①　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　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）

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

②　有価証券

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）

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

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

③　金融商品

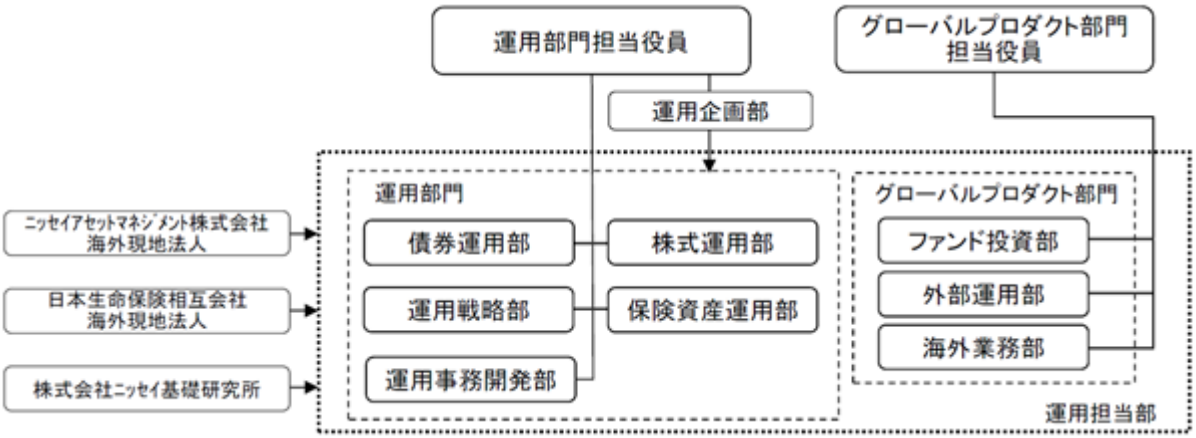
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

④　前記②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③に掲げる金融商品により運用することができます。

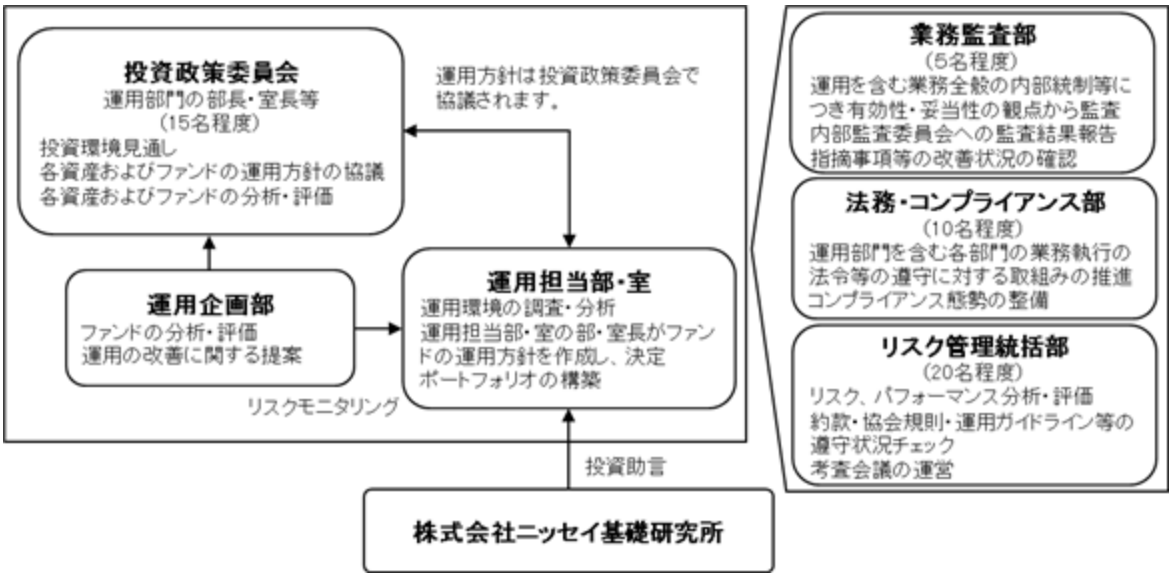
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



＜受託会社に対する管理体制等＞

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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①　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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

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。

②　分配時期

毎決算日とし、決算日は11月20日（年１回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

③　支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

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

＜分配金再投資コースの場合＞

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

○　将来の分配金の支払いおよび水準について、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

①　株式、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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70%以下とします。

⑦　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。

⑧　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。

⑨　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

①　投資する株式等の範囲

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

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

②　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。

③　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。

④　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たときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑤　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たときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑥　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。

ⅰ．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。

ⅱ．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たときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　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⑧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。

⑧　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たときは、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。

⑨　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。

⑩　資金の借入れ

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

２．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

３．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

①　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。

②　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。

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、ベンチマークの動きに連動することを目標に運用しますので、ベンチマークの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。
ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の６の規定）の適用はありません。

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

Ｊ－ＲＥＩＴの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

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

・流動性リスク

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

・新興国の株式投資に関する留意点

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

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

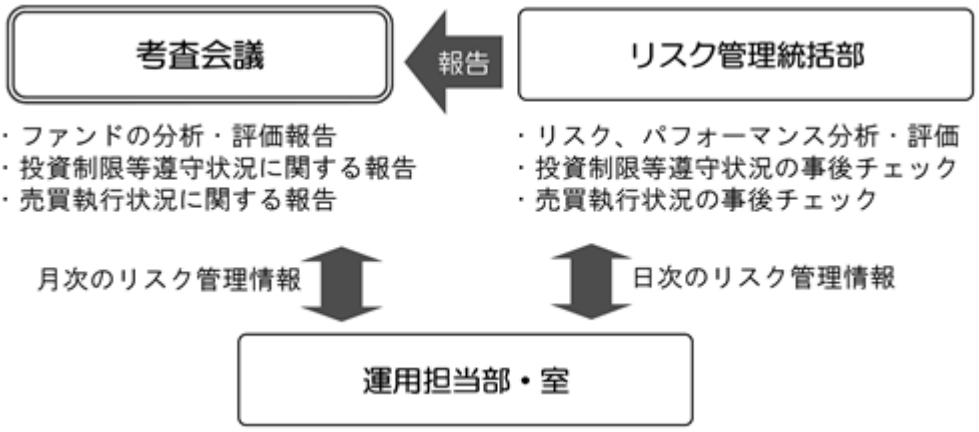
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2020年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に以下の通り保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（%）
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	7.7
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	72.9

（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。

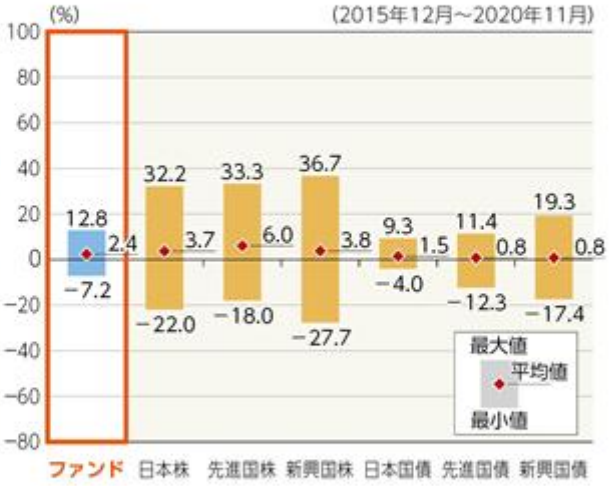
2．運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

○　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。

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 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0.3564%（税抜0.324%）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
0.150%	0.150%	0.024%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

② 前記①の信託報酬については、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払います。

○ ファンドが実質的な投資対象とする上場不動産投資信託証券（リート）は、市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託証券の費用は表示しておりません。

（4）【その他の手数料等】

① 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。

② 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 0.0044%	（税抜0.004%）
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%）

③ 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。

④ 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。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

○ 上記の①、③および④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。

＜ご参考＞

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

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

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

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

※　申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

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

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

※　外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

税率（法人）

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

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

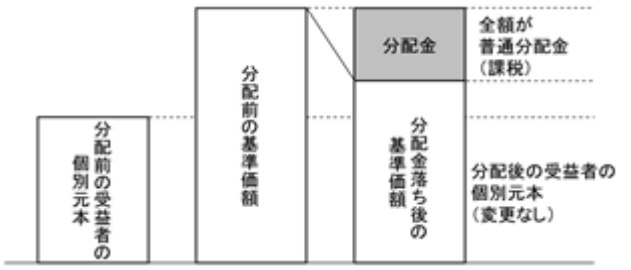
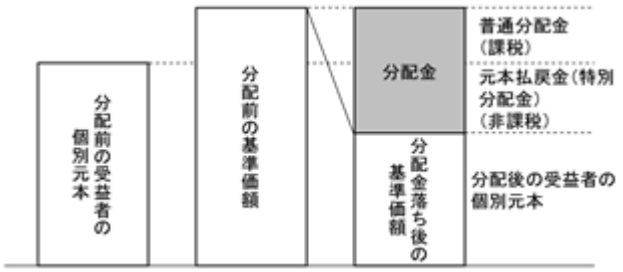
個別元本

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

※　同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合に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）
	
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。	**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。**

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		32,109,441	100.00
	内　日本	32,109,441	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△969	△0.00
純資産総額		32,108,472	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11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		150,481,096,150	96.71
	内　日本	150,481,096,150	96.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,111,282,118	3.29
純資産総額		155,592,378,268	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）		5,143,615,000	3.31
	内　日本	5,143,615,000	3.31

（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）
「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		293,241,165,858	95.57
	内　アメリカ	203,382,502,069	66.29
	内　イギリス	12,709,604,485	4.14
	内　スイス	10,615,131,067	3.46
	内　フランス	10,510,770,794	3.43
	内　カナダ	10,377,863,130	3.38
	内　ドイツ	9,030,767,570	2.94
	内　オランダ	6,385,784,331	2.08
	内　オーストラリア	6,385,088,334	2.08
	内　アイルランド	4,349,603,078	1.42
	内　スウェーデン	3,480,299,916	1.13
	内　香港	2,763,971,728	0.90
	内　スペイン	2,524,768,852	0.82
	内　デンマーク	2,444,554,371	0.80
	内　イタリア	1,926,564,953	0.63
	内　フィンランド	1,072,468,996	0.35
	内　ベルギー	975,442,135	0.32
	内　シンガポール	962,157,722	0.31
	内　ノルウェー	598,201,659	0.19
	内　バミューダ	547,034,488	0.18
	内　ジャージィー	484,062,983	0.16
	内　イスラエル	411,729,274	0.13
	内　ニュージーランド	314,701,221	0.10
	内　ケイマン諸島	313,584,149	0.10
	内　オランダ領キュラソー	199,172,451	0.06
	内　ポルトガル	164,897,662	0.05
	内　オーストリア	163,569,921	0.05
	内　ルクセンブルグ	109,896,656	0.04
	内　パプアニューギニア	36,971,863	0.01
新株予約権証券		1,669,667	0.00
	内　スイス	1,669,667	0.00
投資証券		6,580,313,112	2.14
	内　アメリカ	5,444,190,983	1.77
	内　オーストラリア	480,567,140	0.16
	内　フランス	172,417,040	0.06
	内　イギリス	171,143,344	0.06
	内　シンガポール	155,767,907	0.05
	内　香港	120,585,440	0.04
	内　カナダ	35,641,258	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,999,078,015	2.28
純資産総額		306,822,226,652	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）		6,380,114,832	2.08
	内　アメリカ	4,722,449,812	1.54
	内　ドイツ	1,190,530,533	0.39
	内　イギリス	467,134,487	0.15

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。
その他資産として、先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

（参考情報）
「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		2,223,884,318	92.03
	内　ケイマン諸島	417,427,040	17.27
	内　韓国	300,680,303	12.44
	内　台湾	285,533,578	11.82
	内　中国	259,493,562	10.74
	内　香港	192,392,352	7.96
	内　インド	186,612,791	7.72
	内　ブラジル	115,358,856	4.77
	内　南アフリカ	83,420,360	3.45
	内　アメリカ	77,445,827	3.20
	内　ロシア	56,655,253	2.34
	内　タイ	45,254,123	1.87
	内　メキシコ	39,992,930	1.65
	内　マレーシア	38,214,658	1.58
	内　インドネシア	33,163,599	1.37
	内　フィリピン	17,821,025	0.74
	内　ポーランド	14,789,062	0.61
	内　バミューダ	12,752,341	0.53
	内　チリ	12,152,990	0.50
	内　トルコ	8,139,309	0.34
	内　オランダ	7,878,165	0.33
	内　ハンガリー	4,449,759	0.18
	内　コロンビア	4,429,190	0.18
	内　イギリス	4,257,247	0.18
	内　ギリシャ	2,809,752	0.12
	内　チェコ	2,158,338	0.09
	内　ペルー	601,908	0.02
投資信託受益証券		93,433,667	3.87
	内　アメリカ	93,433,667	3.87
投資証券		1,686,335	0.07
	内　メキシコ	920,124	0.04
	内　南アフリカ	766,211	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		97,552,552	4.04
純資産総額		2,416,556,872	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）		89,812,905	3.72
	内　アメリカ	89,812,905	3.72

（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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		24,785,902,300	98.66
	内　日本	24,785,902,300	98.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		336,986,333	1.34
純資産総額		25,122,888,633	100.00

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

（参考情報）
「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		2,463,388,823	98.25
	内　アメリカ	1,803,947,479	71.95
	内　オーストラリア	199,163,775	7.94
	内　イギリス	141,933,796	5.66
	内　シンガポール	96,557,890	3.85
	内　フランス	63,244,504	2.52
	内　カナダ	51,119,171	2.04
	内　香港	37,607,770	1.50
	内　ベルギー	28,182,048	1.12
	内　スペイン	12,693,139	0.51
	内　ニュージーランド	11,246,541	0.45
	内　ドイツ	5,299,550	0.21
	内　オランダ	4,269,210	0.17
	内　アイルランド	2,907,388	0.12
	内　イスラエル	1,805,053	0.07
	内　ガーンジィ	1,635,478	0.07
	内　マン島	1,273,946	0.05
	内　イタリア	502,085	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		43,832,491	1.75
純資産総額		2,507,221,314	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）
「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		59,368,209,080	74.45
	内　日本	59,368,209,080	74.45
地方債証券		6,932,831,805	8.69
	内　日本	6,932,831,805	8.69
特殊債券		7,956,612,839	9.98
	内　日本	7,956,612,839	9.98
社債券		4,798,323,400	6.02
	内　日本	4,089,036,100	5.13
	内　スウェーデン	407,961,600	0.51
	内　フランス	301,325,700	0.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		682,009,268	0.86
純資産総額		79,737,986,392	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）
「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		32,644,032,934	99.06
	内　アメリカ	14,029,573,074	42.57
	内　フランス	3,462,657,672	10.51
	内　イタリア	3,136,802,573	9.52
	内　ドイツ	2,527,218,977	7.67
	内　イギリス	2,171,885,798	6.59
	内　スペイン	2,025,759,328	6.15
	内　オーストラリア	880,057,011	2.67
	内　ベルギー	831,432,732	2.52
	内　カナダ	656,380,625	1.99
	内　オランダ	650,104,596	1.97
	内　オーストリア	501,721,745	1.52
	内　アイルランド	277,308,958	0.84
	内　メキシコ	266,702,635	0.81
	内　フィンランド	208,848,028	0.63
	内　ポーランド	206,102,078	0.63
	内　デンマーク	185,355,881	0.56
	内　マレーシア	161,820,806	0.49
	内　シンガポール	142,988,189	0.43
	内　イスラエル	141,823,242	0.43
	内　スウェーデン	107,987,341	0.33
	内　ノルウェー	71,501,645	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		308,971,178	0.94
純資産総額		32,953,004,112	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

（2020年11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ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	5,367,650	1.4455 7,759,278	1.4547 7,808,320	－ －	24.32%
2	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	7,870,037	0.9853 7,755,087	0.9838 7,742,542	－ －	24.11%
3	ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,174,129	1.0401 3,301,545	1.0644 3,378,542	－ －	10.52%
4	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,593,480	2.0731 3,303,452	2.1152 3,370,528	－ －	10.50%
5	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	1,730,240	1.8988 3,285,498	1.9290 3,337,632	－ －	10.39%
6	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,336,407	0.9969 3,326,301	0.9991 3,333,404	－ －	10.38%
7	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,036,119	1.5301 3,115,543	1.5414 3,138,473	－ －	9.77%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

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

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

（参考情報）

「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	688,600	7,057.74 4,859,962,179	6,999.00 4,819,511,400	－ －	3.10%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	386,600	6,824.70 2,638,432,606	9,704.00 3,751,566,400	－ －	2.41%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	480,500	4,650.03 2,234,342,743	7,272.00 3,494,196,000	－ －	2.25%
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,900	35,748.28 1,998,328,933	53,290.00 2,978,911,000	－ －	1.91%
5	任天堂 日本	株式 その他製品	37,800	38,684.07 1,462,257,938	59,260.00 2,240,028,000	－ －	1.44%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	809,600	2,617.64 2,119,249,298	2,465.00 1,995,664,000	－ －	1.28%
7	日本電産 日本	株式 電気機器	148,500	6,375.18 946,714,868	13,305.00 1,975,792,500	－ －	1.27%
8	第一三共 日本	株式 医薬品	529,800	2,401.44 1,272,285,260	3,694.00 1,957,081,200	－ －	1.26%

9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	513,500	3,718.27 1,909,332,071	3,745.00 1,923,057,500	— —	1.24%
10	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,164,100	488.97 2,036,134,524	448.50 1,867,598,850	— —	1.20%
11	ダイキン工業 日本	株式 機械	78,600	14,223.17 1,117,941,905	23,665.00 1,860,069,000	— —	1.20%
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	422,500	3,731.93 1,576,742,822	4,400.00 1,859,000,000	— —	1.19%
13	信越化学工業 日本	株式 化学	103,800	11,879.15 1,233,056,113	17,135.00 1,778,613,000	— —	1.14%
14	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	122,400	9,704.44 1,187,823,530	13,910.00 1,702,584,000	— —	1.09%
15	村田製作所 日本	株式 電気機器	181,300	5,717.37 1,036,559,660	9,129.00 1,655,087,700	— —	1.06%
16	ファナック 日本	株式 電気機器	58,000	17,573.12 1,019,241,191	25,365.00 1,471,170,000	— —	0.95%
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	485,900	2,704.34 1,314,038,931	2,871.50 1,395,261,850	— —	0.90%
18	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	39,200	22,397.70 877,990,210	35,470.00 1,390,424,000	— —	0.89%
19	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	441,500	3,240.29 1,430,588,992	2,982.50 1,316,773,750	— —	0.85%
20	ＳＭＣ 日本	株式 機械	19,400	45,654.67 885,700,630	66,320.00 1,286,608,000	— —	0.83%
21	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	421,000	3,243.39 1,365,470,723	3,032.00 1,276,472,000	— —	0.82%
22	エムスリー 日本	株式 サービス業	130,100	3,013.05 391,997,989	9,622.00 1,251,822,200	— —	0.80%
23	日立製作所 日本	株式 電気機器	296,600	3,595.89 1,066,543,788	3,966.00 1,176,315,600	— —	0.76%
24	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	425,200	2,379.19 1,011,632,082	2,758.50 1,172,914,200	— —	0.75%
25	花王 日本	株式 化学	147,800	8,300.74 1,226,850,651	7,808.00 1,154,022,400	— —	0.74%
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	215,200	5,446.59 1,172,106,908	5,190.00 1,116,888,000	— —	0.72%
27	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	62,700	13,590.81 852,143,900	17,765.00 1,113,865,500	— —	0.72%
28	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	827,200	1,401.91 1,159,668,198	1,327.50 1,098,108,000	— —	0.71%
29	中外製薬 日本	株式 医薬品	193,000	3,942.82 760,965,234	5,044.00 973,492,000	— —	0.63%
30	三菱商事 日本	株式 卸売業	398,600	2,592.77 1,033,478,229	2,433.00 969,793,800	— —	0.62%

（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	16.40
		情報・通信業	9.09
		化学	7.35
		輸送用機器	6.78
		サービス業	5.90
		医薬品	5.88
		機械	5.56
		小売業	4.66
		銀行業	4.40
		卸売業	4.31
		食料品	3.43
		陸運業	3.39
		精密機器	2.71
		その他製品	2.62
		建設業	2.28
		不動産業	1.97
		保険業	1.87
		電気・ガス業	1.28
		その他金融業	1.08
		ガラス・土石製品	0.76
		証券、商品先物取引業	0.76
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.60
		鉄鋼	0.59
		ゴム製品	0.53
		繊維製品	0.45
		石油・石炭製品	0.35
		空運業	0.34
		パルプ・紙	0.20
		海運業	0.17
		倉庫・運輸関連業	0.16
		鉱業	0.14
		水産・農林業	0.08
	小計		96.71
合　計（対純資産総額比）			96.71

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

（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11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資比率
1	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	1,078,821	12,325.50 13,297,018,592	12,112.53 13,067,257,229	－ －	4.26%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	453,477	22,068.31 10,007,472,737	22,360.24 10,139,856,685	－ －	3.30%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	26,856	323,851.46 8,697,354,956	331,963.87 8,915,221,762	－ －	2.91%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	151,625	28,355.73 4,299,438,561	28,861.68 4,376,152,366	－ －	1.43%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	19,029	183,253.64 3,487,133,683	186,294.50 3,544,998,213	－ －	1.16%
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	18,858	182,707.56 3,445,499,298	185,653.50 3,501,053,850	－ －	1.14%

7	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	47,050	51,905.25 2,442,142,471	60,854.60 2,863,209,231	－ －	0.93%
8	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	166,047	15,286.37 2,538,256,643	14,960.15 2,484,089,687	－ －	0.81%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	192,206	12,005.52 2,307,534,591	12,593.54 2,420,555,064	－ －	0.79%
10	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	106,346	21,564.44 2,293,292,712	21,920.78 2,331,188,333	－ －	0.76%
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	157,045	14,495.36 2,276,424,240	14,400.19 2,261,478,293	－ －	0.74%
12	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	38,916	55,850.85 2,173,491,771	55,108.45 2,144,600,459	－ －	0.70%
13	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	181,665	11,970.67 2,174,652,928	11,761.43 2,136,640,362	－ －	0.70%
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	88,373	23,847.24 2,107,453,005	24,055.72 2,125,876,983	－ －	0.69%
15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	59,933	35,010.87 2,098,306,867	35,108.58 2,104,162,920	－ －	0.69%
16	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	56,356	34,686.79 1,954,808,917	35,225.98 1,985,195,458	－ －	0.65%
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	67,914	28,146.91 1,911,569,768	28,672.60 1,947,271,031	－ －	0.63%
18	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	114,046	14,723.29 1,679,132,422	15,285.33 1,743,231,395	－ －	0.57%
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	261,452	6,255.21 1,635,438,968	6,293.65 1,645,489,000	－ －	0.54%
20	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア・娯楽	287,631	5,140.47 1,478,560,597	5,376.30 1,546,392,702	－ －	0.50%
21	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	70,354	19,832.60 1,395,302,810	21,961.30 1,545,065,799	－ －	0.50%
22	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	44,288	35,140.58 1,556,306,029	34,778.42 1,540,266,886	－ －	0.50%
23	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	30,225	48,455.33 1,464,562,497	49,558.64 1,497,910,096	－ －	0.49%
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	491,690	2,802.95 1,378,183,567	3,011.77 1,480,857,732	－ －	0.48%
25	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	57,410	27,476.04 1,577,399,736	25,726.28 1,476,945,774	－ －	0.48%
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	27,821	50,353.39 1,400,881,720	51,047.39 1,420,189,448	－ －	0.46%
27	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	257,550	5,519.67 1,421,592,476	5,475.00 1,410,087,022	－ －	0.46%

28	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	89,288	15,803.74 1,411,084,944	15,749.72 1,406,261,356	－ －	0.46%
29	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	450,044	2,938.00 1,322,233,412	3,015.92 1,357,299,715	－ －	0.44%
30	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	350,580	3,759.77 1,318,103,356	3,867.82 1,355,981,983	－ －	0.44%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	ソフトウェア・サービス	11.83
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.67
		メディア・娯楽	6.76
		資本財	6.44
		小売	5.85
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.68
		銀行	5.52
		ヘルスケア機器・サービス	5.14
		素材	4.30
		各種金融	4.24
		半導体・半導体製造装置	4.15
		食品・飲料・タバコ	4.08
		公益事業	3.31
		保険	3.10
		エネルギー	2.98
		家庭用品・パーソナル用品	2.01
		運輸	2.00
		耐久消費財・アパレル	1.94
		電気通信サービス	1.91
		自動車・自動車部品	1.85
		消費者サービス	1.58
		食品・生活必需品小売り	1.56
		商業・専門サービス	1.15
		不動産	0.49
		その他	0.01
	小計		95.57
新株予約権証券	外国	新株予約権証券	0.00
	小計		0.00
投資証券	外国	投資証券	2.14
	小計		2.14
合　計（対純資産総額比）			97.72

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。
株式（外国）の業種はＧＩＣＳ分類（産業グループ）によるものです。なお、ＧＩＣＳに関する知的財産所有権はＳ＆Ｐ及びMSCI Inc.に帰属します。

（参考情報）

「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資比率
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR ケイマン諸島	株式 小売	5,767	26,999.97 155,708,839	28,723.50 165,648,466	－ －	6.85%
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	17,700	7,678.20 135,904,140	7,812.20 138,275,940	－ －	5.72%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	76,000	1,783.60 135,553,600	1,779.96 135,276,960	－ －	5.60%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	14,773	6,085.31 89,898,432	6,424.43 94,908,252	－ －	3.93%
5	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	19,200	3,192.53 61,296,762	3,251.75 62,433,734	－ －	2.58%
6	MEITUAN-B 香港	株式 小売	11,000	3,939.60 43,335,600	4,180.80 45,988,800	－ －	1.90%
7	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 小売	1,342	20,741.32 27,834,858	21,579.22 28,959,326	－ －	1.20%
8	JD.COM INC-ADR ケイマン諸島	株式 小売	2,650	8,938.69 23,687,543	9,288.80 24,615,332	－ －	1.02%
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	297,000	79.73 23,679,810	81.74 24,276,780	－ －	1.00%
10	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	8,808	2,782.14 24,505,102	2,721.01 23,966,726	－ －	0.99%
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	17,500	1,191.26 20,847,050	1,228.78 21,503,650	－ －	0.89%
12	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	9,546	1,884.56 17,990,053	1,854.43 17,702,450	－ －	0.73%
13	VALE SA ブラジル	株式 素材	11,367	1,317.83 14,979,787	1,526.44 17,351,070	－ －	0.72%
14	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	10,512	1,546.41 16,255,940	1,551.00 16,304,112	－ －	0.67%
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 銀行	5,049	3,277.68 16,549,036	3,181.31 16,062,446	－ －	0.66%
16	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	1,698	9,250.43 15,707,247	9,306.95 15,803,218	－ －	0.65%
17	NIO INC - ADR アメリカ	株式 自動車・自動車部品	2,800	5,033.47 14,093,717	5,610.06 15,708,168	－ －	0.65%

18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,545	5,463.60 13,904,862	5,821.55 14,815,870	－ －	0.61%
19	NETEASE.COM INC -ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	1,490	9,269.06 13,810,908	9,697.09 14,448,667	－ －	0.60%
20	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	11,104	1,169.80 12,989,474	1,197.53 13,297,483	－ －	0.55%
21	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	5,000	2,668.12 13,340,600	2,639.00 13,195,000	－ －	0.55%
22	BAIDU INC - SPON ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	863	14,178.90 12,236,396	14,484.34 12,499,988	－ －	0.52%
23	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	186,000	61.64 11,465,040	65.25 12,137,988	－ －	0.50%
24	CHINA MOBILE LTD/HK 香港	株式 電気通信サービス	19,000	631.14 11,991,660	637.17 12,106,230	－ －	0.50%
25	XIAOMI CORP-CLASS B 香港	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	34,400	337.68 11,616,192	349.07 12,008,008	－ －	0.50%
26	PINDUODUO INC-ADR アメリカ	株式 小売	800	14,301.49 11,441,197	14,965.35 11,972,283	－ －	0.50%
27	SBERBANK PAO - SPONSORED ADR ロシア	株式 銀行	8,282	1,351.08 11,189,722	1,409.78 11,675,858	－ －	0.48%
28	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	38,200	301.75 11,527,079	300.66 11,485,364	－ －	0.48%
29	LG CHEM LTD 韓国	株式 素材	147	67,918.19 9,983,975	76,302.00 11,216,394	－ －	0.46%
30	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	15,758	675.03 10,637,240	667.42 10,517,259	－ －	0.44%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	小売	12.91
		銀行	10.54
		メディア・娯楽	8.99
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.01
		半導体・半導体製造装置	8.00
		素材	6.30
		エネルギー	4.80
		食品・飲料・タバコ	3.14
		自動車・自動車部品	3.06
		保険	3.04
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.71
		資本財	2.56
		電気通信サービス	2.53
		各種金融	2.16
		ソフトウェア・サービス	2.04
		不動産	1.93
		公益事業	1.70
		消費者サービス	1.51
		耐久消費財・アパレル	1.28
		運輸	1.25
		食品・生活必需品小売り	1.24
		ヘルスケア機器・サービス	1.10
		家庭用品・パーソナル用品	0.99
		商業・専門サービス	0.23
	小計		92.03
投資信託受益証券	外国	投資信託受益証券	3.87
	小計		3.87
投資証券	外国	投資証券	0.07
	小計		0.07
合　計（対純資産総額比）			95.96

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。
株式（外国）の業種はＧＩＣＳ分類（産業グループ）によるものです。なお、ＧＩＣＳに関する知的財産所有権はＳ＆Ｐ及びMSCI Inc.に帰属します。

（参考情報）
「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,105	572,950.62 1,779,011,693	577,000.00 1,791,585,000	－ －	7.13%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,759	546,826.10 1,508,693,212	542,000.00 1,495,378,000	－ －	5.95%
3	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,175	353,830.66 1,477,243,029	327,500.00 1,367,312,500	－ －	5.44%
4	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	7,933	159,900.08 1,268,487,339	157,900.00 1,252,620,700	－ －	4.99%
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	8,922	134,596.80 1,200,872,691	136,000.00 1,213,392,000	－ －	4.83%
6	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,936	244,597.84 962,737,099	251,300.00 989,116,800	－ －	3.94%
7	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,183	164,493.97 852,572,277	166,500.00 862,969,500	－ －	3.43%

8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,497	156,589.86 860,774,509	156,000.00 857,532,000	— —	3.41%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,621	306,448.72 803,202,100	301,500.00 790,231,500	— —	3.15%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	5,900	127,514.99 752,338,467	118,000.00 696,200,000	— —	2.77%
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,900	181,043.54 706,069,817	176,000.00 686,400,000	— —	2.73%
12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,115	74,790.70 606,926,569	74,600.00 605,379,000	— —	2.41%
13	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	853	637,213.12 543,542,793	662,000.00 564,686,000	— —	2.25%
14	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,382	412,235.75 569,709,809	390,000.00 538,980,000	— —	2.15%
15	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,803	298,854.70 538,835,032	295,000.00 531,885,000	— —	2.12%
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	917	596,813.25 547,277,754	577,000.00 529,109,000	— —	2.11%
17	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,718	299,333.10 514,254,280	306,500.00 526,567,000	— —	2.10%
18	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,074	160,560.92 493,564,271	156,200.00 480,158,800	— —	1.91%
19	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	963	497,962.38 479,537,778	496,000.00 477,648,000	— —	1.90%
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	8,888	55,364.12 492,076,353	51,400.00 456,843,200	— —	1.82%
21	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,241	135,117.11 437,914,556	137,900.00 446,933,900	— —	1.78%
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,536	36,461.60 420,621,070	30,950.00 357,039,200	— —	1.42%
23	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	588	650,762.55 382,648,384	599,000.00 352,212,000	— —	1.40%
24	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,204	297,543.47 358,242,340	289,300.00 348,317,200	— —	1.39%
25	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	916	377,489.69 345,780,558	375,000.00 343,500,000	— —	1.37%
26	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,798	122,784.80 343,551,878	122,100.00 341,635,800	— —	1.36%
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	1,800	171,565.99 308,818,799	178,100.00 320,580,000	— —	1.28%
28	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,560	124,578.23 318,920,271	124,200.00 317,952,000	— —	1.27%
29	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,221	143,466.72 318,639,590	141,800.00 314,937,800	— —	1.25%

30	日本リート投資法人 日本	投資証券	896	349,455.82 313,112,422	350,500.00 314,048,000	— —	1.25%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	国内	投資証券	98.66
	小計		98.66
合　計（対純資産総額比）			98.66

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

（参考情報）
「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」

（2020年11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	14,379	10,387.96 149,368,492	10,451.33 150,279,731	— —	5.99%
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	1,725	75,900.99 130,929,216	72,777.02 125,540,364	— —	5.01%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	5,249	14,856.26 77,980,561	14,204.87 74,561,413	— —	2.97%
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	2,908	23,768.99 69,120,231	22,858.91 66,473,729	— —	2.65%
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	8,162	6,773.62 55,286,351	6,705.06 54,726,704	— —	2.18%
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	6,016	8,376.65 50,393,930	8,887.78 53,468,941	— —	2.13%
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	2,707	17,692.46 47,893,508	17,440.01 47,210,118	— —	1.88%
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	32,899	1,436.67 47,265,295	1,431.29 47,088,177	— —	1.88%
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	6,763	6,348.71 42,936,379	6,403.77 43,308,761	— —	1.73%
10	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	6,607	6,218.85 41,087,977	6,150.28 40,634,952	— —	1.62%
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	2,271	17,010.94 38,631,864	16,844.72 38,254,369	— —	1.53%
12	VENTAS INC アメリカ	投資証券	7,307	5,051.13 36,908,620	4,976.33 36,362,050	— —	1.45%
13	LINK REIT 香港	投資証券	39,300	928.62 36,494,766	917.90 36,073,470	— —	1.44%
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,262	26,403.64 33,321,398	25,973.53 32,778,606	— —	1.31%
15	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	10,382	3,179.03 33,004,730	3,104.23 32,228,149	— —	1.29%
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	10,722	2,917.23 31,278,552	2,987.87 32,036,010	— —	1.28%
17	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,829	10,120.96 28,632,206	10,641.45 30,104,669	— —	1.20%
18	SEGRO PLC イギリス	投資証券	23,329	1,258.86 29,368,068	1,248.88 29,135,346	— —	1.16%
19	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	10,796	2,687.63 29,015,699	2,667.89 28,802,596	— —	1.15%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	2,511	11,700.09 29,378,930	11,427.89 28,695,456	— —	1.14%

21	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	2,194	13,104.68 28,751,678	12,882.35 28,263,897	－ －	1.13%
22	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証券	6,975	4,019.50 28,036,041	3,988.33 27,818,651	－ －	1.11%
23	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	1,849	14,534.21 26,873,756	14,400.19 26,625,956	－ －	1.06%
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	3,303	7,275.41 24,030,701	7,260.87 23,982,660	－ －	0.96%
25	UDR INC アメリカ	投資証券	5,741	4,030.93 23,141,580	4,074.56 23,392,082	－ －	0.93%
26	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	103,920	213.80 22,219,114	221.50 23,018,363	－ －	0.92%
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC アメリカ	投資証券	10,745	1,997.80 21,466,411	2,033.12 21,845,952	－ －	0.87%
28	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD フランス	投資証券	2,769	7,015.03 19,424,623	7,855.84 21,752,823	－ －	0.87%
29	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	13,919	1,501.21 20,895,348	1,518.87 21,141,176	－ －	0.84%
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	3,132	6,308.20 19,757,284	6,099.38 19,103,264	－ －	0.76%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	外国	投資証券	98.25
	小計		98.25
合　計（対純資産総額比）			98.25

（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11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	第１３３回　住宅金融支援機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	102.65 1,026,585,000	101.94 1,019,400,000	0.828000 2023/5/19	1.28%
2	第３５９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	690,000,000	100.77 695,379,590	100.85 695,920,200	0.100000 2030/6/20	0.87%
3	第３２５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	631,000,000	101.97 643,476,450	101.68 641,600,800	0.800000 2022/9/20	0.80%
4	第３３４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	618,000,000	103.27 638,222,730	102.60 634,092,720	0.600000 2024/6/20	0.80%
5	第３５５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	624,000,000	101.66 634,369,030	101.20 631,494,240	0.100000 2029/6/20	0.79%
6	第３５６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	618,000,000	101.38 626,564,890	101.14 625,088,460	0.100000 2029/9/20	0.78%
7	第３５０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	605,000,000	102.95 622,847,500	101.39 613,439,750	0.100000 2028/3/20	0.77%

8	第１３３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	587,000,000	100.55 590,286,710	100.43 589,541,710	0.100000 2022/9/20	0.74%
9	第３５２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	576,000,000	102.36 589,633,780	101.33 583,678,080	0.100000 2028/9/20	0.73%
10	第３４０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	566,000,000	103.73 587,117,460	102.46 579,934,920	0.400000 2025/9/20	0.73%
11	第３４１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	552,000,000	103.37 570,635,520	102.05 563,349,120	0.300000 2025/12/20	0.71%
12	第３５３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	543,000,000	102.16 554,782,920	101.29 550,026,420	0.100000 2028/12/20	0.69%
13	第３３９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	536,000,000	103.50 554,776,080	102.37 548,751,440	0.400000 2025/6/20	0.69%
14	第３５１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	540,000,000	102.62 554,163,640	101.36 547,381,800	0.100000 2028/6/20	0.69%
15	第３４４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	533,000,000	102.66 547,177,800	101.16 539,220,110	0.100000 2026/9/20	0.68%
16	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	532,000,000	102.76 546,683,200	101.21 538,474,440	0.100000 2026/12/20	0.68%
17	第３４６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	523,000,000	102.94 538,376,200	101.26 529,626,410	0.100000 2027/3/20	0.66%
18	第３５７回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	520,000,000	100.91 524,734,400	101.04 525,418,400	0.100000 2029/12/20	0.66%
19	第３５８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	518,000,000	100.75 521,890,620	100.97 523,055,680	0.100000 2030/3/20	0.66%
20	第３５４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	512,000,000	101.95 521,992,300	101.24 518,394,880	0.100000 2029/3/20	0.65%
21	第３４２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	510,000,000	102.36 522,036,000	101.06 515,431,500	0.100000 2026/3/20	0.65%
22	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	102.24 511,203,500	0.660000 2024/5/31	0.64%
23	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	101.42 507,133,500	0.605000 2023/5/31	0.64%
24	第３４８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	499,000,000	102.94 513,674,800	101.36 505,831,310	0.100000 2027/9/20	0.63%
25	第３３８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	491,000,000	103.30 507,237,370	102.29 502,248,810	0.400000 2025/3/20	0.63%
26	第１１３回　利付国債（２０年） 日本	国債証券	415,000,000	120.58 500,431,450	118.79 493,015,850	2.100000 2029/9/20	0.62%
27	第３４９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	481,000,000	103.06 495,718,600	101.38 487,657,040	0.100000 2027/12/20	0.61%

28	第１３１回　利付国債（５年） 日本	国債証券	477,000,000	100.62 479,970,440	100.28 478,364,220	0.100000 2022/3/20	0.60%
29	第１４１回　利付国債（５年） 日本	国債証券	470,000,000	101.41 476,659,900	100.91 474,309,900	0.100000 2024/9/20	0.59%
30	第３４３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	461,000,000	102.49 472,478,900	101.11 466,144,760	0.100000 2026/6/20	0.58%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	74.45
		地方債証券	8.69
		特殊債券	9.98
		社債券	5.13
	小計		98.26
	外国	社債券	0.89
	小計		0.89
合　計（対純資産総額比）			99.14

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

（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11月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	258,686,100	107.66 278,511,802	107.74 278,713,577	2.000000 2025/8/15	0.85%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	237,908,100	107.78 256,429,245	107.83 256,548,199	2.375000 2024/8/15	0.78%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	247,258,200	102.52 253,496,524	102.53 253,536,085	1.625000 2022/8/15	0.77%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	233,752,500	107.70 251,758,455	107.78 251,959,482	2.250000 2024/11/15	0.76%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	229,596,900	107.03 245,739,858	107.09 245,891,391	2.000000 2025/2/15	0.75%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	237,908,100	102.35 243,510,835	102.33 243,472,770	1.750000 2022/5/15	0.74%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	225,441,300	107.74 242,903,983	107.79 243,025,721	2.500000 2024/5/15	0.74%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	225,441,300	106.24 239,531,381	106.26 239,574,215	2.500000 2023/8/15	0.73%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	221,285,700	107.88 238,736,290	107.96 238,917,744	2.125000 2025/5/15	0.73%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	224,402,400	103.83 233,001,499	103.90 233,167,557	1.750000 2023/5/15	0.71%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	225,441,300	102.30 230,644,485	102.29 230,617,432	2.000000 2022/2/15	0.70%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	214,013,400	107.51 230,088,266	107.59 230,263,437	2.750000 2023/11/15	0.70%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	202,585,500	110.97 224,821,284	111.05 224,979,301	2.250000 2027/8/15	0.68%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	200,507,700	108.09 216,734,788	108.14 216,845,067	2.750000 2024/2/15	0.66%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	210,896,700	102.58 216,342,052	102.57 216,333,616	1.625000 2022/8/31	0.66%

16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	206,741,100	101.85 210,584,417	101.79 210,462,439	2.000000 2021/11/15	0.64%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	203,624,400	102.47 208,674,285	102.47 208,666,140	1.750000 2022/6/15	0.63%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	201,546,600	102.92 207,449,899	102.92 207,449,899	1.750000 2022/9/30	0.63%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	200,507,700	103.14 206,811,662	103.12 206,779,580	2.125000 2022/6/30	0.63%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	189,079,800	104.01 196,678,917	104.04 196,737,531	2.000000 2023/2/15	0.60%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	183,885,300	102.66 188,784,004	102.60 188,682,867	2.625000 2021/12/15	0.57%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	182,846,400	102.85 188,067,350	102.87 188,103,234	1.625000 2022/11/15	0.57%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	178,690,800	102.93 183,931,801	102.89 183,869,259	2.375000 2022/3/15	0.56%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	177,651,900	102.21 181,592,219	102.17 181,508,722	2.125000 2021/12/31	0.55%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	158,951,700	112.62 179,019,352	112.67 179,098,827	3.000000 2025/9/30	0.54%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	163,107,300	109.14 178,021,831	109.22 178,155,579	2.250000 2025/11/15	0.54%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	159,990,600	110.94 177,495,171	110.98 177,563,967	2.750000 2025/6/30	0.54%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	173,496,300	102.17 177,269,844	102.17 177,262,904	1.750000 2022/3/31	0.54%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	155,835,000	111.55 173,846,409	111.64 173,986,660	2.375000 2027/5/15	0.53%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	164,146,200	103.32 169,602,419	103.37 169,679,568	1.375000 2023/9/30	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	99.06
	小計		99.06
合　計（対純資産総額比）			99.06

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

②【投資不動産物件】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

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）

「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券パッシブ　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【その他投資資産の主要なもの】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

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11月30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０２１２月	買建	293	4,762,281,150	5,143,615,000	3.31%

（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）
「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30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 500 EMINI FUTURE 202012	買建	250	4,649,077,500	4,722,449,812	1.54%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 202012	買建	271	1,162,553,740	1,190,530,533	0.39%
	ICE－EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 202012	買建	53	464,380,806	467,134,487	0.15%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率であります。
（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

（参考情報）
「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」

（2020年11月30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	NYSE LIFFE US	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202012	買建	14	87,617,137	89,812,905	3.72%

（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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」
該当事項はありません。

（参考情報）
「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」
該当事項はありません。

（参考情報）
「ニッセイ国内債券パッシブ　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】

①【純資産の推移】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	1口当たりの純資産額（分配落）(円)	1口当たりの純資産額（分配付）(円)
第1計算期間末(2018年11月20日)	10,387,974	10,387,974	0.9908	0.9908
第2計算期間末(2019年11月20日)	18,417,924	18,417,924	1.0701	1.0701
第3計算期間末(2020年11月20日)	31,744,500	31,744,500	1.0747	1.0747
2019年11月末日	18,582,362	－	1.0760	－
12月末日	19,618,003	－	1.0840	－
2020年1月末日	20,841,385	－	1.0852	－
2月末日	20,250,123	－	1.0507	－
3月末日	18,676,065	－	0.9602	－
4月末日	20,602,715	－	0.9843	－
5月末日	22,350,555	－	1.0070	－
6月末日	23,668,887	－	1.0202	－
7月末日	25,161,357	－	1.0310	－
8月末日	27,202,777	－	1.0589	－
9月末日	28,598,202	－	1.0478	－
10月末日	29,636,125	－	1.0323	－
11月末日	32,108,472	－	1.0835	－

②【分配の推移】

「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

③【収益率の推移】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

	収益率(%)
第1計算期間	△0.9
第2計算期間	8.0
第3計算期間	0.4

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

（４）【設定及び解約の実績】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1計算期間	16,395,406	5,910,777	10,484,629
第2計算期間	10,576,235	3,849,753	17,211,111
第3計算期間	18,571,996	6,244,753	29,538,354

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

＜参考情報＞

3.運用実績

2020年11月末現在

●基準価額・純資産の推移

基準価額	10,835円
純資産総額	32百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産別組入比率

・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・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。
・2016年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

3.運用実績

2020年11月末現在

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.2%
2	ソニー	2.5%
3	ソフトバンクグループ	2.3%
4	キーエンス	2.0%
5	任天堂	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.0%
2	情報・通信業	9.4%
3	化学	7.6%
4	輸送用機器	7.0%
5	サービス業	6.1%

・比率は対組入株式評価額比です。

2.ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	4.4%
2	マイクロソフト	情報技術	3.4%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	3.0%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.5%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.2%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。
・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	71.7%
2	イギリス	4.7%
3	フランス	3.8%
4	カナダ	3.4%
5	スイス	3.2%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入株式等評価額比です。

3.ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	7.1%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	6.0%
3	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	5.8%
4	サムスン電子	情報技術	4.1%
5	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	2.7%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。
・比率は対組入株式等評価額比です。「その他」にはETFを含みます。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	41.0%
2	韓国	13.0%
3	台湾	12.5%
4	インド	8.0%
5	ブラジル	5.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入株式等評価額比です。

4.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.0%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.5%
4	GLP投資法人	5.1%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.9%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.7%
短期金融資産等	1.3%

・比率は対純資産総額比です。

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

5. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.1%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.1%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.0%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.7%
5	WELLTOWER INC	アメリカ	2.2%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	73.2%
2	オーストラリア	8.1%
3	イギリス	5.9%
4	シンガポール	3.8%
5	フランス	2.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

6. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回　住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.3%
2	第359回　利付国債(10年)	2030/06/20	0.100%	0.9%
3	第325回　利付国債(10年)	2022/09/20	0.800%	0.8%
4	第334回　利付国債(10年)	2024/06/20	0.600%	0.8%
5	第355回　利付国債(10年)	2029/06/20	0.100%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	−
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

7. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2025/08/15	2.000%	0.9%
2	アメリカ国債	米ドル	2024/08/15	2.375%	0.8%
3	アメリカ国債	米ドル	2022/08/15	1.625%	0.8%
4	アメリカ国債	米ドル	2024/11/15	2.250%	0.8%
5	アメリカ国債	米ドル	2025/02/15	2.000%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	43.0%
2	フランス	10.6%
3	イタリア	9.6%
4	ドイツ	7.7%
5	イギリス	6.7%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入債券評価額比です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

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

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

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

②　取扱コース

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

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

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

２．定期引出契約とは、分配金再投資コースにおいて、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。

３．詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

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

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

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

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

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

⑥ 支払開始日

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

⑦ その他

１．受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

２．換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記④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
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

① 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。

② 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。
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。
国内不動産投資信託証券	金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
外国不動産投資信託証券	金融商品取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
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。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。

③ 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。

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 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。

⑥ 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

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限です。

（4）【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

（5）【その他】

① 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。

ⅰ．受益権の口数が30億口を下回っている場合

ⅱ．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

ⅲ．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発します。
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「②　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「②　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。

②　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「②　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発します。
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。

③　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「①　繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「②　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

①　他の受益者の氏名または名称および住所
②　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11月21日から2020年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (2019年11月20日現在)	第3期 (2020年11月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	646	211
コール・ローン	25,985	46,327
親投資信託受益証券	18,418,107	31,744,816
未収入金	48,646	208,169
流動資産合計	18,493,384	31,999,523
資産合計	18,493,384	31,999,523
負債の部		
流動負債		
未払解約金	47,385	205,958
未払受託者報酬	1,988	3,492
未払委託者報酬	25,321	44,190
その他未払費用	766	1,383
流動負債合計	75,460	255,023
負債合計	75,460	255,023
純資産の部		
元本等		
元本	17,211,111	29,538,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,206,813	2,206,146
純資産合計	18,417,924	31,744,500
負債純資産合計	18,493,384	31,999,523

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 (自2018年11月21日 至2019年11月20日)	第3期 (自2019年11月21日 至2020年11月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	1,201,233	652,197
営業収益合計	1,201,233	652,197
営業費用		
受託者報酬	3,433	6,051
委託者報酬	43,962	76,637
その他費用	1,301	2,384
営業費用合計	48,696	85,072
営業利益又は営業損失（△）	1,152,537	567,125
経常利益又は経常損失（△）	1,152,537	567,125
当期純利益又は当期純損失（△）	1,152,537	567,125
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（△）	125,844	△161,653
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△96,655	1,206,813
剰余金増加額又は欠損金減少額	276,775	664,917
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,501	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	266,274	664,917
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	394,362
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	394,362
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,206,813	2,206,146

（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11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	17,211,111口	29,538,354口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0701円 (10,701円)	1.0747円 (10,747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11月21日 至2019年11月20日	第3期 自2019年11月21日 至2020年11月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（891,521円）、収益調整金（315,292円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,206,813円（1口当たり0.070118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（728,778円）、収益調整金（870,595円）及び分配準備積立金（659,452円）より分配対象収益は2,258,825円（1口当たり0.076471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）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自2018年11月21日 至2019年11月20日	第3期 自2019年11月21日 至2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2019年11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 2019年11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,001,631	882,816
合計	1,001,631	882,816

（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 2019年11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
期首元本額	10,484,629円	17,211,111円
期中追加設定元本額	10,576,235円	18,571,996円
期中一部解約元本額	3,849,753円	6,244,753円

（４）【附属明細表】（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 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	1,725,042	3,275,164	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	1,588,705	3,293,226	
	ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド	3,164,605	3,291,189	
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	2,029,548	3,105,411	
	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド	3,326,410	3,316,098	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	7,844,408	7,729,879	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	5,350,294	7,733,849	
親投資信託受益証券　合計		25,029,012	31,744,816	
合計		25,029,012	31,744,816	

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（ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券））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、「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　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が、それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	26,133,173	19,351,449
コール・ローン	1,051,065,921	4,241,017,814
株式	66,020,728,200	148,120,912,010
派生商品評価勘定	32,833,040	330,767,300
未収配当金	614,918,502	1,221,977,076
差入委託証拠金	44,640,000	254,340,000
流動資産合計	67,790,318,836	154,188,365,649
資産合計	67,790,318,836	154,188,365,649
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,164,100	－
前受金	29,905,000	304,250,000
未払解約金	222,978,912	478,191,630
その他未払費用	6,068	6,807
流動負債合計	260,054,080	782,448,437
負債合計	260,054,080	782,448,437
純資産の部		
元本等		
元本	37,206,074,017	80,797,703,529
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,324,190,739	72,608,213,683
純資産合計	67,530,264,756	153,405,917,212
負債純資産合計	67,790,318,836	154,188,365,649

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	37,206,074,017口	80,797,703,529口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8150円 (18,150円)	1.8986円 (18,986円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,259,262,001	18,923,389,638
合計	3,259,262,001	18,923,389,638

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

株式関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	1,547,375,000	－	1,573,095,000	25,720,000	5,098,120,000	－	5,429,060,000	330,940,000
合計	1,547,375,000	－	1,573,095,000	25,720,000	5,098,120,000	－	5,429,060,000	330,940,000

（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。

（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11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	33,015,590,469円	37,206,074,017円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	14,648,507,258円	60,753,324,319円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,458,023,710円	17,161,694,807円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	6,469,503,110円	5,997,522,254円
ニッセイ国内株式インデックスＳＡ（適格機関投資家限定）	4,561,011,771円	4,004,514,028円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	4,059,132円	3,951,454円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,460,555,576円	1,860,653,914円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,163,139,062円	6,246,777,830円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,451,105,833円	4,205,316,361円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	8,469,605円	6,322,700円
ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	37,232,083円	27,161,997円
ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	44,296,788円	29,811,890円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	313,570,047円	427,035,413円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド	14,584,098,618円	17,240,662,075円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	626,761,958円	1,074,533,103円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	83,670,627円	144,747,105円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	75,262,010円	145,261,593円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	55,166,663円	145,236,565円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	111,903,417円	322,269,421円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	34,041,324円	79,701,863円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	41,445,869円	57,705,245円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	25,474,150円	6,311,072円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	3,591,265円	6,106,383円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	1,026,689円	1,725,042円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）	2,865,527円	4,955,125円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	16,706,927円	19,701,162円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	5,863,187円	38,732,745円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	5,563,574円	30,720,016円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	9,335,459円	104,343,668円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	10,353,746円	157,314,590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	38,402,506,248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	5,934,694円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型）	－円	56,157円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型）	－円	111,816円
計	37,206,074,017円	80,797,703,529円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
極洋	3,000	2,832.00	8,496,000	
日本水産	83,200	428.00	35,609,600	
マルハニチロ	12,100	2,297.00	27,793,700	
雪国まいたけ	5,100	1,712.00	8,731,200	
カネコ種苗	2,500	1,547.00	3,867,500	
サカタのタネ	10,000	3,505.00	35,050,000	
ホクト	6,400	2,134.00	13,657,600	
ヒノキヤグループ	2,100	2,164.00	4,544,400	
ショーボンドホールディングス	13,000	5,400.00	70,200,000	
ミライト・ホールディングス	24,700	1,636.00	40,409,200	
タマホーム	4,500	1,435.00	6,457,500	
ファーストコーポレーション	5,100	748.00	3,814,800	
スペースバリューホールディングス	10,100	616.00	6,221,600	
住石ホールディングス	29,400	121.00	3,557,400	
日鉄鉱業	1,900	5,090.00	9,671,000	
三井松島ホールディングス	1,000	750.00	750,000	
国際石油開発帝石	305,900	576.00	176,198,400	
石油資源開発	10,900	1,840.00	20,056,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,000	1,466.00	5,864,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	700.00	3,710,000	
安藤・間	49,500	724.00	35,838,000	
東急建設	24,400	504.00	12,297,600	
コムシスホールディングス	29,500	3,155.00	93,072,500	
ビーアールホールディングス	9,100	639.00	5,814,900	
高松コンストラクショングループ	5,200	2,101.00	10,925,200	
東建コーポレーション	2,600	8,100.00	21,060,000	
ソネック	4,400	856.00	3,766,400	
ヤマウラ	4,100	902.00	3,698,200	
大成建設	64,100	3,550.00	227,555,000	
大林組	192,100	956.00	183,647,600	
清水建設	195,000	798.00	155,610,000	
飛島建設	5,500	1,078.00	5,929,000	
長谷工コーポレーション	74,400	1,171.00	87,122,400	
松井建設	7,600	761.00	5,783,600	
錢高組	800	4,705.00	3,764,000	
鹿島建設	150,800	1,351.00	203,730,800	
不動テトラ	5,000	1,668.00	8,340,000	
大末建設	4,500	882.00	3,969,000	
鉄建建設	4,200	1,904.00	7,996,800	
西松建設	14,800	1,984.00	29,363,200	
三井住友建設	46,400	433.00	20,091,200	
大豊建設	4,300	3,445.00	14,813,500	
前田建設工業	48,100	846.00	40,692,600	
佐田建設	8,300	456.00	3,784,800	
ナカノフドー建設	8,800	416.00	3,660,800	
奥村組	9,100	2,533.00	23,050,300	
東鉄工業	8,200	2,854.00	23,402,800	
淺沼組	2,200	4,025.00	8,855,000	
戸田建設	79,800	631.00	50,353,800	
熊谷組	8,900	2,473.00	22,009,700	
北野建設	1,400	2,671.00	3,739,400	
植木組	1,300	2,810.00	3,653,000	
矢作建設工業	8,500	872.00	7,412,000	
ピーエス三菱	6,400	574.00	3,673,600	
日本ハウスホールディングス	14,600	237.00	3,460,200	
大東建託	21,000	10,130.00	212,730,000	

新日本建設	8,100	885.00	7,168,500	
ＮＩＰＰＯ	15,900	2,739.00	43,550,100	
東亜道路工業	1,200	3,625.00	4,350,000	
前田道路	17,000	1,770.00	30,090,000	
日本道路	1,900	8,000.00	15,200,000	
東亜建設工業	6,000	1,998.00	11,988,000	
日本国土開発	18,700	568.00	10,621,600	
若築建設	3,500	1,170.00	4,095,000	
東洋建設	21,500	395.00	8,492,500	
五洋建設	76,200	782.00	59,588,400	
世紀東急工業	9,200	812.00	7,470,400	
福田組	2,200	5,330.00	11,726,000	
住友林業	48,700	1,851.00	90,143,700	
日本基礎技術	8,600	487.00	4,188,200	
巴コーポレーション	10,300	386.00	3,975,800	
大和ハウス工業	190,100	3,340.00	634,934,000	
ライト工業	11,000	1,675.00	18,425,000	
積水ハウス	208,300	1,903.00	396,394,900	
日特建設	5,000	810.00	4,050,000	
北陸電気工事	3,300	1,148.00	3,788,400	
ユアテック	11,000	683.00	7,513,000	
日本リーテック	4,000	2,411.00	9,644,000	
四電工	1,600	2,370.00	3,792,000	
中電工	7,700	2,172.00	16,724,400	
関電工	27,300	811.00	22,140,300	
きんでん	45,600	1,733.00	79,024,800	
東京エネシス	6,400	809.00	5,177,600	
トーエネック	1,900	3,595.00	6,830,500	
住友電設	5,400	2,784.00	15,033,600	
日本電設工業	10,500	2,185.00	22,942,500	
協和エクシオ	29,100	2,750.00	80,025,000	
新日本空調	5,100	2,171.00	11,072,100	
日本工営	3,900	2,792.00	10,888,800	
九電工	13,500	3,035.00	40,972,500	
三機工業	13,600	1,144.00	15,558,400	
日揮ホールディングス	59,100	945.00	55,849,500	
中外炉工業	2,600	1,640.00	4,264,000	
ヤマト	6,100	741.00	4,520,100	
太平電業	4,600	2,493.00	11,467,800	
高砂熱学工業	14,700	1,481.00	21,770,700	
三晃金属工業	800	2,673.00	2,138,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	17,000	1,868.00	31,756,000	
朝日工業社	1,300	3,025.00	3,932,500	
明星工業	12,400	830.00	10,292,000	
大氣社	9,300	2,845.00	26,458,500	
ダイダン	4,600	2,714.00	12,484,400	
日比谷総合設備	6,200	1,846.00	11,445,200	
日本製粉	18,000	1,682.00	30,276,000	
日清製粉グループ本社	69,500	1,730.00	120,235,000	
昭和産業	5,600	3,285.00	18,396,000	
鳥越製粉	5,400	1,081.00	5,837,400	
中部飼料	7,500	1,445.00	10,837,500	
フィード・ワン	8,300	889.00	7,378,700	
日本甜菜製糖	3,200	1,663.00	5,321,600	
三井製糖	5,400	1,837.00	9,919,800	
塩水港精糖	16,800	225.00	3,780,000	
日新製糖	2,900	1,858.00	5,388,200	
ＬＩＦＵＬＬ	20,400	383.00	7,813,200	
ミクシィ	11,200	2,802.00	31,382,400	
ジェイエイシーリクルートメント	3,900	1,722.00	6,715,800	

日本M&Aセンター	44,800	6,620.00	296,576,000	
メンバーズ	2,100	2,184.00	4,586,400	
ＵＴグループ	9,200	3,115.00	28,658,000	
アイティメディア	2,300	2,335.00	5,370,500	
タケエイ	6,400	1,240.00	7,936,000	
ビーネックスグループ	7,300	1,125.00	8,212,500	
コシダカホールディングス	14,100	401.00	5,654,100	
アルトナー	4,300	896.00	3,852,800	
パソナグループ	6,300	1,808.00	11,390,400	
ＣＤＳ	2,800	1,282.00	3,589,600	
リンクアンドモチベーション	10,800	600.00	6,480,000	
ＧＣＡ	7,600	733.00	5,570,800	
エス・エム・エス	18,200	3,425.00	62,335,000	
サニーサイドアップグループ	5,700	657.00	3,744,900	
パーソルホールディングス	58,500	1,862.00	108,927,000	
リニカル	4,900	745.00	3,650,500	
クックパッド	18,400	312.00	5,740,800	
アイ・ケイ・ケイ	5,800	669.00	3,880,200	
森永製菓	14,400	3,905.00	56,232,000	
中村屋	1,600	4,180.00	6,688,000	
江崎グリコ	16,900	4,435.00	74,951,500	
名糖産業	3,000	1,474.00	4,422,000	
井村屋グループ	3,500	2,523.00	8,830,500	
不二家	3,900	2,427.00	9,465,300	
山崎製パン	46,100	1,833.00	84,501,300	
モロゾフ	1,000	6,140.00	6,140,000	
亀田製菓	3,500	5,010.00	17,535,000	
寿スピリッツ	5,900	5,620.00	33,158,000	
カルビー	28,000	2,998.00	83,944,000	
森永乳業	11,400	5,180.00	59,052,000	
六甲バター	4,100	1,872.00	7,675,200	
ヤクルト本社	42,300	5,080.00	214,884,000	
明治ホールディングス	40,700	7,610.00	309,727,000	
雪印メグミルク	14,800	2,442.00	36,141,600	
プリマハム	9,600	2,898.00	27,820,800	
日本ハム	23,500	4,440.00	104,340,000	
林兼産業	6,500	602.00	3,913,000	
丸大食品	6,600	1,732.00	11,431,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	4,900	3,250.00	15,925,000	
柿安本店	2,100	2,509.00	5,268,900	
伊藤ハム米久ホールディングス	39,600	696.00	27,561,600	
学情	3,500	1,020.00	3,570,000	
スタジオアリス	2,900	2,046.00	5,933,400	
クロスキャット	2,600	1,310.00	3,406,000	
シミックホールディングス	2,900	1,320.00	3,828,000	
システナ	21,400	1,940.00	41,516,000	
ＮＪＳ	2,000	1,931.00	3,862,000	
デジタルアーツ	3,000	8,910.00	26,730,000	
日鉄ソリューションズ	9,000	3,005.00	27,045,000	
綜合警備保障	23,300	5,500.00	128,150,000	
キューブシステム	3,200	1,399.00	4,476,800	
いちご	76,900	330.00	25,377,000	
日本駐車場開発	59,600	126.00	7,509,600	
コア	2,700	1,390.00	3,753,000	
カカクコム	43,200	2,850.00	123,120,000	
アイロムグループ	2,100	1,849.00	3,882,900	
セントケア・ホールディング	5,500	903.00	4,966,500	
ルネサンス	4,500	863.00	3,883,500	
ディップ	8,000	2,420.00	19,360,000	
ＳＢＳホールディングス	4,500	2,442.00	10,989,000	

デジタルホールディングス	4,100	1,702.00	6,978,200	
新日本科学	6,300	687.00	4,328,100	
ツクイホールディングス	13,800	605.00	8,349,000	
ベネフィット・ワン	21,300	3,145.00	66,988,500	
エムスリー	129,100	8,242.00	1,064,042,200	
ツカダ・グローバルホールディング	14,800	267.00	3,951,600	
アウトソーシング	33,500	1,387.00	46,464,500	
ウェルネット	6,700	518.00	3,470,600	
ワールドホールディングス	2,000	1,950.00	3,900,000	
ディー・エヌ・エー	24,800	1,831.00	45,408,800	
博報堂ＤＹホールディングス	81,400	1,472.00	119,820,800	
ぐるなび	10,200	519.00	5,293,800	
タカミヤ	6,800	535.00	3,638,000	
ジャパンベストレスキューシステム	4,600	867.00	3,988,200	
ファンコミュニケーションズ	16,100	445.00	7,164,500	
ライク	1,900	2,126.00	4,039,400	
ビジネス・ブレークスルー	9,600	412.00	3,955,200	
エスプール	15,000	704.00	10,560,000	
ＷＤＢホールディングス	2,700	3,035.00	8,194,500	
バリューコマース	3,900	3,230.00	12,597,000	
インフォマート	59,200	1,064.00	62,988,800	
サッポロホールディングス	21,000	2,026.00	42,546,000	
アサヒグループホールディングス	134,300	4,012.00	538,811,600	
キリンホールディングス	260,700	2,232.00	581,882,400	
宝ホールディングス	45,600	1,201.00	54,765,600	
オエノンホールディングス	17,500	434.00	7,595,000	
養命酒製造	2,100	1,872.00	3,931,200	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	47,100	1,756.00	82,707,600	
サントリー食品インターナショナル	41,100	3,945.00	162,139,500	
ダイドーグループホールディングス	3,200	5,890.00	18,848,000	
伊藤園	18,700	7,990.00	149,413,000	
キーコーヒー	6,000	2,215.00	13,290,000	
ジャパンフーズ	2,900	1,242.00	3,601,800	
日清オイリオグループ	7,900	3,015.00	23,818,500	
不二製油グループ本社	15,000	3,015.00	45,225,000	
かどや製油	1,000	3,855.00	3,855,000	
Ｊ－オイルミルズ	3,200	3,705.00	11,856,000	
ローソン	15,300	4,880.00	74,664,000	
サンエー	5,000	4,215.00	21,075,000	
カワチ薬品	4,700	3,200.00	15,040,000	
エービーシー・マート	9,400	5,890.00	55,366,000	
ハードオフコーポレーション	5,600	665.00	3,724,000	
高千穂交易	3,900	1,049.00	4,091,100	
アスクル	6,300	3,960.00	24,948,000	
ゲオホールディングス	10,900	1,336.00	14,562,400	
アダストリア	8,400	1,796.00	15,086,400	
ジーフット	8,100	444.00	3,596,400	
伊藤忠食品	1,500	5,470.00	8,205,000	
くら寿司	3,500	5,670.00	19,845,000	
キャンドゥ	2,900	1,976.00	5,730,400	
エレマテック	5,600	938.00	5,252,800	
パルグループホールディングス	6,200	1,150.00	7,130,000	
エディオン	27,700	1,005.00	27,838,500	
あらた	4,800	4,825.00	23,160,000	
サーラコーポレーション	12,200	594.00	7,246,800	
トーメンデバイス	900	3,445.00	3,100,500	
ハローズ	2,300	3,535.00	8,130,500	
ＪＰホールディングス	18,400	283.00	5,207,200	
フジオフードグループ本社	5,100	1,424.00	7,262,400	

あみやき亭	1,300	2,927.00	3,805,100	
東京エレクトロン　デバイス	2,200	3,010.00	6,622,000	
双日	333,200	233.00	77,635,600	
アルフレッサ　ホールディングス	67,000	2,122.00	142,174,000	
大黒天物産	1,400	5,770.00	8,078,000	
ハニーズホールディングス	5,300	987.00	5,231,100	
キッコーマン	44,200	6,570.00	290,394,000	
味の素	135,800	2,285.50	310,370,900	
キユーピー	34,200	2,343.00	80,130,600	
ハウス食品グループ本社	23,000	3,800.00	87,400,000	
カゴメ	25,100	4,025.00	101,027,500	
アリアケジャパン	5,600	7,130.00	39,928,000	
ピエトロ	2,200	1,716.00	3,775,200	
エバラ食品工業	1,500	2,361.00	3,541,500	
ニチレイ	29,300	2,996.00	87,782,800	
横浜冷凍	15,800	892.00	14,093,600	
東洋水産	31,600	5,420.00	171,272,000	
イートアンドホールディングス	2,100	1,884.00	3,956,400	
大冷	1,700	2,066.00	3,512,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,200	849.00	3,565,800	
日清食品ホールディングス	26,100	8,750.00	228,375,000	
永谷園ホールディングス	3,000	2,383.00	7,149,000	
一正蒲鉾	700	1,144.00	800,800	
フジッコ	6,700	2,044.00	13,694,800	
ロック・フィールド	6,600	1,544.00	10,190,400	
日本たばこ産業	329,700	2,153.50	710,008,950	
ケンコーマヨネーズ	3,400	1,692.00	5,752,800	
わらべや日洋ホールディングス	4,000	1,469.00	5,876,000	
なとり	3,400	2,056.00	6,990,400	
ピックルスコーポレーション	1,300	3,005.00	3,906,500	
北の達人コーポレーション	21,500	531.00	11,416,500	
ユーグレナ	26,600	815.00	21,679,000	
スター・マイカ・ホールディングス	3,100	1,495.00	4,634,500	
ＡＤワークスグループ	23,900	154.00	3,680,600	
片倉工業	8,000	1,307.00	10,456,000	
グンゼ	4,400	3,680.00	16,192,000	
ヒューリック	128,200	1,059.00	135,763,800	
ラサ商事	4,100	896.00	3,673,600	
アルペン	4,600	2,378.00	10,938,800	
ラクーンホールディングス	2,900	2,092.00	6,066,800	
クオールホールディングス	8,900	1,129.00	10,048,100	
アルコニックス	6,400	1,372.00	8,780,800	
神戸物産	41,600	3,240.00	134,784,000	
ソリトンシステムズ	3,000	2,053.00	6,159,000	
ジンズホールディングス	3,200	7,170.00	22,944,000	
ビックカメラ	35,800	1,149.00	41,134,200	
ＤＣＭホールディングス	36,900	1,216.00	44,870,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	42,900	5,560.00	238,524,000	
東京一番フーズ	6,500	569.00	3,698,500	
あい　ホールディングス	8,600	1,942.00	16,701,200	
ディーブイエックス	3,600	1,066.00	3,837,600	
きちりホールディングス	5,800	659.00	3,822,200	
アークランドサービスホールディングス	5,000	1,993.00	9,965,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	72,000	857.00	61,704,000	
ドトール・日レスホールディングス	8,700	1,527.00	13,284,900	
マツモトキヨシホールディングス	24,900	4,790.00	119,271,000	
ブロンコビリー	3,200	2,360.00	7,552,000	
ＺＯＺＯ	41,500	2,471.00	102,546,500	

トレジャー・ファクトリー	5,400	694.00	3,747,600	
物語コーポレーション	1,600	12,340.00	19,744,000	
ココカラファイン	6,300	7,240.00	45,612,000	
三越伊勢丹ホールディングス	105,500	590.00	62,245,000	
東洋紡	23,700	1,367.00	32,397,900	
ユニチカ	17,600	391.00	6,881,600	
富士紡ホールディングス	2,900	3,485.00	10,106,500	
日清紡ホールディングス	37,400	756.00	28,274,400	
倉敷紡績	6,000	1,899.00	11,394,000	
ダイワボウホールディングス	5,100	6,060.00	30,906,000	
シキボウ	3,900	1,083.00	4,223,700	
日東紡績	9,100	4,250.00	38,675,000	
トヨタ紡織	17,800	1,433.00	25,507,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	14,400	2,046.00	29,462,400	
Ｈａｍｅｅ	2,200	1,615.00	3,553,000	
ラクト・ジャパン	2,600	2,961.00	7,698,600	
ウエルシアホールディングス	35,900	4,170.00	149,703,000	
クリエイトＳＤホールディングス	10,200	3,675.00	37,485,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,400	920.00	10,488,000	
八洲電機	4,700	931.00	4,375,700	
メディアスホールディングス	4,300	906.00	3,895,800	
レスターホールディングス	6,300	2,195.00	13,828,500	
ジューテックホールディングス	3,900	1,006.00	3,923,400	
丸善ＣＨＩホールディングス	9,900	361.00	3,573,900	
ＯＣＨＩホールディングス	2,200	1,279.00	2,813,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	31,900	1,048.00	33,431,200	
黒谷	7,300	602.00	4,394,600	
ミサワ	4,900	806.00	3,949,400	
ティーライフ	3,100	1,148.00	3,558,800	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	5,100	724.00	3,692,400	
三洋貿易	6,100	970.00	5,917,000	
チムニー	2,900	1,278.00	3,706,200	
シュッピン	4,200	777.00	3,263,400	
ビューティガレージ	200	2,950.00	590,000	
オイシックス・ラ・大地	6,000	3,185.00	19,110,000	
ウイン・パートナーズ	4,400	1,058.00	4,655,200	
ネクステージ	10,100	1,330.00	13,433,000	
ジョイフル本田	17,700	1,486.00	26,302,200	
鳥貴族	2,300	1,365.00	3,139,500	
キリン堂ホールディングス	2,400	3,520.00	8,448,000	
ホットランド	4,500	1,244.00	5,598,000	
すかいらーくホールディングス	67,600	1,577.00	106,605,200	
ＳＦＰホールディングス	3,400	1,275.00	4,335,000	
綿半ホールディングス	4,500	1,450.00	6,525,000	
日本毛織	19,700	1,041.00	20,507,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,500	1,122.00	19,635,000	
三栄建築設計	2,400	1,752.00	4,204,800	
野村不動産ホールディングス	36,700	2,008.00	73,693,600	
三重交通グループホールディングス	12,200	519.00	6,331,800	
サムティ	8,600	1,825.00	15,695,000	
ディア・ライフ	9,600	421.00	4,041,600	
コーセーアールイー	6,700	578.00	3,872,600	
日本商業開発	3,800	1,753.00	6,661,400	
プレサンスコーポレーション	9,900	1,790.00	17,721,000	
日本管理センター	3,300	1,272.00	4,197,600	
サンセイランディック	5,000	753.00	3,765,000	
エストラスト	4,700	750.00	3,525,000	

フージャースホールディングス	12,000	678.00	8,136,000	
オープンハウス	19,000	4,045.00	76,855,000	
東急不動産ホールディングス	164,300	492.00	80,835,600	
飯田グループホールディングス	50,400	2,142.00	107,956,800	
イーグランド	4,700	768.00	3,609,600	
ムゲンエステート	7,400	514.00	3,803,600	
帝国繊維	6,800	2,689.00	18,285,200	
日本コークス工業	54,500	72.00	3,924,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,300	1,045.00	4,493,500	
ＢＥＥＮＯＳ	2,800	2,471.00	6,918,800	
あさひ	4,500	1,585.00	7,132,500	
日本調剤	3,700	1,560.00	5,772,000	
コスモス薬品	5,300	17,470.00	92,591,000	
シップヘルスケアホールディングス	9,700	5,010.00	48,597,000	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	3,350.00	8,710,000	
オンリー	7,500	484.00	3,630,000	
セブン&アイ・ホールディングス	236,000	3,306.00	780,216,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,400	571.00	18,500,400	
明治電機工業	2,900	1,361.00	3,946,900	
ツルハホールディングス	13,200	15,330.00	202,356,000	
サンマルクホールディングス	4,800	1,498.00	7,190,400	
フェリシモ	2,700	1,306.00	3,526,200	
トリドールホールディングス	14,900	1,408.00	20,979,200	
帝人	48,900	1,847.00	90,318,300	
東レ	434,400	559.30	242,959,920	
クラレ	94,500	1,113.00	105,178,500	
旭化成	397,700	989.70	393,603,690	
サカイオーベックス	1,900	1,977.00	3,756,300	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10,200	459.00	4,681,800	
稲葉製作所	3,400	1,388.00	4,719,200	
宮地エンジニアリンググループ	2,200	2,099.00	4,617,800	
トーカロ	16,800	1,168.00	19,622,400	
アルファ	3,900	971.00	3,786,900	
ＳＵＭＣＯ	77,500	1,782.00	138,105,000	
川田テクノロジーズ	1,200	4,255.00	5,106,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,000	3,485.00	6,970,000	
ハウスドゥ	3,000	1,205.00	3,615,000	
ケイアイスター不動産	1,900	2,366.00	4,495,400	
グッドコムアセット	2,900	1,426.00	4,135,400	
日本フエルト	7,600	463.00	3,518,800	
イチカワ	300	1,317.00	395,100	
芦森工業	4,000	946.00	3,784,000	
アツギ	6,400	544.00	3,481,600	
ＪＭホールディングス	4,600	2,387.00	10,980,200	
コメダホールディングス	13,200	1,805.00	23,826,000	
アレンザホールディングス	3,000	1,494.00	4,482,000	
バロックジャパンリミテッド	5,600	667.00	3,735,200	
クスリのアオキホールディングス	5,400	8,910.00	48,114,000	
スシローグローバルホールディングス	33,100	3,255.00	107,740,500	
アセンテック	1,700	1,997.00	3,394,900	
セーレン	14,800	1,597.00	23,635,600	
ソトー	3,900	926.00	3,611,400	
東海染工	3,300	1,146.00	3,781,800	
小松マテーレ	9,800	932.00	9,133,600	
ワコールホールディングス	15,000	2,056.00	30,840,000	
ホギメディカル	6,800	3,215.00	21,862,000	
クラウディアホールディングス	12,500	303.00	3,787,500	
ＴＳＩホールディングス	18,200	223.00	4,058,600	

マツオカコーポレーション	1,700	2,833.00	4,816,100	
ワールド	8,500	1,298.00	11,033,000	
ＴＩＳ	60,100	2,016.00	121,161,600	
電算システム	2,300	3,270.00	7,521,000	
グリー	36,900	581.00	21,438,900	
コーエーテクモホールディングス	12,300	5,250.00	64,575,000	
三菱総合研究所	2,600	4,270.00	11,102,000	
電算	1,600	2,403.00	3,844,800	
ＡＧＳ	4,100	892.00	3,657,200	
ファインデックス	5,100	1,264.00	6,446,400	
ブレインパッド	1,600	4,000.00	6,400,000	
ＫＬａｂ	10,900	1,002.00	10,921,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,300	919.00	6,708,700	
イーブックイニシアティブジャパン	1,100	2,975.00	3,272,500	
ネクソン	151,600	2,728.00	413,564,800	
アイスタイル	16,800	461.00	7,744,800	
エムアップホールディングス	1,700	2,624.00	4,460,800	
エイチーム	4,400	924.00	4,065,600	
エニグモ	5,700	1,305.00	7,438,500	
テクノスジャパン	4,700	722.00	3,393,400	
コロプラ	19,700	923.00	18,183,100	
ブロードリーフ	29,800	627.00	18,684,600	
クロス・マーケティンググループ	11,000	364.00	4,004,000	
デジタルハーツホールディングス	3,600	1,111.00	3,999,600	
システム情報	4,500	1,110.00	4,995,000	
メディアドゥ	1,900	7,010.00	13,319,000	
じげん	14,900	323.00	4,812,700	
ブイキューブ	3,200	2,664.00	8,524,800	
サイバーリンクス	1,100	5,430.00	5,973,000	
フィックスターズ	6,400	951.00	6,086,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,800	1,320.00	3,696,000	
オプティム	3,100	3,040.00	9,424,000	
セレス	2,000	2,218.00	4,436,000	
ＳＨＩＦＴ	2,400	14,530.00	34,872,000	
特種東海製紙	3,700	5,210.00	19,277,000	
ティーガイア	5,300	1,801.00	9,545,300	
セック	1,200	2,981.00	3,577,200	
テクマトリックス	8,500	2,120.00	18,020,000	
プロシップ	2,600	1,434.00	3,728,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	14,500	2,533.00	36,728,500	
GMOペイメントゲートウェイ	12,700	13,140.00	166,878,000	
ザッパラス	8,300	478.00	3,967,400	
インターネットイニシアティブ	8,900	4,965.00	44,188,500	
さくらインターネット	6,400	723.00	4,627,200	
ヴィンクス	3,000	1,226.00	3,678,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,300	9,910.00	12,883,000	
ＳＲＡホールディングス	3,200	2,441.00	7,811,200	
朝日ネット	4,300	891.00	3,831,300	
ｅＢＡＳＥ	7,200	939.00	6,760,800	
アバント	5,700	1,047.00	5,967,900	
アドソル日進	2,100	2,760.00	5,796,000	
フリービット	4,200	904.00	3,796,800	
コムチュア	6,700	3,010.00	20,167,000	
サイバーコム	2,100	1,734.00	3,641,400	
アステリア	3,900	963.00	3,755,700	
アイル	3,300	1,359.00	4,484,700	
王子ホールディングス	250,800	496.00	124,396,800	

日本製紙	26,500	1,208.00	32,012,000	
三菱製紙	11,200	311.00	3,483,200	
北越コーポレーション	35,800	369.00	13,210,200	
中越パルプ工業	400	1,237.00	494,800	
大王製紙	28,900	1,800.00	52,020,000	
阿波製紙	8,500	454.00	3,859,000	
マークラインズ	2,500	2,352.00	5,880,000	
メディカル・データ・ビジョン	6,900	2,547.00	17,574,300	
ｇｕｍｉ	7,700	832.00	6,406,400	
モバイルファクトリー	3,600	1,014.00	3,650,400	
テラスカイ	2,200	4,480.00	9,856,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,700	1,434.00	3,871,800	
ＰＣＩホールディングス	3,300	1,255.00	4,141,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,000	3,190.00	3,190,000	
ランドコンピュータ	3,300	1,125.00	3,712,500	
ダブルスタンダード	800	4,375.00	3,500,000	
オープンドア	3,000	1,254.00	3,762,000	
アカツキ	2,100	4,920.00	10,332,000	
ＬＩＮＥ	13,900	5,380.00	74,782,000	
カナミックネットワーク	5,500	765.00	4,207,500	
レンゴー	56,700	851.00	48,251,700	
トーモク	3,700	1,674.00	6,193,800	
ザ・パック	4,500	2,990.00	13,455,000	
チェンジ	4,200	8,410.00	35,322,000	
シンクロ・フード	12,200	310.00	3,782,000	
オークネット	3,200	1,360.00	4,352,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,100	424.00	3,858,400	
マクロミル	12,300	643.00	7,908,900	
オロ	1,900	3,335.00	6,336,500	
ユーザーローカル	800	3,765.00	3,012,000	
テモナ	2,900	1,241.00	3,598,900	
昭和電工	45,600	1,928.00	87,916,800	
住友化学	440,800	385.00	169,708,000	
住友精化	2,700	3,650.00	9,855,000	
日産化学	33,100	6,300.00	208,530,000	
ラサ工業	2,100	1,960.00	4,116,000	
クレハ	5,100	4,975.00	25,372,500	
多木化学	2,300	6,750.00	15,525,000	
テイカ	4,400	1,472.00	6,476,800	
石原産業	10,800	611.00	6,598,800	
片倉コープアグリ	3,000	1,278.00	3,834,000	
日本曹達	8,900	2,773.00	24,679,700	
東ソー	92,700	1,696.00	157,219,200	
トクヤマ	17,300	2,227.00	38,527,100	
セントラル硝子	12,300	2,281.00	28,056,300	
東亞合成	37,700	1,182.00	44,561,400	
大阪ソーダ	6,100	2,523.00	15,390,300	
関東電化工業	14,200	698.00	9,911,600	
デンカ	21,900	3,215.00	70,408,500	
イビデン	37,500	4,415.00	165,562,500	
信越化学工業	103,000	15,160.00	1,561,480,000	
日本カーバイド工業	3,000	1,237.00	3,711,000	
堺化学工業	3,900	2,078.00	8,104,200	
第一稀元素化学工業	6,500	732.00	4,758,000	
エア・ウォーター	55,800	1,773.00	98,933,400	
日本酸素ホールディングス	57,700	1,778.00	102,590,600	
日本化学工業	1,900	2,332.00	4,430,800	
日本パーカライジング	30,300	1,089.00	32,996,700	
高圧ガス工業	9,500	780.00	7,410,000	

四国化成工業	8,800	1,143.00	10,058,400	
ステラ　ケミファ	3,300	3,185.00	10,510,500	
保土谷化学工業	2,200	4,515.00	9,933,000	
日本触媒	9,300	5,320.00	49,476,000	
大日精化工業	5,300	2,290.00	12,137,000	
カネカ	15,500	3,240.00	50,220,000	
協和キリン	61,600	2,748.00	169,276,800	
三菱瓦斯化学	55,800	1,937.00	108,084,600	
三井化学	55,700	2,944.00	163,980,800	
ＪＳＲ	55,900	2,832.00	158,308,800	
東京応化工業	10,300	6,220.00	64,066,000	
大阪有機化学工業	5,500	2,577.00	14,173,500	
三菱ケミカルホールディングス	401,100	584.60	234,483,060	
ＫＨネオケム	9,900	2,884.00	28,551,600	
ダイセル	74,900	791.00	59,245,900	
住友ベークライト	9,400	3,065.00	28,811,000	
積水化学工業	126,900	1,738.00	220,552,200	
日本ゼオン	54,100	1,249.00	67,570,900	
アイカ工業	18,000	3,900.00	70,200,000	
宇部興産	30,300	1,822.00	55,206,600	
積水樹脂	10,800	2,237.00	24,159,600	
タキロンシーアイ	13,000	662.00	8,606,000	
旭有機材	3,400	1,425.00	4,845,000	
ニチバン	3,200	1,736.00	5,555,200	
リケンテクノス	14,600	428.00	6,248,800	
大倉工業	2,800	1,898.00	5,314,400	
積水化成品工業	8,000	554.00	4,432,000	
群栄化学工業	1,500	2,539.00	3,808,500	
タイガースポリマー	8,500	441.00	3,748,500	
ダイキョーニシカワ	12,600	672.00	8,467,200	
森六ホールディングス	3,200	1,986.00	6,355,200	
日本化薬	37,100	941.00	34,911,100	
カーリットホールディングス	7,000	553.00	3,871,000	
ＥＰＳホールディングス	7,900	978.00	7,726,200	
プレステージ・インターナショナル	21,900	927.00	20,301,300	
プロトコーポレーション	5,400	1,076.00	5,810,400	
ハイマックス	3,100	1,168.00	3,620,800	
アミューズ	3,200	2,582.00	8,262,400	
野村総合研究所	85,200	3,395.00	289,254,000	
ドリームインキュベータ	2,500	1,514.00	3,785,000	
サイバネットシステム	4,300	885.00	3,805,500	
クイック	3,600	1,103.00	3,970,800	
ＴＡＣ	16,800	219.00	3,679,200	
ＣＥホールディングス	5,900	637.00	3,758,300	
ケネディクス	50,300	655.00	32,946,500	
電通グループ	65,800	3,345.00	220,101,000	
インテージホールディングス	7,500	1,018.00	7,635,000	
東邦システムサイエンス	4,000	932.00	3,728,000	
ぴあ	1,700	2,768.00	4,705,600	
イオンファンタジー	2,300	2,190.00	5,037,000	
ソースネクスト	28,500	322.00	9,177,000	
シーティーエス	6,600	924.00	6,098,400	
ネクシィーズグループ	3,700	907.00	3,355,900	
インフォコム	6,600	3,615.00	23,859,000	
メディカルシステムネットワーク	8,000	690.00	5,520,000	
日本精化	4,800	1,448.00	6,950,400	
扶桑化学工業	6,100	3,295.00	20,099,500	
トリケミカル研究所	1,300	13,670.00	17,771,000	
ＨＥＲＯＺ	1,200	2,984.00	3,580,800	
ラクスル	4,800	4,950.00	23,760,000	

ＦＩＧ	14,400	274.00	3,945,600	
ＡＤＥＫＡ	27,600	1,663.00	45,898,800	
日油	22,600	4,670.00	105,542,000	
ミヨシ油脂	3,300	1,232.00	4,065,600	
新日本理化	23,400	163.00	3,814,200	
ハリマ化成グループ	5,000	1,041.00	5,205,000	
イーソル	3,300	1,461.00	4,821,300	
アルテリア・ネットワークス	6,700	1,625.00	10,887,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,519.00	3,949,400	
花王	146,700	7,830.00	1,148,661,000	
第一工業製薬	2,200	4,415.00	9,713,000	
日華化学	4,000	976.00	3,904,000	
ニイタカ	1,200	3,200.00	3,840,000	
三洋化成工業	3,600	4,500.00	16,200,000	
武田薬品工業	509,700	3,649.00	1,859,895,300	
アステラス製薬	531,100	1,585.50	842,059,050	
大日本住友製薬	45,400	1,358.00	61,653,200	
塩野義製薬	77,000	5,557.00	427,889,000	
わかもと製薬	8,300	268.00	2,224,400	
あすか製薬	7,000	1,597.00	11,179,000	
日本新薬	16,000	7,620.00	121,920,000	
ビオフェルミン製薬	1,500	2,477.00	3,715,500	
中外製薬	191,600	4,431.00	848,979,600	
科研製薬	10,500	3,875.00	40,687,500	
エーザイ	73,300	7,742.00	567,488,600	
理研ビタミン	5,800	1,411.00	8,183,800	
ロート製薬	31,400	3,340.00	104,876,000	
小野薬品工業	140,700	3,171.00	446,159,700	
久光製薬	16,200	5,900.00	95,580,000	
有機合成薬品工業	12,100	307.00	3,714,700	
持田製薬	8,500	4,090.00	34,765,000	
参天製薬	114,200	1,646.00	187,973,200	
扶桑薬品工業	2,200	2,829.00	6,223,800	
ツムラ	19,000	3,280.00	62,320,000	
日医工	17,400	1,020.00	17,748,000	
テルモ	173,300	4,064.00	704,291,200	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	16,400	2,855.00	46,822,000	
キッセイ薬品工業	10,800	2,079.00	22,453,200	
生化学工業	11,900	985.00	11,721,500	
栄研化学	10,800	1,967.00	21,243,600	
日水製薬	3,500	988.00	3,458,000	
鳥居薬品	3,800	3,220.00	12,236,000	
ＪＣＲファーマ	17,300	2,736.00	47,332,800	
東和薬品	7,800	1,892.00	14,757,600	
富士製薬工業	4,200	1,204.00	5,056,800	
沢井製薬	12,600	4,700.00	59,220,000	
ゼリア新薬工業	11,100	1,868.00	20,734,800	
第一三共	525,900	3,536.00	1,859,582,400	
キョーリン製薬ホールディングス	13,500	1,868.00	25,218,000	
大幸薬品	7,500	1,731.00	12,982,500	
ダイト	3,900	3,725.00	14,527,500	
大塚ホールディングス	127,300	4,325.00	550,572,500	
大正製薬ホールディングス	13,000	6,560.00	85,280,000	
ペプチドリーム	31,100	4,800.00	149,280,000	
大日本塗料	6,800	968.00	6,582,400	
日本ペイントホールディングス	49,500	12,210.00	604,395,000	
関西ペイント	67,400	3,005.00	202,537,000	
中国塗料	17,100	959.00	16,398,900	
日本特殊塗料	4,500	1,153.00	5,188,500	

藤倉化成	8,100	535.00	4,333,500	
太陽ホールディングス	4,400	5,780.00	25,432,000	
ＤＩＣ	25,300	2,565.00	64,894,500	
サカタインクス	13,100	1,165.00	15,261,500	
東洋インキＳＣホールディングス	12,700	2,000.00	25,400,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,600	877.00	4,034,200	
アルプス技研	5,200	2,007.00	10,436,400	
日本空調サービス	6,100	760.00	4,636,000	
オリエンタルランド	62,300	17,290.00	1,077,167,000	
フォーカスシステムズ	4,000	890.00	3,560,000	
ダスキン	14,500	2,918.00	42,311,000	
パーク２４	32,400	1,562.00	50,608,800	
明光ネットワークジャパン	7,400	588.00	4,351,200	
ファルコホールディングス	3,200	1,563.00	5,001,600	
クレスコ	3,700	1,264.00	4,676,800	
フジ・メディア・ホールディングス	57,900	1,058.00	61,258,200	
秀英予備校	8,400	417.00	3,502,800	
ラウンドワン	16,300	866.00	14,115,800	
リゾートトラスト	26,800	1,675.00	44,890,000	
オービック	20,800	21,420.00	445,536,000	
ジャストシステム	9,800	6,850.00	67,130,000	
ＴＤＣソフト	5,300	1,016.00	5,384,800	
Ｚホールディングス	825,500	611.00	504,380,500	
ビー・エム・エル	7,500	3,325.00	24,937,500	
トレンドマイクロ	32,100	5,480.00	175,908,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,200	1,210.00	12,342,000	
ＩＤホールディングス	2,600	1,219.00	3,169,400	
リソー教育	26,700	319.00	8,517,300	
日本オラクル	12,200	11,500.00	140,300,000	
早稲田アカデミー	3,800	939.00	3,568,200	
アルファシステムズ	1,900	3,280.00	6,232,000	
フューチャー	7,300	1,794.00	13,096,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,900	1,417.00	5,526,300	
ＳＢテクノロジー	2,200	3,485.00	7,667,000	
トーセ	4,400	869.00	3,823,600	
ユー・エス・エス	65,500	2,200.00	144,100,000	
オービックビジネスコンサルタント	6,100	6,930.00	42,273,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	27,400	3,670.00	100,558,000	
アイティフォー	7,300	886.00	6,467,800	
東京個別指導学院	6,200	600.00	3,720,000	
東計電算	900	4,335.00	3,901,500	
サイバーエージェント	36,100	6,420.00	231,762,000	
楽天	272,800	1,128.00	307,718,400	
クリーク・アンド・リバー社	3,600	1,039.00	3,740,400	
テー・オー・ダブリュー	12,700	287.00	3,644,900	
大塚商会	32,500	4,930.00	160,225,000	
サイボウズ	7,000	2,835.00	19,845,000	
ソフトブレーン	4,700	866.00	4,070,200	
山田コンサルティンググループ	3,800	955.00	3,629,000	
セントラルスポーツ	2,200	2,194.00	4,826,800	
電通国際情報サービス	3,700	6,430.00	23,791,000	
ＡＣＣＥＳＳ	5,600	792.00	4,435,200	
デジタルガレージ	10,800	3,990.00	43,092,000	
イーエムシステムズ	8,500	824.00	7,004,000	
ウェザーニューズ	2,000	5,540.00	11,080,000	
ＣＩＪ	4,100	920.00	3,772,000	
ビジネスエンジニアリング	1,000	3,300.00	3,300,000	
日本エンタープライズ	15,500	227.00	3,518,500	
WOWOW	2,900	2,825.00	8,192,500	
スカラ	4,000	797.00	3,188,000	

フルキャストホールディングス	5,100	1,687.00	8,603,700	
エン・ジャパン	10,400	3,620.00	37,648,000	
富士フイルムホールディングス	117,500	5,679.00	667,282,500	
コニカミノルタ	133,800	306.00	40,942,800	
資生堂	121,700	7,171.00	872,710,700	
ライオン	79,600	2,530.00	201,388,000	
高砂香料工業	3,800	2,473.00	9,397,400	
マンダム	13,800	1,707.00	23,556,600	
ミルボン	8,200	6,050.00	49,610,000	
ファンケル	24,800	3,925.00	97,340,000	
コーセー	11,500	15,310.00	176,065,000	
コタ	3,500	1,352.00	4,732,000	
シーボン	1,900	1,963.00	3,729,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	26,100	2,045.00	53,374,500	
ノエビアホールディングス	5,200	4,505.00	23,426,000	
アジュバンコスメジャパン	3,700	1,016.00	3,759,200	
エステー	3,900	1,960.00	7,644,000	
アグロ　カネショウ	2,300	1,724.00	3,965,200	
コニシ	10,100	1,585.00	16,008,500	
長谷川香料	10,600	2,129.00	22,567,400	
星光ＰＭＣ	5,800	659.00	3,822,200	
小林製薬	17,200	11,640.00	200,208,000	
荒川化学工業	5,500	1,126.00	6,193,000	
メック	4,200	2,021.00	8,488,200	
日本高純度化学	1,700	2,686.00	4,566,200	
タカラバイオ	16,000	2,937.00	46,992,000	
ＪＣＵ	7,400	3,465.00	25,641,000	
新田ゼラチン	5,300	708.00	3,752,400	
ＯＡＴアグリオ	200	1,400.00	280,000	
デクセリアルズ	15,800	1,196.00	18,896,800	
アース製薬	4,500	6,200.00	27,900,000	
北興化学工業	5,700	1,062.00	6,053,400	
大成ラミック	2,000	2,873.00	5,746,000	
クミアイ化学工業	25,300	1,072.00	27,121,600	
日本農薬	10,900	534.00	5,820,600	
ニチレキ	7,200	1,682.00	12,110,400	
ユシロ化学工業	3,400	1,216.00	4,134,400	
ビーピー・カストロール	3,000	1,297.00	3,891,000	
富士石油	2,800	192.00	537,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,700	1,007.00	3,725,900	
出光興産	68,000	2,209.00	150,212,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	921,500	374.60	345,193,900	
コスモエネルギーホールディングス	17,700	1,769.00	31,311,300	
横浜ゴム	35,500	1,616.00	57,368,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	32,200	1,798.00	57,895,600	
ブリヂストン	162,900	3,745.00	610,060,500	
住友ゴム工業	55,000	1,018.00	55,990,000	
オカモト	3,700	4,255.00	15,743,500	
アキレス	4,200	1,492.00	6,266,400	
フコク	5,500	717.00	3,943,500	
ニッタ	6,900	2,300.00	15,870,000	
住友理工	11,900	533.00	6,342,700	
三ツ星ベルト	8,100	1,688.00	13,672,800	
バンドー化学	10,800	573.00	6,188,400	
ＡＧＣ	56,200	3,510.00	197,262,000	
日本板硝子	29,300	407.00	11,925,100	
有沢製作所	9,700	935.00	9,069,500	
日本山村硝子	4,400	855.00	3,762,000	
日本電気硝子	22,700	2,204.00	50,030,800	
オハラ	3,000	1,254.00	3,762,000	

住友大阪セメント	11,600	3,275.00	37,990,000	
太平洋セメント	38,700	2,927.00	113,274,900	
日本ヒューム	6,100	784.00	4,782,400	
日本コンクリート工業	13,200	312.00	4,118,400	
三谷セキサン	2,900	4,550.00	13,195,000	
アジアパイルホールディングス	8,700	456.00	3,967,200	
東海カーボン	59,900	1,185.00	70,981,500	
日本カーボン	3,400	3,775.00	12,835,000	
東洋炭素	3,600	1,766.00	6,357,600	
ノリタケカンパニーリミテド	3,400	2,973.00	10,108,200	
ＴＯＴＯ	43,800	5,790.00	253,602,000	
日本碍子	73,500	1,621.00	119,143,500	
日本特殊陶業	46,600	1,846.00	86,023,600	
ＭＡＲＵＷＡ	2,400	10,130.00	24,312,000	
品川リフラクトリーズ	1,700	2,333.00	3,966,100	
黒崎播磨	1,300	2,938.00	3,819,400	
ヨータイ	4,900	806.00	3,949,400	
イソライト工業	7,900	435.00	3,436,500	
ニッカトー	5,300	633.00	3,354,900	
フジミインコーポレーテッド	5,500	3,575.00	19,662,500	
クニミネ工業	3,500	1,067.00	3,734,500	
ニチアス	16,800	2,341.00	39,328,800	
日本製鉄	271,100	1,217.00	329,928,700	
神戸製鋼所	110,900	483.00	53,564,700	
中山製鋼所	10,400	384.00	3,993,600	
合同製鐵	3,300	1,865.00	6,154,500	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	163,600	915.00	149,694,000	
東京製鐵	29,500	686.00	20,237,000	
共英製鋼	6,800	1,370.00	9,316,000	
大和工業	12,900	2,566.00	33,101,400	
東京鐵鋼	2,500	2,083.00	5,207,500	
大阪製鐵	900	1,126.00	1,013,400	
淀川製鋼所	8,200	2,077.00	17,031,400	
丸一鋼管	19,700	2,329.00	45,881,300	
モリ工業	1,800	2,428.00	4,370,400	
大同特殊鋼	9,900	4,380.00	43,362,000	
日本高周波鋼業	10,900	339.00	3,695,100	
日本冶金工業	5,000	1,555.00	7,775,000	
山陽特殊製鋼	4,100	1,215.00	4,981,500	
愛知製鋼	3,400	2,663.00	9,054,200	
日立金属	65,300	1,535.00	100,235,500	
大平洋金属	4,100	1,787.00	7,326,700	
新日本電工	39,100	223.00	8,719,300	
栗本鐵工所	3,000	1,704.00	5,112,000	
日本製鋼所	18,400	2,538.00	46,699,200	
三菱製鋼	7,000	524.00	3,668,000	
日亜鋼業	12,300	315.00	3,874,500	
日本精線	1,100	3,180.00	3,498,000	
大紀アルミニウム工業所	9,900	650.00	6,435,000	
日本軽金属ホールディングス	15,300	1,788.00	27,356,400	
三井金属鉱業	16,300	2,890.00	47,107,000	
東邦亜鉛	3,100	1,937.00	6,004,700	
三菱マテリアル	40,000	1,977.00	79,080,000	
住友金属鉱山	77,400	3,659.00	283,206,600	
ＤＯＷＡホールディングス	15,300	3,490.00	53,397,000	
古河機械金属	10,800	1,145.00	12,366,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,300	838.00	5,279,400	
東邦チタニウム	10,800	694.00	7,495,200	
ＵＡＣＪ	9,200	1,748.00	16,081,600	

ＣＫサンエツ	1,300	3,670.00	4,771,000	
古河電気工業	18,800	2,413.00	45,364,400	
住友電気工業	226,500	1,265.00	286,522,500	
フジクラ	73,200	409.00	29,938,800	
昭和電線ホールディングス	7,000	1,497.00	10,479,000	
東京特殊電線	1,600	2,381.00	3,809,600	
タツタ電線	12,000	581.00	6,972,000	
カナレ電気	2,200	1,787.00	3,931,400	
リョービ	7,500	1,217.00	9,127,500	
アーレスティ	11,700	325.00	3,802,500	
アサヒホールディングス	10,600	3,300.00	34,980,000	
東洋製罐グループホールディングス	38,600	1,051.00	40,568,600	
ホッカンホールディングス	3,300	1,401.00	4,623,300	
コロナ	3,900	930.00	3,627,000	
横河ブリッジホールディングス	11,300	1,946.00	21,989,800	
ＯＳＪＢホールディングス	30,300	237.00	7,181,100	
三和ホールディングス	57,100	1,246.00	71,146,600	
文化シヤッター	17,900	924.00	16,539,600	
三協立山	7,800	810.00	6,318,000	
アルインコ	4,400	890.00	3,916,000	
ＬＩＸＩＬグループ	89,400	2,399.00	214,470,600	
日本フイルコン	6,900	572.00	3,946,800	
ノーリツ	12,600	1,697.00	21,382,200	
長府製作所	6,200	2,104.00	13,044,800	
リンナイ	11,800	11,850.00	139,830,000	
ユニプレス	11,900	895.00	10,650,500	
ダイニチ工業	5,100	965.00	4,921,500	
日東精工	8,100	453.00	3,669,300	
三洋工業	2,000	1,922.00	3,844,000	
岡部	12,300	827.00	10,172,100	
ジーテクト	7,500	1,414.00	10,605,000	
東プレ	11,300	1,244.00	14,057,200	
高周波熱錬	11,700	464.00	5,428,800	
東京製綱	7,600	563.00	4,278,800	
サンコール	9,000	425.00	3,825,000	
モリテックスチール	12,400	300.00	3,720,000	
パイオラックス	9,000	1,647.00	14,823,000	
エイチワン	500	666.00	333,000	
日本発条	65,000	658.00	42,770,000	
三浦工業	26,200	5,290.00	138,598,000	
タクマ	20,500	1,831.00	37,535,500	
テクノプロ・ホールディングス	11,700	7,940.00	92,898,000	
インターワークス	11,100	323.00	3,585,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,400	14,070.00	33,768,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,300	1,804.00	7,757,200	
三機サービス	3,800	972.00	3,693,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	4,800	752.00	3,609,600	
イー・ガーディアン	2,600	2,963.00	7,703,800	
リブセンス	13,500	254.00	3,429,000	
ジャパンマテリアル	18,000	1,391.00	25,038,000	
ベクトル	7,300	889.00	6,489,700	
ウチヤマホールディングス	12,100	303.00	3,666,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,000	1,174.00	5,870,000	
ＩＢＪ	4,800	819.00	3,931,200	
アサンテ	2,400	1,528.00	3,667,200	
Ｎ・フィールド	5,500	806.00	4,433,000	
バリューＨＲ	2,300	1,660.00	3,818,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	4,700	6,120.00	28,764,000	

ライドオンエクスプレスホールディングス	2,200	2,068.00	4,549,600	
ＥＲＩホールディングス	5,800	688.00	3,990,400	
アビスト	1,300	2,898.00	3,767,400	
シグマクシス	4,000	1,531.00	6,124,000	
ウィルグループ	4,600	920.00	4,232,000	
メドピア	2,800	5,500.00	15,400,000	
リクルートホールディングス	419,300	4,505.00	1,888,946,500	
エラン	4,000	3,010.00	12,040,000	
ツガミ	12,600	1,602.00	20,185,200	
オークマ	7,100	5,880.00	41,748,000	
芝浦機械	6,800	2,248.00	15,286,400	
アマダ	75,100	1,017.00	76,376,700	
アイダエンジニアリング	15,800	884.00	13,967,200	
滝澤鉄工所	3,700	993.00	3,674,100	
ＦＵＪＩ	26,000	2,400.00	62,400,000	
牧野フライス製作所	7,100	4,130.00	29,323,000	
オーエスジー	29,900	1,863.00	55,703,700	
ダイジェット工業	2,700	1,459.00	3,939,300	
旭ダイヤモンド工業	15,900	443.00	7,043,700	
ＤＭＧ森精機	38,300	1,539.00	58,943,700	
ソディック	13,200	835.00	11,022,000	
ディスコ	8,200	30,550.00	250,510,000	
日東工器	3,300	1,727.00	5,699,100	
日進工具	2,400	2,540.00	6,096,000	
日本郵政	479,800	824.00	395,355,200	
ベルシステム２４ホールディングス	9,800	1,616.00	15,836,800	
鎌倉新書	4,400	1,107.00	4,870,800	
一蔵	9,700	360.00	3,492,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,000	3,465.00	6,930,000	
エアトリ	3,100	1,296.00	4,017,600	
ハイアス・アンド・カンパニー	22,700	160.00	3,632,000	
アトラエ	1,800	2,935.00	5,283,000	
ストライク	2,200	5,880.00	12,936,000	
ソラスト	16,100	1,531.00	24,649,100	
セラク	1,800	1,984.00	3,571,200	
インソース	2,400	3,430.00	8,232,000	
豊田自動織機	49,600	7,460.00	370,016,000	
豊和工業	4,600	842.00	3,873,200	
東洋機械金属	9,100	402.00	3,658,200	
エンシュウ	4,000	903.00	3,612,000	
島精機製作所	9,500	1,751.00	16,634,500	
オプトラン	7,600	2,134.00	16,218,400	
ＮＣホールディングス	6,100	580.00	3,538,000	
イワキ	4,400	815.00	3,586,000	
フリュー	5,900	1,053.00	6,212,700	
ヤマシンフィルタ	13,200	1,055.00	13,926,000	
日阪製作所	7,500	826.00	6,195,000	
やまびこ	11,800	1,372.00	16,189,600	
平田機工	2,900	7,440.00	21,576,000	
ペガサスミシン製造	13,000	293.00	3,809,000	
タツモ	2,600	1,491.00	3,876,600	
ナブテスコ	35,700	4,030.00	143,871,000	
三井海洋開発	6,400	1,718.00	10,995,200	
レオン自動機	5,900	1,181.00	6,967,900	
ＳＭＣ	19,200	60,250.00	1,156,800,000	
ホソカワミクロン	2,100	6,410.00	13,461,000	
ユニオンツール	2,300	3,175.00	7,302,500	
オイレス工業	7,800	1,591.00	12,409,800	
日精エー・エス・ビー機械	1,800	5,310.00	9,558,000	

サトーホールディングス	8,600	2,131.00	18,326,600	
技研製作所	5,300	4,100.00	21,730,000	
カワタ	4,300	804.00	3,457,200	
日精樹脂工業	5,100	880.00	4,488,000	
オカダアイヨン	3,700	1,010.00	3,737,000	
小松製作所	277,500	2,518.50	698,883,750	
住友重機械工業	35,100	2,340.00	82,134,000	
日立建機	24,500	2,896.00	70,952,000	
日工	8,400	668.00	5,611,200	
巴工業	2,400	1,964.00	4,713,600	
井関農機	6,100	1,395.00	8,509,500	
ＴＯＷＡ	6,200	1,726.00	10,701,200	
丸山製作所	2,900	1,438.00	4,170,200	
北川鉄工所	2,800	1,330.00	3,724,000	
シンニッタン	18,600	185.00	3,441,000	
ローツェ	2,700	5,340.00	14,418,000	
タカキタ	5,600	702.00	3,931,200	
クボタ	325,000	2,167.00	704,275,000	
荏原実業	1,500	3,785.00	5,677,500	
三菱化工機	2,100	2,283.00	4,794,300	
月島機械	11,300	1,356.00	15,322,800	
帝国電機製作所	5,000	1,193.00	5,965,000	
新東工業	14,500	737.00	10,686,500	
澁谷工業	5,400	3,535.00	19,089,000	
アイチコーポレーション	10,600	919.00	9,741,400	
小森コーポレーション	15,500	722.00	11,191,000	
鶴見製作所	4,700	1,759.00	8,267,300	
荏原製作所	25,400	3,225.00	81,915,000	
石井鐵工所	1,400	2,799.00	3,918,600	
酉島製作所	6,200	819.00	5,077,800	
北越工業	6,300	1,066.00	6,715,800	
ダイキン工業	78,000	23,215.00	1,810,770,000	
オルガノ	2,200	5,560.00	12,232,000	
トーヨーカネツ	2,700	1,958.00	5,286,600	
栗田工業	33,100	3,625.00	119,987,500	
椿本チエイン	8,700	2,565.00	22,315,500	
大同工業	6,100	678.00	4,135,800	
日機装	19,800	996.00	19,720,800	
木村化工機	8,500	483.00	4,105,500	
レイズネクスト	10,300	1,143.00	11,772,900	
アネスト岩田	9,500	910.00	8,645,000	
ダイフク	31,300	11,440.00	358,072,000	
サムコ	1,500	3,270.00	4,905,000	
加藤製作所	3,600	1,035.00	3,726,000	
タダノ	29,600	835.00	24,716,000	
フジテック	22,300	2,157.00	48,101,100	
ＣＫＤ	16,800	2,176.00	36,556,800	
キトー	4,600	1,593.00	7,327,800	
平和	17,100	1,548.00	26,470,800	
理想科学工業	5,400	1,224.00	6,609,600	
ＳＡＮＫＹＯ	13,600	2,647.00	35,999,200	
日本金銭機械	7,000	575.00	4,025,000	
マースグループホールディングス	3,900	1,636.00	6,380,400	
フクシマガリレイ	3,800	4,455.00	16,929,000	
ダイコク電機	3,900	906.00	3,533,400	
竹内製作所	10,300	2,472.00	25,461,600	
アマノ	16,000	2,496.00	39,936,000	
ＪＵＫＩ	8,500	539.00	4,581,500	
蛇の目ミシン工業	6,300	765.00	4,819,500	
ブラザー工業	74,800	1,913.00	143,092,400	

マックス	9,300	1,439.00	13,382,700	
モリタホールディングス	10,700	1,807.00	19,334,900	
グローリー	15,700	2,191.00	34,398,700	
新晃工業	5,700	1,661.00	9,467,700	
大和冷機工業	9,800	1,000.00	9,800,000	
セガサミーホールディングス	60,800	1,500.00	91,200,000	
日本ピストンリング	3,800	1,015.00	3,857,000	
リケン	2,800	2,333.00	6,532,400	
ＴＰＲ	8,200	1,377.00	11,291,400	
ツバキ・ナカシマ	11,700	919.00	10,752,300	
ホシザキ	19,300	10,180.00	196,474,000	
大豊工業	6,700	611.00	4,093,700	
日本精工	115,300	887.00	102,271,100	
ＮＴＮ	141,800	226.00	32,046,800	
ジェイテクト	58,800	865.00	50,862,000	
不二越	5,700	4,470.00	25,479,000	
ミネベアミツミ	113,700	2,057.00	233,880,900	
日本トムソン	18,200	347.00	6,315,400	
ＴＨＫ	38,200	2,988.00	114,141,600	
ユーシン精機	5,300	722.00	3,826,600	
前澤給装工業	2,200	2,178.00	4,791,600	
イーグル工業	7,600	899.00	6,832,400	
日本ピラー工業	6,200	1,459.00	9,045,800	
キッツ	24,800	551.00	13,664,800	
日立製作所	294,300	3,962.00	1,166,016,600	
三菱電機	612,600	1,484.00	909,098,400	
富士電機	36,900	3,415.00	126,013,500	
東洋電機製造	3,200	1,112.00	3,558,400	
安川電機	65,900	4,725.00	311,377,500	
シンフォニア　テクノロジー	7,900	1,271.00	10,040,900	
明電舎	11,300	1,661.00	18,769,300	
オリジン	2,700	1,326.00	3,580,200	
山洋電気	3,000	4,890.00	14,670,000	
デンヨー	5,200	2,101.00	10,925,200	
ベイカレント・コンサルティング	3,500	15,190.00	53,165,000	
キャリアインデックス	7,900	796.00	6,288,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,600	783.00	3,601,800	
グレイステクノロジー	2,700	6,250.00	16,875,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,700	4,465.00	29,915,500	
グリーンズ	7,900	475.00	3,752,500	
ミダック	1,400	3,430.00	4,802,000	
日総工産	4,700	742.00	3,487,400	
キュービーネットホールディングス	2,400	1,553.00	3,727,200	
ＲＰＡホールディングス	5,000	689.00	3,445,000	
三櫻工業	7,800	626.00	4,882,800	
マキタ	79,900	5,330.00	425,867,000	
東芝テック	7,700	4,010.00	30,877,000	
芝浦メカトロニクス	1,200	3,890.00	4,668,000	
マブチモーター	17,000	4,475.00	76,075,000	
日本電産	147,500	11,460.00	1,690,350,000	
トレックス・セミコンダクター	3,500	1,247.00	4,364,500	
東光高岳	3,500	1,143.00	4,000,500	
ダブル・スコープ	9,700	643.00	6,237,100	
ダイヘン	6,700	4,235.00	28,374,500	
ヤーマン	10,000	2,141.00	21,410,000	
ＪＶＣケンウッド	49,900	151.00	7,534,900	
ミマキエンジニアリング	9,000	479.00	4,311,000	
Ｉ－ＰＥＸ	2,800	1,887.00	5,283,600	
日新電機	14,400	1,145.00	16,488,000	

大崎電気工業	12,200	569.00	6,941,800	
オムロン	54,900	8,440.00	463,356,000	
日東工業	9,000	1,923.00	17,307,000	
ＩＤＥＣ	8,800	1,803.00	15,866,400	
不二電機工業	2,900	1,306.00	3,787,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	20,500	2,407.00	49,343,500	
サクサホールディングス	2,600	1,412.00	3,671,200	
メルコホールディングス	2,100	3,045.00	6,394,500	
日本電気	74,300	5,480.00	407,164,000	
富士通	59,100	13,505.00	798,145,500	
沖電気工業	24,900	912.00	22,708,800	
電気興業	2,900	2,873.00	8,331,700	
サンケン電気	6,700	3,640.00	24,388,000	
アイホン	3,500	1,601.00	5,603,500	
ルネサスエレクトロニクス	262,200	922.00	241,748,400	
セイコーエプソン	76,000	1,464.00	111,264,000	
ワコム	41,200	788.00	32,465,600	
アルバック	11,300	3,965.00	44,804,500	
ＥＩＺＯ	4,800	3,495.00	16,776,000	
ジャパンディスプレイ	177,000	50.00	8,850,000	
日本信号	15,600	925.00	14,430,000	
京三製作所	14,300	421.00	6,020,300	
能美防災	8,100	2,414.00	19,553,400	
ホーチキ	4,400	1,298.00	5,711,200	
エレコム	7,000	4,620.00	32,340,000	
パナソニック	699,900	1,083.50	758,341,650	
シャープ	70,900	1,325.00	93,942,500	
アンリツ	39,400	2,337.00	92,077,800	
富士通ゼネラル	16,600	3,115.00	51,709,000	
ソニー	383,700	9,235.00	3,543,469,500	
ＴＤＫ	29,600	13,600.00	402,560,000	
帝国通信工業	3,300	1,161.00	3,831,300	
タムラ製作所	20,500	520.00	10,660,000	
アルプスアルパイン	54,200	1,370.00	74,254,000	
池上通信機	4,600	797.00	3,666,200	
鈴木	5,300	896.00	4,748,800	
日本トリム	1,000	3,965.00	3,965,000	
ローランド　ディー．ジー．	3,600	1,580.00	5,688,000	
フォスター電機	6,400	1,121.00	7,174,400	
ＳＭＫ	1,600	2,796.00	4,473,600	
ヨコオ	4,000	2,335.00	9,340,000	
ホシデン	16,700	837.00	13,977,900	
ヒロセ電機	9,400	14,420.00	135,548,000	
日本航空電子工業	14,000	1,459.00	20,426,000	
ＴＯＡ	6,600	902.00	5,953,200	
マクセルホールディングス	13,200	1,139.00	15,034,800	
古野電気	7,900	1,134.00	8,958,600	
ユニデンホールディングス	1,900	2,305.00	4,379,500	
スミダコーポレーション	5,200	923.00	4,799,600	
アイコム	3,400	2,808.00	9,547,200	
リオン	2,600	2,890.00	7,514,000	
横河電機	56,200	1,833.00	103,014,600	
新電元工業	2,200	2,339.00	5,145,800	
アズビル	38,700	4,595.00	177,826,500	
日本光電工業	25,300	3,395.00	85,893,500	
共和電業	8,800	422.00	3,713,600	
日本電子材料	2,400	1,465.00	3,516,000	
堀場製作所	12,100	5,500.00	66,550,000	
アドバンテスト	45,500	7,000.00	318,500,000	

小野測器	7,300	528.00	3,854,400	
エスペック	5,400	1,752.00	9,460,800	
キーエンス	55,500	51,800.00	2,874,900,000	
日置電機	2,900	3,795.00	11,005,500	
シスメックス	43,800	10,165.00	445,227,000	
日本マイクロニクス	10,700	978.00	10,464,600	
メガチップス	5,700	2,652.00	15,116,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,600	3,445.00	12,402,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,600	405.00	3,888,000	
澤藤電機	1,900	1,877.00	3,566,300	
デンソー	134,900	5,141.00	693,520,900	
原田工業	4,300	870.00	3,741,000	
コーセル	8,200	1,035.00	8,487,000	
イリソ電子工業	5,100	4,520.00	23,052,000	
オプテックスグループ	10,000	1,714.00	17,140,000	
千代田インテグレ	2,600	1,527.00	3,970,200	
レーザーテック	26,900	10,190.00	274,111,000	
スタンレー電気	42,900	3,010.00	129,129,000	
岩崎電気	2,700	1,341.00	3,620,700	
ウシオ電機	33,800	1,312.00	44,345,600	
岡谷電機産業	10,300	339.00	3,491,700	
エノモト	3,400	1,270.00	4,318,000	
日本セラミック	6,200	2,863.00	17,750,600	
遠藤照明	6,100	552.00	3,367,200	
古河電池	4,400	1,296.00	5,702,400	
双信電機	9,100	419.00	3,812,900	
山一電機	4,400	1,348.00	5,931,200	
図研	4,000	2,675.00	10,700,000	
日本電子	12,100	3,790.00	45,859,000	
カシオ計算機	54,200	2,005.00	108,671,000	
ファナック	57,600	24,520.00	1,412,352,000	
日本シイエムケイ	14,400	411.00	5,918,400	
エンプラス	3,100	2,663.00	8,255,300	
大真空	2,200	1,996.00	4,391,200	
ローム	25,500	8,750.00	223,125,000	
浜松ホトニクス	43,900	5,660.00	248,474,000	
三井ハイテック	6,800	2,486.00	16,904,800	
新光電気工業	20,600	1,959.00	40,355,400	
京セラ	86,200	5,964.00	514,096,800	
協栄産業	2,800	1,301.00	3,642,800	
太陽誘電	27,200	4,310.00	117,232,000	
村田製作所	179,900	8,282.00	1,489,931,800	
双葉電子工業	9,700	884.00	8,574,800	
日東電工	42,300	8,310.00	351,513,000	
北陸電気工業	3,800	930.00	3,534,000	
東海理化電機製作所	16,100	1,659.00	26,709,900	
ニチコン	20,800	1,030.00	21,424,000	
日本ケミコン	4,700	1,417.00	6,659,900	
ＫＯＡ	9,200	1,381.00	12,705,200	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	22,100	365.00	8,066,500	
日立造船	48,600	425.00	20,655,000	
三菱重工業	102,700	2,603.00	267,328,100	
川崎重工業	47,700	1,588.00	75,747,600	
ＩＨＩ	44,100	1,524.00	67,208,400	
スプリックス	4,000	862.00	3,448,000	
マネジメントソリューションズ	2,900	1,425.00	4,132,500	
プロレド・パートナーズ	800	4,900.00	3,920,000	
カーブスホールディングス	16,100	699.00	11,253,900	
日本車輌製造	2,200	2,461.00	5,414,200	
三菱ロジスネクスト	8,100	1,002.00	8,116,200	

近畿車輌	2,800	1,294.00	3,623,200	
ＦＰＧ	18,700	493.00	9,219,100	
島根銀行	6,100	648.00	3,952,800	
じもとホールディングス	4,100	1,029.00	4,218,900	
全国保証	17,000	4,745.00	80,665,000	
めぶきフィナンシャルグループ	313,900	226.00	70,941,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8,200	1,165.00	9,553,000	
九州フィナンシャルグループ	132,200	537.00	70,991,400	
かんぽ生命保険	21,400	1,800.00	38,520,000	
ゆうちょ銀行	171,200	904.00	154,764,800	
富山第一銀行	14,400	294.00	4,233,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	345,100	388.00	133,898,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	40,200	717.00	28,823,400	
イントラスト	4,000	847.00	3,388,000	
日本モーゲージサービス	3,600	1,153.00	4,150,800	
アルヒ	9,600	2,155.00	20,688,000	
プレミアグループ	3,300	2,121.00	6,999,300	
日産自動車	722,500	485.80	350,990,500	
いすゞ自動車	177,500	1,003.00	178,032,500	
トヨタ自動車	683,500	7,352.00	5,025,092,000	
日野自動車	76,500	928.00	70,992,000	
三菱自動車工業	226,700	193.00	43,753,100	
エフテック	7,100	580.00	4,118,000	
武蔵精密工業	13,600	1,432.00	19,475,200	
日産車体	12,000	919.00	11,028,000	
新明和工業	16,500	874.00	14,421,000	
極東開発工業	11,400	1,399.00	15,948,600	
トピー工業	5,000	1,086.00	5,430,000	
ティラド	3,000	1,357.00	4,071,000	
曙ブレーキ工業	33,600	140.00	4,704,000	
タチエス	10,100	1,158.00	11,695,800	
ＮＯＫ	32,900	1,211.00	39,841,900	
フタバ産業	17,000	503.00	8,551,000	
ＫＹＢ	6,900	2,559.00	17,657,100	
市光工業	9,200	530.00	4,876,000	
大同メタル工業	11,700	500.00	5,850,000	
プレス工業	30,400	307.00	9,332,800	
ミクニ	13,900	281.00	3,905,900	
太平洋工業	12,800	1,060.00	13,568,000	
河西工業	10,200	361.00	3,682,200	
アイシン精機	50,400	3,190.00	160,776,000	
マツダ	180,200	636.00	114,607,200	
今仙電機製作所	6,100	862.00	5,258,200	
本田技研工業	482,300	2,977.00	1,435,807,100	
スズキ	121,400	5,445.00	661,023,000	
ＳＵＢＡＲＵ	190,200	2,156.50	410,166,300	
安永	1,100	1,105.00	1,215,500	
ヤマハ発動機	86,600	1,965.00	170,169,000	
小糸製作所	36,700	6,560.00	240,752,000	
ＴＢＫ	8,700	461.00	4,010,700	
エクセディ	8,300	1,289.00	10,698,700	
ミツバ	11,300	479.00	5,412,700	
豊田合成	19,800	2,861.00	56,647,800	
愛三工業	9,600	479.00	4,598,400	
ヨロズ	5,700	1,225.00	6,982,500	
エフ・シー・シー	10,000	2,087.00	20,870,000	
シマノ	22,900	23,445.00	536,890,500	
テイ・エス　テック	14,200	3,175.00	45,085,000	

関西みらいフィナンシャルグループ	35,500	541.00	19,205,500	
三十三フィナンシャルグループ	5,600	1,361.00	7,621,600	
第四北越フィナンシャルグループ	10,500	2,132.00	22,386,000	
ひろぎんホールディングス	89,100	589.00	52,479,900	
ジャムコ	6,100	680.00	4,148,000	
小野建	5,400	1,239.00	6,690,600	
ノジマ	10,700	2,980.00	31,886,000	
佐鳥電機	4,700	828.00	3,891,600	
カッパ・クリエイト	8,500	1,431.00	12,163,500	
伯東	3,700	1,067.00	3,947,900	
コンドーテック	4,700	1,039.00	4,883,300	
中山福	7,500	517.00	3,877,500	
ライトオン	5,800	644.00	3,735,200	
ナガイレーベン	8,000	2,679.00	21,432,000	
三菱食品	6,600	2,775.00	18,315,000	
良品計画	80,100	2,271.00	181,907,100	
松田産業	4,400	1,636.00	7,198,400	
第一興商	9,000	3,535.00	31,815,000	
メディパルホールディングス	65,100	1,994.00	129,809,400	
アドヴァン	9,200	1,342.00	12,346,400	
ＳＰＫ	3,000	1,294.00	3,882,000	
萩原電気ホールディングス	2,200	2,463.00	5,418,600	
アルビス	2,300	2,486.00	5,717,800	
アズワン	3,900	15,000.00	58,500,000	
スズデン	3,200	1,199.00	3,836,800	
シモジマ	3,700	1,414.00	5,231,800	
ドウシシャ	5,700	1,940.00	11,058,000	
小津産業	2,000	1,854.00	3,708,000	
コナカ	14,800	244.00	3,611,200	
高速	3,600	1,534.00	5,522,400	
Ｇ－７ホールディングス	3,600	2,283.00	8,218,800	
イオン北海道	8,000	916.00	7,328,000	
コジマ	10,400	711.00	7,394,400	
ヒマラヤ	4,400	919.00	4,043,600	
コーナン商事	8,600	3,310.00	28,466,000	
ネットワンシステムズ	22,900	3,600.00	82,440,000	
エコス	2,200	2,298.00	5,055,600	
ワタミ	7,100	971.00	6,894,100	
マルシェ	6,800	524.00	3,563,200	
システムソフト	38,200	92.00	3,514,400	
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	132,600	2,459.00	326,063,400	
丸文	7,400	483.00	3,574,200	
西松屋チェーン	13,200	1,795.00	23,694,000	
ゼンショーホールディングス	28,900	2,734.00	79,012,600	
ハピネット	5,000	1,473.00	7,365,000	
幸楽苑ホールディングス	3,800	1,819.00	6,912,200	
橋本総業ホールディングス	1,600	2,383.00	3,812,800	
日本ライフライン	17,900	1,389.00	24,863,100	
サイゼリヤ	8,900	1,834.00	16,322,600	
ＶＴホールディングス	25,000	372.00	9,300,000	
マルカ	2,000	2,188.00	4,376,000	
アルゴグラフィックス	5,100	3,265.00	16,651,500	
ＩＤＯＭ	16,300	616.00	10,040,800	
日本エム・ディ・エム	3,500	2,154.00	7,539,000	
ユナイテッドアローズ	6,400	1,447.00	9,260,800	
進和	3,600	2,014.00	7,250,400	
ダイトロン	2,500	1,397.00	3,492,500	
ハイデイ日高	8,700	1,722.00	14,981,400	
シークス	7,700	1,600.00	12,320,000	

京都きもの友禅	15,600	229.00	3,572,400	
コロワイド	20,000	1,517.00	30,340,000	
ピーシーデポコーポレーション	8,000	610.00	4,880,000	
田中商事	5,300	705.00	3,736,500	
オーハシテクニカ	3,100	1,390.00	4,309,000	
壱番屋	4,300	5,320.00	22,876,000	
白銅	2,800	1,377.00	3,855,600	
スギホールディングス	12,000	6,910.00	82,920,000	
ダイコー通産	2,700	1,416.00	3,823,200	
薬王堂ホールディングス	2,600	2,522.00	6,557,200	
島津製作所	73,200	3,555.00	260,226,000	
ＪＭＳ	5,200	1,021.00	5,309,200	
長野計器	1,900	788.00	1,497,200	
ブイ・テクノロジー	2,900	5,350.00	15,515,000	
スター精密	9,400	1,504.00	14,137,600	
東京計器	4,200	924.00	3,880,800	
愛知時計電機	800	4,390.00	3,512,000	
インターアクション	3,300	1,729.00	5,705,700	
オーバル	16,600	232.00	3,851,200	
東京精密	11,100	4,350.00	48,285,000	
マニー	24,400	2,530.00	61,732,000	
ニコン	93,500	692.00	64,702,000	
トプコン	30,900	1,353.00	41,807,700	
オリンパス	338,900	2,066.50	700,336,850	
理研計器	5,400	2,937.00	15,859,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	10,600	6,270.00	66,462,000	
キヤノン電子	5,600	1,442.00	8,075,200	
タムロン	4,900	1,633.00	8,001,700	
ＨＯＹＡ	121,500	12,545.00	1,524,217,500	
ノーリツ鋼機	4,100	2,242.00	9,192,200	
エー・アンド・デイ	5,800	869.00	5,040,200	
朝日インテック	69,400	3,275.00	227,285,000	
キヤノン	304,400	1,909.00	581,099,600	
リコー	155,800	670.00	104,386,000	
シチズン時計	71,700	284.00	20,362,800	
リズム	6,000	638.00	3,828,000	
大研医器	7,000	517.00	3,619,000	
メニコン	8,700	6,930.00	60,291,000	
スノーピーク	3,600	1,608.00	5,788,800	
パラマウントベッドホールディングス	6,500	4,435.00	28,827,500	
トランザクション	4,000	959.00	3,836,000	
粧美堂	10,400	386.00	4,014,400	
ニホンフラッシュ	5,700	1,298.00	7,398,600	
前田工繊	6,700	2,812.00	18,840,400	
永大産業	5,800	290.00	1,682,000	
アートネイチャー	6,500	664.00	4,316,000	
バンダイナムコホールディングス	63,300	9,094.00	575,650,200	
共立印刷	28,700	123.00	3,530,100	
ＳＨＯＥＩ	5,400	3,500.00	18,900,000	
フランスベッドホールディングス	8,700	880.00	7,656,000	
マーベラス	9,200	835.00	7,682,000	
パイロットコーポレーション	10,800	3,100.00	33,480,000	
萩原工業	3,400	1,618.00	5,501,200	
エイベックス	10,300	1,011.00	10,413,300	
トッパン・フォームズ	13,100	1,005.00	13,165,500	
フジシールインターナショナル	13,700	2,026.00	27,756,200	
タカラトミー	27,500	941.00	25,877,500	
廣済堂	6,100	659.00	4,019,900	
レック	6,500	1,497.00	9,730,500	

三光合成	13,000	290.00	3,770,000	
プロネクサス	5,300	1,107.00	5,867,100	
ホクシン	31,700	115.00	3,645,500	
大建工業	4,100	1,926.00	7,896,600	
凸版印刷	86,500	1,500.00	129,750,000	
大日本印刷	80,200	2,021.00	162,084,200	
共同印刷	1,900	2,920.00	5,548,000	
ＮＩＳＳＨＡ	12,600	1,327.00	16,720,200	
藤森工業	5,500	4,330.00	23,815,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,000	2,041.00	6,123,000	
前澤化成工業	3,900	994.00	3,876,600	
未来工業	3,300	1,874.00	6,184,200	
アシックス	54,200	1,772.00	96,042,400	
ツツミ	1,900	2,185.00	4,151,500	
ウェーブロックホールディングス	5,100	729.00	3,717,900	
ＪＳＰ	3,600	1,518.00	5,464,800	
ニチハ	8,500	3,185.00	27,072,500	
エフピコ	12,900	4,245.00	54,760,500	
小松ウオール工業	2,200	1,722.00	3,788,400	
ヤマハ	36,400	5,650.00	205,660,000	
河合楽器製作所	1,900	2,592.00	4,924,800	
ピジョン	39,300	4,650.00	182,745,000	
天馬	4,100	1,929.00	7,908,900	
オリバー	1,500	2,431.00	3,646,500	
キングジム	5,100	911.00	4,646,100	
象印マホービン	16,600	1,951.00	32,386,600	
リンテック	14,600	2,169.00	31,667,400	
信越ポリマー	11,000	938.00	10,318,000	
東リ	15,300	267.00	4,085,100	
イトーキ	12,200	334.00	4,074,800	
任天堂	37,600	54,550.00	2,051,080,000	
三菱鉛筆	10,100	1,447.00	14,614,700	
松風	2,800	1,657.00	4,639,600	
タカラスタンダード	12,700	1,429.00	18,148,300	
コクヨ	29,400	1,433.00	42,130,200	
ナカバヤシ	6,000	612.00	3,672,000	
ニフコ	22,500	3,640.00	81,900,000	
立川ブラインド工業	2,900	1,235.00	3,581,500	
グローブライド	2,700	3,980.00	10,746,000	
オカムラ	21,400	950.00	20,330,000	
バルカー	5,000	1,872.00	9,360,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,500	1,478.00	3,695,000	
伊藤忠商事	422,000	2,764.50	1,166,619,000	
丸紅	628,000	608.50	382,138,000	
スクロール	9,300	701.00	6,519,300	
高島	2,000	1,668.00	3,336,000	
ヨンドシーホールディングス	6,100	1,922.00	11,724,200	
三陽商会	7,200	536.00	3,859,200	
長瀬産業	33,900	1,406.00	47,663,400	
蝶理	3,800	1,542.00	5,859,600	
豊田通商	67,300	3,415.00	229,829,500	
オンワードホールディングス	36,000	203.00	7,308,000	
三共生興	9,100	422.00	3,840,200	
兼松	22,500	1,256.00	28,260,000	
美津濃	5,600	1,867.00	10,455,200	
三井物産	522,400	1,842.50	962,522,000	
日本紙パルプ商事	3,400	3,785.00	12,869,000	
東京エレクトロン	38,900	32,140.00	1,250,246,000	
カメイ	7,900	1,175.00	9,282,500	
東都水産	900	4,545.00	4,090,500	

ＯＵＧホールディングス	1,300	2,860.00	3,718,000	
スターゼン	2,200	4,375.00	9,625,000	
セイコーホールディングス	8,700	1,423.00	12,380,100	
山善	23,600	1,001.00	23,623,600	
椿本興業	1,100	3,430.00	3,773,000	
住友商事	380,700	1,325.00	504,427,500	
日本ユニシス	18,800	3,575.00	67,210,000	
内田洋行	2,400	5,250.00	12,600,000	
三菱商事	395,600	2,509.50	992,758,200	
第一実業	3,000	3,810.00	11,430,000	
キヤノンマーケティングジャパン	15,000	2,219.00	33,285,000	
西華産業	3,400	1,266.00	4,304,400	
佐藤商事	5,000	1,000.00	5,000,000	
菱洋エレクトロ	6,100	2,942.00	17,946,200	
東京産業	6,900	591.00	4,077,900	
ユアサ商事	5,700	3,055.00	17,413,500	
神鋼商事	2,100	1,827.00	3,836,700	
阪和興業	11,300	2,455.00	27,741,500	
正栄食品工業	3,900	3,820.00	14,898,000	
カナデン	4,900	1,296.00	6,350,400	
菱電商事	4,300	1,520.00	6,536,000	
ニプロ	42,400	1,160.00	49,184,000	
フルサト工業	3,300	1,251.00	4,128,300	
岩谷産業	14,100	5,170.00	72,897,000	
昭光通商	6,100	597.00	3,641,700	
イワキ	7,900	527.00	4,163,300	
兼松エレクトロニクス	3,300	4,180.00	13,794,000	
三愛石油	14,900	1,157.00	17,239,300	
稲畑産業	13,300	1,381.00	18,367,300	
明和産業	9,000	397.00	3,573,000	
ヤマエ久野	4,400	1,255.00	5,522,000	
ゴールドウイン	10,800	6,680.00	72,144,000	
ユニ・チャーム	129,900	5,097.00	662,100,300	
デサント	11,700	1,818.00	21,270,600	
ワキタ	12,900	1,150.00	14,835,000	
ヤマトインターナショナル	11,200	336.00	3,763,200	
東邦ホールディングス	19,400	2,009.00	38,974,600	
サンゲツ	16,300	1,526.00	24,873,800	
ミツウロコグループホールディングス	8,900	1,247.00	11,098,300	
シナネンホールディングス	2,500	2,960.00	7,400,000	
伊藤忠エネクス	13,300	964.00	12,821,200	
サンリオ	16,900	1,635.00	27,631,500	
サンワ　テクノス	4,300	877.00	3,771,100	
リョーサン	6,700	1,937.00	12,977,900	
新光商事	9,000	818.00	7,362,000	
トーホー	2,700	2,041.00	5,510,700	
三信電気	3,200	2,053.00	6,569,600	
東陽テクニカ	6,400	1,092.00	6,988,800	
モスフードサービス	7,900	2,803.00	22,143,700	
加賀電子	6,000	2,054.00	12,324,000	
三益半導体工業	4,700	2,524.00	11,862,800	
都築電気	2,300	1,521.00	3,498,300	
ソーダニッカ	6,600	550.00	3,630,000	
立花エレテック	4,500	1,706.00	7,677,000	
木曽路	7,900	2,430.00	19,197,000	
ＳＲＳホールディングス	7,100	904.00	6,418,400	
千趣会	10,900	316.00	3,444,400	
リテールパートナーズ	8,000	1,521.00	12,168,000	
ケーヨー	12,400	754.00	9,349,600	

上新電機	7,100	2,561.00	18,183,100	
日本瓦斯	9,500	5,560.00	52,820,000	
ロイヤルホールディングス	10,500	1,859.00	19,519,500	
東天紅	3,800	950.00	3,610,000	
いなげや	7,500	1,984.00	14,880,000	
島忠	11,300	5,490.00	62,037,000	
チヨダ	6,300	940.00	5,922,000	
ライフコーポレーション	4,600	3,430.00	15,778,000	
リンガーハット	7,400	2,281.00	16,879,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	8,300	817.00	6,781,100	
テンアライド	10,600	358.00	3,794,800	
ＡＯＫＩホールディングス	12,100	461.00	5,578,100	
オークワ	9,500	1,403.00	13,328,500	
コメリ	9,300	2,938.00	27,323,400	
青山商事	12,500	498.00	6,225,000	
しまむら	7,100	11,060.00	78,526,000	
はせがわ	12,900	286.00	3,689,400	
高島屋	43,900	866.00	38,017,400	
松屋	12,200	726.00	8,857,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	28,600	683.00	19,533,800	
近鉄百貨店	2,300	3,330.00	7,659,000	
丸井グループ	55,300	1,938.00	107,171,400	
クレディセゾン	42,300	1,163.00	49,194,900	
アクシアル　リテイリング	5,000	4,685.00	23,425,000	
イオン	232,200	3,045.00	707,049,000	
イズミ	12,300	3,560.00	43,788,000	
フォーバル	3,700	909.00	3,363,300	
平和堂	12,200	2,117.00	25,827,400	
フジ	7,300	1,965.00	14,344,500	
ヤオコー	6,800	7,130.00	48,484,000	
ゼビオホールディングス	7,300	822.00	6,000,600	
ケーズホールディングス	58,200	1,302.00	75,776,400	
ＰＡＬＴＡＣ	9,700	5,940.00	57,618,000	
三谷産業	8,600	421.00	3,620,600	
新生銀行	44,400	1,308.00	58,075,200	
あおぞら銀行	36,000	1,850.00	66,600,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,133,000	464.10	1,918,125,300	
りそなホールディングス	656,900	383.20	251,724,080	
三井住友トラスト・ホールディングス	114,300	3,205.00	366,331,500	
三井住友フィナンシャルグループ	417,900	3,153.00	1,317,638,700	
千葉銀行	201,600	615.00	123,984,000	
群馬銀行	116,100	352.00	40,867,200	
武蔵野銀行	9,100	1,642.00	14,942,200	
千葉興業銀行	16,600	276.00	4,581,600	
筑波銀行	25,100	203.00	5,095,300	
七十七銀行	20,500	1,560.00	31,980,000	
青森銀行	4,700	2,497.00	11,735,900	
秋田銀行	3,900	1,450.00	5,655,000	
山形銀行	6,800	1,313.00	8,928,400	
岩手銀行	4,000	2,424.00	9,696,000	
東邦銀行	54,000	242.00	13,068,000	
みちのく銀行	3,900	1,239.00	4,832,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	50,900	1,915.00	97,473,500	
静岡銀行	147,100	783.00	115,179,300	
十六銀行	7,600	2,116.00	16,081,600	
スルガ銀行	61,800	358.00	22,124,400	
八十二銀行	145,800	398.00	58,028,400	
山梨中央銀行	7,000	791.00	5,537,000	

大垣共立銀行	12,000	2,509.00	30,108,000	
福井銀行	5,200	1,980.00	10,296,000	
北國銀行	6,100	2,945.00	17,964,500	
清水銀行	2,500	1,810.00	4,525,000	
富山銀行	1,300	3,325.00	4,322,500	
滋賀銀行	12,200	2,440.00	29,768,000	
南都銀行	10,100	1,944.00	19,634,400	
百五銀行	54,400	340.00	18,496,000	
京都銀行	21,700	5,250.00	113,925,000	
紀陽銀行	21,400	1,671.00	35,759,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	40,300	1,096.00	44,168,800	
山陰合同銀行	35,800	575.00	20,585,000	
中国銀行	52,000	951.00	49,452,000	
鳥取銀行	3,400	1,180.00	4,012,000	
伊予銀行	86,200	714.00	61,546,800	
百十四銀行	6,500	1,691.00	10,991,500	
四国銀行	9,200	756.00	6,955,200	
阿波銀行	9,900	2,716.00	26,888,400	
大分銀行	3,500	2,429.00	8,501,500	
宮崎銀行	4,100	2,458.00	10,077,800	
佐賀銀行	3,700	1,377.00	5,094,900	
沖縄銀行	5,600	3,165.00	17,724,000	
琉球銀行	13,900	897.00	12,468,300	
セブン銀行	201,900	230.00	46,437,000	
みずほフィナンシャルグループ	821,000	1,414.50	1,161,304,500	
山口フィナンシャルグループ	75,400	725.00	54,665,000	
芙蓉総合リース	6,300	6,340.00	39,942,000	
みずほリース	9,300	2,722.00	25,314,600	
東京センチュリー	12,200	6,480.00	79,056,000	
ＳＢＩホールディングス	69,400	2,643.00	183,424,200	
日本証券金融	26,700	502.00	13,403,400	
アイフル	92,200	264.00	24,340,800	
長野銀行	2,700	1,436.00	3,877,200	
名古屋銀行	4,600	2,894.00	13,312,400	
北洋銀行	91,100	246.00	22,410,600	
愛知銀行	2,200	3,100.00	6,820,000	
中京銀行	2,500	2,186.00	5,465,000	
大光銀行	3,000	1,329.00	3,987,000	
愛媛銀行	8,500	1,137.00	9,664,500	
京葉銀行	25,800	481.00	12,409,800	
栃木銀行	29,200	188.00	5,489,600	
北日本銀行	1,900	2,001.00	3,801,900	
東和銀行	10,600	690.00	7,314,000	
リコーリース	4,800	2,941.00	14,116,800	
イオンフィナンシャルサービス	37,000	1,171.00	43,327,000	
アコム	121,400	501.00	60,821,400	
ジャックス	6,700	1,801.00	12,066,700	
オリエントコーポレーション	163,500	119.00	19,456,500	
日立キャピタル	14,200	2,375.00	33,725,000	
オリックス	374,800	1,525.00	571,570,000	
三菱ＵＦＪリース	153,300	478.00	73,277,400	
ジャフコ　グループ	9,300	4,550.00	42,315,000	
九州リースサービス	6,100	604.00	3,684,400	
トモニホールディングス	46,700	343.00	16,018,100	
大和証券グループ本社	484,800	472.40	229,019,520	
野村ホールディングス	1,063,100	509.00	541,117,900	
岡三証券グループ	51,500	364.00	18,746,000	
丸三証券	18,000	493.00	8,874,000	
東洋証券	30,600	128.00	3,916,800	

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	69,400	293.00	20,334,200	
光世証券	5,300	676.00	3,582,800	
水戸証券	17,500	232.00	4,060,000	
いちよし証券	11,300	446.00	5,039,800	
松井証券	34,600	864.00	29,894,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	113,600	4,007.00	455,195,200	
日本取引所グループ	173,400	2,410.50	417,980,700	
マネックスグループ	44,300	324.00	14,353,200	
極東証券	8,200	717.00	5,879,400	
岩井コスモホールディングス	5,800	1,276.00	7,400,800	
藍澤證券	10,900	704.00	7,673,600	
フィデアホールディングス	58,700	110.00	6,457,000	
池田泉州ホールディングス	69,500	162.00	11,259,000	
アニコム　ホールディングス	20,100	1,041.00	20,924,100	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	158,000	3,169.00	500,702,000	
スパークス・グループ	27,900	237.00	6,612,300	
第一生命ホールディングス	341,900	1,643.50	561,912,650	
東京海上ホールディングス	213,600	5,453.00	1,164,760,800	
イー・ギャランティ	6,900	2,014.00	13,896,600	
アサックス	5,100	710.00	3,621,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,500	1,833.00	4,582,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	180,600	1,223.00	220,873,800	
アドバンスクリエイト	1,200	1,876.00	2,251,200	
三井不動産	293,700	2,178.50	639,825,450	
三菱地所	423,300	1,796.00	760,246,800	
平和不動産	11,100	3,100.00	34,410,000	
東京建物	59,700	1,333.00	79,580,100	
ダイビル	15,600	1,260.00	19,656,000	
京阪神ビルディング	9,700	2,080.00	20,176,000	
住友不動産	135,800	3,378.00	458,732,400	
テーオーシー	11,900	626.00	7,449,400	
東京楽天地	1,000	4,195.00	4,195,000	
レオパレス２１	79,100	158.00	12,497,800	
スターツコーポレーション	8,200	2,748.00	22,533,600	
フジ住宅	7,000	615.00	4,305,000	
空港施設	8,200	467.00	3,829,400	
ゴールドクレスト	4,800	1,411.00	6,772,800	
リログループ	32,000	2,781.00	88,992,000	
エスリード	2,800	1,348.00	3,774,400	
日神グループホールディングス	9,100	400.00	3,640,000	
日本エスコン	10,900	884.00	9,635,600	
タカラレーベン	27,600	295.00	8,142,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	4,200	866.00	3,637,200	
イオンモール	30,300	1,716.00	51,994,800	
毎日コムネット	5,200	717.00	3,728,400	
ファースト住建	3,700	1,017.00	3,762,900	
カチタス	15,000	3,065.00	45,975,000	
東祥	3,600	1,327.00	4,777,200	
トーセイ	8,300	1,092.00	9,063,600	
穴吹興産	2,300	1,620.00	3,726,000	
サンフロンティア不動産	8,300	934.00	7,752,200	
エフ・ジェー・ネクスト	5,300	992.00	5,257,600	
グランディハウス	10,200	376.00	3,835,200	
東武鉄道	63,800	3,445.00	219,791,000	
相鉄ホールディングス	19,600	2,724.00	53,390,400	
東急	154,500	1,371.00	211,819,500	
京浜急行電鉄	78,700	1,807.00	142,210,900	
小田急電鉄	91,100	3,150.00	286,965,000	

京王電鉄	31,800	7,730.00	245,814,000	
京成電鉄	42,600	3,670.00	156,342,000	
富士急行	8,400	5,040.00	42,336,000	
新京成電鉄	500	2,207.00	1,103,500	
東日本旅客鉄道	107,800	6,505.00	701,239,000	
西日本旅客鉄道	54,600	5,070.00	276,822,000	
東海旅客鉄道	50,900	14,355.00	730,669,500	
西武ホールディングス	80,000	1,148.00	91,840,000	
鴻池運輸	9,700	1,063.00	10,311,100	
西日本鉄道	17,000	3,155.00	53,635,000	
ハマキョウレックス	4,700	3,035.00	14,264,500	
サカイ引越センター	3,200	5,140.00	16,448,000	
近鉄グループホールディングス	58,000	4,735.00	274,630,000	
阪急阪神ホールディングス	77,400	3,680.00	284,832,000	
南海電気鉄道	27,500	2,815.00	77,412,500	
京阪ホールディングス	25,800	4,645.00	119,841,000	
神戸電鉄	1,400	3,620.00	5,068,000	
名古屋鉄道	47,700	3,070.00	146,439,000	
山陽電気鉄道	4,100	2,102.00	8,618,200	
トランコム	1,600	8,350.00	13,360,000	
日本通運	20,100	7,120.00	143,112,000	
ヤマトホールディングス	101,700	2,659.00	270,420,300	
山九	16,100	4,095.00	65,929,500	
日新	5,000	1,309.00	6,545,000	
丸全昭和運輸	4,700	3,235.00	15,204,500	
センコーグループホールディングス	32,000	1,010.00	32,320,000	
トナミホールディングス	1,400	5,980.00	8,372,000	
ニッコンホールディングス	20,800	2,052.00	42,681,600	
日本石油輸送	1,400	2,602.00	3,642,800	
福山通運	7,400	4,910.00	36,334,000	
セイノーホールディングス	43,400	1,581.00	68,615,400	
エスライン	3,800	928.00	3,526,400	
神奈川中央交通	1,400	3,925.00	5,495,000	
日立物流	10,600	3,255.00	34,503,000	
丸和運輸機関	6,100	4,305.00	26,260,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	5,900	1,827.00	10,779,300	
日本郵船	48,600	2,120.00	103,032,000	
商船三井	36,800	2,605.00	95,864,000	
川崎汽船	17,900	1,567.00	28,049,300	
ＮＳユナイテッド海運	3,200	1,339.00	4,284,800	
飯野海運	27,500	389.00	10,697,500	
九州旅客鉄道	50,900	2,338.00	119,004,200	
ＳＧホールディングス	121,800	2,723.00	331,661,400	
日本航空	102,600	1,916.00	196,581,600	
ＡＮＡホールディングス	106,000	2,532.00	268,392,000	
パスコ	1,200	1,295.00	1,554,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,000	2,110.00	4,220,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	2,600	4,060.00	10,556,000	
国際紙パルプ商事	14,300	255.00	3,646,500	
ブックオフグループホールディングス	4,400	864.00	3,801,600	
三菱倉庫	18,400	3,045.00	56,028,000	
三井倉庫ホールディングス	6,600	2,033.00	13,417,800	
住友倉庫	20,900	1,397.00	29,197,300	
澁澤倉庫	3,200	2,197.00	7,030,400	
ヤマタネ	3,000	1,354.00	4,062,000	
東陽倉庫	11,200	331.00	3,707,200	
乾汽船	4,000	948.00	3,792,000	
日本トランスシティ	12,800	568.00	7,270,400	

ケイヒン	2,700	1,385.00	3,739,500	
中央倉庫	3,500	1,192.00	4,172,000	
安田倉庫	4,800	993.00	4,766,400	
東洋埠頭	2,600	1,459.00	3,793,400	
宇徳	7,500	480.00	3,600,000	
上組	32,400	1,902.00	61,624,800	
キユーソー流通システム	900	1,768.00	1,591,200	
近鉄エクスプレス	12,300	2,216.00	27,256,800	
東海運	12,000	307.00	3,684,000	
エーアイテイー	4,100	1,034.00	4,239,400	
内外トランスライン	3,000	1,222.00	3,666,000	
ＴＢＳホールディングス	36,600	1,795.00	65,697,000	
日本テレビホールディングス	50,200	1,157.00	58,081,400	
朝日放送グループホールディングス	6,000	715.00	4,290,000	
テレビ朝日ホールディングス	16,500	1,731.00	28,561,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	39,500	490.00	19,355,000	
テレビ東京ホールディングス	4,900	2,451.00	12,009,900	
日本ＢＳ放送	3,500	1,077.00	3,769,500	
ビジョン	7,500	1,071.00	8,032,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,700	1,415.00	3,820,500	
コネクシオ	3,400	1,226.00	4,168,400	
日本通信	46,900	205.00	9,614,500	
日本電信電話	803,500	2,491.50	2,001,920,250	
ＫＤＤＩ	438,200	3,042.00	1,333,004,400	
ソフトバンク	546,300	1,279.00	698,717,700	
光通信	6,200	23,970.00	148,614,000	
ＮＴＴドコモ	429,800	3,876.00	1,665,904,800	
エムティーアイ	5,800	807.00	4,680,600	
GMOインターネット	21,500	2,720.00	58,480,000	
ファイバーゲート	2,000	2,284.00	4,568,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	9,000	375.00	3,375,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	16,200	3,155.00	51,111,000	
学研ホールディングス	8,100	1,521.00	12,320,100	
ゼンリン	12,000	1,320.00	15,840,000	
インプレスホールディングス	19,500	167.00	3,256,500	
東京電力ホールディングス	489,000	289.00	141,321,000	
中部電力	187,400	1,305.50	244,650,700	
関西電力	232,100	995.40	231,032,340	
中国電力	88,400	1,400.00	123,760,000	
北陸電力	56,000	789.00	44,184,000	
東北電力	153,000	946.00	144,738,000	
四国電力	55,200	782.00	43,166,400	
九州電力	126,300	946.00	119,479,800	
北海道電力	57,300	412.00	23,607,600	
沖縄電力	11,900	1,568.00	18,659,200	
電源開発	48,700	1,463.00	71,248,100	
エフオン	3,400	1,113.00	3,784,200	
イーレックス	8,700	1,694.00	14,737,800	
レノバ	10,300	2,378.00	24,493,400	
東京瓦斯	117,800	2,567.50	302,451,500	
大阪瓦斯	118,900	2,199.00	261,461,100	
東邦瓦斯	30,100	6,880.00	207,088,000	
北海道瓦斯	3,300	1,560.00	5,148,000	
広島ガス	12,600	374.00	4,712,400	
西部瓦斯	6,900	3,155.00	21,769,500	
静岡ガス	17,400	990.00	17,226,000	
メタウォーター	5,900	2,497.00	14,732,300	
アイネット	3,100	1,510.00	4,681,000	

松竹	4,000	13,200.00	52,800,000	
東宝	35,500	4,565.00	162,057,500	
エイチ・アイ・エス	9,100	1,614.00	14,687,400	
東映	2,200	17,040.00	37,488,000	
ラックランド	1,700	2,314.00	3,933,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	160,000	1,380.00	220,800,000	
共立メンテナンス	9,700	3,560.00	34,532,000	
イチネンホールディングス	6,600	1,284.00	8,474,400	
建設技術研究所	3,800	2,090.00	7,942,000	
スペース	4,800	826.00	3,964,800	
アインホールディングス	7,400	7,250.00	53,650,000	
燦ホールディングス	3,100	1,190.00	3,689,000	
ピー・シー・エー	1,000	4,430.00	4,430,000	
東京テアトル	3,000	1,335.00	4,005,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	1,484.00	3,413,200	
ナガワ	1,900	9,110.00	17,309,000	
よみうりランド	1,300	6,050.00	7,865,000	
東京都競馬	3,800	5,200.00	19,760,000	
カナモト	10,300	2,298.00	23,669,400	
東京ドーム	23,700	910.00	21,567,000	
ＤＴＳ	13,400	2,169.00	29,064,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	25,600	5,360.00	137,216,000	
シーイーシー	6,400	1,512.00	9,676,800	
カプコン	28,300	5,370.00	151,971,000	
西尾レントオール	5,400	2,133.00	11,518,200	
アイ・エス・ビー	1,400	2,573.00	3,602,200	
日本空港ビルデング	19,300	5,840.00	112,712,000	
トランス・コスモス	5,600	2,776.00	15,545,600	
乃村工藝社	25,100	766.00	19,226,600	
ジャステック	3,800	1,529.00	5,810,200	
ＳＣＳＫ	13,900	5,680.00	78,952,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,600	856.00	3,081,600	
日本管財	6,300	2,073.00	13,059,900	
トーカイ	5,700	2,045.00	11,656,500	
セコム	62,200	10,165.00	632,263,000	
日本システムウエア	2,000	2,088.00	4,176,000	
セントラル警備保障	2,800	3,485.00	9,758,000	
アイネス	5,900	1,439.00	8,490,100	
丹青社	11,100	758.00	8,413,800	
メイテック	7,200	5,150.00	37,080,000	
ＴＫＣ	5,100	6,620.00	33,762,000	
富士ソフト	6,400	5,090.00	32,576,000	
応用地質	6,800	1,268.00	8,622,400	
船井総研ホールディングス	12,100	2,493.00	30,165,300	
ＮＳＤ	19,300	1,965.00	37,924,500	
進学会ホールディングス	8,400	429.00	3,603,600	
丸紅建材リース	2,200	1,727.00	3,799,400	
コナミホールディングス	21,800	5,190.00	113,142,000	
学究社	3,500	1,200.00	4,200,000	
ベネッセホールディングス	19,500	2,308.00	45,006,000	
イオンディライト	7,200	2,652.00	19,094,400	
ナック	4,100	934.00	3,829,400	
福井コンピュータホールディングス	2,400	3,380.00	8,112,000	
ダイセキ	9,800	3,030.00	29,694,000	
ステップ	2,500	1,602.00	4,005,000	
日鉄物産	4,300	3,315.00	14,254,500	
泉州電業	1,700	2,901.00	4,931,700	
元気寿司	1,600	2,334.00	3,734,400	
トラスコ中山	13,800	2,747.00	37,908,600	

ヤマダホールディングス	183,800	493.00	90,613,400	
オートバックスセブン	22,400	1,335.00	29,904,000	
モリト	5,400	640.00	3,456,000	
アークランドサカモト	9,400	1,811.00	17,023,400	
ニトリホールディングス	26,100	21,085.00	550,318,500	
グルメ杵屋	4,300	1,010.00	4,343,000	
愛眼	16,400	227.00	3,722,800	
吉野家ホールディングス	19,800	1,948.00	38,570,400	
加藤産業	8,700	3,575.00	31,102,500	
イノテック	3,800	892.00	3,389,600	
イエローハット	11,400	1,621.00	18,479,400	
松屋フーズホールディングス	2,900	3,455.00	10,019,500	
ＪＢＣＣホールディングス	4,100	1,462.00	5,994,200	
ＪＫホールディングス	5,500	824.00	4,532,000	
サガミホールディングス	8,100	1,267.00	10,262,700	
日伝	5,500	2,375.00	13,062,500	
関西スーパーマーケット	5,000	1,239.00	6,195,000	
ミロク情報サービス	5,300	2,063.00	10,933,900	
北沢産業	12,700	276.00	3,505,200	
杉本商事	3,300	2,279.00	7,520,700	
因幡電機産業	17,200	2,501.00	43,017,200	
王将フードサービス	4,400	5,960.00	26,224,000	
プレナス	6,800	1,715.00	11,662,000	
ミニストップ	4,500	1,402.00	6,309,000	
アークス	12,300	2,232.00	27,453,600	
バローホールディングス	13,300	2,581.00	34,327,300	
東テク	2,000	2,529.00	5,058,000	
ミスミグループ本社	75,600	3,255.00	246,078,000	
ベルク	3,000	6,270.00	18,810,000	
大　庄	3,300	1,024.00	3,379,200	
タキヒヨー	2,100	1,917.00	4,025,700	
ファーストリテイリング	8,100	81,130.00	657,153,000	
ソフトバンクグループ	476,900	6,749.00	3,218,598,100	
蔵王産業	2,600	1,353.00	3,517,800	
スズケン	25,600	3,935.00	100,736,000	
サンドラッグ	22,700	4,190.00	95,113,000	
サックスバー　ホールディングス	6,600	552.00	3,643,200	
ジェコス	4,200	939.00	3,943,800	
やまや	1,700	2,147.00	3,649,900	
ベルーナ	12,900	916.00	11,816,400	
合計	65,082,900		148,120,912,010	

② 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。

「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	785,869,477	900,689,151
金銭信託	98,970,113	18,805,944
コール・ローン	3,980,538,915	4,121,466,201
株式	199,297,460,924	285,514,371,822
投資証券	5,434,364,911	6,689,318,591
派生商品評価勘定	212,899,978	541,982,561
未収入金	48,299,571	1,302,477
未収配当金	290,269,135	314,895,056
差入委託証拠金	1,858,544,563	4,508,205,897
流動資産合計	212,007,217,587	302,611,037,700
資産合計	212,007,217,587	302,611,037,700
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,913,084	39,308,980
未払金	3,148,485	282,483
未払解約金	951,945,848	1,647,606,579
その他未払費用	23,905	6,093
流動負債合計	964,031,322	1,687,204,135
負債合計	964,031,322	1,687,204,135
純資産の部		
元本等		
元本	110,982,930,759	145,169,780,539
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	100,060,255,506	155,754,053,026
純資産合計	211,043,186,265	300,923,833,565
負債純資産合計	212,007,217,587	302,611,037,700

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。 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。
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。 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。
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。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	110,982,930,759口	145,169,780,539口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9016円 (19,016円)	2.0729円 (20,729円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	14,047,876,149	47,693,053,356
投資証券	257,545,307	827,754,816
合計	14,305,421,456	48,520,808,172

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	280,684,290	－	281,182,580	△498,290	1,029,325,674	－	1,020,040,130	9,285,544
アメリカ・ドル	210,740,750	－	210,896,350	△155,600	764,144,472	－	755,955,200	8,189,272
イギリス・ポンド	21,234,187	－	21,311,920	△77,733	80,589,892	－	80,525,250	64,642
ユーロ	48,709,353	－	48,974,310	△264,957	184,591,310	－	183,559,680	1,031,630
買　建	3,217,946,194	－	3,211,968,970	△5,977,224	3,299,950,340	－	3,260,641,360	△39,308,980
アメリカ・ドル	2,243,779,726	－	2,236,585,610	△7,194,116	2,319,701,352	－	2,288,114,400	△31,586,952
イギリス・ポンド	266,133,660	－	266,399,000	265,340	339,662,469	－	335,866,000	△3,796,469
ユーロ	708,032,808	－	708,984,360	951,552	640,586,519	－	636,660,960	△3,925,559
合計	3,498,630,484	－	3,493,151,550	△6,475,514	4,329,276,014	－	4,280,681,490	△30,023,436

（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。

①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。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買　建	5,816,144,283	－	6,026,606,691	210,462,408	7,785,858,218	－	8,318,555,236	532,697,018
合計	5,816,144,283	－	6,026,606,691	210,462,408	7,785,858,218	－	8,318,555,236	532,697,018

（注）１．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
３．評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
４．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	88,596,175,879円	110,982,930,759円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	43,121,658,246円	65,821,989,117円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	20,734,903,366円	31,635,139,337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）	705,419,292円	854,059,755円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,284,755,401円	3,771,468,504円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,471,314,789円	2,859,153,135円
ニッセイ外国株式インデックスＳＡ（適格機関投資家限定）	1,485,332,737円	1,680,106,235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）	4,090,937円	2,902,320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）	23,976,047円	16,628,124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）	32,048,288円	20,292,993円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	11,371,888,952円	11,039,104,952円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国株式インデックスファンド	75,325,693,121円	101,174,107,029円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	15,291,138,731円	20,965,866,221円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	605,358,530円	986,387,028円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	59,931,201円	98,693,841円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	72,703,499円	133,359,257円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	39,305,684円	98,739,969円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	79,667,845円	218,778,176円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	22,747,558円	48,776,845円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	40,031,114円	52,991,843円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	24,696,756円	5,819,342円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	3,481,454円	5,624,058円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	995,057円	1,588,705円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	16,196,854円	18,159,475円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	4,212,091円	26,453,761円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	3,974,678円	20,935,466円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	6,685,873円	70,913,550円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	7,284,270円	104,875,929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	263,829,859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	303,405,272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	49,172,147円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	－円	277,586,748円
計	110,982,930,759円	145,169,780,539円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 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	36,346	171.61	6,237,337.06	
	ABBOTT LABORATORIES	111,742	111.00	12,403,362.00	
	ABBVIE INC	111,613	99.67	11,124,467.71	
	ABIOMED INC	2,829	270.61	765,555.69	
	ACCENTURE PLC	40,187	243.20	9,773,478.40	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	48,603	75.93	3,690,425.79	
	ADOBE INC	30,412	466.41	14,184,460.92	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,356	146.08	636,324.48	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	73,971	85.54	6,327,479.34	
	AERCAP HOLDINGS NV	8,154	39.00	318,006.00	
	AES CORP	42,419	20.88	885,708.72	
	AFLAC INC	42,785	43.72	1,870,560.20	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,542	108.68	2,123,824.56	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,943	270.36	3,769,629.48	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,202	101.50	1,035,503.00	
	ALBEMARLE CORP	6,701	125.80	842,985.80	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,885	122.05	1,694,664.25	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,716	441.35	2,081,406.60	
	ALLEGHANY CORP	881	600.07	528,661.67	
	ALLEGION PLC	5,889	114.13	672,111.57	
	ALLIANT ENERGY CORP	15,799	52.47	828,973.53	
	ALLSTATE CORP	19,682	100.37	1,975,482.34	
	ALLY FINANCIAL INC	23,695	29.89	708,243.55	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,285	123.81	901,955.85	
	ALPHABET INC-CL A	18,796	1,758.57	33,054,081.72	
	ALPHABET INC-CL C	19,253	1,763.92	33,960,751.76	
	ALTICE USA INC- A	19,643	31.85	625,629.55	
	ALTRIA GROUP INC	117,553	40.06	4,709,173.18	
	AMAZON.COM INC	26,776	3,117.02	83,461,327.52	
	AMCOR PLC	100,109	11.92	1,193,299.28	
	AMERCO	667	404.43	269,754.81	
	AMEREN CORPORATION	15,594	78.35	1,221,789.90	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	31,351	82.45	2,584,889.95	
	AMERICAN EXPRESS CO	43,306	114.14	4,942,946.84	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,794	89.02	426,761.88	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	54,399	38.54	2,096,537.46	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,444	156.65	1,792,702.60	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,668	183.63	1,408,074.84	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	9,637	101.90	982,010.30	
	AMETEK INC	14,476	118.18	1,710,773.68	
	AMGEN INC	37,156	224.67	8,347,838.52	

AMPHENOL CORP-CL A	18,719	127.20	2,381,056.80	
ANALOG DEVICES INC	23,320	136.17	3,175,484.40	
ANSYS INC	5,393	324.12	1,747,979.16	
ANTHEM INC	15,907	311.85	4,960,597.95	
AON PLC	14,594	202.92	2,961,414.48	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10,924	44.70	488,302.80	
APPLE INC	1,094,972	118.64	129,907,478.08	
APPLIED MATERIALS INC	57,755	77.25	4,461,573.75	
APTIV PLC	16,978	115.36	1,958,582.08	
ARAMARK	14,465	35.26	510,035.90	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,436	34.87	886,953.32	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	35,012	48.92	1,712,787.04	
ARISTA NETWORKS INC	3,578	272.87	976,328.86	
ARROW ELECTRONICS INC	4,945	88.44	437,335.80	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,981	116.04	1,390,275.24	
ASSURANT INC	3,756	134.92	506,759.52	
AT&T INC	450,444	28.28	12,738,556.32	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	7,741	43.02	333,017.82	
ATMOS ENERGY CORP	7,691	95.10	731,414.10	
AUTODESK INC	13,840	256.88	3,555,219.20	
AUTOLIV INC	5,302	89.82	476,225.64	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	27,179	173.63	4,719,089.77	
AUTOZONE INC	1,473	1,133.76	1,670,028.48	
AVALARA INC	5,019	164.05	823,366.95	
AVANTOR INC	29,209	26.59	776,667.31	
AVERY DENNISON CORP	5,268	147.03	774,554.04	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	13,553	28.24	382,736.72	
BAKER HUGHES COMPANY	41,719	18.31	763,874.89	
BALL CORP	20,658	97.91	2,022,624.78	
BANK OF AMERICA CORP	492,828	26.98	13,296,499.44	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	50,256	38.49	1,934,353.44	
BAXTER INTERNATIONAL INC	32,117	78.88	2,533,388.96	
BECTON DICKINSON & CO	18,310	232.90	4,264,399.00	
BEIGENE LTD-ADR	2,563	281.91	722,535.33	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	87,794	229.53	20,151,356.82	
BEST BUY CO INC	14,646	118.83	1,740,384.18	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,384	574.38	794,941.92	
BIOGEN INC	10,272	244.01	2,506,470.72	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,395	75.13	856,106.35	
BLACK KNIGHT INC	9,466	93.88	888,668.08	
BLACKROCK INC	9,612	673.48	6,473,489.76	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	42,376	58.64	2,484,928.64	
BOEING CO	33,898	205.67	6,971,801.66	
BOOKING HOLDINGS INC	2,582	2,010.97	5,192,324.54	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,729	88.15	769,461.35	
BORGWARNER INC	13,088	37.71	493,548.48	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	90,246	34.21	3,087,315.66	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142,980	62.09	8,877,628.20	
BROADCOM INC	25,279	384.33	9,715,478.07	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,261	146.60	1,064,462.60	
BROWN & BROWN INC	15,082	47.44	715,490.08	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	19,510	80.14	1,563,531.40	
BUNGE LIMITED	9,163	58.53	536,310.39	
BURLINGTON STORES INC	4,179	233.09	974,083.11	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,693	93.77	815,142.61	
CABLE ONE INC	307	1,984.50	609,241.50	
CABOT OIL & GAS CORP	24,903	17.18	427,833.54	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	17,501	112.60	1,970,612.60	
CAMPBELL SOUP CO	11,474	49.32	565,897.68	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	28,824	84.99	2,449,751.76	
CARDINAL HEALTH INC	18,572	52.29	971,129.88	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,940	27.80	248,532.00	
CARMAX INC	10,323	94.53	975,833.19	
CARNIVAL CORP	30,180	18.19	548,974.20	
CARRIER GLOBAL CORP	52,006	39.13	2,034,994.78	
CATALENT INC	9,848	104.16	1,025,767.68	
CATERPILLAR INC	34,206	172.90	5,914,217.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,928	89.91	622,896.48	
CBRE GROUP INC	21,251	58.47	1,242,545.97	
CDK GLOBAL INC	7,736	47.78	369,626.08	
CDW CORP/DE	9,021	132.78	1,197,808.38	
CELANESE CORP-SERIES A	7,484	133.55	999,488.20	
CENTENE CORP	36,599	63.61	2,328,062.39	
CENTERPOINT ENERGY INC	32,178	23.43	753,930.54	
CENTURYLINK INC	59,786	9.82	587,098.52	
CERNER CORP	19,081	72.87	1,390,432.47	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,583	32.15	436,693.45	
CHARLES SCHWAB CORP	91,554	47.08	4,310,362.32	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,145	650.54	5,949,188.30	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7,175	119.18	855,116.50	
CHENIERE ENERGY INC	14,355	55.27	793,400.85	
CHEVRON CORP	117,889	85.73	10,106,623.97	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,671	1,310.46	2,189,778.66	
CHUBB LTD	28,492	147.37	4,198,866.04	
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,552	86.20	1,340,582.40	
CIGNA CORP	23,286	204.74	4,767,575.64	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,701	78.35	760,073.35	
CINTAS CORP	5,588	367.89	2,055,769.32	
CISCO SYSTEMS INC	266,577	41.17	10,974,975.09	
CITIGROUP INC	131,459	52.14	6,854,272.26	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	26,926	32.81	883,442.06	
CITRIX SYSTEMS INC	7,372	120.77	890,316.44	

CLOROX CO	7,963	202.47	1,612,268.61	
CME GROUP INC	22,659	165.93	3,759,807.87	
CMS ENERGY CORP	18,219	60.58	1,103,707.02	
COCA-COLA CO	257,822	53.13	13,698,082.86	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	13,082	42.53	556,377.46	
COGNEX CORP	10,798	71.36	770,545.28	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	34,058	76.20	2,595,219.60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	51,465	85.38	4,394,081.70	
COMCAST CORP	287,665	49.48	14,233,664.20	
COMERICA INC	8,864	50.93	451,443.52	
CONAGRA BRANDS INC	30,743	36.19	1,112,589.17	
CONCHO RESOURCES INC	12,328	57.24	705,654.72	
CONOCOPHILLIPS	67,449	39.47	2,662,212.03	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,105	77.10	1,627,195.50	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,607	204.21	2,166,055.47	
COOPER COS INC/THE	3,362	332.23	1,116,957.26	
COPART INC	13,310	113.83	1,515,077.30	
CORNING INC	48,086	36.33	1,746,964.38	
CORTEVA INC	47,165	36.96	1,743,218.40	
COSTAR GROUP INC	2,484	894.75	2,222,559.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	27,867	383.54	10,688,109.18	
COUPA SOFTWARE INC	4,217	314.05	1,324,348.85	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,011	143.76	1,295,421.36	
CROWN HOLDINGS INC	8,567	96.23	824,402.41	
CSX CORP	48,820	91.70	4,476,794.00	
CUMMINS INC	9,292	233.14	2,166,336.88	
CVS HEALTH CORP	82,553	66.06	5,453,451.18	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,483	108.31	268,933.73	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	22,800	4.35	99,180.00	
DANAHER CORP	40,283	225.83	9,097,109.89	
DARDEN RESTAURANTS INC	8,192	109.80	899,481.60	
DATADOG INC - CLASS A	8,334	88.89	740,809.26	
DAVITA INC	5,355	107.63	576,358.65	
DEERE & CO	18,800	255.59	4,805,092.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	15,243	68.50	1,044,145.50	
DELTA AIR LINES INC	10,116	37.91	383,497.56	
DENTSPLY SIRONA INC	13,850	48.87	676,849.50	
DEXCOM INC	5,835	330.64	1,929,284.40	
DIAMONDBACK ENERGY INC	9,880	39.44	389,667.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,502	76.76	1,496,973.52	
DISCOVERY INC-A	9,654	25.02	241,591.35	
DISCOVERY INC-C	20,779	22.52	468,046.97	
DISH NETWORK CORP	15,412	33.96	523,391.52	
DOCUSIGN INC	10,992	219.70	2,414,942.40	
DOLLAR GENERAL CORP	15,898	211.21	3,357,816.58	
DOLLAR TREE INC	14,974	94.55	1,415,791.70	
DOMINION ENERGY INC	53,075	79.76	4,233,262.00	
DOMINO'S PIZZA INC	2,466	385.04	949,508.64	
DOVER CORP	9,112	124.68	1,136,084.16	
DOW INC	46,937	55.34	2,597,493.58	
DR HORTON INC	21,814	75.10	1,638,231.40	

DROPBOX INC-CLASS A	15,701	18.92	297,062.92	
DTE ENERGY COMPANY	12,245	129.66	1,587,686.70	
DUKE ENERGY CORP	46,526	91.70	4,266,434.20	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,403	62.05	2,879,306.15	
DYNATRACE INC	11,562	35.96	415,769.52	
EAST WEST BANCORP INC	8,750	43.37	379,487.50	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,584	96.51	828,441.84	
EATON CORP PLC	25,283	118.12	2,986,427.96	
EBAY INC	44,257	49.78	2,203,113.46	
ECOLAB INC	16,100	210.93	3,395,973.00	
EDISON INTERNATIONAL	23,974	63.62	1,525,225.88	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,066	85.24	3,329,985.84	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	25,252	29.50	744,934.00	
ELECTRONIC ARTS INC	18,177	120.14	2,183,784.78	
ELI LILLY & CO	54,422	143.41	7,804,659.02	
EMERSON ELECTRIC CO	37,733	77.24	2,914,496.92	
ENTERGY CORP	12,743	108.97	1,388,604.71	
EOG RESOURCES INC	36,515	45.46	1,659,971.90	
EPAM SYSTEMS INC	3,512	334.58	1,175,044.96	
EQUIFAX INC	7,697	173.61	1,336,276.17	
EQUITABLE HOLDINGS INC	25,577	24.72	632,263.44	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,600	241.37	386,192.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	14,808	43.06	637,632.48	
ESTEE LAUDER COS INC	14,198	241.92	3,434,780.16	
EVEREST RE GROUP LTD	2,498	233.83	584,107.34	
EVERGY INC	14,447	53.69	775,659.43	
EVERSOURCE ENERGY	21,301	88.19	1,878,535.19	
EXACT SCIENCES CORP	9,512	113.18	1,076,568.16	
EXELON CORP	61,616	42.35	2,609,437.60	
EXPEDIA GROUP INC	8,581	123.96	1,063,700.76	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	10,580	90.28	955,162.40	
EXXON MOBIL CORP	267,050	37.40	9,987,670.00	
F5 NETWORKS INC	3,798	160.20	608,439.60	
FACEBOOK INC-A	151,844	272.94	41,444,301.36	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,372	317.96	754,201.12	
FAIR ISAAC CORP	1,837	479.30	880,474.10	
FASTENAL CO	35,993	47.98	1,726,944.14	
FEDEX CORP	15,780	279.85	4,416,033.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17,437	35.70	622,500.90	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39,076	147.70	5,771,525.20	
FIFTH THIRD BANCORP	45,054	25.88	1,165,997.52	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,825	132.24	1,431,498.00	
FIRSTENERGY CORP	34,636	29.04	1,005,829.44	
FISERV INC	35,996	113.02	4,068,267.92	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,288	260.28	1,376,360.64	
FLIR SYSTEMS INC	8,212	37.59	308,689.08	
FMC CORP	8,198	115.32	945,393.36	
FORD MOTOR CO	247,521	8.82	2,183,135.22	

FORTINET INC	8,671	117.03	1,014,767.13	
FORTIVE CORP	19,172	71.33	1,367,538.76	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8,731	85.11	743,095.41	
FOX CORP - CLASS A	20,885	27.71	578,723.35	
FOX CORP- CLASS B	11,551	27.27	314,995.77	
FRANKLIN RESOURCES INC	18,382	20.85	383,264.70	
FREEPORT-MCMORAN INC	91,594	21.11	1,933,549.34	
GARMIN LTD	9,018	114.29	1,030,667.22	
GARTNER INC	5,701	152.27	868,091.27	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,417	149.99	2,312,395.83	
GENERAL ELECTRIC CO	552,846	9.66	5,340,492.36	
GENERAL MILLS INC	38,250	62.00	2,371,500.00	
GENERAL MOTORS CO	81,419	42.82	3,486,361.58	
GENUINE PARTS CO	9,171	98.00	898,758.00	
GILEAD SCIENCES INC	79,223	60.63	4,803,290.49	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,927	190.55	3,606,539.85	
GLOBE LIFE INC	6,277	93.35	585,957.95	
GODADDY INC - CLASS A	10,513	76.34	802,562.42	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,613	224.57	4,629,061.41	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,258	118.22	621,600.76	
HALLIBURTON CO	55,394	16.00	886,304.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	22,409	46.24	1,036,192.16	
HASBRO INC	8,277	91.75	759,414.75	
HCA HEALTHCARE INC	17,061	150.85	2,573,651.85	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10,149	55.80	566,314.20	
HEICO CORP	2,741	133.17	365,018.97	
HEICO CORP-CLASS A	4,562	117.43	535,715.66	
HENRY SCHEIN INC	8,898	63.50	565,023.00	
HERSHEY CO/THE	9,328	149.40	1,393,603.20	
HESS CORP	17,454	47.07	821,559.78	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	80,614	10.49	845,640.86	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,490	102.80	1,797,972.00	
HOLOGIC INC	16,281	70.01	1,139,832.81	
HOME DEPOT INC	67,942	270.93	18,407,526.06	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44,343	202.72	8,989,212.96	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	77,700	4.22	327,894.00	
HORMEL FOODS CORP	18,530	49.99	926,314.70	
HOWMET AEROSPACE INC	24,766	23.57	583,734.62	
HP INC	90,276	20.50	1,850,658.00	
HUMANA INC	8,340	407.17	3,395,797.80	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	64,517	11.95	770,978.15	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,544	162.21	412,662.24	
IAC/INTERACTIVECORP	5,008	139.13	696,763.04	
IDEX CORP	4,754	196.07	932,116.78	
IDEXX LABORATORIES INC	5,364	457.19	2,452,367.16	
IHS MARKIT LTD	24,063	92.45	2,224,624.35	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	19,979	206.89	4,133,455.31	
ILLUMINA INC	9,287	299.00	2,776,813.00	
INCYTE CORP	11,653	81.69	951,933.57	

INGERSOLL-RAND INC	22,380	44.20	989,196.00	
INGREDION INC	4,177	76.16	318,120.32	
INSULET CORP	4,152	264.24	1,097,124.48	
INTEL CORP	267,302	45.62	12,194,317.24	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34,551	100.90	3,486,195.90	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	56,130	117.18	6,577,313.40	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	5,425	111.95	607,328.75	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,617	49.23	1,162,664.91	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	25,165	21.59	543,312.35	
INTUIT INC	16,445	361.44	5,943,880.80	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,359	733.95	5,401,138.05	
INVESCO LTD	24,471	15.96	390,557.16	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	8,396	50.45	423,578.20	
IPG PHOTONICS CORP	2,332	201.00	468,732.00	
IQVIA HOLDINGS INC	12,128	169.55	2,056,302.40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,819	161.52	778,364.88	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,248	105.15	867,277.20	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	14,000	51.22	717,080.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	14,200	24.47	347,474.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,442	143.66	494,477.72	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,528	133.78	739,535.84	
JM SMUCKER CO	7,164	117.05	838,546.20	
JOHNSON & JOHNSON	166,372	147.14	24,479,976.08	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	47,246	45.71	2,159,614.66	
JONES LANG LASALLE INC	3,271	134.23	439,066.33	
JPMORGAN CHASE & CO	192,382	115.56	22,231,663.92	
JUNIPER NETWORKS INC	20,803	21.94	456,417.82	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,108	189.06	1,154,778.48	
KELLOGG CO	16,246	65.21	1,059,401.66	
KEURIG DR PEPPER INC	22,502	29.76	669,659.52	
KEYCORP	61,968	15.62	967,940.16	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,762	117.96	1,387,445.52	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,548	141.74	3,054,213.52	
KINDER MORGAN INC	128,852	14.40	1,855,468.80	
KKR & CO INC -A	31,833	38.47	1,224,615.51	
KLA CORPORATION	9,795	243.75	2,387,531.25	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	8,402	42.09	353,640.18	
KRAFT HEINZ CO/THE	42,412	31.88	1,352,094.56	
KROGER CO	49,467	32.76	1,620,538.92	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13,640	195.76	2,670,166.40	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	6,138	198.77	1,220,050.26	
LAM RESEARCH CORP	9,162	437.68	4,010,024.16	

LAMB WESTON HOLDING INC	9,299	71.60	665,808.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	21,734	58.56	1,272,743.04	
LEAR CORP	3,599	140.07	504,111.93	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,563	100.34	859,211.42	
LENNAR CORP-CL A	17,389	76.30	1,326,780.70	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,200	298.51	656,722.00	
LIBERTY BROADBAND-A	1,510	157.14	237,281.40	
LIBERTY BROADBAND-C	6,927	157.90	1,093,773.30	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,531	23.06	288,964.86	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	22,563	22.34	504,057.42	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	5,379	42.86	230,543.94	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11,223	42.94	481,915.62	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	13,015	41.13	535,306.95	
LINCOLN NATIONAL CORP	11,994	44.62	535,172.28	
LINDE PLC	33,208	253.07	8,403,948.56	
LIVE NATION INC	10,350	66.91	692,518.50	
LKQ CORP	18,204	35.33	643,147.32	
LOCKHEED MARTIN CORP	15,940	376.46	6,000,772.40	
LOEWS CORP	15,974	42.82	684,006.68	
LOWE'S COS INC	47,694	149.60	7,135,022.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,821	344.60	2,695,116.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,920	82.23	1,391,331.60	
M&T BANK CORP	8,003	120.46	964,041.38	
MARATHON PETROLEUM CORP	41,217	39.08	1,610,760.36	
MARKEL CORP	868	1,008.32	875,221.76	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,385	534.22	1,274,114.70	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	17,417	121.11	2,109,372.87	
MARSH & MCLENNAN COS INC	32,285	114.48	3,695,986.80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,929	269.55	1,059,061.95	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	42,027	44.18	1,856,752.86	
MASCO CORP	16,654	55.24	919,966.96	
MASIMO CORPORATION	3,234	246.47	797,083.98	
MASTERCARD INC-CLASS A	56,450	333.88	18,847,526.00	
MATCH GROUP INC	15,543	132.31	2,056,494.33	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	16,845	81.18	1,367,477.10	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,824	183.24	1,433,669.76	
MCDONALD'S CORP	46,993	215.11	10,108,664.23	
MCKESSON CORP	10,206	171.94	1,754,819.64	
MEDTRONIC PLC	84,694	111.00	9,401,034.00	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	13,643	18.77	256,079.11	
MERCADOLIBRE INC	2,826	1,370.30	3,872,467.80	
MERCK & CO INC	159,425	80.39	12,816,175.75	

METLIFE INC	48,382	45.51	2,201,864.82	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,511	1,147.34	1,733,630.74	
MGM MIRAGE	29,412	27.24	801,182.88	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,547	127.51	1,982,397.97	
MICRON TECHNOLOGY INC	70,126	61.83	4,335,890.58	
MICROSOFT CORP	454,990	212.42	96,648,975.80	
MODERNA INC	17,199	92.77	1,595,551.23	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,847	126.98	488,492.06	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,731	209.18	780,450.58	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	11,954	44.04	526,454.16	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	90,114	57.60	5,190,566.40	
MONGODB INC	3,046	255.11	777,065.06	
MONSTER BEVERAGE CORP	24,819	83.73	2,078,094.87	
MOODY'S CORP	10,662	274.12	2,922,667.44	
MORGAN STANLEY	89,000	58.63	5,218,070.00	
MOSAIC CO/THE	22,875	19.58	447,892.50	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,766	169.16	1,821,176.56	
MSCI INC	5,372	400.79	2,153,043.88	
NASDAQ INC	7,195	124.76	897,648.20	
NATIONAL-OILWELL INC	24,508	12.31	301,693.48	
NETAPP INC	13,950	51.98	725,121.00	
NETFLIX INC	27,780	484.67	13,464,132.60	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,561	87.45	486,309.45	
NEWELL BRANDS INC	25,641	20.39	522,819.99	
NEWMONT CORP	50,624	61.41	3,108,819.84	
NEWS CORP - CLASS A	24,616	17.55	432,010.80	
NEXTERA ENERGY INC	123,704	75.13	9,293,881.52	
NIELSEN HOLDINGS PLC	22,710	16.07	364,949.70	
NIKE INC	78,376	131.91	10,338,578.16	
NISOURCE INC	24,747	23.60	584,029.20	
NORDSON CORP	3,459	202.31	699,790.29	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,342	242.10	3,956,398.20	
NORTHERN TRUST CORP	12,483	93.36	1,165,412.88	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,999	309.48	3,094,490.52	
NORTONLIFELOCK INC	35,280	18.67	658,677.60	
NRG ENERGY INC	15,209	30.97	471,022.73	
NUCOR CORP	18,900	52.83	998,487.00	
NVIDIA CORP	38,840	537.61	20,880,772.40	
NVR INC	221	4,215.53	931,632.13	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,632	151.35	2,668,603.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,684	451.39	2,114,310.76	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,976	13.36	761,199.36	
OGE ENERGY CORP	12,879	33.48	431,188.92	
OKTA INC	7,352	232.45	1,708,972.40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,086	205.53	1,250,855.58	
OMNICOM GROUP	13,690	59.39	813,049.10	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	26,010	27.85	724,378.50	
ONEOK INC	27,896	33.30	928,936.80	
ORACLE CORP	129,452	56.45	7,307,565.40	
OTIS WORLDWIDE CORP	26,016	66.16	1,721,218.56	

OWENS CORNING	6,863	72.45	497,224.35	
PACCAR INC	21,866	90.04	1,968,814.64	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,977	129.80	775,814.60	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,104	287.52	1,755,022.08	
PARKER HANNIFIN CORP	8,106	268.84	2,179,217.04	
PAYCHEX INC	20,411	92.08	1,879,444.88	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,148	392.64	1,236,030.72	
PAYPAL HOLDINGS INC	70,445	190.90	13,447,950.50	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,373	105.26	1,302,381.98	
PENTAIR PLC	10,412	53.27	554,647.24	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	26,387	12.86	339,336.82	
PEPSICO INC	87,656	143.32	12,562,857.92	
PERKINELMER INC	7,052	130.81	922,472.12	
PERRIGO CO PLC	8,594	48.81	419,473.14	
PFIZER INC	350,810	36.19	12,695,813.90	
PG&E CORP	67,604	12.29	830,853.16	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	98,410	77.51	7,627,759.10	
PHILLIPS 66	27,531	61.45	1,691,779.95	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,146	83.55	597,048.30	
PINTEREST INC- CLASS A	25,474	65.95	1,680,010.30	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,295	96.63	994,805.85	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,804	130.30	3,492,561.20	
PPG INDUSTRIES INC	14,903	143.22	2,134,407.66	
PPL CORPORATION	48,797	29.23	1,426,336.31	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17,234	48.93	843,259.62	
PROCTER & GAMBLE CO	156,371	139.53	21,818,445.63	
PROGRESSIVE CORP	36,912	94.27	3,479,694.24	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,000	75.79	1,894,750.00	
PTC INC	6,935	100.21	694,956.35	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,010	57.62	1,844,416.20	
PULTE GROUP INC	16,959	43.63	739,921.17	
QORVO INC	7,216	146.86	1,059,741.76	
QUALCOMM INC	71,053	147.53	10,482,449.09	
QUEST DIAGNOSTICS	8,441	122.81	1,036,639.21	
RALPH LAUREN CORP	3,028	80.59	244,026.52	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,691	89.20	686,037.20	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	95,680	71.11	6,803,804.80	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,360	514.71	3,273,555.60	
REGIONS FINANCIAL CORP	60,341	15.46	932,871.86	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4,256	117.44	499,824.64	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,129	176.38	551,893.02	
REPUBLIC SERVICES INC	14,198	99.91	1,418,522.18	
RESMED INC	9,125	211.76	1,932,310.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,627	296.90	1,373,756.30	

ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	7,152	62.32	445,712.64	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,333	250.14	1,834,276.62	
ROKU INC	6,445	255.67	1,647,793.15	
ROLLINS INC	9,294	58.70	545,557.80	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,593	409.48	2,699,701.64	
ROSS STORES INC	22,449	110.20	2,473,879.80	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,237	74.44	836,482.28	
RPM INTERNATIONAL INC	8,224	89.17	733,334.08	
S&P GLOBAL INC	15,212	338.63	5,151,239.56	
SALESFORCE.COM INC	56,811	264.65	15,035,031.15	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,713	134.42	633,521.46	
SCHLUMBERGER LTD	87,829	20.46	1,796,981.34	
SEAGATE TECHNOLOGY	14,590	55.92	815,872.80	
SEAGEN INC	7,667	174.37	1,336,894.79	
SEALED AIR CORP	9,881	44.80	442,668.80	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,626	54.29	414,015.54	
SEMPRA ENERGY	18,512	130.25	2,411,188.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,000	47.90	479,000.00	
SERVICENOW INC	12,038	514.33	6,191,504.54	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,173	728.73	3,769,720.29	
SIGNATURE BANK	3,316	106.02	351,562.32	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	70,495	6.41	451,872.95	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,502	139.36	1,463,558.72	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	24,218	27.73	671,565.14	
SMITH (A.O.) CORP	8,533	56.60	482,967.80	
SNAP INC - A	56,425	42.29	2,386,213.25	
SNAP-ON INC	3,219	171.72	552,766.68	
SOUTHERN CO	66,936	61.07	4,087,781.52	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,108	46.08	419,696.64	
SPLUNK INC	10,048	199.28	2,002,365.44	
SQUARE INC - A	22,937	191.66	4,396,105.42	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,655	68.59	1,005,186.45	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,746	186.51	1,817,726.46	
STARBUCKS CORP	73,788	97.76	7,213,514.88	
STATE STREET CORP	22,158	69.27	1,534,884.66	
STEEL DYNAMICS INC	13,138	35.82	470,603.16	
STERIS PLC	5,354	194.73	1,042,584.42	
STRYKER CORP	21,356	233.57	4,988,120.92	
SVB FINANCIAL GROUP	3,216	354.67	1,140,618.72	
SYNCHRONY FINANCIAL	33,284	30.05	1,000,184.20	
SYNOPSYS INC	9,481	221.28	2,097,955.68	
SYSCO CORP	30,509	71.99	2,196,342.91	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,218	139.53	1,983,837.54	
T-MOBILE US INC	35,224	129.19	4,550,588.56	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,184	165.58	1,189,526.72	
TARGET CORP	31,566	171.37	5,409,465.42	
TE CONNECTIVITY LTD	20,829	111.34	2,319,100.86	
TELADOC HEALTH INC	4,474	191.19	855,384.06	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,316	390.82	905,139.12	
TELEFLEX INC	2,942	372.27	1,095,218.34	
TERADYNE INC	10,390	106.47	1,106,223.30	
TESLA, INC.	46,861	499.27	23,396,291.47	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	69,203	9.35	647,048.05	
TEXAS INSTRUMENTS INC	57,948	157.27	9,113,481.96	
TEXTRON INC	14,266	45.45	648,389.70	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,946	453.10	11,303,032.60	
TIFFANY & CO	6,886	131.53	905,715.58	
TJX COS INC	75,697	61.56	4,659,907.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,292	131.25	957,075.00	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	2,586	805.92	2,084,109.12	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,271	58.75	309,671.25	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,151	146.79	2,224,015.29	
TRANSDIGM GROUP INC	3,258	590.65	1,924,337.70	
TRANSUNION	12,070	96.32	1,162,582.40	
TRAVELERS COS INC/THE	15,908	133.87	2,129,603.96	
TRIMBLE INC	15,792	57.74	911,830.08	
TRUIST FINANCIAL CORP	85,307	46.90	4,000,898.30	
TWILIO INC - A	7,731	295.64	2,285,592.84	
TWITTER INC	49,603	43.62	2,163,682.86	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,502	414.38	1,036,778.76	
TYSON FOODS INC-CL A	18,581	62.34	1,158,339.54	
UBER TECHNOLOGIES INC	60,567	49.26	2,983,530.42	
UGI CORP	13,314	36.04	479,836.56	
ULTA BEAUTY INC	3,375	274.86	927,652.50	
UNION PACIFIC CORP	43,123	204.55	8,820,809.65	
UNITED PARCEL SERVICE INC	44,557	166.48	7,417,849.36	
UNITED RENTALS INC	4,537	217.00	984,529.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,883	337.00	20,180,571.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4,872	133.95	652,604.40	
US BANCORP	85,691	43.24	3,705,278.84	
VAIL RESORTS INC	2,550	276.07	703,978.50	
VALERO ENERGY CORP	25,733	51.21	1,317,786.93	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,720	173.68	993,449.60	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,512	272.57	2,320,115.84	
VERISIGN INC	6,582	197.44	1,299,550.08	
VERISK ANALYTICS INC	9,751	205.72	2,005,975.72	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	261,741	60.21	15,759,425.61	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,336	211.97	3,462,741.92	
VF CORP	20,961	84.96	1,780,846.56	
VIACOMCBS INC	35,692	33.43	1,193,183.56	
VIATRIS INC	75,930	18.11	1,375,092.30	
VISA INC-CLASS A SHARES	106,547	207.57	22,115,960.79	
VISTRA CORP	27,816	18.53	515,430.48	
VMWARE INC-CLASS A	5,296	148.68	787,409.28	
VOYA FINANCIAL INC	8,017	57.54	461,298.18	

	VULCAN MATERIALS CO	8,369	140.11	1,172,580.59	
	WABTEC CORP	11,465	72.35	829,492.75	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,865	37.85	1,773,840.25	
	WALMART INC	89,437	152.12	13,605,156.44	
	WALT DISNEY CO	114,123	141.72	16,173,511.56	
	WASTE CONNECTIONS INC	16,705	106.00	1,770,730.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	26,742	120.58	3,224,550.36	
	WATERS CORP	3,907	226.35	884,349.45	
	WAYFAIR INC- CLASS A	4,067	248.55	1,010,852.85	
	WEC ENERGY GROUP INC	19,942	95.55	1,905,458.10	
	WELLS FARGO & CO	245,927	26.16	6,433,450.32	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,631	281.22	1,302,329.82	
	WESTERN DIGITAL CORP	18,965	42.61	808,098.65	
	WESTERN UNION CO	25,987	21.53	559,500.11	
	WESTROCK CO-WHEN ISSUED	16,277	42.59	693,237.43	
	WEYERHAEUSER CO	47,038	29.02	1,365,042.76	
	WHIRLPOOL CORP	3,927	192.56	756,183.12	
	WILLIAMS COS INC	76,781	20.16	1,547,904.96	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,130	204.49	1,662,503.70	
	WIX.COM LTD	3,272	257.34	842,016.48	
	WORKDAY INC-CLASS A	10,998	230.80	2,538,338.40	
	WR BERKLEY CORP	8,977	66.86	600,202.22	
	WW GRAINGER INC	2,855	422.86	1,207,265.30	
	WYNN RESORTS LTD	6,163	98.75	608,596.25	
	XCEL ENERGY INC	33,219	69.35	2,303,737.65	
	XILINX INC	15,349	132.96	2,040,803.04	
	XPO LOGISTICS INC	5,878	105.93	622,656.54	
	XYLEM INC	11,384	94.37	1,074,308.08	
	YUM! BRANDS INC	18,969	105.27	1,996,866.63	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,343	358.39	1,198,097.77	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	8,852	109.49	969,205.48	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,064	146.53	1,914,267.92	
	ZIONS BANCORP, N.A.	10,041	38.39	385,473.99	
	ZOETIS INC	30,041	166.31	4,996,118.71	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,049	414.29	4,163,200.21	
	ZSCALER INC	4,534	138.54	628,140.36	
アメリカ・ドル 小計		19,709,428		1,971,641,084.84 (204,814,075,893)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	61,215	11.06	677,037.90	
	ADMIRAL GROUP PLC	12,159	29.39	357,353.01	
	ANGLO AMERICAN PLC	77,023	21.20	1,632,887.60	
	ANTOFAGASTA PLC	24,544	10.97	269,247.68	
	ASHTEAD GROUP PLC	28,431	31.33	890,743.23	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22,343	19.99	446,748.28	
	ASTRAZENECA PLC	82,913	81.25	6,736,681.25	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	61,161	5.57	341,156.05	
	AVEVA GROUP PLC	4,142	41.94	173,715.48	
	AVIVA PLC	244,856	3.15	771,296.40	

BAE SYSTEMS PLC	202,982	5.07	1,030,742.59	
BARCLAYS PLC	1,088,864	1.38	1,512,432.09	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,664	6.52	421,867.93	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	7,978	47.69	380,470.82	
BHP GROUP PLC	132,699	16.21	2,151,581.58	
BP PLC	1,283,052	2.43	3,126,797.72	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	144,954	27.80	4,029,721.20	
BT GROUP PLC	563,923	1.28	721,821.44	
BUNZL PLC	21,257	23.80	505,916.60	
BURBERRY GROUP PLC	25,664	16.03	411,393.92	
COCA-COLA HBC AG-CDI	12,686	22.27	282,517.22	
COMPASS GROUP PLC	112,450	13.50	1,518,075.00	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,129	62.48	507,899.92	
DCC PLC	6,238	55.14	343,963.32	
DIAGEO PLC	147,861	29.79	4,405,518.49	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	85,202	3.03	258,673.27	
EVRAZ PLC	31,897	3.77	120,538.76	
EXPERIAN PLC	57,486	29.33	1,686,064.38	
FERGUSON PLC	14,179	80.68	1,143,961.72	
GLAXOSMITHKLINE PLC	317,349	13.95	4,427,018.55	
GLENCORE PLC	629,934	1.90	1,199,394.33	
GVC HOLDINGS PLC	36,765	9.70	356,694.03	
HALMA PLC	23,984	24.23	581,132.32	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,840	14.68	306,035.40	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,859	25.96	281,899.64	
HSBC HOLDINGS PLC	1,286,017	3.83	4,935,733.24	
IMPERIAL BRANDS PLC	59,899	15.05	901,479.95	
INFORMA PLC	96,302	5.82	561,055.45	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	11,028	44.82	494,274.96	
INTERTEK GROUP PLC	10,225	60.32	616,772.00	
JD SPORTS FASHION PLC	27,610	8.01	221,321.76	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,138	24.08	292,283.04	
KINGFISHER PLC	132,143	2.91	384,932.55	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	379,127	2.58	978,147.66	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,452,768	0.35	1,585,185.40	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,027	80.92	1,620,584.84	
M&G PLC	165,075	1.93	318,594.75	
MELROSE INDUSTRIES PLC	308,256	1.58	487,352.73	
MONDI PLC/WI	30,471	16.85	513,436.35	
MORRISON WM SUPERMARKETS	149,850	1.86	279,020.70	
NATIONAL GRID PLC	222,087	9.33	2,072,071.71	
NATWEST GROUP PLC	303,159	1.56	474,140.67	
NEXT PLC	8,396	66.74	560,349.04	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.00	4.75	
OCADO GROUP PLC	28,932	23.30	674,115.60	
PEARSON PLC	47,506	6.39	303,563.34	
PERSIMMON PLC	20,159	28.95	583,603.05	

	PRUDENTIAL PLC	164,797	12.78	2,106,929.64	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	44,988	67.28	3,026,792.64	
	RELX PLC	122,192	17.76	2,170,740.88	
	RENTOKIL INITIAL PLC	117,631	5.15	606,505.43	
	RIO TINTO PLC	70,706	47.16	3,334,494.96	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	123,768	0.98	121,911.48	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	259,074	12.26	3,176,247.24	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	233,596	11.82	2,761,571.91	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	64,276	6.76	434,634.31	
	SAGE GROUP PLC	68,645	6.79	466,648.71	
	SAINSBURY (J) PLC	110,620	2.22	245,576.40	
	SCHRODERS PLC	7,825	29.75	232,793.75	
	SEVERN TRENT PLC	15,258	24.52	374,126.16	
	SMITH & NEPHEW PLC	55,102	14.49	798,703.49	
	SMITHS GROUP PLC	25,239	15.30	386,282.89	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,675	115.00	537,625.00	
	SSE PLC	66,218	13.63	902,551.34	
	ST JAMES'S PLACE PLC	33,903	10.85	367,847.55	
	STANDARD CHARTERED PLC	168,190	4.38	737,681.34	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	145,189	2.70	392,155.48	
	TAYLOR WIMPEY PLC	230,069	1.67	385,365.57	
	TESCO PLC	620,495	2.36	1,464,988.69	
	UNILEVER PLC	73,876	44.63	3,297,085.88	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	43,648	9.17	400,252.16	
	VODAFONE GROUP PLC	1,698,190	1.21	2,064,999.04	
	WHITBREAD PLC	12,668	30.57	387,260.76	
	WPP PLC	78,141	7.40	578,868.52	
イギリス・ポンド　小計		18,105,595		94,627,663.88 (13,028,336,763)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	2,769	189.90	525,833.10	
	BANK HAPOALIM BM	71,938	22.28	1,602,778.64	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,902	18.70	1,699,867.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,690	390.00	659,100.00	
	ICL GROUP LTD	44,037	13.85	609,912.45	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	73,010	11.24	820,632.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,152	72.44	662,970.88	
	NICE LTD	3,947	784.00	3,094,448.00	
イスラエル・シュケル　小計		297,445		9,675,542.87 (300,328,850)	
オーストラリア・ドル	AFTERPAY LTD	13,654	97.89	1,336,590.06	
	AGL ENERGY LTD	44,431	12.97	576,270.07	
	AMP LTD	231,650	1.74	403,071.00	
	AMPOL LTD	16,965	28.45	482,654.25	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,340	34.59	1,291,590.60	
	ASX LTD	13,236	81.84	1,083,234.24	
	AURIZON HOLDINGS LTD	141,081	4.04	569,967.24	
	AUSNET SERVICES	151,629	1.87	284,304.37	

	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	183,943	22.45	4,129,520.35	
	BHP GROUP LIMITED	187,576	36.51	6,848,399.76	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,136	17.72	604,889.92	
	BRAMBLES LTD	101,538	10.89	1,105,748.82	
	CIMIC GROUP LIMITED	7,870	23.20	182,584.00	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,232	12.60	481,723.20	
	COCHLEAR LTD	4,452	233.50	1,039,542.00	
	COLES GROUP LTD	87,281	18.04	1,574,549.24	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	113,585	78.87	8,958,448.95	
	COMPUTERSHARE LIMITED	35,518	13.52	480,203.36	
	CROWN RESORTS LTD	28,937	9.46	273,744.02	
	CSL LIMITED	28,907	310.27	8,968,974.89	
	EVOLUTION MINING LTD	107,782	5.53	596,034.46	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	107,989	16.95	1,830,413.55	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	156,261	5.46	853,185.06	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	29,022	40.25	1,168,135.50	
	MACQUARIE GROUP LTD	21,927	138.01	3,026,145.27	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8,504	62.29	529,714.16	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	189,642	2.92	553,754.64	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	206,863	22.70	4,695,790.10	
	NEWCREST MINING LIMITED	52,144	28.31	1,476,196.64	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	48,530	14.14	686,214.20	
	OIL SEARCH LTD	131,899	3.73	491,983.27	
	ORICA LTD	30,090	16.97	510,627.30	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	119,384	4.76	568,267.84	
	QANTAS AIRWAYS LTD	64,209	5.25	337,097.25	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	97,044	10.00	970,440.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	12,781	65.90	842,267.90	
	REA GROUP LTD	3,801	140.55	534,230.55	
	RIO TINTO LTD	23,948	98.92	2,368,936.16	
	SANTOS LTD	117,855	6.00	707,130.00	
	SEEK LTD	23,866	25.43	606,912.38	
	SONIC HEALTHCARE LTD	30,419	34.25	1,041,850.75	
	SOUTH32 LTD	324,968	2.30	747,426.40	
	SUNCORP GROUP LTD	90,302	9.43	851,547.86	
	TABCORP HOLDINGS LTD	158,296	4.10	649,013.60	
	TELSTRA CORP LTD	288,842	3.10	895,410.20	
	TPG TELECOM LTD	28,524	7.69	219,349.56	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	47,547	9.89	470,239.83	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,016	29.21	234,147.36	
	WESFARMERS LIMITED	74,444	49.45	3,681,255.80	
	WESTPAC BANKING CORP	233,732	19.90	4,651,266.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	9,640	30.70	295,948.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	64,843	21.78	1,412,280.54	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	81,354	38.17	3,105,282.18	

オーストラリア・ドル　小計		4,496,429		82,284,505.45 (6,220,708,612)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	15,208	88.20	1,341,345.60	
	AIR CANADA	9,182	21.68	199,065.76	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	38,315	20.14	771,664.10	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	54,234	43.24	2,345,078.16	
	ALTAGAS LTD	17,820	18.03	321,294.60	
	ATCO LTD -CL 'I'	4,950	37.73	186,763.50	
	B2GOLD CORP	64,506	7.42	478,634.52	
	BANK OF MONTREAL	40,464	92.27	3,733,613.28	
	BANK OF NOVA SCOTIA	76,634	62.99	4,827,175.66	
	BARRICK GOLD CORP	112,247	31.56	3,542,515.32	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	20,409	25.64	523,286.76	
	BCE INC	10,656	56.75	604,728.00	
	BLACKBERRY LTD	34,328	7.01	240,639.28	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	84,700	53.32	4,516,204.00	
	CAE INC	16,878	31.00	523,218.00	
	CAMECO CORP	24,609	12.91	317,702.19	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	28,190	109.44	3,085,113.60	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	45,584	142.90	6,513,953.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	74,525	27.93	2,081,483.25	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,734	441.35	3,854,750.90	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,642	160.88	585,924.96	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,568	31.20	267,321.60	
	CANOPY GROWTH CORP	14,548	31.21	454,043.08	
	CCL INDUSTRIES INC -CL B	9,608	58.59	562,932.72	
	CENOVUS ENERGY INC	65,598	6.04	396,211.92	
	CGI INC	14,410	91.46	1,317,938.60	
	CI FINANCIAL CORP	12,964	17.26	223,758.64	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,274	1,551.77	1,976,954.98	
	CRONOS GROUP INC	12,474	9.41	117,380.34	
	DOLLARAMA INC	18,762	49.99	937,912.38	
	EMERA INC	16,065	54.90	881,968.50	
	EMPIRE CO LTD 'A'	10,682	35.89	383,376.98	
	ENBRIDGE INC	128,450	38.07	4,890,091.50	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,703	438.70	747,106.10	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	37,006	16.79	621,330.74	
	FORTIS INC	30,001	53.03	1,590,953.03	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,985	166.81	1,999,217.85	
	GEORGE WESTON LTD	4,919	97.29	478,569.51	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,629	33.78	426,607.62	
	GREAT-WEST LIFECO INC	18,228	30.16	549,756.48	
	HYDRO ONE LTD	21,626	28.47	615,692.22	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,654	57.65	383,603.10	
	IGM FINANCIAL INC	5,434	34.15	185,571.10	

	IMPERIAL OIL LTD	15,961	22.59	360,558.99	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,078	147.81	1,341,819.18	
	INTER PIPELINE LTD	27,062	12.31	333,133.22	
	KEYERA CORP	13,759	21.99	302,560.41	
	KINROSS GOLD CORP	78,465	9.81	769,741.65	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	16,627	52.85	878,736.95	
	LOBLAW COS LTD	11,249	64.28	723,085.72	
	LUNDIN MINING CORP	41,115	8.81	362,223.15	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	18,137	79.26	1,437,538.62	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	122,597	21.75	2,666,484.75	
	METRO INC	16,112	60.34	972,198.08	
	NATIONAL BANK OF CANADA	21,277	70.47	1,499,390.19	
	NUTRIEN LTD	36,041	58.53	2,109,479.73	
	ONEX CORPORATION	5,311	69.55	369,380.05	
	OPEN TEXT CORP	17,423	55.65	969,589.95	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	13,322	39.64	528,084.08	
	PARKLAND CORP	9,584	40.25	385,756.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	34,762	31.49	1,094,655.38	
	POWER CORP OF CANADA	35,742	29.24	1,045,096.08	
	QUEBECOR INC -CL B	11,707	32.49	380,360.43	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	18,094	77.84	1,408,436.96	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,927	84.79	587,340.33	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	22,880	59.76	1,367,308.80	
	ROYAL BANK OF CANADA	90,065	103.97	9,364,058.05	
	SAPUTO INC	15,585	34.09	531,292.65	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,251	23.08	698,193.08	
	SHOPIFY INC - CLASS A	6,794	1,262.00	8,574,028.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	37,039	58.87	2,180,485.93	
	SUNCOR ENERGY INC	96,252	20.14	1,938,515.28	
	TC ENERGY CORP	59,528	55.46	3,301,422.88	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	29,576	19.38	573,182.88	
	THOMSON REUTERS CORP	11,068	105.20	1,164,353.60	
	TMX GROUP LTD	3,652	126.46	461,831.92	
	TORONTO-DOMINION BANK	114,324	68.41	7,820,904.84	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28,342	53.49	1,516,013.58	
	WSP GLOBAL INC	7,204	94.11	677,968.44	
	YAMANA GOLD INC	59,685	6.90	411,826.50	
カナダ・ドル　小計		2,442,000		121,709,490.36 (9,667,384,819)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	175,100	2.98	521,798.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,700	7.58	225,126.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	113,400	24.42	2,769,228.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	376,000	0.82	308,320.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,100	20.60	125,660.00	
	KEPPEL CORP LTD	94,300	5.07	478,101.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	209,300	9.79	2,049,047.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	87,400	4.06	354,844.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	50,600	9.08	459,448.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	99,500	3.91	389,045.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	522,900	2.39	1,249,731.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	74,400	22.41	1,667,304.00	
	UOL Group Limited	29,800	7.41	220,818.00	
	VENTURE CORP LTD	17,500	18.92	331,100.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	119,100	4.25	506,175.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	158,000	0.92	145,360.00	
シンガポール・ドル　小計		2,163,100		11,801,105.00 (911,753,372)	
スイス・フラン	ABB LTD	116,599	24.54	2,861,339.46	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,843	52.14	513,214.02	
	ALCON INC	31,058	57.40	1,782,729.20	
	BALOISE HOLDING AG	2,953	157.90	466,278.70	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,080	97.10	201,968.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	190	1,988.00	377,720.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	68	7,905.00	537,540.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	84,000.00	504,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	33,006	75.14	2,480,070.84	
	CLARIANT AG	12,709	17.94	228,063.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	152,491	11.10	1,692,650.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	510	819.50	417,945.00	
	GEBERIT AG-REG	2,338	556.00	1,299,928.00	
	GIVAUDAN-REG	584	3,646.00	2,129,264.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,202	49.51	703,141.02	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,442	192.00	660,864.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	32,996	46.28	1,527,054.88	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,274	74.90	769,522.60	
	LONZA GROUP AG	4,712	583.20	2,748,038.40	
	NESTLE SA	187,878	104.12	19,561,857.36	
	NOVARTIS AG	140,231	79.10	11,092,272.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,181	946.60	1,117,934.60	
	ROCHE HOLDING AG	44,343	305.65	13,553,437.95	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,390	246.00	341,940.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,471	251.20	620,715.20	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	382	2,642.00	1,009,244.00	
	SIKA AG-BEARER	8,965	235.60	2,112,154.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,454	223.40	771,623.60	
	STRAUMANN HOLDING AG	654	1,047.50	685,065.00	
	SWATCH GROUP AG	1,720	232.40	399,728.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,028	399.00	809,172.00	

	SWISS PRIME SITE-REG	5,045	84.45	426,050.25	
	SWISS RE AG	18,706	81.26	1,520,049.56	
	SWISSCOM AG	1,683	478.80	805,820.40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	4,216	112.85	475,775.60	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	3,716	45.30	168,334.80	
	UBS GROUP AG	231,231	13.10	3,029,126.10	
	VIFOR PHARMA AG	2,873	124.50	357,688.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,510	365.80	3,478,758.00	
スイス・フラン　小計		1,101,738		84,238,078.24 (9,610,722,346)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	19,932	204.80	4,082,073.60	
	ASSA ABLOY AB	63,600	216.50	13,769,400.00	
	ATLAS COPCO AB	24,527	386.30	9,474,780.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	42,579	440.60	18,760,307.40	
	BOLIDEN AB	16,985	275.60	4,681,066.00	
	ELECTROLUX AB	14,442	205.50	2,967,831.00	
	EPIROC AB-A	41,814	144.50	6,042,123.00	
	EPIROC AB-B	24,666	137.70	3,396,508.20	
	EQT AB	15,060	195.90	2,950,254.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	38,582	270.50	10,436,431.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	7,992	649.80	5,193,201.60	
	HENNES & MAURITZ AB	50,726	173.00	8,775,598.00	
	HEXAGON AB-B SHS	17,833	707.40	12,615,064.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	26,592	91.38	2,429,976.96	
	ICA GRUPPEN AB	6,371	413.00	2,631,223.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,865	258.60	2,551,089.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9,399	229.00	2,152,371.00	
	INVESTOR AB	28,490	598.00	17,037,020.00	
	KINNEVIK AB - B	14,898	399.40	5,950,261.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,769	446.40	2,128,881.60	
	LUNDIN ENERGY AB	11,665	207.80	2,423,987.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	19,979	238.80	4,770,985.20	
	NORDEA BANK ABP	204,714	73.71	15,089,468.94	
	SANDVIK AB	71,236	187.25	13,338,941.00	
	SECURITAS AB	20,137	144.80	2,915,837.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	103,169	91.24	9,413,139.56	
	SKANSKA AB-B SHS	21,687	205.30	4,452,341.10	
	SKF AB	24,115	201.80	4,866,407.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB	37,914	134.55	5,101,328.70	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	98,738	85.26	8,418,401.88	
	SWEDBANK AB - A SHARES	56,965	155.60	8,863,754.00	
	SWEDISH MATCH AB	10,266	708.00	7,268,328.00	
	TELE2 AB	32,843	107.75	3,538,833.25	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	184,131	104.35	19,214,069.85	
	TELIA CO AB	161,080	36.25	5,839,150.00	
	VOLVO AB	94,159	199.85	18,817,676.15	
スウェーデン・クローナ　小計		1,631,920		272,358,110.09 (3,290,085,969)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	210	10,520.00	2,209,200.00	

	A P MOLLER - MAERSK A/S	414	11,385.00	4,713,390.00	
	AMBU A/S-B	10,275	199.00	2,044,725.00	
	CARLSBERG AS-B	6,509	946.40	6,160,117.60	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,672	647.80	4,322,121.60	
	COLOPLAST-B	7,471	935.20	6,986,879.20	
	DANSKE BANK A/S	43,324	102.55	4,442,876.20	
	DEMANT A/S	6,793	215.00	1,460,495.00	
	DSV PANALPINA A/S	13,167	1,005.00	13,232,835.00	
	GENMAB A/S	4,118	2,275.00	9,368,450.00	
	GN STORE NORD A/S	8,092	465.10	3,763,589.20	
	H LUNDBECK A/S	4,415	191.75	846,576.25	
	NOVO-NORDISK A/S	108,604	421.95	45,825,457.80	
	NOVOZYMES A/S	13,070	370.80	4,846,356.00	
	ORSTED A/S	11,988	1,102.50	13,216,770.00	
	PANDORA A/S	6,298	610.00	3,841,780.00	
	TRYGVESTA AS	7,838	180.00	1,410,840.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,437	1,192.00	14,824,904.00	
デンマーク・クローネ　小計		271,695		143,517,362.85 (2,375,212,355)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	46,911	14.54	682,085.94	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,703	7.72	638,467.16	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,340	33.44	1,215,209.60	
	MERCURY NZ LTD	46,488	5.88	273,349.44	
	MERIDIAN ENERGY LTD	82,903	5.97	494,930.91	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	25,957	15.51	402,593.07	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	123,265	4.53	559,006.77	
ニュージーランド・ドル　小計		444,567		4,265,642.89 (306,145,190)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	15,212	134.50	2,046,014.00	
	DNB ASA	60,129	157.10	9,446,265.90	
	EQUINOR ASA	62,823	136.65	8,584,762.95	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,951	195.60	2,533,215.60	
	MOWI ASA	28,024	176.25	4,939,230.00	
	NORSK HYDRO ASA	84,406	34.30	2,895,125.80	
	ORKLA ASA	47,790	86.00	4,109,940.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,303	308.00	1,941,324.00	
	TELENOR ASA	47,792	151.75	7,252,436.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,144	360.50	4,017,412.00	
ノルウェー・クローネ　小計		376,574		47,765,726.25 (550,738,824)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	27,207	9.06	246,604.24	
	ACCOR	12,077	29.38	354,822.26	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	17,044	25.53	435,133.32	
	ADIDAS AG	12,025	282.00	3,391,050.00	
	ADP	2,050	113.40	232,470.00	
	ADYEN NV	1,144	1,592.00	1,821,248.00	
	AEGON NV	111,337	2.99	333,008.96	
	AENA SME SA	4,385	143.00	627,055.00	
	AGEAS	10,945	40.90	447,650.50	
	AIR LIQUIDE	29,910	138.85	4,153,003.50	
	AIRBUS SE	37,204	89.33	3,323,433.32	

AKZO NOBEL NV	12,221	87.00	1,063,227.00	
ALLIANZ SE	26,300	194.84	5,124,292.00	
ALSTOM RGPT	12,195	43.50	530,482.50	
ALSTOM SA - RIGHTS	12,195	4.30	52,438.50	
ALTICE NV - A-W/I	40,475	4.32	174,852.00	
AMADEUS IT GROUP SA	28,452	59.50	1,692,894.00	
AMUNDI SA	3,835	68.50	262,697.50	
ANDRITZ AG	4,653	33.88	157,643.64	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	48,215	55.17	2,660,021.55	
ARCELORMITTAL	45,299	13.74	622,680.05	
ARGENX SE	2,844	222.60	633,074.40	
ARKEMA	4,345	91.68	398,349.60	
AROUNDTOWN SA	74,088	5.52	409,262.11	
ASML HOLDING NV	26,886	355.45	9,556,628.70	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	69,699	14.07	980,664.93	
ATLANTIA SPA	31,644	14.64	463,426.38	
ATOS SE	6,165	69.80	430,317.00	
AXA SA	121,931	18.93	2,308,397.69	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	417,805	3.57	1,492,399.46	
BANCO SANTANDER SA	1,048,964	2.32	2,437,792.33	
BANCO SANTANDER SA - RIGHTS	1,048,964	0.10	104,896.40	
BANKINTER SA	42,563	4.22	179,700.98	
BASF SE	57,984	57.78	3,350,315.52	
BAYER AG	62,087	46.39	2,880,526.36	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,961	74.00	1,551,114.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,585	55.05	197,354.25	
BEIERSDORF AG	6,349	97.10	616,487.90	
BIOMERIEUX	2,606	119.40	311,156.40	
BNP PARIBAS	70,779	40.80	2,888,137.09	
BOLLORE	58,512	3.40	198,940.80	
BOUYGUES	14,421	33.58	484,257.18	
BRENNTAG AG	9,695	63.24	613,111.80	
BUREAU VERITAS SA	18,926	21.42	405,394.92	
CAIXABANK	221,578	2.18	485,034.24	
CAPGEMINI SA	10,163	116.65	1,185,513.95	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,543	116.90	297,276.70	
CARREFOUR SA	37,949	14.13	536,409.11	
CELLNEX TELECOM SAU	20,167	51.82	1,045,053.94	
CIE DE SAINT-GOBAIN	32,752	39.41	1,290,756.32	
CNH INDUSTRIAL NV	65,093	8.89	578,676.77	
CNP ASSURANCES	10,739	12.68	136,170.52	
COLRUYT NV	3,400	49.75	169,150.00	
COMMERZBANK AG	62,289	4.93	307,333.92	
CONTINENTAL AG	6,957	110.50	768,748.50	
COVESTRO AG	10,884	46.19	502,731.96	
CREDIT AGRICOLE SA	72,159	8.87	640,194.64	
CRH PLC	49,375	33.21	1,639,743.75	
DAIMLER AG	54,060	55.07	2,977,084.20	
DANONE	39,020	52.90	2,064,158.00	
DASSAULT AVIATION SA	153	909.50	139,153.50	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,371	155.90	1,305,038.90	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	36,437	9.57	348,993.58	
DELIVERY HERO SE	8,155	99.50	811,422.50	
DEUTSCHE BANK AG	124,082	8.99	1,115,621.26	
DEUTSCHE BOERSE AG	11,984	134.80	1,615,443.20	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	18,971	9.47	179,807.13	
DEUTSCHE POST AG	62,890	39.10	2,458,999.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG	211,324	14.85	3,138,161.40	
DEUTSCHE WOHNEN SE	21,667	42.48	920,414.16	
DIASORIN SPA	1,573	172.60	271,499.80	
E.ON SE	142,589	9.05	1,290,430.45	
EDENRED	15,592	45.23	705,226.16	
EDF	39,509	11.90	470,354.64	
EIFFAGE	5,427	82.84	449,572.68	
ELIA GROUP SA/NV	1,983	93.40	185,212.20	
ELISA OYJ	9,187	45.26	415,803.62	
ENAGAS SA	15,518	20.01	310,515.18	
ENDESA SA	20,189	24.69	498,466.41	
ENEL SPA	513,685	8.16	4,193,724.34	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	176,575	4.44	785,582.17	
ENGIE	115,583	12.05	1,393,353.06	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	159,886	8.07	1,291,399.22	
ERSTE GROUP BANK AG	17,761	23.74	421,646.14	
ESSILORLUXOTTICA	18,012	114.15	2,056,069.80	
EURAZEO	2,583	51.75	133,670.25	
EUROFINS SCIENTIFIC	8,360	72.44	605,598.40	
EVONIK INDUSTRIES AG	13,038	23.63	308,087.94	
EXOR NV	6,823	56.86	387,955.78	
FAURECIA	4,849	40.25	195,172.25	
FERRARI NV	7,961	179.95	1,432,581.95	
FERROVIAL S.A.	31,350	23.08	723,558.00	
FERROVIAL SA-RTS	31,350	0.23	7,461.30	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	69,100	12.94	894,154.00	
FINECOBANK SPA	38,343	12.46	477,753.78	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	9,708	142.20	1,380,477.60	
FORTUM OYJ	28,061	17.58	493,312.38	
FRAPORT AG	3,074	45.86	140,973.64	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	13,435	71.24	957,109.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26,322	37.64	990,760.08	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	4,215	48.48	204,343.20	
GALAPAGOS NV	2,705	104.00	281,320.00	
GALP ENERGIA SGPS SA	31,316	8.82	276,207.12	
GEA GROUP AG	9,630	28.60	275,418.00	
GETLINK SE - REGR	29,368	14.49	425,542.32	
GRIFOLS SA	18,825	25.20	474,390.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7,205	80.70	581,443.50	
HANNOVER RUECK SE	3,787	144.80	548,357.60	
HEIDELBERGCEMENT AG	9,307	58.38	543,342.66	
HEINEKEN HOLDING NV	7,345	79.30	582,458.50	
HEINEKEN NV	16,411	90.20	1,480,272.20	
HENKEL AG & CO KGAA	6,683	78.15	522,276.45	
HENKEL KGAA-VORZUG	11,098	87.12	966,857.76	
HERMES INTERNATIONAL	2,002	848.40	1,698,496.80	

HOCHTIEF AG	1,687	76.85	129,645.95	
IBERDROLA SA	374,452	11.36	4,253,774.72	
ILIAD SA	954	173.70	165,709.80	
INDITEX SA	68,590	26.97	1,849,872.30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	78,977	27.06	2,137,117.62	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,629	10.41	162,697.89	
ING GROEP NV-CVA	246,213	7.69	1,894,855.24	
INTESA SANPAOLO	1,038,673	1.85	1,925,699.74	
IPSEN	2,378	83.50	198,563.00	
JC DECAUX SA	5,690	19.50	110,955.00	
JERONIMO MARTINS	15,498	13.91	215,654.67	
JUST EAT TAKEAWAY	8,000	90.00	720,000.00	
KBC GROEP NV	15,741	56.76	893,459.16	
KERING	4,788	612.00	2,930,256.00	
KERRY GROUP PLC-A	10,028	119.80	1,201,354.40	
KINGSPAN GROUP PLC	9,717	74.90	727,803.30	
KION GROUP AG	4,094	66.70	273,069.80	
KNORR-BREMSE AG	3,070	106.76	327,753.20	
KONE OYJ	21,470	70.40	1,511,488.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	69,409	23.52	1,632,499.68	
KONINKLIJKE DSM NV	10,888	141.75	1,543,374.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	57,699	43.57	2,514,233.92	
L'OREAL SA	15,893	310.80	4,939,544.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,372	34.51	185,387.72	
LANXESS	5,168	53.82	278,141.76	
LEG IMMOBILIEN AG	4,382	118.12	517,601.84	
LEGRAND SA	16,872	71.80	1,211,409.60	
LEONARDO SPA	24,549	5.68	139,585.61	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	17,554	488.65	8,577,762.10	
MAPFRE SA	64,900	1.58	102,542.00	
MEDIOBANCA SPA	39,557	7.56	299,130.03	
MERCK KGAA	8,130	128.45	1,044,298.50	
METRO AG	11,489	8.05	92,486.45	
MICHELIN (C.G.D.E.)	10,696	106.95	1,143,937.20	
MONCLER SPA	12,195	40.60	495,117.00	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,353	196.00	657,188.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,822	236.10	2,082,874.20	
NATIXIS	59,796	2.52	150,745.71	
NATURGY ENERGY GROUP SA	18,750	19.07	357,656.25	
NEMETSCHEK SE	3,641	63.90	232,659.90	
NESTE OYJ	26,600	53.90	1,433,740.00	
NEXI SPA	23,761	15.31	363,780.91	
NN GROUP NV	18,106	34.48	624,294.88	
NOKIA OYJ	356,618	3.25	1,159,365.11	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	4,337	56.00	242,872.00	
OMV AG	8,988	28.22	253,641.36	
ORANGE S.A.	127,734	10.38	1,326,517.59	
ORION OYJ-CLASS B	6,599	39.58	261,188.42	
ORPEA	3,304	106.75	352,702.00	
PERNOD-RICARD	13,413	160.90	2,158,151.70	

PEUGEOT SA	36,663	19.56	717,311.59	
PIRELLI & C SPA	25,272	4.19	105,940.22	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	9,375	56.52	529,875.00	
POSTE ITALIANE SPA	34,740	8.71	302,863.32	
PROSUS	30,789	87.74	2,701,426.86	
PROXIMUS	10,039	17.29	173,574.31	
PRYSMIAN SPA	15,169	25.40	385,292.60	
PUBLICIS GROUPE	13,740	38.10	523,494.00	
PUMA AG	5,269	83.96	442,385.24	
QIAGEN NV	14,403	40.00	576,120.00	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	9,281	15.78	146,454.18	
RANDSTAD NV	7,482	49.56	370,807.92	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,582	45.79	301,389.78	
RED ELECTRICA DE ESPANA	27,284	16.52	450,731.68	
REMY COINTREAU	1,425	152.70	217,597.50	
RENAULT SA	12,357	31.14	384,858.76	
REPSOL SA	94,157	7.74	729,340.12	
ROYAL KPN NV	231,330	2.59	599,838.69	
RWE AG	40,448	34.06	1,377,658.88	
SAFRAN SA	20,246	120.25	2,434,581.50	
SAMPO OYJ	29,791	36.57	1,089,456.87	
SANOFI	71,418	85.64	6,116,237.52	
SAP SE	65,929	99.42	6,554,661.18	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,245	370.20	831,099.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,751	304.80	533,704.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,908	118.75	4,145,325.00	
SCOR REGROUPE	9,908	28.94	286,737.52	
SCOUT24 AG	6,739	64.70	436,013.30	
SEB SA	1,427	147.40	210,339.80	
SIEMENS AG	48,296	109.80	5,302,900.80	
SIEMENS ENERGY AG	24,148	24.19	584,140.12	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,094	27.51	415,235.94	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	9,400	37.27	350,385.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,247	36.08	514,031.76	
SNAM SPA	128,271	4.67	599,410.38	
SOCIETE GENERALE	50,883	16.18	823,592.23	
SODEXO	5,558	70.54	392,061.32	
SOFINA	915	258.00	236,070.00	
SOLVAY SA	4,728	89.10	421,264.80	
STMICROELECTRONICS NV	40,253	30.40	1,223,691.20	
STORA ENSO OYJ	36,391	13.65	496,737.15	
SUEZ	22,345	16.13	360,536.57	
SYMRISE AG	8,102	105.20	852,330.40	
TEAMVIEWER AG	8,201	38.35	314,508.35	
TELECOM ITALIA SPA	864,217	0.36	311,118.12	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	70,034	2.32	163,039.15	
TELEFONICA SA	310,536	3.46	1,075,696.70	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,012	34.14	102,829.68	
TELEPERFORMANCE	3,726	276.30	1,029,493.80	

	TENARIS SA	28,322	6.26	177,465.65	
	TERNA SPA	89,202	6.32	563,935.04	
	THALES SA	6,704	78.70	527,604.80	
	THYSSENKRUPP AG	26,157	4.73	123,905.70	
	TOTAL SE	156,046	34.11	5,322,729.06	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	5,745	80.30	461,323.50	
	UCB SA	7,966	90.94	724,428.04	
	UMICORE	12,393	35.66	441,934.38	
	UNICREDIT SPA	133,655	8.40	1,122,835.65	
	UNILEVER NV	92,379	49.55	4,577,379.45	
	UNIPER SE	12,727	28.08	357,374.16	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,714	32.97	221,360.58	
	UPM-KYMMENE OYJ	33,644	26.50	891,566.00	
	VALEO SA	14,502	31.06	450,432.12	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,286	18.35	629,319.53	
	VINCI SA	32,701	86.80	2,838,446.80	
	VIVENDI SA	52,447	25.50	1,337,398.50	
	VOESTALPINE AG	7,372	25.79	190,123.88	
	VOLKSWAGEN AG	2,214	161.70	358,003.80	
	VOLKSWAGEN AG	11,639	152.52	1,775,180.28	
	VONOVIA SE	32,705	57.96	1,895,581.80	
	VOPAK	4,375	44.23	193,506.25	
	WARTSILA OYJ	28,440	7.80	221,832.00	
	WENDEL	1,805	93.25	168,316.25	
	WOLTERS KLUWER NV	17,283	71.14	1,229,512.62	
	WORLDLINE SA	8,692	73.66	640,252.72	
	ZALANDO SE	9,554	79.18	756,485.72	
ユーロ　小計		13,023,873		255,430,298.44 (31,504,773,010)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	764,275	88.20	67,409,055.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	19,500	87.50	1,706,250.00	
	BANK OF EAST ASIA	86,000	16.04	1,379,440.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	238,039	24.60	5,855,759.40	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	109,100	27.00	2,945,700.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	163,909	43.70	7,162,823.30	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	170,909	58.05	9,921,267.45	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	43,500	40.05	1,742,175.00	
	CLP HOLDINGS LTD	104,643	73.50	7,691,260.50	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	135,810	61.30	8,325,153.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	131,157	21.15	2,773,970.55	
	HANG SENG BANK LTD	48,812	132.60	6,472,471.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	99,641	31.35	3,123,745.35	
	HONG KONG & CHINA GAS	684,750	12.14	8,312,865.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	76,111	370.40	28,191,514.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	45,000	20.75	933,750.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	46,000	34.55	1,589,300.00	
	MTR CORP	105,755	42.85	4,531,601.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	100,917	40.35	4,072,000.95	
	PCCW LTD	333,000	4.75	1,581,750.00	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	88,587	41.20	3,649,784.40	
	SANDS CHINA LTD	155,780	34.05	5,304,309.00	
	SINO LAND CO	206,000	9.97	2,053,820.00	
	SJM HOLDINGS LTD	127,000	9.38	1,191,260.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	83,023	106.60	8,850,251.80	
	SWIRE PACIFIC LTD	32,866	46.60	1,531,555.60	
	SWIRE PROPERTIES LTD	77,200	24.05	1,856,660.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	87,500	104.50	9,143,750.00	
	WH GROUP LTD	604,500	6.72	4,062,240.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	106,733	39.05	4,167,923.65	
	WYNN MACAU LTD	103,303	13.84	1,429,713.52	
香港・ドル　小計		5,179,320		218,963,120.82 (2,934,105,819)	
合計		69,243,684		285,514,371,822 (285,514,371,822)	

② 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	36,361.00	548,687.49	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,974.00	1,305,662.76	
		AMERICAN TOWER REIT INC	28,006.00	6,677,470.58	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	91,976.00	721,091.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,841.00	1,505,622.30	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,294.00	905,421.48	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,093.00	596,200.05	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,346.00	4,428,499.14	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,946.00	2,423,278.00	
		DUKE REALTY CORP	23,190.00	897,221.10	
		EQUINIX INC	5,591.00	4,084,728.69	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,892.00	661,362.24	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,424.00	1,402,160.64	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,096.00	1,040,998.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,161.00	919,091.82	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,500.00	408,555.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	33,843.00	1,035,595.80	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	44,490.00	642,880.50	
		INVITATION HOMES INC	34,301.00	963,172.08	
		IRON MOUNTAIN INC	18,437.00	475,490.23	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,466.00	643,551.18	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,158.00	902,910.12	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,649.00	427,344.37	

	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,366.00	495,770.66	
	PROLOGIS INC	46,617.00	4,661,233.83	
	PUBLIC STORAGE	9,898.00	2,264,563.42	
	REALTY INCOME CORP	21,571.00	1,318,203.81	
	REGENCY CENTERS CORP	10,662.00	509,217.12	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,050.00	2,099,208.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	19,312.00	1,557,126.56	
	SUN COMMUNITIES INC	6,197.00	866,960.30	
	UDR INC	18,617.00	722,339.60	
	VENTAS INC	23,527.00	1,143,882.74	
	VEREIT	67,671.00	498,058.56	
	VICI PROPERTIES INC	29,584.00	765,338.08	
	VORNADO REALTY TRUST	10,233.00	407,682.72	
	WELLTOWER INC	26,369.00	1,719,258.80	
	WP CAREY INC	10,869.00	761,156.07	
アメリカ・ドル　小計		816,578.00	53,406,996.08 (5,547,918,753)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	56,005.00	268,880.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,529.00	304,355.71	
	SEGRO PLC	74,921.00	680,732.20	
イギリス・ポンド　小計		175,455.00	1,253,967.91 (172,646,302)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	76,844.00	754,608.08	
	GOODMAN GROUP	107,643.00	2,010,771.24	
	GPT GROUP	133,044.00	610,671.96	
	MIRVAC GROUP	272,106.00	734,686.20	
	SCENTRE GROUP	337,233.00	937,507.74	
	STOCKLAND	155,645.00	700,402.50	
	VICINITY CENTRES	259,546.00	434,739.55	
オーストラリア・ドル　小計		1,342,061.00	6,183,387.27 (467,464,078)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,229.00	260,195.04	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,901.00	105,861.34	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,861.00	169,905.03	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,851.00	118,898.01	
カナダ・ドル　小計		26,842.00	654,859.42 (52,015,484)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	193,700.00	575,289.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	284,296.00	562,906.08	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	136,900.00	273,800.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	166,900.00	330,462.00	
	SUNTEC REIT	121,300.00	184,376.00	
シンガポール・ドル　小計		903,096.00	1,926,833.08 (148,867,124)	
ユーロ	COVIVIO	3,260.00	235,535.00	
	GECINA SA	2,838.00	367,521.00	

		ICADE	2,015.00	129,967.50	
		KLEPIERRE	12,326.00	221,683.11	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,720.00	491,808.00	
	ユーロ　小計		29,159.00	1,446,514.61 (178,413,112)	
	香港・ドル	LINK REIT	131,371.00	9,104,010.30	
	香港・ドル　小計		131,371.00	9,104,010.30 (121,993,738)	
投資証券　合計				6,689,318,591 (6,689,318,591)	
合計				6,689,318,591 (6,689,318,591)	

（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　590銘柄 投資証券　38銘柄	68.06% -%	-% 1.84%	71.99%
イギリス・ポンド	株式　84銘柄 投資証券　3銘柄	4.33% -%	-% 0.06%	4.52%
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	0.10%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式　53銘柄 投資証券　7銘柄	2.07% -%	-% 0.16%	2.29%
カナダ・ドル	株式　80銘柄 投資証券　4銘柄	3.21% -%	-% 0.02%	3.33%
シンガポール・ドル	株式　16銘柄 投資証券　5銘柄	0.30% -%	-% 0.05%	0.36%
スイス・フラン	株式　39銘柄	3.19%	-%	3.29%
スウェーデン・クローナ	株式　36銘柄	1.09%	-%	1.13%
デンマーク・クローネ	株式　18銘柄	0.79%	-%	0.81%
ニュージーランド・ドル	株式　7銘柄	0.10%	-%	0.10%
ノルウェー・クローネ	株式　10銘柄	0.18%	-%	0.19%
ユーロ	株式　240銘柄 投資証券　5銘柄	10.47% -%	-% 0.06%	10.84%
香港・ドル	株式　31銘柄 投資証券　1銘柄	0.98% -%	-% 0.04%	1.05%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第４　不動産等明細表

該当事項はありません。

第５　商品明細表
該当事項はありません。

第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

第７　その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

第８　借入金明細表
該当事項はありません。

「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	71,199,703	7,652,697
金銭信託	2,081,042	302,967
コール・ローン	83,698,699	66,397,624
株式	1,850,663,620	2,171,408,735
投資信託受益証券	84,830,276	92,267,409
投資証券	5,384,789	1,651,711
派生商品評価勘定	5,466,152	5,251,134
未収入金	1,096,470	－
未収配当金	1,291,471	1,048,398
差入委託証拠金	69,546,063	61,368,460
流動資産合計	2,175,258,285	2,407,349,135
資産合計	2,175,258,285	2,407,349,135
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	409,423	68,995
未払金	17,248	－
未払解約金	14,311,923	53,866,791
その他未払費用	658	131
流動負債合計	14,739,252	53,935,917
負債合計	14,739,252	53,935,917
純資産の部		
元本等		
元本	2,309,692,542	2,262,953,958
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△149,173,509	90,459,260
純資産合計	2,160,519,033	2,353,413,218
負債純資産合計	2,175,258,285	2,407,349,135

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。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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。
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。 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。
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。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	2,309,692,542口	2,262,953,958口
２．　投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	149,173,509円	――――――
３．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9354円 (9,354円)	1.0400円 (10,400円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	149,505,319	304,236,158
投資信託受益証券	△5,124,959	955,618
投資証券	337,833	△1,061,289
合計	144,718,193	304,130,487

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	36,863,086	－	36,870,106	△7,020	－	－	－	－
アメリカ・ドル	36,859,164	－	36,866,200	△7,036	－	－	－	－
ブラジル・レアル	3,922	－	3,906	16	－	－	－	－
買　建	74,649,899	－	74,386,870	△263,029	9,512,722	－	9,449,440	△63,282
アメリカ・ドル	74,649,899	－	74,386,870	△263,029	9,512,722	－	9,449,440	△63,282
合計	111,512,985	－	111,256,976	△270,049	9,512,722	－	9,449,440	△63,282

（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。

①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。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	178,059,035	－	183,385,812	5,326,777	76,010,554	－	81,255,974	5,245,420
合計	178,059,035	－	183,385,812	5,326,777	76,010,554	－	81,255,974	5,245,420

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

２．株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

３．評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

４．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

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

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,844,866,571円	2,309,692,542円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	1,061,417,332円	1,517,287,525円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	596,591,361円	1,564,026,109円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	787,226,995円	－円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ新興国株式インデックスファンド	1,413,724,632円	2,004,009,065円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	49,901,389円	11,629,773円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	7,015,043円	11,202,847円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	2,005,205円	3,164,605円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	32,645,881円	36,171,367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	72,576,677円
ＤＣニッセイ新興国株式インデックス	17,173,397円	124,199,624円
計	2,309,692,542円	2,262,953,958円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表
① 株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル	51JOB INC-ADR	100	71.00	7,100.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	5,767	259.89	1,498,785.63	
	AUTOHOME INC-ADR	234	99.84	23,362.56	
	BAIDU INC - SPON ADR	863	136.48	117,782.24	
	BAOZUN INC-SPN ADR	100	40.78	4,078.00	
	BEST INC - ADR	800	3.01	2,408.00	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	400	58.46	23,384.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	11.43	6,092.19	
	CREDICORP LTD	182	133.59	24,313.38	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	200	87.90	17,580.00	
	GLOBANT SA	100	187.63	18,763.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	300	71.35	21,405.00	
	HUAZHU GROUP LIMITED ADR	400	53.56	21,424.00	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	200	30.41	6,082.00	
	HUYA INC-ADR	200	20.99	4,198.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	2,100	0.64	1,352.40	
	IQIYI INC-ADR	900	22.60	20,340.00	
	JD.COM INC-ADR	2,650	86.04	228,006.00	

	JOYY INC	134	86.11	11,538.74	
	KE HOLDINGS INC	300	59.35	17,805.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,286	64.42	82,844.12	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,208	15.21	18,373.68	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	870	7.08	6,159.60	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC	1,682	8.37	14,078.34	
	MOMO INC-SPON ADR	466	15.24	7,101.84	
	NETEASE.COM INC -ADR	1,490	89.22	132,937.80	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	433	180.67	78,230.11	
	NIO INC - ADR	2,800	48.45	135,660.00	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	100	31.75	3,175.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	308	163.10	50,234.80	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	396	25.00	9,900.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	556	13.28	7,383.68	
	PINDUODUO INC-ADR	800	137.66	110,128.00	
	PJSC GAZPROM ADR	18,326	4.77	87,451.67	
	PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	2,128	27.03	57,519.84	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	193	101.80	19,647.40	
	ROSNEFT OJSC-GDR	4,582	5.90	27,052.12	
	SBERBANK PAO - SPONSORED ADR	8,282	13.00	107,707.41	
	SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1,099	14.34	15,759.66	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	2,280	0.82	1,883.28	
	SINA CORP	234	43.33	10,139.22	
	SOUTHERN COPPER CORP	234	56.05	13,115.70	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	3,070	4.77	14,656.18	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,224	74.75	91,494.00	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	740	39.96	29,570.40	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,500	16.40	24,600.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	1,427	33.68	48,061.36	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1,415	23.32	32,997.80	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	0.91	6,057.30	
	WEIBO CORP-SPON ADR	134	45.41	6,084.94	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	35.54	14,997.88	
	YANDEX NV-A	900	62.53	56,277.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,091	60.25	65,732.75	
	ZAI LAB LTD-ADR	200	103.63	20,726.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	1,200	29.99	35,988.00	
アメリカ・ドル　小計		86,159		3,519,527.02 (365,608,467)	

イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	717	16.78	12,034.84	
イギリス・ポンド　小計		717		12,034.84 (1,656,957)	
インド・ルピー	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	1,512	381.90	577,432.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,593	258.70	670,809.10	
	ASIAN PAINTS LTD	922	2,161.70	1,993,087.40	
	AUROBINDO PHARMA LTD	802	830.15	665,780.30	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	432	2,392.20	1,033,430.40	
	AXIS BANK LTD	6,840	611.50	4,182,660.00	
	BAJAJ AUTO LTD	269	3,034.25	816,213.25	
	BAJAJ FINANCE LTD	564	4,536.55	2,558,614.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	119	7,823.40	930,984.60	
	BANDHAN BANK LTD	1,335	352.60	470,721.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	919	636.80	585,219.20	
	BHARAT FORGE LTD	429	510.00	218,790.00	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	2,261	383.70	867,545.70	
	BHARTI AIRTEL LTD	3,760	468.55	1,761,748.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	733	185.90	136,264.70	
	BIOCON LTD	1,590	422.75	672,172.50	
	BOSCH LTD	15	11,927.55	178,913.25	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	163	3,511.35	572,350.05	
	CIPLA LIMITED	1,072	742.10	795,531.20	
	COAL INDIA LTD	3,906	122.05	476,727.30	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	277	1,516.80	420,153.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	611	408.25	249,440.75	
	DABUR INDIA LTD	1,654	507.30	839,074.20	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	245	3,435.05	841,587.25	
	DLF LTD	2,165	184.90	400,308.50	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	348	4,707.70	1,638,279.60	
	EICHER MOTORS LTD	350	2,551.25	892,937.50	
	GAIL INDIA LTD	4,264	93.65	399,323.60	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	1,109	684.90	759,554.10	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	864	836.75	722,952.00	
	HAVELLS INDIA LTD	799	827.80	661,412.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	3,436	804.55	2,764,433.80	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	153	2,424.75	370,986.75	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	2,013	646.05	1,300,498.65	
	HERO MOTOCORP LTD	409	2,988.50	1,222,296.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	3,542	213.85	757,456.70	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	213.35	411,765.50	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,526	2,130.75	5,382,274.50	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	5,049	2,324.60	11,736,905.40	
	ICICI BANK LTD	15,758	478.75	7,544,142.50	

ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	863	1,296.45	1,118,836.35	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	1,143	441.30	504,405.90	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	5,990	84.70	507,353.00	
INFO EDGE INDIA LTD	218	3,834.20	835,855.60	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	10,512	1,096.75	11,529,036.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	203	1,687.95	342,653.85	
ITC LTD	10,481	187.90	1,969,379.90	
JSW STEEL LTD	2,559	331.20	847,540.80	
JUBILANT FOODWORKS LTD	195	2,510.35	489,518.25	
LARSEN & TOUBRO LTD	1,377	1,134.25	1,561,862.25	
LIC HOUSING FINANCE LTD	589	328.85	193,692.65	
LUPIN LTD	907	884.40	802,150.80	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	2,407	703.90	1,694,287.30	
MARICO LTD	1,422	367.35	522,371.70	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	362	6,963.30	2,520,714.60	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2,044	136.75	279,517.00	
NESTLE INDIA LTD	62	16,934.15	1,049,917.30	
NTPC LTD	10,161	89.80	912,457.80	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	7,934	72.15	572,438.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	14	21,913.45	306,788.30	
PETRONET LNG LTD	1,873	253.85	475,461.05	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	443	1,558.40	690,371.20	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	268	1,393.05	373,337.40	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	5,845	189.80	1,109,381.00	
REC LTD	1,368	114.40	156,499.20	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	8,808	1,973.15	17,379,505.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	1,140	846.75	965,295.00	
SHREE CEMENT LTD	26	23,661.65	615,202.90	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	328	911.80	299,070.40	
STATE BANK OF INDIA	5,790	239.75	1,388,152.50	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	2,759	507.35	1,399,778.65	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	2,775	2,636.90	7,317,397.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	2,022	515.60	1,042,543.20	
TATA MOTORS LTD	4,240	167.95	712,108.00	
TATA STEEL LTD	1,159	523.60	606,852.40	
TECH MAHINDRA LTD	1,520	822.90	1,250,808.00	
TITAN CO LTD	952	1,292.45	1,230,412.40	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	257	2,634.60	677,092.20	
ULTRATECH CEMENT LTD	335	4,778.00	1,600,630.00	
UNITED SPIRITS LTD	1,082	572.05	618,958.10	

	UPL LTD	1,612	416.50	671,398.00	
	VEDANTA LTD	5,757	112.10	645,359.70	
	WIPRO LTD	3,890	342.60	1,332,714.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	3,076	186.35	573,212.60	
インド・ルピー　小計		194,506		131,173,096.60 (184,954,066)	
インドネシア・ルピア	ACE HARDWARE INDONESIA	34,300	1,690.00	57,967,000.00	
	ADARO ENERGY TBK PT	27,100	1,240.00	33,604,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	64,800	5,725.00	370,980,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	30,100	33,075.00	995,557,500.00	
	BANK MANDIRI TBK	60,400	6,325.00	382,030,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	23,200	5,750.00	133,400,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	179,400	4,040.00	724,776,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	88,500	960.00	84,960,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	22,600	6,400.00	144,640,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	1,100	44,925.00	49,417,500.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	19,900	1,560.00	31,044,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	8,875.00	53,250,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	7,500	14,100.00	105,750,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	10,350.00	99,360,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	7,275.00	75,660,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	56,900	1,495.00	85,065,500.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	21,500	1,355.00	29,132,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	11,150.00	104,810,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	158,100	3,170.00	501,177,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	23,500	7,775.00	182,712,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	5,000	21,500.00	107,500,000.00	
インドネシア・ルピア　小計		859,300		4,352,793,500.00 (32,210,671)	
オフショア・人民元	AECC AVIATION POWER CO-A	1,000	41.00	41,000.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,000	3.23	25,840.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	1,430	62.53	89,417.90	
	AISINO CORP-A	1,800	13.94	25,092.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	56.79	56,790.00	
	AVIC CAPITAL CO LTD -A	9,200	4.56	41,952.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	8,600	4.80	41,280.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	4,500	3.24	14,580.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,700	4.61	17,057.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	1,700	36.15	61,455.00	

BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	7.94	35,730.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	5,700	6.29	35,853.00	
BBMG CORPORATION-A	14,100	3.08	43,428.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	11,000	5.39	59,290.00	
BYD CO LTD -A	600	161.62	96,972.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	356.00	35,600.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	4.99	33,932.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	9,700	4.33	42,001.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	14.54	20,792.20	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,000	43.21	43,210.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	5,400	44.87	242,298.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,700	22.36	60,372.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	14.90	28,310.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,500	5.21	18,235.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	11,300	4.57	51,641.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	4.68	49,608.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	1,500	34.10	51,150.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	8,400	4.12	34,608.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	3,900	8.49	33,111.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8,800	5.62	49,456.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	2,000	17.62	35,240.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	7,800	4.32	33,696.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	6.25	29,375.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	10,800	5.31	57,348.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	500	183.31	91,655.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	9,200	4.82	44,344.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	2,200	30.91	68,002.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	4,500	19.84	89,280.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	400	120.00	48,000.00	
CITIC SECURITIES CO-A	2,800	29.33	82,124.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	600	242.10	145,260.00	
CRRC CORP LTD-A	8,100	5.56	45,036.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	3,900	6.60	25,740.00	

EAST MONEY INFORMATION CO-A	3,480	25.83	89,888.40	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	9.47	55,873.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	720	163.01	117,367.20	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	2,600	14.34	37,284.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	16.83	62,271.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	212.00	29,680.00	
GOERTEK INC -A	1,000	40.07	40,070.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	800	67.90	54,320.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	18.29	60,357.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,000	29.10	58,200.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,900	13.13	38,077.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	2,200	48.10	105,820.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	51.77	41,416.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	2,800	24.70	69,160.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,400	14.99	35,976.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	2,900	8.19	23,751.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	2,100	18.82	39,522.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	4,100	12.41	50,881.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	6.37	39,494.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	32.99	46,186.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	6,100	5.09	31,049.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	650	92.20	59,930.00	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	40.89	49,068.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	11,300	5.04	56,952.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	4,700	19.33	90,851.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.19	38,556.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	5.73	12,033.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	1,200	39.08	46,896.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	1,320	87.30	115,236.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	400	177.00	70,800.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,000	11.10	55,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	17.17	34,340.00	

KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	1,720.19	344,038.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,000	64.83	64,830.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,689	52.04	87,895.56	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	400	191.66	76,664.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	2.71	55,555.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	850	75.19	63,911.50	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	1,800	23.50	42,300.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	60.55	54,495.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	26.30	47,340.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	2,900	9.50	27,550.00	
PETROCHINA CO LTD-A	6,900	4.24	29,256.00	
PING AN BANK CO LTD-A	4,400	18.85	82,940.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	3,000	85.42	256,260.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	16.99	45,873.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	4.06	40,600.00	
S F HOLDING CO LTD-A	1,000	80.79	80,790.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	2,100	26.01	54,621.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,200	26.94	32,328.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	27.89	83,670.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	24.20	11,132.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	5.16	32,508.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	700	52.28	36,596.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	6,700	9.74	65,258.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	7.93	44,408.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	200	259.93	51,986.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	110.69	15,496.60	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	5.29	58,190.00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	100	176.61	17,661.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	152.60	45,780.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	200	343.83	68,766.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	2,100	13.91	29,211.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	1,900	16.97	32,243.00	

	SUNING.COM CO LTD-A	4,400	9.04	39,776.00	
	TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,000	6.89	27,560.00	
	UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	22.28	21,834.40	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	900	89.49	80,541.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	3,400	17.77	60,418.00	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	19.76	35,568.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	100	205.20	20,520.00	
	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	106.80	21,360.00	
	WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	4.71	24,021.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	700	264.70	185,290.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-A	560	106.96	59,897.60	
	XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	5.10	13,260.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	45.45	76,810.50	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	96.30	48,150.00	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	218.68	65,604.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	700	32.70	22,890.00	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	16.09	32,180.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	7,100	8.38	59,498.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	7.71	72,474.00	
	ZTE CORP-A	700	36.30	25,410.00	
オフショア・人民元　小計		480,339		7,105,180.86 (112,332,909)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	764	27,100.00	20,704,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,664	27,150.00	45,177,600.00	
	ECOPETROL SA	18,083	2,145.00	38,788,035.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	662	21,300.00	14,100,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	22,700.00	33,187,400.00	
コロンビア・ペソ　小計		22,635		151,958,035.00 (4,330,804)	
タイ・バーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	3,800	176.50	670,700.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	13,700	67.00	917,900.00	
	B GRIMM POWER PCL-FOREIGN	3,100	47.75	148,025.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	1,600	118.00	188,800.00	
	BANGKOK COMMERCIAL-FOREIGN	9,000	21.30	191,700.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	29,600	22.60	668,960.00	

	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	23,600	9.15	215,940.00	
	BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	6,000	34.00	204,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	20,200	10.30	208,060.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	1,300	107.50	139,750.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	7,200	53.50	385,200.00	
	CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	6,700	33.75	226,125.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	10,200	28.25	288,150.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	18,500	62.25	1,151,625.00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	1,000	190.50	190,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	4,200	43.75	183,750.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	2,400	66.25	159,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	7,500	36.00	270,000.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	18,400	15.00	276,000.00	
	INDORAMA VENTURES-FOREIGN	5,100	30.25	154,275.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	54.00	340,200.00	
	IRPC PCL - FOREIGN	70,100	2.90	203,290.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	5,500	97.50	536,250.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	11,400	10.30	117,420.00	
	LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	21,300	7.70	164,010.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	7,100	24.40	173,240.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	2,100	54.75	114,975.00	
	OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	36.75	117,600.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	4,800	92.25	442,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	7,200	53.75	387,000.00	
	PTT PCL/FOREIGN	35,100	37.75	1,325,025.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	2,300	52.50	120,750.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	2,500	358.00	895,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	2,800	84.25	235,900.00	
	SRISAWADCORP PCL - FOREIGN	2,400	54.50	130,800.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	2,400	48.50	116,400.00	
	THAI UNION GROUP PCL-F	9,800	15.30	149,940.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	27,100	1.00	27,100.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	2,200	35.25	77,550.00	
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	36,400	3.10	112,840.00	
タイ・バーツ　小計		455,100		12,626,550.00	

				(43,182,801)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	571	468.00	267,228.00	
	KOMERCNI BANKA AS	188	568.00	106,784.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	64.50	72,498.00	
チェコ・コルナ　小計		1,883		446,510.00 (2,089,666)	
チリ・ペソ	AGUAS ANDINAS SA-A	4,650	207.99	967,153.50	
	BANCO DE CHILE	178,957	69.99	12,525,200.43	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	162	26,956.00	4,366,872.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	219,753	33.99	7,469,404.47	
	CENCOSUD SA	4,383	1,310.00	5,741,730.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	3,859	1,204.00	4,646,236.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	5,328.00	1,454,544.00	
	COLBUN SA	13,714	130.39	1,788,168.46	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	470	1,666.00	783,020.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	269	4,700.00	1,264,300.00	
	EMPRESAS CMPC SA	3,736	1,664.10	6,217,077.60	
	EMPRESAS COPEC SA	1,242	6,450.00	8,010,900.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	53.67	4,856,383.62	
	ENERSIS SA	99,456	114.06	11,343,951.36	
	FALABELLA SA	2,406	2,728.00	6,563,568.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	314	33,899.00	10,644,286.00	
チリ・ペソ　小計		624,130		88,642,795.44 (12,152,927)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	9,369	6.47	60,617.43	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	403	21.54	8,680.62	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,100	18.27	38,367.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,292	70.00	90,440.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	11.45	93,145.75	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	117.00	18,369.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	6,512	10.92	71,111.04	
	KOC HOLDING AS	2,509	19.15	48,047.35	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	396	90.00	35,640.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	997	11.71	11,674.87	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	3,509	16.00	56,144.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	7,135	9.52	67,925.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	3,028	6.91	20,923.48	
トルコ・リラ　小計		45,542		621,085.74 (8,552,351)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	968	1,979.00	1,915,672.00	
	OTP BANK RT	665	11,940.00	7,940,100.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	410	6,920.00	2,837,200.00	
ハンガリー・フォリント　小計		2,043		12,692,972.00 (4,357,497)	

フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	47.50	299,725.00	
	ABOITIZ POWER CORP	2,800	26.85	75,180.00	
	AYALA CORPORATION	1,175	850.00	998,750.00	
	AYALA LAND INC	23,000	39.25	902,750.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	4,840	86.70	419,628.00	
	BDO UNIBANK INC	6,370	99.00	630,630.00	
	GLOBE TELECOM INC	65	2,006.00	130,390.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	190	560.00	106,400.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,800	128.00	358,400.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	9,607	72.15	693,145.05	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,380	193.80	267,444.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	300.00	411,000.00	
	MEGAWORLD CORP	22,900	3.82	87,478.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	28,100	4.15	116,615.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	5,537	45.65	252,764.05	
	PLDT INC	265	1,370.00	363,050.00	
	ROBINSONS LAND CO	3,400	16.46	55,964.00	
	SM INVESTMENTS CORP	735	1,005.00	738,675.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	32,900	38.00	1,250,200.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	2,810	148.00	415,880.00	
フィリピン・ペソ　小計		156,554		8,574,068.10 (18,434,246)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	15,100	14.73	222,423.00	
	ATACADAO SA	1,900	20.29	38,551.00	
	B2W CIA DIGITAL	600	74.63	44,778.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	4,342	22.29	96,783.18	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	13,728	24.64	338,257.92	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	600	82.36	49,416.00	
	BANCO DO BRASIL SA	2,800	34.62	96,936.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	1,300	39.13	50,869.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	2,200	28.07	61,754.00	
	BM&FBOVESPA SA	6,700	55.32	370,644.00	
	BRASKEM SA-PREF A	500	23.26	11,630.00	
	BRF SA	1,600	20.79	33,264.00	
	CCR SA	3,800	12.70	48,260.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	700	32.59	22,813.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	700	31.39	21,973.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	500	69.82	34,910.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3,019	11.95	36,077.05	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	300	68.24	20,472.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	1,000	44.36	44,360.00	
	CIELO SA	3,900	3.77	14,703.00	

	COGNA EDUCACAO	6,100	4.98	30,378.00	
	COSAN SA	600	80.01	48,006.00	
	CPFL ENERGIA SA	600	30.77	18,462.00	
	ENERGISA SA-UNITS	600	46.80	28,080.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	44.01	29,706.75	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	2,500	21.12	52,800.00	
	GERDAU SA-PREF	3,100	21.24	65,844.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	700	71.37	49,959.00	
	HYPERA S.A	1,100	31.16	34,276.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	2,400	6.68	16,032.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	15,150	28.81	436,471.50	
	ITAUSA SA	13,930	10.72	149,329.60	
	JBS SA	3,500	21.84	76,440.00	
	KLABIN SA - UNIT	1,900	23.35	44,365.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	1,995	65.48	130,632.60	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	2,300	24.26	55,798.00	
	LOJAS RENNER S.A.	2,420	46.94	113,594.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	9,200	24.64	226,688.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,200	22.00	26,400.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	2,200	48.87	107,514.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	1,600	70.39	112,624.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	12,300	24.45	300,735.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	15,100	23.82	359,682.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	2,600	21.01	54,626.00	
	PORTO SEGURO SA	200	50.80	10,160.00	
	RAIA DROGASIL SA	4,000	25.86	103,440.00	
	RUMO SA	3,400	18.60	63,240.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	700	41.66	29,162.00	
	SUZANO S.A.	1,522	50.21	76,419.62	
	TELEF BRASIL	1,400	46.39	64,946.00	
	TIM SA	3,500	13.90	48,650.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	2,200	20.69	45,518.00	
	VALE SA	11,367	67.72	769,773.24	
	VIA VAREJO SA	3,800	17.94	68,172.00	
	WEG SA	2,760	80.93	223,366.80	
ブラジル・レアル　小計		203,908		5,730,166.06 (112,139,350)	
ポーランド・ズロチ	BANK PEKAO SA	648	55.84	36,184.32	
	CD PROJEKT SA	218	368.00	80,224.00	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	26.86	27,450.92	
	DINO POLSKA SA	96	268.00	25,728.00	
	GRUPA LOTOS SA	296	33.32	9,862.72	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	426	135.95	57,914.70	
	LPP SA	4	7,005.00	28,020.00	
	MBANK SA	66	167.00	11,022.00	
	ORANGE POLSKA SA	1,329	6.45	8,572.05	

	PGE SA	1,780	6.01	10,697.80	
	PKO BANK POLSKI SA	2,716	26.76	72,680.16	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	855	50.28	42,989.40	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	5,402	4.94	26,696.68	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	1,940	26.25	50,925.00	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	157	171.20	26,878.40	
ポーランド・ズロチ　小計		16,955		515,846.15 (14,232,195)	
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	3.27	31,719.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	8,700	3.33	28,971.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	600	21.90	13,140.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	18,300	3.64	66,612.00	
	DIALOG GROUP BHD	14,900	3.63	54,087.00	
	DIGI.COM BHD	9,600	4.11	39,456.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	300	31.84	9,552.00	
	GAMUDA BHD	3,100	3.62	11,222.00	
	GENTING BHD	6,700	4.09	27,403.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.51	28,363.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	500	9.86	4,930.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	1,100	8.32	9,152.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,700	14.10	66,270.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	2,200	16.80	36,960.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.24	30,856.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	6,300	5.43	34,209.00	
	IOI CORPORATION BHD	5,400	4.52	24,408.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	3,800	6.10	23,180.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,100	23.56	25,916.00	
	MALAYAN BANKING BHD	12,200	8.10	98,820.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	5.45	26,705.00	
	MAXIS BHD	6,200	5.05	31,310.00	
	MISC BHD	5,000	6.90	34,500.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	138.80	27,760.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	7,800	6.77	52,806.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	700	19.62	13,734.00	
	PETRONAS GAS BHD	2,200	16.32	35,904.00	
	PPB GROUP BERHAD	1,880	18.48	34,742.40	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	7,000	6.43	45,010.00	
	PUBLIC BANK BHD	9,900	18.38	181,962.00	
	QL RESOURCES BHD	3,000	6.35	19,050.00	
	RHB BANK BHD	4,900	5.05	24,745.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.32	11,136.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	7,700	5.20	40,040.00	

	SUPERMAX CORP BHD	4,600	7.76	35,696.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	2,200	4.70	10,340.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	6,000	11.24	67,440.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	14,400	6.94	99,936.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,800	4.20	7,560.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	8,618	0.73	6,291.14	
マレーシア・リンギット　小計		226,198		1,471,893.54 (37,356,658)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	9,600	14.90	143,040.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	101,600	14.26	1,448,816.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	101.55	182,790.00	
	CEMEX SAB-CPO	47,800	9.45	451,710.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	1,600	92.23	147,568.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	6,400	152.64	976,896.00	
	GRUMA S.A.B.-B	515	218.09	112,316.35	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	645	314.17	202,639.65	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	1,200	211.35	253,620.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	5,300	43.15	228,695.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	46.47	41,823.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	8,100	108.66	880,146.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	7,500	19.07	143,025.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	10,700	65.84	704,488.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	6,900	32.75	225,975.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	360	307.44	110,678.40	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	1,800	74.57	134,226.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	4,900	32.94	161,406.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	800	71.88	57,504.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	3,300	40.16	132,528.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	430	164.68	70,812.40	
	WALMART DE MEXICO-SER V	16,800	56.52	949,536.00	
メキシコ・ペソ　小計		238,950		7,760,238.80 (39,887,627)	
ユーロ	FF GROUP	129	4.80	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	533	12.85	6,849.05	
	JUMBO SA	280	14.66	4,104.80	
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	544	10.27	5,586.88	
	OPAP SA	482	8.53	4,111.46	
ユーロ　小計		1,968		21,271.39 (2,623,613)	

韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	55	165,000.00	9,075,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	105	188,000.00	19,740,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	17	58,300.00	991,100.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	60	50,800.00	3,048,000.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	130,500.00	1,957,500.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	85	5,980.00	508,300.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	203	97,700.00	19,833,100.00	
	CELLTRION INC	289	294,000.00	84,966,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	21,050.00	2,778,600.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	26	370,000.00	9,620,000.00	
	CJ CORP	53	79,700.00	4,224,100.00	
	CJ ENM CO LTD	28	134,200.00	3,757,600.00	
	CJ LOGISTICS	16	166,000.00	2,656,000.00	
	COWAY CO LTD	158	71,500.00	11,297,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	89	81,900.00	7,289,100.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	114	25,000.00	2,850,000.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	172	365,500.00	62,866,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	161	45,550.00	7,333,550.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	272	31,450.00	8,554,400.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	95	102,500.00	9,737,500.00	
	E-MART CO LTD	63	158,000.00	9,954,000.00	
	FILA HOLDINGS CORP	150	44,550.00	6,682,500.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	188	31,250.00	5,875,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	25	36,900.00	922,500.00	
	GS RETAIL CO LTD	52	34,100.00	1,773,200.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	969	35,700.00	34,593,300.00	
	HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	401	35,000.00	14,035,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	21	327,500.00	6,877,500.00	
	HANON SYSTEMS	960	15,500.00	14,880,000.00	
	HANWHA CORPORATION	18	26,150.00	470,700.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	466	49,400.00	23,020,400.00	
	HLB INC	170	93,200.00	15,844,000.00	
	HOTEL SHILLA CO LTD	99	78,900.00	7,811,100.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	207	33,550.00	6,944,850.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	59	188,000.00	11,092,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	31	254,500.00	7,889,500.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	123	23,950.00	2,945,850.00	
	HYUNDAI MOBIS	218	243,000.00	52,974,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO	476	180,000.00	85,680,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	167	85,000.00	14,195,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	45	85,400.00	3,843,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	260	31,900.00	8,294,000.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	787	9,080.00	7,145,960.00	
	KANGWON LAND INC	358	22,650.00	8,108,700.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	1,229	46,500.00	57,148,500.00	

KIA MOTORS CORPORATION	812	58,800.00	47,745,600.00	
KMW CO LTD	97	68,000.00	6,596,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	320	23,850.00	7,632,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	790	21,050.00	16,629,500.00	
KOREA GAS CORPORATION	54	28,550.00	1,541,700.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	139	74,000.00	10,286,000.00	
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	101	94,500.00	9,544,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	26	383,500.00	9,971,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	87	23,200.00	2,018,400.00	
KT&G CORP	371	85,300.00	31,646,300.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	35	151,000.00	5,285,000.00	
LG CHEM LTD	147	721,000.00	105,987,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	15	355,000.00	5,325,000.00	
LG CORP	307	75,400.00	23,147,800.00	
LG DISPLAY CO LTD	707	14,650.00	10,357,550.00	
LG ELECTRONICS INC	323	89,100.00	28,779,300.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	30	1,532,000.00	45,960,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	4	704,000.00	2,816,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	42	161,000.00	6,762,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	14	10,800.00	151,200.00	
LG UPLUS CORP	815	11,400.00	9,291,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	71	281,500.00	19,986,500.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	57	33,800.00	1,926,600.00	
LOTTE SHOPPING CO	22	96,700.00	2,127,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,040	3,735.00	3,884,400.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	1,312	9,450.00	12,398,400.00	
NAVER CORP	378	280,500.00	106,029,000.00	
NCSOFT CORPORATION	56	828,000.00	46,368,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	129,500.00	7,511,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	92	124,000.00	11,408,000.00	
OTTOGI CORPORATION	2	552,000.00	1,104,000.00	
PEARL ABYSS CORP	13	210,700.00	2,739,100.00	
POSCO	212	236,000.00	50,032,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	74	79,700.00	5,897,800.00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	69	14,000.00	966,000.00	
S-1 CORPORATION	32	82,600.00	2,643,200.00	
S-OIL CORPORATION	136	65,100.00	8,853,600.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	53	808,000.00	42,824,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	268	122,500.00	32,830,000.00	
SAMSUNG CARD CO	58	34,750.00	2,015,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	172	150,500.00	25,886,000.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	14,773	64,600.00	954,335,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	2,545	58,000.00	147,610,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	349	13,200.00	4,606,800.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	89	206,000.00	18,334,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1,171	5,790.00	6,780,090.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	225	75,000.00	16,875,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	177	518,000.00	91,686,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	113	179,000.00	20,227,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	94	38,050.00	3,576,700.00	
	SEEGENE INC	55	208,100.00	11,445,500.00	
	SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	89	123,000.00	10,947,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,477	33,250.00	49,110,250.00	
	SHINSEGAE CO LTD	14	229,000.00	3,206,000.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	112	214,500.00	24,024,000.00	
	SK HYNIX INC	1,698	98,200.00	166,743,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	174	154,000.00	26,796,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	112	229,500.00	25,704,000.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	417	4,050.00	1,688,850.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	2,131	9,900.00	21,096,900.00	
	YUHAN CORP	145	66,000.00	9,570,000.00	
韓国・ウォン　小計		45,058		3,071,350,250.00 (286,864,113)	
香港・ドル	3SBIO INC	4,000	7.32	29,280.00	
	A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	1,500	34.00	51,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2,000	42.10	84,200.00	
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	4,000	11.64	46,560.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	83,000	2.82	234,060.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	6.38	63,800.00	
	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	2,000	15.60	31,200.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	12,000	20.25	243,000.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	40,000	1.02	40,800.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	2.20	52,800.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,000	52.90	211,600.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	90.22	63,154.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,000	111.40	334,200.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	4.47	17,880.00	
	BAIC MOTOR CORP LTD-H	4,000	3.20	12,800.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	237,000	2.71	642,270.00	

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	27,000	4.18	112,860.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	6.27	25,080.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,500	25.50	38,250.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	3.11	49,760.00	
BOC AVIATION LTD	500	68.50	34,250.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.20	51,200.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	8,000	6.91	55,280.00	
BYD CO LTD	2,000	172.30	344,600.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	1,000	35.25	35,250.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	400	154.40	61,760.00	
CGN POWER CO LTD-H	34,000	1.66	56,440.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	4,000	8.08	32,320.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	1.52	42,560.00	
CHINA CITIC BANK	29,000	3.33	96,570.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	14,000	4.20	58,800.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	4.19	33,520.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	4,500	36.80	165,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	297,000	5.95	1,767,150.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	5,500	6.95	38,225.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	2,000	16.16	32,320.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,000	3.55	14,200.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	2,000	14.90	29,800.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	3.01	36,120.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	4.22	63,300.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	4,000	11.22	44,880.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	6,000	16.68	100,080.00	
CHINA FEIHE LTD	5,000	17.40	87,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4.83	55,545.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	9,600	27.30	262,080.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	6,500	6.80	44,200.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	21,000	0.88	18,480.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	4,000	18.00	72,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	18,000	3.94	70,920.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	5,000	13.12	65,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	23,000	17.66	406,180.00	

CHINA LITERATURE LTD	400	61.00	24,400.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	10,000	6.41	64,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	3,000	8.65	25,950.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	9,000	41.70	375,300.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	11,000	50.45	554,950.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	4,000	10.14	40,560.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	22,900	4.34	99,386.00	
CHINA MOBILE LTD/HK	19,000	47.10	894,900.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,000	3.47	20,820.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	12,000	10.90	130,800.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	4,000	5.96	23,840.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	12,000	19.00	228,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	4.90	24,500.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	8,600	27.55	236,930.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	78,000	3.54	276,120.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	26,880	8.21	220,684.80	
CHINA POWER INTERNATIONAL	10,000	1.56	15,600.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	9,000	3.93	35,370.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	4,000	2.83	11,320.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	6,500	5.39	35,035.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	13,000	0.81	10,530.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	4,000	57.35	229,400.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	6,000	10.50	63,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	2,000	36.90	73,800.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	10,000	36.30	363,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	4,000	4.12	16,480.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	6,000	8.35	50,100.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	10,000	14.48	144,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	4,000	4.89	19,560.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	4,000	5.33	21,320.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	12.94	85,404.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	42,000	2.39	100,380.00	

CHINA TOWER CORP LTD-H	134,000	1.24	166,160.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.44	20,640.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	18,000	4.83	86,940.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	4,700	29.05	136,535.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	5,000	3.23	16,150.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	8,000	6.37	50,960.00	
CITIC LTD	19,000	6.16	117,040.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	7,000	17.00	119,000.00	
CNOOC LTD	54,000	8.86	478,440.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	5.25	31,500.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	24,000	10.74	257,760.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	4,000	44.25	177,000.00	
CRRC CORP LTD H	13,000	3.21	41,730.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	4,500	4.90	22,050.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	8,000	8.68	69,440.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2,400	102.70	246,480.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	8.02	56,140.00	
FOSUN INTERNATIONAL	7,500	11.10	83,250.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	37.35	119,520.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	20,000	22.65	453,000.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	2,000	12.30	24,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	11.18	53,664.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	20,000	0.93	18,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	6,500	13.88	90,220.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	6,000	8.74	52,440.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	8,000	13.36	106,880.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	9,600	8.87	85,152.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	3,200	10.18	32,576.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	1,400	10.94	15,316.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	3,000	57.30	171,900.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	38.50	192,500.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1,000	22.35	22,350.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	6.46	64,600.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	33.80	135,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	2,000	57.45	114,900.00	

HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1,000	33.55	33,550.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	3.14	43,960.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	12.04	65,016.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	186,000	4.60	855,600.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	3,000	54.45	163,350.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	9.34	18,680.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	2,000	10.80	21,600.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	7,000	3.88	27,160.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	2,000	27.95	55,900.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	12.42	31,050.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	7,000	25.40	177,800.00	
KINGSOFT CORP LTD	3,000	41.00	123,000.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	10,000	6.42	64,200.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	11.40	45,600.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	3,000	5.67	17,010.00	
LEGEND GROUP LTD	22,000	5.41	119,020.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	1,000	10.50	10,500.00	
LI NING CO LTD	6,000	47.15	282,900.00	
LOGAN GROUP CO LTD	4,000	12.88	51,520.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	5,500	49.50	272,250.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	2,500	4.30	10,750.00	
MEITUAN-B	11,000	294.00	3,234,000.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	2,200	32.20	70,840.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	10.48	31,440.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	2.42	55,660.00	
PETROCHINA CO LTD-H	64,000	2.52	161,280.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	23,000	6.38	146,740.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,100	104.00	114,400.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	17,500	88.90	1,555,750.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	600	55.10	33,060.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	26,000	4.28	111,280.00	
SEAZEN GROUP LTD	8,000	6.67	53,360.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	11,000	22.90	251,900.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	16.88	135,040.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	4,000	2.20	8,800.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	1,000	33.05	33,050.00	

SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	1,000	11.40	11,400.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	13.62	36,774.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	5,500	13.52	74,360.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	8,000	2.53	20,240.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2,500	141.30	353,250.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	4,000	30.50	122,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	33,000	7.80	257,400.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	6,000	1.62	9,720.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	3,000	3.35	10,050.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	24,000	1.60	38,400.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	4,800	19.36	92,928.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	2,000	19.72	39,440.00	
SOHO CHINA LTD	4,500	2.54	11,430.00	
SSY GROUP LTD	4,000	4.77	19,080.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	5,500	8.16	44,880.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	8,000	31.15	249,200.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	257	14.14	3,633.98	
SUNNY OPTICAL TECH	2,500	157.80	394,500.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	17,700	573.00	10,142,100.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	6,000	14.12	84,720.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	4,400	14.68	64,592.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	4,000	12.02	48,080.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3,000	18.86	56,580.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	73.05	146,100.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	7.30	21,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	15,000	5.67	85,050.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	6,000	17.14	102,840.00	
WHARF HOLDINGS LTD	4,000	17.80	71,200.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	784	123.00	96,432.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	9,000	78.95	710,550.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	34,400	25.20	866,880.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,400	12.10	29,040.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	14,000	13.44	188,160.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	4,000	6.18	24,720.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1,000	97.05	97,050.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	16,000	1.57	25,120.00	

	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	13,000	3.07	39,910.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	3,500	10.20	35,700.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.62	11,240.00	
	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	7,000	4.81	33,670.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	700	38.65	27,055.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	61.90	123,800.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	1,700	25.85	43,945.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	7.23	130,140.00	
	ZTE CORP-H	2,800	20.70	57,960.00	
香港・ドル　小計		2,713,821		38,747,992.78 (519,223,103)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	2,000	242.50	485,000.00	
	ACER INC	13,000	22.70	295,100.00	
	ADVANTECH CO LTD	1,099	315.00	346,185.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	10,000	72.90	729,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	7,000	44.25	309,750.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	2,000	251.00	502,000.00	
	AU OPTRONICS CORP	26,000	11.25	292,500.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	192.00	384,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	25,000	41.50	1,037,500.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	4,327	166.00	718,282.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,560	17.95	351,102.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	4,000	41.80	167,200.00	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	1,005	85.80	86,229.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	37,000	8.69	321,530.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,918	20.50	223,819.00	
	CHINA STEEL CORP	37,000	22.00	814,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	12,000	110.00	1,320,000.00	
	COMPAL ELECTRONICS	13,000	19.50	253,500.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	49,000	19.60	960,400.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	6,000	208.00	1,248,000.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	36,039	25.65	924,400.35	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	417.00	417,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	3,243	12.60	40,861.80	
	EVERGREEN MARINE	3,150	21.95	69,142.50	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	10,000	28.20	282,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	4,000	60.90	243,600.00	

FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,320	193.00	254,760.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	33,569	21.70	728,447.30	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	10,000	79.80	798,000.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	4,000	94.00	376,000.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	11,000	88.10	969,100.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	1,000	31.90	31,900.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	2,000	51.50	103,000.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	20,000	45.25	905,000.00	
GIANT MANUFACTURING	1,000	283.50	283,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	440.00	440,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	2,200	43.15	94,930.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,060	298.00	315,880.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	38,200	82.90	3,166,780.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	700.00	700,000.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	24,186	18.55	448,650.30	
INNOLUX CORPORATION	28,000	9.52	266,560.00	
INVENTEC CO LTD	8,000	23.00	184,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	7,000	48.75	341,250.00	
MEDIATEK INC	5,000	733.00	3,665,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	35,000	29.60	1,036,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	2,000	123.00	246,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	17,000	65.30	1,110,100.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	4,000	67.80	271,200.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	2,000	297.50	595,000.00	
PEGATRON CORP	6,000	65.00	390,000.00	
POU CHEN	7,000	31.00	217,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	2,000	89.50	179,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	271.00	542,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	9,000	76.50	688,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	381.00	762,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,800	41.40	74,520.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	31,244	8.62	269,323.28	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	34,480	11.30	389,624.00	
STANDARD FOODS CORP	1,000	61.90	61,900.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	4,000	43.35	173,400.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	29,170	13.30	387,961.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	19,672	9.85	193,769.20	

	TAIWAN CEMENT	11,629	42.90	498,884.10	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	30,245	20.45	618,510.25	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	31.45	188,700.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	5,000	99.50	497,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	76,000	490.00	37,240,000.00	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	10,000	40.50	405,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	15,000	68.40	1,026,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	37,000	32.10	1,187,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	2,000	99.00	198,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	1,000	189.00	189,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	1,000	336.00	336,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	17.45	383,900.00	
	WISTRON CORP	9,146	29.95	273,922.70	
	WPG HOLDINGS LTD	5,760	40.30	232,128.00	
	YAGEO CORPORATION	1,000	404.00	404,000.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	31,200	18.95	591,240.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	2,000	119.00	238,000.00	
台湾・ドル　小計		1,014,222		78,990,641.78 (287,525,936)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	2,712	107.27	290,916.24	
	ANGLO PLATINUM LTD	176	1,177.02	207,155.52	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	1,292	340.70	440,184.40	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	961	126.61	121,672.21	
	BID CORP LTD	1,065	283.41	301,831.65	
	BIDVEST GROUP LTD	883	162.30	143,310.90	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	226	1,380.00	311,880.00	
	CLICKS GROUP LTD	796	252.01	200,599.96	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	1,109	126.25	140,011.25	
	EXXARO RESOURCES LTD	783	122.97	96,285.51	
	FIRSTRAND LTD	15,922	47.16	750,881.52	
	GOLD FIELDS LTD	3,120	146.19	456,112.80	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	1,461	69.96	102,211.56	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	2,526	169.57	428,333.82	
	KUMBA IRON ORE LTD	214	500.13	107,027.82	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	4,021	17.46	70,206.66	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	1,761	16.04	28,246.44	
	MR PRICE GROUP LTD	673	156.01	104,994.73	
	MTN GROUP LTD	5,409	66.80	361,321.20	
	MULTICHOICE GROUP LTD	1,332	131.03	174,531.96	
	NASPERS LTD-N SHS	1,342	3,041.25	4,081,357.50	

	NEDBANK GROUP LTD	1,237	135.12	167,143.44	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	1,207	70.19	84,719.33	
	NORTHAM PLATINUM LTD	1,216	177.88	216,302.08	
	OLD MUTUAL LTD	15,106	12.18	183,991.08	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	3,649	13.94	50,867.06	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	1,888	31.67	59,792.96	
	REINET INVESTMENTS SCA	328	285.03	93,489.84	
	REMGRO LTD	1,616	96.52	155,976.32	
	SANLAM LIMITED	5,058	55.70	281,730.60	
	SASOL LTD	1,791	117.68	210,764.88	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	1,476	131.67	194,344.92	
	SIBANYE STILLWATER LTD	7,182	51.36	368,867.52	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	596	206.75	123,223.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	4,151	128.91	535,105.41	
	TIGER BRANDS LTD	508	207.45	105,384.60	
	VODACOM GROUP LTD	2,030	126.12	256,023.60	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	2,935	38.77	113,789.95	
南アフリカ・ランド　小計		99,758		12,120,590.24 (81,692,778)	
合計		7,489,746		2,171,408,735 (2,171,408,735)	

② 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	9,546.00	173,164.44	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	19,200.00	590,016.00	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	11,104.00	125,031.04	
	アメリカ・ドル　小計		39,850.00	888,211.48 (92,267,409)	
投資信託受益証券　合計				92,267,409 (92,267,409)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8,900.00	173,550.00	
	メキシコ・ペソ　小計		8,900.00	173,550.00 (892,047)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	9,053.00	112,709.85	
	南アフリカ・ランド　小計		9,053.00	112,709.85 (759,664)	
投資証券　合計				1,651,711 (1,651,711)	
合計				93,919,120 (93,919,120)	

（注）１．　通貨種類ごとの小計欄の（　）内は、邦貨換算額であります。
（注）２．　種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。（　）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
（注）３．　外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	55銘柄	15.54%	-%	-%	20.21%
	投資信託受益証券	3銘柄	-%	3.92%	-%	
イギリス・ポンド	株式	1銘柄	0.07%	-%	-%	0.07%
インド・ルピー	株式	84銘柄	7.86%	-%	-%	8.16%
インドネシア・ルピア	株式	21銘柄	1.37%	-%	-%	1.42%
オフショア・人民元	株式	127銘柄	4.77%	-%	-%	4.96%
コロンビア・ペソ	株式	5銘柄	0.18%	-%	-%	0.19%
タイ・バーツ	株式	40銘柄	1.83%	-%	-%	1.91%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.09%	-%	-%	0.09%
チリ・ペソ	株式	16銘柄	0.52%	-%	-%	0.54%
トルコ・リラ	株式	13銘柄	0.36%	-%	-%	0.38%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.19%	-%	-%	0.19%
フィリピン・ペソ	株式	20銘柄	0.78%	-%	-%	0.81%
ブラジル・レアル	株式	55銘柄	4.76%	-%	-%	4.95%
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.60%	-%	-%	0.63%
マレーシア・リンギット	株式	40銘柄	1.59%	-%	-%	1.65%
メキシコ・ペソ	株式	22銘柄	1.69%	-%	-%	1.80%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.04%	
ユーロ	株式	5銘柄	0.11%	-%	-%	0.12%
韓国・ウォン	株式	106銘柄	12.19%	-%	-%	12.66%
香港・ドル	株式	199銘柄	22.06%	-%	-%	22.92%
台湾・ドル	株式	80銘柄	12.22%	-%	-%	12.69%
南アフリカ・ランド	株式	38銘柄	3.47%	-%	-%	3.64%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.03%	

(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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,671,023	1,615,735
コール・ローン	952,039,197	354,100,755
投資証券	31,416,451,100	24,449,444,250
未収入金	30,846,954	27,451,978
未収配当金	148,501,553	157,109,348
流動資産合計	32,571,509,827	24,989,722,066
資産合計	32,571,509,827	24,989,722,066
負債の部		
流動負債		
未払金	524,172,847	26,397,803
未払解約金	247,460,838	80,624,514
その他未払費用	5,218	389
流動負債合計	771,638,903	107,022,706
負債合計	771,638,903	107,022,706
純資産の部		
元本等		
元本	16,398,065,583	16,261,892,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,401,805,341	8,620,807,050
純資産合計	31,799,870,924	24,882,699,360
負債純資産合計	32,571,509,827	24,989,722,066

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	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。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	16,398,065,583口	16,261,892,310口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9392円 (19,392円)	1.5301円 (15,301円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	1,436,964,806	△523,212,964
合計	1,436,964,806	△523,212,964

（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11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	11,518,929,567円	16,398,065,583円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	12,025,469,621円	10,734,070,769円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	7,146,333,605円	10,870,244,042円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,589,859,033円	1,408,620,060円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	1,501,629,877円	1,334,615,580円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＪリートインデックスファンド	8,117,494,358円	7,994,095,472円
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０１３－０２（適格機関投資家限定）	1,858,643,446円	1,797,071,866円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	2,484,924,690円	2,497,454,821円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	785,204,355円	1,124,577,814円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	38,195,777円	67,045,069円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	3,282,914円	7,181,692円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	938,090円	2,029,548円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）	2,642,646円	5,799,025円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	15,250,397円	23,140,573円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型）	－円	87,185円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型）	－円	173,605円
計	16,398,065,583円	16,261,892,310円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額又は口数	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	746	110,557,200	
	ＧＬＰ投資法人	7,863	1,258,080,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	3,346	269,687,600	
	Ｏｎｅリート投資法人	426	102,453,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	609	75,698,700	
	いちごオフィスリート投資法人	2,269	159,737,600	
	いちごホテルリート投資法人	478	33,842,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,370	533,615,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,597	788,189,500	
	イオンリート投資法人	2,773	334,423,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,567	240,667,900	
	インヴィンシブル投資法人	11,434	371,605,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	447	49,348,800	

	オリックス不動産投資法人	5,448	827,006,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,899	187,811,100	
	ケネディクス・オフィス投資法人	846	550,746,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,784	310,594,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,006	223,332,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,193	352,412,200	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	526	54,704,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	669	64,357,800	
	ザイマックス・リート投資法人	419	38,003,300	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,809	449,259,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,537	313,319,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,734	1,432,616,000	
	スターアジア不動産投資法人	2,810	129,541,000	
	スターツプロシード投資法人	426	83,283,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	822	71,103,000	
	トーセイ・リート投資法人	605	63,646,000	
	ヒューリックリート投資法人	2,201	307,479,700	
	フロンティア不動産投資法人	907	339,218,000	
	プレミア投資法人	2,470	289,237,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	583	73,574,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	256	28,160,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,848	705,853,600	
	ラサールロジポート投資法人	3,047	483,254,200	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,061	142,174,000	
	阪急阪神リート投資法人	1,235	151,781,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	954	476,046,000	
	三菱地所物流リート投資法人	615	241,387,500	
	産業ファンド投資法人	3,865	672,123,500	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	592	63,699,200	
	森トラスト総合リート投資法人	1,954	245,031,600	
	森ヒルズリート投資法人	3,212	434,262,400	
	星野リゾート・リート投資法人	416	207,792,000	
	積水ハウス・リート投資法人	8,043	601,616,400	
	大江戸温泉リート投資法人	441	31,707,900	
	大和ハウスリート投資法人	3,901	945,602,400	
	大和証券オフィス投資法人	583	370,205,000	
	大和証券リビング投資法人	3,450	310,845,000	
	投資法人みらい	2,953	108,522,750	
	東急リアル・エステート投資法人	1,833	270,917,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	909	534,492,000	
	日本ビルファンド投資法人	3,077	1,753,890,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,702	509,749,000	
	日本プロロジスリート投資法人	4,138	1,417,265,000	
	日本リート投資法人	888	304,140,000	
	日本リテールファンド投資法人	5,137	831,680,300	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,787	537,887,000	
	福岡リート投資法人	1,414	195,414,800	
	平和不動産リート投資法人	1,678	193,641,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8,843	1,191,152,100	
投資証券　合計		164,451	24,449,444,250	
合計		164,451	24,449,444,250	

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。

「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	10,428,921	4,026,889
金銭信託	2,397,162	250,284
コール・ローン	96,412,913	54,851,725
投資証券	2,413,971,912	2,458,157,327
未収入金	104,316	28,019,012
未収配当金	4,487,833	6,246,462
流動資産合計	2,527,803,057	2,551,551,699
資産合計	2,527,803,057	2,551,551,699
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	8,066
未払解約金	56,919,231	53,606,652
その他未払費用	325	68
流動負債合計	56,919,556	53,614,786
負債合計	56,919,556	53,614,786
純資産の部		
元本等		
元本	2,138,126,735	2,505,757,114
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	332,756,766	△7,820,201
純資産合計	2,470,883,501	2,497,936,913
負債純資産合計	2,527,803,057	2,551,551,699

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
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。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	2,138,126,735口	2,505,757,114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	――――――	7,820,201円
３．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1556円 (11,556円)	0.9969円 (9,969円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	247,250,811	△281,579,062
合計	247,250,811	△281,579,062

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	－	－	－	－	27,812,654	－	27,820,720	△8,066
アメリカ・ドル	－	－	－	－	24,597,583	－	24,603,699	△6,116
イギリス・ポンド	－	－	－	－	861,972	－	862,413	△441
シンガポール・ドル	－	－	－	－	2,353,099	－	2,354,608	△1,509
合計	－	－	－	－	27,812,654	－	27,820,720	△8,066

（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。
①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。
②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。
２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

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

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,958,293,015円	2,138,126,735円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	322,424,011円	707,585,616円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	142,590,291円	339,955,237円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,859,238,576円	1,809,389,383円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	64,798,652円	113,071,639円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	5,538,910円	11,782,552円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	1,584,230円	3,326,410円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	25,749,136円	38,043,480円
ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	181,217,231円	530,143,650円
計	2,138,126,735円	2,505,757,114円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表
① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	1,731.00	24,614.82	
		AGREE REALTY CORP	970.00	62,943.30	
		ALEXANDER'S INC	18.00	5,204.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,271.00	371,853.54	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,029.00	29,768.97	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,829.00	114,235.02	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,038.00	15,183.10	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	4,879.00	139,393.03	
		AMERICOLD REALTY TRUST	3,975.00	139,204.50	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	3,012.00	92,890.08	

		APPLE HOSPITALITY REIT INC	4,249.00	54,812.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,707.00	461,002.10	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,066.00	9,956.44	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,829.00	275,601.18	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	4,104.00	44,282.16	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,845.00	97,202.35	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	1,167.00	19,348.86	
		BRT APARTMENTS CORP	345.00	4,616.10	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,795.00	175,640.75	
		CARETRUST REIT INC	1,954.00	37,653.58	
		CHATHAM LODGING TRUST	1,586.00	17,477.72	
		CITY OFFICE REIT INC	275.00	2,329.25	
		CLIPPER REALTY INC	93.00	560.79	
		COLONY CAPITAL INC	10,736.00	45,520.64	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	2,599.00	36,100.11	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	490.00	22,353.80	
		CORECIVIC INC	2,136.00	14,567.52	
		COREPOINT LODGING INC	1,013.00	6,604.76	
		CORESITE REALTY CORP	801.00	102,351.78	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2,327.00	62,549.76	
		COUSINS PROPERTIES INC	2,912.00	94,581.76	
		CUBESMART	3,657.00	121,631.82	
		CYRUSONE INC	2,327.00	167,404.38	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	4,989.00	36,669.15	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,249.00	750,607.00	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	4,231.00	19,801.08	
		DOUGLAS EMMETT INC	3,143.00	100,198.84	
		DUKE REALTY CORP	6,975.00	269,862.75	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1,466.00	32,222.68	
		EASTGROUP PROPERTIES	770.00	108,362.10	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	2,154.00	18,309.00	
		EPR PROPERTIES	1,551.00	49,383.84	
		EQUINIX INC	1,725.00	1,260,267.75	
		EQUITY COMMONWEALTH	1,603.00	42,543.62	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,132.00	190,175.04	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,607.00	395,495.02	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	2,031.00	40,132.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,262.00	320,737.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,511.00	282,788.82	
		FARMLAND PARTNERS INC	604.00	4,898.44	

		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,412.00	128,195.48	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2,390.00	100,451.70	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,568.00	44,233.28	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,666.00	8,113.42	
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	1,202.00	16,094.78	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	4,226.00	174,702.84	
		GEO GROUP INC/THE	2,701.00	25,524.45	
		GETTY REALTY CORP	549.00	15,838.65	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	866.00	15,631.30	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,067.00	15,012.69	
		GLOBAL NET LEASE INC	2,082.00	34,956.78	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,547.00	78,880.59	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	4,299.00	117,147.75	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	10,382.00	317,689.20	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	611.00	4,472.52	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,143.00	79,719.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	13,919.00	201,129.55	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	3,115.00	81,426.10	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2,175.00	28,492.50	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	1,303.00	28,418.43	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	450.00	69,061.50	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	187.00	13,626.69	
		INVITATION HOMES INC	10,722.00	301,073.76	
		IRON MOUNTAIN INC	5,838.00	150,562.02	
		JBG SMITH PROPERTIES	2,040.00	63,505.20	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	15,200.00	10,564.00	
		KILROY REALTY CORP	1,973.00	123,746.56	
		KIMCO REALTY CORP	8,728.00	130,745.44	
		KITE REALTY GROUP TRUST	1,573.00	23,296.13	
		LEXINGTON REALTY TRUST	5,062.00	52,948.52	
		LIFE STORAGE INC	928.00	103,806.08	
		LTC PROPERTIES INC	677.00	25,407.81	
		MACERICH CO/THE	2,228.00	20,519.88	
		MACK-CALI REALTY CORP	1,534.00	21,153.86	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	31,700.00	23,299.50	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10,745.00	206,626.35	

		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,194.00	276,751.16	
		MONMOUTH REIT -CL A	1,629.00	24,011.46	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,468.00	139,170.84	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,161.00	41,261.94	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	1,001.00	65,605.54	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,121.00	11,135.25	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	432.00	18,770.40	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,049.00	24,252.88	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4,525.00	156,157.75	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	420.00	7,446.60	
		PARAMOUNT GROUP INC	3,077.00	29,969.98	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	4,614.00	71,517.00	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,025.00	56,991.00	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	4,090.00	73,538.20	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2,260.00	35,414.20	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	601.00	7,999.31	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	508.00	4,353.56	
		PRIME US REIT	11,300.00	8,814.00	
		PROLOGIS INC	14,379.00	1,437,756.21	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	309.00	41,338.02	
		PUBLIC STORAGE	2,908.00	665,321.32	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,216.00	75,987.84	
		REALTY INCOME CORP	6,763.00	413,286.93	
		REGENCY CENTERS CORP	3,252.00	155,315.52	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	2,876.00	38,624.68	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	5,164.00	41,312.00	
		RETAIL VALUE INC	338.00	4,958.46	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	2,354.00	114,074.84	
		RLJ LODGING TRUST	3,857.00	47,749.66	
		RPT REALTY	2,399.00	17,176.84	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,055.00	63,384.40	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	4,464.00	74,905.92	
		SAFEHOLD INC	317.00	21,416.52	
		SAUL CENTERS INC	186.00	5,671.14	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	659.00	10,359.48	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	3,218.00	37,940.22	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,016.00	485,070.08	
		SITE CENTERS CORP	3,163.00	32,452.38	
		SL GREEN REALTY CORP	1,570.00	90,981.50	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,133.00	76,745.34	
		STAG INDUSTRIAL INC	2,775.00	83,028.00	
		STORE CAPITAL CORP	4,654.00	148,928.00	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,855.00	15,192.45	
		SUN COMMUNITIES INC	1,849.00	258,675.10	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3,500.00	37,800.00	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,475.00	13,186.50	
		TAUBMAN CENTERS INC	1,127.00	48,246.87	
		TERRENO REALTY CORP	1,280.00	75,392.00	
		UDR INC	5,741.00	222,750.80	
		UMH PROPERTIES INC	479.00	6,902.39	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	291.00	17,366.88	
		URBAN EDGE PROPERTIES	2,165.00	28,664.60	
		URSTADT BIDDLE - CL A	500.00	6,335.00	
		VENTAS INC	7,307.00	355,266.34	
		VEREIT	20,754.00	152,749.44	
		VICI PROPERTIES INC	10,796.00	279,292.52	
		VORNADO REALTY TRUST	3,182.00	126,770.88	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	4,308.00	3,394.70	
		WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,407.00	33,261.48	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	2,715.00	59,051.25	
		WELLTOWER INC	8,162.00	532,162.40	
		WHITESTONE REIT	1,666.00	12,828.20	
		WP CAREY INC	3,303.00	231,309.09	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	2,019.00	27,418.02	
	アメリカ・ドル　小計		519,257.00	17,428,954.25 (1,810,519,767)	
	イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	3,378.00	2,628.08	
		ASSURA PLC	53,934.00	40,935.90	
		BIG YELLOW GROUP PLC	3,039.00	35,465.13	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	19,723.00	14,397.79	
		BRITISH LAND CO PLC	19,333.00	92,817.73	
		CAPITAL & COUNTIES PRO-W/I	17,283.00	24,196.20	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	8,881.00	9,271.76	
		CUSTODIAN REIT PLC	5,885.00	5,167.03	
		DERWENT LONDON PLC	2,179.00	70,599.60	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	9,327.00	6,715.44	
		GCP STUDENT LIVING PLC	9,283.00	13,181.86	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	5,644.00	37,792.22	
		HAMMERSON PLC	79,291.00	18,157.63	

		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	5,009.00	5,359.63	
		INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
		INVISTA FOUNDATION PROPERTY	6,989.00	2,725.71	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,300.00	104,575.50	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	18,657.00	43,955.89	
		LXI REIT PLC	8,606.00	10,378.83	
		NEWRIVER REIT PLC	6,981.00	5,061.22	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	13,020.00	9,556.68	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	24,115.00	35,111.44	
		RDI REIT PLC	9,730.00	9,282.42	
		REGIONAL REIT LTD	15,739.00	12,701.37	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	4,355.00	35,384.37	
		SEGRO PLC	23,329.00	211,967.29	
		SHAFTESBURY PLC	4,412.00	24,045.40	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	11,337.00	11,847.16	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	5,029.00	5,406.17	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	35,962.00	59,193.45	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	16,967.00	12,827.05	
		UNITE GROUP PLC	8,127.00	87,040.17	
		WORKSPACE GROUP PLC	2,940.00	20,653.50	
イギリス・ポンド　小計			493,371.00	1,078,419.20 (148,476,755)	
イスラエル・シュケル		REIT 1 LTD	3,643.00	57,559.40	
イスラエル・シュケル　小計			3,643.00	57,559.40 (1,786,644)	
オーストラリア・ドル		ABACUS PROPERTY GROUP	8,316.00	26,361.72	
		APN INDUSTRIA REIT	1,406.00	4,035.22	
		ARENA REIT	6,685.00	18,718.00	
		BWP TRUST	9,674.00	41,307.98	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	8,737.00	20,968.80	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	8,760.00	27,068.40	
		CENTURIA OFFICE REIT	9,829.00	22,803.28	
		CHARTER HALL GROUP	9,765.00	130,460.40	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	10,254.00	50,142.06	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	10,660.00	41,360.80	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	6,214.00	18,766.28	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	38,140.00	38,140.00	
		DEXUS	21,478.00	210,913.96	
		GDI PROPERTY GROUP	5,939.00	7,097.10	
		GOODMAN GROUP	32,899.00	614,553.32	
		GPT GROUP	40,248.00	184,738.32	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	6,212.00	23,170.76	

		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	5,048.00	15,901.20	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,242.00	33,023.52	
		INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	9,150.00	11,254.50	
		MIRVAC GROUP	81,836.00	220,957.20	
		NATIONAL STORAGE REIT	23,334.00	43,167.90	
		RURAL FUNDS GROUP	7,734.00	20,185.74	
		SCENTRE GROUP	103,920.00	288,897.60	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	24,216.00	60,540.00	
		STOCKLAND	49,147.00	221,161.50	
		VICINITY CENTRES	77,784.00	130,288.20	
		WAYPOINT REIT LTD	17,763.00	47,960.10	
オーストラリア・ドル　小計			642,390.00	2,573,943.86 (194,590,156)	
カナダ・ドル		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1,200.00	47,400.00	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,100.00	22,239.00	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	800.00	8,536.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	600.00	20,202.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,500.00	74,640.00	
		CHOICE PROPERTIES REIT	2,748.00	36,878.16	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,800.00	16,128.00	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	700.00	10,395.00	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	500.00	7,360.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1,500.00	18,870.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000.00	20,550.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2,200.00	33,748.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	500.00	37,505.00	
		H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	3,300.00	45,078.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	900.00	12,384.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	900.00	15,642.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	600.00	11,304.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	200.00	3,088.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,200.00	26,686.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,700.00	63,751.00	
		SLATE GROCERY REIT	900.00	10,899.00	
		SLATE OFFICE REIT	2,200.00	8,822.00	

	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,700.00	41,667.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,800.00	23,796.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	900.00	5,670.00	
カナダ・ドル　小計		36,448.00	623,238.16 (49,503,807)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	7,200.00	8,568.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	19,000.00	11,020.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	52,700.00	156,519.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	35,242.00	35,065.79	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	82,328.00	163,009.44	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	16,100.00	19,803.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	15,600.00	18,564.00	
	ESR REIT	66,900.00	26,091.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	23,500.00	14,922.50	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	8,800.00	3,740.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	18,300.00	42,273.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	55,011.00	69,313.86	
	IREIT GLOBAL	12,600.00	7,875.00	
	KEPPEL DC REIT	24,900.00	70,716.00	
	KEPPEL REIT	36,000.00	37,440.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	20,400.00	13,260.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	29,800.00	2,443.60	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	42,800.00	85,600.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	29,100.00	87,300.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	53,200.00	105,336.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	44,400.00	41,070.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	26,700.00	9,478.50	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	2,500.00	9,900.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	11,200.00	3,920.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	3,400.00	2,720.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	33,400.00	16,533.00	
	SPH REIT	4,100.00	3,280.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	21,100.00	9,811.50	
	SUNTEC REIT	42,900.00	65,208.00	
シンガポール・ドル　小計		839,181.00	1,140,781.19 (88,136,755)	

	ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	14,738.00	21,517.48	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	18,883.00	45,508.03	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	33,732.00	43,176.96	
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	17,855.00	31,514.07	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	4,583.00	13,680.25	
	ニュージーランド・ドル　小計		89,791.00	155,396.79 (11,152,827)	
	ユーロ	AEDIFICA	594.00	59,103.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,101.00	42,204.61	
		ALTAREA	21.00	2,914.80	
		BEFIMMO S.C.A.	274.00	10,247.60	
		COFINIMMO	458.00	58,440.80	
		COVIVIO	1,034.00	74,706.50	
		EUROCOMMERCIAL-CVA	759.00	11,324.28	
		GECINA SA	1,068.00	138,306.00	
		HIBERNIA REIT PLC-W/I	12,137.00	15,292.62	
		ICADE	598.00	38,571.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	3,929.74	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	5,324.00	43,869.76	
		INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	314.00	7,159.20	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	6,593.00	9,955.43	
		KLEPIERRE	4,187.00	75,303.19	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1,218.00	5,420.10	
		MERCIALYS	500.00	3,137.50	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	6,664.00	52,312.40	
		MONTEA	151.00	14,526.20	
		NSI NV	124.00	3,974.20	
		RETAIL ESTATES	211.00	12,828.80	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,769.00	156,171.60	
		VASTNED RETAIL NV	245.00	6,100.50	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,377.00	68,505.14	
		WERELDHAVE NV	1,103.00	11,912.40	
	ユーロ　小計		52,950.00	926,217.37 (114,239,650)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	25,000.00	110,000.00	
		FORTUNE REIT	19,000.00	133,000.00	
		LINK REIT	39,300.00	2,723,490.00	
	香港・ドル　小計		83,300.00	2,966,490.00 (39,750,966)	
投資証券　合計				2,458,157,327 (2,458,157,327)	
合計				2,458,157,327 (2,458,157,327)	

（注）１．通貨種類ごとの小計欄の（　）内は、邦貨換算額であります。
（注）２．種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。（　）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
（注）３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 151銘柄	72.48%	73.65%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	5.94%	6.04%
イスラエル・シュケル	投資証券 1銘柄	0.07%	0.07%
オーストラリア・ドル	投資証券 28銘柄	7.79%	7.92%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	1.98%	2.01%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	3.53%	3.59%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	0.45%	0.45%
ユーロ	投資証券 25銘柄	4.57%	4.65%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	1.59%	1.62%

(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。

「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17,896,530	3,263,107
コール・ローン	719,791,373	715,134,885
国債証券	57,768,627,800	59,246,366,240
地方債証券	7,218,000,954	6,941,484,288
特殊債券	8,348,131,578	7,964,184,739
社債券	5,745,638,100	4,800,673,800
未収利息	185,554,319	183,104,653
前払費用	1,594,822	3,630,961
流動資産合計	80,005,235,476	79,857,842,673
資産合計	80,005,235,476	79,857,842,673
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,369,510	16,804,162
その他未払費用	3,824	881
流動負債合計	5,373,334	16,805,043
負債合計	5,373,334	16,805,043
純資産の部		
元本等		
元本	80,458,265,938	81,027,549,554
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△458,403,796	△1,186,511,924
純資産合計	79,999,862,142	79,841,037,630
負債純資産合計	80,005,235,476	79,857,842,673

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	80,458,265,938口	81,027,549,554口
２．　投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	458,403,796円	1,186,511,924円
３．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9943円 (9,943円)	0.9854円 (9,854円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	501,204,720	△1,241,311,430
地方債証券	△35,879,623	△59,968,309
特殊債券	△32,516,691	△51,139,536
社債券	△26,464,200	△35,555,100
合計	406,344,206	△1,387,974,375

（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11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	91,553,091,806円	80,458,265,938円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	7,229,627,282円	8,990,513,828円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	18,324,453,150円	8,421,230,212円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブＤＢ（適格機関投資家限定）	76,296,408,816円	73,107,845,104円
ＤＣニッセイ日本債券インデックス	1,851,878,712円	2,389,221,039円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	34,686,709円	63,168,246円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,648,815,407円	3,213,068,882円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	34,894,519円	95,856,034円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	117,890,150円	373,115,899円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	300,648,162円	960,641,992円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	75,145,871円	105,454,989円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	4,591,102円	7,844,408円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）	24,364,655円	42,574,201円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	29,860,218円	35,744,250円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	1,990,783円	13,265,677円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	2,897,961円	16,791,479円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	7,036,801円	82,046,548円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	27,156,072円	520,910,806円
計	80,458,265,938円	81,027,549,554円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 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４０７回　利付国債（２年）	70,000,000	70,185,500	
	第４０８回　利付国債（２年）	81,000,000	81,232,470	
	第４０９回　利付国債（２年）	78,000,000	78,241,020	
	第４１０回　利付国債（２年）	79,000,000	79,285,190	
	第４１１回　利付国債（２年）	200,000,000	200,716,000	
	第４１２回　利付国債（２年）	8,000,000	8,032,160	
	第４１３回　利付国債（２年）	186,000,000	186,777,480	
	第４１４回　利付国債（２年）	74,000,000	74,320,420	
	第４１５回　利付国債（２年）	160,000,000	160,715,200	
	第４１６回　利付国債（２年）	266,000,000	267,250,200	
	第４１７回　利付国債（２年）	200,000,000	200,964,000	
	第１３０回　利付国債（５年）	386,000,000	386,972,720	
	第１３１回　利付国債（５年）	477,000,000	478,540,710	
	第１３２回　利付国債（５年）	314,000,000	315,234,020	
	第１３３回　利付国債（５年）	587,000,000	589,788,250	
	第１３４回　利付国債（５年）	212,000,000	213,144,800	
	第１３５回　利付国債（５年）	235,000,000	236,419,400	
	第１３７回　利付国債（５年）	144,000,000	145,039,680	
	第１３８回　利付国債（５年）	404,000,000	407,175,440	

第１３９回　利付国債（５年）	434,000,000	437,689,000	
第１４０回　利付国債（５年）	340,000,000	343,111,000	
第１４１回　利付国債（５年）	470,000,000	474,606,000	
第１４２回　利付国債（５年）	150,000,000	151,566,000	
第１回　利付国債（４０年）	110,000,000	161,396,400	
第２回　利付国債（４０年）	142,000,000	201,879,980	
第３回　利付国債（４０年）	122,000,000	173,919,540	
第４回　利付国債（４０年）	171,000,000	245,272,140	
第５回　利付国債（４０年）	182,000,000	252,839,860	
第６回　利付国債（４０年）	176,000,000	241,197,440	
第７回　利付国債（４０年）	197,000,000	260,057,730	
第８回　利付国債（４０年）	207,000,000	255,947,220	
第９回　利付国債（４０年）	220,000,000	203,616,600	
第１０回　利付国債（４０年）	295,000,000	319,957,000	
第１１回　利付国債（４０年）	213,000,000	224,278,350	
第１３回　利付国債（４０年）	95,000,000	90,254,750	
第３１９回　利付国債（１０年）	76,000,000	77,010,800	
第３２０回　利付国債（１０年）	52,000,000	52,635,960	
第３２１回　利付国債（１０年）	63,000,000	63,951,930	
第３２３回　利付国債（１０年）	32,000,000	32,528,640	
第３２４回　利付国債（１０年）	99,000,000	100,479,060	
第３２５回　利付国債（１０年）	631,000,000	641,947,850	
第３２７回　利付国債（１０年）	28,000,000	28,552,440	
第３２８回　利付国債（１０年）	263,000,000	267,586,720	
第３２９回　利付国債（１０年）	269,000,000	275,590,500	
第３３０回　利付国債（１０年）	3,000,000	3,080,760	
第３３２回　利付国債（１０年）	196,000,000	200,535,440	
第３３３回　利付国債（１０年）	193,000,000	197,825,000	
第３３４回　利付国債（１０年）	618,000,000	634,630,380	
第３３５回　利付国債（１０年）	289,000,000	296,219,220	
第３３６回　利付国債（１０年）	53,000,000	54,410,860	
第３３７回　利付国債（１０年）	303,000,000	308,584,290	
第３３８回　利付国債（１０年）	491,000,000	502,734,900	
第３３９回　利付国債（１０年）	536,000,000	549,308,880	
第３４０回　利付国債（１０年）	566,000,000	580,551,860	
第３４１回　利付国債（１０年）	552,000,000	564,116,400	
第３４２回　利付国債（１０年）	510,000,000	516,140,400	
第３４３回　利付国債（１０年）	461,000,000	466,817,820	
第３４４回　利付国債（１０年）	533,000,000	540,030,270	
第３４５回　利付国債（１０年）	532,000,000	539,155,400	
第３４６回　利付国債（１０年）	523,000,000	530,322,000	
第３４７回　利付国債（１０年）	426,000,000	432,061,980	
第３４８回　利付国債（１０年）	499,000,000	506,375,220	
第３４９回　利付国債（１０年）	481,000,000	488,195,760	
第３５０回　利付国債（１０年）	605,000,000	614,141,550	
第３５１回　利付国債（１０年）	540,000,000	548,024,400	
第３５２回　利付国債（１０年）	576,000,000	584,386,560	
第３５３回　利付国債（１０年）	543,000,000	550,716,030	
第３５４回　利付国債（１０年）	512,000,000	519,060,480	
第３５５回　利付国債（１０年）	624,000,000	632,324,160	
第３５６回　利付国債（１０年）	618,000,000	625,935,120	
第３５７回　利付国債（１０年）	520,000,000	526,146,400	
第３５８回　利付国債（１０年）	518,000,000	523,801,600	
第３５９回　利付国債（１０年）	690,000,000	696,934,500	
第３６０回　利付国債（１０年）	34,000,000	34,300,220	
第１回　利付国債（３０年）	10,000,000	12,508,700	
第２回　利付国債（３０年）	83,000,000	101,642,630	
第３回　利付国債（３０年）	125,000,000	152,412,500	
第４回　利付国債（３０年）	116,000,000	149,379,000	
第５回　利付国債（３０年）	95,000,000	116,546,000	

第６回　利付国債（３０年）	39,000,000	49,016,370	
第７回　利付国債（３０年）	50,000,000	62,703,500	
第８回　利付国債（３０年）	39,000,000	46,913,490	
第９回　利付国債（３０年）	37,000,000	42,762,380	
第１０回　利付国債（３０年）	62,000,000	69,459,220	
第１１回　利付国債（３０年）	50,000,000	59,819,500	
第１２回　利付国債（３０年）	39,000,000	48,750,780	
第１３回　利付国債（３０年）	39,000,000	48,373,260	
第１４回　利付国債（３０年）	61,000,000	79,023,670	
第１５回　利付国債（３０年）	82,000,000	107,698,800	
第１６回　利付国債（３０年）	54,000,000	71,183,340	
第１７回　利付国債（３０年）	67,000,000	87,652,750	
第１８回　利付国債（３０年）	81,000,000	105,115,320	
第１９回　利付国債（３０年）	74,000,000	96,272,520	
第２０回　利付国債（３０年）	93,000,000	124,058,280	
第２１回　利付国債（３０年）	95,000,000	124,278,050	
第２２回　利付国債（３０年）	105,000,000	140,892,150	
第２３回　利付国債（３０年）	108,000,000	145,288,080	
第２４回　利付国債（３０年）	95,000,000	128,117,000	
第２５回　利付国債（３０年）	109,000,000	143,968,290	
第２６回　利付国債（３０年）	182,000,000	243,921,860	
第２７回　利付国債（３０年）	165,000,000	224,929,650	
第２８回　利付国債（３０年）	213,000,000	292,065,600	
第２９回　利付国債（３０年）	225,000,000	305,968,500	
第３０回　利付国債（３０年）	236,000,000	317,955,720	
第３１回　利付国債（３０年）	215,000,000	287,265,800	
第３２回　利付国債（３０年）	268,000,000	364,538,960	
第３３回　利付国債（３０年）	299,000,000	391,534,520	
第３４回　利付国債（３０年）	276,000,000	373,563,240	
第３５回　利付国債（３０年）	241,000,000	317,864,540	
第３６回　利付国債（３０年）	292,000,000	386,426,960	
第３７回　利付国債（３０年）	303,000,000	395,805,870	
第３８回　利付国債（３０年）	204,000,000	263,053,920	
第３９回　利付国債（３０年）	189,000,000	247,943,430	
第４０回　利付国債（３０年）	161,000,000	207,918,620	
第４１回　利付国債（３０年）	167,000,000	212,405,630	
第４２回　利付国債（３０年）	183,000,000	232,993,770	
第４３回　利付国債（３０年）	173,000,000	220,490,230	
第４４回　利付国債（３０年）	173,000,000	220,713,400	
第４５回　利付国債（３０年）	197,000,000	242,713,850	
第４６回　利付国債（３０年）	233,000,000	287,254,050	
第４７回　利付国債（３０年）	213,000,000	267,783,600	
第４８回　利付国債（３０年）	226,000,000	273,631,760	
第４９回　利付国債（３０年）	225,000,000	272,542,500	
第５０回　利付国債（３０年）	221,000,000	236,162,810	
第５１回　利付国債（３０年）	226,000,000	214,293,200	
第５２回　利付国債（３０年）	239,000,000	237,640,090	
第５３回　利付国債（３０年）	217,000,000	220,730,230	
第５４回　利付国債（３０年）	221,000,000	235,323,010	
第５５回　利付国債（３０年）	213,000,000	226,657,560	
第５６回　利付国債（３０年）	231,000,000	245,645,400	
第５７回　利付国債（３０年）	238,000,000	252,913,080	
第５８回　利付国債（３０年）	286,000,000	303,700,540	
第５９回　利付国債（３０年）	219,000,000	226,592,730	
第６０回　利付国債（３０年）	199,000,000	215,805,550	
第６１回　利付国債（３０年）	201,000,000	207,321,450	
第６２回　利付国債（３０年）	130,000,000	127,160,800	
第６３回　利付国債（３０年）	139,000,000	132,058,340	
第６４回　利付国債（３０年）	142,000,000	134,525,120	
第６５回　利付国債（３０年）	126,000,000	119,024,640	

第６６回　利付国債（３０年）	126,000,000	118,828,080	
第６７回　利付国債（３０年）	145,000,000	144,275,000	
第６８回　利付国債（３０年）	84,000,000	83,471,640	
第５３回　利付国債（２０年）	4,000,000	4,096,120	
第５４回　利付国債（２０年）	1,000,000	1,025,100	
第５５回　利付国債（２０年）	85,000,000	87,412,300	
第５６回　利付国債（２０年）	103,000,000	106,484,490	
第５７回　利付国債（２０年）	106,000,000	109,418,500	
第５８回　利付国債（２０年）	130,000,000	134,868,500	
第６５回　利付国債（２０年）	42,000,000	44,649,360	
第６６回　利付国債（２０年）	13,000,000	13,780,000	
第６７回　利付国債（２０年）	24,000,000	25,640,400	
第６８回　利付国債（２０年）	109,000,000	117,540,150	
第６９回　利付国債（２０年）	73,000,000	78,476,460	
第７０回　利付国債（２０年）	127,000,000	138,623,040	
第７１回　利付国債（２０年）	34,000,000	36,867,560	
第７２回　利付国債（２０年）	64,000,000	69,521,920	
第７３回　利付国債（２０年）	30,000,000	32,635,200	
第７５回　利付国債（２０年）	87,000,000	95,485,980	
第７６回　利付国債（２０年）	115,000,000	125,217,750	
第７７回　利付国債（２０年）	88,000,000	96,201,600	
第７８回　利付国債（２０年）	73,000,000	79,830,610	
第７９回　利付国債（２０年）	58,000,000	63,693,860	
第８０回　利付国債（２０年）	86,000,000	94,838,220	
第８１回　利付国債（２０年）	64,000,000	70,597,120	
第８２回　利付国債（２０年）	104,000,000	115,224,720	
第８３回　利付国債（２０年）	69,000,000	76,834,950	
第８４回　利付国債（２０年）	124,000,000	137,447,800	
第８５回　利付国債（２０年）	89,000,000	99,600,790	
第８６回　利付国債（２０年）	74,000,000	83,605,940	
第８７回　利付国債（２０年）	71,000,000	79,836,660	
第８８回　利付国債（２０年）	129,000,000	146,545,290	
第８９回　利付国債（２０年）	73,000,000	82,519,200	
第９０回　利付国債（２０年）	237,000,000	269,314,950	
第９１回　利付国債（２０年）	167,000,000	190,749,070	
第９２回　利付国債（２０年）	297,000,000	337,323,690	
第９３回　利付国債（２０年）	128,000,000	145,274,880	
第９４回　利付国債（２０年）	192,000,000	219,133,440	
第９５回　利付国債（２０年）	202,000,000	234,293,740	
第９６回　利付国債（２０年）	104,000,000	119,249,520	
第９７回　利付国債（２０年）	196,000,000	227,118,920	
第９８回　利付国債（２０年）	166,000,000	191,215,400	
第９９回　利付国債（２０年）	225,000,000	260,343,000	
第１００回　利付国債（２０年）	213,000,000	249,114,150	
第１０１回　利付国債（２０年）	151,000,000	178,827,790	
第１０２回　利付国債（２０年）	165,000,000	196,313,700	
第１０３回　利付国債（２０年）	158,000,000	186,781,280	
第１０４回　利付国債（２０年）	135,000,000	157,532,850	
第１０５回　利付国債（２０年）	182,000,000	213,229,380	
第１０６回　利付国債（２０年）	134,000,000	158,047,640	
第１０７回　利付国債（２０年）	152,000,000	178,844,720	
第１０８回　利付国債（２０年）	202,000,000	234,394,740	
第１０９回　利付国債（２０年）	226,000,000	263,138,580	
第１１０回　利付国債（２０年）	265,000,000	312,978,250	
第１１１回　利付国債（２０年）	211,000,000	251,967,760	
第１１２回　利付国債（２０年）	296,000,000	350,922,800	
第１１３回　利付国債（２０年）	415,000,000	493,841,700	
第１１４回　利付国債（２０年）	200,000,000	238,748,000	
第１１５回　利付国債（２０年）	172,000,000	206,888,480	
第１１６回　利付国債（２０年）	194,000,000	234,204,560	

	第１１７回　利付国債（２０年）	266,000,000	318,641,400	
	第１１８回　利付国債（２０年）	188,000,000	224,088,480	
	第１１９回　利付国債（２０年）	159,000,000	186,476,790	
	第１２０回　利付国債（２０年）	150,000,000	173,049,000	
	第１２１回　利付国債（２０年）	238,000,000	282,137,100	
	第１２２回　利付国債（２０年）	178,000,000	209,262,140	
	第１２３回　利付国債（２０年）	247,000,000	298,637,820	
	第１２４回　利付国債（２０年）	170,000,000	203,830,000	
	第１２５回　利付国債（２０年）	143,000,000	175,007,690	
	第１２６回　利付国債（２０年）	127,000,000	152,812,750	
	第１２７回　利付国債（２０年）	124,000,000	147,927,040	
	第１２８回　利付国債（２０年）	214,000,000	256,029,600	
	第１２９回　利付国債（２０年）	122,000,000	144,676,140	
	第１３０回　利付国債（２０年）	135,000,000	160,515,000	
	第１３１回　利付国債（２０年）	72,000,000	84,832,560	
	第１３２回　利付国債（２０年）	95,000,000	112,195,950	
	第１３３回　利付国債（２０年）	124,000,000	147,810,480	
	第１３４回　利付国債（２０年）	130,000,000	155,339,600	
	第１３５回　利付国債（２０年）	69,000,000	81,674,610	
	第１３６回　利付国債（２０年）	71,000,000	83,243,950	
	第１３７回　利付国債（２０年）	102,000,000	121,011,780	
	第１３８回　利付国債（２０年）	85,000,000	98,893,250	
	第１３９回　利付国債（２０年）	92,000,000	108,092,640	
	第１４０回　利付国債（２０年）	273,000,000	324,602,460	
	第１４１回　利付国債（２０年）	193,000,000	229,967,220	
	第１４２回　利付国債（２０年）	115,000,000	138,400,200	
	第１４３回　利付国債（２０年）	188,000,000	222,176,520	
	第１４４回　利付国債（２０年）	120,000,000	140,355,600	
	第１４５回　利付国債（２０年）	318,000,000	380,452,020	
	第１４６回　利付国債（２０年）	280,000,000	335,650,000	
	第１４７回　利付国債（２０年）	301,000,000	357,639,170	
	第１４８回　利付国債（２０年）	261,000,000	307,204,830	
	第１４９回　利付国債（２０年）	289,000,000	340,884,170	
	第１５０回　利付国債（２０年）	313,000,000	365,483,840	
	第１５１回　利付国債（２０年）	317,000,000	361,868,180	
	第１５２回　利付国債（２０年）	318,000,000	363,273,660	
	第１５３回　利付国債（２０年）	337,000,000	390,030,320	
	第１５４回　利付国債（２０年）	309,000,000	353,480,550	
	第１５５回　利付国債（２０年）	342,000,000	381,470,220	
	第１５６回　利付国債（２０年）	292,000,000	299,565,720	
	第１５７回　利付国債（２０年）	313,000,000	311,118,870	
	第１５８回　利付国債（２０年）	305,000,000	316,846,200	
	第１５９回　利付国債（２０年）	305,000,000	321,244,300	
	第１６０回　利付国債（２０年）	272,000,000	290,732,640	
	第１６１回　利付国債（２０年）	289,000,000	304,123,370	
	第１６２回　利付国債（２０年）	282,000,000	296,494,800	
	第１６３回　利付国債（２０年）	284,000,000	298,560,680	
	第１６４回　利付国債（２０年）	370,000,000	382,494,900	
	第１６５回　利付国債（２０年）	304,000,000	313,883,040	
	第１６６回　利付国債（２０年）	290,000,000	309,099,400	
	第１６７回　利付国債（２０年）	315,000,000	324,409,050	
	第１６８回　利付国債（２０年）	275,000,000	277,843,500	
	第１６９回　利付国債（２０年）	278,000,000	275,575,840	
	第１７０回　利付国債（２０年）	265,000,000	262,426,850	
	第１７１回　利付国債（２０年）	255,000,000	252,268,950	
	第１７２回　利付国債（２０年）	240,000,000	241,514,400	
	第１７３回　利付国債（２０年）	128,000,000	128,700,160	
国債証券　合計		53,684,000,000	59,246,366,240	
地方債証券	第７０８回　東京都公募公債	300,000,000	304,273,500	
	第７３０回　東京都公募公債	300,000,000	306,676,200	

	平成２７年度第１回　北海道公募公債	300,000,000	305,688,000	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,658,900	
	第３６０回　大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	304,131,600	
	第３７８回　大阪府公募公債（１０年）	144,000,000	147,023,856	
	第４４８回　大阪府公募公債（１０年）	38,000,000	37,685,094	
	第４５５回　大阪府公募公債（１０年）	180,000,000	180,159,480	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	116,118,700	
	平成２４年度第１回　兵庫県公募公債	300,000,000	304,290,900	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	116,937,600	
	平成２４年度第３回　静岡県公募公債	300,000,000	304,100,400	
	平成２４年度第１９回　愛知県公募公債	300,000,000	304,512,600	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債	100,000,000	107,793,800	
	平成２５年度第４回　埼玉県公募公債	100,000,000	102,463,500	
	平成２５年度第１０回　埼玉県公募公債	119,000,000	121,598,008	
	平成２４年度第９回　福岡県公募公債	300,000,000	304,503,900	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債	100,000,000	116,855,600	
	平成２４年度第２回　新潟県公募公債	300,000,000	305,395,200	
	第１０回　群馬県公募公債	300,000,000	306,061,200	
	第１１０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,068,900	
	第１２３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,757,200	
	第１３３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,063,200	
	平成２５年度第２回　大阪市公募公債	150,000,000	153,137,700	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	100,545,000	
	第１回　名古屋市公募公債	100,000,000	131,740,200	
	第１回　京都市公募公債	300,000,000	326,194,200	
	平成２５年度第１１回　神戸市公募公債	100,000,000	102,232,100	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	117,818,900	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	118,880,000	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	119,442,700	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	132,717,100	
	平成２５年度第３回　北九州市公募公債	150,000,000	153,378,900	
	平成２６年度第２回　北九州市公募公債	150,000,000	152,750,250	
	平成２４年度第４回　福岡市公募公債	100,000,000	101,566,000	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債（２０年）	100,000,000	104,263,900	
地方債証券　合計		6,631,000,000	6,941,484,288	
特殊債券	第１回　政保新関西空港債券	200,000,000	202,814,400	
	第２２回　政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	316,892,700	
	第１６３回　政保道路機構債券	300,000,000	304,134,000	
	第１９０回　政保道路機構債券	500,000,000	507,413,000	

	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	116,987,600	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	116,704,200	
	第２１８回　政保道路機構債券	500,000,000	511,473,500	
	第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	114,806,400	
	第２４９回　政保道路機構債券	179,000,000	183,059,720	
	第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	99,106,700	
	第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	103,844,800	
	第３６回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,697,400	
	第４８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,391,100	
	第４８回　地方公共団体金融機構債券	400,000,000	408,090,000	
	第７２回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,677,200	
	第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,061,182	
	第１６回　公営企業債券	200,000,000	221,210,000	
	第３５回　日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,503,000	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	107,991,000	
	第４６回　福祉医療機構債券	200,000,000	200,478,600	
	第１３３回　住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,020,421,000	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,675,200	
	第３７回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,440,000	28,150,668	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,702,000	75,036,032	
	第４６回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	89,748,000	96,900,915	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,736,000	78,558,334	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,124,000	87,371,723	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,230,000	88,282,060	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,242,000	42,495,552	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	344,456,000	363,022,178	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	214,760,000	225,175,860	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	138,300,000	146,432,040	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	124,062,000	129,731,633	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	238,281,000	239,758,342	
	い第８２２号　利付農林債券	100,000,000	100,150,700	
	第３３３回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,119,900	
	第３３５回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,150,800	
	第３３６回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,161,000	
	第３４４回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,175,200	
	第３５３回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,085,600	
	第５５回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,922,800	
	第１１６回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,070,700	
特殊債券　合計		7,708,081,000	7,964,184,739	
社債券	第２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	300,000,000	300,506,400	
	第3回　ノルデア・バンク	200,000,000	204,670,800	
	第5回　スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	203,220,400	
	第５６回　中日本高速道路債券	200,000,000	204,420,400	

	第６０回　中日本高速道路債券	100,000,000	102,054,100	
	第２０回　西日本高速道路債券	100,000,000	102,048,900	
	第２５回　西日本高速道路債券	200,000,000	203,945,000	
	第２６回　西日本高速道路債券	200,000,000	205,010,000	
	第１４回　森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,074,200	
	第３回　富士フイルムホールディングス	300,000,000	305,006,700	
	第２４回　豊田自動織機	100,000,000	101,773,200	
	第７１回　伊藤忠商事	200,000,000	203,565,600	
	第４５回　住友商事	100,000,000	101,489,100	
	第４６回　住友商事	100,000,000	101,649,500	
	第７９回　三菱商事	100,000,000	101,458,300	
	第１回　三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	101,339,700	
	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	101,430,300	
	第８回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後特約付	100,000,000	107,068,600	
	第２０回　みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	101,587,600	
	第４６回　三井不動産	100,000,000	101,637,400	
	第６６回　三井不動産	100,000,000	100,591,000	
	第１１１回　三菱地所	100,000,000	101,628,300	
	第７５回　東京急行電鉄	100,000,000	101,457,300	
	第７７回　東京急行電鉄	100,000,000	102,371,000	
	第２６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	102,388,200	
	第８７回　東日本旅客鉄道	200,000,000	203,075,800	
	第３８１回　中国電力	200,000,000	206,151,000	
	第３０４回　北陸電力	100,000,000	102,770,100	
	第３０６回　北陸電力	100,000,000	102,866,400	
	第２５３回　四国電力	200,000,000	205,002,800	
	第４２９回　九州電力	200,000,000	206,397,600	
	第３３１回　北海道電力	100,000,000	101,162,000	
	第１３回　電源開発	100,000,000	108,856,100	
社債券　合計		4,700,000,000	4,800,673,800	
合計		72,723,081,000	78,952,709,067	

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。

「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	111,069,596	64,298,407
金銭信託	2,091,577	607,033
コール・ローン	84,122,383	133,035,965
国債証券	24,640,272,641	32,372,603,021
派生商品評価勘定	1,123	－
未収入金	737,601	－
未収利息	139,580,909	164,814,898
前払費用	12,891,736	13,471,248
流動資産合計	24,990,767,566	32,748,830,572
資産合計	24,990,767,566	32,748,830,572
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	78,201	308,382
未払金	72,688,119	－
未払解約金	45,922,806	90,235,999
その他未払費用	733	172
流動負債合計	118,689,859	90,544,553
負債合計	118,689,859	90,544,553
純資産の部		
元本等		
元本	18,019,497,917	22,593,334,379
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,852,579,790	10,064,951,640
純資産合計	24,872,077,707	32,658,286,019
負債純資産合計	24,990,767,566	32,748,830,572

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 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。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　受益権総口数	18,019,497,917口	22,593,334,379口
２．　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3803円 (13,803円)	1.4455円 (14,455円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年11月21日 至　2019年11月20日	自　2019年11月21日 至　2020年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	635,054,816	171,967,021
合計	635,054,816	171,967,021

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	2019年11月20日 現在				2020年11月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	54,671,804	－	54,594,726	△77,078	32,114,574	－	31,806,192	△308,382
アメリカ・ドル	39,192,886	－	39,118,884	△74,002	32,114,574	－	31,806,192	△308,382
イギリス・ポンド	1,456,184	－	1,456,288	104	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	3,221,592	－	3,221,852	260	－	－	－	－
スウェーデン・クローナ	1,885,873	－	1,885,371	△502	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	1,886,204	－	1,882,507	△3,697	－	－	－	－
ユーロ	7,029,065	－	7,029,824	759	－	－	－	－
合計	54,671,804	－	54,594,726	△77,078	32,114,574	－	31,806,192	△308,382

（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。

①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。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	13,426,526,479円	18,019,497,917円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	7,559,583,314円	9,937,638,716円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,966,611,876円	5,363,802,254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）	1,913,723,452円	2,334,887,551円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,342,592,527円	3,866,542,648円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,117,994,429円	1,302,630,172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）	695,278,547円	758,947,512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）	5,548,187円	3,966,949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）	16,265,029円	11,348,657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）	15,522,663円	9,906,781円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国債券インデックスファンド	8,537,605,753円	10,287,697,386円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	821,539,249円	1,348,446,447円
ＤＣニッセイ外国債券インデックス	870,914,843円	1,310,372,857円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	28,348,797円	46,718,492円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	492,962,365円	911,353,650円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	18,637,530円	47,289,025円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	38,575,285円	106,427,690円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	14,055,660円	33,342,256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）	54,322,993円	72,331,508円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	3,312,314円	5,350,294円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	21,545,383円	24,383,814円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	1,986,946円	12,556,140円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	1,882,158円	10,025,784円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	3,194,198円	34,004,065円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	3,689,609円	54,804,701円
計	18,019,497,917円	22,593,334,379円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１　有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 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	162,698.40	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	80,000.00	109,208.80	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	120,000.00	173,826.00	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	90,000.00	122,895.00	

		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	100,000.00	128,933.00	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	120,000.00	165,534.00	
		US TREASURY N/B 0.125 2023/09/15	1,580,000.00	1,575,923.60	
		US TREASURY N/B 0.25 2023/06/15	1,500,000.00	1,501,875.00	
		US TREASURY N/B 0.375 2027/09/30	840,000.00	826,350.00	
		US TREASURY N/B 0.5 2027/06/30	910,000.00	904,840.30	
		US TREASURY N/B 0.625 2027/03/31	590,000.00	592,507.50	
		US TREASURY N/B 0.625 2030/08/15	1,590,000.00	1,557,945.60	
		US TREASURY N/B 1.125 2040/05/15	820,000.00	789,118.80	
		US TREASURY N/B 1.125 2040/08/15	720,000.00	690,969.60	
		US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	1,390,000.00	1,432,617.40	
		US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	1,580,000.00	1,632,519.20	
		US TREASURY N/B 1.375 2050/08/15	1,090,000.00	1,036,513.70	
		US TREASURY N/B 1.5 2023/02/28	1,140,000.00	1,173,880.80	
		US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	1,290,000.00	1,329,848.10	
		US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	1,340,000.00	1,416,996.40	
		US TREASURY N/B 1.5 2030/02/15	1,010,000.00	1,073,044.20	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	2,380,000.00	2,440,047.40	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/31	2,030,000.00	2,082,414.60	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,700,000.00	1,748,535.00	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/12/15	1,290,000.00	1,328,442.00	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	1,280,000.00	1,359,795.20	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	1,390,000.00	1,478,390.10	
		US TREASURY N/B 1.625 2026/09/30	680,000.00	724,247.60	
		US TREASURY N/B 1.625 2029/08/15	680,000.00	729,857.60	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	1,670,000.00	1,706,322.50	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	2,290,000.00	2,343,929.50	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/06/15	1,960,000.00	2,008,608.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	1,940,000.00	1,996,822.60	
		US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	2,160,000.00	2,242,771.20	

		US TREASURY N/B 1.75 2026/12/31	620,000.00	665,818.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2029/11/15	580,000.00	629,317.40	
		US TREASURY N/B 1.875 2026/06/30	600,000.00	646,800.00	
		US TREASURY N/B 2 2021/11/15	1,990,000.00	2,026,994.10	
		US TREASURY N/B 2 2022/02/15	2,170,000.00	2,220,083.60	
		US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,820,000.00	1,893,145.80	
		US TREASURY N/B 2 2024/06/30	1,240,000.00	1,317,301.60	
		US TREASURY N/B 2 2025/02/15	2,210,000.00	2,365,385.10	
		US TREASURY N/B 2 2025/08/15	2,490,000.00	2,680,833.60	
		US TREASURY N/B 2 2026/11/15	1,190,000.00	1,294,255.90	
		US TREASURY N/B 2 2050/02/15	790,000.00	871,709.70	
		US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	1,710,000.00	1,747,927.80	
		US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	1,930,000.00	1,990,679.20	
		US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	1,200,000.00	1,249,116.00	
		US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	1,260,000.00	1,338,838.20	
		US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	1,290,000.00	1,380,751.50	
		US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	2,130,000.00	2,297,971.80	
		US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	1,200,000.00	1,275,228.00	
		US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	2,250,000.00	2,423,317.50	
		US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	1,400,000.00	1,510,894.00	
		US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	1,570,000.00	1,713,560.80	
		US TREASURY N/B 2.25 2026/03/31	840,000.00	920,850.00	
		US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	1,160,000.00	1,282,020.40	
		US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	1,950,000.00	2,164,032.00	
		US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	790,000.00	878,408.90	
		US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	510,000.00	590,421.90	
		US TREASURY N/B 2.25 2049/08/15	750,000.00	871,605.00	
		US TREASURY N/B 2.375 2022/03/15	1,720,000.00	1,770,447.60	
		US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	2,290,000.00	2,468,276.50	
		US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	1,500,000.00	1,673,370.00	

		US TREASURY N/B 2.375 2029/05/15	800,000.00	907,152.00	
		US TREASURY N/B 2.375 2049/11/15	650,000.00	775,554.00	
		US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	2,170,000.00	2,305,625.00	
		US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	2,170,000.00	2,338,088.20	
		US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	530,000.00	640,552.70	
		US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	480,000.00	581,472.00	
		US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	480,000.00	581,736.00	
		US TREASURY N/B 2.625 2021/12/15	1,770,000.00	1,817,152.80	
		US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	1,430,000.00	1,571,770.20	
		US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	630,000.00	700,648.20	
		US TREASURY N/B 2.625 2029/02/15	960,000.00	1,105,612.80	
		US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	1,950,000.00	2,096,464.50	
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	1,930,000.00	2,086,194.90	
		US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	1,540,000.00	1,708,491.40	
		US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	930,000.00	1,068,700.20	
		US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	280,000.00	351,551.20	
		US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	360,000.00	451,756.80	
		US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	510,000.00	648,990.30	
		US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	520,000.00	662,428.00	
		US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	1,000,000.00	1,161,400.00	
		US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	990,000.00	1,153,152.00	
		US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	470,000.00	602,131.10	
		US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	440,000.00	567,441.60	
		US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	440,000.00	570,350.00	
		US TREASURY N/B 2.875 2049/05/15	730,000.00	956,380.30	
		US TREASURY N/B 3 2025/09/30	1,530,000.00	1,723,162.50	
		US TREASURY N/B 3 2042/05/15	200,000.00	260,592.00	
		US TREASURY N/B 3 2044/11/15	470,000.00	616,743.40	
		US TREASURY N/B 3 2045/05/15	440,000.00	578,613.20	
		US TREASURY N/B 3 2045/11/15	320,000.00	422,073.60	

		US TREASURY N/B 3 2047/02/15	450,000.00	596,988.00	
		US TREASURY N/B 3 2047/05/15	340,000.00	451,588.00	
		US TREASURY N/B 3 2048/02/15	600,000.00	799,074.00	
		US TREASURY N/B 3 2048/08/15	680,000.00	907,902.00	
		US TREASURY N/B 3 2049/02/15	730,000.00	977,112.30	
		US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	980,000.00	1,164,014.60	
		US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	190,000.00	251,704.40	
		US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	240,000.00	318,748.80	
		US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	350,000.00	465,374.00	
		US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	510,000.00	681,625.20	
		US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	610,000.00	830,881.00	
		US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	460,000.00	637,638.20	
		US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	690,000.00	983,325.90	
		US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	130,000.00	178,896.90	
		US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	390,000.00	558,156.30	
		US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	480,000.00	688,872.00	
		US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	380,000.00	554,203.40	
		US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	190,000.00	275,824.90	
		US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	190,000.00	285,868.30	
		US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	200,000.00	304,554.00	
		US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	100,000.00	150,566.00	
		US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	200,000.00	306,514.00	
		US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	120,000.00	177,922.80	
		US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	110,000.00	168,320.90	
		US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	190,000.00	294,610.20	
		US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	200,000.00	316,000.00	
		US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	210,000.00	339,788.40	
		US TREASURY N/B 5 2037/05/15	100,000.00	158,589.00	
		US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	110,000.00	165,278.30	
		WI TREASURY SEC. 0.625 2030/05/15	1,280,000.00	1,256,998.40	

		WI TREASURY SEC. 1.25 2050/05/15	910,000.00	838,901.70	
		WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	200,000.00	287,850.00	
		WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	200,000.00	307,920.00	
		WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	180,000.00	279,532.80	
	アメリカ・ドル　小計		122,640,000.00	134,720,716.20 (13,994,787,999)	
	イギリス・ポンド	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	210,000.00	319,485.60	
		TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	280,000.00	484,982.40	
		TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	280,000.00	426,420.40	
		TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	260,000.00	461,856.20	
		TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	200,000.00	257,942.00	
		TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	270,000.00	385,608.60	
		TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	200,000.00	321,520.00	
		TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	240,000.00	392,340.00	
		TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	260,000.00	522,670.20	
		TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	250,000.00	359,362.50	
		TSY 4% 2022 4 2022/03/07	210,000.00	220,997.70	
		TSY 4% 2060 4 2060/01/22	190,000.00	387,978.10	
		TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	230,000.00	386,160.80	
		TSY 5 2025 5 2025/03/07	230,000.00	279,666.20	
		UK TREASURY 6 2028/12/07	160,000.00	233,641.60	
		UK TSY 0 1/2% 2061 0.5 2061/10/22	160,000.00	140,592.00	
		UK TSY 0 1/8% 2023 0.125 2023/01/31	510,000.00	511,463.70	
		UK TSY 0 1/8% 2026 0.125 2026/01/30	250,000.00	250,735.00	
		UK TSY 0 1/8% 2028 0.125 2028/01/31	250,000.00	248,925.00	
		UK TSY 0 3/8% 2030 0.375 2030/10/22	400,000.00	401,160.00	
		UK TSY 0 5/8% 2025 0.625 2025/06/07	410,000.00	421,553.80	
		UK TSY 0 5/8% 2050 0.625 2050/10/22	250,000.00	230,917.50	
		UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	230,000.00	249,090.00	
		UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	300,000.00	341,469.00	
		UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	280,000.00	301,019.60	

		UK TSY 1 1/4% 2041 1.25 2041/10/22	240,000.00	257,589.60	
		UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	250,000.00	278,345.00	
		UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22	190,000.00	229,877.20	
		UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	110,000.00	149,662.70	
		UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	350,000.00	362,414.50	
		UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	350,000.00	361,273.50	
		UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	170,000.00	205,564.00	
		UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	290,000.00	368,862.60	
		UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	220,000.00	234,132.80	
		UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	170,000.00	187,926.50	
		UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	180,000.00	197,235.00	
		UK TSY 2029 0.875 2029/10/22	240,000.00	252,660.00	
		UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	220,000.00	449,497.40	
		UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	320,000.00	478,198.40	
		UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	210,000.00	375,291.00	
		UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	340,000.00	532,181.60	
		UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	190,000.00	352,368.30	
		UK TSY GILT 0 5/8% 2035 0.625 2035/07/31	150,000.00	148,810.50	
		UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	400,000.00	403,612.00	
		UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	320,000.00	326,848.00	
		UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	370,000.00	428,511.80	
		UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	230,000.00	370,474.80	
	イギリス・ポンド　小計		12,020,000.00	15,488,895.10 (2,132,511,077)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1 2030/03/31	210,000.00	215,386.50	
		ISRAEL FIXED BOND 1.25 2022/11/30	710,000.00	734,885.50	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 2023/11/30	650,000.00	684,352.50	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 2037/05/31	180,000.00	183,123.00	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 2025/08/31	490,000.00	524,324.50	
		ISRAEL FIXED BOND 2 2027/03/31	280,000.00	310,506.00	
		ISRAEL FIXED BOND 2.25 2028/09/28	270,000.00	304,641.00	

	ISRAEL FIXED BOND 3.75 2024/03/31	300,000.00	342,300.00	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 2047/03/31	280,000.00	400,078.00	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 2042/01/31	290,000.00	510,124.50	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 2026/10/30	250,000.00	336,575.00	
イスラエル・シュケル　小計		3,910,000.00	4,546,296.50 (141,117,043)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 2024/11/21	280,000.00	280,728.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 2025/11/21	360,000.00	359,139.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.5 2026/09/21	400,000.00	402,272.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1 2030/12/21	440,000.00	444,862.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1 2031/11/21	360,000.00	361,508.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.25 2032/05/21	280,000.00	287,747.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.5 2031/06/21	360,000.00	380,962.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2051/06/21	230,000.00	224,250.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	260,000.00	265,457.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	410,000.00	427,589.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	450,000.00	504,477.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	530,000.00	610,968.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	660,000.00	719,433.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	420,000.00	483,932.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	470,000.00	546,563.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	490,000.00	573,971.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	140,000.00	168,504.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	100,000.00	119,186.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	200,000.00	251,296.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	500,000.00	566,285.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	490,000.00	591,719.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	150,000.00	191,578.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	180,000.00	242,699.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	510,000.00	617,043.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	210,000.00	294,955.50	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	440,000.00	559,407.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	500,000.00	564,850.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	360,000.00	393,562.80	
オーストラリア・ドル　小計		10,180,000.00	11,434,949.00 (864,482,144)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	60,000.00	91,368.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2022/08/01	260,000.00	259,992.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2022/11/01	460,000.00	459,848.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2024/04/01	120,000.00	119,740.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2026/03/01	90,000.00	89,076.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	230,000.00	230,802.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2025/09/01	550,000.00	552,321.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2030/12/01	130,000.00	126,973.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	340,000.00	344,481.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	180,000.00	185,706.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2021/11/01	120,000.00	121,185.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2025/03/01	200,000.00	207,506.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2030/06/01	580,000.00	609,713.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/02/01	110,000.00	111,687.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/05/01	170,000.00	173,099.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	200,000.00	206,124.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2024/09/01	200,000.00	208,770.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	180,000.00	190,195.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	370,000.00	382,361.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	370,000.00	387,464.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	160,000.00	177,136.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	360,000.00	433,396.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	150,000.00	159,474.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	170,000.00	184,198.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	170,000.00	193,164.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	160,000.00	172,220.80	

	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	170,000.00	176,509.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	200,000.00	274,610.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	220,000.00	332,897.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	150,000.00	232,029.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	130,000.00	211,417.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	140,000.00	199,634.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	170,000.00	269,604.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	60,000.00	88,809.60	
カナダ・ドル　小計		7,330,000.00	8,163,519.60 (648,428,362)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.75 2022/04/01	70,000.00	71,421.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT 1.875 2050/03/01	60,000.00	70,666.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	70,000.00	75,810.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	90,000.00	103,380.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	90,000.00	97,641.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2039/07/01	50,000.00	59,247.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	60,000.00	67,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	220,000.00	233,882.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	60,000.00	76,230.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	110,000.00	144,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	110,000.00	127,677.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	100,000.00	117,884.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	170,000.00	186,507.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	140,000.00	147,107.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	100,000.00	127,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	110,000.00	128,755.00	
シンガポール・ドル　小計		1,610,000.00	1,835,109.00 (141,780,521)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.125 2031/05/12	450,000.00	455,665.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	860,000.00	920,311.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	900,000.00	970,164.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	950,000.00	1,022,447.00	

	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	1,370,000.00	1,447,240.60	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	1,070,000.00	1,208,768.30	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,620,000.00	1,717,459.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	700,000.00	1,093,967.00	
スウェーデン・クローナ　小計		7,920,000.00	8,836,023.40 (106,739,163)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2022/11/15	910,000.00	926,152.50	
	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2052/11/15	360,000.00	393,116.40	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	1,240,000.00	1,330,718.40	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2029/11/15	1,550,000.00	1,686,725.50	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	920,000.00	979,542.40	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	950,000.00	1,063,202.00	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	920,000.00	952,742.80	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,900,000.00	3,639,222.00	
デンマーク・クローネ　小計		8,750,000.00	10,971,422.00 (181,577,034)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.375 2030/08/19	660,000.00	696,234.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	560,000.00	588,795.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	600,000.00	633,900.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	640,000.00	685,670.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2029/09/06	630,000.00	684,148.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	1,180,000.00	1,231,117.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	560,000.00	614,465.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	880,000.00	957,466.40	
ノルウェー・クローネ　小計		5,710,000.00	6,091,797.70 (70,238,427)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0 2022/07/25	350,000.00	349,825.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25 2030/10/25	200,000.00	201,222.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.25 2022/04/25	640,000.00	660,512.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2023/01/25	460,000.00	484,449.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	990,000.00	1,070,308.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	700,000.00	775,544.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	460,000.00	512,205.40	

	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	510,000.00	579,334.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2029/10/25	690,000.00	790,015.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	760,000.00	860,570.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	420,000.00	468,434.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	519,514.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	130,000.00	181,720.50	
ポーランド・ズロチ　小計		6,780,000.00	7,453,656.40 (205,646,380)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	470,000.00	483,850.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	560,000.00	580,865.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.62 2021/11/30	310,000.00	316,271.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	200,000.00	216,888.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.757 2040/05/22	200,000.00	208,374.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.828 2034/07/05	220,000.00	236,412.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	410,000.00	442,677.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.885 2029/08/15	290,000.00	316,552.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	510,000.00	554,604.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	300,000.00	325,779.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	350,000.00	379,256.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.065 2050/06/15	80,000.00	80,272.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	490,000.00	526,113.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	260,000.00	293,181.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	110,000.00	122,487.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	140,000.00	155,071.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	220,000.00	251,836.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	160,000.00	180,617.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	180,000.00	211,581.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	130,000.00	153,397.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.921 2048/07/06	170,000.00	195,678.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	130,000.00	150,220.20	
マレーシア・リンギット　小計		5,890,000.00	6,381,986.60 (161,974,820)	

メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	6,840,000.00	8,104,374.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	1,100,000.00	1,472,834.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	2,970,000.00	3,040,299.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	4,550,000.00	4,685,908.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.25 2021/12/09	3,150,000.00	3,241,003.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	4,140,000.00	4,601,196.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	2,050,000.00	2,332,080.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	1,520,000.00	1,714,225.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	2,870,000.00	3,137,254.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	6,440,000.00	7,042,848.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	2,780,000.00	3,101,924.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	4,640,000.00	5,513,758.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	2,660,000.00	3,128,958.00	
メキシコ・ペソ　小計		45,710,000.00	51,116,664.70 (262,739,657)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0 2027/10/22	130,000.00	134,938.70	
	BELGIUM KINGDOM 0.1 2030/06/22	190,000.00	198,988.90	
	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	140,000.00	143,721.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.4 2040/06/22	80,000.00	84,742.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	200,000.00	209,448.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	270,000.00	288,416.70	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	220,000.00	240,167.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	220,000.00	242,446.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	250,000.00	279,662.50	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	230,000.00	251,109.40	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	230,000.00	262,683.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	120,000.00	142,833.60	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	70,000.00	87,334.10	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	160,000.00	214,748.80	
	BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22	110,000.00	153,370.80	
	BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	140,000.00	186,904.20	

		BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	100,000.00	171,765.00	
		BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	200,000.00	215,492.00	
		BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	90,000.00	147,959.10	
		BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	230,000.00	257,540.20	
		BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	130,000.00	187,075.20	
		BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	150,000.00	277,218.00	
		BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	210,000.00	223,358.10	
		BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	120,000.00	179,730.00	
		BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	240,000.00	262,250.40	
		BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	270,000.00	494,788.50	
		BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	170,000.00	217,440.20	
		BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	290,000.00	508,167.00	
		BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	290,000.00	421,288.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2023/04/30	320,000.00	324,355.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2025/01/31	330,000.00	336,431.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/10/31	310,000.00	311,813.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2024/07/30	250,000.00	257,187.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	330,000.00	337,986.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	320,000.00	324,544.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	280,000.00	285,754.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5 2030/04/30	330,000.00	345,255.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.6 2029/10/31	320,000.00	338,291.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.8 2027/07/30	280,000.00	299,426.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1 2050/10/31	200,000.00	206,968.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.2 2040/10/31	180,000.00	199,321.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.25 2030/10/31	370,000.00	413,304.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	390,000.00	428,266.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	340,000.00	379,871.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	320,000.00	358,380.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	330,000.00	368,346.00	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	320,000.00	361,305.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	300,000.00	334,863.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	320,000.00	349,667.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.85 2035/07/30	300,000.00	363,144.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	340,000.00	383,492.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	350,000.00	415,163.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	360,000.00	406,263.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	290,000.00	366,049.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	210,000.00	308,529.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	370,000.00	417,885.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	260,000.00	389,883.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	220,000.00	401,731.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	310,000.00	356,617.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	320,000.00	510,169.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	320,000.00	366,979.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	340,000.00	422,147.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	320,000.00	574,041.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	270,000.00	316,410.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	280,000.00	506,839.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	270,000.00	383,602.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	220,000.00	434,940.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	330,000.00	373,563.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	340,000.00	560,622.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	340,000.00	366,074.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	340,000.00	462,311.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	400,000.00	600,904.00	
		BUNDESOBLIGATION 0 2022/04/08	310,000.00	313,087.60	
		BUNDESOBLIGATION 0 2022/10/07	300,000.00	304,224.00	
		BUNDESOBLIGATION 0 2023/04/14	270,000.00	275,040.90	
		BUNDESOBLIGATION 0 2023/10/13	290,000.00	296,641.00	

		BUNDESOBLIGATION 0 2024/10/18	330,000.00	339,982.50	
		BUNDESOBLIGATION 0 2025/04/11	300,000.00	310,113.00	
		BUNDESOBLIGATION 0 2025/10/10	270,000.00	280,073.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	440,000.00	459,272.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2027/11/15	330,000.00	346,374.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2029/08/15	410,000.00	433,460.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/02/15	380,000.00	401,819.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/08/15	430,000.00	454,630.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/08/15	100,000.00	105,967.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2035/05/15	310,000.00	327,980.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2050/08/15	250,000.00	263,347.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	470,000.00	499,661.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	380,000.00	408,241.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	400,000.00	430,924.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	420,000.00	443,016.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	470,000.00	501,579.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	440,000.00	477,206.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	380,000.00	413,991.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	340,000.00	362,919.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	420,000.00	455,746.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	380,000.00	537,730.40	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	410,000.00	426,576.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	320,000.00	336,355.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	330,000.00	348,786.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	680,000.00	734,767.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	400,000.00	416,220.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	570,000.00	617,378.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	330,000.00	340,180.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	340,000.00	366,132.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	430,000.00	723,539.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	470,000.00	812,709.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	290,000.00	523,258.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	410,000.00	713,141.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	290,000.00	549,637.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	380,000.00	661,572.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	310,000.00	633,559.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	170,000.00	280,595.20	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/12/10	240,000.00	241,780.80	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/03/11	210,000.00	211,948.80	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/06/10	220,000.00	222,479.40	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/09/16	80,000.00	81,075.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0 2024/01/15	40,000.00	40,306.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2023/01/15	30,000.00	30,288.30	

		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2021/11/01	240,000.00	241,982.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2025/02/01	220,000.00	224,270.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.5 2026/02/01	70,000.00	71,617.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	750,000.00	770,970.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.9 2022/08/01	270,000.00	276,164.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.9 2031/04/01	90,000.00	92,346.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	480,000.00	494,721.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2030/08/01	250,000.00	259,140.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1 2022/07/15	200,000.00	204,804.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	580,000.00	618,430.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	840,000.00	861,243.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2030/04/01	340,000.00	365,534.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	290,000.00	299,981.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2036/03/01	190,000.00	202,298.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	820,000.00	878,129.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	550,000.00	595,936.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2030/12/01	350,000.00	385,511.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	380,000.00	418,600.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.7 2051/09/01	120,000.00	125,403.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.8 2041/03/01	160,000.00	174,616.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	500,000.00	536,015.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	560,000.00	616,280.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	360,000.00	402,984.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	500,000.00	559,530.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	280,000.00	287,999.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	250,000.00	281,772.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	240,000.00	283,192.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	280,000.00	334,118.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2050/09/01	240,000.00	295,298.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	540,000.00	597,321.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	270,000.00	345,683.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	300,000.00	356,820.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	140,000.00	184,772.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	230,000.00	297,003.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3 2029/08/01	300,000.00	364,803.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.1 2040/03/01	200,000.00	264,130.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	250,000.00	349,565.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	220,000.00	290,543.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	240,000.00	348,712.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	380,000.00	482,402.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	300,000.00	344,454.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.85 2049/09/01	200,000.00	311,996.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	420,000.00	601,839.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	480,000.00	537,340.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	350,000.00	404,446.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	380,000.00	468,695.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	370,000.00	421,071.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	360,000.00	480,182.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	270,000.00	455,479.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	440,000.00	536,170.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	390,000.00	595,467.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	340,000.00	558,552.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	330,000.00	547,176.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	450,000.00	637,537.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	270,000.00	298,479.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	500,000.00	557,615.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	310,000.00	488,290.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	440,000.00	677,252.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	400,000.00	569,796.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	180,000.00	229,519.80	

		DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	220,000.00	314,223.80	
		DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	320,000.00	524,006.40	
		DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	250,000.00	366,227.50	
		DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	200,000.00	298,444.00	
		FINNISH GOVERNMENT 0 2022/04/15	80,000.00	80,812.80	
		FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	90,000.00	91,852.20	
		FINNISH GOVERNMENT 0 2030/09/15	50,000.00	52,044.00	
		FINNISH GOVERNMENT 0.125 2036/04/15	60,000.00	62,938.80	
		FINNISH GOVERNMENT 0.25 2040/09/15	50,000.00	53,496.50	
		FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	100,000.00	106,337.00	
		FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	100,000.00	107,530.00	
		FINNISH GOVERNMENT 0.5 2029/09/15	100,000.00	108,819.00	
		FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	60,000.00	67,330.20	
		FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	80,000.00	86,086.40	
		FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	80,000.00	95,209.60	
		FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	50,000.00	68,937.50	
		FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	70,000.00	73,784.20	
		FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	70,000.00	73,038.00	
		FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	140,000.00	153,115.20	
		FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	70,000.00	112,117.60	
		FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	140,000.00	176,003.80	
		FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	90,000.00	109,855.80	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	440,000.00	443,814.80	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	480,000.00	485,088.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2023/02/25	80,000.00	81,260.80	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	770,000.00	782,797.40	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	600,000.00	614,058.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2025/03/25	670,000.00	689,470.20	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2026/02/25	330,000.00	340,840.50	
		FRANCE (GOVT OF) 0 2029/11/25	610,000.00	633,161.70	

		FRANCE (GOVT OF) 0 2030/11/25	370,000.00	382,790.90	
		FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	560,000.00	588,890.40	
		FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	610,000.00	642,641.10	
		FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	610,000.00	648,399.50	
		FRANCE (GOVT OF) 0.5 2029/05/25	500,000.00	541,440.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0.5 2040/05/25	150,000.00	162,703.50	
		FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	700,000.00	767,928.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	600,000.00	660,762.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0.75 2052/05/25	280,000.00	315,599.20	
		FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	530,000.00	574,504.10	
		FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	540,000.00	596,322.00	
		FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	550,000.00	657,222.50	
		FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	530,000.00	640,865.40	
		FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	730,000.00	872,736.90	
		FRANCE (GOVT OF) 1.5 2050/05/25	440,000.00	592,512.80	
		FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	860,000.00	913,483.40	
		FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	580,000.00	637,350.40	
		FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	410,000.00	544,480.00	
		FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	200,000.00	311,018.00	
		FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	410,000.00	603,798.80	
		FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	560,000.00	592,205.60	
		FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	520,000.00	574,496.00	
		FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	750,000.00	960,802.50	
		FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	720,000.00	888,854.40	
		FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	700,000.00	736,967.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	380,000.00	661,534.40	
		FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	680,000.00	835,509.20	
		FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	400,000.00	692,096.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	250,000.00	547,845.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	250,000.00	581,897.50	

		FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	660,000.00	756,940.80	
		FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	560,000.00	1,067,920.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	440,000.00	757,746.00	
		FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	610,000.00	924,198.80	
		FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	490,000.00	850,037.30	
		FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	470,000.00	627,078.70	
		IRISH TSY 0.2% 2030 0.2 2030/10/18	100,000.00	104,656.00	
		IRISH TSY 0.20% 2027 0.2 2027/05/15	100,000.00	104,487.00	
		IRISH TSY 0.4% 2035 0.4 2035/05/15	70,000.00	74,537.40	
		IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	110,000.00	112,104.30	
		IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	180,000.00	195,561.00	
		IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	130,000.00	146,390.40	
		IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	70,000.00	82,745.60	
		IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	90,000.00	105,127.20	
		IRISH TSY 1.5% 2050 1.5 2050/05/15	80,000.00	106,512.80	
		IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	90,000.00	114,887.70	
		IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	130,000.00	185,706.30	
		IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	140,000.00	176,526.00	
		IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	80,000.00	80,990.40	
		IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	150,000.00	165,085.50	
		IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	120,000.00	136,180.80	
		IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	110,000.00	121,722.70	
		ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	180,000.00	255,636.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	230,000.00	231,886.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	240,000.00	245,560.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2027/01/15	180,000.00	187,173.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2030/07/15	220,000.00	230,678.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2052/01/15	90,000.00	92,850.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	230,000.00	240,451.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2029/07/15	180,000.00	192,848.40	

		NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	260,000.00	277,604.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2040/01/15	140,000.00	160,305.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	230,000.00	251,624.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	230,000.00	254,315.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	270,000.00	287,982.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	220,000.00	242,167.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	230,000.00	241,352.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	200,000.00	272,750.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	250,000.00	447,407.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	210,000.00	230,407.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	240,000.00	448,932.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	240,000.00	412,104.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	190,000.00	274,996.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	110,000.00	111,463.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2023/07/15	240,000.00	244,581.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2030/02/20	150,000.00	156,064.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2040/10/20	40,000.00	40,408.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	150,000.00	160,939.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2029/02/20	160,000.00	173,601.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	200,000.00	216,624.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	160,000.00	175,576.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2051/03/20	60,000.00	72,192.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	180,000.00	196,945.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	110,000.00	152,937.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	40,000.00	68,147.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	280,000.00	306,219.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	170,000.00	182,362.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	90,000.00	203,761.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	130,000.00	177,721.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	100,000.00	176,810.00	

		REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	150,000.00	162,478.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	130,000.00	138,014.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	60,000.00	147,505.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	210,000.00	361,202.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	150,000.00	195,000.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	130,000.00	190,685.30	
		TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	170,000.00	214,540.00	
	ユーロ　小計		89,540,000.00	109,133,941.90 (13,460,580,394)	
国債証券　合計				32,372,603,021 (32,372,603,021)	
合計				32,372,603,021 (32,372,603,021)	

（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　128銘柄	42.85%	43.23%
イギリス・ポンド	国債証券　47銘柄	6.53%	6.59%
イスラエル・シュケル	国債証券　11銘柄	0.43%	0.44%
オーストラリア・ドル	国債証券　28銘柄	2.65%	2.67%
カナダ・ドル	国債証券　34銘柄	1.99%	2.00%
シンガポール・ドル	国債証券　16銘柄	0.43%	0.44%
スウェーデン・クローナ	国債証券　8銘柄	0.33%	0.33%
デンマーク・クローネ	国債証券　8銘柄	0.56%	0.56%
ノルウェー・クローネ	国債証券　8銘柄	0.22%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券　13銘柄	0.63%	0.64%
マレーシア・リンギット	国債証券　22銘柄	0.50%	0.50%
メキシコ・ペソ	国債証券　13銘柄	0.80%	0.81%
ユーロ	国債証券　306銘柄	41.22%	41.58%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第４　不動産等明細表

該当事項はありません。

第５　商品明細表

該当事項はありません。

第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第７　その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第８　借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」　　（2020年11月30日現在）

Ⅰ　資産総額	32,234,241円
Ⅱ　負債総額	125,769円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,108,472円
Ⅳ　発行済数量	29,633,784口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0835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

①　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。

②　前記①の申請のある場合には、前記①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①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。

③　前記①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た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11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年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　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。

②　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11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	408	69,697
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	130	26,342
単位型公社債投資信託	0	0
合計	538	96,040

○　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して記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

　当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第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。
　また、第26期事業年度に係る中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部				
流動資産				
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
固定資産				
有形固定資産				
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
無形固定資産				
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
投資その他の資産				
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	8,422
事故損失賠償金	※2	511	※2	4,351
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									
	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	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	①　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。 ②　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。 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。 ③　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。
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	①　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。 ②　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。
４．引当金の計上基準	①　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。 ②　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。 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。 ③　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。
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	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②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。 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 ③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。 ④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。
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せない範囲で、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)
建物付属設備	－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

①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

①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

②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
①現金・預金	18,401,863	18,401,863	―
②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	―
③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	―
④デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△47,244	△47,244	―

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

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
①現金・預金	28,674,230	28,674,230	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
③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	―
④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△で示しております。

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

①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。

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

④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、記載しておりません。

（注３）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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）
①現金・預金	18,401,863	－	－	－
②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）
①現金・預金	28,674,230	－	－	－
②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
	① 国債・地方債等	5,808,720	5,801,046	7,673
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等			
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	7,736,640	8,140,850	△404,209
	小計	7,736,640	8,140,850	△404,209
合計		22,087,270	21,673,209	414,060

（注１）投資信託受益証券等であります。

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自2018年4月1日　至2019年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	―	―	―
(2)債券	―	―	―
(3)その他	2,232,532	655,395	81,265
合計	2,232,532	655,395	81,265

当事業年度（自2019年4月1日　至2020年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2020年3月31日）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

前事業年度（2019年3月31日）

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

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	1,860,993	-	10,218
合計			1,860,993	-	10,218

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

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

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職及び一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

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。

中間財務諸表

（1）中間貸借対照表

（単位：千円）

		第26期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		25,867,054
有価証券		2,200,310
前払費用		490,156
未収委託者報酬		5,083,348
未収運用受託報酬		2,860,357
未収投資助言報酬		205,730
その他		5,627
流動資産合計		36,712,587
固定資産		
有形固定資産	※1	217,645
無形固定資産		1,388,913
投資その他の資産		
投資有価証券		37,195,151
関係会社株式		66,222
長期前払費用		2,470
差入保証金		300,007
繰延税金資産		850,500
その他		17,695
投資その他の資産合計		38,432,046
固定資産合計		40,038,605
資産合計		76,751,192

負債の部		
流動負債		
預り金		48,531
未払収益分配金		4,837
未払手数料		1,745,443
未払運用委託報酬		663,984
未払投資助言報酬		805,922
その他未払金		1,824,956
未払費用		174,548
未払法人税等		521,943
前受投資助言報酬		47,773
賞与引当金		552,768
その他	※2	355,688
流動負債合計		6,746,397
固定負債		
退職給付引当金		2,061,987
役員退職慰労引当金		26,275
固定負債合計		2,088,262
負債合計		8,834,660
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		47,777,753
利益剰余金合計		48,457,560
株主資本合計		66,739,400
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,230,312
繰延ヘッジ損益		△ 53,180
評価・換算差額等合計		1,177,132
純資産合計		67,916,532
負債・純資産合計		76,751,192

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第26期中間会計期間 （自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		13,048,440
運用受託報酬		6,476,531
投資助言報酬		425,029
営業収益計		19,950,002
営業費用		8,911,467
一般管理費	※1	4,550,470
営業利益		6,488,064
営業外収益	※2	82,144
営業外費用	※3	35,367
経常利益		6,534,841
特別利益	※4	929
特別損失	※5	51,744
税引前中間純利益		6,484,025
法人税、住民税及び事業税		1,823,853
法人税等調整額		127,685
法人税等合計		1,951,539
中間純利益		4,532,486

(3)中間株主資本等変動計算書

第26期中間会計期間(自 2020年4月１日　至 2020年9月30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	48,745,315	49,425,122	67,706,962
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△5,500,048	△5,500,048	△5,500,048
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	4,532,486	4,532,486	4,532,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	△967,562	△967,562	△967,562
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	47,777,753	48,457,560	66,739,400

	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	512,183	△ 63,949	448,234	68,155,196
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△ 5,500,048
中間純利益	-	-	-	4,532,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	718,129	10,768	728,898	728,898
当中間期変動額合計	718,129	10,768	728,898	△ 238,663
当中間期末残高	1,230,312	△ 53,180	1,177,132	67,916,532

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第26期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①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。 ②その他有価証券 時価のあるもの …中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 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。 ③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。
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	①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。 ②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。
４．引当金の計上基準	①賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 ②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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。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。 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、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。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。 ③役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

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、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
６．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②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。 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 ③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。 ④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。
７．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
８．連結納税制度	日本生命保険相互会社を連結納税親会社として、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。

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）	
※１．有形固定資産の減価償却累計額	740,836千円
※２．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第26期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
※１．減価償却の実施額	
有形固定資産	31,642千円
無形固定資産	189,242千円
※２．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	52,744千円
金融派生商品収益	22,756千円
※３．営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	18,910千円
金融派生商品損失	14,197千円
※４．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	702千円
※５．特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	39,656千円
事故損失賠償金	12,088千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間
（自 2020年4月1日
至 2020年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	5,500,048	50,716	2020年3月31日	2020年6月29日

（金融商品関係）

第26期中間会計期間末（2020年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
①現金・預金	25,867,054	25,867,054	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	2,200,310	2,201,100	789
その他有価証券	―	―	―
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	12,067,677	12,071,606	3,928
その他有価証券	25,127,473	25,127,473	―
④デリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	―	―	―
ヘッジ会計が適用されているもの	△7,126	△7,126	―

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

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

①現金・預金
短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

②有価証券
中間会計期間末日の市場価格等によっております。

③投資有価証券
中間会計期間末日の市場価格等によっております。

④デリバティブ
注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

（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

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

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（2020年9月30日現在）

１．満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	11,448,319	11,453,125	4,805
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	11,448,319	11,453,125	4,805
時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	2,819,668	2,819,581	△87
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	2,819,668	2,819,581	△87
合計		14,267,988	14,272,706	4,717

２．その他有価証券

	種類	取得原価または償却原価（千円）	中間貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注）	15,190,859	16,809,083	1,618,223
	小計	15,190,859	16,809,083	1,618,223
中間貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注）	8,503,340	8,318,390	△184,949
	小計	8,503,340	8,318,390	△184,949
合計		23,694,199	25,127,473	1,433,273

（注）投資信託受益証券等であります。

（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

第26期中間会計期間末（2020年9月30日現在）

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

第26期中間会計期間末（2020年9月30日現在）

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	1,364,820	－	△7,126
合計			1,364,820	－	△7,126

（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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第26期中間会計期間 （自 2020年4月１日 至 2020年9月30日）
1株当たり純資産額	626,258円96銭
1株当たり中間純利益金額	41,794円10銭

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

２．１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	4,532,486千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る中間純利益金額	4,532,486千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第26期中間会計期間（自 2020年4月1日　至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

① 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)。

② 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)。

③ 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④⑤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。

④ 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。

⑤ 上記③④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】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 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	
光世証券株式会社	12,000	
楽天証券株式会社	7,495	
内藤証券株式会社	3,002	
ＳＭＢＣ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	

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

2020年3月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

３【資本関係】

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

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

第３【その他】

（１）目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。

（２）届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。

（３）投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。

・　ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更に際しては、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

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

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．ＸＢＲＬ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１２月２８日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の２０１９年１１月２１日から２０２０年１１月２０日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
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・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の２０２０年１１月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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。

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、ファンド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、経営者に対して、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。

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．ＸＢＲＬ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１１月３０日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
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　㊞

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　牧　野　あ　や　子　㊞

中間監査意見

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２０２０年４月１日から２０２１年３月３１日までの第２６期事業年度の中間会計期間（２０２０年４月１日から２０２０年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の２０２０年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（２０２０年４月１日から２０２０年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。**
- **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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。**
- **中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。