

【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8月20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】	<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）
【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】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

（７）【申込期間】

継続申込期間：2021年8月21日（土）～ 2022年2月18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經由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(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/>

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

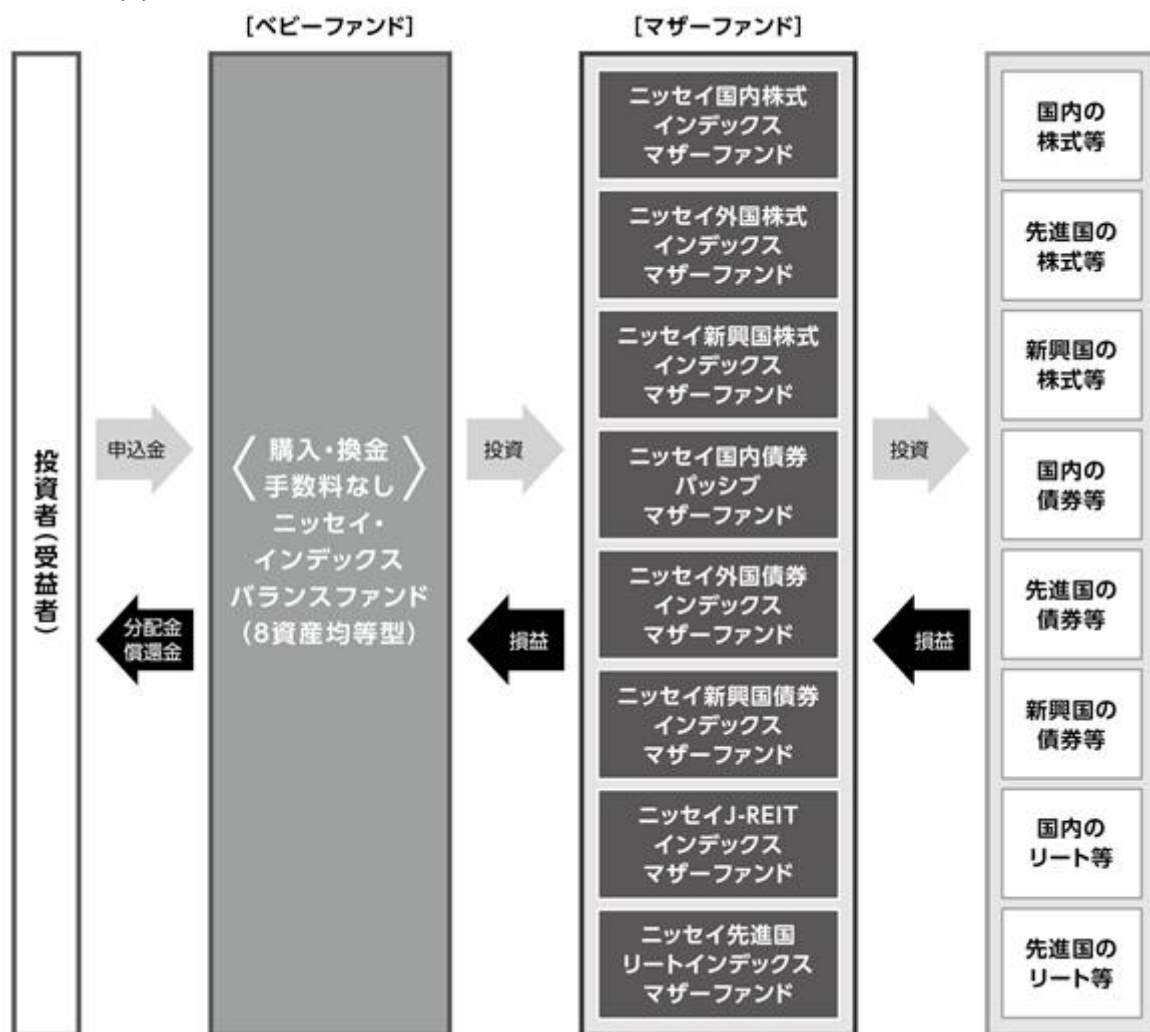
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

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

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

【投資対象とするマザーファンド】

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

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

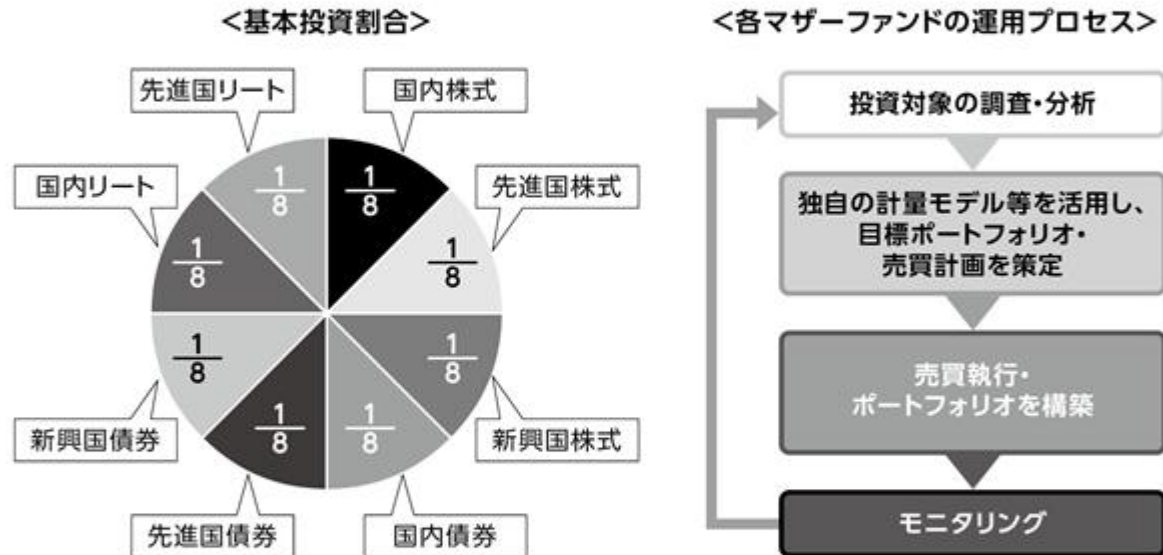
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ[※]を行いません。

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

2 8つの資産への投資割合は均等を基本とします。

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

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



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

3 購入時および換金時の手数料は無料です。

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

・保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

〈各指数について〉

●TOPIX(東証株価指数)

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

●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●NOMURA-BPI総合

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

●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

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

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

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

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

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

●東証REIT指数

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

●S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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

<MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型 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		グローバル (日本含む)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月)	日 本 北 米 欧 州 ア ジ ア	ファミリー ファンド	あ り ()	日経225 T O P I X
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア 中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し	その他 (合成ベンチ マーク)
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・ 債券・不動産 投信)資産配分 固定型))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマー ジング			

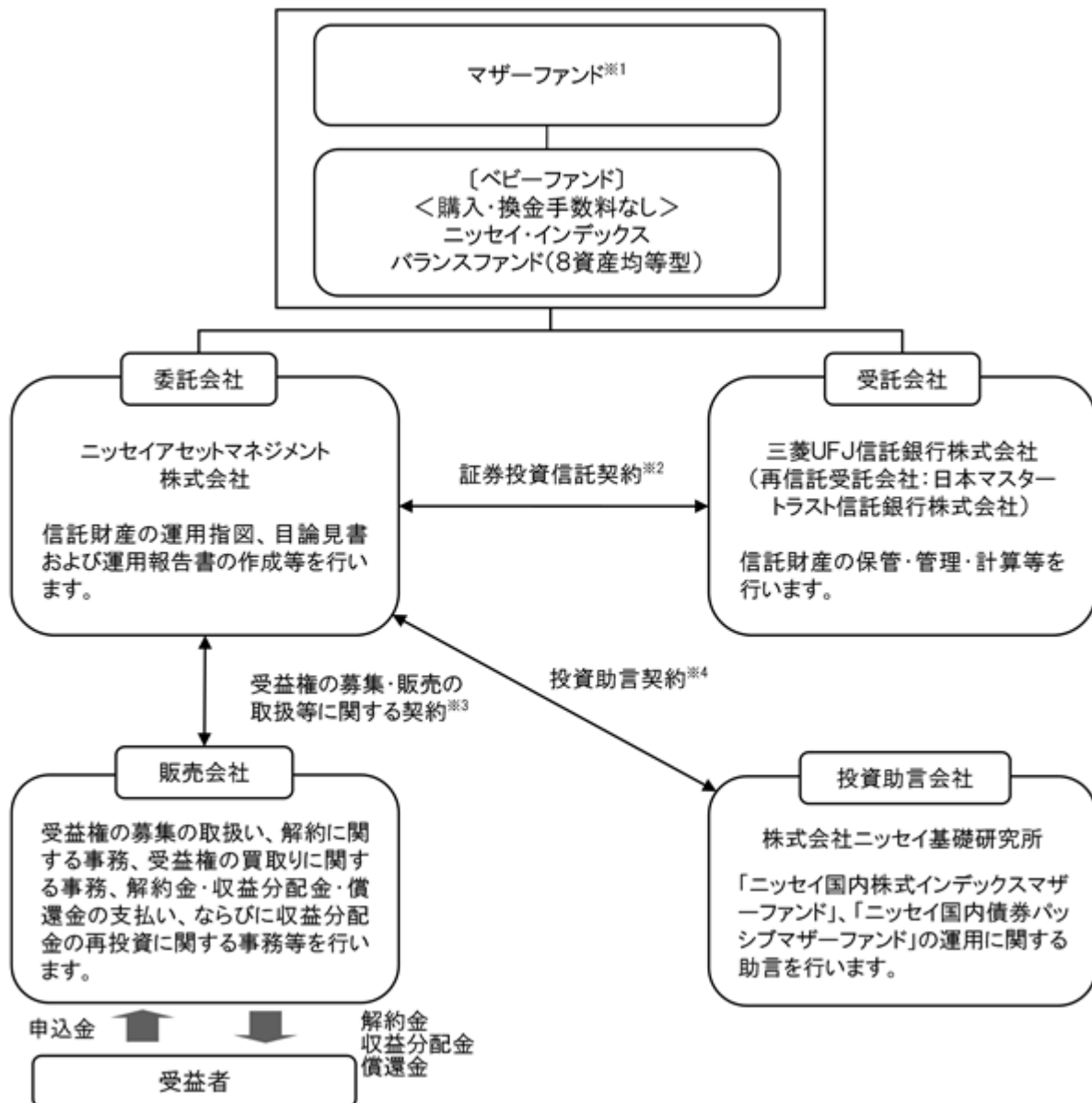
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券・ 不動産投信) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる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

2018年2月13日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2021年5月末現在）

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

8. 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

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

b 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

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

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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

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

金融商品

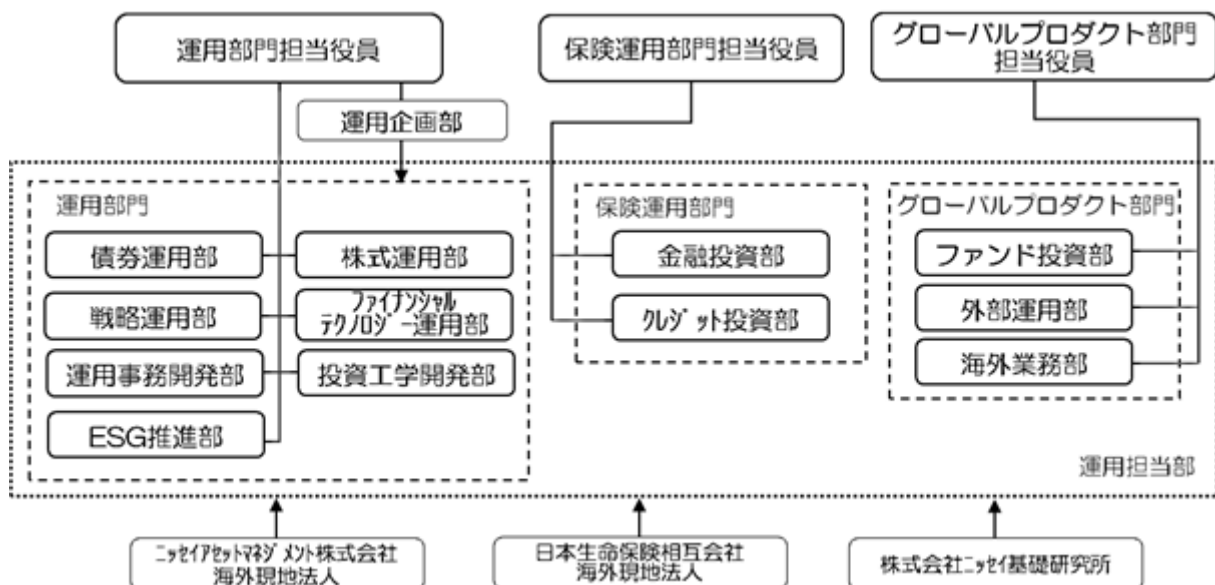
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

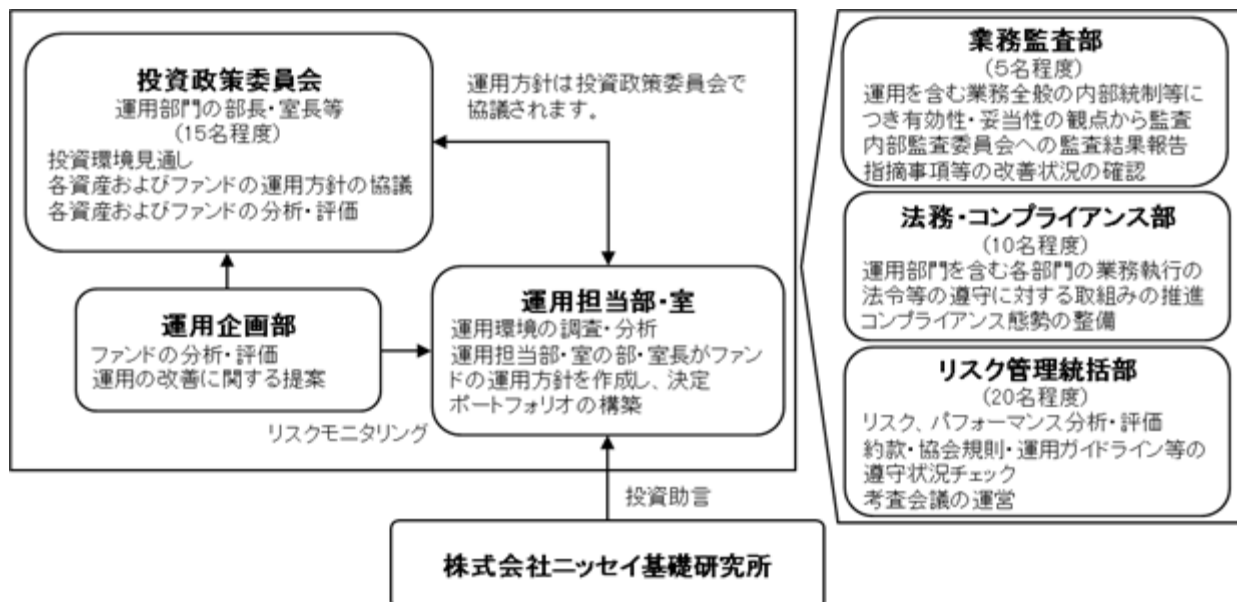
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】**a 約款に定める主な投資制限**

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

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限**投資する株式等の範囲**

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

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

信用取引の範囲

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

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

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

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

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

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

J - R E I T の税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・新興国の株式および債券投資に関する留意点

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

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

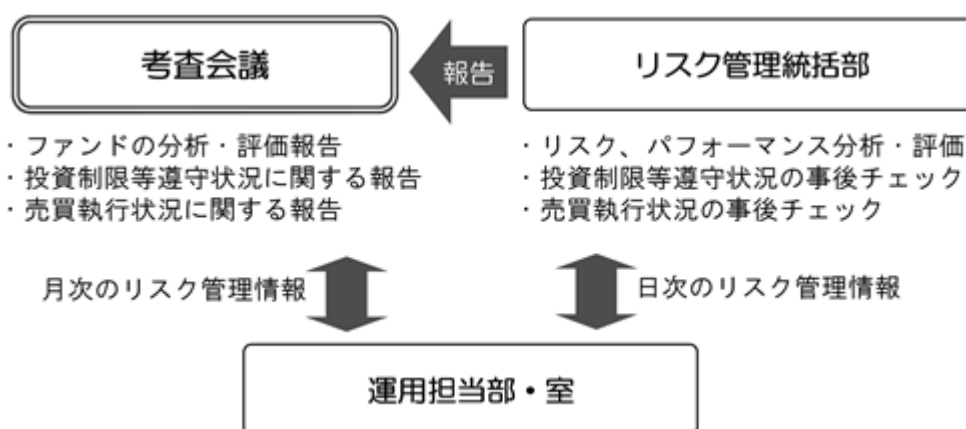
委託会社および委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2020年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に以下の通り保有しています。

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

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（％）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	-	7.7
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	96.9	-
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

委託会社については実質保有比率が5％超のマザーファンドを記載しています。

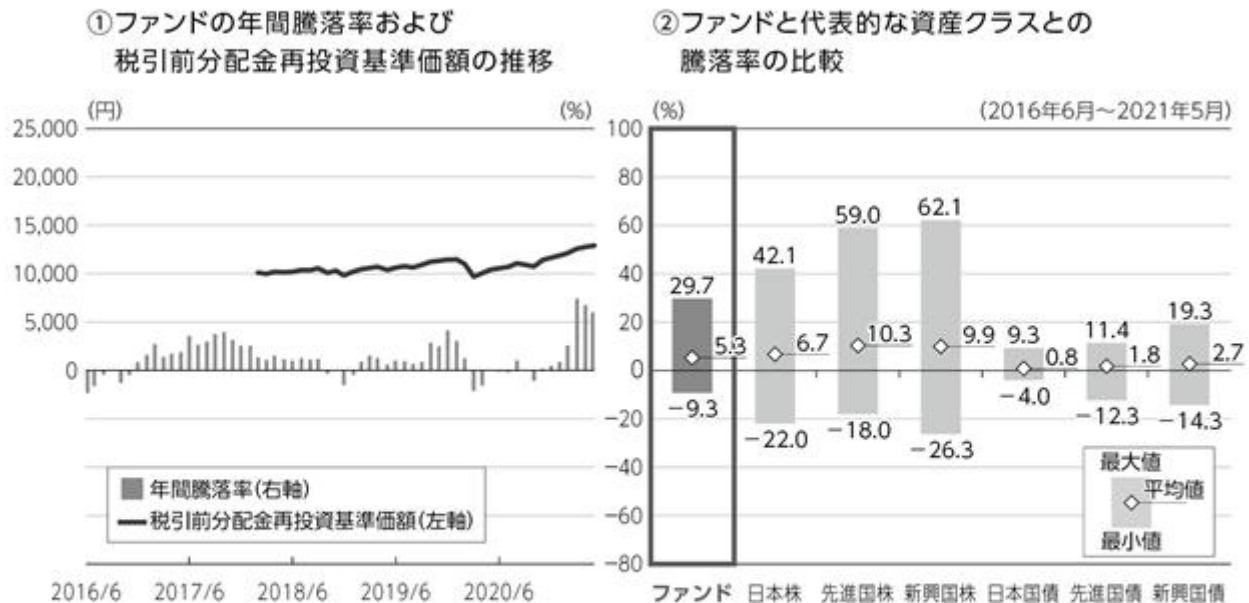
（２）投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

なお、2021年8月21日現在の信託報酬率は年0.1749%（税抜0.159%）であり、その配分は次の通りとします。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<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。

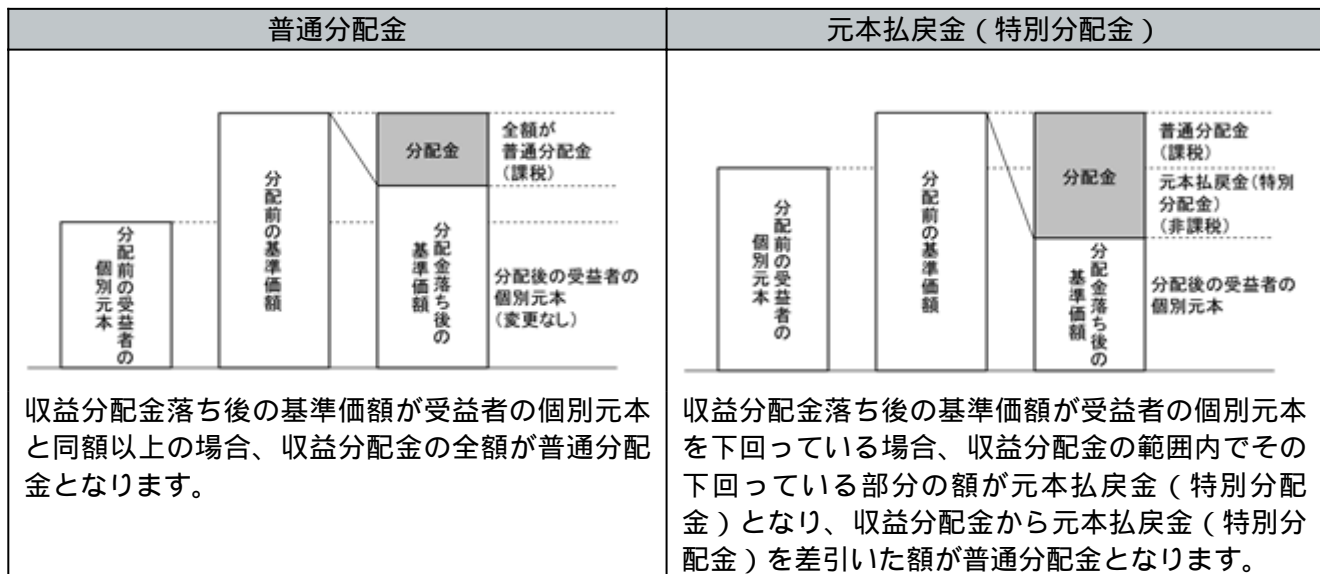
個別元本

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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



投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	360,041,399	100.00
内 日本	360,041,399	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,214	0.00
純資産総額	360,036,185	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の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	144,006,409,190	97.34
内 日本	144,006,409,190	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,935,720,760	2.66
純資産総額	147,942,129,950	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,454,835,000	3.01
内 日本	4,454,835,000	3.01

（注1）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の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	59,393,249,610	77.17
内 日本	59,393,249,610	77.17
地方債証券	5,392,306,427	7.01
内 日本	5,392,306,427	7.01
特殊債券	7,323,312,565	9.52
内 日本	7,323,312,565	9.52
社債券	4,178,726,700	5.43
内 日本	3,674,483,900	4.77
内 フランス	301,605,000	0.39
内 スウェーデン	202,637,800	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	676,170,545	0.88
純資産総額	76,963,765,847	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の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	31,139,269,470	98.65
内 日本	31,139,269,470	98.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	426,433,804	1.35
純資産総額	31,565,703,274	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の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	388,180,835,711	95.18
内 アメリカ	268,219,856,869	65.77
内 イギリス	17,620,440,464	4.32
内 カナダ	14,730,597,822	3.61
内 フランス	13,762,756,514	3.37
内 スイス	13,541,858,312	3.32
内 ドイツ	11,938,707,263	2.93
内 オーストラリア	8,429,368,289	2.07
内 オランダ	7,945,019,935	1.95
内 アイルランド	5,738,262,569	1.41
内 スウェーデン	4,949,352,485	1.21
内 香港	3,658,384,251	0.90
内 スペイン	3,310,456,198	0.81
内 デンマーク	3,227,712,302	0.79
内 イタリア	2,733,060,901	0.67
内 フィンランド	1,339,627,803	0.33
内 ベルギー	1,232,208,372	0.30
内 シンガポール	1,202,111,006	0.29
内 ノルウェー	818,091,003	0.20
内 ジャージー	769,727,294	0.19
内 バミューダ	690,926,717	0.17
内 イスラエル	550,115,868	0.13
内 ケイマン諸島	371,238,389	0.09
内 オランダ領キュラソー	327,151,850	0.08
内 ニュージーランド	305,893,623	0.08
内 オーストリア	260,039,241	0.06
内 ポルトガル	252,945,907	0.06
内 ルクセンブルグ	209,463,736	0.05
内 パプアニューギニア	45,460,728	0.01
投資証券	8,698,836,163	2.13
内 アメリカ	7,308,014,893	1.79
内 オーストラリア	578,158,253	0.14
内 イギリス	230,715,861	0.06
内 フランス	216,080,870	0.05
内 シンガポール	166,277,312	0.04
内 香港	150,682,476	0.04
内 カナダ	48,906,498	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,962,747,462	2.69
純資産総額	407,842,419,336	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,086,107,085	2.47
内 アメリカ	7,472,337,868	1.83
内 ドイツ	1,870,626,729	0.46
内 イギリス	743,142,488	0.18

（注1）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の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	39,406,144,533	100.02
内 アメリカ	17,364,858,648	44.08
内 フランス	4,118,521,886	10.45
内 イタリア	3,779,932,684	9.59
内 ドイツ	2,979,136,529	7.56
内 イギリス	2,605,432,821	6.61
内 スペイン	2,411,462,949	6.12
内 ベルギー	956,180,774	2.43
内 オーストラリア	858,427,637	2.18
内 カナダ	822,129,502	2.09
内 オランダ	774,554,182	1.97
内 オーストリア	598,855,880	1.52
内 アイルランド	333,856,104	0.85
内 メキシコ	318,037,529	0.81
内 ポーランド	255,805,605	0.65
内 フィンランド	245,791,816	0.62
内 デンマーク	202,138,471	0.51
内 マレーシア	187,583,290	0.48
内 イスラエル	178,302,072	0.45
内 シンガポール	169,606,159	0.43
内 スウェーデン	144,764,658	0.37
内 ノルウェー	100,765,337	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,718,273	0.02
純資産総額	39,398,426,260	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の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	3,403,205,736	98.07
内 アメリカ	2,536,531,967	73.09
内 オーストラリア	248,561,845	7.16
内 イギリス	201,522,750	5.81
内 シンガポール	119,505,848	3.44
内 フランス	85,112,031	2.45
内 カナダ	68,471,769	1.97
内 香港	49,151,275	1.42
内 ベルギー	41,825,348	1.21
内 スペイン	16,812,736	0.48
内 ニュージーランド	12,355,529	0.36
内 ドイツ	8,318,378	0.24
内 オランダ	6,780,980	0.20
内 アイルランド	3,339,519	0.10
内 イスラエル	2,182,567	0.06
内 ガーンジー	2,121,794	0.06
内 イタリア	611,400	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	67,121,084	1.93
純資産総額	3,470,326,820	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の比率です。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	3,121,536,475	89.35
内 台湾	439,643,883	12.58
内 韓国	431,247,553	12.34
内 香港	428,523,400	12.27
内 中国	346,914,657	9.93
内 インド	328,501,040	9.40
内 ケイマン諸島	325,019,590	9.30
内 ブラジル	165,190,954	4.73
内 アメリカ	134,376,179	3.85
内 南アフリカ	124,807,537	3.57
内 ロシア	82,439,549	2.36
内 メキシコ	56,603,610	1.62
内 タイ	55,492,479	1.59
内 マレーシア	41,545,130	1.19
内 インドネシア	39,403,961	1.13
内 ポーランド	23,711,898	0.68
内 フィリピン	18,804,906	0.54
内 バミューダ	15,595,860	0.45
内 チリ	14,273,892	0.41
内 イギリス	11,688,235	0.33
内 オランダ	9,539,438	0.27
内 ハンガリー	7,766,175	0.22
内 トルコ	7,176,686	0.21
内 コロンビア	4,468,028	0.13
内 ギリシャ	4,073,797	0.12
内 チェコ	3,092,291	0.09
内 イギリス領バージン諸島	961,804	0.03
内 ペルー	673,943	0.02
新株予約権証券	7,724	0.00
内 タイ	7,724	0.00
投資信託受益証券	160,582,602	4.60
内 アメリカ	160,582,602	4.60
投資証券	2,194,069	0.06
内 メキシコ	1,141,848	0.03
内 南アフリカ	1,052,221	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	209,394,157	5.99
純資産総額	3,493,715,027	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	231,527,195	6.63
内 アメリカ	231,527,195	6.63

（注1）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の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	1,205,424,071	96.92
内 メキシコ	202,576,432	16.29
内 インドネシア	166,179,052	13.36
内 ロシア	162,471,888	13.06
内 ブラジル	132,836,818	10.68
内 フィリピン	121,256,565	9.75
内 コロンビア	117,581,057	9.45
内 南アフリカ	69,517,812	5.59
内 ペルー	68,280,552	5.49
内 パナマ	63,286,626	5.09
内 ハンガリー	35,918,882	2.89
内 ルーマニア	35,440,635	2.85
内 クロアチア	30,077,752	2.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	38,242,804	3.08
純資産総額	1,243,666,875	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の比率です。

(2) 【投資資産】
【投資有価証券の主要銘柄】

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	36,397,538	1.0140 36,908,962	1.2488 45,453,245	- -	12.62
2	ニッセイ新興国債券イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	37,380,161	1.1839 44,256,776	1.2132 45,349,611	- -	12.60
3	ニッセイ外国株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	17,338,885	2.1186 36,735,777	2.6030 45,133,117	- -	12.54
4	ニッセイ国内株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	21,092,976	1.9357 40,831,619	2.1378 45,092,564	- -	12.52
5	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	29,983,459	1.4526 43,556,218	1.5024 45,047,148	- -	12.51
6	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	23,278,639	1.5678 36,497,955	1.9237 44,781,117	- -	12.44
7	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	35,733,856	1.0697 38,227,495	1.2507 44,692,333	- -	12.41
8	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	45,289,357	0.9844 44,583,567	0.9824 44,492,264	- -	12.36

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

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

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 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	552,800	8,082.53 4,468,022,900	9,115.00 5,038,772,000	- -	3.41
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	341,800	11,959.46 4,087,745,200	10,785.00 3,686,313,000	- -	2.49

3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	424,800	10,484.37 4,453,763,200	8,256.00 3,507,148,800	- -	2.37
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	53,600	56,670.98 3,037,565,000	53,870.00 2,887,432,000	- -	1.95
5	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	3,681,400	564.75 2,079,095,860	620.00 2,282,468,000	- -	1.54
6	任天堂 日本	株式 その他製 品	31,200	67,992.44 2,121,364,200	67,700.00 2,112,240,000	- -	1.43
7	リクルートホールディン グス 日本	株式 サービ ス業	373,500	5,475.33 2,045,039,300	5,555.00 2,074,792,500	- -	1.40
8	信越化学工業 日本	株式 化学	98,800	18,747.03 1,852,207,100	18,855.00 1,862,874,000	- -	1.26
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	626,200	2,821.51 1,766,830,350	2,931.50 1,835,705,300	- -	1.24
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	454,000	3,688.03 1,674,367,400	3,719.00 1,688,426,000	- -	1.14
11	日本電産 日本	株式 電気機器	131,300	14,603.05 1,917,381,600	12,530.00 1,645,189,000	- -	1.11
12	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	429,400	3,397.54 1,458,907,100	3,717.00 1,596,079,800	- -	1.08
13	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	32,000	46,363.15 1,483,621,100	48,660.00 1,557,120,000	- -	1.05
14	HOYA 日本	株式 精密機器	107,400	13,088.33 1,405,686,900	14,350.00 1,541,190,000	- -	1.04
15	日立製作所 日本	株式 電気機器	262,300	4,952.06 1,298,927,200	5,736.00 1,504,552,800	- -	1.02
16	ダイキン工業 日本	株式 機械	69,500	22,104.76 1,536,281,300	21,605.00 1,501,547,500	- -	1.01
17	三井住友フィナンシャル グループ 日本	株式 銀行業	372,400	3,768.60 1,403,429,200	3,951.00 1,471,352,400	- -	0.99
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	429,600	2,988.93 1,284,044,700	3,353.00 1,440,448,800	- -	0.97
19	村田製作所 日本	株式 電気機器	160,300	9,846.57 1,578,406,400	8,279.00 1,327,123,700	- -	0.90
20	ファナック 日本	株式 電気機器	47,900	27,551.26 1,319,705,500	26,300.00 1,259,770,000	- -	0.85
21	みずほフィナンシャル グループ 日本	株式 銀行業	731,300	1,590.56 1,163,178,150	1,673.00 1,223,464,900	- -	0.83
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	375,900	3,252.26 1,222,526,200	3,249.00 1,221,299,100	- -	0.83

23	第一三共 日本	株式 医薬品	428,800	3,257.90 1,396,990,860	2,530.00 1,084,864,000	- -	0.73
24	S M C 日本	株式 機械	16,000	65,860.63 1,053,770,200	65,520.00 1,048,320,000	- -	0.71
25	三井物産 日本	株式 卸売業	428,700	2,215.11 949,618,850	2,414.00 1,034,881,800	- -	0.70
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	210,200	4,216.62 886,335,400	4,736.00 995,507,200	- -	0.67
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	327,200	2,983.19 976,100,000	2,984.00 976,364,800	- -	0.66
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	545,600	1,603.98 875,135,300	1,692.00 923,155,200	- -	0.62
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	177,200	5,347.54 947,585,700	5,179.00 917,718,800	- -	0.62
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	55,500	17,987.69 998,316,800	16,310.00 905,205,000	- -	0.61

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	電気機器	17.32
		情報・通信業	8.78
		輸送用機器	7.44
		化学	7.18
		機械	5.48
		サービス業	5.47
		銀行業	5.04
		医薬品	4.95
		卸売業	4.60
		小売業	4.40
		食料品	3.30
		陸運業	3.23
		精密機器	2.64
		その他製品	2.49
		建設業	2.26
		不動産業	1.95
		保険業	1.90
		電気・ガス業	1.19
		その他金融業	1.09
		鉄鋼	0.82
		証券、商品先物取引業	0.80
		ガラス・土石製品	0.77
		非鉄金属	0.74
		ゴム製品	0.65
		金属製品	0.60
		繊維製品	0.47
		空運業	0.46
		石油・石炭製品	0.40
海運業	0.27		
パルプ・紙	0.23		
倉庫・運輸関連業	0.17		
鉱業	0.17		
水産・農林業	0.09		
	小計		97.34
合計（対純資産総額比）			97.34

(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の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第70回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,049,000,000	108.03 1,133,321,580	107.73 1,130,140,150	2.4 2024/6/20	1.47
2	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	101.77 1,017,724,000	101.61 1,016,135,000	0.828 2023/5/19	1.32
3	第35回 利付国債(30年) 日本	国債証券	774,000,000	130.01 1,006,349,830	129.80 1,004,667,480	2 2041/9/20	1.31
4	第328回 利付国債(10年) 日本	国債証券	779,000,000	101.43 790,201,700	101.31 789,259,430	0.6 2023/3/20	1.03

5	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	770,000,000	100.83 776,420,700	101.05 778,138,900	0.1 2028/3/20	1.01
6	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	723,000,000	100.17 724,229,100	100.65 727,757,340	0.1 2030/3/20	0.95
7	第127回 利付国債(20年) 日本	国債証券	575,000,000	117.57 676,044,750	117.81 677,413,250	1.9 2031/3/20	0.88
8	第351回 利付国債(10年) 日本	国債証券	646,000,000	100.77 651,012,300	101.02 652,621,500	0.1 2028/6/20	0.85
9	第334回 利付国債(10年) 日本	国債証券	618,000,000	102.31 632,325,240	102.23 631,818,480	0.6 2024/6/20	0.82
10	第354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	615,000,000	100.52 618,198,000	100.89 620,522,700	0.1 2029/3/20	0.81
11	第349回 利付国債(10年) 日本	国債証券	597,000,000	100.86 602,135,660	101.05 603,280,440	0.1 2027/12/20	0.78
12	第327回 利付国債(10年) 日本	国債証券	592,000,000	101.62 601,596,320	101.43 600,518,880	0.8 2022/12/20	0.78
13	第352回 利付国債(10年) 日本	国債証券	576,000,000	100.67 579,899,520	100.98 581,690,880	0.1 2028/9/20	0.76
14	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	566,000,000	102.20 578,474,640	102.24 578,729,340	0.4 2025/9/20	0.75
15	第341回 利付国債(10年) 日本	国債証券	552,000,000	101.79 561,924,960	101.87 562,355,520	0.3 2025/12/20	0.73
16	第353回 利付国債(10年) 日本	国債証券	543,000,000	100.62 546,372,030	100.94 548,131,350	0.1 2028/12/20	0.71
17	第339回 利付国債(10年) 日本	国債証券	536,000,000	102.08 547,154,160	102.13 547,459,680	0.4 2025/6/20	0.71
18	第344回 利付国債(10年) 日本	国債証券	533,000,000	100.83 537,429,230	100.98 538,250,050	0.1 2026/9/20	0.70
19	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	532,000,000	100.84 536,468,800	101.00 537,341,280	0.1 2026/12/20	0.70
20	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	523,000,000	100.81 527,262,450	101.01 528,329,370	0.1 2027/3/20	0.69
21	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	510,000,000	100.83 514,238,100	100.96 514,916,400	0.1 2026/3/20	0.67

22	第218回 政保道路機構 債券 日本	特殊債 券	500,000,000	101.95 509,752,000	101.92 509,623,000	0.66 2024/5/31	0.66
23	第190回 政保道路機構 債券 日本	特殊債 券	500,000,000	101.23 506,158,500	101.17 505,870,500	0.605 2023/5/31	0.66
24	第348回 利付国債（1 0年） 日本	国債証 券	499,000,000	100.81 503,076,830	101.04 504,209,560	0.1 2027/9/20	0.66
25	第338回 利付国債（1 0年） 日本	国債証 券	491,000,000	101.97 500,716,890	102.00 500,839,640	0.4 2025/3/20	0.65
26	第113回 利付国債（2 0年） 日本	国債証 券	415,000,000	117.35 487,039,850	117.38 487,164,350	2.1 2029/9/20	0.63
27	第335回 利付国債（1 0年） 日本	国債証 券	475,000,000	102.10 485,001,760	102.07 484,846,750	0.5 2024/9/20	0.63
28	第141回 利付国債（5 年） 日本	国債証 券	470,000,000	100.70 473,327,600	100.74 473,506,200	0.1 2024/9/20	0.62
29	第343回 利付国債（1 0年） 日本	国債証 券	461,000,000	100.82 464,780,200	100.96 465,444,040	0.1 2026/6/20	0.60
30	第361回 利付国債（1 0年） 日本	国債証 券	457,000,000	99.86 456,370,870	100.33 458,517,240	0.1 2030/12/20	0.60

（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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	77.17
		特殊債券	9.52
		地方債証券	7.01
		社債券	4.77
	小計	98.47	
	外国	社債券	0.66
小計	0.66		
合計（対純資産総額比）			99.12

（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の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 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	3,132	696,000.00 2,179,872,000	694,000.00 2,173,608,000	- -	6.89
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,783	668,000.00 1,859,044,000	660,000.00 1,836,780,000	- -	5.82
3	GLP投資法人 日本	投資証券	8,697	181,400.00 1,577,635,800	186,900.00 1,625,469,300	- -	5.15
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	9,000	174,800.00 1,573,200,000	173,400.00 1,560,600,000	- -	4.94
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	13,863	109,100.00 1,512,453,300	110,800.00 1,536,020,400	- -	4.87
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	4,400	346,500.00 1,524,600,000	339,500.00 1,493,800,000	- -	4.73
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,971	297,400.00 1,180,975,400	306,000.00 1,215,126,000	- -	3.85
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,546	191,700.00 1,063,168,200	203,500.00 1,128,611,000	- -	3.58
9	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	5,952	164,400.00 978,508,800	157,000.00 934,464,000	- -	2.96
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	2,644	349,500.00 924,078,000	352,000.00 930,688,000	- -	2.95
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,934	197,300.00 776,178,200	196,000.00 771,064,000	- -	2.44
12	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	1,733	427,000.00 739,991,000	430,500.00 746,056,500	- -	2.36
13	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	8,186	89,500.00 732,647,000	90,600.00 741,651,600	- -	2.35
14	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証券	861	800,000.00 688,800,000	812,000.00 699,132,000	- -	2.21
15	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	1,395	502,000.00 700,290,000	498,500.00 695,407,500	- -	2.20
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	959	639,000.00 612,801,000	634,000.00 608,006,000	- -	1.93
17	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	8,966	64,600.00 579,203,600	67,200.00 602,515,200	- -	1.91

18	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,367	173,500.00 584,174,500	178,500.00 601,009,500	- -	1.90
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,819	317,500.00 577,532,500	309,000.00 562,071,000	- -	1.78
20	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	971	551,000.00 535,021,000	562,000.00 545,702,000	- -	1.73
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,638	43,000.00 500,434,000	44,600.00 519,054,800	- -	1.64
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,269	157,400.00 514,540,600	157,800.00 515,848,200	- -	1.63
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	924	488,000.00 450,912,000	504,000.00 465,696,000	- -	1.48
24	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	593	770,000.00 456,610,000	778,000.00 461,354,000	- -	1.46
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,823	150,500.00 424,861,500	154,100.00 435,024,300	- -	1.38
26	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	1,897	221,900.00 420,944,300	225,200.00 427,204,400	- -	1.35
27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,251	347,000.00 434,097,000	339,000.00 424,089,000	- -	1.34
28	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	3,634	112,800.00 409,915,200	112,000.00 407,008,000	- -	1.29
29	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,583	151,100.00 390,291,300	157,200.00 406,047,600	- -	1.29
30	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,307	176,200.00 406,493,400	174,900.00 403,494,300	- -	1.28

（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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	国内		98.65
	小計		98.65
合計(対純資産総額比)			98.65

（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の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 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	1,141,162	13,685.97 15,617,913,918	13,677.19 15,607,893,602	- -	3.83
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	487,025	26,690.54 12,998,961,173	27,404.87 13,346,860,123	- -	3.27
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	29,095	354,766.75 10,321,938,701	353,764.16 10,292,768,328	- -	2.52
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・ エンターテインメント	163,491	34,433.88 5,629,629,481	36,081.40 5,898,984,952	- -	1.45
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・ エンターテインメント	20,049	253,404.00 5,080,496,988	264,692.82 5,306,826,460	- -	1.30
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・ エンターテインメント	20,426	249,446.18 5,095,187,865	258,687.85 5,283,958,146	- -	1.30
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	207,372	17,684.21 3,667,210,456	18,026.98 3,738,291,394	- -	0.92
8	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部品	52,197	61,973.11 3,234,810,619	68,624.14 3,581,974,611	- -	0.88
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・ バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	178,676	18,667.17 3,335,375,289	18,576.87 3,319,242,610	- -	0.81
10	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製造装置	42,077	61,816.52 2,601,053,750	71,319.85 3,000,925,446	- -	0.74
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	93,167	31,416.55 2,926,985,795	31,768.93 2,959,816,311	- -	0.73
12	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	64,475	44,950.23 2,898,166,277	45,212.33 2,915,065,569	- -	0.71

13	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	115,305	24,653.93 2,842,721,522	24,948.44 2,876,680,796	- -	0.71
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲 料・タバ コ	195,795	13,332.16 2,610,371,579	13,546.63 2,652,364,222	- -	0.65
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	73,187	34,516.72 2,526,175,829	35,003.56 2,561,805,662	- -	0.63
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	167,417	14,993.52 2,510,170,888	14,801.13 2,477,961,785	- -	0.61
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	527,935	4,606.67 2,432,026,742	4,652.72 2,456,337,111	- -	0.60
18	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	123,401	18,587.80 2,293,753,337	19,608.62 2,419,723,810	- -	0.59
19	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	60,283	39,622.11 2,388,540,115	39,577.26 2,385,836,012	- -	0.58
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	75,613	26,865.56 2,031,385,751	28,539.79 2,157,979,534	- -	0.53
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	28,508	68,073.65 1,940,643,899	73,864.60 2,105,732,073	- -	0.52
22	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	310,577	5,956.00 1,849,798,444	6,293.63 1,954,659,333	- -	0.48
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	287,751	6,473.60 1,862,785,702	6,406.69 1,843,531,799	- -	0.45
24	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	47,688	37,124.67 1,770,401,605	38,474.79 1,834,786,071	- -	0.45
25	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	32,508	52,754.83 1,714,954,110	55,382.70 1,800,380,837	- -	0.44

26	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信 サービス	281,936	6,246.98 1,761,248,625	6,200.34 1,748,099,734	- -	0.43
27	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	276,169	6,076.32 1,678,091,677	6,269.49 1,731,439,115	- -	0.42
28	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	278,541	5,946.79 1,656,426,281	6,068.63 1,690,362,380	- -	0.41
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	286,863	5,759.48 1,652,182,433	5,806.30 1,665,613,784	- -	0.41
30	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	30,106	53,547.60 1,612,104,096	55,188.42 1,661,502,741	- -	0.41

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

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	11.26
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.20
		メディア・娯楽	7.07
		資本財	6.55
		銀行	6.38
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.33
		小売	5.31
		ヘルスケア機器・サービス	5.03
		各種金融	4.67
		素材	4.50
		半導体・半導体製造装置	4.36
		食品・飲料・タバコ	3.92
		エネルギー	3.21
		保険	3.16
		公益事業	2.92
		運輸	2.08
		耐久消費財・アパレル	1.98
		自動車・自動車部品	1.91
		消費者サービス	1.89
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
電気通信サービス	1.71		
食品・生活必需品小売り	1.32		
商業・専門サービス	1.19		
不動産	0.49		
	小計		95.18
投資証券	外国		2.13
	小計		2.13
合計(対純資産総額比)			97.31

(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の比率です。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。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 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	365,500,800	106.70 390,014,938	106.75 390,172,104	2.75 2024/2/15	0.99
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	301,840,000	106.18 320,514,840	106.21 320,584,264	2.75 2023/11/15	0.81
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	299,644,800	106.64 319,553,200	106.94 320,455,131	2.25 2025/11/15	0.81
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	304,035,200	103.74 315,412,197	104.08 316,467,199	1.625 2026/2/15	0.80
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	293,059,200	105.14 308,145,887	105.19 308,295,347	2.25 2023/12/31	0.78
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	280,985,600	106.42 299,035,361	106.50 299,258,093	2.5 2024/5/15	0.76
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	280,985,600	105.53 296,526,913	105.79 297,282,764	2 2025/8/15	0.75

8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	279,888,000	103.20 288,852,812	103.17 288,763,248	2 2023/2/15	0.73
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	265,619,200	105.97 281,481,978	106.18 282,042,435	2.125 2025/5/15	0.72
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	273,302,400	103.12 281,850,181	103.10 281,799,371	1.75 2023/5/15	0.72
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	266,716,800	105.38 281,071,498	105.56 281,572,925	2 2025/2/15	0.71
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	261,228,800	106.33 277,769,807	106.43 278,044,097	2.375 2024/8/15	0.71
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	260,131,200	106.12 276,072,039	106.26 276,438,824	2.25 2024/11/15	0.70
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	270,009,600	102.22 276,009,213	102.19 275,936,310	1.625 2022/11/15	0.70
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	260,131,200	105.15 273,539,613	105.22 273,725,656	2.125 2024/3/31	0.69
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	255,740,800	105.10 268,806,597	105.10 268,786,138	2.5 2023/8/15	0.68
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	262,326,400	102.33 268,462,214	102.31 268,401,879	1.625 2022/12/15	0.68
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	260,131,200	103.19 268,442,391	103.15 268,330,535	2.125 2022/12/31	0.68
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	261,228,800	101.88 266,166,024	101.86 266,105,941	1.625 2022/8/15	0.68
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	243,667,200	108.37 264,081,638	108.67 264,815,076	2.625 2025/12/31	0.67
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	238,179,200	106.73 254,224,827	107.08 255,047,050	2.25 2026/3/31	0.65
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	235,984,000	106.37 251,018,540	106.90 252,271,615	2.25 2027/11/15	0.64
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	238,179,200	103.82 247,281,355	104.02 247,761,149	1.625 2026/5/15	0.63
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	223,910,400	109.85 245,980,567	110.08 246,500,720	3 2025/9/30	0.63
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	220,617,600	109.51 241,618,189	110.07 242,842,617	2.75 2028/2/15	0.62
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	231,593,600	101.94 236,088,831	101.90 235,998,510	1.625 2022/8/31	0.60
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	220,617,600	102.22 225,519,723	102.18 225,442,506	1.75 2022/9/30	0.57
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	215,129,600	101.78 218,969,663	101.72 218,834,131	1.75 2022/6/15	0.56
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	203,056,000	106.49 216,246,517	106.96 217,196,819	2.25 2027/8/15	0.55
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	211,836,800	102.26 216,626,430	102.19 216,486,617	2.125 2022/6/30	0.55

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	100.02
	小計		100.02
合 計 (対純資産総額比)			100.02

（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の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 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	15,777	11,026.08 173,958,607	12,934.11 204,061,585	- -	5.88
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証 券	1,900	79,827.90 151,673,017	80,862.38 153,638,535	- -	4.43
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	7,097	9,184.01 65,178,981	14,103.06 100,089,433	- -	2.88
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	6,004	15,639.82 93,901,533	16,635.22 99,877,894	- -	2.88
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証 券	3,176	25,226.67 80,119,929	31,005.00 98,471,895	- -	2.84
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	8,926	7,186.19 64,143,970	8,206.75 73,253,496	- -	2.11
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	2,953	18,753.93 55,380,367	22,713.73 67,073,657	- -	1.93
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	7,288	6,650.45 48,468,538	8,500.91 61,954,646	- -	1.79
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	8,140	6,750.65 54,950,371	7,507.58 61,111,733	- -	1.76
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証 券	35,938	1,578.00 56,710,220	1,634.93 58,756,164	- -	1.69
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	2,697	18,060.11 48,708,121	19,565.81 52,769,010	- -	1.52
12	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	8,165	5,377.72 43,909,131	6,086.19 49,693,757	- -	1.43
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	12,038	3,115.87 37,508,856	3,980.99 47,923,220	- -	1.38
14	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	2,788	12,534.88 34,947,248	16,443.14 45,843,489	- -	1.32
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	1,385	28,009.64 38,793,363	32,411.03 44,889,277	- -	1.29
16	LINK REIT 香港	投資証 券	42,300	980.74 41,485,714	1,058.37 44,769,431	- -	1.29
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	2,346	15,566.82 36,519,767	18,376.01 43,110,141	- -	1.24

18	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証 券	2,439	13,995.33 34,134,623	17,638.43 43,020,135	- -	1.24
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	11,630	3,368.66 39,177,563	3,663.78 42,609,863	- -	1.23
20	SEGRO PLC イギリス	投資証 券	25,356	1,425.17 36,136,704	1,623.68 41,170,182	- -	1.19
21	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証 券	7,853	4,275.88 33,578,499	5,099.44 40,045,977	- -	1.15
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	11,671	2,872.44 33,524,316	3,416.82 39,877,808	- -	1.15
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	3,081	10,743.84 33,101,783	12,903.38 39,755,331	- -	1.15
24	UDR INC アメリカ	投資証 券	6,322	4,298.36 27,174,255	5,227.86 33,050,586	- -	0.95
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	3,889	7,703.87 29,960,389	8,281.39 32,206,333	- -	0.93
26	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC アメリカ	投資証 券	12,687	2,148.97 27,263,988	2,323.61 29,479,756	- -	0.85
27	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	6,062	2,903.64 17,601,890	4,778.95 28,969,997	- -	0.83
28	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD フランス	投資証 券	2,966	7,645.72 22,677,229	9,652.01 28,627,878	- -	0.82
29	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証 券	14,977	1,604.11 24,024,903	1,884.57 28,225,342	- -	0.81
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	3,537	6,678.40 23,621,528	7,777.59 27,509,348	- -	0.79

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	外国		98.07
	小計		98.07
合計(対純資産総額比)			98.07

(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の比率です。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	87,000	2,004.28 174,372,583	2,336.99 203,318,130	- -	5.82
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア ア・娯楽	20,400	8,251.47 168,330,174	8,505.21 173,506,284	- -	4.97
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 小売	53,600	2,955.90 158,436,620	2,932.63 157,189,289	- -	4.50
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	17,111	6,632.84 113,494,633	7,881.83 134,866,164	- -	3.86
5	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	22,700	3,459.12 78,522,066	4,230.15 96,024,414	- -	2.75
6	MEITUAN-B 香港	株式 小売	13,000	4,194.14 54,523,901	3,749.92 48,749,064	- -	1.40
7	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 小売	1,569	24,563.35 38,539,898	24,134.37 37,866,828	- -	1.08
8	VALE SA ブラジル	株式 素材	14,367	1,579.45 22,692,090	2,344.33 33,681,111	- -	0.96
9	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネル ギー	10,209	3,018.31 30,814,014	3,184.09 32,506,436	- -	0.93
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	351,000	84.96 29,824,387	90.49 31,764,096	- -	0.91
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	22,500	1,257.65 28,297,251	1,199.77 26,995,027	- -	0.77
12	JD.COM INC-ADR ケイマン諸島	株式 小売	3,150	9,461.86 29,804,868	8,115.65 25,564,311	- -	0.73
13	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	15,504	1,324.80 20,539,744	1,631.03 25,287,544	- -	0.72
14	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,998	10,369.77 20,718,802	12,300.00 24,575,400	- -	0.70

15	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	11,447	1,687.21 19,313,493	2,135.67 24,447,083	- -	0.70
16	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 銀行	6,278	3,604.02 22,626,058	3,862.85 24,250,984	- -	0.69
17	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	10,346	1,989.78 20,586,264	2,124.29 21,977,956	- -	0.63
18	PINDUODUO INC-ADR アメリカ	株式 小売	1,600	15,225.66 24,361,066	13,706.82 21,930,926	- -	0.63
19	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	52,600	361.97 19,040,020	404.40 21,271,650	- -	0.61
20	BAIDU INC - SPON ADR ケイマン諸島	株式 メデ ィア・娯 楽	963	17,323.15 16,682,201	21,542.59 20,745,519	- -	0.59
21	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC 香港	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	12,500	1,213.12 15,164,047	1,627.51 20,343,925	- -	0.58
22	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	46,200	347.51 16,054,994	439.67 20,312,800	- -	0.58
23	NIO INC - ADR アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	4,700	5,180.76 24,349,596	4,238.93 19,922,976	- -	0.57
24	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	2,689	5,872.87 15,792,149	7,104.47 19,103,946	- -	0.55
25	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	5,000	2,903.41 14,517,065	3,806.52 19,032,605	- -	0.54

26	NETEASE.COM INC -ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	1,390	9,956.21 13,839,132	12,943.99 17,992,155	- -	0.51
27	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	17,828	748.46 13,343,547	977.43 17,425,729	- -	0.50
28	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	5,000	2,931.48 14,657,445	3,458.53 17,292,688	- -	0.49
29	SBERBANK PAO -SPONSORED ADR ロシア	株式 銀行	9,037	1,452.94 13,130,243	1,852.19 16,738,330	- -	0.48
30	PJSC GAZPROM ADR ロシア	株式 エネルギー	20,067	541.02 10,856,686	779.73 15,646,942	- -	0.45

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	銀行	10.40
		小売	9.76
		メディア・娯楽	8.31
		半導体・半導体製造装置	8.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.11
		素材	7.44
		エネルギー	4.34
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.37
		食品・飲料・タバコ	3.25
		自動車・自動車部品	3.22
		保険	2.58
		資本財	2.42
		各種金融	2.41
		ソフトウェア・サービス	2.35
		電気通信サービス	1.84
		公益事業	1.80
		不動産	1.80
		耐久消費財・アパレル	1.64
		運輸	1.52
		ヘルスケア機器・サービス	1.11
消費者サービス	1.10		
食品・生活必需品小売り	1.06		
家庭用品・パーソナル用品	0.92		
商業・専門サービス	0.30		
その他	0.00		
	小計		89.35
新株予約権証券	外国		0.00
	小計		0.00
投資信託受益証券	外国		4.60
	小計		4.60
投資証券	外国		0.06
	小計		0.06
合計(対純資産総額比)			94.01

(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の比率です。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。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	43,904,000	136.18 59,788,906	124.40 54,619,649	5.25 2047/6/23	4.39
2	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	21,952,000	143.56 31,514,730	140.79 30,907,098	6.375 2034/10/23	2.49
3	CROATIA クロアチア	国債証券	26,342,400	115.18 30,343,020	114.17 30,077,752	6 2024/1/26	2.42
4	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	21,952,000	129.91 28,518,940	120.22 26,392,670	5.125 2045/1/15	2.12
5	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	21,952,000	126.28 27,721,424	118.49 26,011,802	5.1 2035/3/28	2.09

6	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証 券	21,952,000	120.48 26,449,745	117.28 25,745,964	4.75 2029/2/11	2.07
7	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証 券	21,952,000	116.78 25,636,643	114.65 25,168,626	4.75 2026/1/8	2.02
8	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	21,952,000	113.35 24,882,811	113.57 24,932,862	4.15 2027/3/28	2.00
9	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証 券	21,952,000	115.43 25,339,413	113.55 24,927,374	4.75 2026/5/27	2.00
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証 券	21,952,000	111.25 24,421,600	112.87 24,777,441	5.875 2025/9/16	1.99
11	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	21,952,000	117.37 25,767,257	111.81 24,546,506	5 2051/4/27	1.97
12	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証 券	21,952,000	113.63 24,944,935	111.45 24,465,504	4.25 2027/6/23	1.97
13	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証 券	21,952,000	120.25 26,397,280	110.91 24,348,719	4.2 2050/10/15	1.96
14	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証 券	21,952,000	127.70 28,032,704	110.78 24,318,864	4.5 2056/4/1	1.96
15	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	21,952,000	109.19 23,970,705	110.60 24,281,107	3.6 2025/1/30	1.95
16	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証 券	21,952,000	120.64 26,483,551	110.46 24,249,057	4.35 2048/1/11	1.95
17	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証 券	21,952,000	114.00 25,025,499	110.38 24,232,373	3.875 2028/3/17	1.95
18	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証 券	21,952,000	111.71 24,523,457	109.14 23,958,851	3.5 2028/1/11	1.93
19	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	21,952,000	110.35 24,224,251	109.07 23,945,022	3.75 2028/1/11	1.93
20	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証 券	21,952,000	111.05 24,377,696	108.87 23,900,020	4.625 2028/1/13	1.92
21	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証 券	21,952,000	109.92 24,130,077	108.87 23,899,361	4.875 2023/9/16	1.92
22	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証 券	21,952,000	110.37 24,229,739	107.76 23,656,572	3 2028/2/1	1.90
23	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証 券	21,952,000	117.00 25,683,840	107.52 23,604,327	5.625 2047/2/21	1.90
24	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	21,952,000	125.80 27,615,616	106.50 23,380,416	5.2 2049/5/15	1.88
25	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証 券	21,952,000	116.93 25,668,693	106.28 23,332,780	3.7 2042/2/2	1.88
26	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	21,952,000	107.37 23,571,179	106.16 23,306,438	4 2024/2/26	1.87
27	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	21,952,000	113.25 24,860,640	105.86 23,238,826	4.6 2048/2/10	1.87
28	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	21,952,000	122.75 26,946,080	103.56 22,733,930	5 2045/6/15	1.83
29	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証 券	21,952,000	100.12 21,978,781	103.20 22,655,781	4.3 2028/10/12	1.82
30	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	21,952,000	105.85 23,236,411	103.13 22,640,195	3.25 2030/4/16	1.82

(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の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	96.92
	小計		96.92
合 計 (対純資産総額比)			96.92

(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の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

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。

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。

ニッセイJ - R E I Tインデックス マザーファンド

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

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

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

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

該当事項はありません。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	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 0 306月	買建	231	4,415,307,050	4,454,835,000	3.01

(注1) 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の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

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。

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。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	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 202106	買建	324	7,326,093,644	7,472,337,868	1.83
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202106	買建	344	1,814,847,252	1,870,626,729	0.46
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202106	買建	68	735,321,254	743,142,488	0.18

(注1) 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の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

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。

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。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	N Y S E L I F F E U S	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202106	買建	31	226,342,077	231,527,195	6.63

(注1) 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の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の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で評価しています。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2021年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	123,377,684	123,377,684	1.0166	1.0166
第2計算期間末 (2019年11月20日)	240,300,010	240,300,010	1.1250	1.1250
第3計算期間末 (2020年11月20日)	292,325,819	292,325,819	1.1316	1.1316
2020年5月末日	261,508,743	-	1.0412	-
6月末日	270,495,989	-	1.0568	-
7月末日	279,280,155	-	1.0701	-
8月末日	287,707,496	-	1.1083	-
9月末日	288,100,055	-	1.0917	-
10月末日	289,361,053	-	1.0749	-
11月末日	294,799,222	-	1.1422	-
12月末日	311,892,232	-	1.1667	-
2021年1月末日	317,744,196	-	1.1886	-
2月末日	315,696,807	-	1.2138	-
3月末日	334,558,504	-	1.2586	-
4月末日	348,020,484	-	1.2763	-
5月末日	360,036,185	-	1.2913	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2020年11月21日～2021年5月20日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	10.7
第3計算期間	0.6
2020年11月21日～2021年5月20日	12.2

(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います（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】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	155,808,418	34,441,297	121,367,121
第2計算期間	186,191,794	93,957,053	213,601,862
第3計算期間	139,113,792	94,394,937	258,320,717
2020年11月21日～ 2021年5月20日	50,497,260	30,620,917	278,197,060

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 参考情報 >

3.運用実績

2021年5月末現在

●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,913円
純資産総額	360百万円

●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。

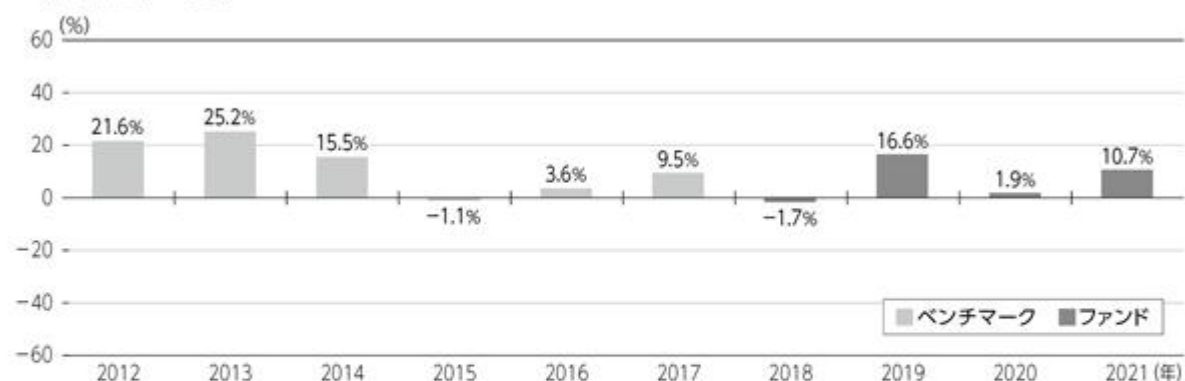
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2018年はファンド設定時から年末まで、2021年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2021年5月末現在

3.運用実績

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.5%
2	ソニーグループ	2.6%
3	ソフトバンクグループ	2.4%
4	キーエンス	2.0%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	3.9%
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	2.6%
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	1.3%

・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。

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	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	6.2%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	5.3%
3	アリババグループ・ホールディング	一般消費財・サービス	4.8%
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	2.9%

・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。

4. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第70回 利付国債(20年)	2024/06/20	2.400%	1.5%
2	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.3%
3	第35回 利付国債(30年)	2041/09/20	2.000%	1.3%
4	第328回 利付国債(10年)	2023/03/20	0.600%	1.0%
5	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.8%
2	情報・通信業	9.0%
3	輸送用機器	7.6%
4	化学	7.4%
5	機械	5.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	71.4%
2	イギリス	4.7%
3	フランス	3.8%
4	カナダ	3.7%
5	スイス	3.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	37.6%
2	台湾	13.5%
3	韓国	13.1%
4	インド	10.0%
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。

組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	-
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2021年5月末現在

5. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2024/02/15	2.750%	1.0%
2	アメリカ国債	米ドル	2023/11/15	2.750%	0.8%
3	アメリカ国債	米ドル	2025/11/15	2.250%	0.8%
4	アメリカ国債	米ドル	2026/02/15	1.625%	0.8%
5	アメリカ国債	米ドル	2023/12/31	2.250%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	44.1%
2	フランス	10.5%
3	イタリア	9.6%
4	ドイツ	7.6%
5	イギリス	6.6%

・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。

・比率は対組入債券評価額比です。

6. ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	ロシア国債	米ドル	2047/06/23	5.250%	4.5%
2	フィリピン国債	米ドル	2034/10/23	6.375%	2.6%
3	クロアチア国債	米ドル	2024/01/26	6.000%	2.5%
4	インドネシア国債	米ドル	2045/01/15	5.125%	2.2%
5	ロシア国債	米ドル	2035/03/28	5.100%	2.2%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	メキシコ	16.8%
2	インドネシア	13.8%
3	ロシア	13.5%
4	ブラジル	11.0%
5	フィリピン	10.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

7. ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.0%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.9%
3	GLP投資法人	5.2%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	5.0%
5	日本都市ファンド投資法人	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	98.6%
短期金融資産等	1.4%

・比率は対純資産総額比です。

8. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.0%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.5%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	2.9%
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.9%
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.9%

・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	74.5%
2	オーストラリア	7.3%
3	イギリス	6.0%
4	シンガポール	3.5%
5	フランス	2.5%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

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

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（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】

換金受付

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

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

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

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(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】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(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】

繰上償還

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

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

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

約款の変更等

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

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、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】

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

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第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	4,373	1,084
コール・ローン	175,878	237,606
親投資信託受益証券	240,301,163	292,327,222
未収入金	1,315,198	9,114,208
流動資産合計	241,796,612	301,680,120
資産合計	241,796,612	301,680,120
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,307,255	9,104,171
未払受託者報酬	23,645	31,247
未払委託者報酬	164,593	217,422
その他未払費用	1,109	1,461
流動負債合計	1,496,602	9,354,301
負債合計	1,496,602	9,354,301
純資産の部		
元本等		
元本	213,601,862	258,320,717
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,698,148	34,005,102
純資産合計	240,300,010	292,325,819
負債純資産合計	241,796,612	301,680,120

(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	21,197,797	4,947,805
営業収益合計	21,197,797	4,947,805
営業費用		
支払利息	7	-
受託者報酬	40,324	58,864
委託者報酬	280,797	409,606
その他費用	1,846	2,764
営業費用合計	322,974	471,234
営業利益又は営業損失()	20,874,823	4,476,571
経常利益又は経常損失()	20,874,823	4,476,571
当期純利益又は当期純損失()	20,874,823	4,476,571
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()	3,552,822	2,893,521
期首剰余金又は期首欠損金()	2,010,563	26,698,148
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,872,808	10,926,163
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,872,808	10,926,163
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,507,224	10,989,301
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,507,224	10,989,301
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()	26,698,148	34,005,102

(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	213,601,862口	258,320,717口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1250円 (11,250円)	1.1316円 (11,316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(17,046,606円)、収益調整金(9,651,549円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は26,698,155円(1口当たり0.124990円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(7,370,085円)、収益調整金(15,052,359円)及び分配準備積立金(11,582,658円)より分配対象収益は34,005,102円(1口当たり0.131639円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自2018年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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	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	第2期	第3期
	2019年11月20日現在	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	16,605,006	10,866,321
合計	16,605,006	10,866,321

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第2期	第3期
	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
期首元本額	121,367,121円	213,601,862円
期中追加設定元本額	186,191,794円	139,113,792円
期中一部解約元本額	93,957,053円	94,394,937円

(4) 【附属明細表】(2020年11月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	19,701,162	37,404,626	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	35,744,250	35,222,383	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	23,140,573	35,407,390	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	18,159,475	37,642,775	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	24,383,814	35,246,803	
	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	38,043,480	37,925,545	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	36,171,367	37,618,221	
	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	30,309,762	35,859,479	
親投資信託受益証券 合計		225,653,883	292,327,222	
合計		225,653,883	292,327,222	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

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

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	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）

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

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	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			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引							
先物取引							
買 建	1,547,375,000	-	1,573,095,000	5,098,120,000	-	5,429,060,000	330,940,000
合計	1,547,375,000	-	1,573,095,000	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。

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	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
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	
ピ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	
飛鳥建設	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	
銭高組	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	
浅沼組	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
N I P P O	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
N E C ネットエスアイ	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
大気社	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
L I F U L L	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
総合警備保障	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
麒麟ホールディングス	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
キャンドウ	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
J P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
キュービー	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
ピク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
A D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inz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
D C M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
Z O Z O	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
H a m e e	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
C o m i n i x	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
ピューティガレージ	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
ソフトクリエイティブホールディングス	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
クリエイティブ・レストランズ・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
ハウストゥ	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
日本フェルト	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
パ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
クラウドシ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
T I S	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
A G S	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
K L a b	10,900	1,002.00	10,921,800
ポルトゥウィン・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
ビキューブ	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
C A R T A H O L D I N G S	2,800	1,320.00	3,696,000
オブティム	3,100	3,040.00	9,424,000
セレス	2,000	2,218.00	4,436,000
S H I F T	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
G M O 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
G M O グローバルサイン・ホールディングス	1,300	9,910.00	12,883,000
S R A 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
e B A S E	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
オーブンドア	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・バック	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
東亜合成	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
J S R	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
K H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
E P S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
T A C	16,800	219.00	3,679,200
C E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
びあ	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
H E R O Z	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
D I C	25,300	2,565.00	64,894,500
サカティクス	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 T O K A	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
T D C 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
I D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
C A C H o l d i n g s	3,900	1,417.00	5,526,300
S B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
A C C E S S	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
C I J	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
ビービー・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
パンドー化学	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
日垂鋼業	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
文化シャッター	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
日本フィルコン	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
バリュール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
E R I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
F U J I	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
D M G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
L I T A L I C O	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
N C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
S M C	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
西島製作所	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
C K D	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
T P R	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
N T N	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
T H K	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
ベイクレント・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
M S - J a p a n	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
R P A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
J V C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 - P E X	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
I D E C	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
E I Z O	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
T D K	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
S M K	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
T O A	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
日本車輛製造	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

近畿車輛	2,800	1,294.00	3,623,200
F P G	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
N O K	32,900	1,211.00	39,841,900
フタバ産業	17,000	503.00	8,551,000
K Y B	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
S U B A R U	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
T B K	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
佐島電機	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
メディカ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
S P K	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
V T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
I D O M	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
壺番屋	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
前田工織	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
N I S S H A	12,600	1,327.00	16,720,200
藤森工業	5,500	4,330.00	23,815,000
T A K A R A & C O M P A N Y	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
J S P	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
ビジョン	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ндарт	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
M U T O H 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
日本紙バルブ商事	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
キャ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
トーヨー	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
テナアライド	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트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
S O M P O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
M S & A D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
N E C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 2 1	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
A V A N T I A	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
国際紙バルブ商事	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
キュ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
エーアイティー	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J S A T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йд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
D T S	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
カブコン	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
S C S K	13,900	5,680.00	78,952,000
K N T - C T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
T K C	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
N S D	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
JBC Cホールディングス	4,100	1,462.00	5,994,200
J K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
サックスパー 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
ペルーナ	12,900	916.00	11,816,400
合計	65,082,900		148,120,912,010

株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第4 不動産等明細表
該当事項はありません。

第5 商品明細表
該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	2019年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	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	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)

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

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

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第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・ハンデルスバンク	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	富士フィ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」-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	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	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）

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

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

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年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）

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

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。

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2019年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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2019年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		
D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	705,419,292円	854,059,755円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,284,755,401円	3,771,468,504円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,471,314,789円	2,859,153,135円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	1,485,332,737円	1,680,106,235円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	4,090,937円	2,902,320円
ニッセイインデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	23,976,047円	16,628,124円
ニッセイインデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	32,048,288円	20,292,993円
ニッセイ外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	11,371,888,952円	11,039,104,952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
D C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
D C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
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	72,703,499円	133,359,257円
D C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
D C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
D C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
D C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
D C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
D C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
D C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
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	
SYNOPSIS 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 SOFTWARE	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	
ASHTED 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・ボンド 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 HAPOLIM 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	
	YANGZIJANG 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・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)	

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）

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

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。

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

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

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2019年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

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	120,000.00	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・ボンド 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	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/04/08	310,000.00	313,087.60	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/10/07	300,000.00	304,224.00	
BUNDES OBLIGATION 0 2023/04/14	270,000.00	275,040.90	
BUNDES OBLIGATION 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。

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年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）

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

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	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	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)	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。

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2019年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

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	1,731.00	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	
	QUE 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	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年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）

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

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・リアル	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。

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2019年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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2019年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・株式ノリート）	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・株式ノリートノ債券）	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

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・ボンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	717	16.78	12,034.84	
イギリス・ボンド	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 PRECISIONIndustr-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	
SHENAN 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	
	WEICHAJ 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 APTEC 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 PIENZEHUANG 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・パーツ	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・パーツ 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・リアル	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	
ITAUUSA 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・リアル 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 TELEVISIA 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	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	6,000	17.14	102,840.00	
WHARF HOLDINGS LTD	4,000	17.80	71,200.00	
WUXI APTEC 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 CRRR 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)	

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 投資信託 3銘柄 受益証券	15.54% -%	-% 3.92%	-% -%	20.21%
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 投資証券 1銘柄	1.69% -%	-% -%	-% 0.04%	1.80%
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 投資証券 1銘柄	3.47% -%	-% -%	-% 0.03%	3.64%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	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	4,513,004	5,484,950
金銭信託	78,080	18,225
コール・ローン	3,140,362	3,994,047
国債証券	1,121,414,233	1,184,568,054
派生商品評価勘定	-	565
未収入金	61,378	-
未収利息	13,320,720	13,726,799
前払費用	607,564	177,750
流動資産合計	1,143,135,341	1,207,970,390
資産合計	1,143,135,341	1,207,970,390
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,053	28,321
未払金	487	-
未払解約金	221,467	1,175,378
その他未払費用	18	3
流動負債合計	228,025	1,203,702
負債合計	228,025	1,203,702
純資産の部		
元本等		
元本	1,020,060,445	1,019,988,559
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	122,846,871	186,778,129
純資産合計	1,142,907,316	1,206,766,688
負債純資産合計	1,143,135,341	1,207,970,390

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
1. 受益権総口数	1,020,060,445口	1,019,988,559口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1204円 (11,204円)	1.1831円 (11,831円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年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

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	116,529,413	68,340,257
合計	116,529,413	68,340,257

(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	-	-	-	-	286,095	-	285,530	565
アメリカ・ドル	-	-	-	-	286,095	-	285,530	565
買 建	2,955,871	-	2,949,818	6,053	2,851,966	-	2,823,645	28,321
アメリカ・ドル	2,955,871	-	2,949,818	6,053	2,851,966	-	2,823,645	28,321
合計	2,955,871	-	2,949,818	6,053	3,138,061	-	3,109,175	27,756

（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取相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買取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	1,012,672,810円	1,020,060,445円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	24,980,838円	19,394,018円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	17,593,203円	19,465,904円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	993,388,880円	989,678,797円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	26,671,565円	30,309,762円
計	1,020,060,445円	1,019,988,559円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第１ 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	CROATIA 6 2024/01/26	240,000.00	276,448.80	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 4.25 2025/01/07	200,000.00	218,000.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 4.625 2028/01/13	200,000.00	222,100.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5 2045/01/27	200,000.00	219,000.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.625 2041/01/07	100,000.00	116,875.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.625 2047/02/21	200,000.00	234,000.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 7.125 2037/01/20	100,000.00	133,501.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL 8.25 2034/01/20	100,000.00	143,126.00	
		HUNGARY 5.375 2023/02/21	60,000.00	66,144.00	
		HUNGARY 5.375 2024/03/25	70,000.00	80,133.90	
		HUNGARY 5.75 2023/11/22	90,000.00	103,080.60	

HUNGARY 7.625 2041/03/29	50,000.00	89,732.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA 3.875 2027/04/25	200,000.00	220,300.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 4 2024/02/26	200,000.00	214,752.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 5 2045/06/15	200,000.00	245,500.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 6.125 2041/01/18	100,000.00	134,500.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 7.375 2037/09/18	200,000.00	291,752.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA 8.125 2024/05/21	30,000.00	36,450.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 3.5 2028/01/11	200,000.00	223,428.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 4.35 2048/01/11	200,000.00	241,286.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 4.75 2026/01/08	200,000.00	233,570.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 5.125 2045/01/15	200,000.00	259,830.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 5.25 2047/01/08	250,000.00	335,042.50	
REPUBLIC OF INDONESIA 5.875 2024/01/15	200,000.00	230,022.00	
REPUBLIC OF INDONESIA 7.75 2038/01/17	100,000.00	158,039.00	
REPUBLIC OF PANAMA 3.875 2028/03/17	200,000.00	228,002.00	
REPUBLIC OF PANAMA 4.5 2056/04/01	200,000.00	255,400.00	
REPUBLIC OF PANAMA 6.7 2036/01/26	100,000.00	147,626.00	
REPUBLIC OF PERU 4.125 2027/08/25	110,000.00	128,701.10	
REPUBLIC OF PERU 5.625 2050/11/18	110,000.00	176,275.00	
REPUBLIC OF PERU 6.55 2037/03/14	40,000.00	60,900.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 3 2028/02/01	200,000.00	220,752.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 3.7 2042/02/02	200,000.00	233,862.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 6.375 2032/01/15	100,000.00	142,414.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 6.375 2034/10/23	100,000.00	146,635.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 7.75 2031/01/14	100,000.00	153,253.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES 9.5 2030/02/02	70,000.00	115,000.90	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.3 2028/10/12	200,000.00	200,244.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5.65 2047/09/27	200,000.00	191,488.00	

REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5.875 2025/09/16	200,000.00	222,500.00	
ROMANIA 4.375 2023/08/22	50,000.00	54,499.00	
ROMANIA 4.875 2024/01/22	30,000.00	33,411.00	
ROMANIA 5.125 2048/06/15	50,000.00	64,591.00	
ROMANIA 6.125 2044/01/22	30,000.00	42,450.00	
ROMANIA 6.75 2022/02/07	70,000.00	75,019.00	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 2027/06/23	200,000.00	227,268.00	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 2026/05/27	200,000.00	230,862.00	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 2023/09/16	200,000.00	219,844.00	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 2035/03/28	200,000.00	252,564.00	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 2047/06/23	400,000.00	544,724.00	
RUSSIAN FEDERATION 7.5 2030/03/31	76,500.00	88,759.12	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 2030/04/16	200,000.00	211,702.00	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 2025/01/30	200,000.00	218,392.00	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 2028/01/11	200,000.00	220,702.00	
UNITED MEXICAN STATES 4 2023/10/02	100,000.00	108,650.00	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 2027/03/28	200,000.00	226,702.00	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 2046/01/23	200,000.00	228,000.00	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 2048/02/10	200,000.00	226,500.00	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 2044/03/08	200,000.00	231,000.00	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 2045/01/21	100,000.00	127,651.00	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 2110/10/12	120,000.00	150,151.20	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 2040/01/11	100,000.00	131,376.00	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 2034/09/27	100,000.00	138,751.00	
アメリカ・ドル 小計	9,446,500.00	11,403,235.02 (1,184,568,054)	
国債証券 合計		1,184,568,054 (1,184,568,054)	
合計		1,184,568,054 (1,184,568,054)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 63銘柄	98.16%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

中間財務諸表

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年11月21日から2021年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,084	6,320
コール・ローン	237,606	261,473
親投資信託受益証券	292,327,222	353,228,181
未収入金	9,114,208	141,829
流動資産合計	301,680,120	353,637,803
資産合計	301,680,120	353,637,803
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,104,171	130,043
未払受託者報酬	31,247	35,140
未払委託者報酬	217,422	244,480
その他未払費用	1,461	1,662
流動負債合計	9,354,301	411,325
負債合計	9,354,301	411,325
純資産の部		
元本等		
元本	258,320,717	278,197,060
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	34,005,102	75,029,418
(分配準備積立金)	18,952,743	16,880,909
元本等合計	292,325,819	353,226,478
純資産合計	292,325,819	353,226,478
負債純資産合計	301,680,120	353,637,803

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日	第4期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	26,249,556	36,743,704
営業収益合計	26,249,556	36,743,704
営業費用		
受託者報酬	27,617	35,140
委託者報酬	192,184	244,480
その他費用	1,303	1,662
営業費用合計	221,104	281,282
営業利益又は営業損失（ ）	26,470,660	36,462,422
経常利益又は経常損失（ ）	26,470,660	36,462,422
中間純利益又は中間純損失（ ）	26,470,660	36,462,422
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,985,758	1,921,172
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	26,698,148	34,005,102
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,192,636	10,599,549
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,192,636	10,599,549
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,339,740	4,116,483
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,339,740	4,116,483
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,066,142	75,029,418

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2020年11月21日	至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2020年11月20日現在	2021年5月20日現在
1. 期首元本額	213,601,862円	258,320,717円
期中追加設定元本額	139,113,792円	50,497,260円
期中一部解約元本額	94,394,937円	30,620,917円
2. 受益権の総数	258,320,717口	278,197,060口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1316円 (11,316円)	1,2697円 (12,697円)

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託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。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	105,544,603
コール・ローン	4,366,684,331
株式	139,341,986,150
派生商品評価勘定	15,410,600
未収配当金	1,395,171,000
前払金	123,890,000
差入委託証拠金	254,790,000
流動資産合計	145,603,476,684
資産合計	145,603,476,684
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	123,074,500
未払解約金	258,864,140
その他未払費用	8,193
流動負債合計	381,946,833
負債合計	381,946,833
純資産の部	
元本等	
元本	68,907,940,433
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	76,313,589,418
元本等合計	145,221,529,851
純資産合計	145,221,529,851
負債純資産合計	145,603,476,684

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
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、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、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	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,797,703,529円
同期中追加設定元本額	10,809,785,490円
同期中一部解約元本額	22,699,548,586円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,850,286,823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)	3,794,576,317円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,725,959円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,897,221,475円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,408,177,450円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	4,557,064,539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)	5,519,631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)	21,918,421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)	27,772,927円
DCニッセイ国内株式インデックス	592,067,295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	18,411,879,747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)	1,425,203,297円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	178,616,676円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	161,785,055円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	176,299,369円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	373,257,849円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	62,191,481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)	65,307,596円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,827,373円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	7,832,608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)	2,260,490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)	5,270,052円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	21,047,678円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	75,993,270円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	46,509,732円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	133,076,219円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	156,385,424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)	24,424,679,241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)	14,985,903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)	65,065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)	135,471円
計	68,907,940,433円
2. 受益権の総数	68,907,940,433口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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）は短時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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年5月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	5,753,110,000	-	5,645,610,000	107,500,000
合計	5,753,110,000	-	5,645,610,000	107,500,000

（注）株価指数先物取引

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	2.1075円
（1万口当たり純資産額）	（21,075円）

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	16,766,134
コール・ローン	693,663,277
国債証券	59,084,089,410
地方債証券	5,392,540,627
特殊債券	7,328,992,898
社債券	4,178,443,700
未収利息	170,875,465
前払費用	13,670,581
流動資産合計	76,879,042,092
資産合計	
76,879,042,092	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	21,430,373
その他未払費用	1,273
流動負債合計	21,431,646
負債合計	
21,431,646	
純資産の部	
元本等	
元本	78,242,459,349
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,384,848,903
元本等合計	76,857,610,446
純資産合計	76,857,610,446
負債純資産合計	76,879,042,092

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として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。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	81,027,549,554円
同期中追加設定元本額	6,325,225,416円
同期中一部解約元本額	9,110,315,621円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B (適格機関投資家限定)	68,261,378,005円
DCニッセイ日本債券インデックス	2,558,145,913円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	94,794,105円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	4,182,061,689円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	140,817,449円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	545,693,822円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,267,719,737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)	139,409,855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)	12,140,299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)	52,828,294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)	45,192,669円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	31,834,515円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	30,616,113円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	125,438,531円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	754,388,353円
計	78,242,459,349円
2. 受益権の総数	78,242,459,349口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,384,848,903円であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	0.9823円
(1万口当たり純資産額)	(9,823円)

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,208,500
コール・ローン	339,609,278
投資証券	31,041,505,250
未収配当金	230,767,167
流動資産合計	31,620,090,195
資産合計	31,620,090,195
負債の部	
流動負債	
未払解約金	119,100,472
その他未払費用	709
流動負債合計	119,101,181
負債合計	119,101,181
純資産の部	
元本等	
元本	16,463,441,951
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,037,547,063
元本等合計	31,500,989,014
純資産合計	31,500,989,014
負債純資産合計	31,620,090,195

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
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	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,261,892,310円
同期中追加設定元本額	4,669,188,083円
同期中一部解約元本額	4,467,638,442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）	1,388,465,135円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,296,658,868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	8,098,677,592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）	1,768,790,592円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,588,192,041円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,210,636,558円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）	71,663,712円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	8,647,253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）	2,496,314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）	5,817,582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）	23,228,808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）	54,345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）	113,151円
計	16,463,441,951円
2. 受益権の総数	16,463,441,951口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.9134円
(1万口当たり純資産額)	(19,134円)

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,617,354,235
金銭信託	96,452,773
コール・ローン	3,990,529,137
株式	371,823,893,621
投資証券	8,353,804,242
派生商品評価勘定	49,203,073
未収入金	100,709,167
未収配当金	410,052,494
差入委託証拠金	7,003,104,372
流動資産合計	393,445,103,114
資産合計	
393,445,103,114	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101,638,353
未払金	57,095,003
未払解約金	636,067,348
その他未払費用	10,898
流動負債合計	794,811,602
負債合計	
794,811,602	
純資産の部	
元本等	
元本	155,354,575,597
剰余金	
剰余金又は欠損金()	237,295,715,915
元本等合計	392,650,291,512
純資産合計	392,650,291,512
負債純資産合計	393,445,103,114

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、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で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	145,169,780,539円
同期中追加設定元本額	25,631,068,968円
同期中一部解約元本額	15,446,273,910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）	779,730,464円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,417,710,986円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,737,839,538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）	1,715,446,785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）	2,268,221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）	12,010,470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）	16,660,209円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	10,958,485,657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	109,462,750,904円
DCニッセイ外国株式インデックス	23,058,697,237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)	1,172,126,166円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	108,884,067円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	133,017,924円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	107,128,655円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	226,189,165円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	32,315,978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)	53,693,214円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,612,863円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	6,440,136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)	1,859,586円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	17,301,375円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	46,308,978円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	28,293,038円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	80,836,646円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	92,991,462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)	241,180,939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)	249,289,545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)	108,875,056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)	243,120,436円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適 格機関投資家限定)	237,509,897円
計	155,354,575,597円
2. 受益権の総数	155,354,575,597口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約等は、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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年5月20日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	4,749,219,991	-	4,746,401,960		2,818,031
イギリス・ポンド	3,287,518,514	-	3,282,497,880		5,020,634
ユーロ	499,585,813	-	499,389,020		196,793
	962,115,664	-	964,515,060		2,399,396
合計	4,749,219,991	-	4,746,401,960		2,818,031

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2021年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	12,573,394,576	-	12,523,777,330	49,617,246
合計	12,573,394,576	-	12,523,777,330	49,617,246

（注）株価指数先物取引

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5274円 (25,274円)

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	120,681,698
金銭信託	2,485,667
コール・ローン	102,839,185
国債証券	38,226,958,956
派生商品評価勘定	2,384
未収入金	225,532
未収利息	205,036,497
前払費用	17,846,475
流動資産合計	38,676,076,394
資産合計	
38,676,076,394	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	126,433
未払金	79,935,696
未払解約金	54,189,053
その他未払費用	261
流動負債合計	134,251,443
負債合計	
134,251,443	
純資産の部	
元本等	
元本	25,985,960,019
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,555,864,932
元本等合計	38,541,824,951
純資産合計	38,541,824,951
負債純資産合計	38,676,076,394

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
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、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、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、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	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	22,593,334,379円
同期中追加設定元本額	5,625,008,430円
同期中一部解約元本額	2,232,382,790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)	2,696,830,323円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,432,854,017円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,578,204,755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)	771,522,677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)	3,922,618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)	10,385,489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)	10,290,085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	11,230,375,100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)	2,026,586,146円
DCニッセイ外国債券インデックス	1,484,247,582円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	65,614,163円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,150,163,525円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	64,726,485円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	139,392,113円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	32,515,837円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	92,852,551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)	8,036,702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)	29,919,119円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	27,707,077円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	17,068,327円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	49,367,498円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	63,377,830円
計	25,985,960,019円
2. 受益権の総数	25,985,960,019口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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）は短時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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年5月20日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	65,341,063	-	65,217,014	124,049	
イギリス・ポンド	43,669,408	-	43,559,622	109,786	
オーストラリア・ドル	1,652,929	-	1,653,141	212	
ポーランド・ズロチ	3,686,244	-	3,672,973	13,271	
マレーシア・リングギット	1,594,085	-	1,592,844	1,241	
ユーロ	2,859,697	-	2,858,145	1,552	
ユーロ	11,878,700	-	11,880,289	1,589	
合計	65,341,063	-	65,217,014	124,049	

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.4832円
(1万口当たり純資産額)	(14,832円)

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,181,862
金銭信託	1,633,442
コール・ローン	67,580,196
投資証券	3,255,703,113
未収入金	1,864,979
未収配当金	5,435,913
流動資産合計	3,339,399,505
資産合計	
3,339,399,505	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,866,974
その他未払費用	121
流動負債合計	3,867,095
負債合計	
3,867,095	
純資産の部	
元本等	
元本	2,757,709,388
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	577,823,022
元本等合計	3,335,532,410
純資産合計	3,335,532,410
負債純資産合計	3,339,399,505

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
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。
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	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,505,757,114円
同期中追加設定元本額	452,140,300円
同期中一部解約元本額	200,188,026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）	1,806,153,900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）	112,718,935円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	13,519,886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）	3,903,276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）	36,319,080円
DCニッセイ先進国リートインデックス	785,094,311円
計	2,757,709,388円
2. 受益権の総数	2,757,709,388口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.2095円
（1万口当たり純資産額）	（12,095円）

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	35,726,976
金銭信託	6,924,151
コール・ローン	286,472,071
株式	2,779,581,425
投資信託受益証券	146,360,890
投資証券	2,120,800
派生商品評価勘定	904,720
未収入金	1,897,159
未収配当金	3,043,824
差入委託証拠金	126,113,382
流動資産合計	3,389,145,398
資産合計	
3,389,145,398	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,013,182
未払金	149,228
未払解約金	33,032,461
その他未払費用	601
流動負債合計	38,195,472
負債合計	
38,195,472	
純資産の部	
元本等	
元本	2,759,971,456
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	590,978,470
元本等合計	3,350,949,926
純資産合計	3,350,949,926
負債純資産合計	3,389,145,398

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、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で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,262,953,958円
同期中追加設定元本額	1,028,256,913円
同期中一部解約元本額	531,239,415円
元本の内訳	
ファンド名	
<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	2,246,883,242円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	11,597,716円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	13,281,570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）	3,835,183円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	35,654,637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）	173,740,405円
DCニッセイ新興国株式インデックス	274,978,703円
計	2,759,971,456円
2. 受益権の総数	2,759,971,456口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	28,881,647	-	28,834,080	47,567
アメリカ・ドル	28,881,647	-	28,834,080	47,567
買建	287,588,647	-	286,811,720	776,927
アメリカ・ドル	287,588,647	-	286,811,720	776,927
合計	316,470,294	-	315,645,800	729,360

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2021年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引				
買建	415,965,551	-	412,586,448	3,379,103
合計	415,965,551	-	412,586,448	3,379,103

（注）株価指数先物取引

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.2141円
（1万口当たり純資産額）	（12,141円）

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	10,255,336
金銭信託	80,485
コール・ローン	3,329,905
国債証券	1,201,736,641
未収入金	20,374
未収利息	13,098,538
前払費用	363,303
流動資産合計	1,228,884,582
資産合計	
1,228,884,582	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,970
未払解約金	78,532
その他未払費用	9
流動負債合計	88,511
負債合計	
88,511	
純資産の部	
元本等	
元本	1,025,145,824
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	203,650,247
元本等合計	1,228,796,071
純資産合計	
1,228,796,071	
負債純資産合計	
1,228,884,582	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
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、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、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、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	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,019,988,559円
同期中追加設定元本額	10,899,022円
同期中一部解約元本額	5,741,757円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	987,845,675円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	37,300,149円
計	1,025,145,824円
2. 受益権の総数	1,025,145,824口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年5月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	3,032,108	-	3,022,138	9,970
合計	3,032,108	-	3,022,138	9,970

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額	1,1987円
(1万口当たり純資産額)	(11,987円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年5月31日現在

資産総額	361,450,109円
負債総額	1,413,924円
純資産総額（ - ）	360,036,185円
発行済数量	278,810,081口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2913円

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	151,216,161,166円
負債総額	3,274,031,216円
純資産総額（ - ）	147,942,129,950円
発行済数量	69,202,671,260口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1378円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	78,832,684,157円
負債総額	1,868,918,310円
純資産総額（ - ）	76,963,765,847円
発行済数量	78,343,792,970口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9824円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	31,731,703,145円
負債総額	165,999,871円
純資産総額（ - ）	31,565,703,274円
発行済数量	16,408,472,182口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9237円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	408,728,746,456円
負債総額	886,327,120円
純資産総額（ - ）	407,842,419,336円
発行済数量	156,682,034,974口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6030円

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	40,339,800,943円
負債総額	941,374,683円
純資産総額(-)	39,398,426,260円
発行済数量	26,222,917,841口
1口当たり純資産額(/)	1.5024円

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	3,476,948,509円
負債総額	6,621,689円
純資産総額(-)	3,470,326,820円
発行済数量	2,779,021,929口
1口当たり純資産額(/)	1.2488円

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	3,918,271,272円
負債総額	424,556,245円
純資産総額(-)	3,493,715,027円
発行済数量	2,793,311,688口
1口当たり純資産額(/)	1.2507円

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	1,243,879,223円
負債総額	212,348円
純資産総額(-)	1,243,666,875円
発行済数量	1,025,134,886口
1口当たり純資産額(/)	1.2132円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(4) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

2021年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年5月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	409	69,356
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	136	26,390
単位型公社債投資信託	0	0
合計	545	95,747

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

3【委託会社等の経理状況】

1.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（自2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,674,230		40,822,894
有価証券		6,301,326		-
前払費用		546,666		718,688
未収委託者報酬		4,882,250		5,412,597
未収運用受託報酬		2,039,974		2,425,363
未収投資助言報酬		174,892		216,401
その他		50,572		38,899
流動資産合計		42,669,914		49,634,844
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	98,471	1	130,411
車両	1	2,180	1	1,454
器具備品	1	142,866	1	125,816
有形固定資産合計		243,517		257,681
無形固定資産				
ソフトウェア		969,528		1,225,315
ソフトウェア仮勘定		216,033		359,445
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,193,575		1,592,774
投資その他の資産				
投資有価証券		33,634,499		37,058,043
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		237,055
差入保証金		303,875		382,751
繰延税金資産		1,292,446		1,200,554
その他		17,821		15,154
投資その他の資産合計		35,314,867		38,959,781
固定資産合計		36,751,960		40,810,238
資産合計		79,421,875		90,445,083

負債の部

流動負債

預り金		45,856		47,039
未払収益分配金		5,643		5,643
未払手数料	2	1,633,415	2	1,911,775
未払運用委託報酬	2	810,981	2	1,871,193
未払投資助言報酬	2	852,782	2	1,147,828
その他未払金	2	3,591,122	2	4,839,326
未払費用	2	146,706	2	132,085
未払法人税等		686,983		1,042,946
未払消費税等		527,890		904,947
賞与引当金		975,373		1,123,336
その他		16,476		82,891
流動負債合計		9,293,232		13,109,013

固定負債

退職給付引当金		1,950,746		2,155,971
役員退職慰労引当金		22,700		27,450
固定負債合計		1,973,446		2,183,421

負債合計

		11,266,679		15,292,435
--	--	------------	--	------------

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		48,745,315		55,045,550
利益剰余金合計		49,425,122		55,725,357
株主資本合計		67,706,962		74,007,197

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		512,183		1,242,655
繰延ヘッジ損益		63,949		97,204
評価・換算差額等合計		448,234		1,145,450

純資産合計

		68,155,196		75,152,647
--	--	------------	--	------------

負債・純資産合計

		79,421,875		90,445,083
--	--	------------	--	------------

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	27,088,982	26,838,624
運用受託報酬	13,165,624	18,630,497
投資助言報酬	677,248	878,199
その他営業収益	2,000	-
営業収益計	40,933,856	46,347,320
営業費用		
支払手数料	11,090,478	10,412,572
広告宣伝費	25,032	17,988
調査費	6,466,222	8,251,721
支払運用委託報酬	1,866,932	2,916,886
支払投資助言報酬	3,238,306	3,866,188
委託調査費	125,262	129,355
調査費	1,235,721	1,339,290
委託計算費	249,653	256,942
営業雑経費	929,200	760,920
通信費	47,749	64,179
印刷費	189,820	176,812
協会費	38,958	40,454
その他営業雑経費	652,672	479,472
営業費用計	18,760,587	19,700,144
一般管理費		
役員報酬	142,108	126,093
給料・手当	3,934,995	4,103,410
賞与引当金繰入額	974,031	1,120,241
賞与	285,503	280,494
福利厚生費	762,163	797,392
退職給付費用	307,637	359,252
役員退職慰労引当金繰入額	7,000	7,150
役員退職慰労金	30	-
その他人件費	172,763	166,126
不動産賃借料	682,105	716,925
その他不動産経費	31,283	32,816
交際費	28,014	6,766
旅費交通費	170,993	8,778
固定資産減価償却費	442,697	477,830
租税公課	341,195	395,649
業務委託費	291,579	315,850
器具備品費	354,221	357,066
保険料	46,549	45,818
寄付金	-	30,000
諸経費	225,408	226,790
一般管理費計	9,200,283	9,574,455
営業利益	12,972,984	17,072,720
営業外収益		
受取利息	1,176	289
有価証券利息	12,651	4,705
受取配当金	1 200,028	1 74,260

金融派生商品収益		14,042		40,753
その他営業外収益		13,606		14,644
営業外収益計		241,504		134,653
営業外費用				
為替差損		27,288		32,651
金融派生商品費用		9,593		24,611
控除対象外消費税		5,453		3,018
その他営業外費用		8,493		4,203
営業外費用計		50,829		64,485
経常利益		13,163,659		17,142,888
特別利益				
投資有価証券売却益		4,459		3,376
投資有価証券償還益		1,744		20,904
特別利益計		6,204		24,280
特別損失				
投資有価証券売却損		72,045		49,202
投資有価証券償還損		4,115		105,236
固定資産除却損	2	8,422	2	870
事故損失賠償金	3	4,351	3	12,614
特別損失計		88,934		167,924
税引前当期純利益		13,080,929		16,999,244
法人税、住民税及び事業税		4,134,957		5,395,622
法人税等調整額		106,970		196,661
法人税等合計		4,027,986		5,198,960
当期純利益		9,052,942		11,800,283

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962
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	-	-	-	-	-	-	-	11,800,283	11,800,283	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	6,300,235	6,300,235	6,300,235
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
当期純利益	-	-	-	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	730,471	33,255	697,216	697,216
当期変動額合計	730,471	33,255	697,216	6,997,451
当期末残高	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8. 連結納税	日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(2020年3月31日 企業会計基準委員会 実務対応報告第39号)に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

(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 2021年3月26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

財務諸表に与える影響はありません。

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物附属設備	310,385千円	318,792千円
車両	4,549	5,275
器具備品	394,258	447,285
計	709,193	771,352

2. 当事業年度において、関係会社に対する負債として、未払手数料、未払運用委託報酬、未払投資助言報酬、その他未払金、未払費用に含まれるものの合計額は、負債及び純資産の合計額の100分の5を超えており、その金額は4,960,571千円であります。前事業年度の関係会社に対する負債は、その金額が負債及び純資産の合計額の100分の5以下であるため、記載を省略しております。

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
受取配当金	70,499千円	9,823千円

2. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
建物附属設備	4,181千円	- 千円
器具備品	4,240	870
計	8,422	870

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	50,716円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2020年6月29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	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月29日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年6月30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	9,440,289千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	87,049円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30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・地方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(2020年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	28,674,230	28,674,230	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	-
資産計	68,610,058	68,615,802	5,744
その他未払金	3,591,122	3,591,122	-
負債計	3,591,122	3,591,122	-
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	-
デリバティブ取引計	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。

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	40,822,894	40,822,894	-
有価証券			
満期保有目的の債券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	15,018,123	15,023,675	5,551
其他有価証券	22,039,919	22,039,919	-
資産計	77,880,937	77,886,489	5,551
其他未払金	4,839,326	4,839,326	-
負債計	4,839,326	4,839,326	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	65,238	65,238	-
デリバティブ取引計	65,238	65,238	-

() 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

資 産

現金・預金

預金はすべて短期であるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

負 債

其他未払金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021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(2020年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2021年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	40,822,894	-	-	-
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	-	15,020,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	2,802,653	17,140,145	2,093,118	-
合計	43,625,547	32,160,145	2,093,118	-

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(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

当事業年度(2021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	12,218,123	12,224,015	5,891
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,218,123	12,224,015	5,891
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	2,800,000	2,799,660	340
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,800,000	2,799,660	340
合計		15,018,123	15,023,675	5,551

2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	14,512,369	12,884,500	1,627,869
	小計	14,512,369	12,884,500	1,627,869
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	7,527,550	7,711,000	183,449
	小計	7,527,550	7,711,000	183,449
	合計	22,039,919	20,595,500	1,444,419

(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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021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	3,737,763	3,376	49,202
合計	3,737,763	3,376	49,202

(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（2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2021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（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。

当事業年度（2021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	1,239,952	-	65,238
合計			1,239,952	-	65,238

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(注2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制適用者及び年俸制非適用者を制度の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。

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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	- 千円	1,833,391 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	-
勤務費用	-	247,178
利息費用	-	5,766
数理計算上の差異の発生額	-	28,155
退職給付の支払額	-	65,497
その他	-	936
退職給付債務の期末残高	1,833,391	2,049,929

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,801,748 千円	117,355 千円
退職給付費用	274,595	19,053
退職給付の支払額	71,495	1,275
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	1,887,492	-
その他	-	936
退職給付引当金の期末残高	117,355	134,197

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,950,746 千円	2,184,126 千円
未認識数理計算上の差異	-	28,155
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,950,746	2,155,971
退職給付引当金	1,950,746	2,155,971
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,950,746	2,155,971

(4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	274,595 千円	19,053 千円
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	54,100	-
勤務費用	-	247,178
利息費用	-	5,766
確定給付制度に係る退職給付費用	220,494	271,997

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
割引率	0.32 %	0.28 %

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62,535千円、当事業年度において64,693千円であり、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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	298,659 千円	343,965 千円
未払事業税	130,502	216,469
退職給付引当金	597,318	660,158
税務上の繰延資産償却超過額	4,337	2,848
役員退職慰労引当金	6,950	8,405
投資有価証券評価差額	254,174	156,971
その他	82,112	96,541
小計	1,374,055	1,485,360
評価性引当額	19	10
繰延税金資産合計	1,374,036	1,485,350
繰延税金負債		
特別分配金否認	3,682	4,093
投資有価証券評価差額	77,906	280,701
繰延税金負債合計	81,589	284,795
繰延税金資産(は負債)の純額	1,292,446	1,200,554

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。

当事業年度（自2020年4月1日 至2021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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021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	3,562,864	未収運用受託報酬	988,094
								投資助言報酬の受取	128,262	未収投資助言報酬	11,387
								連結納税	4,351,846	その他未払金	4,351,846

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	628,459円68銭	692,983円25銭
1株当たり当期純利益金額	83,477円26銭	108,810円52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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,052,942千円	11,800,283千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,052,942千円	11,800,283千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2021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

2021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：2021年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
エイチ・エス証券株式会社	3,000	
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
楽天証券株式会社	7,495	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
PayPay銀行株式会社	37,250	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。

(3) 投資助言会社(参考情報)

a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

b. 資本金の額

2021年3月末現在、450百万円

c. 事業の内容

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

(3) 投資助言会社(参考情報)

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

3【資本関係】

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

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

第3【その他】

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

2021年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
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

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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2020年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 公認会計士 百瀬和政印
業務執行社員

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〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2019年11月21日から2020年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、〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2020年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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年6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 公認会計士 百瀬和政 印
業務執行社員

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、「ファンドの経理状況」に掲げられている〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2020年11月21日から2021年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2021年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月21日から2021年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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、継続企業的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。

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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

利害関係

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

以 上

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