# 【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】 | ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券） |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 | 継続募集額　上限１兆円 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

# 第一部【証券情報】

## （1）【ファンドの名称】

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

## （2）【内国投資信託受益証券の形態等】

① 契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

② 委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

## （3）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

## （4）【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

## （5）【申込手数料】

ありません。

## （6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。
申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。
なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

## （7）【申込期間】

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

**（１０）【払込取扱場所】**

**払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。**

**ニッセイアセットマネジメント株式会社**

**コールセンター　０１２０-７６２-５０６**

**（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）**

**ホームページ　　https://www.nam.co.jp/**

**（１１）【振替機関に関する事項】**

**振替機関は下記の通りです。**

**株式会社証券保管振替機構**

**（１２）【その他】**

**該当事項はありません。**

# 第二部【ファンド情報】

# 第１【ファンドの状況】

## １【ファンドの性格】

### （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

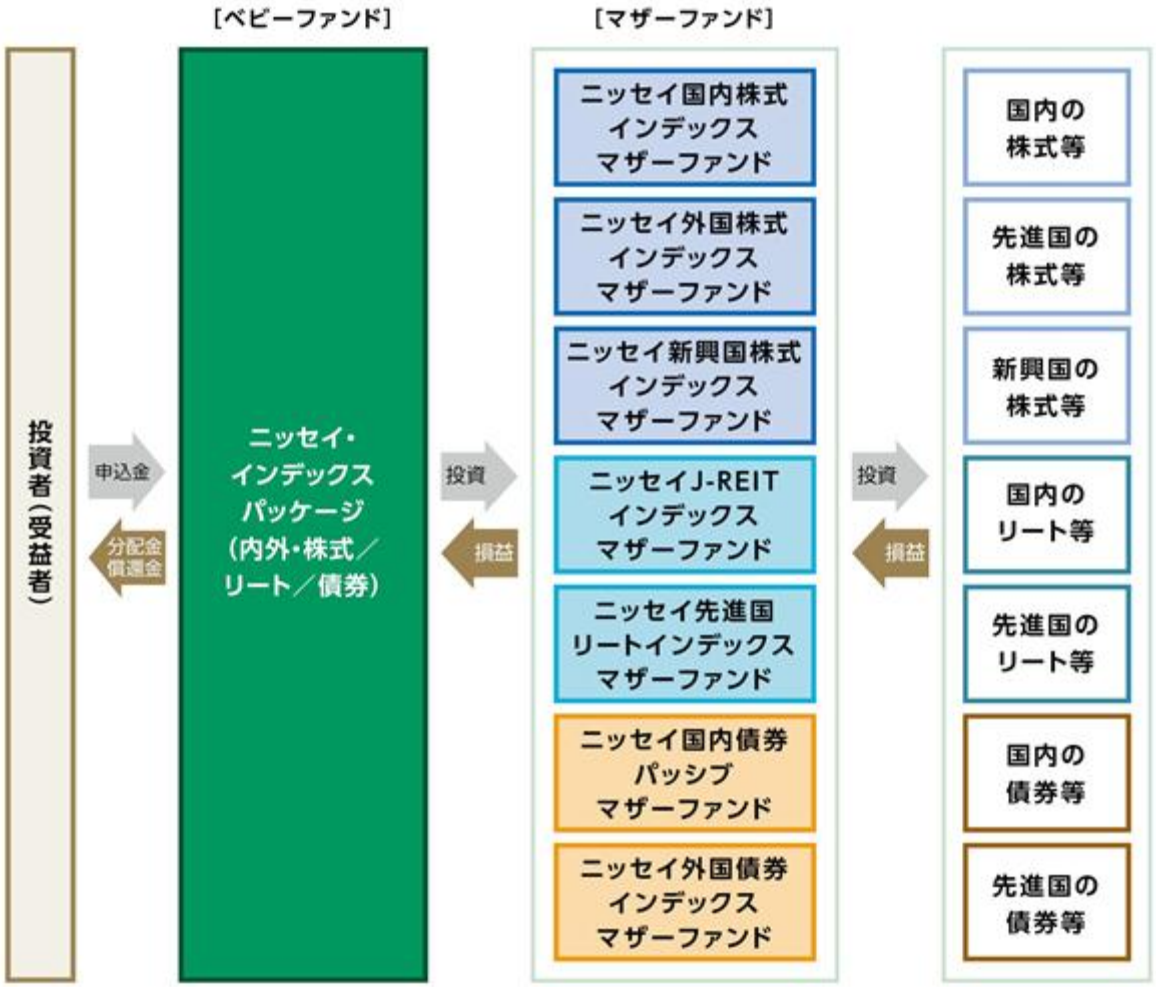
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



## ③　ファンドの特色

### 1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

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

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

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

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

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

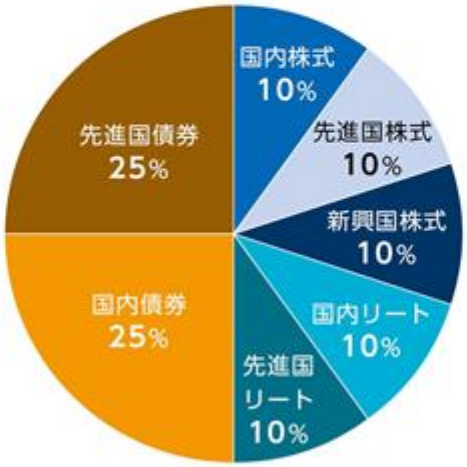
〈各マザーファンドの運用プロセス〉

## 2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

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

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

【基本投資割合】




〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

〈各指数について〉

●TOPIX（東証株価指数）

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

●MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●東証REIT指数

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

●S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

●NOMURA−BPI総合

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

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

**＜ＭＳＣＩ指数にかかる免責条項等＞**

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

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

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

**資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。**

**④　信託金の上限**

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

**⑤　ファンドの分類**

**追加型投信／内外／資産複合／インデックス型に属します。**

**○　課税上は株式投資信託として取扱われます。**

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

**商品分類表**

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

**属性区分表**

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

**商品分類表**

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

**属性区分表**

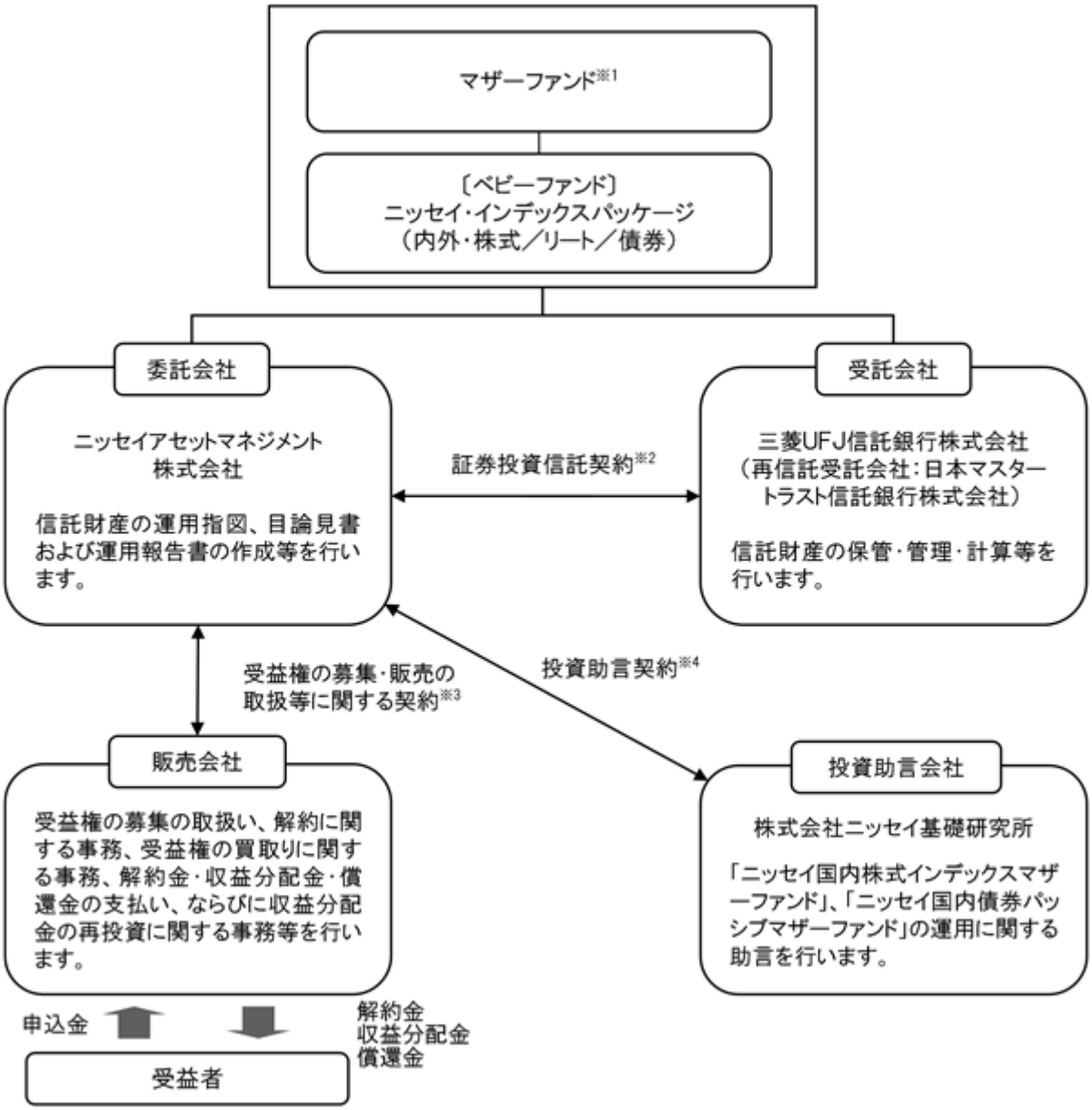
| | |
|---|---|
| その他資産<br>（投資信託証券<br>（資産複合（株式・<br>不動産投信・債券）<br>資産配分固定型）） | 目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。<br>目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。<br>目論見書または約款において、主として株式、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。 |
| 年１回 | 目論見書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

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

**（２）【ファンドの沿革】**

2017年11月17日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

**（３）【ファンドの仕組み】**




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

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

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

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

委託会社の概況（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】

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

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

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

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

④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

**（参考）マザーファンドの概要**

**ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド**

**（１）基本方針**

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

**（２）運用方法**

**ａ　投資対象**

**国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。**

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

**ｂ　投資態度**

**①　国内の証券取引所上場株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。**

**②　株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。**

**③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。**

**④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。**

**（３）投資制限**

**①　株式への投資割合には、制限を設けません。**

**②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。**

**③　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。**

**④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。**

**⑤　同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。**

**⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。**

**⑦　外貨建資産への投資は行いません。**

**⑧　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。**

**⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。**

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

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

**（１）基本方針**

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

**（２）運用方法**

**ａ　投資対象**

**日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。**

**ｂ　投資態度**

**①　主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。**

**②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。**

**③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。**

**④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。**

**（３）投資制限**

**①　株式への投資割合には、制限を設けません。**

**②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。**

**③　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。**

**④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。**

**⑤　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。**

**⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。**

**⑦　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。**

**⑧　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。**

**⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。**

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

**（1）基本方針**

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

**（2）運用方法**

**a　投資対象**

新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます）を主要投資対象とします。

**b　投資態度**

① 主として新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます）に投資することにより、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
② 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
③ 株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。
④ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

**（3）投資制限**

① 株式への投資割合には、制限を設けません。
② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
③ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
⑦ デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
⑧ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
⑨ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

**（１）基本方針**

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

**（２）運用方法**

**ａ　投資対象**

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

**ｂ　投資態度**

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

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

③　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

**（３）投資制限**

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　デリバティブの直接利用は行いません。

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

## ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

**（1）基本方針**

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

**（2）運用方法**

**ａ　投資対象**

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

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

**ｂ　投資態度**

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

②　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

**（3）投資制限**

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

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

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

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

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

**（1）基本方針**

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

**（2）運用方法**

**ａ　投資対象**

国内の公社債を主要投資対象とします。

**ｂ　投資態度**

①　国内の公社債に投資し、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

③　組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

**（3）投資制限**

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

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

⑥　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

**（1）基本方針**

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

**（2）運用方法**

**a　投資対象**

**日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。**

**b　投資態度**

**①　主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。**

**②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。**

**③　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。**

**④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。**

**（3）投資制限**

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

**②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以内とします。**

**③　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。**

**④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。**

**⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。**

**⑥　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。**

**⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。**

**⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

**（２）【投資対象】**

**ａ　主な投資対象**

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

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

**ｂ　約款に定める投資対象**

**①　投資の対象とする資産の種類**

**このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。**

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

**イ．有価証券**

**ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限　ｂ　約款に定めるその他の投資制限　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）**

**ハ．約束手形**

**ニ．金銭債権**

**２．次に掲げる特定資産以外の資産**

**イ．為替手形**

**②　有価証券**

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

**１．株券または新株引受権証書**

**２．国債証券**

**３．地方債証券**

**４．特別の法律により法人の発行する債券**

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

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

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

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

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

**10．コマーシャル・ペーパー**

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

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

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

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

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

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

**17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）**

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

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

③　金融商品

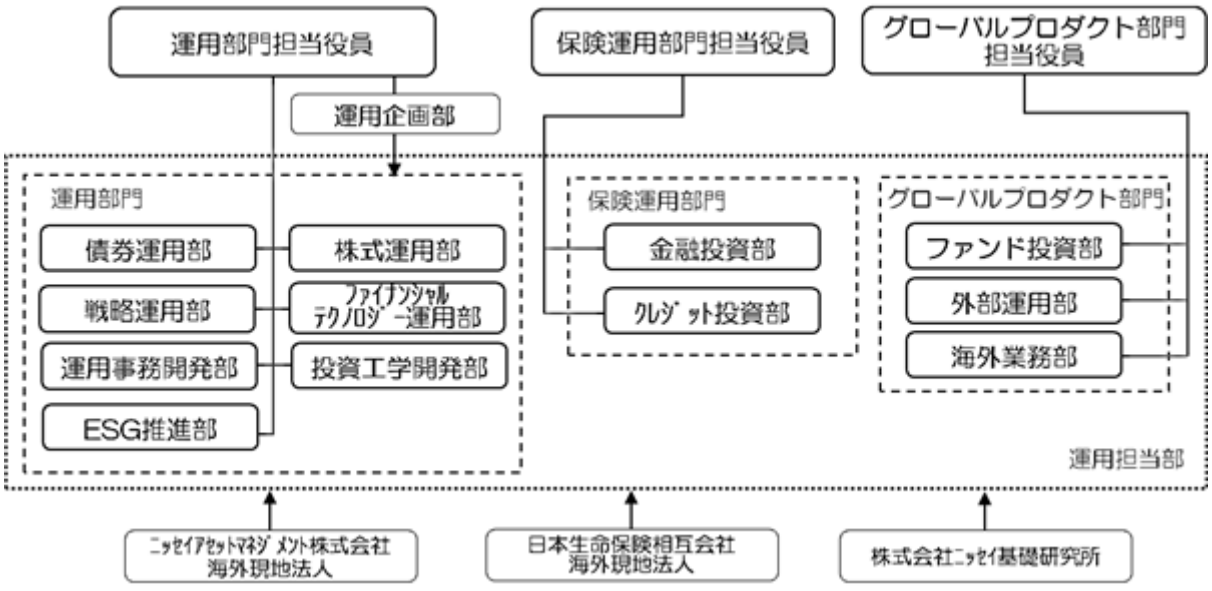
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

④　前記②にかかわらず、このファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記③に掲げる金融商品により運用することができます。

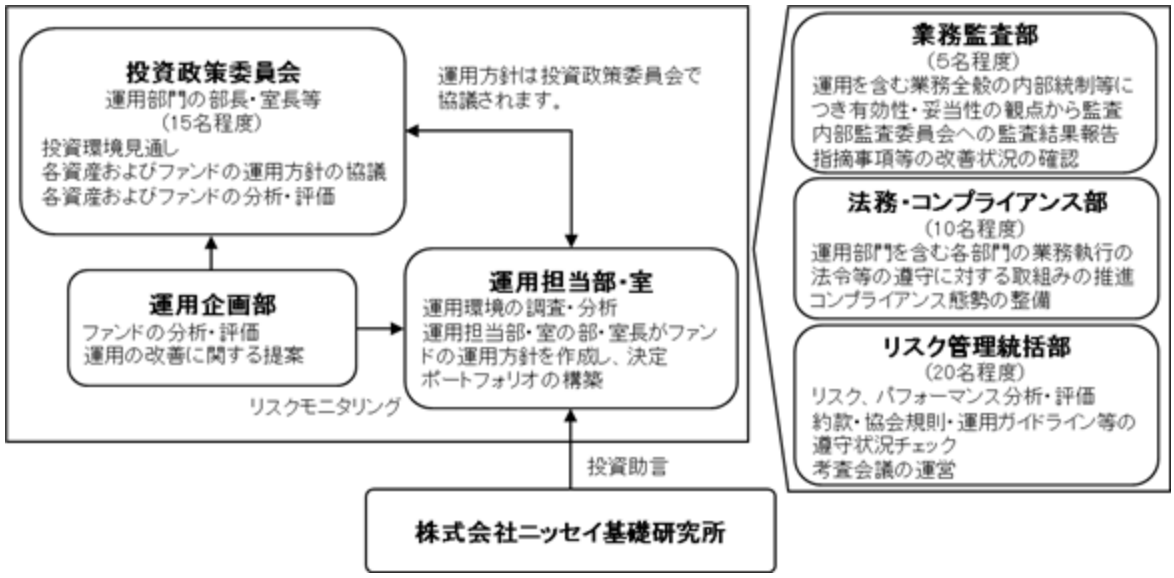
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制




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

**内部管理体制および意思決定を監督する組織**




**＜受託会社に対する管理体制等＞**

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

**○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。**

**（４）【分配方針】**

**①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。**

**１．分配対象額の範囲**

**経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。**

**２．分配対象額についての分配方針**

**委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。**

**３．留保益の運用方針**

**留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。**

**②　分配時期**

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

**③　支払方法**

**＜分配金受取コースの場合＞**

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

**＜分配金再投資コースの場合＞**

**税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。**

**○　将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。**

**（５）【投資制限】**

**ａ　約款に定める主な投資制限**

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

**②　同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。**

**③　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。**

**④　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。**

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

**⑥　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。**

**⑦　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。**

**⑧　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。**

**⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

**ｂ　約款に定めるその他の投資制限**

**①　投資する株式等の範囲**

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

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

**②　信用取引の範囲**

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

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

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

**③　先物取引等**

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

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

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

**④　スワップ取引**

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

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

**３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。**

**４．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。**

**５．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。**

**６．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。**

**⑤　金利先渡取引および為替先渡取引**

**１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。**

**２．金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。**

**３．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。**

**４．金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。**

**⑥　有価証券の貸付けおよび範囲**

**１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。**

**ⅰ．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。**

**ⅱ．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。**

**２．前記１．に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。**

**３．有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れを行うものとします。**

**⑦　有価証券の空売り**

**１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。**

**２．前記１．の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。**

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

**⑧　有価証券の借入れ**

**１．信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供を行うものとします。**

**２．前記１．は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。**

**３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。**

**４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。**

**⑨　外国為替予約等**

**１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。**

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

**３．前記２．の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。**

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

**５．外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。**

**⑩　資金の借入れ**

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

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

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

**４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。**

**c　法令に定める投資制限**

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

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

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

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

**③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）**

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

## 3【投資リスク】

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

### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

Ｊ－ＲＥＩＴの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

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

・流動性リスク

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

・新興国の株式投資に関する留意点

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

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

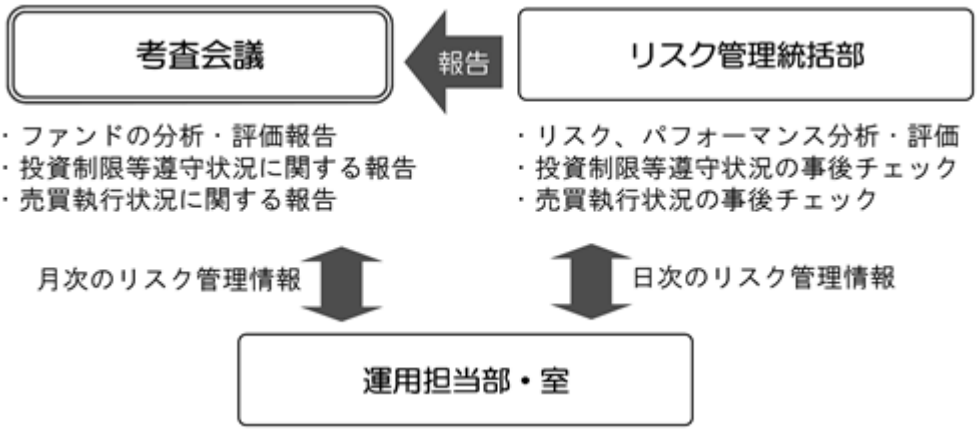
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

**・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点**

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

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

## （2）投資リスク管理体制




**1．リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。**

**・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。**

**・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。**

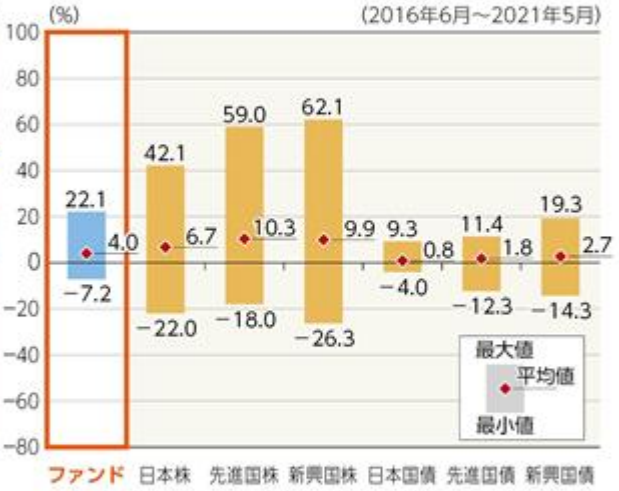
**2．運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。**

**○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。**

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

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較




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

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

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

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

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

# 4【手数料等及び税金】

## （1）【申込手数料】

ありません。

## （2）【換金（解約）手数料】

ありません。

## （3）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.3564%（税抜0.324%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

| 信託報酬の配分（年率・税抜） | | |
|---|---|---|
| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
| 0.150% | 0.150% | 0.024% |

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

## （4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

| 純資産総額 | | | 監査報酬率 | |
|---|---|---|---|---|
| 100億円超 | | の部分 | 年 0.0044% | （税抜0.004%） |
| 50億円超 | 100億円以下 | の部分 | 年 0.0055% | （税抜0.005%） |
| 10億円超 | 50億円以下 | の部分 | 年 0.0077% | （税抜0.007%） |
| | 10億円以下 | の部分 | 年 0.0110% | （税抜0.010%） |

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

○ 上記の①、③および④の費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「４　手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

**＜ご参考＞**

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

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

**（５）【課税上の取扱い】**

**課税対象**

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

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

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

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

**個人の課税の取扱い**

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

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

**税率（個人）**

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

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

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

**＜少額投資非課税制度について＞**

**公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。**

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

**法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）**

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

**益金不算入制度の適用はありません。**

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

**税率（法人）**

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

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

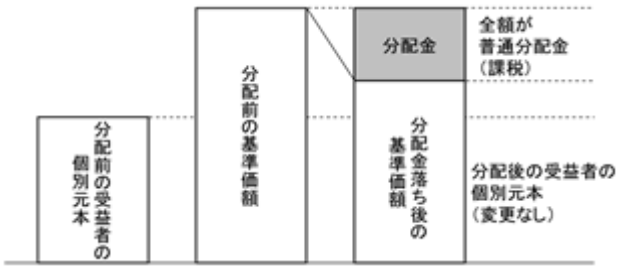
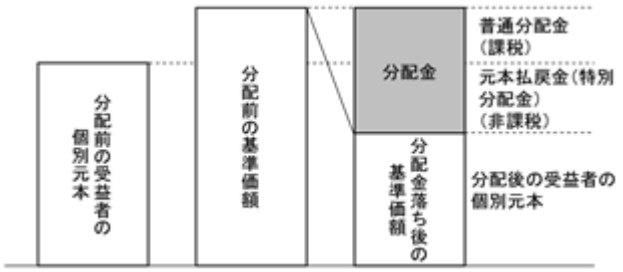
**個別元本**

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

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

**普通分配金と元本払戻金（特別分配金）**

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

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

**○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。**

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

# 5【運用状況】

## （1）【投資状況】

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 | | 48,476,066 | 100.00 |
| | 内　日本 | 48,476,066 | 100.00 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | △1,461 | △0.00 |
| 純資産総額 | | 48,474,605 | 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　ジャージィー | 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　ガーンジィ | 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。

## （２）【投資資産】

### ①【投資有価証券の主要銘柄】

2021年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>国/地域 | 種類 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 8,091,426 | 1.4566<br>11,786,055 | 1.5024<br>12,156,558 | －<br>－ | 25.08 |
| 2 | ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 12,223,280 | 0.9839<br>12,026,719 | 0.9824<br>12,008,150 | －<br>－ | 24.77 |
| 3 | ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 3,929,865 | 1.0377<br>4,078,364 | 1.2488<br>4,907,615 | －<br>－ | 10.12 |
| 4 | ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 1,872,283 | 2.1761<br>4,074,407 | 2.6030<br>4,873,552 | －<br>－ | 10.05 |
| 5 | ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 2,275,798 | 1.9687<br>4,480,451 | 2.1378<br>4,865,200 | －<br>－ | 10.04 |
| 6 | ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 2,513,342 | 1.6142<br>4,057,046 | 1.9237<br>4,834,916 | －<br>－ | 9.97 |
| 7 | ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 3,861,898 | 1.0948<br>4,228,277 | 1.2507<br>4,830,075 | －<br>－ | 9.96 |

（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<br>国/地域 | 種類<br>業種 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | トヨタ自動車<br>日本 | 株式<br>輸送用機器 | 552,800 | 8,082.53<br>4,468,022,900 | 9,115.00<br>5,038,772,000 | －<br>－ | 3.41 |
| 2 | ソニーグループ<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 341,800 | 11,959.46<br>4,087,745,200 | 10,785.00<br>3,686,313,000 | －<br>－ | 2.49 |
| 3 | ソフトバンクグループ<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 424,800 | 10,484.37<br>4,453,763,200 | 8,256.00<br>3,507,148,800 | －<br>－ | 2.37 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 4 | キーエンス<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 53,600 | 56,670.98<br>3,037,565,000 | 53,870.00<br>2,887,432,000 | －<br>－ | 1.95 |
| 5 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ<br>日本 | 株式<br>銀行業 | 3,681,400 | 564.75<br>2,079,095,860 | 620.00<br>2,282,468,000 | －<br>－ | 1.54 |
| 6 | 任天堂<br>日本 | 株式<br>その他製品 | 31,200 | 67,992.44<br>2,121,364,200 | 67,700.00<br>2,112,240,000 | －<br>－ | 1.43 |
| 7 | リクルートホールディングス<br>日本 | 株式<br>サービス業 | 373,500 | 5,475.33<br>2,045,039,300 | 5,555.00<br>2,074,792,500 | －<br>－ | 1.40 |
| 8 | 信越化学工業<br>日本 | 株式<br>化学 | 98,800 | 18,747.03<br>1,852,207,100 | 18,855.00<br>1,862,874,000 | －<br>－ | 1.26 |
| 9 | 日本電信電話<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 626,200 | 2,821.51<br>1,766,830,350 | 2,931.50<br>1,835,705,300 | －<br>－ | 1.24 |
| 10 | 武田薬品工業<br>日本 | 株式<br>医薬品 | 454,000 | 3,688.03<br>1,674,367,400 | 3,719.00<br>1,688,426,000 | －<br>－ | 1.14 |
| 11 | 日本電産<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 131,300 | 14,603.05<br>1,917,381,600 | 12,530.00<br>1,645,189,000 | －<br>－ | 1.11 |
| 12 | ＫＤＤＩ<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 429,400 | 3,397.54<br>1,458,907,100 | 3,717.00<br>1,596,079,800 | －<br>－ | 1.08 |
| 13 | 東京エレクトロン<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 32,000 | 46,363.15<br>1,483,621,100 | 48,660.00<br>1,557,120,000 | －<br>－ | 1.05 |
| 14 | ＨＯＹＡ<br>日本 | 株式<br>精密機器 | 107,400 | 13,088.33<br>1,405,686,900 | 14,350.00<br>1,541,190,000 | －<br>－ | 1.04 |
| 15 | 日立製作所<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 262,300 | 4,952.06<br>1,298,927,200 | 5,736.00<br>1,504,552,800 | －<br>－ | 1.02 |
| 16 | ダイキン工業<br>日本 | 株式<br>機械 | 69,500 | 22,104.76<br>1,536,281,300 | 21,605.00<br>1,501,547,500 | －<br>－ | 1.01 |
| 17 | 三井住友フィナンシャルグループ<br>日本 | 株式<br>銀行業 | 372,400 | 3,768.60<br>1,403,429,200 | 3,951.00<br>1,471,352,400 | －<br>－ | 0.99 |
| 18 | 本田技研工業<br>日本 | 株式<br>輸送用機器 | 429,600 | 2,988.93<br>1,284,044,700 | 3,353.00<br>1,440,448,800 | －<br>－ | 0.97 |
| 19 | 村田製作所<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 160,300 | 9,846.57<br>1,578,406,400 | 8,279.00<br>1,327,123,700 | －<br>－ | 0.90 |
| 20 | ファナック<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 47,900 | 27,551.26<br>1,319,705,500 | 26,300.00<br>1,259,770,000 | －<br>－ | 0.85 |
| 21 | みずほフィナンシャルグループ<br>日本 | 株式<br>銀行業 | 731,300 | 1,590.56<br>1,163,178,150 | 1,673.00<br>1,223,464,900 | －<br>－ | 0.83 |
| 22 | 伊藤忠商事<br>日本 | 株式<br>卸売業 | 375,900 | 3,252.26<br>1,222,526,200 | 3,249.00<br>1,221,299,100 | －<br>－ | 0.83 |
| 23 | 第一三共<br>日本 | 株式<br>医薬品 | 428,800 | 3,257.90<br>1,396,990,860 | 2,530.00<br>1,084,864,000 | －<br>－ | 0.73 |
| 24 | ＳＭＣ<br>日本 | 株式<br>機械 | 16,000 | 65,860.63<br>1,053,770,200 | 65,520.00<br>1,048,320,000 | －<br>－ | 0.71 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 25 | 三井物産<br>日本 | 株式<br>卸売業 | 428,700 | 2,215.11<br>949,618,850 | 2,414.00<br>1,034,881,800 | －<br>－ | 0.70 |
| 26 | セブン&アイ・ホールディングス<br>日本 | 株式<br>小売業 | 210,200 | 4,216.62<br>886,335,400 | 4,736.00<br>995,507,200 | －<br>－ | 0.67 |
| 27 | 三菱商事<br>日本 | 株式<br>卸売業 | 327,200 | 2,983.19<br>976,100,000 | 2,984.00<br>976,364,800 | －<br>－ | 0.66 |
| 28 | 三菱電機<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 545,600 | 1,603.98<br>875,135,300 | 1,692.00<br>923,155,200 | －<br>－ | 0.62 |
| 29 | 東京海上ホールディングス<br>日本 | 株式<br>保険業 | 177,200 | 5,347.54<br>947,585,700 | 5,179.00<br>917,718,800 | －<br>－ | 0.62 |
| 30 | オリエンタルランド<br>日本 | 株式<br>サービス業 | 55,500 | 17,987.69<br>998,316,800 | 16,310.00<br>905,205,000 | －<br>－ | 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<br>国/地域 | 種類<br>業種 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | APPLE INC<br>アメリカ | 株式<br>テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1,141,162 | 13,685.97<br>15,617,913,918 | 13,677.19<br>15,607,893,602 | －<br>－ | 3.83 |
| 2 | MICROSOFT CORP<br>アメリカ | 株式<br>ソフトウェア・サービス | 487,025 | 26,690.54<br>12,998,961,173 | 27,404.87<br>13,346,860,123 | －<br>－ | 3.27 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 3 | AMAZON.COM INC<br>アメリカ | 株式<br>小売 | 29,095 | 354,766.75<br>10,321,938,701 | 353,764.16<br>10,292,768,328 | －<br>－ | 2.52 |
| 4 | FACEBOOK INC-A<br>アメリカ | 株式<br>メディア・娯楽 | 163,491 | 34,433.88<br>5,629,629,481 | 36,081.40<br>5,898,984,952 | －<br>－ | 1.45 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C<br>アメリカ | 株式<br>メディア・娯楽 | 20,049 | 253,404.00<br>5,080,496,988 | 264,692.82<br>5,306,826,460 | －<br>－ | 1.30 |
| 6 | ALPHABET INC-CL A<br>アメリカ | 株式<br>メディア・娯楽 | 20,426 | 249,446.18<br>5,095,187,865 | 258,687.85<br>5,283,958,146 | －<br>－ | 1.30 |
| 7 | JPMORGAN CHASE & CO<br>アメリカ | 株式<br>銀行 | 207,372 | 17,684.21<br>3,667,210,456 | 18,026.98<br>3,738,291,394 | －<br>－ | 0.92 |
| 8 | TESLA, INC.<br>アメリカ | 株式<br>自動車・自動車部品 | 52,197 | 61,973.11<br>3,234,810,619 | 68,624.14<br>3,581,974,611 | －<br>－ | 0.88 |
| 9 | JOHNSON & JOHNSON<br>アメリカ | 株式<br>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<br>3,335,375,289 | 18,576.87<br>3,319,242,610 | －<br>－ | 0.81 |
| 10 | NVIDIA CORP<br>アメリカ | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 42,077 | 61,816.52<br>2,601,053,750 | 71,319.85<br>3,000,925,446 | －<br>－ | 0.74 |
| 11 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B<br>アメリカ | 株式<br>各種金融 | 93,167 | 31,416.55<br>2,926,985,795 | 31,768.93<br>2,959,816,311 | －<br>－ | 0.73 |
| 12 | UNITEDHEALTH GROUP INC<br>アメリカ | 株式<br>ヘルスケア機器・サービス | 64,475 | 44,950.23<br>2,898,166,277 | 45,212.33<br>2,915,065,569 | －<br>－ | 0.71 |
| 13 | VISA INC-CLASS A SHARES<br>アメリカ | 株式<br>ソフトウェア・サービス | 115,305 | 24,653.93<br>2,842,721,522 | 24,948.44<br>2,876,680,796 | －<br>－ | 0.71 |
| 14 | NESTLE SA<br>スイス | 株式<br>食品・飲料・タバコ | 195,795 | 13,332.16<br>2,610,371,579 | 13,546.63<br>2,652,364,222 | －<br>－ | 0.65 |
| 15 | HOME DEPOT INC<br>アメリカ | 株式<br>小売 | 73,187 | 34,516.72<br>2,526,175,829 | 35,003.56<br>2,561,805,662 | －<br>－ | 0.63 |
| 16 | PROCTER & GAMBLE CO<br>アメリカ | 株式<br>家庭用品・パーソナル用品 | 167,417 | 14,993.52<br>2,510,170,888 | 14,801.13<br>2,477,961,785 | －<br>－ | 0.61 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 17 | BANK OF AMERICA CORP<br>アメリカ | 株式<br>銀行 | 527,935 | 4,606.67<br>2,432,026,742 | 4,652.72<br>2,456,337,111 | －<br>－ | 0.60 |
| 18 | WALT DISNEY CO<br>アメリカ | 株式<br>メディア・娯楽 | 123,401 | 18,587.80<br>2,293,753,337 | 19,608.62<br>2,419,723,810 | －<br>－ | 0.59 |
| 19 | MASTERCARD INC-CLASS A<br>アメリカ | 株式<br>ソフトウェア・サービス | 60,283 | 39,622.11<br>2,388,540,115 | 39,577.26<br>2,385,836,012 | －<br>－ | 0.58 |
| 20 | PAYPAL HOLDINGS INC<br>アメリカ | 株式<br>ソフトウェア・サービス | 75,613 | 26,865.56<br>2,031,385,751 | 28,539.79<br>2,157,979,534 | －<br>－ | 0.53 |
| 21 | ASML HOLDING NV<br>オランダ | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 28,508 | 68,073.65<br>1,940,643,899 | 73,864.60<br>2,105,732,073 | －<br>－ | 0.52 |
| 22 | COMCAST CORP<br>アメリカ | 株式<br>メディア・娯楽 | 310,577 | 5,956.00<br>1,849,798,444 | 6,293.63<br>1,954,659,333 | －<br>－ | 0.48 |
| 23 | EXXON MOBIL CORP<br>アメリカ | 株式<br>エネルギー | 287,751 | 6,473.60<br>1,862,785,702 | 6,406.69<br>1,843,531,799 | －<br>－ | 0.45 |
| 24 | ROCHE HOLDING AG<br>スイス | 株式<br>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<br>1,770,401,605 | 38,474.79<br>1,834,786,071 | －<br>－ | 0.45 |
| 25 | ADOBE INC<br>アメリカ | 株式<br>ソフトウェア・サービス | 32,508 | 52,754.83<br>1,714,954,110 | 55,382.70<br>1,800,380,837 | －<br>－ | 0.44 |
| 26 | VERIZON COMMUNICATIONS INC<br>アメリカ | 株式<br>電気通信サービス | 281,936 | 6,246.98<br>1,761,248,625 | 6,200.34<br>1,748,099,734 | －<br>－ | 0.43 |
| 27 | INTEL CORP<br>アメリカ | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 276,169 | 6,076.32<br>1,678,091,677 | 6,269.49<br>1,731,439,115 | －<br>－ | 0.42 |
| 28 | COCA-COLA CO<br>アメリカ | 株式<br>食品・飲料・タバコ | 278,541 | 5,946.79<br>1,656,426,281 | 6,068.63<br>1,690,362,380 | －<br>－ | 0.41 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 29 | CISCO SYSTEMS INC<br>アメリカ | 株式<br>テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 286,863 | 5,759.48<br>1,652,182,433 | 5,806.30<br>1,665,613,784 | －<br>－ | 0.41 |
| 30 | NETFLIX INC<br>アメリカ | 株式<br>メディア・娯楽 | 30,106 | 53,547.60<br>1,612,104,096 | 55,188.42<br>1,661,502,741 | －<br>－ | 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<br>国/地域 | 種類<br>業種 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING<br>台湾 | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 87,000 | 2,004.28<br>174,372,583 | 2,336.99<br>203,318,130 | －<br>－ | 5.82 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD<br>ケイマン諸島 | 株式<br>メディア・娯楽 | 20,400 | 8,251.47<br>168,330,174 | 8,505.21<br>173,506,284 | －<br>－ | 4.97 |
| 3 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD<br>香港 | 株式<br>小売 | 53,600 | 2,955.90<br>158,436,620 | 2,932.63<br>157,189,289 | －<br>－ | 4.50 |
| 4 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD<br>韓国 | 株式<br>テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 17,111 | 6,632.84<br>113,494,633 | 7,881.83<br>134,866,164 | －<br>－ | 3.86 |
| 5 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF<br>アメリカ | 投資信託受益証券<br>－ | 22,700 | 3,459.12<br>78,522,066 | 4,230.15<br>96,024,414 | －<br>－ | 2.75 |
| 6 | MEITUAN-B<br>香港 | 株式<br>小売 | 13,000 | 4,194.14<br>54,523,901 | 3,749.92<br>48,749,064 | －<br>－ | 1.40 |
| 7 | NASPERS LTD-N SHS<br>南アフリカ | 株式<br>小売 | 1,569 | 24,563.35<br>38,539,898 | 24,134.37<br>37,866,828 | －<br>－ | 1.08 |
| 8 | VALE SA<br>ブラジル | 株式<br>素材 | 14,367 | 1,579.45<br>22,692,090 | 2,344.33<br>33,681,111 | －<br>－ | 0.96 |
| 9 | RELIANCE INDUSTRIES LIMITED<br>インド | 株式<br>エネルギー | 10,209 | 3,018.31<br>30,814,014 | 3,184.09<br>32,506,436 | －<br>－ | 0.93 |
| 10 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H<br>中国 | 株式<br>銀行 | 351,000 | 84.96<br>29,824,387 | 90.49<br>31,764,096 | －<br>－ | 0.91 |
| 11 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H<br>中国 | 株式<br>保険 | 22,500 | 1,257.65<br>28,297,251 | 1,199.77<br>26,995,027 | －<br>－ | 0.77 |
| 12 | JD.COM INC-ADR<br>ケイマン諸島 | 株式<br>小売 | 3,150 | 9,461.86<br>29,804,868 | 8,115.65<br>25,564,311 | －<br>－ | 0.73 |
| 13 | ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF<br>アメリカ | 投資信託受益証券<br>－ | 15,504 | 1,324.80<br>20,539,744 | 1,631.03<br>25,287,544 | －<br>－ | 0.72 |
| 14 | SK HYNIX INC<br>韓国 | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 1,998 | 10,369.77<br>20,718,802 | 12,300.00<br>24,575,400 | －<br>－ | 0.70 |

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

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 26 | NETEASE.COM INC -ADR<br>ケイマン諸島 | 株式<br>メディア・娯楽 | 1,390 | 9,956.21<br>13,839,132 | 12,943.99<br>17,992,155 | －<br>－ | 0.51 |
| 27 | ICICI BANK LTD<br>インド | 株式<br>銀行 | 17,828 | 748.46<br>13,343,547 | 977.43<br>17,425,729 | －<br>－ | 0.50 |
| 28 | ISHARES MSCI KUWAIT ETF<br>アメリカ | 投資信託受益証券<br>－ | 5,000 | 2,931.48<br>14,657,445 | 3,458.53<br>17,292,688 | －<br>－ | 0.49 |
| 29 | SBERBANK PAO -SPONSORED ADR<br>ロシア | 株式<br>銀行 | 9,037 | 1,452.94<br>13,130,243 | 1,852.19<br>16,738,330 | －<br>－ | 0.48 |
| 30 | PJSC GAZPROM ADR<br>ロシア | 株式<br>エネルギー | 20,067 | 541.02<br>10,856,686 | 779.73<br>15,646,942 | －<br>－ | 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<br>国/地域 | 種類 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 3,132 | 696,000.00<br>2,179,872,000 | 694,000.00<br>2,173,608,000 | －<br>－ | 6.89 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人<br>日本 | 投資証券 | 2,783 | 668,000.00<br>1,859,044,000 | 660,000.00<br>1,836,780,000 | －<br>－ | 5.82 |
| 3 | ＧＬＰ投資法人<br>日本 | 投資証券 | 8,697 | 181,400.00<br>1,577,635,800 | 186,900.00<br>1,625,469,300 | －<br>－ | 5.15 |
| 4 | 野村不動産マスターファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 9,000 | 174,800.00<br>1,573,200,000 | 173,400.00<br>1,560,600,000 | －<br>－ | 4.94 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5 | 日本都市ファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 13,863 | 109,100.00<br>1,512,453,300 | 110,800.00<br>1,536,020,400 | －<br>－ | 4.87 |
| 6 | 日本プロロジスリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 4,400 | 346,500.00<br>1,524,600,000 | 339,500.00<br>1,493,800,000 | －<br>－ | 4.73 |
| 7 | 大和ハウスリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 3,971 | 297,400.00<br>1,180,975,400 | 306,000.00<br>1,215,126,000 | －<br>－ | 3.85 |
| 8 | オリックス不動産投資法人<br>日本 | 投資証券 | 5,546 | 191,700.00<br>1,063,168,200 | 203,500.00<br>1,128,611,000 | －<br>－ | 3.58 |
| 9 | ユナイテッド・アーバン投資法人<br>日本 | 投資証券 | 5,952 | 164,400.00<br>978,508,800 | 157,000.00<br>934,464,000 | －<br>－ | 2.96 |
| 10 | アドバンス・レジデンス投資法人<br>日本 | 投資証券 | 2,644 | 349,500.00<br>924,078,000 | 352,000.00<br>930,688,000 | －<br>－ | 2.95 |
| 11 | 産業ファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 3,934 | 197,300.00<br>776,178,200 | 196,000.00<br>771,064,000 | －<br>－ | 2.44 |
| 12 | 日本プライムリアルティ投資法人<br>日本 | 投資証券 | 1,733 | 427,000.00<br>739,991,000 | 430,500.00<br>746,056,500 | －<br>－ | 2.36 |
| 13 | 積水ハウス・リート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 8,186 | 89,500.00<br>732,647,000 | 90,600.00<br>741,651,600 | －<br>－ | 2.35 |
| 14 | ケネディクス・オフィス投資法人<br>日本 | 投資証券 | 861 | 800,000.00<br>688,800,000 | 812,000.00<br>699,132,000 | －<br>－ | 2.21 |
| 15 | アクティビア・プロパティーズ投資法人<br>日本 | 投資証券 | 1,395 | 502,000.00<br>700,290,000 | 498,500.00<br>695,407,500 | －<br>－ | 2.20 |
| 16 | 日本アコモデーションファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 959 | 639,000.00<br>612,801,000 | 634,000.00<br>608,006,000 | －<br>－ | 1.93 |
| 17 | ジャパン・ホテル・リート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 8,966 | 64,600.00<br>579,203,600 | 67,200.00<br>602,515,200 | －<br>－ | 1.91 |
| 18 | ラサールロジポート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 3,367 | 173,500.00<br>584,174,500 | 178,500.00<br>601,009,500 | －<br>－ | 1.90 |
| 19 | 日本ロジスティクスファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 1,819 | 317,500.00<br>577,532,500 | 309,000.00<br>562,071,000 | －<br>－ | 1.78 |
| 20 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人<br>日本 | 投資証券 | 971 | 551,000.00<br>535,021,000 | 562,000.00<br>545,702,000 | －<br>－ | 1.73 |
| 21 | インヴィンシブル投資法人<br>日本 | 投資証券 | 11,638 | 43,000.00<br>500,434,000 | 44,600.00<br>519,054,800 | －<br>－ | 1.64 |
| 22 | 森ヒルズリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 3,269 | 157,400.00<br>514,540,600 | 157,800.00<br>515,848,200 | －<br>－ | 1.63 |
| 23 | フロンティア不動産投資法人<br>日本 | 投資証券 | 924 | 488,000.00<br>450,912,000 | 504,000.00<br>465,696,000 | －<br>－ | 1.48 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 24 | 大和証券オフィス投資法人<br>日本 | 投資証券 | 593 | 770,000.00<br>456,610,000 | 778,000.00<br>461,354,000 | －<br>－ | 1.46 |
| 25 | イオンリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 2,823 | 150,500.00<br>424,861,500 | 154,100.00<br>435,024,300 | －<br>－ | 1.38 |
| 26 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人<br>日本 | 投資証券 | 1,897 | 221,900.00<br>420,944,300 | 225,200.00<br>427,204,400 | －<br>－ | 1.35 |
| 27 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人<br>日本 | 投資証券 | 1,251 | 347,000.00<br>434,097,000 | 339,000.00<br>424,089,000 | －<br>－ | 1.34 |
| 28 | 大和証券リビング投資法人<br>日本 | 投資証券 | 3,634 | 112,800.00<br>409,915,200 | 112,000.00<br>407,008,000 | －<br>－ | 1.29 |
| 29 | ジャパンエクセレント投資法人<br>日本 | 投資証券 | 2,583 | 151,100.00<br>390,291,300 | 157,200.00<br>406,047,600 | －<br>－ | 1.29 |
| 30 | ヒューリックリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 2,307 | 176,200.00<br>406,493,400 | 174,900.00<br>403,494,300 | －<br>－ | 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<br>国/地域 | 種類 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | PROLOGIS INC<br>アメリカ | 投資証券 | 15,777 | 11,026.08<br>173,958,607 | 12,934.11<br>204,061,585 | －<br>－ | 5.88 |
| 2 | EQUINIX INC<br>アメリカ | 投資証券 | 1,900 | 79,827.90<br>151,673,017 | 80,862.38<br>153,638,535 | －<br>－ | 4.43 |
| 3 | SIMON PROPERTY GROUP INC<br>アメリカ | 投資証券 | 7,097 | 9,184.01<br>65,178,981 | 14,103.06<br>100,089,433 | －<br>－ | 2.88 |
| 4 | DIGITAL REALTY TRUST INC<br>アメリカ | 投資証券 | 6,004 | 15,639.82<br>93,901,533 | 16,635.22<br>99,877,894 | －<br>－ | 2.88 |
| 5 | PUBLIC STORAGE<br>アメリカ | 投資証券 | 3,176 | 25,226.67<br>80,119,929 | 31,005.00<br>98,471,895 | －<br>－ | 2.84 |
| 6 | WELLTOWER INC<br>アメリカ | 投資証券 | 8,926 | 7,186.19<br>64,143,970 | 8,206.75<br>73,253,496 | －<br>－ | 2.11 |
| 7 | AVALONBAY COMMUNITIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 2,953 | 18,753.93<br>55,380,367 | 22,713.73<br>67,073,657 | －<br>－ | 1.93 |
| 8 | EQUITY RESIDENTIAL<br>アメリカ | 投資証券 | 7,288 | 6,650.45<br>48,468,538 | 8,500.91<br>61,954,646 | －<br>－ | 1.79 |
| 9 | REALTY INCOME CORP<br>アメリカ | 投資証券 | 8,140 | 6,750.65<br>54,950,371 | 7,507.58<br>61,111,733 | －<br>－ | 1.76 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 10 | GOODMAN GROUP<br>オーストラリア | 投資証券 | 35,938 | 1,578.00<br>56,710,220 | 1,634.93<br>58,756,164 | －<br>－ | 1.69 |
| 11 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT<br>アメリカ | 投資証券 | 2,697 | 18,060.11<br>48,708,121 | 19,565.81<br>52,769,010 | －<br>－ | 1.52 |
| 12 | VENTAS INC<br>アメリカ | 投資証券 | 8,165 | 5,377.72<br>43,909,131 | 6,086.19<br>49,693,757 | －<br>－ | 1.43 |
| 13 | INVITATION HOMES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 12,038 | 3,115.87<br>37,508,856 | 3,980.99<br>47,923,220 | －<br>－ | 1.38 |
| 14 | EXTRA SPACE STORAGE INC<br>アメリカ | 投資証券 | 2,788 | 12,534.88<br>34,947,248 | 16,443.14<br>45,843,489 | －<br>－ | 1.32 |
| 15 | ESSEX PROPERTY TRUST INC<br>アメリカ | 投資証券 | 1,385 | 28,009.64<br>38,793,363 | 32,411.03<br>44,889,277 | －<br>－ | 1.29 |
| 16 | LINK REIT<br>香港 | 投資証券 | 42,300 | 980.74<br>41,485,714 | 1,058.37<br>44,769,431 | －<br>－ | 1.29 |
| 17 | SUN COMMUNITIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 2,346 | 15,566.82<br>36,519,767 | 18,376.01<br>43,110,141 | －<br>－ | 1.24 |
| 18 | MID-AMERICA APARTMENT COMM<br>アメリカ | 投資証券 | 2,439 | 13,995.33<br>34,134,623 | 17,638.43<br>43,020,135 | －<br>－ | 1.24 |
| 19 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 11,630 | 3,368.66<br>39,177,563 | 3,663.78<br>42,609,863 | －<br>－ | 1.23 |
| 20 | SEGRO PLC<br>イギリス | 投資証券 | 25,356 | 1,425.17<br>36,136,704 | 1,623.68<br>41,170,182 | －<br>－ | 1.19 |
| 21 | DUKE REALTY CORP<br>アメリカ | 投資証券 | 7,853 | 4,275.88<br>33,578,499 | 5,099.44<br>40,045,977 | －<br>－ | 1.15 |
| 22 | VICI PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 11,671 | 2,872.44<br>33,524,316 | 3,416.82<br>39,877,808 | －<br>－ | 1.15 |
| 23 | BOSTON PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 3,081 | 10,743.84<br>33,101,783 | 12,903.38<br>39,755,331 | －<br>－ | 1.15 |
| 24 | UDR INC<br>アメリカ | 投資証券 | 6,322 | 4,298.36<br>27,174,255 | 5,227.86<br>33,050,586 | －<br>－ | 0.95 |
| 25 | WP CAREY INC<br>アメリカ | 投資証券 | 3,889 | 7,703.87<br>29,960,389 | 8,281.39<br>32,206,333 | －<br>－ | 0.93 |
| 26 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC<br>アメリカ | 投資証券 | 12,687 | 2,148.97<br>27,263,988 | 2,323.61<br>29,479,756 | －<br>－ | 0.85 |
| 27 | IRON MOUNTAIN INC<br>アメリカ | 投資証券 | 6,062 | 2,903.64<br>17,601,890 | 4,778.95<br>28,969,997 | －<br>－ | 0.83 |
| 28 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD<br>フランス | 投資証券 | 2,966 | 7,645.72<br>22,677,229 | 9,652.01<br>28,627,878 | －<br>－ | 0.82 |
| 29 | HOST HOTELS AND RESORTS INC<br>アメリカ | 投資証券 | 14,977 | 1,604.11<br>24,024,903 | 1,884.57<br>28,225,342 | －<br>－ | 0.81 |
| 30 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES<br>アメリカ | 投資証券 | 3,537 | 6,678.40<br>23,621,528 | 7,777.59<br>27,509,348 | －<br>－ | 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<br>国/地域 | 種類 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 第７０回　利付国債（２０年）<br>日本 | 国債証券 | 1,049,000,000 | 108.03<br>1,133,321,580 | 107.73<br>1,130,140,150 | 2.4<br>2024/6/20 | 1.47 |
| 2 | 第１３３回　住宅金融支援機構債券<br>日本 | 特殊債券 | 1,000,000,000 | 101.77<br>1,017,724,000 | 101.61<br>1,016,135,000 | 0.828<br>2023/5/19 | 1.32 |
| 3 | 第３５回　利付国債（３０年）<br>日本 | 国債証券 | 774,000,000 | 130.01<br>1,006,349,830 | 129.80<br>1,004,667,480 | 2<br>2041/9/20 | 1.31 |
| 4 | 第３２８回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 779,000,000 | 101.43<br>790,201,700 | 101.31<br>789,259,430 | 0.6<br>2023/3/20 | 1.03 |
| 5 | 第３５０回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 770,000,000 | 100.83<br>776,420,700 | 101.05<br>778,138,900 | 0.1<br>2028/3/20 | 1.01 |
| 6 | 第３５８回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 723,000,000 | 100.17<br>724,229,100 | 100.65<br>727,757,340 | 0.1<br>2030/3/20 | 0.95 |
| 7 | 第１２７回　利付国債（２０年）<br>日本 | 国債証券 | 575,000,000 | 117.57<br>676,044,750 | 117.81<br>677,413,250 | 1.9<br>2031/3/20 | 0.88 |
| 8 | 第３５１回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 646,000,000 | 100.77<br>651,012,300 | 101.02<br>652,621,500 | 0.1<br>2028/6/20 | 0.85 |
| 9 | 第３３４回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 618,000,000 | 102.31<br>632,325,240 | 102.23<br>631,818,480 | 0.6<br>2024/6/20 | 0.82 |
| 10 | 第３５４回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 615,000,000 | 100.52<br>618,198,000 | 100.89<br>620,522,700 | 0.1<br>2029/3/20 | 0.81 |
| 11 | 第３４９回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 597,000,000 | 100.86<br>602,135,660 | 101.05<br>603,280,440 | 0.1<br>2027/12/20 | 0.78 |
| 12 | 第３２７回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 592,000,000 | 101.62<br>601,596,320 | 101.43<br>600,518,880 | 0.8<br>2022/12/20 | 0.78 |
| 13 | 第３５２回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 576,000,000 | 100.67<br>579,899,520 | 100.98<br>581,690,880 | 0.1<br>2028/9/20 | 0.76 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 14 | 第３４０回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 566,000,000 | 102.20<br>578,474,640 | 102.24<br>578,729,340 | 0.4<br>2025/9/20 | 0.75 |
| 15 | 第３４１回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 552,000,000 | 101.79<br>561,924,960 | 101.87<br>562,355,520 | 0.3<br>2025/12/20 | 0.73 |
| 16 | 第３５３回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 543,000,000 | 100.62<br>546,372,030 | 100.94<br>548,131,350 | 0.1<br>2028/12/20 | 0.71 |
| 17 | 第３３９回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 536,000,000 | 102.08<br>547,154,160 | 102.13<br>547,459,680 | 0.4<br>2025/6/20 | 0.71 |
| 18 | 第３４４回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 533,000,000 | 100.83<br>537,429,230 | 100.98<br>538,250,050 | 0.1<br>2026/9/20 | 0.70 |
| 19 | 第３４５回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 532,000,000 | 100.84<br>536,468,800 | 101.00<br>537,341,280 | 0.1<br>2026/12/20 | 0.70 |
| 20 | 第３４６回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 523,000,000 | 100.81<br>527,262,450 | 101.01<br>528,329,370 | 0.1<br>2027/3/20 | 0.69 |
| 21 | 第３４２回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 510,000,000 | 100.83<br>514,238,100 | 100.96<br>514,916,400 | 0.1<br>2026/3/20 | 0.67 |
| 22 | 第２１８回　政保道路機構債券<br>日本 | 特殊債券 | 500,000,000 | 101.95<br>509,752,000 | 101.92<br>509,623,000 | 0.66<br>2024/5/31 | 0.66 |
| 23 | 第１９０回　政保道路機構債券<br>日本 | 特殊債券 | 500,000,000 | 101.23<br>506,158,500 | 101.17<br>505,870,500 | 0.605<br>2023/5/31 | 0.66 |
| 24 | 第３４８回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 499,000,000 | 100.81<br>503,076,830 | 101.04<br>504,209,560 | 0.1<br>2027/9/20 | 0.66 |
| 25 | 第３３８回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 491,000,000 | 101.97<br>500,716,890 | 102.00<br>500,839,640 | 0.4<br>2025/3/20 | 0.65 |
| 26 | 第１１３回　利付国債（２０年）<br>日本 | 国債証券 | 415,000,000 | 117.35<br>487,039,850 | 117.38<br>487,164,350 | 2.1<br>2029/9/20 | 0.63 |
| 27 | 第３３５回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 475,000,000 | 102.10<br>485,001,760 | 102.07<br>484,846,750 | 0.5<br>2024/9/20 | 0.63 |
| 28 | 第１４１回　利付国債（５年）<br>日本 | 国債証券 | 470,000,000 | 100.70<br>473,327,600 | 100.74<br>473,506,200 | 0.1<br>2024/9/20 | 0.62 |
| 29 | 第３４３回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 461,000,000 | 100.82<br>464,780,200 | 100.96<br>465,444,040 | 0.1<br>2026/6/20 | 0.60 |
| 30 | 第３６１回　利付国債（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 457,000,000 | 99.86<br>456,370,870 | 100.33<br>458,517,240 | 0.1<br>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<br>国/地域 | 種類 | 株数、口数又は額面金額 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 365,500,800 | 106.70<br>390,014,938 | 106.75<br>390,172,104 | 2.75<br>2024/2/15 | 0.99 |
| 2 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 301,840,000 | 106.18<br>320,514,840 | 106.21<br>320,584,264 | 2.75<br>2023/11/15 | 0.81 |
| 3 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 299,644,800 | 106.64<br>319,553,200 | 106.94<br>320,455,131 | 2.25<br>2025/11/15 | 0.81 |
| 4 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 304,035,200 | 103.74<br>315,412,197 | 104.08<br>316,467,199 | 1.625<br>2026/2/15 | 0.80 |
| 5 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 293,059,200 | 105.14<br>308,145,887 | 105.19<br>308,295,347 | 2.25<br>2023/12/31 | 0.78 |
| 6 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 280,985,600 | 106.42<br>299,035,361 | 106.50<br>299,258,093 | 2.5<br>2024/5/15 | 0.76 |
| 7 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 280,985,600 | 105.53<br>296,526,913 | 105.79<br>297,282,764 | 2<br>2025/8/15 | 0.75 |
| 8 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 279,888,000 | 103.20<br>288,852,812 | 103.17<br>288,763,248 | 2<br>2023/2/15 | 0.73 |
| 9 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 265,619,200 | 105.97<br>281,481,978 | 106.18<br>282,042,435 | 2.125<br>2025/5/15 | 0.72 |
| 10 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 273,302,400 | 103.12<br>281,850,181 | 103.10<br>281,799,371 | 1.75<br>2023/5/15 | 0.72 |
| 11 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 266,716,800 | 105.38<br>281,071,498 | 105.56<br>281,572,925 | 2<br>2025/2/15 | 0.71 |
| 12 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 261,228,800 | 106.33<br>277,769,807 | 106.43<br>278,044,097 | 2.375<br>2024/8/15 | 0.71 |
| 13 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 260,131,200 | 106.12<br>276,072,039 | 106.26<br>276,438,824 | 2.25<br>2024/11/15 | 0.70 |
| 14 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 270,009,600 | 102.22<br>276,009,213 | 102.19<br>275,936,310 | 1.625<br>2022/11/15 | 0.70 |
| 15 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 260,131,200 | 105.15<br>273,539,613 | 105.22<br>273,725,656 | 2.125<br>2024/3/31 | 0.69 |
| 16 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 255,740,800 | 105.10<br>268,806,597 | 105.10<br>268,786,138 | 2.5<br>2023/8/15 | 0.68 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 17 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 262,326,400 | 102.33<br>268,462,214 | 102.31<br>268,401,879 | 1.625<br>2022/12/15 | 0.68 |
| 18 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 260,131,200 | 103.19<br>268,442,391 | 103.15<br>268,330,535 | 2.125<br>2022/12/31 | 0.68 |
| 19 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 261,228,800 | 101.88<br>266,166,024 | 101.86<br>266,105,941 | 1.625<br>2022/8/15 | 0.68 |
| 20 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 243,667,200 | 108.37<br>264,081,638 | 108.67<br>264,815,076 | 2.625<br>2025/12/31 | 0.67 |
| 21 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 238,179,200 | 106.73<br>254,224,827 | 107.08<br>255,047,050 | 2.25<br>2026/3/31 | 0.65 |
| 22 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 235,984,000 | 106.37<br>251,018,540 | 106.90<br>252,271,615 | 2.25<br>2027/11/15 | 0.64 |
| 23 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 238,179,200 | 103.82<br>247,281,355 | 104.02<br>247,761,149 | 1.625<br>2026/5/15 | 0.63 |
| 24 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 223,910,400 | 109.85<br>245,980,567 | 110.08<br>246,500,720 | 3<br>2025/9/30 | 0.63 |
| 25 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 220,617,600 | 109.51<br>241,618,189 | 110.07<br>242,842,617 | 2.75<br>2028/2/15 | 0.62 |
| 26 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 231,593,600 | 101.94<br>236,088,831 | 101.90<br>235,998,510 | 1.625<br>2022/8/31 | 0.60 |
| 27 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 220,617,600 | 102.22<br>225,519,723 | 102.18<br>225,442,506 | 1.75<br>2022/9/30 | 0.57 |
| 28 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 215,129,600 | 101.78<br>218,969,663 | 101.72<br>218,834,131 | 1.75<br>2022/6/15 | 0.56 |
| 29 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 203,056,000 | 106.49<br>216,246,517 | 106.96<br>217,196,819 | 2.25<br>2027/8/15 | 0.55 |
| 30 | US TREASURY N/B<br>アメリカ | 国債証券 | 211,836,800 | 102.26<br>216,626,430 | 102.19<br>216,486,617 | 2.125<br>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。

### ②【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。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

### ③【その他投資資産の主要なもの】

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　０３０６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 |
| | ＥＵＲＥＸ取引所 | DJ EURO STOXX 50 202106 | 買建 | 344 | 1,814,847,252 | 1,870,626,729 | 0.46 |
| | ＩＣＥ－ＥＵ | 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 | ＮＹＳＥ ＬＩＦＦＥ　ＵＳ | 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。**

**ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド**

**該当事項はありません。**

## （３）【運用実績】

### ①【純資産の推移】

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) | 10,387,974 | 10,387,974 | 0.9908 | 0.9908 |
| 第2計算期間末(2019年11月20日) | 18,417,924 | 18,417,924 | 1.0701 | 1.0701 |
| 第3計算期間末(2020年11月20日) | 31,744,500 | 31,744,500 | 1.0747 | 1.0747 |
| 2020年5月末日 | 22,350,555 | － | 1.0070 | － |
| 6月末日 | 23,668,887 | － | 1.0202 | － |
| 7月末日 | 25,161,357 | － | 1.0310 | － |
| 8月末日 | 27,202,777 | － | 1.0589 | － |
| 9月末日 | 28,598,202 | － | 1.0478 | － |
| 10月末日 | 29,636,125 | － | 1.0323 | － |
| 11月末日 | 32,108,472 | － | 1.0835 | － |
| 12月末日 | 33,566,551 | － | 1.1025 | － |
| 2021年1月末日 | 35,438,792 | － | 1.1190 | － |
| 2月末日 | 37,241,009 | － | 1.1371 | － |
| 3月末日 | 40,644,873 | － | 1.1726 | － |
| 4月末日 | 44,778,763 | － | 1.1858 | － |
| 5月末日 | 48,474,605 | － | 1.1968 | － |

### ②【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 | － |

### ③【収益率の推移】

| | 収益率（%） |
|---|---|
| 第1計算期間 | △0.9 |
| 第2計算期間 | 8.0 |
| 第3計算期間 | 0.4 |
| 2020年11月21日～2021年5月20日 | 9.8 |

（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 | 16,395,406 | 5,910,777 | 10,484,629 |
| 第2計算期間 | 10,576,235 | 3,849,753 | 17,211,111 |
| 第3計算期間 | 18,571,996 | 6,244,753 | 29,538,354 |
| 2020年11月21日～<br>2021年5月20日 | 13,756,281 | 3,069,804 | 40,224,831 |

（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 | 11,968円 |
| 純資産総額 | 48百万円 |

●分配の推移 1万口当り(税引前)

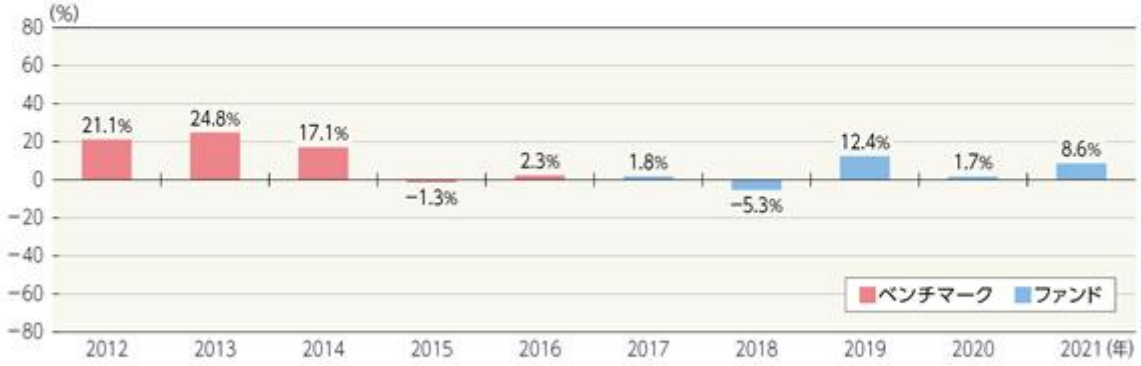
| | |
|---|---|
| 2018年11月 | 0円 |
| 2019年11月 | 0円 |
| 2020年11月 | 0円 |
| 直近1年間累計 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

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

●資産別組入比率

・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移




・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2017年はファンド設定時から年末まで、2021年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
・2016年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

## 3.運用実績

2021年5月末現在

### ●マザーファンドの状況

#### 1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

| | 銘柄 | 比率 |
|---|---|---|
| 1 | トヨタ自動車 | 3.5% |
| 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。

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。

#### 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。

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。

#### 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。

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。

#### 4.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

| | 銘柄 | 比率 |
|---|---|---|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人 | 7.0% |
| 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。

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

## 5. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

| | 銘柄 | 国・地域 | 比率 |
|---|---|---|---|
| 1 | PROLOGIS INC | アメリカ | 6.0% |
| 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。

## 6. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

| | 銘柄 | 償還日 | クーポン | 比率 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 第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。

組入比率

| 種別 | 比率 |
|---|---|
| 債券 | 99.1% |
| 債券先物 | － |
| 現金、その他 | 0.9% |

・比率は対純資産総額比です。

## 7. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

| | 銘柄 | 通貨 | 償還日 | クーポン | 比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | アメリカ国債 | 米ドル | 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。

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

# 第２【管理及び運営】

## １【申込（販売）手続等】

①　申込受付

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

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

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

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

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

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

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

## ２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

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

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

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

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

② 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③ 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○ 換金手数料はありません。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

⑥ 支払開始日

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

⑦ その他

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

２．換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記④の規定に準じて算出した価額とします。

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

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

# 3【資産管理等の概要】

## （1）【資産の評価】

① 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

② ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

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

③ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④ 予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

⑥ 基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

## （2）【保管】

該当事項はありません。

## （3）【信託期間】

無期限です。

## （4）【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

## （5）【その他】

① 繰上償還

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

ⅰ．受益権の口数が30億口を下回っている場合

ⅱ．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

ⅲ．やむを得ない事情が発生したとき

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

②　約款の変更等

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

**６．前記２．から５．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。**

**７．前記１．から６．までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。**

**８．委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記１．から７．までの規定にしたがいます。**

**③　反対者の買取請求の不適用**

**ファンドは、受益者からの換金請求に対して、この信託契約の一部を解約することにより公正な価格をもって支払いに応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、前記「①　繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「②　約款の変更等」に規定する重大な約款の変更等を行う場合の書面決議において反対した受益者からの買取請求を受付けません。**

**④　公告**

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

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

**⑤　運用報告書の作成**

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

**・交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知れている受益者に交付します。**

**・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（https://www.nam.co.jp/）に掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付します。**

**⑥　信託事務処理の再信託**

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

**⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き**

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

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

## ４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

**（１）収益分配金に対する請求権**

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

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

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

**（２）償還金に対する請求権**

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

**（３）解約請求権**

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

**（４）帳簿閲覧権**

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

**（５）書面決議における議決権**

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

**（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限**

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

①　他の受益者の氏名または名称および住所
②　他の受益者が有する受益権の内容

# 第３【ファンドの経理状況】

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

**２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2019年11月21日から2020年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。**

# 1【財務諸表】

## 【ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）】

### （1）【貸借対照表】

（単位：円）

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

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第2期<br>(自2018年11月21日<br>至2019年11月20日) | 第3期<br>(自2019年11月21日<br>至2020年11月20日) |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 1,201,233 | 652,197 |
| 営業収益合計 | 1,201,233 | 652,197 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 3,433 | 6,051 |
| 委託者報酬 | 43,962 | 76,637 |
| その他費用 | 1,301 | 2,384 |
| 営業費用合計 | 48,696 | 85,072 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 1,152,537 | 567,125 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 1,152,537 | 567,125 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 1,152,537 | 567,125 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | 125,844 | △161,653 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | △96,655 | 1,206,813 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 276,775 | 664,917 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 10,501 | － |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 266,274 | 664,917 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | 394,362 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | 394,362 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,206,813 | 2,206,146 |

## （３）【注記表】

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>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<br>2019年11月20日現在 | 第3期<br>2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| １．　受益権総口数 | 17,211,111口 | 29,538,354口 |
| ２．　1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0701円<br>(10,701円) | 1.0747円<br>(10,747円) |

**（損益及び剰余金計算書に関する注記）**

| 項目 | 第2期<br>自2018年11月21日<br>至2019年11月20日 | 第3期<br>自2019年11月21日<br>至2020年11月20日 |
|---|---|---|
| １．　分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（891,521円）、収益調整金（315,292円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,206,813円（1口当たり0.070118円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（728,778円）、収益調整金（870,595円）及び分配準備積立金（659,452円）より分配対象収益は2,258,825円（1口当たり0.076471円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。 |

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

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

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

| 項目 | 第2期<br>2019年11月20日現在 | 第3期<br>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<br>（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>2019年11月20日現在 | 第3期<br>2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 1,001,631 | 882,816 |
| 合計 | 1,001,631 | 882,816 |

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

該当事項はありません。

**（関連当事者との取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（その他の注記）**

元本額の変動

| 項目 | 第2期<br>2019年11月20日現在 | 第3期<br>2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 10,484,629円 | 17,211,111円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,576,235円 | 18,571,996円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,849,753円 | 6,244,753円 |

## （４）【附属明細表】（2020年11月20日現在）

**第１　有価証券明細表**

**① 株式**

該当事項はありません。

**② 株式以外の有価証券**

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

**第２　信用取引契約残高明細表**

該当事項はありません。

**第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第４　不動産等明細表**

該当事項はありません。

**第５　商品明細表**

該当事項はありません。

**第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第７　その他特定資産の明細表**

該当事項はありません。

**第８　借入金明細表**

該当事項はありません。

**（参考）**

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

## 「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

**（単位：円）**

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br><br>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<br><br>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<br>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<br>（1万口当たり純資産額） | 1.8150円<br>(18,150円) | 1.8986円<br>(18,986円) |

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

| 項目 | 自　2018年11月21日<br>至　2019年11月20日 | 自　2019年11月21日<br>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。<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| １．　貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| ２．　時価の算定方法 | (１)有価証券<br>（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 2020年11月20日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 株式 | 3,259,262,001 | 18,923,389,638 |
| 合計 | 3,259,262,001 | 18,923,389,638 |

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

デリバティブ取引

株式関連

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

（注）　１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

**（関連当事者との取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（その他の注記）**

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

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| 開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額 | 33,015,590,469円 | 37,206,074,017円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額 | 14,648,507,258円 | 60,753,324,319円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額 | 10,458,023,710円 | 17,161,694,807円 |
| | | |
| 元本の内訳 | | |
| | | |
| ファンド名 | | |
| | | |
| ニッセイＴＯＰＩＸオープン | 6,469,503,110円 | 5,997,522,254円 |
| ニッセイ国内株式インデックスＳＡ（適格機関投資家限定） | 4,561,011,771円 | 4,004,514,028円 |
| ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 4,059,132円 | 3,951,454円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） | 1,460,555,576円 | 1,860,653,914円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型） | 5,163,139,062円 | 6,246,777,830円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型） | 3,451,105,833円 | 4,205,316,361円 |
| ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 8,469,605円 | 6,322,700円 |
| ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 37,232,083円 | 27,161,997円 |
| ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 44,296,788円 | 29,811,890円 |
| ＤＣニッセイ国内株式インデックス | 313,570,047円 | 427,035,413円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＴＯＰＩＸインデックスファンド | 14,584,098,618円 | 17,240,662,075円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型） | 626,761,958円 | 1,074,533,103円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５ | 83,670,627円 | 144,747,105円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型） | 75,262,010円 | 145,261,593円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５ | 55,166,663円 | 145,236,565円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５ | 111,903,417円 | 322,269,421円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５ | 34,041,324円 | 79,701,863円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型） | 41,445,869円 | 57,705,245円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式） | 25,474,150円 | 6,311,072円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート） | 3,591,265円 | 6,106,383円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券） | 1,026,689円 | 1,725,042円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券） | 2,865,527円 | 4,955,125円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型） | 16,706,927円 | 19,701,162円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０ | 5,863,187円 | 38,732,745円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０ | 5,563,574円 | 30,720,016円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０ | 9,335,459円 | 104,343,668円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０ | 10,353,746円 | 157,314,590円 |
| ニッセイ国内株式市場連動ＳＡファンド（適格機関投資家限定） | －円 | 38,402,506,248円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット） | －円 | 5,934,694円 |
| ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型） | －円 | 56,157円 |
| ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型） | －円 | 111,816円 |
| | | |
| 計 | 37,206,074,017円 | 80,797,703,529円 |

**附属明細表（2020年11月20日現在）**

**第１　有価証券明細表**

**① 株式**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

② 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

第４　不動産等明細表
該当事項はありません。

第５　商品明細表
該当事項はありません。

第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

第７　その他特定資産の明細表

**該当事項はありません。**

## 第８　借入金明細表

**該当事項はありません。**

## 「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br><br>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。<br><br>投資証券<br>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<br><br>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。<br><br>為替予約取引<br>個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 |
| ３．　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。 |
| ４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 |

**（貸借対照表に関する注記）**

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

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

| 項目 | 自　2018年11月21日<br>至　2019年11月20日 | 自　2019年11月21日<br>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。<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

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

**（有価証券に関する注記）**

売買目的有価証券

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

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

**デリバティブ取引**

**通貨関連**

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

**（注）１．時価の算定方法**

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

**①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。**

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

**２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。**

**株式関連**

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

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

**（関連当事者との取引に関する注記）**
該当事項はありません。

**（その他の注記）**

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

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| 開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額 | 88,596,175,879円 | 110,982,930,759円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額 | 43,121,658,246円 | 65,821,989,117円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額 | 20,734,903,366円 | 31,635,139,337円 |
| | | |
| 元本の内訳 | | |
| | | |
| ファンド名 | | |
| | | |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） | 705,419,292円 | 854,059,755円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型） | 3,284,755,401円 | 3,771,468,504円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型） | 2,471,314,789円 | 2,859,153,135円 |
| ニッセイ外国株式インデックスＳＡ（適格機関投資家限定） | 1,485,332,737円 | 1,680,106,235円 |
| ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 4,090,937円 | 2,902,320円 |
| ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 23,976,047円 | 16,628,124円 |
| ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 32,048,288円 | 20,292,993円 |
| ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定） | 11,371,888,952円 | 11,039,104,952円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国株式インデックスファンド | 75,325,693,121円 | 101,174,107,029円 |
| ＤＣニッセイ外国株式インデックス | 15,291,138,731円 | 20,965,866,221円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型） | 605,358,530円 | 986,387,028円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５ | 59,931,201円 | 98,693,841円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型） | 72,703,499円 | 133,359,257円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５ | 39,305,684円 | 98,739,969円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５ | 79,667,845円 | 218,778,176円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５ | 22,747,558円 | 48,776,845円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型） | 40,031,114円 | 52,991,843円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式） | 24,696,756円 | 5,819,342円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート） | 3,481,454円 | 5,624,058円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券） | 995,057円 | 1,588,705円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型） | 16,196,854円 | 18,159,475円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０ | 4,212,091円 | 26,453,761円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０ | 3,974,678円 | 20,935,466円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０ | 6,685,873円 | 70,913,550円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０ | 7,284,270円 | 104,875,929円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド２０２０－０２（適格機関投資家限定） | －円 | 263,829,859円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定） | －円 | 303,405,272円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット） | －円 | 49,172,147円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定） | －円 | 277,586,748円 |
| | | |
| 計 | 110,982,930,759円 | 145,169,780,539円 |

# 附属明細表（2020年11月20日現在）

## 第１　有価証券明細表

### ① 株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | PRUDENTIAL PLC | 164,797 | 12.78 | 2,106,929.64 | |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 44,988 | 67.28 | 3,026,792.64 | |
| | RELX PLC | 122,192 | 17.76 | 2,170,740.88 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 117,631 | 5.15 | 606,505.43 | |
| | RIO TINTO PLC | 70,706 | 47.16 | 3,334,494.96 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 123,768 | 0.98 | 121,911.48 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 259,074 | 12.26 | 3,176,247.24 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 233,596 | 11.82 | 2,761,571.91 | |
| | RSA INSURANCE GROUP PLC | 64,276 | 6.76 | 434,634.31 | |
| | SAGE GROUP PLC | 68,645 | 6.79 | 466,648.71 | |
| | SAINSBURY (J) PLC | 110,620 | 2.22 | 245,576.40 | |
| | SCHRODERS PLC | 7,825 | 29.75 | 232,793.75 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 15,258 | 24.52 | 374,126.16 | |
| | SMITH & NEPHEW PLC | 55,102 | 14.49 | 798,703.49 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 25,239 | 15.30 | 386,282.89 | |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 4,675 | 115.00 | 537,625.00 | |
| | SSE PLC | 66,218 | 13.63 | 902,551.34 | |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 33,903 | 10.85 | 367,847.55 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 168,190 | 4.38 | 737,681.34 | |
| | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 145,189 | 2.70 | 392,155.48 | |
| | TAYLOR WIMPEY PLC | 230,069 | 1.67 | 385,365.57 | |
| | TESCO PLC | 620,495 | 2.36 | 1,464,988.69 | |
| | UNILEVER PLC | 73,876 | 44.63 | 3,297,085.88 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 43,648 | 9.17 | 400,252.16 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,698,190 | 1.21 | 2,064,999.04 | |
| | WHITBREAD PLC | 12,668 | 30.57 | 387,260.76 | |
| | WPP PLC | 78,141 | 7.40 | 578,868.52 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | 18,105,595 | | 94,627,663.88<br>(13,028,336,763) | |
| イスラエル・シュケル | AZRIELI GROUP | 2,769 | 189.90 | 525,833.10 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 71,938 | 22.28 | 1,602,778.64 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 90,902 | 18.70 | 1,699,867.40 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 1,690 | 390.00 | 659,100.00 | |
| | ICL GROUP LTD | 44,037 | 13.85 | 609,912.45 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 73,010 | 11.24 | 820,632.40 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 9,152 | 72.44 | 662,970.88 | |
| | NICE LTD | 3,947 | 784.00 | 3,094,448.00 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | 297,445 | | 9,675,542.87<br>(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<br>(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<br>(9,667,384,819) | |
| シンガポール・ドル | CAPITALAND LTD | 175,100 | 2.98 | 521,798.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 29,700 | 7.58 | 225,126.00 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 113,400 | 24.42 | 2,769,228.00 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 376,000 | 0.82 | 308,320.00 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 6,100 | 20.60 | 125,660.00 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 94,300 | 5.07 | 478,101.00 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 209,300 | 9.79 | 2,049,047.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 87,400 | 4.06 | 354,844.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 50,600 | 9.08 | 459,448.00 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 99,500 | 3.91 | 389,045.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 522,900 | 2.39 | 1,249,731.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 74,400 | 22.41 | 1,667,304.00 | |
| | UOL Group Limited | 29,800 | 7.41 | 220,818.00 | |
| | VENTURE CORP LTD | 17,500 | 18.92 | 331,100.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 119,100 | 4.25 | 506,175.00 | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 158,000 | 0.92 | 145,360.00 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | 2,163,100 | | 11,801,105.00<br>(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<br>(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<br>(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<br>(2,375,212,355) | |
| ニュージーランド・ドル | A2 MILK CO LTD | 46,911 | 14.54 | 682,085.94 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 82,703 | 7.72 | 638,467.16 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 36,340 | 33.44 | 1,215,209.60 | |
| | MERCURY NZ LTD | 46,488 | 5.88 | 273,349.44 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 82,903 | 5.97 | 494,930.91 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 25,957 | 15.51 | 402,593.07 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 123,265 | 4.53 | 559,006.77 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | 444,567 | | 4,265,642.89<br>(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<br>(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<br>(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<br>(2,934,105,819) | |
| 合計 | | 69,243,684 | | 285,514,371,822<br>(285,514,371,822) | |

② 株式以外の有価証券

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

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 14,366.00 | 495,770.66 | |
| | PROLOGIS INC | 46,617.00 | 4,661,233.83 | |
| | PUBLIC STORAGE | 9,898.00 | 2,264,563.42 | |
| | REALTY INCOME CORP | 21,571.00 | 1,318,203.81 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 10,662.00 | 509,217.12 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 7,050.00 | 2,099,208.00 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 19,312.00 | 1,557,126.56 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 6,197.00 | 866,960.30 | |
| | UDR INC | 18,617.00 | 722,339.60 | |
| | VENTAS INC | 23,527.00 | 1,143,882.74 | |
| | VEREIT | 67,671.00 | 498,058.56 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 29,584.00 | 765,338.08 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 10,233.00 | 407,682.72 | |
| | WELLTOWER INC | 26,369.00 | 1,719,258.80 | |
| | WP CAREY INC | 10,869.00 | 761,156.07 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | 816,578.00 | 53,406,996.08<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(121,993,738) | |
| 投資証券　合計 | | | | 6,689,318,591<br>(6,689,318,591) | |
| 合計 | | | | 6,689,318,591<br>(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<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>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<br>投資証券　38銘柄 | 68.06%<br>-% | -%<br>1.84% | 71.99% |
| イギリス・ポンド | 株式　84銘柄<br>投資証券　3銘柄 | 4.33%<br>-% | -%<br>0.06% | 4.52% |
| イスラエル・シュケル | 株式　8銘柄 | 0.10% | -% | 0.10% |
| オーストラリア・ドル | 株式　53銘柄<br>投資証券　7銘柄 | 2.07%<br>-% | -%<br>0.16% | 2.29% |
| カナダ・ドル | 株式　80銘柄<br>投資証券　4銘柄 | 3.21%<br>-% | -%<br>0.02% | 3.33% |
| シンガポール・ドル | 株式　16銘柄<br>投資証券　5銘柄 | 0.30%<br>-% | -%<br>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<br>投資証券　5銘柄 | 10.47%<br>-% | -%<br>0.06% | 10.84% |
| 香港・ドル | 株式　31銘柄<br>投資証券　1銘柄 | 0.98%<br>-% | -%<br>0.04% | 1.05% |

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 第４　不動産等明細表

該当事項はありません。

**第５　商品明細表**

**該当事項はありません。**

**第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表**

**該当事項はありません。**

**第７　その他特定資産の明細表**

**該当事項はありません。**

**第８　借入金明細表**

**該当事項はありません。**

## 「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br><br>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。<br><br>投資信託受益証券<br>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。<br><br>投資証券<br>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<br><br>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。<br><br>為替予約取引<br>個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 |
| ３．　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。 |
| ４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 |

**（貸借対照表に関する注記）**

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

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

| 項目 | 自　2018年11月21日<br>至　2019年11月20日 | 自　2019年11月21日<br>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。<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

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

**（有価証券に関する注記）**

売買目的有価証券

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

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

**デリバティブ取引**

**通貨関連**

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

（注）１．時価の算定方法

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

**株式関連**

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

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

４．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

**（関連当事者との取引に関する注記）**
該当事項はありません。

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

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

## 附属明細表（2020年11月20日現在）

**第１　有価証券明細表**
**① 株式**

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

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| イギリス・ポンド | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 717 | 16.78 | 12,034.84 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | 717 | | 12,034.84<br>(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<br>(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<br>(32,210,671) | |
| オフショア・人民元 | AECC AVIATION POWER CO-A | 1,000 | 41.00 | 41,000.00 | |
| | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 8,000 | 3.23 | 25,840.00 | |
| | AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 1,430 | 62.53 | 89,417.90 | |
| | AISINO CORP-A | 1,800 | 13.94 | 25,092.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 1,000 | 56.79 | 56,790.00 | |
| | AVIC CAPITAL CO LTD -A | 9,200 | 4.56 | 41,952.00 | |
| | BANK OF BEIJING CO LTD -A | 8,600 | 4.80 | 41,280.00 | |
| | BANK OF CHINA LTD-A | 4,500 | 3.24 | 14,580.00 | |
| | BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 3,700 | 4.61 | 17,057.00 | |
| | BANK OF NINGBO CO LTD -A | 1,700 | 36.15 | 61,455.00 | |

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

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

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

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

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | (43,182,801) | |
| チェコ・コルナ | CEZ AS | 571 | 468.00 | 267,228.00 | |
| | KOMERCNI BANKA AS | 188 | 568.00 | 106,784.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 1,124 | 64.50 | 72,498.00 | |
| チェコ・コルナ　小計 | | 1,883 | | 446,510.00<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(18,434,246) | |
| ブラジル・レアル | AMBEV SA | 15,100 | 14.73 | 222,423.00 | |
| | ATACADAO SA | 1,900 | 20.29 | 38,551.00 | |
| | B2W CIA DIGITAL | 600 | 74.63 | 44,778.00 | |
| | BANCO BRADESCO S.A. | 4,342 | 22.29 | 96,783.18 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 13,728 | 24.64 | 338,257.92 | |
| | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 600 | 82.36 | 49,416.00 | |
| | BANCO DO BRASIL SA | 2,800 | 34.62 | 96,936.00 | |
| | BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL | 1,300 | 39.13 | 50,869.00 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 2,200 | 28.07 | 61,754.00 | |
| | BM&FBOVESPA SA | 6,700 | 55.32 | 370,644.00 | |
| | BRASKEM SA-PREF A | 500 | 23.26 | 11,630.00 | |
| | BRF SA | 1,600 | 20.79 | 33,264.00 | |
| | CCR SA | 3,800 | 12.70 | 48,260.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 700 | 32.59 | 22,813.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 700 | 31.39 | 21,973.00 | |
| | CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC | 500 | 69.82 | 34,910.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 3,019 | 11.95 | 36,077.05 | |
| | CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 300 | 68.24 | 20,472.00 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 1,000 | 44.36 | 44,360.00 | |
| | CIELO SA | 3,900 | 3.77 | 14,703.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | COGNA EDUCACAO | 6,100 | 4.98 | 30,378.00 | |
| | COSAN SA | 600 | 80.01 | 48,006.00 | |
| | CPFL ENERGIA SA | 600 | 30.77 | 18,462.00 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 600 | 46.80 | 28,080.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 675 | 44.01 | 29,706.75 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 2,500 | 21.12 | 52,800.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 3,100 | 21.24 | 65,844.00 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 700 | 71.37 | 49,959.00 | |
| | HYPERA S.A | 1,100 | 31.16 | 34,276.00 | |
| | IRB BRASIL RESSEGUROS SA | 2,400 | 6.68 | 16,032.00 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 15,150 | 28.81 | 436,471.50 | |
| | ITAUSA SA | 13,930 | 10.72 | 149,329.60 | |
| | JBS SA | 3,500 | 21.84 | 76,440.00 | |
| | KLABIN SA - UNIT | 1,900 | 23.35 | 44,365.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 1,995 | 65.48 | 130,632.60 | |
| | LOJAS AMERICANAS SA-PREF | 2,300 | 24.26 | 55,798.00 | |
| | LOJAS RENNER S.A. | 2,420 | 46.94 | 113,594.80 | |
| | MAGAZINE LUIZA SA | 9,200 | 24.64 | 226,688.00 | |
| | MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS | 1,200 | 22.00 | 26,400.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 2,200 | 48.87 | 107,514.00 | |
| | NOTRE DAME INTERMED PAR SA | 1,600 | 70.39 | 112,624.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 12,300 | 24.45 | 300,735.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 15,100 | 23.82 | 359,682.00 | |
| | PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 2,600 | 21.01 | 54,626.00 | |
| | PORTO SEGURO SA | 200 | 50.80 | 10,160.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 4,000 | 25.86 | 103,440.00 | |
| | RUMO SA | 3,400 | 18.60 | 63,240.00 | |
| | SUL AMERICA SA - UNITS | 700 | 41.66 | 29,162.00 | |
| | SUZANO S.A. | 1,522 | 50.21 | 76,419.62 | |
| | TELEF BRASIL | 1,400 | 46.39 | 64,946.00 | |
| | TIM SA | 3,500 | 13.90 | 48,650.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 2,200 | 20.69 | 45,518.00 | |
| | VALE SA | 11,367 | 67.72 | 769,773.24 | |
| | VIA VAREJO SA | 3,800 | 17.94 | 68,172.00 | |
| | WEG SA | 2,760 | 80.93 | 223,366.80 | |
| ブラジル・レアル　小計 | | 203,908 | | 5,730,166.06<br>(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<br>(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<br>(37,356,658) | |
| メキシコ・ペソ | ALFA S.A.B.-A | 9,600 | 14.90 | 143,040.00 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE CV | 101,600 | 14.26 | 1,448,816.00 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 1,800 | 101.55 | 182,790.00 | |
| | CEMEX SAB-CPO | 47,800 | 9.45 | 451,710.00 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 1,600 | 92.23 | 147,568.00 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 6,400 | 152.64 | 976,896.00 | |
| | GRUMA S.A.B.-B | 515 | 218.09 | 112,316.35 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | 645 | 314.17 | 202,639.65 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH | 1,200 | 211.35 | 253,620.00 | |
| | GRUPO BIMBO SAB-SERIES A | 5,300 | 43.15 | 228,695.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 900 | 46.47 | 41,823.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 8,100 | 108.66 | 880,146.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 7,500 | 19.07 | 143,025.00 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 10,700 | 65.84 | 704,488.00 | |
| | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO | 6,900 | 32.75 | 225,975.00 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 360 | 307.44 | 110,678.40 | |
| | INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV | 1,800 | 74.57 | 134,226.00 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 4,900 | 32.94 | 161,406.00 | |
| | MEGACABLE HOLDINGS-CPO | 800 | 71.88 | 57,504.00 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 3,300 | 40.16 | 132,528.00 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 430 | 164.68 | 70,812.40 | |
| | WALMART DE MEXICO-SER V | 16,800 | 56.52 | 949,536.00 | |
| メキシコ・ペソ　小計 | | 238,950 | | 7,760,238.80<br>(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<br>(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<br>(286,864,113) | |
| **香港・ドル** | 3SBIO INC | 4,000 | 7.32 | 29,280.00 | |
| | A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H | 1,500 | 34.00 | 51,000.00 | |
| | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 2,000 | 42.10 | 84,200.00 | |
| | AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 4,000 | 11.64 | 46,560.00 | |
| | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 83,000 | 2.82 | 234,060.00 | |
| | AIR CHINA LIMITED-H | 10,000 | 6.38 | 63,800.00 | |
| | AK MEDICAL HOLDINGS LTD | 2,000 | 15.60 | 31,200.00 | |
| | ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 12,000 | 20.25 | 243,000.00 | |
| | ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 40,000 | 1.02 | 40,800.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 24,000 | 2.20 | 52,800.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 4,000 | 52.90 | 211,600.00 | |
| | ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 700 | 90.22 | 63,154.00 | |
| | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 3,000 | 111.40 | 334,200.00 | |
| | AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 4,000 | 4.47 | 17,880.00 | |
| | BAIC MOTOR CORP LTD-H | 4,000 | 3.20 | 12,800.00 | |
| | BANK OF CHINA LTD - H | 237,000 | 2.71 | 642,270.00 | |

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

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

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

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

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD | 13,000 | 3.07 | 39,910.00 | |
| | ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 3,500 | 10.20 | 35,700.00 | |
| | ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 2,000 | 5.62 | 11,240.00 | |
| | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | 7,000 | 4.81 | 33,670.00 | |
| | ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 700 | 38.65 | 27,055.00 | |
| | ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 2,000 | 61.90 | 123,800.00 | |
| | ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H | 1,700 | 25.85 | 43,945.00 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 18,000 | 7.23 | 130,140.00 | |
| | ZTE CORP-H | 2,800 | 20.70 | 57,960.00 | |
| 香港・ドル　小計 | | 2,713,821 | | 38,747,992.78<br>(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<br>(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<br>(81,692,778) | |
| 合計 | | 7,489,746 | | 2,171,408,735<br>(2,171,408,735) | |

② 株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額又は口数 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | アメリカ・ドル | ISHARES MSCI QATAR CP ETF | 9,546.00 | 173,164.44 | |
| | | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 19,200.00 | 590,016.00 | |
| | | ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF | 11,104.00 | 125,031.04 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | 39,850.00 | 888,211.48<br>(92,267,409) | |
| 投資信託受益証券　合計 | | | | 92,267,409<br>(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<br>(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<br>(759,664) | |
| 投資証券　合計 | | | | 1,651,711<br>(1,651,711) | |
| 合計 | | | | 93,919,120<br>(93,919,120) | |

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

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

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 第４　不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第５　商品明細表

該当事項はありません。

## 第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第７　その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第８　借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br><br>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<br>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。 |

**（貸借対照表に関する注記）**

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

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

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

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

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

**（有価証券に関する注記）**

売買目的有価証券

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

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

該当事項はありません。

**（関連当事者との取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（その他の注記）**

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

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| 開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額 | 11,518,929,567円 | 16,398,065,583円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額 | 12,025,469,621円 | 10,734,070,769円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額 | 7,146,333,605円 | 10,870,244,042円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家限定） | 1,589,859,033円 | 1,408,620,060円 |
| ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド | 1,501,629,877円 | 1,334,615,580円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＪリートインデックスファンド | 8,117,494,358円 | 7,994,095,472円 |
| ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０１３－０２（適格機関投資家限定） | 1,858,643,446円 | 1,797,071,866円 |
| ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ | 2,484,924,690円 | 2,497,454,821円 |
| ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ | 785,204,355円 | 1,124,577,814円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型） | 38,195,777円 | 67,045,069円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート） | 3,282,914円 | 7,181,692円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券） | 938,090円 | 2,029,548円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券） | 2,642,646円 | 5,799,025円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型） | 15,250,397円 | 23,140,573円 |
| ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型） | －円 | 87,185円 |
| ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型） | －円 | 173,605円 |
| 計 | 16,398,065,583円 | 16,261,892,310円 |

## 附属明細表（2020年11月20日現在）

**第１　有価証券明細表**

**① 株式**

**該当事項はありません。**

**② 株式以外の有価証券**

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

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

**第２　信用取引契約残高明細表**

該当事項はありません。

**第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第４　不動産等明細表**

該当事項はありません。

**第５　商品明細表**

該当事項はありません。

**第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第７　その他特定資産の明細表**

該当事項はありません。

**第８　借入金明細表**

該当事項はありません。

## 「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

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

**（貸借対照表に関する注記）**

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| １．　受益権総口数 | 2,138,126,735口 | 2,505,757,114口 |
| ２．　投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額<br>元本の欠損 | ―――――― | 7,820,201円 |
| ３．　1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.1556円<br>(11,556円) | 0.9969円<br>(9,969円) |

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

| 項目 | 自　2018年11月21日<br>至　2019年11月20日 | 自　2019年11月21日<br>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。<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| １．　貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| ２．　時価の算定方法 | (１)有価証券<br>（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 2020年11月20日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 投資証券 | 247,250,811 | △281,579,062 |
| 合計 | 247,250,811 | △281,579,062 |

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

デリバティブ取引

通貨関連

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

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

**（関連当事者との取引に関する注記）**
該当事項はありません。

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

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

## 附属明細表（2020年11月20日現在）

**第１　有価証券明細表**
**① 株式**
該当事項はありません。

**② 株式以外の有価証券**

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

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

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

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 6,016.00 | 485,070.08 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 3,163.00 | 32,452.38 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 1,570.00 | 90,981.50 | |
| | | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 2,133.00 | 76,745.34 | |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 2,775.00 | 83,028.00 | |
| | | STORE CAPITAL CORP | 4,654.00 | 148,928.00 | |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 1,855.00 | 15,192.45 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 1,849.00 | 258,675.10 | |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 3,500.00 | 37,800.00 | |
| | | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 1,475.00 | 13,186.50 | |
| | | TAUBMAN CENTERS INC | 1,127.00 | 48,246.87 | |
| | | TERRENO REALTY CORP | 1,280.00 | 75,392.00 | |
| | | UDR INC | 5,741.00 | 222,750.80 | |
| | | UMH PROPERTIES INC | 479.00 | 6,902.39 | |
| | | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 291.00 | 17,366.88 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 2,165.00 | 28,664.60 | |
| | | URSTADT BIDDLE - CL A | 500.00 | 6,335.00 | |
| | | VENTAS INC | 7,307.00 | 355,266.34 | |
| | | VEREIT | 20,754.00 | 152,749.44 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 10,796.00 | 279,292.52 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 3,182.00 | 126,770.88 | |
| | | WASHINGTON PRIME GROUP INC | 4,308.00 | 3,394.70 | |
| | | WASHINGTON REAL ESTATE INV | 1,407.00 | 33,261.48 | |
| | | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 2,715.00 | 59,051.25 | |
| | | WELLTOWER INC | 8,162.00 | 532,162.40 | |
| | | WHITESTONE REIT | 1,666.00 | 12,828.20 | |
| | | WP CAREY INC | 3,303.00 | 231,309.09 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 2,019.00 | 27,418.02 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | 519,257.00 | 17,428,954.25<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(49,503,807) | |
| シンガポール・ドル | AIMS APAC REIT | 7,200.00 | 8,568.00 | |
| | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 19,000.00 | 11,020.00 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 52,700.00 | 156,519.00 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 35,242.00 | 35,065.79 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 82,328.00 | 163,009.44 | |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 16,100.00 | 19,803.00 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 15,600.00 | 18,564.00 | |
| | ESR REIT | 66,900.00 | 26,091.00 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 23,500.00 | 14,922.50 | |
| | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 8,800.00 | 3,740.00 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 18,300.00 | 42,273.00 | |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 55,011.00 | 69,313.86 | |
| | IREIT GLOBAL | 12,600.00 | 7,875.00 | |
| | KEPPEL DC REIT | 24,900.00 | 70,716.00 | |
| | KEPPEL REIT | 36,000.00 | 37,440.00 | |
| | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 20,400.00 | 13,260.00 | |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 29,800.00 | 2,443.60 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 42,800.00 | 85,600.00 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 29,100.00 | 87,300.00 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 53,200.00 | 105,336.00 | |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 44,400.00 | 41,070.00 | |
| | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 26,700.00 | 9,478.50 | |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 2,500.00 | 9,900.00 | |
| | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 11,200.00 | 3,920.00 | |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 3,400.00 | 2,720.00 | |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 33,400.00 | 16,533.00 | |
| | SPH REIT | 4,100.00 | 3,280.00 | |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 21,100.00 | 9,811.50 | |
| | SUNTEC REIT | 42,900.00 | 65,208.00 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | 839,181.00 | 1,140,781.19<br>(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<br>(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<br>(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<br>(39,750,966) | |
| 投資証券　合計 | | | | 2,458,157,327<br>(2,458,157,327) | |
| 合計 | | | | 2,458,157,327<br>(2,458,157,327) | |

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

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

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

**第２　信用取引契約残高明細表**

該当事項はありません。

**第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表**

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

**第４　不動産等明細表**

該当事項はありません。

**第５　商品明細表**

該当事項はありません。

**第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第７　その他特定資産の明細表**

該当事項はありません。

**第８　借入金明細表**

該当事項はありません。

## 「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

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

**（貸借対照表に関する注記）**

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

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

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

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

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

**（有価証券に関する注記）**

売買目的有価証券

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

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

該当事項はありません。

**（関連当事者との取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（その他の注記）**

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

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| 開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額 | 91,553,091,806円 | 80,458,265,938円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額 | 7,229,627,282円 | 8,990,513,828円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額 | 18,324,453,150円 | 8,421,230,212円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ニッセイ国内債券パッシブＤＢ（適格機関投資家限定） | 76,296,408,816円 | 73,107,845,104円 |
| ＤＣニッセイ日本債券インデックス | 1,851,878,712円 | 2,389,221,039円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５ | 34,686,709円 | 63,168,246円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型） | 1,648,815,407円 | 3,213,068,882円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５ | 34,894,519円 | 95,856,034円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５ | 117,890,150円 | 373,115,899円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５ | 300,648,162円 | 960,641,992円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型） | 75,145,871円 | 105,454,989円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券） | 4,591,102円 | 7,844,408円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券） | 24,364,655円 | 42,574,201円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型） | 29,860,218円 | 35,744,250円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０ | 1,990,783円 | 13,265,677円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０ | 2,897,961円 | 16,791,479円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０ | 7,036,801円 | 82,046,548円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０ | 27,156,072円 | 520,910,806円 |
| 計 | 80,458,265,938円 | 81,027,549,554円 |

## 附属明細表（2020年11月20日現在）

**第１　有価証券明細表**

**① 株式**

**該当事項はありません。**

**② 株式以外の有価証券**

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

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

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

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

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

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

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

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

**第２　信用取引契約残高明細表**

該当事項はありません。

**第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第４　不動産等明細表**

該当事項はありません。

**第５　商品明細表**

該当事項はありません。

**第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表**

該当事項はありません。

**第７　その他特定資産の明細表**

該当事項はありません。

**第８　借入金明細表**

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br><br>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<br><br>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<br>（1万口当たり純資産額） | 1.3803円<br>(13,803円) | 1.4455円<br>(14,455円) |

**（金融商品に関する注記）**

**Ⅰ　金融商品の状況に関する事項**

| 項目 | 自　2018年11月21日<br>至　2019年11月20日 | 自　2019年11月21日<br>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。<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

**Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項**

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

**（有価証券に関する注記）**

売買目的有価証券

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

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

**デリバティブ取引**

**通貨関連**

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

（注）１．時価の算定方法

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

**（関連当事者との取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（その他の注記）**

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

| 項目 | 2019年11月20日現在 | 2020年11月20日現在 |
|---|---|---|
| 開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額 | 13,426,526,479円 | 18,019,497,917円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額 | 7,559,583,314円 | 9,937,638,716円 |
| 開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額 | 2,966,611,876円 | 5,363,802,254円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） | 1,913,723,452円 | 2,334,887,551円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型） | 3,342,592,527円 | 3,866,542,648円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型） | 1,117,994,429円 | 1,302,630,172円 |
| ニッセイ外国債券インデックスＳＡ（適格機関投資家限定） | 695,278,547円 | 758,947,512円 |
| ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 5,548,187円 | 3,966,949円 |
| ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 16,265,029円 | 11,348,657円 |
| ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定） | 15,522,663円 | 9,906,781円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国債券インデックスファンド | 8,537,605,753円 | 10,287,697,386円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型） | 821,539,249円 | 1,348,446,447円 |
| ＤＣニッセイ外国債券インデックス | 870,914,843円 | 1,310,372,857円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５ | 28,348,797円 | 46,718,492円 |
| ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型） | 492,962,365円 | 911,353,650円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５ | 18,637,530円 | 47,289,025円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５ | 38,575,285円 | 106,427,690円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５ | 14,055,660円 | 33,342,256円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型） | 54,322,993円 | 72,331,508円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券） | 3,312,314円 | 5,350,294円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型） | 21,545,383円 | 24,383,814円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０ | 1,986,946円 | 12,556,140円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０ | 1,882,158円 | 10,025,784円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０ | 3,194,198円 | 34,004,065円 |
| ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０ | 3,689,609円 | 54,804,701円 |
| 計 | 18,019,497,917円 | 22,593,334,379円 |

## 附属明細表（2020年11月20日現在）

**第１　有価証券明細表**

**① 株式**

**該当事項はありません。**

**② 株式以外の有価証券**

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額又は口数 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15 | 120,000.00 | 162,698.40 | |
| | | US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15 | 80,000.00 | 109,208.80 | |
| | | US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15 | 120,000.00 | 173,826.00 | |
| | | US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15 | 90,000.00 | 122,895.00 | |

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

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

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

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

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | UK TSY 1 1/4% 2041 1.25 2041/10/22 | 240,000.00 | 257,589.60 | |
| | | UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22 | 250,000.00 | 278,345.00 | |
| | | UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22 | 190,000.00 | 229,877.20 | |
| | | UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22 | 110,000.00 | 149,662.70 | |
| | | UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22 | 350,000.00 | 362,414.50 | |
| | | UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07 | 350,000.00 | 361,273.50 | |
| | | UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22 | 170,000.00 | 205,564.00 | |
| | | UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22 | 290,000.00 | 368,862.60 | |
| | | UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07 | 220,000.00 | 234,132.80 | |
| | | UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07 | 170,000.00 | 187,926.50 | |
| | | UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07 | 180,000.00 | 197,235.00 | |
| | | UK TSY 2029 0.875 2029/10/22 | 240,000.00 | 252,660.00 | |
| | | UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22 | 220,000.00 | 449,497.40 | |
| | | UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22 | 320,000.00 | 478,198.40 | |
| | | UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22 | 210,000.00 | 375,291.00 | |
| | | UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22 | 340,000.00 | 532,181.60 | |
| | | UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07 | 190,000.00 | 352,368.30 | |
| | | UK TSY GILT 0 5/8% 2035 0.625 2035/07/31 | 150,000.00 | 148,810.50 | |
| | | UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22 | 400,000.00 | 403,612.00 | |
| | | UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22 | 320,000.00 | 326,848.00 | |
| | | UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07 | 370,000.00 | 428,511.80 | |
| | | UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22 | 230,000.00 | 370,474.80 | |
| | イギリス・ポンド　小計 | | 12,020,000.00 | 15,488,895.10<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(262,739,657) | |
| ユーロ | BELGIUM KINGDOM 0 2027/10/22 | 130,000.00 | 134,938.70 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.1 2030/06/22 | 190,000.00 | 198,988.90 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22 | 140,000.00 | 143,721.20 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.4 2040/06/22 | 80,000.00 | 84,742.40 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22 | 200,000.00 | 209,448.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22 | 270,000.00 | 288,416.70 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22 | 220,000.00 | 240,167.40 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22 | 220,000.00 | 242,446.60 | |
| | BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22 | 250,000.00 | 279,662.50 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22 | 230,000.00 | 251,109.40 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22 | 230,000.00 | 262,683.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22 | 120,000.00 | 142,833.60 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22 | 70,000.00 | 87,334.10 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22 | 160,000.00 | 214,748.80 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22 | 110,000.00 | 153,370.80 | |
| | BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22 | 140,000.00 | 186,904.20 | |

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券時価比率 | 有価証券の合計金額に対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 国債証券　128銘柄 | 42.85% | 43.23% |
| イギリス・ポンド | 国債証券　47銘柄 | 6.53% | 6.59% |
| イスラエル・シュケル | 国債証券　11銘柄 | 0.43% | 0.44% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券　28銘柄 | 2.65% | 2.67% |
| カナダ・ドル | 国債証券　34銘柄 | 1.99% | 2.00% |
| シンガポール・ドル | 国債証券　16銘柄 | 0.43% | 0.44% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券　8銘柄 | 0.33% | 0.33% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券　8銘柄 | 0.56% | 0.56% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券　8銘柄 | 0.22% | 0.22% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券　13銘柄 | 0.63% | 0.64% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券　22銘柄 | 0.50% | 0.50% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券　13銘柄 | 0.80% | 0.81% |
| ユーロ | 国債証券　306銘柄 | 41.22% | 41.58% |

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 第４　不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第５　商品明細表

該当事項はありません。

## 第６　商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第７　その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第８　借入金明細表

該当事項はありません。

# 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。**

## 【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）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第3期<br>2020年11月20日現在 | 第4期中間計算期間<br>2021年5月20日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 211 | 1,532 |
| コール・ローン | 46,327 | 63,399 |
| 親投資信託受益証券 | 31,744,816 | 47,463,104 |
| 未収入金 | 208,169 | 141,863 |
| 流動資産合計 | 31,999,523 | 47,669,898 |
| 資産合計 | 31,999,523 | 47,669,898 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 205,958 | 138,598 |
| 未払受託者報酬 | 3,492 | 4,898 |
| 未払委託者報酬 | 44,190 | 61,810 |
| その他未払費用 | 1,383 | 1,964 |
| 流動負債合計 | 255,023 | 207,270 |
| 負債合計 | 255,023 | 207,270 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 29,538,354 | 40,224,831 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 2,206,146 | 7,237,797 |
| （分配準備積立金） | 1,388,230 | 1,260,155 |
| 元本等合計 | 31,744,500 | 47,462,628 |
| 純資産合計 | 31,744,500 | 47,462,628 |
| 負債純資産合計 | 31,999,523 | 47,669,898 |

## （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<br>自　2019年11月21日<br>至　2020年5月20日 | 第4期中間計算期間<br>自　2020年11月21日<br>至　2021年5月20日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | △1,567,344 | 3,439,241 |
| 営業収益合計 | △1,567,344 | 3,439,241 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 2,559 | 4,898 |
| 委託者報酬 | 32,447 | 61,810 |
| その他費用 | 1,001 | 1,964 |
| 営業費用合計 | 36,007 | 68,672 |
| 営業利益又は営業損失（△） | △1,603,351 | 3,370,569 |
| 経常利益又は経常損失（△） | △1,603,351 | 3,370,569 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | △1,603,351 | 3,370,569 |
| 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（△） | △142,625 | 131,362 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 1,206,813 | 2,206,146 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 248,533 | 2,036,476 |
| 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 | 248,533 | 2,036,476 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 292,992 | 244,032 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 292,992 | 244,032 |
| 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（△） | △298,372 | 7,237,797 |

## （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<br>自　2020年11月21日<br>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<br>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<br>2020年11月20日現在 | 第4期中間計算期間<br>2021年5月20日現在 |
|---|---|---|
| １．　期首元本額 | 17,211,111円 | 29,538,354円 |
| 期中追加設定元本額 | 18,571,996円 | 13,756,281円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,244,753円 | 3,069,804円 |
| ２．　受益権の総数 | 29,538,354口 | 40,224,831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<br>2020年11月20日現在 | 第4期中間計算期間<br>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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>2020年11月20日現在 | 第4期中間計算期間<br>2021年5月20日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0747円<br>(10,747円) | 1.1799円<br>(11,799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、「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」受益証券を主要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が、それらは監査意見の対象外であります。**

**ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド**

**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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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）**

**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<br>　先物取引<br>　　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<br>（1万口当たり純資産額） | 2.1075円<br>(21,075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<br>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<br>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。<br><br>投資証券<br>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<br>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。<br><br>為替予約取引<br>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．　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。 |
| ４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>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 | 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Ⅱ（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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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） | 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 | 4,749,219,991 | － | 4,746,401,960 | △2,818,031 |
| アメリカ・ドル | 3,287,518,514 | － | 3,282,497,880 | △5,020,634 |
| イギリス・ポンド | 499,585,813 | － | 499,389,020 | △196,793 |
| ユーロ | 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。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

**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 | 2.5274円 |
| （1万口当たり純資産額） | (25,274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<br>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<br>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。<br><br>投資信託受益証券<br>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。<br><br>投資証券<br>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<br>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。<br><br>為替予約取引<br>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．　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。 |
| ４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>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 | 2,262,953,958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 | (１)有価証券<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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） | 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 | 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。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

**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 | 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<br>（1万口当たり純資産額） | 1.2141円<br>(12,141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<br>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<br>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<br>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 | (１)有価証券<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>（1万口当たり純資産額） | 1.9134円<br>(19,134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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>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、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>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。<br>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。 |

**（貸借対照表に関する注記）**

| 項目 | | 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ＤＢ（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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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<br>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<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>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<br>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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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） | 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 | 65,341,063 | － | 65,217,014 | △124,049 |
| アメリカ・ドル | 43,669,408 | － | 43,559,622 | △109,786 |
| イギリス・ポンド | 1,652,929 | － | 1,653,141 | 212 |
| オーストラリア・ドル | 3,686,244 | － | 3,672,973 | △13,271 |
| ポーランド・ズロチ | 1,594,085 | － | 1,592,844 | △1,241 |
| マレーシア・リンギット | 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。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

**（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<br>（1万口当たり純資産額） | 1.4832円<br>(14,832円) |

# ２【ファンドの現況】
## 【純資産額計算書】

2021年5月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 48,561,336円 |
| Ⅱ　負債総額 | 86,731円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 48,474,605円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 40,503,253口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.1968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

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

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

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

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

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

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

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

# 第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

**（１）受益証券の名義書換等**

該当事項はありません。

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

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

**（２）受益者に対する特典**

ありません。

**（３）譲渡制限**

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

**（４）受益権の譲渡**

①　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②　前記①の申請のある場合には、前記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③　前記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

**（５）受益権の再分割**

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

**（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて**

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

# 第三部【委託会社等の情報】

# 第１【委託会社等の概況】

## １【委託会社等の概況】

### （１）資本金の額

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年間における資本金の増減はありません。

### （２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

## ２【事業の内容及び営業の概況】

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

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

# 3【委託会社等の経理状況】

## 1.財務諸表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<br>(2020年3月31日) | | 当事業年度<br>(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<br>（自　2019年4月1日<br>至　2020年3月31日） | | 当事業年度<br>（自　2020年4月1日<br>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 | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | | | | | 株主資本合計 |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | | 利益剰余金合計 | |
| | | | | | 配当準備積立金 | 研究開発積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 10,000,000 | 8,281,840 | 8,281,840 | 139,807 | 120,000 | 70,000 | 350,000 | 48,745,315 | 49,425,122 | 67,706,962 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | | |
| 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<br>（自　2020年4月1日<br>至　2021年3月31日） |
|---|---|
| １．有価証券の評価基準及び評価方法 | ①　満期保有目的の債券<br>償却原価法（定額法）によっております。<br>②　その他有価証券<br>時価のあるもの<br>…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。<br>時価のないもの<br>…移動平均法に基づく原価法によっております。<br>③　関係会社株式<br>移動平均法に基づく原価法によっております。 |
| ２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法 | デリバティブ取引の評価は時価法によっております。 |
| ３．固定資産の減価償却の方法 | ①　有形固定資産<br>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。<br>②　無形固定資産<br>定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。 |
| ４．引当金の計上基準 | ①　賞与引当金<br>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。<br>②　退職給付引当金<br>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。<br>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。<br>③　役員退職慰労引当金<br>役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。 |
| ５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |

| | |
|---|---|
| ６．ヘッジ会計の方法 | ①ヘッジ会計の方法<br>繰延ヘッジ処理によっております。<br>②ヘッジ手段とヘッジ対象<br>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。<br>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物<br>ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券<br>③ヘッジ方針<br>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。<br>④ヘッジ有効性評価の方法<br>ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。 |
| ７．消費税等の会計処理 | 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。 |
| ８．連結納税 | 日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日　企業会計基準委員会　実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。 |

**(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せない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。**

**（２） 適用年月日**

**2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。**

**（３） 当該会計基準等の適用による影響**

**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<br>（2020年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（2020年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2020年4月 1日<br>至　2021年3月31日） |
|---|---|---|
| 建物付属設備 | 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**

**①配当金支払額**

**2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項**

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

**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**

**①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 |

**②基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの**

**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 |
|---|---|---|---|
| ①現金・預金 | 28,674,230 | 28,674,230 | ― |
| ②有価証券 | | | |
| 満期保有目的の債券 | 6,301,326 | 6,307,330 | 6,003 |
| ③投資有価証券 | | | |
| 満期保有目的の債券 | 11,547,229 | 11,546,970 | △259 |
| その他有価証券 | 22,087,270 | 22,087,270 | ― |
| 資産計 | 68,610,058 | 68,615,802 | 5,744 |
| ①その他未払金 | 3,591,122 | 3,591,122 | ― |
| 負債計 | 3,591,122 | 3,591,122 | ― |
| ①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 |
|---|---|---|---|
| ①現金・預金 | 40,822,894 | 40,822,894 | － |
| ②有価証券 | | | |
| 満期保有目的の債券 | － | － | － |
| ③投資有価証券 | | | |
| 満期保有目的の債券 | 15,018,123 | 15,023,675 | 5,551 |
| その他有価証券 | 22,039,919 | 22,039,919 | － |
| 資産計 | 77,880,937 | 77,886,489 | 5,551 |
| ①その他未払金 | 4,839,326 | 4,839,326 | － |
| 負債計 | 4,839,326 | 4,839,326 | － |
| ①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

①現金・預金

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

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

負　債

①その他未払金

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

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

（注）投資信託受益証券であります。

**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） |
|---|---|---|---|---|
| ①現金・預金 | 40,822,894 | ― | ― | ― |
| ②有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| 満期保有目的の債券 | | | | |
| 国債・地方債等 | ― | 15,020,000 | ― | ― |
| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
| その他（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 | ― | ― | ― |
| | ① 国債・地方債等 | ― | ― | ― |
| | ② 社債 | ― | ― | ― |
| | ③ その他 | ― | ― | ― |
| | (3)その他（注１） | 14,350,630 | 13,532,359 | 818,270 |
| | 小計 | 14,350,630 | 13,532,359 | 818,270 |
| 貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの | (1)株式 | ― | ― | ― |
| | (2)債券 | ― | ― | ― |
| | ① 国債・地方債等 | ― | ― | ― |
| | ② 社債 | ― | ― | ― |
| | ③ その他 | ― | ― | ― |
| | (3)その他（注１） | 7,736,640 | 8,140,850 | △404,209 |
| | 小計 | 7,736,640 | 8,140,850 | △404,209 |
| 合計 | | 22,087,270 | 21,673,209 | 414,060 |

**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 | ― | ― | ― |
| | ① 国債・地方債等 | ― | ― | ― |
| | ② 社債 | ― | ― | ― |
| | ③ 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 | ― | ― | ― |
| | ① 国債・地方債等 | ― | ― | ― |
| | ② 社債 | ― | ― | ― |
| | ③ 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<br>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<br>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△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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>(自　2020年4月 1日<br>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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>(自　2020年4月 1日<br>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<br>（2020年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>(自　2020年4月 1日<br>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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>(自　2020年4月 1日<br>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<br>(2020年3月31日) | 当事業年度<br>(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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2020年4月 1日<br>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<br>（自　2019年4月 1日<br>至　2020年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2020年4月 1日<br>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。

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 訴訟その他の重要事項

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

# 第２【その他の関係法人の概況】

## １【名称、資本金の額及び事業の内容】

### （１）受託会社

**ａ．名称**

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

**ｂ．資本金の額**

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 |
|---|---|---|
| auカブコム証券株式会社 | 7,196 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社ＳＢＩ証券 | 48,323 | |
| 光世証券株式会社 | 12,000 | |
| 楽天証券株式会社 | 7,495 | |
| 内藤証券株式会社 | 3,002 | |
| ＳＭＢＣ日興証券株式会社 | 10,000 | |
| マネックス証券株式会社 | 12,200 | |
| 松井証券株式会社 | 11,945 | |

### （３）投資助言会社（参考情報）

**ａ．名称**

株式会社ニッセイ基礎研究所

**ｂ．資本金の額**

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に際しては、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。

・　商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。

・　基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。

なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（４）目論見書に以下の内容を記載することがあります。

投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。

（５）目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 ２ 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

（６）目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。

（７）目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

# 独立監査人の監査報告書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。**

# 独立監査人の監査報告書

２０２０年１２月２８日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政　印

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の２０１９年１１月２１日から２０２０年１１月２０日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の２０２０年１１月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

**・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**

**・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

**・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

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

**利害関係**

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

**以　上**

---

**※　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。**

**２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

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
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政　印

**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」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の２０２０年１１月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、ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。