

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2021年11月19日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 大関 洋
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】</b>	DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）
<b>【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)

(以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

### (7)【申込期間】

継続申込期間：2021年11月20日(土)～2022年5月20日(金)

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

### (8)【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

## ( 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。

## ( 1 0 ) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

## ( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

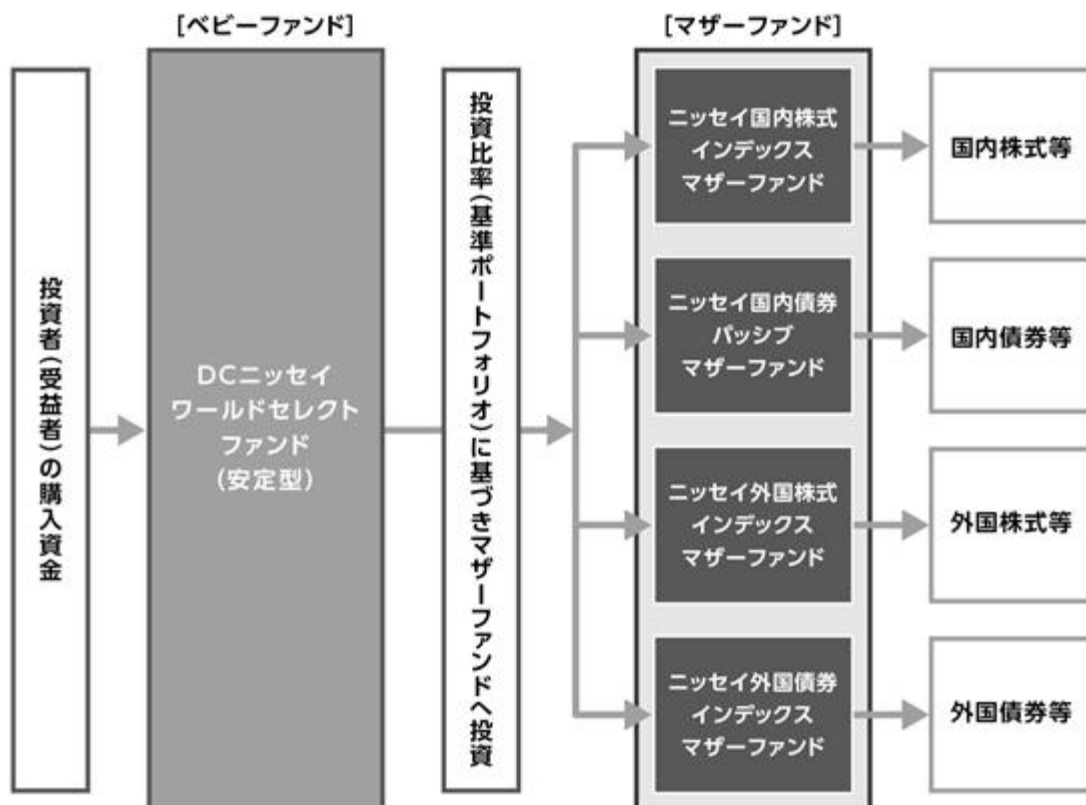
###### 基本方針

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

###### ファンドの特色

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

○ 東京証券取引所の東証1部、東証2部などの市場は、2022年4月に新しい市場区分への再編が予定されています。これに併せ、TOPIXの算出方法についても変更が予定されています。

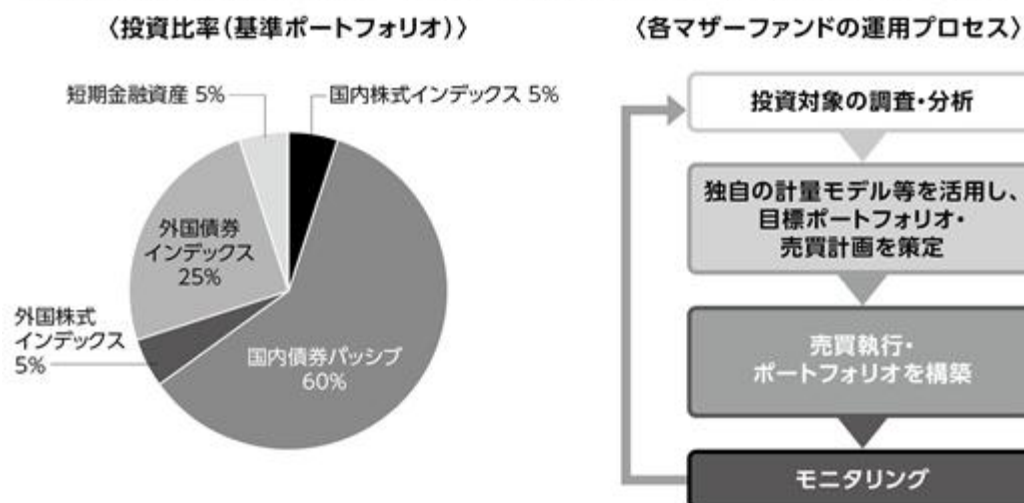
※2 NOMURA-BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

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

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

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

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



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

### ＜MSC I 指数にかかる免責条項等＞

当ファンドは、MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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。MSC I 指数は、MSC I Inc. が独占的に所有しています。MSC I Inc. およびMSC I 指数は、MSC I 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。MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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MSC I 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。MSC I 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、MSC I 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、MSC I Inc. により決定、作成および計算されています。MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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、MSC I 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。MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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。

MSC I Inc. は、自らが信頼できると考える情報源からMSC I 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、MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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、MSC I 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。MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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MSC I 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。MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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、MSC I 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。MSC I 指数およびそれに含まれるデータに関し、MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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、MSC I Inc.、MSC I Inc. の関連会社およびMSC I 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、MSC I Inc. の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSC I 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MSC I 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MSC I Inc. の書面による許諾を得ることなくMSC I Inc. との関係は一切主張することはできません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

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

## ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
	海 外	債 券
追 加 型	内 外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

## 属性区分表

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

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

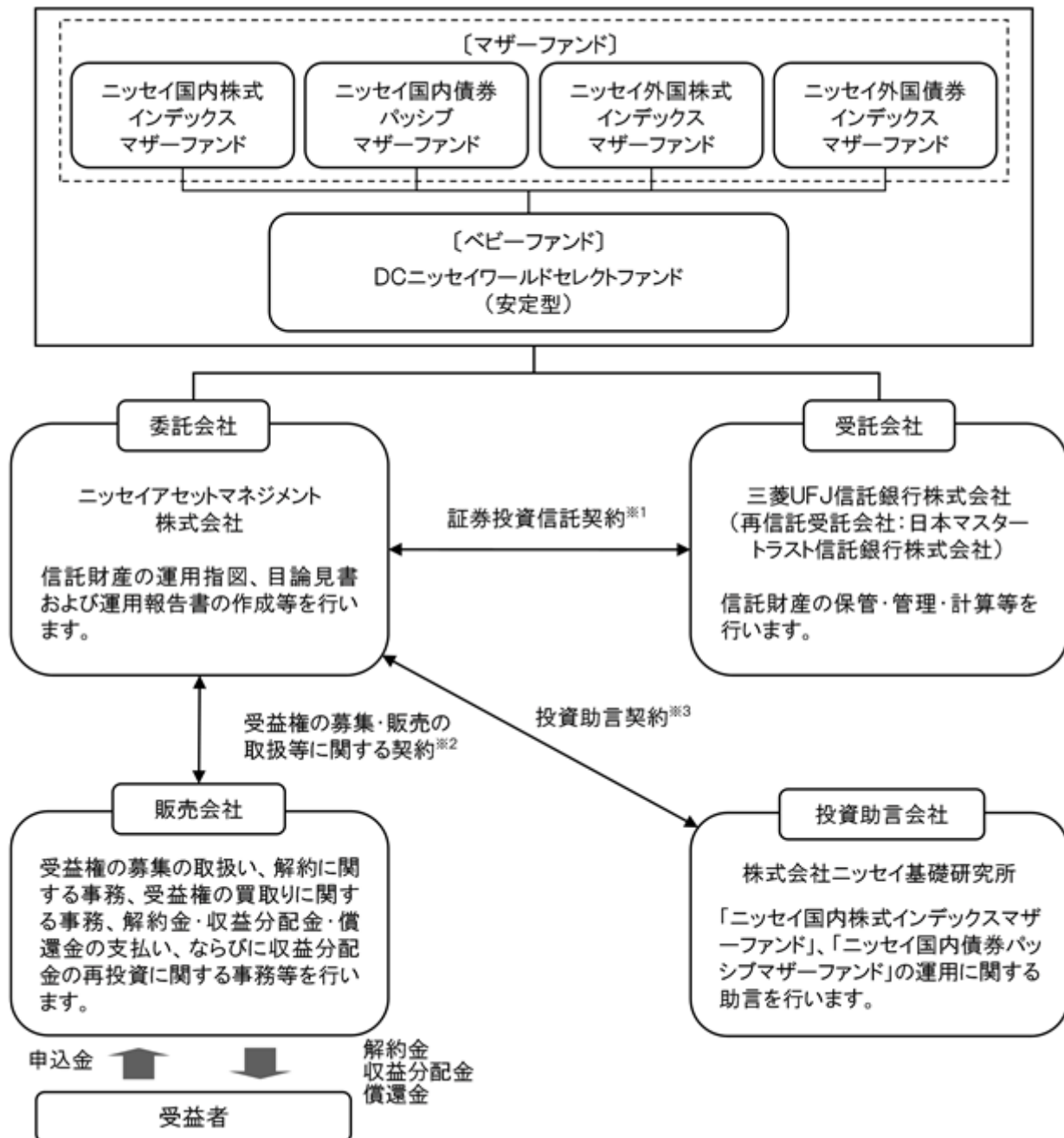
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、  
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年7月14日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始



## (3) 【ファンドの仕組み】



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

## 委託会社の概況（2021年8月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
- ・設立年月日：1995年4月4日
- ・資本金の額：100億円
- ・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。

## ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

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

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

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## イ. 有価証券

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

## ハ. 約束手形

## ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

## イ. 為替手形

## 有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます)の新株引受権証券を除きます)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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。

#### 金融商品

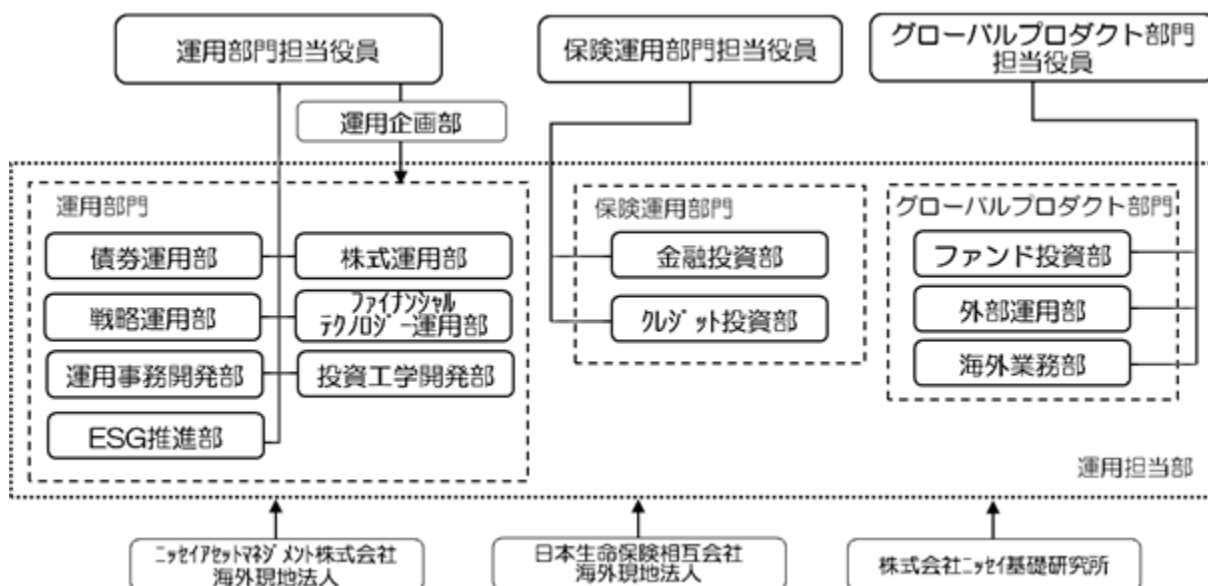
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

### （3）【運用体制】

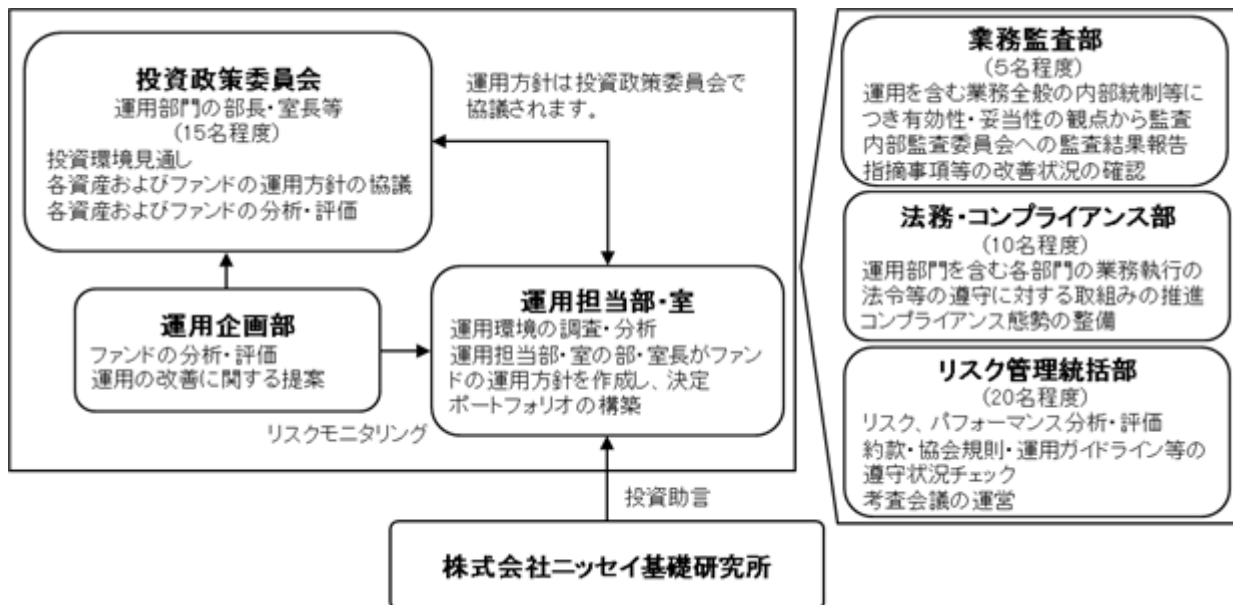
#### 委託会社の組織体制



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



## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

## 1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

## 2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

## 3. 留保益の運用方針

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

## 分配時期

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

## 支払方法

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

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。

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

## a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。

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

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

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

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

#### b 約款に定めるその他の投資制限

##### 投資する株式等の範囲

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

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

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

##### 信用取引の範囲

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

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

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

##### 先物取引等

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

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

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

##### スワップ取引

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

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

3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属すると

みなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

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

有価証券の空売り

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

有価証券の借入れ

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

外国為替予約等

1. 外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
2. 前記1.の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財

産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。

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

#### 資金の借入れ

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

#### c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

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

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

##### ・流動性リスク

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

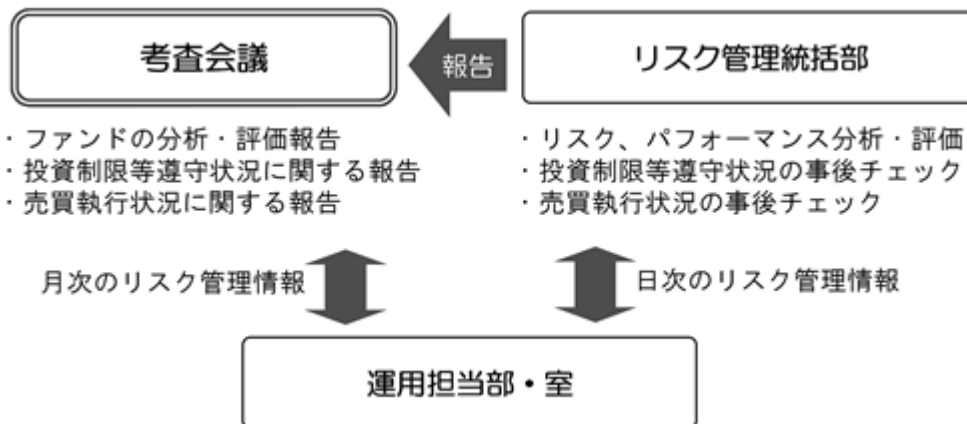
##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2021年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に7.4%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

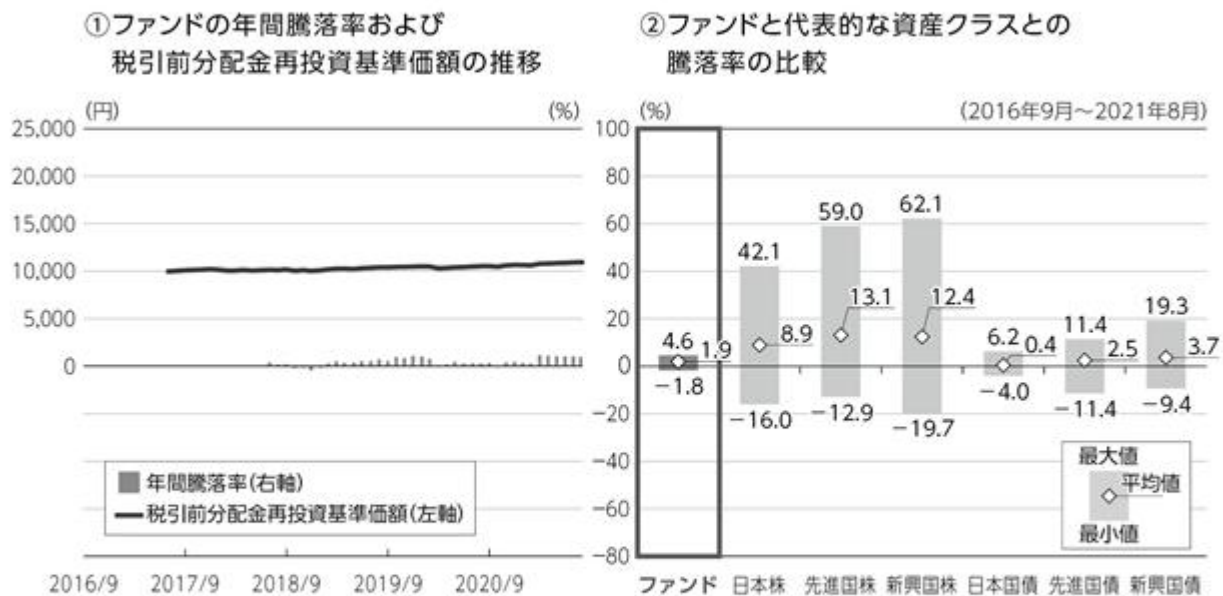
(2) 投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

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

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

##### (4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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



## &lt;ご参考&gt;

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

### 確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

### 確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

#### 課税対象

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

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

#### 個人の課税の取扱い

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

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

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

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

#### 税率（個人）

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

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

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

#### < 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

## 法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	7,401,548,708	95.01
内 日本	7,401,548,708	95.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	388,617,498	4.99
純資産総額	7,790,166,206	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8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	150,524,397,720	97.36
内 日本	150,524,397,720	97.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,075,930,787	2.64
純資産総額	154,600,328,507	100.00

その他資産の投資状況

2021年8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）	3,987,935,000	2.58
内 日本	3,987,935,000	2.58

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	57,355,113,420	74.27
内 日本	57,355,113,420	74.27
地方債証券	5,209,309,300	6.75
内 日本	5,209,309,300	6.75
特殊債券	8,660,390,449	11.21
内 日本	8,660,390,449	11.21
社債券	5,310,269,900	6.88
内 日本	4,706,052,300	6.09
内 フランス	401,733,400	0.52
内 スウェーデン	202,484,200	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	694,563,269	0.90
純資産総額	77,229,646,338	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	435,324,064,366	94.38
内 アメリカ	306,598,300,763	66.47
内 イギリス	18,496,717,893	4.01
内 カナダ	15,493,523,491	3.36
内 スイス	15,395,891,179	3.34
内 フランス	14,476,963,178	3.14
内 ドイツ	12,644,818,493	2.74
内 オランダ	9,175,785,800	1.99
内 オーストラリア	8,680,954,403	1.88
内 アイルランド	6,645,057,386	1.44
内 スウェーデン	5,283,797,225	1.15
内 デンマーク	3,813,422,015	0.83
内 香港	3,619,428,901	0.78
内 スペイン	3,252,847,741	0.71
内 イタリア	2,848,976,885	0.62
内 フィンランド	1,509,920,365	0.33
内 ベルギー	1,259,658,881	0.27
内 シンガポール	1,225,295,988	0.27
内 ノルウェー	881,361,240	0.19
内 ジャージー	820,071,141	0.18
内 バミューダ	754,702,975	0.16
内 イスラエル	639,560,229	0.14
内 ケイマン諸島	346,667,070	0.08
内 ニュージーランド	336,417,631	0.07
内 オランダ領キュラソー	312,951,024	0.07
内 オーストリア	277,112,265	0.06
内 ポルトガル	257,820,199	0.06
内 ルクセンブルグ	230,058,980	0.05
内 パプアニューギニア	45,981,025	0.01
投資証券	9,991,502,879	2.17
内 アメリカ	8,483,751,461	1.84
内 オーストラリア	629,585,714	0.14
内 イギリス	271,078,021	0.06
内 フランス	220,847,864	0.05
内 シンガポール	179,215,766	0.04
内 香港	152,963,383	0.03
内 カナダ	54,060,670	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,947,104,984	3.46
純資産総額	461,262,672,229	100.00

## その他資産の投資状況

2021年8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）	14,824,682,933	3.21
内 アメリカ	10,990,760,508	2.38
内 ドイツ	2,743,970,644	0.59
内 イギリス	1,089,951,781	0.24

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	42,508,932,679	99.38
内 アメリカ	19,231,216,467	44.96
内 フランス	4,375,922,570	10.23
内 イタリア	4,089,188,154	9.56
内 ドイツ	3,190,803,714	7.46
内 イギリス	2,711,539,492	6.34
内 スペイン	2,550,294,051	5.96
内 ベルギー	1,029,446,482	2.41
内 カナダ	858,666,311	2.01
内 オランダ	810,952,907	1.90
内 オーストラリア	810,024,273	1.89
内 オーストリア	641,389,340	1.50
内 アイルランド	355,289,987	0.83
内 メキシコ	305,666,309	0.71
内 フィンランド	264,148,794	0.62
内 ポーランド	248,617,598	0.58
内 デンマーク	217,620,601	0.51
内 イスラエル	202,982,645	0.47
内 マレーシア	195,239,169	0.46
内 シンガポール	189,909,446	0.44
内 スウェーデン	125,339,475	0.29
内 ノルウェー	104,674,894	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	265,003,642	0.62
純資産総額	42,773,936,321	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 【投資資産】  
【投資有価証券の主要銘柄】

2021年8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,727,693,934	0.9781 4,624,512,358	0.9871 4,666,706,682	- -	59.91
2	ニッセイ外国債券インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,284,402,807	1.4657 1,882,672,747	1.5105 1,940,090,439	- -	24.90
3	ニッセイ外国株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	143,896,043	2.3866 343,430,007	2.7720 398,879,831	- -	5.12
4	ニッセイ国内株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	181,367,919	2.1369 387,572,337	2.1827 395,871,756	- -	5.08

(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8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		95.01
	小計		95.01
合計(対純資産総額比)			95.01

(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。

(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8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	567,400	8,128.29 4,611,993,500	9,592.00 5,442,500,800	- -	3.52
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	350,800	11,948.31 4,191,470,200	11,360.00 3,985,088,000	- -	2.58
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,000	56,705.32 3,118,793,000	66,130.00 3,637,150,000	- -	2.35
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	436,100	10,394.68 4,533,123,100	6,181.00 2,695,534,100	- -	1.74
5	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービス 業	383,400	5,482.79 2,102,102,900	6,500.00 2,492,100,000	- -	1.61
6	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	3,778,600	565.25 2,135,860,660	594.40 2,245,999,840	- -	1.45

7	ダイキン工業 日本	株式 機械	71,400	22,126.22 1,579,812,200	27,405.00 1,956,717,000	- -	1.27
8	HOYA 日本	株式 精密機器	109,300	13,131.00 1,435,218,600	17,780.00 1,943,354,000	- -	1.26
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	642,800	2,821.44 1,813,625,750	2,936.00 1,887,260,800	- -	1.22
10	信越化学工業 日本	株式 化学	101,400	18,723.36 1,898,549,500	18,205.00 1,845,987,000	- -	1.19
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	466,000	3,689.80 1,719,451,400	3,679.00 1,714,414,000	- -	1.11
12	日本電産 日本	株式 電気機器	134,800	14,546.14 1,960,820,100	12,620.00 1,701,176,000	- -	1.10
13	任天堂 日本	株式 その他製品	32,100	67,733.02 2,174,230,200	52,900.00 1,698,090,000	- -	1.10
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	269,300	4,990.06 1,343,825,200	6,085.00 1,638,690,500	- -	1.06
15	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	32,800	46,342.42 1,520,031,500	47,240.00 1,549,472,000	- -	1.00
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	164,500	9,827.61 1,616,643,200	9,119.00 1,500,075,500	- -	0.97
17	KDDI 日本	株式 情報・通信業	440,700	3,398.14 1,497,564,400	3,370.00 1,485,159,000	- -	0.96
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	441,000	3,003.25 1,324,434,900	3,342.00 1,473,822,000	- -	0.95
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	382,300	3,767.34 1,440,257,200	3,801.00 1,453,122,300	- -	0.94
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	385,800	3,253.00 1,255,008,100	3,311.00 1,277,383,800	- -	0.83
21	ファナック 日本	株式 電気機器	49,200	27,510.48 1,353,515,900	23,990.00 1,180,308,000	- -	0.76
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	750,600	1,590.05 1,193,498,450	1,543.00 1,158,175,800	- -	0.75
23	SMC 日本	株式 機械	16,400	65,852.18 1,079,975,800	70,510.00 1,156,364,000	- -	0.75
24	第一三共 日本	株式 医薬品	440,100	3,231.41 1,422,144,660	2,614.50 1,150,641,450	- -	0.74
25	三菱商事 日本	株式 卸売業	335,800	2,985.61 1,002,570,800	3,311.00 1,111,833,800	- -	0.72
26	三井物産 日本	株式 卸売業	440,000	2,223.30 978,253,050	2,429.00 1,068,760,000	- -	0.69
27	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	215,800	4,234.38 913,781,000	4,815.00 1,039,077,000	- -	0.67
28	富士通 日本	株式 電気機器	50,400	16,062.96 809,573,300	20,300.00 1,023,120,000	- -	0.66



29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	181,900	5,345.75 972,392,300	5,377.00 978,076,300	- -	0.63
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	123,300	6,707.77 827,068,900	7,710.00 950,643,000	- -	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2021年8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	17.88
		情報・通信業	8.21
		輸送用機器	7.55
		化学	6.93
		サービス業	5.79
		機械	5.49
		医薬品	5.10
		銀行業	4.78
		卸売業	4.71
		小売業	4.32
		食料品	3.35
		陸運業	3.12
		精密機器	2.92
		建設業	2.22
		その他製品	2.16
		不動産業	1.91
		保険業	1.87
		電気・ガス業	1.15
		その他金融業	1.11
		鉄鋼	0.88
		ガラス・土石製品	0.77
		証券、商品先物取引業	0.72
		ゴム製品	0.69
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.61
		海運業	0.51
繊維製品	0.47		
空運業	0.44		
石油・石炭製品	0.38		
パルプ・紙	0.22		
鉱業	0.18		
倉庫・運輸関連業	0.18		
水産・農林業	0.09		
	小計		97.36
合 計 (対純資産総額比)			97.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債 券	1,000,000,000	101.77 1,017,724,000	101.39 1,013,997,000	0.828 2023/5/19	1.31
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	770,000,000	100.83 776,420,700	101.38 780,664,500	0.1 2028/3/20	1.01
3	第127回 利付国債(2 0年) 日本	国債証 券	575,000,000	117.57 676,044,750	118.08 678,983,000	1.9 2031/3/20	0.88
4	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	641,000,000	100.77 645,935,700	101.43 650,217,580	0.1 2028/6/20	0.84
5	第334回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	618,000,000	102.31 632,325,240	102.06 630,761,700	0.6 2024/6/20	0.82
6	第328回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	613,000,000	101.43 621,811,300	101.13 619,939,160	0.6 2023/3/20	0.80
7	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	597,000,000	100.86 602,135,660	101.36 605,143,080	0.1 2027/12/20	0.78
8	第338回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	585,000,000	101.96 596,493,490	101.88 596,050,650	0.4 2025/3/20	0.77
9	第352回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	576,000,000	100.67 579,899,520	101.45 584,386,560	0.1 2028/9/20	0.76
10	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	566,000,000	102.20 578,474,640	102.15 578,214,280	0.4 2025/9/20	0.75
11	第354回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	568,000,000	100.52 570,953,600	101.48 576,417,760	0.1 2029/3/20	0.75
12	第358回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	557,000,000	100.17 557,946,900	101.33 564,413,670	0.1 2030/3/20	0.73
13	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	552,000,000	101.79 561,924,960	101.85 562,261,680	0.3 2025/12/20	0.73
14	第353回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	543,000,000	100.62 546,372,030	101.47 550,987,530	0.1 2028/12/20	0.71
15	第339回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	536,000,000	102.08 547,154,160	102.02 546,843,280	0.4 2025/6/20	0.71

16	第344回 利付国債（10年） 日本	国債証券	533,000,000	100.83 537,429,230	101.11 538,958,940	0.1 2026/9/20	0.70
17	第345回 利付国債（10年） 日本	国債証券	532,000,000	100.84 536,468,800	101.17 538,240,360	0.1 2026/12/20	0.70
18	第327回 利付国債（10年） 日本	国債証券	531,000,000	101.62 539,602,200	101.20 537,398,550	0.8 2022/12/20	0.70
19	第346回 利付国債（10年） 日本	国債証券	523,000,000	100.81 527,262,450	101.22 529,422,440	0.1 2027/3/20	0.69
20	第342回 利付国債（10年） 日本	国債証券	510,000,000	100.83 514,238,100	101.02 515,247,900	0.1 2026/3/20	0.67
21	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	101.95 509,752,000	101.91 509,584,500	0.66 2024/5/31	0.66
22	第348回 利付国債（10年） 日本	国債証券	499,000,000	100.81 503,076,830	101.34 505,691,590	0.1 2027/9/20	0.65
23	第190回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	101.23 506,158,500	101.09 505,475,500	0.605 2023/5/31	0.65
24	第335回 利付国債（10年） 日本	国債証券	480,000,000	102.09 490,070,100	101.93 489,264,000	0.5 2024/9/20	0.63
25	第113回 利付国債（20年） 日本	国債証券	403,000,000	117.35 472,920,500	117.57 473,815,160	2.1 2029/9/20	0.61
26	第70回 利付国債（20年） 日本	国債証券	437,000,000	108.03 472,091,100	107.10 468,066,330	2.4 2024/6/20	0.61
27	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	461,000,000	100.82 464,780,200	101.08 466,006,460	0.1 2026/6/20	0.60
28	第361回 利付国債（10年） 日本	国債証券	457,000,000	99.86 456,370,870	101.02 461,679,680	0.1 2030/12/20	0.60
29	第363回 利付国債（10年） 日本	国債証券	450,000,000	100.80 453,603,000	100.78 453,519,000	0.1 2031/6/20	0.59
30	第347回 利付国債（10年） 日本	国債証券	433,000,000	100.82 436,552,660	101.28 438,559,720	0.1 2027/6/20	0.57

（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8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	74.27
		特殊債券	11.21

		地方債証券	6.75
		社債券	6.09
	小計		98.32
	外国	社債券	0.78
	小計		0.78
合 計（対純資産総額比）			99.10

（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8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	1,207,826	13,799.73 16,667,678,929	16,827.88 20,325,160,651	- -	4.41
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	515,476	26,913.65 13,873,341,867	33,364.54 17,198,620,136	- -	3.73
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	30,795	356,659.86 10,983,340,487	376,030.54 11,579,860,571	- -	2.51
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・ エンターテインメント	173,041	34,692.43 6,003,213,648	41,834.53 7,239,089,597	- -	1.57
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・ エンターテインメント	21,619	251,453.22 5,436,167,228	317,809.91 6,870,732,638	- -	1.49
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・ エンターテインメント	21,220	255,608.68 5,424,016,230	319,741.96 6,784,924,412	- -	1.47
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	178,142	15,782.90 2,811,597,495	24,934.11 4,441,812,579	- -	0.96
8	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	55,246	62,603.87 3,458,613,895	80,327.00 4,437,745,939	- -	0.96
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	219,487	17,684.11 3,881,433,610	17,632.35 3,870,072,921	- -	0.84
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	189,114	18,687.33 3,534,036,112	19,085.23 3,609,284,942	- -	0.78

11	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	68,241	44,985.55 3,069,859,256	45,971.16 3,137,118,611	- -	0.68
12	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	122,041	24,744.90 3,019,892,827	25,412.17 3,101,327,493	- -	0.67
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	98,610	31,447.49 3,101,037,572	31,394.03 3,095,765,692	- -	0.67
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	207,234	13,146.34 2,724,369,849	14,025.90 2,906,643,775	- -	0.63
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	77,463	34,594.03 2,679,757,770	35,948.28 2,784,662,388	- -	0.60
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	177,198	15,020.83 2,661,662,764	15,708.00 2,783,427,424	- -	0.60
17	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	30,173	66,717.61 2,013,070,605	92,028.02 2,776,761,568	- -	0.60
18	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	130,609	18,659.68 2,437,123,310	19,779.80 2,583,420,159	- -	0.56
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	558,776	4,607.74 2,574,698,258	4,578.43 2,558,319,036	- -	0.55
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	80,031	27,125.86 2,170,910,379	31,702.85 2,537,211,028	- -	0.55
21	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	34,407	53,503.32 1,840,888,800	73,192.30 2,518,327,500	- -	0.55
22	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	63,805	39,714.29 2,533,970,820	38,800.19 2,475,646,441	- -	0.54
23	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	50,474	36,838.80 1,859,402,062	43,859.41 2,213,760,365	- -	0.48

24	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア・ ア・娯楽	328,719	5,986.70 1,967,945,323	6,562.12 2,157,096,482	- -	0.47
25	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	401,335	4,388.84 1,761,397,896	5,138.92 2,062,430,063	- -	0.45
26	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	68,710	24,366.86 1,674,247,453	29,120.20 2,000,849,148	- -	0.43
27	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア ア・娯楽	31,864	53,762.95 1,713,102,728	62,223.18 1,982,679,471	- -	0.43
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	303,621	5,779.50 1,754,779,737	6,498.38 1,973,046,759	- -	0.43
29	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	304,561	6,495.30 1,978,216,299	6,062.08 1,846,274,365	- -	0.40
30	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	294,813	5,962.58 1,757,848,347	6,174.18 1,820,229,117	- -	0.39

(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8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	12.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.51
		メディア・娯楽	7.45
		資本財	6.22
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.93
		銀行	5.71
		小売	5.27
		ヘルスケア機器・サービス	5.02
		半導体・半導体製造装置	4.62
		各種金融	4.60
		素材	4.14
		食品・飲料・タバコ	3.63
		保険	2.92
		エネルギー	2.87
		公益事業	2.79
		耐久消費財・アパレル	1.89
		自動車・自動車部品	1.84
		運輸	1.83
		消費者サービス	1.73
		家庭用品・パーソナル用品	1.64
電気通信サービス	1.56		
食品・生活必需品小売り	1.36		
商業・専門サービス	1.22		
不動産	0.45		
	小計		94.38
投資証券	外国		2.17
	小計		2.17
合 計（対純資産総額比）			96.54

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

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	519,827,000	106.20 552,073,078	105.82 550,101,724	2.5 2024/5/15	1.29
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	407,729,000	106.65 434,855,929	106.00 432,221,281	2.75 2024/2/15	1.01
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	353,878,000	103.06 364,721,631	102.70 363,468,093	1.75 2023/5/15	0.85
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	331,898,000	106.12 352,219,828	105.48 350,099,286	2.75 2023/11/15	0.82
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	334,096,000	103.89 347,098,976	104.07 347,720,434	1.625 2026/5/15	0.81
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	323,106,000	103.74 335,197,742	104.04 336,169,175	1.625 2026/2/15	0.79
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	302,225,000	106.64 322,302,806	106.62 322,235,317	2.25 2025/11/15	0.75
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	307,720,000	105.03 323,226,417	104.48 321,530,473	2.5 2023/8/15	0.75
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	303,324,000	105.52 320,092,509	105.44 319,827,858	2 2025/8/15	0.75
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	301,126,000	105.13 316,594,426	104.59 314,956,717	2.25 2023/12/31	0.74
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	286,839,000	106.29 304,902,930	105.83 303,587,529	2.375 2024/8/15	0.71
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	279,146,000	106.71 297,888,931	106.92 298,465,694	2.25 2026/3/31	0.70
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	281,344,000	105.14 295,831,028	104.63 294,398,361	2.125 2024/3/31	0.69
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	280,245,000	103.20 289,221,247	102.71 287,850,849	2 2023/2/15	0.67
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	271,453,000	105.96 287,644,665	105.72 286,996,398	2.125 2025/5/15	0.67
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	269,255,000	106.11 285,729,625	105.76 284,766,780	2.25 2024/11/15	0.67
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	267,057,000	105.38 281,430,007	105.12 280,732,988	2 2025/2/15	0.66
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	274,750,000	102.32 281,134,574	101.94 280,104,877	1.625 2022/12/15	0.65
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	279,146,000	100.13 279,531,562	100.12 279,494,932	0.25 2023/6/15	0.65
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	272,552,000	102.48 279,316,806	102.14 278,406,416	1.5 2023/3/31	0.65
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	265,958,000	103.18 274,425,685	102.65 273,032,482	2.125 2022/12/31	0.64
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	250,572,000	108.38 271,579,956	108.33 271,467,199	2.625 2025/12/31	0.63



23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	242,879,000	109.57 266,126,010	111.05 269,736,559	2.75 2028/2/15	0.63
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	234,087,000	106.37 249,000,682	107.83 252,420,693	2.25 2027/11/15	0.59
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	247,275,000	102.35 253,097,050	102.04 252,334,246	1.5 2023/2/28	0.59
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	227,493,000	109.85 249,921,150	109.54 249,209,481	3 2025/9/30	0.58
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	226,394,000	107.44 243,252,976	108.35 245,318,274	2.375 2027/5/15	0.57
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	239,582,000	102.45 245,456,374	102.19 244,831,241	1.375 2023/6/30	0.57
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	237,384,000	102.22 242,658,672	101.83 241,749,491	1.625 2022/11/15	0.57
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	231,889,000	101.94 236,389,965	101.56 235,511,106	1.625 2022/8/31	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8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	99.38
	小計		99.38
合計(対純資産総額比)			99.38

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【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8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物 0 309月	買建	203	3,937,226,650	3,987,935,000	2.58

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年8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 202109	買建	442	10,641,484,295	10,990,760,508	2.38
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202109	買建	504	2,688,715,960	2,743,970,644	0.59
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202109	買建	101	1,074,834,311	1,089,951,781	0.24

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（2021年8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2月21日)	27,072,959	27,072,959	1.0066	1.0066
第2計算期間末 (2019年2月21日)	459,363,791	459,363,791	1.0190	1.0190
第3計算期間末 (2020年2月21日)	3,187,112,052	3,187,112,052	1.0590	1.0590
第4計算期間末 (2021年2月22日)	5,944,766,656	5,944,766,656	1.0669	1.0669
2020年8月末日	4,748,250,687	-	1.0527	-
9月末日	4,947,011,775	-	1.0541	-
10月末日	5,142,220,103	-	1.0460	-
11月末日	5,319,944,459	-	1.0610	-
12月末日	5,662,231,035	-	1.0663	-
2021年1月末日	5,801,810,445	-	1.0654	-
2月末日	5,913,274,404	-	1.0612	-
3月末日	6,456,610,506	-	1.0780	-
4月末日	6,665,968,730	-	1.0800	-
5月末日	6,903,624,128	-	1.0852	-
6月末日	7,269,511,118	-	1.0872	-
7月末日	7,576,955,612	-	1.0917	-
8月末日	7,790,166,206	-	1.0940	-

## 【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
第4計算期間	0.0000
2021年2月23日～2021年8月22日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	1.2
第3計算期間	3.9
第4計算期間	0.7
2021年2月23日～2021年8月22日	2.2

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	32,130,976	5,235,210	26,895,766
第2計算期間	452,842,888	28,932,225	450,806,429
第3計算期間	2,737,365,208	178,488,494	3,009,683,143
第4計算期間	3,158,136,127	595,621,118	5,572,198,152
2021年2月23日 ~ 2021年8月22日	1,931,338,631	413,852,437	7,089,684,346

(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。

&lt; 参考情報 &gt;

## 3. 運用実績

2021年8月末現在

### ● 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,940円
純資産総額	77億円

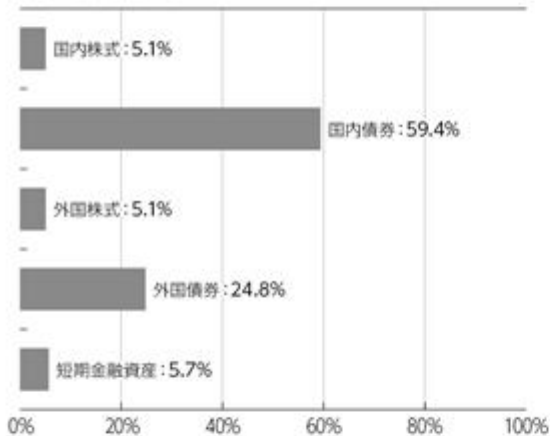
### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

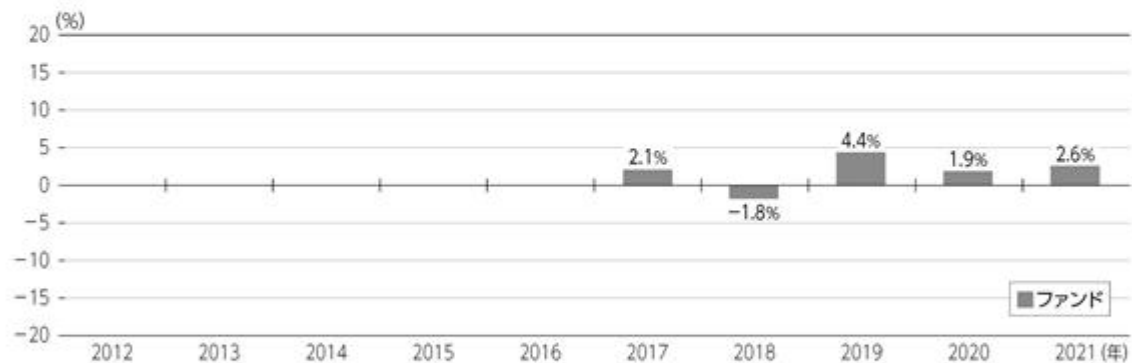
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

### ● 資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

### ● 年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2017年はファンド設定時から年末まで、2021年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

#### 取扱コース

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

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

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

ありません。

#### その他

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

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

#### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

**換金単位**

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

**換金価額****< 解約請求の場合 >**

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

**< 買取請求の場合 >**

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

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

換金手数料はありません。

**信託財産留保額**

ありません。

**支払開始日**

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

**その他**

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

#### (5)【その他】

繰上償還

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

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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



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

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

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

### 第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2020年2月22日から2021年2月22日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2020年2月21日現在)	第4期 (2021年2月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,581,120	5,639,420
コール・ローン	153,741,532	288,331,485
親投資信託受益証券	3,032,107,808	5,655,922,357
未収入金	371,078	15,200,734
流動資産合計	3,189,801,538	5,965,093,996
資産合計	3,189,801,538	5,965,093,996
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	362,482	15,947,898
未払受託者報酬	306,165	594,057
未払委託者報酬	1,896,986	3,564,606
その他未払費用	123,853	220,779
流動負債合計	2,689,486	20,327,340
負債合計	2,689,486	20,327,340
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,009,683,143	5,572,198,152
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	177,428,909	372,568,504
純資産合計	3,187,112,052	5,944,766,656
負債純資産合計	3,189,801,538	5,965,093,996

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 (自2019年2月22日 至2020年2月21日)	第4期 (自2020年2月22日 至2021年2月22日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	2,348	7,066
有価証券売買等損益	82,144,386	79,602,831
営業収益合計	82,146,734	79,609,897
<b>営業費用</b>		
支払利息	63,497	130,668
受託者報酬	422,054	1,012,576
委託者報酬	2,708,419	6,075,953
その他費用	179,444	391,248
営業費用合計	3,373,414	7,610,445
営業利益又は営業損失（ ）	78,773,320	71,999,452
経常利益又は経常損失（ ）	78,773,320	71,999,452
当期純利益又は当期純損失（ ）	78,773,320	71,999,452
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（ ）	1,729,597	2,029
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,557,362	177,428,909
剰余金増加額又は欠損金減少額	97,065,414	155,229,124
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	97,065,414	155,229,124
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,237,590	32,091,010
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,237,590	32,091,010
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（ ）	177,428,909	372,568,504

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間  当ファンドは、原則として毎年2月21日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2020年2月22日から2021年2月22日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第3期 2020年2月21日現在	第4期 2021年2月22日現在
1 . 受益権総口数	3,009,683,143口	5,572,198,152口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0590円 (10,590円)	1.0669円 (10,669円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第3期 自2019年2月22日 至2020年2月21日	第4期 自2020年2月22日 至2021年2月22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(77,095,740円)、収益調整金(96,625,470円)及び分配準備積立金(3,766,695円)より分配対象収益は177,487,905円(1口当たり0.058972円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(72,066,031円)、収益調整金(230,080,287円)及び分配準備積立金(70,538,191円)より分配対象収益は372,684,509円(1口当たり0.066883円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自2019年2月22日 至2020年2月21日	第4期 自2020年2月22日 至2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期
	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	2020年2月21日現在	2021年2月22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	77,359,060	77,563,705
合計	77,359,060	77,563,705

(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3期	第4期
	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
期首元本額	450,806,429円	3,009,683,143円
期中追加設定元本額	2,737,365,208円	3,158,136,127円
期中一部解約元本額	178,488,494円	595,621,118円

(4)【附属明細表】(2021年2月22日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	143,266,411	305,673,214	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	3,650,903,922	3,565,107,679	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	130,273,210	302,846,131	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	1,018,059,982	1,482,295,333	
親投資信託受益証券 合計		4,942,503,525	5,655,922,357	
合計		4,942,503,525	5,655,922,357	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

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

### 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

#### 貸借対照表

（単位：円）

	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,140,529	22,734,045
コール・ローン	1,293,967,064	1,162,343,035
株式	67,022,069,250	169,111,924,060
派生商品評価勘定	-	100,174,250
未収入金	4,810,000	-
未収配当金	108,315,429	221,013,500
前払金	17,845,000	-
差入委託証拠金	31,680,000	62,400,000
流動資産合計	68,508,827,272	170,680,588,890
資産合計	68,508,827,272	170,680,588,890
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,161,300	-
前受金	-	94,035,000
未払解約金	272,526,243	292,673,611
その他未払費用	3,324	3,774
流動負債合計	295,690,867	386,712,385
負債合計	295,690,867	386,712,385
純資産の部		
元本等		
元本	37,902,386,971	79,813,755,893
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,310,749,434	90,480,120,612
純資産合計	68,213,136,405	170,293,876,505
負債純資産合計	68,508,827,272	170,680,588,890

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	37,902,386,971口	79,813,755,893口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7997円 (17,997円)	2.1336円 (21,336円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日	自 2020年2月22日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年2月21日現在	2021年2月22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	19,228,350	36,295,243,081
合計	19,228,350	36,295,243,081

(デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 株式関連

種類	2020年2月21日 現在			2021年2月22日 現在			評価損益 (円)	評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)		
市場取引								
先物取引								
買 建	1,125,325,000	-	1,102,200,000	23,125,000	1,160,465,000	-	1,260,675,000	100,210,000
合計	1,125,325,000	-	1,102,200,000	23,125,000	1,160,465,000	-	1,260,675,000	100,210,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	34,479,781,252円	37,902,386,971円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	14,213,392,764円	61,439,207,773円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,790,787,045円	19,527,838,851円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,328,670,873円	5,791,943,526円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	4,348,214,857円	3,838,721,766円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,064,002円	3,845,110円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,533,758,682円	1,824,833,310円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,400,151,642円	6,083,058,971円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,650,003,285円	4,223,461,711円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	8,429,921円	4,505,216円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	35,456,926円	21,672,934円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	33,985,099円	28,960,592円
DCニッセイ国内株式インデックス	308,609,717円	492,190,490円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	15,005,800,254円	17,275,669,670円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	708,961,084円	1,180,490,320円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	95,260,690円	152,517,938円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,348,383円	143,266,411円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	69,517,201円	153,665,546円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	127,166,977円	328,688,648円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	32,079,078円	57,347,460円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	49,538,445円	56,221,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,858,143円	6,193,882円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	4,166,589円	6,520,617円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,136,629円	1,793,965円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	3,601,646円	4,798,597円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	19,343,945円	19,125,276円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	10,022,746円	51,866,593円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	7,973,243円	34,906,904円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	12,208,615円	112,843,783円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	12,058,299円	140,615,947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	37,763,633,451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	10,242,693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	50,342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	102,941円
計	37,902,386,971円	79,813,755,893円

附属明細表(2021年2月22日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	2,900	3,050.00	8,845,000	
日本水産	80,400	502.00	40,360,800	
マルハニチロ	13,600	2,480.00	33,728,000	
雪国まいたけ	5,400	1,768.00	9,547,200	
カネコ種苗	2,600	1,597.00	4,152,200	
サカタのタネ	10,400	3,880.00	40,352,000	
ホクト	7,300	2,145.00	15,658,500	
ヒノキヤグループ	2,100	2,191.00	4,601,100	
ショーボンドホールディングス	12,400	4,730.00	58,652,000	
ミライト・ホールディングス	30,000	1,712.00	51,360,000	
タマホーム	5,200	1,898.00	9,869,600	
ファーストコーポレーション	5,900	698.00	4,118,200	
スペースバリューホールディングス	10,600	814.00	8,628,400	
住石ホールディングス	2,400	124.00	297,600	
日鉄鉱業	2,000	5,990.00	11,980,000	
三井松島ホールディングス	5,300	932.00	4,939,600	
国際石油開発帝石	318,400	776.00	247,078,400	
石油資源開発	11,300	2,239.00	25,300,700	
K&Oエナジーグループ	4,200	1,464.00	6,148,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	846.00	2,707,200	
安藤・間	55,500	782.00	43,401,000	
東急建設	25,400	544.00	13,817,600	
コムシスホールディングス	30,700	3,250.00	99,775,000	
ビーアールホールディングス	10,200	684.00	6,976,800	
高松コンストラクショングループ	5,400	2,127.00	11,485,800	
東建コーポレーション	2,700	8,570.00	23,139,000	
ソネック	5,100	832.00	4,243,200	
ヤマウラ	4,500	953.00	4,288,500	
大成建設	62,200	3,790.00	235,738,000	
大林組	199,900	936.00	187,106,400	
清水建設	187,300	817.00	153,024,100	
飛鳥建設	5,700	1,119.00	6,378,300	
長谷工コーポレーション	65,500	1,354.00	88,687,000	
松井建設	7,900	716.00	5,656,400	
銭高組	1,000	4,575.00	4,575,000	
鹿島建設	146,500	1,421.00	208,176,500	
不動テトラ	4,900	1,805.00	8,844,500	
大末建設	5,000	926.00	4,630,000	
鉄建建設	4,000	1,966.00	7,864,000	
西松建設	14,300	2,596.00	37,122,800	
三井住友建設	48,300	460.00	22,218,000	
大豊建設	4,400	3,680.00	16,192,000	
前田建設工業	50,100	998.00	49,999,800	
佐田建設	9,600	427.00	4,099,200	
ナカノフドー建設	10,600	371.00	3,932,600	
奥村組	11,000	2,682.00	29,502,000	
東鉄工業	8,600	2,648.00	22,772,800	
浅沼組	2,400	4,530.00	10,872,000	
戸田建設	83,000	743.00	61,669,000	
熊谷組	9,300	2,800.00	26,040,000	
北野建設	1,700	2,478.00	4,212,600	
植木組	1,500	2,910.00	4,365,000	
矢作建設工業	8,800	847.00	7,453,600	
ピーエス三菱	6,800	685.00	4,658,000	
日本ハウスホールディングス	13,600	336.00	4,569,600	
大東建託	21,800	12,350.00	269,230,000	



新日本建設	8,500	846.00	7,191,000
N I P P O	16,500	2,832.00	46,728,000
東亜道路工業	1,200	4,140.00	4,968,000
前田道路	12,400	2,003.00	24,837,200
日本道路	1,900	8,010.00	15,219,000
東亜建設工業	5,300	2,170.00	11,501,000
日本国土開発	19,400	558.00	10,825,200
若築建設	3,600	1,277.00	4,597,200
東洋建設	22,400	553.00	12,387,200
五洋建設	84,900	795.00	67,495,500
世紀東急工業	9,600	890.00	8,544,000
福田組	2,300	5,020.00	11,546,000
住友林業	47,000	2,099.00	98,653,000
日本基礎技術	8,700	498.00	4,332,600
巴コーポレーション	10,500	397.00	4,168,500
大和ハウス工業	184,600	3,200.00	590,720,000
ライト工業	11,400	1,647.00	18,775,800
積水ハウス	216,800	2,081.00	451,160,800
日特建設	5,400	785.00	4,239,000
北陸電気工事	3,500	1,192.00	4,172,000
ユアテック	11,400	816.00	9,302,400
日本リーテック	4,200	2,494.00	10,474,800
四電工	1,500	2,804.00	4,206,000
中電工	9,200	2,211.00	20,341,200
関電工	32,500	884.00	28,730,000
きんでん	43,200	1,776.00	76,723,200
東京エネシス	6,600	918.00	6,058,800
トーエネック	2,000	3,735.00	7,470,000
住友電設	5,600	2,434.00	13,630,400
日本電設工業	11,000	1,932.00	21,252,000
協和エクシオ	30,300	2,722.00	82,476,600
新日本空調	5,300	2,270.00	12,031,000
日本工営	3,800	2,891.00	10,985,800
九電工	14,000	3,390.00	47,460,000
三機工業	14,200	1,296.00	18,403,200
日揮ホールディングス	66,700	1,355.00	90,378,500
中外炉工業	2,500	1,744.00	4,360,000
ヤマト	6,400	669.00	4,281,600
太平電業	4,400	2,663.00	11,717,200
高砂熱学工業	18,100	1,596.00	28,887,600
三晃金属工業	1,500	3,095.00	4,642,500
N E C ネットズエスアイ	20,700	1,889.00	39,102,300
朝日工業社	1,500	3,010.00	4,515,000
明星工業	12,900	806.00	10,397,400
大気社	9,700	2,947.00	28,585,900
ダイダン	4,400	2,809.00	12,359,600
日比谷総合設備	6,400	1,878.00	12,019,200
ニッポン	18,700	1,609.00	30,088,300
日清製粉グループ本社	72,300	1,727.00	124,862,100
昭和産業	5,400	3,245.00	17,523,000
鳥越製粉	5,700	859.00	4,896,300
中部飼料	7,800	1,443.00	11,255,400
フィード・ワン	8,600	914.00	7,860,400
日本甜菜製糖	3,300	1,685.00	5,560,500
三井製糖	5,000	1,938.00	9,690,000
塩水港精糖	18,900	228.00	4,309,200
日新製糖	3,000	1,870.00	5,610,000
L I F U L L	21,300	422.00	8,988,600
ミクシィ	11,600	2,747.00	31,865,200
ジェイエイシーリクルートメント	4,100	1,665.00	6,826,500

日本M & Aセンター	49,900	6,090.00	303,891,000
メンバーズ	1,800	2,785.00	5,013,000
UTグループ	8,800	3,285.00	28,908,000
アイティメディア	2,000	1,908.00	3,816,000
タケエイ	6,800	1,272.00	8,649,600
ビーネックスグループ	7,600	1,407.00	10,693,200
コシダカホールディングス	14,700	551.00	8,099,700
アルトナー	4,600	838.00	3,854,800
パソナグループ	6,600	1,923.00	12,691,800
CDS	3,000	1,389.00	4,167,000
リンクアンドモチベーション	11,200	531.00	5,947,200
GCA	8,000	796.00	6,368,000
エス・エム・エス	20,700	3,700.00	76,590,000
サニーサイドアップグループ	6,600	744.00	4,910,400
パーソルホールディングス	60,900	2,169.00	132,092,100
リニカル	5,300	792.00	4,197,600
クックパッド	19,100	311.00	5,940,100
アイ・ケイ・ケイ	6,900	610.00	4,209,000
森永製菓	15,000	3,980.00	59,700,000
中村屋	1,500	3,970.00	5,955,000
江崎グリコ	17,600	4,480.00	78,848,000
名糖産業	3,000	1,515.00	4,545,000
井村屋グループ	3,600	2,516.00	9,057,600
不二家	4,100	2,278.00	9,339,800
山崎製パン	48,000	1,887.00	90,576,000
モロゾフ	1,000	5,650.00	5,650,000
亀田製菓	3,600	4,810.00	17,316,000
寿スピリッツ	6,200	6,820.00	42,284,000
カルビー	29,200	2,903.00	84,767,600
森永乳業	11,800	4,830.00	56,994,000
六甲バター	4,200	1,738.00	7,299,600
ヤクルト本社	44,000	5,530.00	243,320,000
明治ホールディングス	42,300	6,970.00	294,831,000
雪印メグミルク	15,400	2,189.00	33,710,600
プリマハム	9,000	3,340.00	30,060,000
日本ハム	24,500	4,665.00	114,292,500
林兼産業	7,100	626.00	4,444,600
丸大食品	6,300	1,698.00	10,697,400
S Foods	5,700	3,465.00	19,750,500
柿安本店	2,200	2,724.00	5,992,800
伊藤ハム米久ホールディングス	41,200	745.00	30,694,000
学情	3,200	1,416.00	4,531,200
スタジオアリス	3,100	2,139.00	6,630,900
クロスキャット	3,500	1,144.00	4,004,000
シミックホールディングス	3,000	1,717.00	5,151,000
システナ	22,300	1,947.00	43,418,100
NJS	2,100	1,883.00	3,954,300
デジタルアーツ	3,600	10,990.00	39,564,000
日鉄ソリューションズ	9,400	3,225.00	30,315,000
総合警備保障	24,200	4,970.00	120,274,000
キューブシステム	3,300	1,172.00	3,867,600
いちご	70,000	338.00	23,660,000
日本駐車場開発	62,100	142.00	8,818,200
コア	2,800	1,541.00	4,314,800
カカクコム	45,000	3,530.00	158,850,000
アイロムグループ	2,300	1,932.00	4,443,600
セントケア・ホールディング	4,400	940.00	4,136,000
ルネサンス	4,500	1,174.00	5,283,000
ディップ	9,500	3,025.00	28,737,500
SBSホールディングス	4,700	2,541.00	11,942,700

デジタルホールディングス	4,200	1,971.00	8,278,200
新日本科学	7,400	650.00	4,810,000
ツクイホールディングス	14,300	924.00	13,213,200
ベネフィット・ワン	22,200	2,931.00	65,068,200
エムスリー	107,500	8,800.00	946,000,000
ツカダ・グローバルホールディング	15,200	354.00	5,380,800
アウトソーシング	34,900	1,483.00	51,756,700
ウェルネット	8,600	529.00	4,549,400
ワールドホールディングス	2,100	2,465.00	5,176,500
ディー・エヌ・エー	25,800	2,253.00	58,127,400
博報堂DYホールディングス	84,800	1,818.00	154,166,400
ぐるなび	10,500	637.00	6,688,500
タカミヤ	7,600	510.00	3,876,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	886.00	4,430,000
ファンコミュニケーションズ	16,700	406.00	6,780,200
ライク	2,000	1,966.00	3,932,000
ビジネス・ブレークスルー	9,200	435.00	4,002,000
エスプール	15,600	1,018.00	15,880,800
WDBホールディングス	2,800	2,700.00	7,560,000
アドウェイズ	7,400	965.00	7,141,000
パリュコマース	4,100	3,080.00	12,628,000
インフォマート	61,600	1,048.00	64,556,800
サッポロホールディングス	21,800	2,244.00	48,919,200
アサヒグループホールディングス	139,800	4,548.00	635,810,400
麒麟ホールディングス	271,300	2,115.00	573,799,500
宝ホールディングス	47,400	1,499.00	71,052,600
オエノンホールディングス	18,200	400.00	7,280,000
養命酒製造	2,200	1,924.00	4,232,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	49,000	1,832.00	89,768,000
サントリー食品インターナショナル	42,800	3,770.00	161,356,000
ダイトーグループホールディングス	3,600	5,410.00	19,476,000
伊藤園	19,400	6,310.00	122,414,000
キーコーヒー	6,300	2,157.00	13,589,100
日清オイリオグループ	8,200	3,195.00	26,199,000
不二製油グループ本社	15,600	3,190.00	49,764,000
かどや製油	1,100	4,095.00	4,504,500
J・オイルミルズ	3,000	3,805.00	11,415,000
ローソン	15,900	5,150.00	81,885,000
サンエー	4,700	4,220.00	19,834,000
カワチ薬品	4,400	2,974.00	13,085,600
エービーシー・マート	9,800	6,130.00	60,074,000
ハードオフコーポレーション	5,500	808.00	4,444,000
アスクル	5,500	3,735.00	20,542,500
ゲオホールディングス	8,400	1,172.00	9,844,800
アダストリア	8,700	2,056.00	17,887,200
ジーフット	10,100	419.00	4,231,900
オルパヘルスケアホールディングス	2,700	1,560.00	4,212,000
伊藤忠食品	1,500	5,270.00	7,905,000
くら寿司	3,700	7,640.00	28,268,000
キャンドゥ	3,000	1,915.00	5,745,000
エレマテック	5,000	988.00	4,940,000
パルグループホールディングス	5,500	1,640.00	9,020,000
エディオン	26,600	1,076.00	28,621,600
あらた	5,000	4,635.00	23,175,000
サーラコーポレーション	12,700	584.00	7,416,800
トーメンデバイス	1,100	3,970.00	4,367,000
ハローズ	2,400	3,000.00	7,200,000
J Pホールディングス	17,400	293.00	5,098,200
フジオフードグループ本社	5,300	1,296.00	6,868,800

あみやき亭	1,500	2,934.00	4,401,000
東京エレクトロン デバイス	2,100	3,915.00	8,221,500
双日	346,800	281.00	97,450,800
アルフレッサ ホールディングス	65,100	2,171.00	141,332,100
大黒天物産	1,500	6,170.00	9,255,000
ハニーズホールディングス	5,000	1,033.00	5,165,000
キッコーマン	46,000	7,400.00	340,400,000
味の素	152,200	2,267.50	345,113,500
キュービー	35,600	2,394.00	85,226,400
ハウス食品グループ本社	23,900	3,720.00	88,908,000
カゴメ	26,100	3,340.00	87,174,000
アリアケジャパン	5,800	6,800.00	39,440,000
ピエトロ	2,400	1,780.00	4,272,000
エバラ食品工業	900	2,647.00	2,382,300
ニチレイ	30,500	2,807.00	85,613,500
横浜冷凍	16,400	901.00	14,776,400
東洋水産	32,900	4,615.00	151,833,500
イトアンドホールディングス	2,300	1,940.00	4,462,000
大冷	2,100	1,962.00	4,120,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	957.00	4,689,300
日清食品ホールディングス	25,100	8,340.00	209,334,000
永谷園ホールディングス	3,100	2,358.00	7,309,800
一正蒲鉾	3,700	1,157.00	4,280,900
フジッコ	6,900	2,003.00	13,820,700
ロック・フィールド	6,900	1,555.00	10,729,500
日本たばこ産業	343,100	1,936.50	664,413,150
ケンコーマヨネーズ	3,900	2,024.00	7,893,600
わらべや日洋ホールディングス	4,200	1,716.00	7,207,200
なとり	3,600	2,019.00	7,268,400
ビックスコーポレーション	1,500	3,580.00	5,370,000
北の達人コーポレーション	22,300	636.00	14,182,800
ユーグレナ	27,700	990.00	27,423,000
スター・マイカ・ホールディングス	3,700	1,194.00	4,417,800
A Dワークスグループ	26,800	157.00	4,207,600
片倉工業	8,400	1,391.00	11,684,400
ゲンゼ	4,600	3,790.00	17,434,000
ヒューリック	133,400	1,199.00	159,946,600
ラサ商事	4,600	913.00	4,199,800
アルペン	4,800	2,320.00	11,136,000
ラクーンホールディングス	4,400	2,231.00	9,816,400
クオールホールディングス	8,500	1,445.00	12,282,500
アルコニックス	6,700	1,633.00	10,941,100
神戸物産	43,300	2,924.00	126,609,200
ソリトンシステムズ	3,100	1,862.00	5,772,200
ジーンズホールディングス	3,300	7,320.00	24,156,000
ビックカメラ	37,200	1,184.00	44,044,800
D C Mホールディングス	38,700	1,101.00	42,608,700
MonotaRO	44,600	6,860.00	305,956,000
東京一番フーズ	7,200	596.00	4,291,200
あい ホールディングス	9,000	2,041.00	18,369,000
ディー・ビー・エックス	4,100	1,044.00	4,280,400
きちりホールディングス	7,200	608.00	4,377,600
アークランドサービスホールディングス	5,200	2,146.00	11,159,200
J . フロント リテイリング	75,000	1,012.00	75,900,000
ドトール・日レスホールディングス	9,900	1,655.00	16,384,500
マツモトキヨシホールディングス	26,000	4,280.00	111,280,000
ブロンコビリー	3,300	2,319.00	7,652,700
Z O Z O	37,000	3,590.00	132,830,000
トレジャー・ファクトリー	5,700	808.00	4,605,600
物語コーポレーション	1,700	12,300.00	20,910,000

ココカラファイン	5,600	7,440.00	41,664,000
三越伊勢丹ホールディングス	109,800	732.00	80,373,600
東洋紡	24,700	1,342.00	33,147,400
ユニチカ	18,300	446.00	8,161,800
富士紡ホールディングス	3,000	4,290.00	12,870,000
日清紡ホールディングス	39,000	804.00	31,356,000
倉敷紡績	5,800	1,920.00	11,136,000
ダイワボウホールディングス	5,700	8,130.00	46,341,000
日東紡績	9,500	4,390.00	41,705,000
トヨタ紡織	18,600	1,733.00	32,233,800
マクニカ・富士エレホールディングス	15,000	2,111.00	31,665,000
H a m e e	2,300	1,672.00	3,845,600
ラクト・ジャパン	2,700	2,643.00	7,136,100
ウエルシアホールディングス	33,200	3,615.00	120,018,000
クリエイトSDホールディングス	9,300	3,395.00	31,573,500
グリムス	1,400	1,752.00	2,452,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,900	790.00	8,611,000
八洲電機	4,800	951.00	4,564,800
メディアスホールディングス	5,200	841.00	4,373,200
レスターホールディングス	6,500	2,055.00	13,357,500
ジューテックホールディングス	4,100	1,057.00	4,333,700
丸善C H Iホールディングス	11,100	379.00	4,206,900
O C H Iホールディングス	3,200	1,347.00	4,310,400
T O K A Iホールディングス	30,400	956.00	29,062,400
ミサワ	5,700	667.00	3,801,900
ティーライフ	3,600	1,223.00	4,402,800
C o m i n i x	5,500	772.00	4,246,000
三洋貿易	6,300	1,078.00	6,791,400
チムニー	3,400	1,400.00	4,760,000
シュッピン	4,400	1,103.00	4,853,200
ビューティガレージ	1,700	2,531.00	4,302,700
オイシックス・ラ・大地	6,200	2,921.00	18,110,200
ウイン・パートナーズ	4,500	1,165.00	5,242,500
ネクステージ	10,700	1,721.00	18,414,700
ジョイフル本田	18,400	1,415.00	26,036,000
鳥貴族ホールディングス	2,800	1,759.00	4,925,200
ホットランド	4,700	1,227.00	5,766,900
すかいらくホールディングス	70,400	1,638.00	115,315,200
S F Pホールディングス	2,100	1,446.00	3,036,600
綿半ホールディングス	4,700	1,262.00	5,931,400
日本毛織	20,500	958.00	19,639,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18,200	1,127.00	20,511,400
三栄建築設計	2,500	1,793.00	4,482,500
野村不動産ホールディングス	38,200	2,415.00	92,253,000
三重交通グループホールディングス	12,700	487.00	6,184,900
サムティ	8,900	1,771.00	15,761,900
ディア・ライフ	9,500	428.00	4,066,000
コーセーアールイー	6,400	592.00	3,788,800
日本商業開発	4,000	1,650.00	6,600,000
プレサンスコーポレーション	10,300	1,503.00	15,480,900
日本管理センター	3,600	1,222.00	4,399,200
サンセイランディック	5,700	768.00	4,377,600
エストラスト	5,900	711.00	4,194,900
フージャースホールディングス	10,300	692.00	7,127,600
オープンハウス	19,800	4,100.00	81,180,000
東急不動産ホールディングス	171,000	678.00	115,938,000
飯田グループホールディングス	52,400	2,449.00	128,327,600
イーグランド	5,100	866.00	4,416,600

ムゲンエステート	9,200	488.00	4,489,600
帝国繊維	7,000	2,275.00	15,925,000
日本コークス工業	53,900	104.00	5,605,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,800	1,264.00	6,067,200
B E E N O S	2,900	2,613.00	7,577,700
あさひ	4,700	1,514.00	7,115,800
日本調剤	3,800	1,595.00	6,061,000
コスモス薬品	6,300	15,860.00	99,918,000
シップヘルスケアホールディングス	11,100	5,880.00	65,268,000
ソフトクリエイティブホールディングス	2,500	2,498.00	6,245,000
オンリー	9,200	466.00	4,287,200
セブン&アイ・ホールディングス	245,600	4,202.00	1,032,011,200
クリエイティブ・レストランツ・ホールディングス	33,700	840.00	28,308,000
明治電機工業	2,700	1,413.00	3,815,100
ツルハホールディングス	13,700	14,110.00	193,307,000
サンマルクホールディングス	5,000	1,626.00	8,130,000
フェリシモ	3,100	1,354.00	4,197,400
トリドールホールディングス	15,500	1,505.00	23,327,500
帝人	58,800	1,873.00	110,132,400
東レ	452,100	706.80	319,544,280
クラレ	98,300	1,196.00	117,566,800
旭化成	413,800	1,147.50	474,835,500
サカイオーベックス	1,900	2,851.00	5,416,900
T O K Y O B A S E	9,000	722.00	6,498,000
稲葉製作所	3,500	1,427.00	4,994,500
宮地エンジニアリンググループ	2,100	2,221.00	4,664,100
トーカロ	16,300	1,403.00	22,868,900
アルファ	4,200	1,096.00	4,603,200
S U M C O	80,700	2,520.00	203,364,000
川田テクノロジーズ	1,300	4,680.00	6,084,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,000	6,330.00	12,660,000
ハウスドゥ	3,600	1,170.00	4,212,000
ケイアイスター不動産	2,000	3,675.00	7,350,000
グッドコムアセット	3,300	1,410.00	4,653,000
日本フエルト	9,800	444.00	4,351,200
イチカワ	3,200	1,328.00	4,249,600
芦森工業	4,400	1,031.00	4,536,400
アツギ	8,600	546.00	4,695,600
J Mホールディングス	4,800	2,005.00	9,624,000
コメダホールディングス	13,700	1,938.00	26,550,600
アレンザホールディングス	3,600	1,376.00	4,953,600
パロックジャパンリミテッド	5,600	817.00	4,575,200
クスリのアオキホールディングス	6,200	8,840.00	54,808,000
スシローグローバルホールディングス	34,500	4,275.00	147,487,500
アセンテック	2,200	1,689.00	3,715,800
セーレン	15,400	1,909.00	29,398,600
ソトー	5,200	830.00	4,316,000
東海染工	3,700	1,128.00	4,173,600
小松マテーレ	10,200	1,024.00	10,444,800
ワコールホールディングス	15,600	2,223.00	34,678,800
ホギメディカル	8,400	3,185.00	26,754,000
クラウドシアホールディングス	16,000	294.00	4,704,000
T S Iホールディングス	19,000	278.00	5,282,000
マツオカコーポレーション	2,100	1,916.00	4,023,600
ワールド	8,200	1,381.00	11,324,200
T I S	62,500	2,264.00	141,500,000
電算システム	2,300	3,270.00	7,521,000
グリー	38,400	603.00	23,155,200
コーエーテクモホールディングス	12,800	6,370.00	81,536,000

三菱総合研究所	2,700	4,105.00	11,083,500
電算	1,700	2,549.00	4,333,300
A G S	5,100	835.00	4,258,500
ファインデックス	5,300	1,222.00	6,476,600
ブレインパッド	1,600	5,080.00	8,128,000
K L a b	11,400	867.00	9,883,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	8,300	1,166.00	9,677,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,262.00	3,393,000
ネクソン	158,000	3,490.00	551,420,000
アイスタイル	19,100	551.00	10,524,100
エムアップホールディングス	1,700	2,695.00	4,581,500
エイチーム	4,300	1,238.00	5,323,400
エニグモ	5,900	1,242.00	7,327,800
テクノスジャパン	6,200	693.00	4,296,600
コロブラ	20,500	910.00	18,655,000
ブロードリーフ	31,000	513.00	15,903,000
クロス・マーケティンググループ	11,100	408.00	4,528,800
システム情報	4,700	1,065.00	5,005,500
メディアドゥ	2,400	6,220.00	14,928,000
じげん	15,500	406.00	6,293,000
ピキューブ	3,400	2,769.00	9,414,600
サイバーリンクス	2,000	2,007.00	4,014,000
フィックスターズ	6,700	1,003.00	6,720,100
C A R T A H O L D I N G S	3,100	1,567.00	4,857,700
オブティム	4,400	3,180.00	13,992,000
セレス	2,100	4,355.00	9,145,500
S H I F T	2,800	14,750.00	41,300,000
特種東海製紙	3,800	4,735.00	17,993,000
ティーガイア	6,700	1,877.00	12,575,900
セック	1,500	2,822.00	4,233,000
日本アジアグループ	6,000	1,246.00	7,476,000
テクマトリックス	9,700	1,751.00	16,984,700
プロシップ	2,900	1,356.00	3,932,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,100	2,363.00	35,681,300
G M O ペイメントゲートウェイ	13,300	15,830.00	210,539,000
ザッパラス	8,900	464.00	4,129,600
インターネットイニシアティブ	16,600	2,311.00	38,362,600
さくらインターネット	6,700	681.00	4,562,700
ヴィンクス	3,500	1,138.00	3,983,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	1,400	8,460.00	11,844,000
S R A ホールディングス	3,300	2,602.00	8,586,600
朝日ネット	5,100	838.00	4,273,800
e B A S E	7,500	930.00	6,975,000
アバント	6,700	1,409.00	9,440,300
アドソル日進	2,200	2,738.00	6,023,600
フリービット	4,100	998.00	4,091,800
コムチュア	5,700	2,887.00	16,455,900
サイバーコム	2,500	1,589.00	3,972,500
アステリア	4,500	916.00	4,122,000
アイル	3,500	1,644.00	5,754,000
王子ホールディングス	281,100	709.00	199,299,900
日本製紙	27,600	1,406.00	38,805,600
三菱製紙	11,900	361.00	4,295,900
北越コーポレーション	44,700	514.00	22,975,800
中越パルプ工業	3,600	1,202.00	4,327,200
大王製紙	30,100	2,224.00	66,942,400
阿波製紙	200	451.00	90,200

マークラインズ	2,600	2,400.00	6,240,000
メディカル・データ・ビジョン	7,100	2,158.00	15,321,800
g u m i	8,700	989.00	8,604,300
モバイルファクトリー	3,800	1,041.00	3,955,800
テラスカイ	2,000	3,900.00	7,800,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,800	1,644.00	4,603,200
P R T I M E S	1,300	3,410.00	4,433,000
ランドコンピュータ	3,700	1,127.00	4,169,900
ダブルスタンダード	900	4,155.00	3,739,500
オープンドア	3,700	2,335.00	8,639,500
アカツキ	2,500	4,340.00	10,850,000
U b i c o mホールディングス	1,600	3,110.00	4,976,000
カナミックネットワーク	5,800	777.00	4,506,600
レンゴー	64,400	879.00	56,607,600
トモク	3,800	1,869.00	7,102,200
ザ・バック	4,700	2,737.00	12,863,900
チェンジ	8,700	3,465.00	30,145,500
シンクロ・フード	11,900	363.00	4,319,700
オークネット	3,300	1,348.00	4,448,400
A O I T Y O H O L D I N G S	9,400	477.00	4,483,800
マクロミル	12,800	873.00	11,174,400
オロ	2,000	3,950.00	7,900,000
ユーザーローカル	1,000	4,620.00	4,620,000
昭和電工	47,400	2,592.00	122,860,800
住友化学	491,500	522.00	256,563,000
住友精化	3,000	4,020.00	12,060,000
日産化学	34,400	6,240.00	214,656,000
ラサ工業	2,000	2,248.00	4,496,000
クレハ	5,400	7,190.00	38,826,000
多木化学	2,400	6,390.00	15,336,000
テイカ	4,600	1,440.00	6,624,000
石原産業	11,200	821.00	9,195,200
片倉コープアグリ	3,400	1,289.00	4,382,600
日本曹達	8,700	3,385.00	29,449,500
東ソー	96,500	1,989.00	191,938,500
トクヤマ	18,500	2,682.00	49,617,000
セントラル硝子	11,900	2,301.00	27,381,900
東亜合成	38,100	1,243.00	47,358,300
大阪ソーダ	6,300	2,643.00	16,650,900
関東電化工業	14,800	887.00	13,127,600
デンカ	22,800	4,120.00	93,936,000
イビデン	30,700	4,820.00	147,974,000
信越化学工業	115,500	18,740.00	2,164,470,000
日本カーバイド工業	3,300	1,338.00	4,415,400
堺化学工業	4,400	1,976.00	8,694,400
第一稀元素化学工業	6,300	1,046.00	6,589,800
エア・ウォーター	63,700	1,743.00	111,029,100
日本酸素ホールディングス	51,400	2,009.00	103,262,600
日本化学工業	1,800	3,310.00	5,958,000
日本パーカライジング	31,500	1,101.00	34,681,500
高压ガス工業	9,900	739.00	7,316,100
四国化成工業	8,300	1,261.00	10,466,300
ステラ ケミファ	3,400	3,275.00	11,135,000
保土谷化学工業	1,800	4,930.00	8,874,000
日本触媒	11,300	5,790.00	65,427,000
大日精化工業	5,200	2,404.00	12,500,800
カネカ	16,100	4,275.00	68,827,500
協和キリン	64,100	3,085.00	197,748,500
三菱瓦斯化学	62,500	2,597.00	162,312,500



三井化学	53,900	3,240.00	174,636,000
J S R	62,700	3,390.00	212,553,000
東京応化工業	10,700	6,810.00	72,867,000
大阪有機化学工業	5,800	3,840.00	22,272,000
三菱ケミカルホールディングス	417,400	731.50	305,328,100
K Hネオケム	10,300	2,508.00	25,832,400
ダイセル	83,900	775.00	65,022,500
住友ベークライト	9,800	4,435.00	43,463,000
積水化学工業	132,000	2,021.00	266,772,000
日本ゼオン	56,300	1,654.00	93,120,200
アイカ工業	17,400	3,840.00	66,816,000
宇部興産	31,500	2,141.00	67,441,500
積水樹脂	10,300	2,066.00	21,279,800
タキロンシーアイ	13,500	691.00	9,328,500
旭有機材	3,500	1,473.00	5,155,500
ニチバン	3,300	1,822.00	6,012,600
リケンテクノス	15,200	495.00	7,524,000
大倉工業	2,900	2,000.00	5,800,000
積水化成品工業	8,400	561.00	4,712,400
群栄化学工業	1,700	2,502.00	4,253,400
タイガースポリマー	10,400	467.00	4,856,800
ダイキョーニシカワ	13,200	799.00	10,546,800
森六ホールディングス	3,400	2,047.00	6,959,800
日本化薬	38,600	1,060.00	40,916,000
カーリットホールディングス	6,200	728.00	4,513,600
E P Sホールディングス	8,200	1,201.00	9,848,200
レグス	2,500	1,685.00	4,212,500
プレステージ・インターナショナル	22,800	764.00	17,419,200
プロトコーポレーション	5,600	1,171.00	6,557,600
ハイマックス	3,400	1,727.00	5,871,800
アミューズ	3,300	2,516.00	8,302,800
野村総合研究所	114,100	3,565.00	406,766,500
ドリームインキュベータ	3,300	1,215.00	4,009,500
サイバネットシステム	4,400	856.00	3,766,400
クイック	3,800	1,194.00	4,537,200
T A C	16,200	276.00	4,471,200
C Eホールディングス	6,600	547.00	3,610,200
ケネディクス	17,500	747.00	13,072,500
電通グループ	68,500	3,670.00	251,395,000
インテージホールディングス	7,800	1,197.00	9,336,600
東邦システムサイエンス	4,500	927.00	4,171,500
ぴあ	1,700	3,325.00	5,652,500
イオンファンタジー	2,300	2,456.00	5,648,800
ソースネクスト	29,700	337.00	10,008,900
シーティーエス	6,900	880.00	6,072,000
ネクシィーズグループ	4,600	1,075.00	4,945,000
インフォコム	5,700	2,808.00	16,005,600
メディカルシステムネットワーク	7,100	732.00	5,197,200
日本精化	4,500	1,417.00	6,376,500
扶桑化学工業	4,900	3,970.00	19,453,000
トリケミカル研究所	5,600	4,250.00	23,800,000
H E R O Z	1,800	3,540.00	6,372,000
ラクスル	5,100	3,810.00	19,431,000
F I G	16,100	269.00	4,330,900
A D E K A	28,700	1,863.00	53,468,100
日油	23,500	5,850.00	137,475,000
ミヨシ油脂	3,600	1,200.00	4,320,000
新日本理化	15,200	279.00	4,240,800
ハリマ化成グループ	4,600	948.00	4,360,800
イーソル	3,400	1,412.00	4,800,800

アルテリア・ネットワークス	6,900	1,567.00	10,812,300
EDULAB	600	7,210.00	4,326,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,200	2,016.00	4,435,200
トピラシステムズ	3,000	1,608.00	4,824,000
ギフトィ	2,800	4,450.00	12,460,000
花王	152,600	7,270.00	1,109,402,000
第一工業製薬	2,100	3,770.00	7,917,000
日華化学	4,800	888.00	4,262,400
ニイタカ	1,500	2,704.00	4,056,000
三洋化成工業	3,700	5,230.00	19,351,000
武田薬品工業	530,400	3,687.00	1,955,584,800
アステラス製薬	552,700	1,779.00	983,253,300
大日本住友製薬	47,300	1,701.00	80,457,300
塩野義製薬	80,200	5,811.00	466,042,200
わかもと製薬	13,800	245.00	3,381,000
あすか製薬	7,300	1,411.00	10,300,300
日本新薬	18,100	7,810.00	141,361,000
中外製薬	199,400	5,250.00	1,046,850,000
科研製薬	10,900	4,155.00	45,289,500
エーザイ	70,400	7,625.00	536,800,000
理研ビタミン	6,000	1,363.00	8,178,000
ロート製薬	30,400	2,967.00	90,196,800
小野薬品工業	146,400	3,055.00	447,252,000
久光製薬	18,500	7,070.00	130,795,000
有機合成薬品工業	13,200	296.00	3,907,200
持田製薬	8,800	4,145.00	36,476,000
参天製薬	110,900	1,572.00	174,334,800
扶桑薬品工業	2,100	2,654.00	5,573,400
ツムラ	21,300	3,435.00	73,165,500
日医工	18,100	1,106.00	20,018,600
テルモ	195,400	4,278.00	835,921,200
H・U・グループホールディングス	17,000	3,290.00	55,930,000
キッセイ薬品工業	11,300	2,237.00	25,278,100
生化学工業	11,200	1,061.00	11,883,200
栄研化学	11,200	2,142.00	23,990,400
日水製薬	4,200	997.00	4,187,400
鳥居薬品	4,000	3,005.00	12,020,000
JCRファーマ	18,000	3,270.00	58,860,000
東和薬品	9,200	2,230.00	20,516,000
富士製薬工業	4,300	1,280.00	5,504,000
沢井製薬	14,000	4,895.00	68,530,000
ゼリア新薬工業	11,600	2,024.00	23,478,400
第一三共	547,300	3,261.00	1,784,745,300
キョーリン製薬ホールディングス	14,100	1,931.00	27,227,100
大幸薬品	7,800	1,322.00	10,311,600
ダイト	4,100	3,590.00	14,719,000
大塚ホールディングス	132,500	4,469.00	592,142,500
大正製薬ホールディングス	15,200	6,920.00	105,184,000
ペプチドリーム	32,400	5,420.00	175,608,000
大日本塗料	7,100	924.00	6,560,400
日本ペイントホールディングス	51,500	8,710.00	448,565,000
関西ペイント	70,100	2,917.00	204,481,700
中国塗料	15,000	936.00	14,040,000
日本特殊塗料	4,700	1,154.00	5,423,800
藤倉化成	8,400	525.00	4,410,000
太陽ホールディングス	4,600	5,890.00	27,094,000
DIC	26,400	2,860.00	75,504,000
サカタインクス	13,600	1,103.00	15,000,800
東洋インキSCホールディングス	13,200	2,007.00	26,492,400

T&K TOKA	5,000	828.00	4,140,000
アルプス技研	5,400	2,027.00	10,945,800
日本空調サービス	6,400	736.00	4,710,400
オリエンタルランド	64,800	18,040.00	1,168,992,000
フォーカスシステムズ	4,300	933.00	4,011,900
ダスキン	14,100	2,802.00	39,508,200
パーク24	33,700	2,234.00	75,285,800
明光ネットワークジャパン	7,700	569.00	4,381,300
ファルコホールディングス	2,900	1,616.00	4,686,400
クレスコ	4,300	1,386.00	5,959,800
フジ・メディア・ホールディングス	64,900	1,320.00	85,668,000
秀英予備校	9,800	427.00	4,184,600
ラウンドワン	20,800	1,110.00	23,088,000
リゾートトラスト	27,900	1,747.00	48,741,300
オービック	19,700	19,350.00	381,195,000
ジャストシステム	8,900	6,970.00	62,033,000
TDCソフト	5,500	949.00	5,219,500
Zホールディングス	859,300	661.00	567,997,300
ビー・エム・エル	7,800	3,650.00	28,470,000
トレンドマイクロ	33,400	5,640.00	188,376,000
りらいあコミュニケーションズ	9,300	1,396.00	12,982,800
IDホールディングス	3,400	1,218.00	4,141,200
リソー教育	30,900	334.00	10,320,600
日本オラクル	12,700	11,930.00	151,511,000
早稲田アカデミー	4,300	997.00	4,287,100
アルファシステムズ	1,700	3,600.00	6,120,000
フューチャー	7,500	1,900.00	14,250,000
CAC Holdings	4,100	1,437.00	5,891,700
SBテクノロジー	2,200	3,000.00	6,600,000
トーセ	5,200	814.00	4,232,800
ユー・エス・エス	68,200	2,100.00	143,220,000
オービックビジネスコンサルタント	6,400	6,340.00	40,576,000
伊藤忠テクノソリューションズ	28,500	3,435.00	97,897,500
アイティフォー	8,200	863.00	7,076,600
東京個別指導学院	6,000	675.00	4,050,000
東計電算	1,000	4,285.00	4,285,000
サイバーエージェント	37,500	6,990.00	262,125,000
楽天	283,900	1,145.00	325,065,500
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,294.00	4,529,000
テー・オー・ダブリュー	15,100	304.00	4,590,400
大塚商会	33,800	5,140.00	173,732,000
サイボウズ	7,300	2,497.00	18,228,100
山田コンサルティンググループ	4,300	1,004.00	4,317,200
セントラルスポーツ	2,300	2,429.00	5,586,700
電通国際情報サービス	7,700	3,830.00	29,491,000
ACCESS	5,900	835.00	4,926,500
デジタルガレージ	10,300	4,445.00	45,783,500
イーエムシステムズ	10,300	856.00	8,816,800
ウェザーニューズ	1,900	5,300.00	10,070,000
CIJ	4,700	872.00	4,098,400
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,230.00	4,199,000
日本エンタープライズ	17,200	255.00	4,386,000
WOWOW	3,000	2,872.00	8,616,000
スカラ	5,600	723.00	4,048,800
フルキャストホールディングス	5,300	1,980.00	10,494,000
エン・ジャパン	10,800	3,370.00	36,396,000
富士フイルムホールディングス	112,000	6,333.00	709,296,000
コニカミノルタ	129,300	550.00	71,115,000
資生堂	126,700	8,150.00	1,032,605,000
ライオン	82,900	2,175.00	180,307,500

高砂香料工業	4,000	2,609.00	10,436,000
マンダム	13,400	1,870.00	25,058,000
ミルボン	8,500	6,400.00	54,400,000
ファンケル	23,200	4,080.00	94,656,000
コーセー	12,000	18,100.00	217,200,000
コタ	3,700	1,828.00	6,763,600
シーボン	2,100	1,995.00	4,189,500
ポーラ・オルビスホールディングス	27,200	2,476.00	67,347,200
ノエビアホールディングス	5,400	4,865.00	26,271,000
アジュバンコスメジャパン	4,000	1,099.00	4,396,000
エステー	4,100	1,973.00	8,089,300
アグロ カネショウ	2,700	1,623.00	4,382,100
コニシ	10,500	1,678.00	17,619,000
長谷川香料	11,000	1,951.00	21,461,000
星光PMC	5,400	773.00	4,174,200
小林製薬	17,900	10,990.00	196,721,000
荒川化学工業	5,300	1,295.00	6,863,500
メック	4,400	2,073.00	9,121,200
日本高純度化学	1,800	2,688.00	4,838,400
タカラバイオ	16,700	3,085.00	51,519,500
JCU	7,200	3,410.00	24,552,000
新田ゼラチン	6,200	680.00	4,216,000
OATアグリオ	3,200	1,384.00	4,428,800
デクセリアルズ	17,800	1,538.00	27,376,400
アース製薬	4,800	6,070.00	29,136,000
北興化学工業	5,900	1,046.00	6,171,400
大成ラミック	2,000	2,935.00	5,870,000
クミアイ化学工業	26,400	882.00	23,284,800
日本農薬	11,400	530.00	6,042,000
ニチレキ	7,500	1,538.00	11,535,000
ユシロ化学工業	3,800	1,085.00	4,123,000
富士石油	18,700	211.00	3,945,700
MORESCO	3,700	1,150.00	4,255,000
出光興産	70,800	2,742.00	194,133,600
ENEOSホールディングス	959,000	462.90	443,921,100
コスモエネルギーホールディングス	20,200	2,485.00	50,197,000
横浜ゴム	36,900	1,961.00	72,360,900
TOYO TIRE	33,600	1,906.00	64,041,600
ブリヂストン	169,500	4,199.00	711,730,500
住友ゴム工業	57,300	1,194.00	68,416,200
オカモト	3,900	4,115.00	16,048,500
アキレス	4,400	1,487.00	6,542,800
フコク	5,900	711.00	4,194,900
ニッタ	6,600	2,396.00	15,813,600
住友理工	12,400	641.00	7,948,400
三ツ星ベルト	7,700	1,726.00	13,290,200
バンドー化学	11,200	737.00	8,254,400
AGC	58,500	3,905.00	228,442,500
日本板硝子	32,300	552.00	17,829,600
有沢製作所	8,900	982.00	8,739,800
日本山村硝子	4,800	918.00	4,406,400
日本電気硝子	23,600	2,502.00	59,047,200
オハラ	2,500	2,052.00	5,130,000
住友大阪セメント	11,500	3,560.00	40,940,000
太平洋セメント	37,700	2,748.00	103,599,600
日本ヒューム	5,800	769.00	4,460,200
日本コンクリート工業	13,700	386.00	5,288,200
三谷セキサン	3,000	4,820.00	14,460,000
アジアパイルホールディングス	9,800	530.00	5,194,000
東海カーボン	62,300	1,515.00	94,384,500

日本カーボン	3,500	4,095.00	14,332,500
東洋炭素	3,700	1,987.00	7,351,900
ノリタケカンパニーリミテド	3,500	3,615.00	12,652,500
TOTO	45,500	6,850.00	311,675,000
日本碍子	70,100	1,881.00	131,858,100
日本特殊陶業	48,500	1,868.00	90,598,000
MARUWA	2,200	10,570.00	23,254,000
品川リフクトリーズ	1,600	2,762.00	4,419,200
黒崎播磨	1,100	4,825.00	5,307,500
ヨータイ	4,900	1,038.00	5,086,200
イソライト工業	7,200	649.00	4,672,800
ニッカトー	5,200	717.00	3,728,400
フジインコーポレーテッド	5,100	4,225.00	21,547,500
クニミネ工業	3,300	1,211.00	3,996,300
ニチアス	16,100	2,486.00	40,024,600
日本製鉄	300,900	1,551.50	466,846,350
神戸製鋼所	115,400	636.00	73,394,400
中山製鋼所	11,600	401.00	4,651,600
合同製鐵	3,400	2,080.00	7,072,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	182,400	1,113.00	203,011,200
東京製鐵	24,600	722.00	17,761,200
共英製鋼	7,100	1,432.00	10,167,200
大和工業	13,400	2,712.00	36,340,800
東京鐵鋼	2,400	2,007.00	4,816,800
大阪製鐵	3,300	1,256.00	4,144,800
淀川製鋼所	8,500	2,303.00	19,575,500
丸一鋼管	20,500	2,502.00	51,291,000
モリ工業	1,900	2,333.00	4,432,700
大同特殊鋼	10,300	4,695.00	48,358,500
日本高周波鋼業	12,000	364.00	4,368,000
日本冶金工業	4,900	2,119.00	10,383,100
山陽特殊製鋼	7,600	1,749.00	13,292,400
愛知製鋼	3,500	3,275.00	11,462,500
日立金属	59,400	1,722.00	102,286,800
大平洋金属	4,300	2,500.00	10,750,000
新日本電工	40,700	298.00	12,128,600
栗本鐵工所	2,900	1,765.00	5,118,500
日本製鋼所	19,100	2,887.00	55,141,700
三菱製鋼	2,000	764.00	1,528,000
日亜鋼業	14,100	294.00	4,145,400
日本精線	1,100	3,655.00	4,020,500
大紀アルミニウム工業所	9,500	802.00	7,619,000
日本軽金属ホールディングス	17,200	2,167.00	37,272,400
三井金属鉱業	17,000	3,885.00	66,045,000
東邦亜鉛	3,500	2,415.00	8,452,500
三菱マテリアル	41,600	2,598.00	108,076,800
住友金属鉱山	80,600	5,578.00	449,586,800
DOWAホールディングス	15,900	4,175.00	66,382,500
古河機械金属	10,400	1,352.00	14,060,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,600	818.00	5,398,800
東邦チタニウム	11,300	981.00	11,085,300
UACJ	9,600	2,507.00	24,067,200
CKサンエツ	1,300	3,955.00	5,141,500
古河電気工業	19,600	2,871.00	56,271,600
住友電気工業	220,000	1,549.50	340,890,000
フジクラ	76,100	525.00	39,952,500
昭和電線ホールディングス	6,100	1,753.00	10,693,300
東京特殊電線	1,700	2,596.00	4,413,200
タツタ電線	11,100	651.00	7,226,100
平河ヒューテック	3,500	1,189.00	4,161,500

リヨービ	7,800	1,306.00	10,186,800
アーレスティ	10,600	405.00	4,293,000
アサヒホールディングス	11,800	4,315.00	50,917,000
東洋製罐グループホールディングス	40,100	1,361.00	54,576,100
ホッカシホールディングス	3,200	1,430.00	4,576,000
コロナ	4,400	951.00	4,184,400
横河ブリッジホールディングス	10,800	1,912.00	20,649,600
OSJBホールディングス	29,100	273.00	7,944,300
三和ホールディングス	59,400	1,315.00	78,111,000
文化シャッター	18,600	1,000.00	18,600,000
三協立山	8,100	828.00	6,706,800
アルインコ	4,400	974.00	4,285,600
LIXIL	86,800	3,025.00	262,570,000
日本フィルコン	8,300	500.00	4,150,000
ノーリツ	13,100	1,675.00	21,942,500
長府製作所	6,400	2,108.00	13,491,200
リンナイ	12,300	11,460.00	140,958,000
ユニプレス	10,400	962.00	10,004,800
ダイニチ工業	4,600	852.00	3,919,200
日東精工	9,000	667.00	6,003,000
三洋工業	2,200	1,852.00	4,074,400
岡部	12,800	789.00	10,099,200
ジーテクト	7,800	1,448.00	11,294,400
東プレ	11,800	1,586.00	18,714,800
高周波熱錬	12,100	540.00	6,534,000
東京製綱	4,500	1,445.00	6,502,500
サンコール	6,800	487.00	3,311,600
モリテックスチール	9,700	420.00	4,074,000
パイオラックス	9,300	1,594.00	14,824,200
エイチワン	6,200	772.00	4,786,400
日本発条	62,800	812.00	50,993,600
三浦工業	27,300	6,140.00	167,622,000
タクマ	21,400	2,023.00	43,292,200
テクノプロ・ホールディングス	12,200	8,100.00	98,820,000
インターワークス	11,400	381.00	4,343,400
アイ・アールジャパンホールディングス	2,500	13,980.00	34,950,000
Keeper 技研	3,900	1,954.00	7,620,600
三機サービス	4,100	1,010.00	4,141,000
Gunosy	5,400	808.00	4,363,200
イー・ガーディアン	2,700	3,210.00	8,667,000
リブセンス	17,400	234.00	4,071,600
ジャパンマテリアル	18,700	1,464.00	27,376,800
ベクトル	7,600	1,198.00	9,104,800
ウチヤマホールディングス	12,200	365.00	4,453,000
チャーム・ケア・コーポレーション	4,500	1,427.00	6,421,500
キャリアリンク	2,000	2,767.00	5,534,000
IBJ	5,000	1,024.00	5,120,000
アサンテ	2,600	1,733.00	4,505,800
N・フィールド	5,000	1,197.00	5,985,000
バリューHR	2,400	1,995.00	4,788,000
M&Aキャピタルパートナーズ	5,000	4,890.00	24,450,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,300	1,721.00	3,958,300
E R Iホールディングス	6,700	618.00	4,140,600
アビスト	1,400	2,972.00	4,160,800
シグマクス	3,300	1,780.00	5,874,000
ウィルグループ	4,500	981.00	4,414,500
メドピア	2,900	6,150.00	17,835,000
リクルートホールディングス	436,400	5,475.00	2,389,290,000
エラン	8,400	1,400.00	11,760,000

ツガミ	13,100	1,635.00	21,418,500
オークマ	7,300	5,970.00	43,581,000
芝浦機械	6,500	2,956.00	19,214,000
アマダ	92,400	1,289.00	119,103,600
アイダエンジニアリング	16,500	957.00	15,790,500
滝澤鉄工所	4,100	1,059.00	4,341,900
F U J I	25,200	2,667.00	67,208,400
牧野フライス製作所	7,400	4,025.00	29,785,000
オーエスジー	31,100	1,973.00	61,360,300
ダイジェット工業	3,100	1,382.00	4,284,200
旭ダイヤモンド工業	16,500	510.00	8,415,000
D M G 森精機	39,900	1,599.00	63,800,100
ソディック	13,700	991.00	13,576,700
ディスコ	8,600	35,500.00	305,300,000
日東工器	3,000	1,858.00	5,574,000
日進工具	2,500	2,746.00	6,865,000
日本郵政	460,900	900.00	414,810,000
ベルシステム24ホールディングス	10,200	1,847.00	18,839,400
鎌倉新書	6,100	903.00	5,508,300
S M N	5,100	752.00	3,835,200
一蔵	12,100	395.00	4,779,500
L I T A L I C O	2,500	3,825.00	9,562,500
エアトリ	3,300	1,995.00	6,583,500
アトラエ	1,900	3,270.00	6,213,000
ストライク	2,300	4,715.00	10,844,500
ソラスト	14,900	1,495.00	22,275,500
セラク	2,300	1,782.00	4,098,600
インソース	5,100	2,249.00	11,469,900
豊田自動織機	51,600	9,520.00	491,232,000
豊和工業	4,800	858.00	4,118,400
東洋機械金属	9,100	458.00	4,167,800
エンシュウ	4,800	880.00	4,224,000
島精機製作所	9,200	2,304.00	21,196,800
オプトラン	7,900	2,775.00	21,922,500
N C ホールディングス	7,100	661.00	4,693,100
イワキ	5,100	836.00	4,263,600
フリー	6,200	1,120.00	6,944,000
ヤマシンフィルタ	12,700	890.00	11,303,000
日阪製作所	7,800	841.00	6,559,800
やまびこ	12,200	1,177.00	14,359,400
平田機工	3,000	7,280.00	21,840,000
ペガサスミシン製造	12,000	460.00	5,520,000
マルマエ	1,500	1,304.00	1,956,000
タツモ	2,700	1,644.00	4,438,800
ナブテスコ	37,100	4,860.00	180,306,000
三井海洋開発	6,700	1,752.00	11,738,400
レオン自動機	6,200	1,135.00	7,037,000
S M C	18,700	65,860.00	1,231,582,000
ホソカワミクロン	2,200	6,550.00	14,410,000
ユニオンツール	2,300	3,480.00	8,004,000
オイレス工業	8,800	1,697.00	14,933,600
日精エー・エス・ビー機械	1,800	5,630.00	10,134,000
サトーホールディングス	8,300	2,497.00	20,725,100
技研製作所	5,600	5,190.00	29,064,000
カワタ	4,300	905.00	3,891,500
日精樹脂工業	4,800	921.00	4,420,800
オカダアイヨン	3,600	1,190.00	4,284,000
小松製作所	288,800	3,253.00	939,466,400
住友重機械工業	36,500	2,901.00	105,886,500
日立建機	29,800	3,325.00	99,085,000

日工	9,500	727.00	6,906,500
巴工業	2,500	2,054.00	5,135,000
井関農機	6,400	1,541.00	9,862,400
TOWA	5,900	2,179.00	12,856,100
丸山製作所	2,600	1,648.00	4,284,800
北川鉄工所	3,100	1,478.00	4,581,800
シンニッタン	20,600	219.00	4,511,400
ローツェ	2,800	8,110.00	22,708,000
タカキタ	6,000	685.00	4,110,000
クボタ	334,900	2,471.50	827,705,350
荏原実業	1,600	4,650.00	7,440,000
三菱化工機	2,000	2,966.00	5,932,000
月島機械	11,700	1,293.00	15,128,100
帝国電機製作所	4,400	1,210.00	5,324,000
新東工業	15,100	759.00	11,460,900
澁谷工業	5,600	3,530.00	19,768,000
アイチコーポレーション	11,000	897.00	9,867,000
小森コーポレーション	16,200	721.00	11,680,200
鶴見製作所	4,900	1,727.00	8,462,300
荏原製作所	26,400	4,110.00	108,504,000
石井鐵工所	1,500	2,938.00	4,407,000
西島製作所	6,400	836.00	5,350,400
北越工業	6,600	1,118.00	7,378,800
ダイキン工業	81,200	22,100.00	1,794,520,000
オルガノ	2,100	6,190.00	12,999,000
トーヨーカネツ	2,400	2,777.00	6,664,800
栗田工業	34,500	4,430.00	152,835,000
椿本チエイン	9,100	2,941.00	26,763,100
大同工業	5,800	775.00	4,495,000
日機装	20,600	1,075.00	22,145,000
レイズネクスト	10,700	1,177.00	12,593,900
アネスト岩田	10,700	1,087.00	11,630,900
ダイフク	35,100	11,310.00	396,981,000
サムコ	1,600	3,695.00	5,912,000
加藤製作所	4,400	1,002.00	4,408,800
タダノ	30,800	1,013.00	31,200,400
フジテック	21,900	2,536.00	55,538,400
C K D	14,800	2,475.00	36,630,000
キトー	5,400	1,472.00	7,948,800
平和	17,800	1,601.00	28,497,800
理想科学工業	4,900	1,365.00	6,688,500
SANKYO	15,200	2,954.00	44,900,800
日本金銭機械	8,000	553.00	4,424,000
マースグループホールディングス	4,000	1,595.00	6,380,000
フクシマガリレイ	4,400	4,195.00	18,458,000
ダイコク電機	4,700	944.00	4,436,800
竹内製作所	10,700	2,779.00	29,735,300
アマノ	16,700	2,418.00	40,380,600
JUKI	8,900	830.00	7,387,000
蛇の目ミシン工業	5,800	813.00	4,715,400
ブラザー工業	77,800	2,262.00	175,983,600
マックス	8,800	1,614.00	14,203,200
モリタホールディングス	10,200	1,813.00	18,492,600
グローリー	16,400	2,290.00	37,556,000
新晃工業	5,900	1,975.00	11,652,500
大和冷機工業	10,200	1,085.00	11,067,000
セガサミーホールディングス	58,000	1,832.00	106,256,000
日本ピストンリング	4,400	1,040.00	4,576,000
リケン	3,000	2,249.00	6,747,000
T P R	8,600	1,523.00	13,097,800



ツバキ・ナカシマ	12,200	1,274.00	15,542,800
ホシザキ	20,100	9,650.00	193,965,000
日本精工	130,900	1,014.00	132,732,600
NTN	147,500	315.00	46,462,500
ジェイテクト	61,100	1,146.00	70,020,600
不二越	5,900	4,685.00	27,641,500
ミネベアミツミ	109,900	2,670.00	293,433,000
日本トムソン	17,500	569.00	9,957,500
THK	39,700	3,640.00	144,508,000
ユースキン精機	4,400	945.00	4,158,000
前澤給装工業	2,300	2,233.00	5,135,900
イーグル工業	7,900	1,153.00	9,108,700
日本ピラー工業	6,400	1,723.00	11,027,200
キッツ	19,700	582.00	11,465,400
日立製作所	306,500	4,934.00	1,512,271,000
三菱電機	637,500	1,601.50	1,020,956,250
富士電機	38,400	4,665.00	179,136,000
東洋電機製造	3,500	1,210.00	4,235,000
安川電機	68,600	5,670.00	388,962,000
シンフォニアテクノロジー	8,300	1,339.00	11,113,700
明電舎	10,800	2,372.00	25,617,600
オリジン	3,200	1,373.00	4,393,600
山洋電気	3,100	6,040.00	18,724,000
デンヨー	5,400	2,117.00	11,431,800
ベikalレント・コンサルティング	4,000	21,270.00	85,080,000
MS-Japan	3,400	1,146.00	3,896,400
グレイステクノロジー	3,100	5,760.00	17,856,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	17,500	2,241.00	39,217,500
グリーンズ	9,100	573.00	5,214,300
ミダック	1,300	4,480.00	5,824,000
日総工産	5,200	837.00	4,352,400
キュービーネットホールディングス	3,000	1,734.00	5,202,000
RPAホールディングス	7,000	639.00	4,473,000
三櫻工業	8,800	940.00	8,272,000
マキタ	83,100	4,695.00	390,154,500
東芝テック	6,800	3,860.00	26,248,000
芝浦メカトロニクス	1,100	5,070.00	5,577,000
マブチモーター	17,600	4,885.00	85,976,000
日本電産	153,400	14,650.00	2,247,310,000
トレックス・セミコンダクター	3,400	1,609.00	5,470,600
東光高岳	3,200	1,560.00	4,992,000
ダブル・スコープ	12,600	792.00	9,979,200
ダイヘン	7,000	4,680.00	32,760,000
ヤーマン	10,400	1,935.00	20,124,000
JVCケンウッド	55,200	193.00	10,653,600
ミマキエンジニアリング	8,700	569.00	4,950,300
I-PEX	3,000	2,024.00	6,072,000
日新電機	14,900	1,270.00	18,923,000
大崎電気工業	12,700	609.00	7,734,300
オムロン	53,100	9,420.00	500,202,000
日東工業	9,400	2,094.00	19,683,600
IDEC	8,500	1,881.00	15,988,500
不二電機工業	3,200	1,271.00	4,067,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	22,900	3,370.00	77,173,000
サクサホールディングス	3,000	1,495.00	4,485,000
メルコホールディングス	2,200	3,910.00	8,602,000
日本電気	81,000	6,290.00	509,490,000
富士通	57,400	15,905.00	912,947,000
沖電気工業	25,900	1,050.00	27,195,000

電気興業	3,100	2,943.00	9,123,300
サンケン電気	7,500	5,580.00	41,850,000
アイホン	3,600	1,753.00	6,310,800
ルネサスエレクトロニクス	274,200	1,255.00	344,121,000
セイコーエプソン	79,100	1,768.00	139,848,800
ワコム	46,100	796.00	36,695,600
アルバック	11,700	5,110.00	59,787,000
E I Z O	5,400	3,830.00	20,682,000
ジャパンディスプレイ	217,700	48.00	10,449,600
日本信号	14,900	957.00	14,259,300
京三製作所	13,700	426.00	5,836,200
能美防災	8,400	2,256.00	18,950,400
ホーチキ	4,600	1,294.00	5,952,400
エレコム	7,300	4,980.00	36,354,000
パナソニック	679,800	1,441.50	979,931,700
シャープ	73,800	2,140.00	157,932,000
アンリツ	38,300	2,380.00	91,154,000
富士通ゼネラル	19,500	2,986.00	58,227,000
ソニー	399,300	11,980.00	4,783,614,000
T D K	30,800	16,260.00	500,808,000
帝国通信工業	3,700	1,143.00	4,229,100
タムラ製作所	22,900	556.00	12,732,400
アルプスアルパイン	52,100	1,437.00	74,867,700
池上通信機	4,900	833.00	4,081,700
日本電波工業	6,200	694.00	4,302,800
日本トリム	1,400	4,390.00	6,146,000
ローランド ディー・ジー・	3,800	1,909.00	7,254,200
フォスター電機	6,700	1,307.00	8,756,900
S M K	1,600	3,015.00	4,824,000
ヨコオ	4,700	2,997.00	14,085,900
ホシデン	17,400	1,087.00	18,913,800
ヒロセ電機	9,800	16,780.00	164,444,000
日本航空電子工業	14,600	1,696.00	24,761,600
T O A	7,500	903.00	6,772,500
マクセルホールディングス	12,700	1,444.00	18,338,800
古野電気	8,200	1,144.00	9,380,800
ユニデンホールディングス	2,000	2,356.00	4,712,000
スミダコーポレーション	5,400	1,027.00	5,545,800
アイコム	2,600	2,780.00	7,228,000
リオン	2,700	2,935.00	7,924,500
横河電機	63,800	2,143.00	136,723,400
新電元工業	2,500	3,160.00	7,900,000
アズビル	43,100	5,010.00	215,931,000
東亜ディーケーケー	4,900	832.00	4,076,800
日本光電工業	26,300	3,020.00	79,426,000
共和電業	10,900	385.00	4,196,500
日本電子材料	2,300	1,903.00	4,376,900
堀場製作所	12,600	6,740.00	84,924,000
アドバンテスト	47,400	9,670.00	458,358,000
小野測器	7,800	545.00	4,251,000
エスベック	5,600	1,927.00	10,791,200
キーエンス	62,600	56,750.00	3,552,550,000
日置電機	3,100	3,810.00	11,811,000
シスメックス	49,700	11,760.00	584,472,000
日本マイクロニクス	11,100	1,888.00	20,956,800
メガチップス	6,400	3,445.00	22,048,000
O B A R A G R O U P	3,700	3,970.00	14,689,000
I M A G I C A G R O U P	10,700	513.00	5,489,100
澤藤電機	1,000	2,319.00	2,319,000
デンソー	140,400	6,672.00	936,748,800

原田工業	4,900	914.00	4,478,600
コーセル	7,800	1,164.00	9,079,200
イリソ電子工業	5,400	5,040.00	27,216,000
オブテックスグループ	10,500	1,762.00	18,501,000
千代田インテグレ	2,700	1,800.00	4,860,000
レーザーテック	28,000	14,580.00	408,240,000
スタンレー電気	44,700	3,440.00	153,768,000
岩崎電気	3,000	1,521.00	4,563,000
ウシオ電機	32,700	1,377.00	45,027,900
岡谷電機産業	11,600	375.00	4,350,000
エノモト	2,600	1,868.00	4,856,800
日本セラミック	6,500	2,740.00	17,810,000
遠藤照明	7,800	647.00	5,046,600
古河電池	4,500	1,588.00	7,146,000
双信電機	9,100	447.00	4,067,700
山一電機	4,200	1,480.00	6,216,000
図研	4,100	2,950.00	12,095,000
日本電子	11,600	4,315.00	50,054,000
カシオ計算機	51,300	2,055.00	105,421,500
ファナック	55,900	27,585.00	1,542,001,500
日本シイエムケイ	13,700	437.00	5,986,900
エンプラス	2,900	4,645.00	13,470,500
大真空	2,100	2,680.00	5,628,000
ローム	26,500	11,470.00	303,955,000
浜松ホトニクス	45,700	6,820.00	311,674,000
三井ハイテック	6,200	4,535.00	28,117,000
新光電気工業	21,400	3,035.00	64,949,000
京セラ	97,200	6,944.00	674,956,800
協栄産業	3,100	1,386.00	4,296,600
太陽誘電	28,300	5,840.00	165,272,000
村田製作所	187,300	9,882.00	1,850,898,600
双葉電子工業	10,900	968.00	10,551,200
日東電工	40,800	9,430.00	384,744,000
北陸電気工業	4,500	937.00	4,216,500
東海理化電機製作所	16,800	1,806.00	30,340,800
ニチコン	20,100	1,147.00	23,054,700
日本ケミコン	6,400	1,847.00	11,820,800
K O A	8,800	1,520.00	13,376,000
三井E & Sホールディングス	24,700	441.00	10,892,700
日立造船	50,500	707.00	35,703,500
三菱重工業	100,200	3,055.00	306,111,000
川崎重工業	49,600	2,307.00	114,427,200
I H I	42,900	1,899.00	81,467,100
スプリックス	5,200	839.00	4,362,800
マネジメントソリューションズ	3,000	1,990.00	5,970,000
プロレド・パートナーズ	1,100	3,520.00	3,872,000
and factory	5,500	845.00	4,647,500
カーブスホールディングス	16,700	972.00	16,232,400
日本車輛製造	2,300	2,491.00	5,729,300
三菱ロジスネクスト	8,400	1,154.00	9,693,600
近畿車輛	3,400	1,254.00	4,263,600
F P G	19,400	614.00	11,911,600
島根銀行	6,200	679.00	4,209,800
じもとホールディングス	5,200	797.00	4,144,400
全国保証	16,400	5,160.00	84,624,000
めぶきフィナンシャルグループ	326,700	234.00	76,447,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,700	1,313.00	4,858,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	1,231.00	9,724,900
九州フィナンシャルグループ	128,400	451.00	57,908,400
かんぽ生命保険	77,900	2,172.00	169,198,800

ゆうちょ銀行	178,100	1,006.00	179,168,600
富山第一銀行	15,000	297.00	4,455,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	383,000	426.00	163,158,000
西日本フィナンシャルホールディングス	41,800	710.00	29,678,000
イントラスト	5,100	721.00	3,677,100
アルヒ	9,300	1,641.00	15,261,300
プレミアグループ	2,900	2,432.00	7,052,800
日産自動車	751,800	587.20	441,456,960
いすゞ自動車	184,700	1,124.00	207,602,800
トヨタ自動車	645,800	8,060.00	5,205,148,000
日野自動車	79,600	1,017.00	80,953,200
三菱自動車工業	236,000	293.00	69,148,000
エフテック	6,800	667.00	4,535,600
武蔵精密工業	14,200	1,897.00	26,937,400
日産車体	9,300	808.00	7,514,400
新明和工業	18,000	961.00	17,298,000
極東開発工業	11,000	1,605.00	17,655,000
トピー工業	5,200	1,448.00	7,529,600
ティラド	3,100	1,849.00	5,731,900
曙ブレーキ工業	35,000	164.00	5,740,000
タチエス	9,800	1,101.00	10,789,800
N O K	30,800	1,473.00	45,368,400
フタバ産業	16,000	540.00	8,640,000
K Y B	7,100	3,010.00	21,371,000
市光工業	9,500	763.00	7,248,500
大同メタル工業	13,200	558.00	7,365,600
プレス工業	31,600	332.00	10,491,200
ミクニ	15,400	287.00	4,419,800
太平洋工業	13,300	1,214.00	16,146,200
河西工業	9,100	418.00	3,803,800
アイシン精機	46,700	3,640.00	169,988,000
マツダ	200,100	859.00	171,885,900
今仙電機製作所	5,700	770.00	4,389,000
本田技研工業	501,900	2,977.50	1,494,407,250
スズキ	126,400	4,918.00	621,635,200
S U B A R U	182,700	2,035.00	371,794,500
ヤマハ発動機	90,100	2,410.00	217,141,000
小糸製作所	38,200	7,750.00	296,050,000
T B K	9,300	438.00	4,073,400
エクセディ	8,700	1,645.00	14,311,500
ミツバ	11,700	624.00	7,300,800
豊田合成	20,600	2,856.00	58,833,600
愛三工業	10,000	578.00	5,780,000
ヨロズ	5,500	1,309.00	7,199,500
エフ・シー・シー	10,400	1,743.00	18,127,200
シマノ	23,900	25,405.00	607,179,500
テイ・エス テック	14,800	3,050.00	45,140,000
関西みらいフィナンシャルグループ	29,500	611.00	18,024,500
三十三フィナンシャルグループ	5,400	1,369.00	7,392,600
第四北越フィナンシャルグループ	10,200	2,334.00	23,806,800
ひろぎんホールディングス	92,700	650.00	60,255,000
ダイレクトマーケティングミックス	2,400	3,315.00	7,956,000
ジャムコ	6,200	888.00	5,505,600
小野建	5,600	1,323.00	7,408,800
ノジマ	11,200	2,911.00	32,603,200
佐鳥電機	5,300	807.00	4,277,100
カップ・クリエイト	8,800	1,511.00	13,296,800
伯東	3,800	1,282.00	4,871,600
コンドーテック	4,900	1,068.00	5,233,200

中山福	7,600	517.00	3,929,200
ライトオン	6,800	634.00	4,311,200
ナガイレーベン	8,300	2,785.00	23,115,500
三菱食品	6,900	2,962.00	20,437,800
良品計画	83,400	2,515.00	209,751,000
松田産業	4,600	1,941.00	8,928,600
第一興商	9,300	4,115.00	38,269,500
メディバルホールディングス	62,900	2,236.00	140,644,400
アドヴァン	6,400	1,119.00	7,161,600
S P K	3,300	1,268.00	4,184,400
萩原電気ホールディングス	2,300	2,585.00	5,945,500
アルビス	2,000	2,456.00	4,912,000
アズワン	4,500	14,760.00	66,420,000
スズデン	3,400	1,268.00	4,311,200
シモジマ	3,800	1,399.00	5,316,200
ドウシシャ	5,900	1,832.00	10,808,800
小津産業	2,200	1,919.00	4,221,800
コナカ	13,800	364.00	5,023,200
高速	3,300	1,544.00	5,095,200
G - 7ホールディングス	3,700	2,315.00	8,565,500
イオン北海道	8,300	1,154.00	9,578,200
コジマ	10,800	645.00	6,966,000
ヒマラヤ	4,200	973.00	4,086,600
コーナン商事	8,900	3,015.00	26,833,500
ネットワンシステムズ	25,500	3,300.00	84,150,000
エコス	2,300	1,955.00	4,496,500
ワタミ	8,300	1,007.00	8,358,100
マルシェ	8,500	515.00	4,377,500
システムソフト	44,500	135.00	6,007,500
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	125,500	2,550.00	320,025,000
丸文	7,500	529.00	3,967,500
西松屋チェーン	13,800	1,542.00	21,279,600
ゼンショーホールディングス	33,700	2,885.00	97,224,500
ハビネット	5,200	1,535.00	7,982,000
幸楽苑ホールディングス	4,000	1,799.00	7,196,000
橋本総業ホールディングス	1,600	2,597.00	4,155,200
日本ライフライン	20,300	1,320.00	26,796,000
サイゼリヤ	9,300	2,195.00	20,413,500
V Tホールディングス	23,600	424.00	10,006,400
マルカ	2,200	2,017.00	4,437,400
アルゴグラフィックス	4,900	3,050.00	14,945,000
I D O M	21,200	634.00	13,440,800
日本エム・ディ・エム	3,700	2,006.00	7,422,200
ユナイテッドアローズ	7,200	2,032.00	14,630,400
進和	3,700	2,147.00	7,943,900
ダイトロン	2,600	1,567.00	4,074,200
ハイデイ日高	9,100	1,802.00	16,398,200
シークス	8,000	1,756.00	14,048,000
京都きもの友禅	19,200	251.00	4,819,200
コロワイド	20,900	1,994.00	41,674,600
ピーシーデポコーポレーション	7,400	532.00	3,936,800
田中商事	6,000	702.00	4,212,000
オーハシテクニカ	3,200	1,445.00	4,624,000
壺番屋	4,400	4,990.00	21,956,000
白銅	3,000	1,393.00	4,179,000
スギホールディングス	12,500	7,450.00	93,125,000
ダイコー通産	2,600	1,518.00	3,946,800
薬王堂ホールディングス	2,700	2,716.00	7,333,200
島津製作所	82,000	4,365.00	357,930,000

JMS	5,400	983.00	5,308,200
長野計器	4,600	1,006.00	4,627,600
バイ・テクノロジー	3,000	5,940.00	17,820,000
スター精密	9,800	1,618.00	15,856,400
東京計器	4,400	927.00	4,078,800
愛知時計電機	1,000	4,395.00	4,395,000
インターアクション	3,200	2,691.00	8,611,200
オーバル	4,400	305.00	1,342,000
東京精密	10,700	5,130.00	54,891,000
マニー	25,400	2,695.00	68,453,000
ニコン	97,300	919.00	89,418,700
トプコン	32,100	1,270.00	40,767,000
オリンパス	352,700	2,240.50	790,224,350
理研計器	5,600	2,791.00	15,629,600
SCREENホールディングス	11,100	9,370.00	104,007,000
キヤノン電子	5,800	1,692.00	9,813,600
タムロン	5,100	1,969.00	10,041,900
HOYA	126,500	13,060.00	1,652,090,000
ノーリツ鋼機	5,700	2,385.00	13,594,500
エー・アンド・デイ	5,400	1,223.00	6,604,200
朝日インテック	67,100	3,280.00	220,088,000
キヤノン	316,800	2,338.50	740,836,800
リコー	162,200	948.00	153,765,600
シチズン時計	80,900	388.00	31,389,200
リズム	6,000	790.00	4,740,000
大研医器	7,300	573.00	4,182,900
メニコン	9,800	6,810.00	66,738,000
スノーピーク	3,800	3,170.00	12,046,000
パラマウントベッドホールディングス	6,100	4,540.00	27,694,000
粧美堂	10,500	404.00	4,242,000
ニホンフラッシュ	5,500	1,226.00	6,743,000
前田工織	7,000	2,966.00	20,762,000
永大産業	14,600	302.00	4,409,200
アートネイチャー	6,500	670.00	4,355,000
バンダイナムコホールディングス	52,700	8,744.00	460,808,800
共立印刷	34,000	126.00	4,284,000
SHOEI	5,600	4,260.00	23,856,000
フランスベッドホールディングス	8,200	962.00	7,888,400
マーベラス	9,900	947.00	9,375,300
パイロットコーポレーション	11,300	3,305.00	37,346,500
萩原工業	3,500	1,496.00	5,236,000
エイベックス	10,800	1,493.00	16,124,400
トッパン・フォームズ	11,400	1,040.00	11,856,000
フジシールインターナショナル	13,100	2,149.00	28,151,900
タカラトミー	28,600	999.00	28,571,400
廣済堂	4,800	936.00	4,492,800
レック	7,600	1,356.00	10,305,600
三光合成	5,800	444.00	2,575,200
プロネクス	5,500	1,208.00	6,644,000
ホクシン	37,000	118.00	4,366,000
大建工業	4,300	2,012.00	8,651,600
凸版印刷	96,900	1,681.00	162,888,900
大日本印刷	77,000	1,943.00	149,611,000
共同印刷	2,000	3,100.00	6,200,000
NISSHA	13,100	1,441.00	18,877,100
藤森工業	5,700	4,630.00	26,391,000
TAKARA & COMPANY	3,100	1,745.00	5,409,500
前澤化成工業	4,400	968.00	4,259,200
未来工業	2,400	1,736.00	4,166,400
アシックス	56,400	1,777.00	100,222,800

ツツミ	2,300	2,094.00	4,816,200
ウェーブロックホールディングス	4,900	734.00	3,596,600
JSP	3,700	1,815.00	6,715,500
ニチハ	8,900	3,045.00	27,100,500
ローランド	3,700	3,500.00	12,950,000
エフピコ	11,700	4,250.00	49,725,000
小松ウオール工業	2,400	1,934.00	4,641,600
ヤマハ	37,900	5,770.00	218,683,000
河合楽器製作所	1,800	3,650.00	6,570,000
ビジョン	40,900	4,090.00	167,281,000
天馬	4,800	2,150.00	10,320,000
オリバー	1,600	2,573.00	4,116,800
キングジム	5,300	887.00	4,701,100
象印マホービン	17,200	1,824.00	31,372,800
リンテック	13,600	2,415.00	32,844,000
信越ポリマー	9,800	1,027.00	10,064,600
東リ	17,200	245.00	4,214,000
イトーキ	12,700	364.00	4,622,800
任天堂	36,500	68,030.00	2,483,095,000
三菱鉛筆	10,500	1,400.00	14,700,000
松風	2,900	1,808.00	5,243,200
タカラスタANDARD	13,200	1,571.00	20,737,200
コクヨ	30,600	1,423.00	43,543,800
ナカバヤシ	6,800	620.00	4,216,000
ニフコ	23,400	3,795.00	88,803,000
立川ブラインド工業	3,200	1,271.00	4,067,200
グローブライト	3,100	4,060.00	12,586,000
オカムラ	24,500	1,073.00	26,288,500
バルカー	5,200	2,123.00	11,039,600
MUTOHホールディングス	2,700	1,590.00	4,293,000
伊藤忠商事	439,100	3,250.00	1,427,075,000
丸紅	619,100	786.60	486,984,060
スクロール	9,000	1,251.00	11,259,000
高島	2,500	1,713.00	4,282,500
ヨンドシーホールディングス	5,800	1,957.00	11,350,600
三陽商会	400	728.00	291,200
長瀬産業	35,300	1,740.00	61,422,000
蝶理	4,000	1,581.00	6,324,000
豊田通商	63,100	4,605.00	290,575,500
オンワードホールディングス	37,500	276.00	10,350,000
三共生興	9,500	499.00	4,740,500
兼松	25,100	1,388.00	34,838,800
美津濃	6,300	2,228.00	14,036,400
三井物産	509,800	2,214.50	1,128,952,100
日本紙パルプ商事	3,300	3,665.00	12,094,500
東京エレクトロン	37,300	46,300.00	1,726,990,000
カメイ	8,200	1,193.00	9,782,600
OUGホールディングス	1,500	2,821.00	4,231,500
スターゼン	2,300	4,310.00	9,913,000
セイコーホールディングス	9,000	1,680.00	15,120,000
山善	24,500	1,010.00	24,745,000
椿本興業	1,200	3,780.00	4,536,000
住友商事	396,200	1,565.50	620,251,100
日本ユニシス	21,700	3,245.00	70,416,500
内田洋行	2,500	4,555.00	11,387,500
三菱商事	382,300	2,982.50	1,140,209,750
第一実業	2,900	4,145.00	12,020,500
キヤノンマーケティングジャパン	15,600	2,387.00	37,237,200
西華産業	3,300	1,398.00	4,613,400
佐藤商事	5,200	999.00	5,194,800

菱洋エレクトロ	4,800	2,831.00	13,588,800
東京産業	6,900	673.00	4,643,700
ユアサ商事	6,400	3,080.00	19,712,000
神鋼商事	2,300	1,919.00	4,413,700
阪和興業	12,600	2,857.00	35,998,200
正栄食品工業	4,100	3,910.00	16,031,000
カナデン	5,100	1,266.00	6,456,600
菱電商事	4,500	1,573.00	7,078,500
ニプロ	47,500	1,388.00	65,930,000
フルサト工業	3,300	1,322.00	4,362,600
岩谷産業	15,100	6,360.00	96,036,000
昭光通商	6,500	752.00	4,888,000
イワキ	8,200	620.00	5,084,000
兼松エレクトロニクス	3,400	3,655.00	12,427,000
三愛石油	15,500	1,077.00	16,693,500
稲畑産業	15,100	1,532.00	23,133,200
明和産業	9,200	472.00	4,342,400
ヤマエ久野	4,600	1,063.00	4,889,800
ゴールドウイン	10,300	7,380.00	76,014,000
ユニ・チャーム	135,200	4,644.00	627,868,800
デサント	10,700	1,771.00	18,949,700
ワキタ	12,400	1,018.00	12,623,200
ヤマトインターナショナル	12,400	336.00	4,166,400
東邦ホールディングス	20,100	1,969.00	39,576,900
サンゲツ	16,900	1,604.00	27,107,600
ミツウロコグループホールディングス	9,300	1,252.00	11,643,600
シナネンホールディングス	2,300	3,230.00	7,429,000
伊藤忠エネクス	13,900	1,033.00	14,358,700
サンリオ	17,600	1,722.00	30,307,200
サンワテクノス	4,100	1,047.00	4,292,700
リョーサン	6,900	2,274.00	15,690,600
新光商事	8,500	777.00	6,604,500
トーヨー	2,800	1,830.00	5,124,000
三信電気	3,400	2,029.00	6,898,600
東陽テクニカ	6,700	1,131.00	7,577,700
モスフードサービス	8,900	3,120.00	27,768,000
加賀電子	5,700	2,388.00	13,611,600
三益半導体工業	4,900	2,649.00	12,980,100
都築電気	2,500	1,536.00	3,840,000
ソーダニッカ	7,900	541.00	4,273,900
立花エレクトック	4,600	1,574.00	7,240,400
木曽路	8,200	2,454.00	20,122,800
SRSホールディングス	7,800	870.00	6,786,000
リテールパートナーズ	7,600	1,483.00	11,270,800
ケーヨー	11,600	756.00	8,769,600
上新電機	7,400	3,100.00	22,940,000
日本瓦斯	10,300	5,020.00	51,706,000
ロイヤルホールディングス	11,000	1,885.00	20,735,000
東天紅	4,700	940.00	4,418,000
いなげや	7,000	1,685.00	11,795,000
島忠	4,200	5,480.00	23,016,000
チヨダ	6,600	1,001.00	6,606,600
ライフコーポレーション	4,800	3,310.00	15,888,000
リンガーハット	7,700	2,405.00	18,518,500
MrMaxHD	8,600	768.00	6,604,800
テンアライド	12,500	353.00	4,412,500
AOKIホールディングス	12,600	653.00	8,227,800
オークワ	9,800	1,195.00	11,711,000
コメリ	9,700	2,949.00	28,605,300
青山商事	14,000	778.00	10,892,000



しまむら	7,300	11,430.00	83,439,000
はせがわ	14,400	293.00	4,219,200
高島屋	45,700	1,052.00	48,076,400
松屋	13,700	964.00	13,206,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	29,700	842.00	25,007,400
近鉄百貨店	2,400	3,375.00	8,100,000
丸井グループ	53,100	2,062.00	109,492,200
クレディセゾン	36,700	1,323.00	48,554,100
アクシアル リテイリング	5,200	4,790.00	24,908,000
イオン	241,600	3,550.00	857,680,000
イズミ	12,800	3,910.00	50,048,000
フォーバル	5,200	843.00	4,383,600
平和堂	11,600	2,059.00	23,884,400
フジ	7,600	1,984.00	15,078,400
ヤオコー	7,100	6,670.00	47,357,000
ゼビオホールディングス	7,600	931.00	7,075,600
ケーズホールディングス	55,900	1,523.00	85,135,700
PALTAC	10,100	5,690.00	57,469,000
三谷産業	9,800	432.00	4,233,600
新生銀行	51,300	1,541.00	79,053,300
あおぞら銀行	37,500	2,301.00	86,287,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,301,000	563.30	2,422,753,300
りそなホールディングス	683,700	436.30	298,298,310
三井住友トラスト・ホールディングス	118,800	3,613.00	429,224,400
三井住友フィナンシャルグループ	435,200	3,763.00	1,637,657,600
千葉銀行	209,800	711.00	149,167,800
群馬銀行	129,400	348.00	45,031,200
武蔵野銀行	9,400	1,609.00	15,124,600
千葉興業銀行	17,400	272.00	4,732,800
筑波銀行	26,100	187.00	4,880,700
七十七銀行	19,700	1,442.00	28,407,400
青森銀行	4,900	2,462.00	12,063,800
秋田銀行	3,800	1,433.00	5,445,400
山形銀行	7,100	1,115.00	7,916,500
岩手銀行	4,100	2,142.00	8,782,200
東邦銀行	56,200	213.00	11,970,600
みちのく銀行	4,100	1,066.00	4,370,600
ふくおかフィナンシャルグループ	56,700	2,028.00	114,987,600
静岡銀行	153,100	798.00	122,173,800
十六銀行	7,900	2,000.00	15,800,000
スルガ銀行	55,100	361.00	19,891,100
八十二銀行	141,600	366.00	51,825,600
山梨中央銀行	7,300	906.00	6,613,800
大垣共立銀行	12,500	2,077.00	25,962,500
福井銀行	5,400	1,939.00	10,470,600
北國銀行	5,800	2,690.00	15,602,000
清水銀行	2,600	1,657.00	4,308,200
富山銀行	1,500	2,943.00	4,414,500
滋賀銀行	12,600	2,056.00	25,905,600
南都銀行	9,200	1,836.00	16,891,200
百五銀行	56,600	311.00	17,602,600
京都銀行	22,500	6,610.00	148,725,000
紀陽銀行	22,300	1,446.00	32,245,800
ほくほくフィナンシャルグループ	41,900	976.00	40,894,400
山陰合同銀行	39,600	497.00	19,681,200
中国銀行	54,100	870.00	47,067,000
鳥取銀行	3,800	1,127.00	4,282,600
伊予銀行	83,300	641.00	53,395,300
百十四銀行	6,700	1,599.00	10,713,300
四国銀行	8,900	736.00	6,550,400

阿波銀行	9,600	2,297.00	22,051,200
大分銀行	3,600	2,155.00	7,758,000
宮崎銀行	3,900	2,289.00	8,927,100
佐賀銀行	3,600	1,416.00	5,097,600
沖縄銀行	5,800	2,819.00	16,350,200
琉球銀行	13,700	789.00	10,809,300
セブン銀行	210,100	243.00	51,054,300
みずほフィナンシャルグループ	854,400	1,588.50	1,357,214,400
山口フィナンシャルグループ	78,500	673.00	52,830,500
芙蓉総合リース	6,600	7,190.00	47,454,000
みずほリース	9,700	3,375.00	32,737,500
東京センチュリー	14,600	7,350.00	107,310,000
SBIホールディングス	77,100	3,120.00	240,552,000
日本証券金融	26,600	611.00	16,252,600
アイフル	105,500	279.00	29,434,500
長野銀行	3,300	1,307.00	4,313,100
名古屋銀行	5,100	2,842.00	14,494,200
北洋銀行	94,800	237.00	22,467,600
愛知銀行	2,100	2,933.00	6,159,300
中京銀行	2,300	1,785.00	4,105,500
大光銀行	3,300	1,379.00	4,550,700
愛媛銀行	8,800	1,001.00	8,808,800
京葉銀行	26,800	436.00	11,684,800
栃木銀行	30,400	180.00	5,472,000
北日本銀行	2,200	1,932.00	4,250,400
東和銀行	11,000	695.00	7,645,000
リコーリース	4,900	3,300.00	16,170,000
イオンフィナンシャルサービス	38,500	1,397.00	53,784,500
アコム	126,400	473.00	59,787,200
ジャックス	6,900	2,083.00	14,372,700
オリエン트コーポレーション	170,100	154.00	26,195,400
日立キャピタル	14,800	2,904.00	42,979,200
オリックス	390,100	1,784.00	695,938,400
三菱UFJリース	141,800	573.00	81,251,400
ジャフコグループ	9,700	6,860.00	66,542,000
九州リースサービス	6,800	643.00	4,372,400
トモニホールディングス	48,600	312.00	15,163,200
大和証券グループ本社	470,900	529.00	249,106,100
野村ホールディングス	960,000	632.10	606,816,000
岡三証券グループ	53,600	418.00	22,404,800
丸三証券	18,700	625.00	11,687,500
東洋証券	27,100	187.00	5,067,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	67,000	388.00	25,996,000
光世証券	6,600	703.00	4,639,800
水戸証券	16,800	305.00	5,124,000
いちよし証券	12,600	637.00	8,026,200
松井証券	30,800	926.00	28,520,800
SOMPOホールディングス	110,800	4,124.00	456,939,200
日本取引所グループ	169,900	2,405.50	408,694,450
マネックスグループ	56,400	974.00	54,933,600
極東証券	8,400	831.00	6,980,400
岩井コスモホールディングス	6,400	1,597.00	10,220,800
藍澤証券	11,300	880.00	9,944,000
フィデアホールディングス	61,000	125.00	7,625,000
池田泉州ホールディングス	72,300	163.00	11,784,900
アニコムホールディングス	17,700	1,078.00	19,080,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	152,700	3,133.00	478,409,100
スパークス・グループ	29,000	337.00	9,773,000

第一生命ホールディングス	332,200	1,902.00	631,844,400
東京海上ホールディングス	208,400	5,351.00	1,115,148,400
イー・ギャランティ	7,200	2,172.00	15,638,400
アサックス	5,700	739.00	4,212,300
N E C キャピタルソリューション	2,600	2,000.00	5,200,000
T & D ホールディングス	187,900	1,467.00	275,649,300
アドバンスクリエイト	1,400	1,818.00	2,545,200
三井不動産	286,600	2,395.00	686,407,000
三菱地所	413,100	1,849.50	764,028,450
平和不動産	10,800	3,575.00	38,610,000
東京建物	62,100	1,560.00	96,876,000
ダイビル	16,200	1,304.00	21,124,800
京阪神ビルディング	10,800	1,535.00	16,578,000
住友不動産	141,300	3,675.00	519,277,500
テーオーシー	12,300	780.00	9,594,000
東京楽天地	1,000	4,430.00	4,430,000
レオパレス 2 1	52,200	130.00	6,786,000
スターツコーポレーション	7,500	2,896.00	21,720,000
フジ住宅	7,300	654.00	4,774,200
空港施設	8,600	524.00	4,506,400
ゴールドクレスト	5,700	1,719.00	9,798,300
リログループ	33,300	2,572.00	85,647,600
エスリード	1,600	1,594.00	2,550,400
日神グループホールディングス	10,000	441.00	4,410,000
日本エスコン	11,400	769.00	8,766,600
タカラレーベン	26,300	350.00	9,205,000
A V A N T I A	4,900	889.00	4,356,100
イオンモール	31,500	1,863.00	58,684,500
毎日コムネット	6,100	690.00	4,209,000
ファースト住建	3,900	1,110.00	4,329,000
カチタス	15,600	3,025.00	47,190,000
東祥	3,800	1,990.00	7,562,000
トーセイ	8,700	1,027.00	8,934,900
穴吹興産	2,600	1,725.00	4,485,000
サンフロンティア不動産	7,700	928.00	7,145,600
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	1,126.00	6,981,200
グランディハウス	10,200	457.00	4,661,400
東武鉄道	66,400	3,040.00	201,856,000
相鉄ホールディングス	21,900	2,473.00	54,158,700
東急	160,800	1,453.00	233,642,400
京浜急行電鉄	81,900	1,807.00	147,993,300
小田急電鉄	102,100	3,225.00	329,272,500
京王電鉄	35,600	8,380.00	298,328,000
京成電鉄	47,800	3,790.00	181,162,000
富士急行	8,700	5,790.00	50,373,000
新京成電鉄	1,900	2,245.00	4,265,500
東日本旅客鉄道	112,200	7,625.00	855,525,000
西日本旅客鉄道	56,800	6,312.00	358,521,600
東海旅客鉄道	53,000	17,600.00	932,800,000
西武ホールディングス	76,800	1,298.00	99,686,400
鴻池運輸	10,100	1,090.00	11,009,000
西日本鉄道	17,700	3,015.00	53,365,500
ハマキョウレックス	4,900	3,345.00	16,390,500
サカイ引越センター	2,900	4,900.00	14,210,000
近鉄グループホールディングス	60,400	4,560.00	275,424,000
阪急阪神ホールディングス	80,500	3,625.00	291,812,500
南海電気鉄道	28,600	2,611.00	74,674,600
京阪ホールディングス	26,900	4,910.00	132,079,000
神戸電鉄	1,400	3,680.00	5,152,000
名古屋鉄道	49,600	2,763.00	137,044,800

山陽電気鉄道	4,300	1,995.00	8,578,500
トランコム	1,800	8,170.00	14,706,000
日本通運	20,900	7,990.00	166,991,000
ヤマトホールディングス	84,600	2,854.00	241,448,400
山九	15,500	4,470.00	69,285,000
日新	4,800	1,391.00	6,676,800
丸全昭和運輸	4,900	3,130.00	15,337,000
センコーグループホールディングス	33,300	1,040.00	34,632,000
トナミホールディングス	1,400	5,440.00	7,616,000
ニッコンホールディングス	20,300	2,154.00	43,726,200
日本石油輸送	1,500	2,661.00	3,991,500
福山通運	7,700	4,335.00	33,379,500
セイノーホールディングス	45,200	1,534.00	69,336,800
神奈川中央交通	1,500	3,825.00	5,737,500
日立物流	13,300	3,355.00	44,621,500
丸和運輸機関	12,700	2,177.00	27,647,900
C & F ロジホールディングス	6,100	1,796.00	10,955,600
日本郵船	50,500	3,055.00	154,277,500
商船三井	35,900	3,355.00	120,444,500
川崎汽船	18,600	2,065.00	38,409,000
NSユニテッド海運	2,900	1,607.00	4,660,300
飯野海運	28,100	453.00	12,729,300
九州旅客鉄道	46,700	2,553.00	119,225,100
SGホールディングス	114,100	2,655.00	302,935,500
日本航空	147,100	2,416.00	355,393,600
ANAホールディングス	162,900	2,550.50	415,476,450
パスコ	1,200	1,370.00	1,644,000
Genky DrugStores	2,800	3,595.00	10,066,000
国際紙パルプ商事	17,700	244.00	4,318,800
ブックオフグループホールディングス	4,900	886.00	4,341,400
三菱倉庫	20,900	3,390.00	70,851,000
三井倉庫ホールディングス	6,400	2,240.00	14,336,000
住友倉庫	21,700	1,463.00	31,747,100
澁澤倉庫	3,300	2,290.00	7,557,000
ヤマタネ	3,100	1,442.00	4,470,200
東陽倉庫	13,000	332.00	4,316,000
乾汽船	4,600	935.00	4,301,000
日本トランスシティ	13,300	569.00	7,567,700
ケイヒン	3,200	1,367.00	4,374,400
安田倉庫	5,000	946.00	4,730,000
東洋埠頭	3,000	1,428.00	4,284,000
宇徳	9,000	466.00	4,194,000
上組	33,700	2,008.00	67,669,600
キューソー流通システム	2,700	1,573.00	4,247,100
近鉄エクスプレス	11,400	2,771.00	31,589,400
東海運	13,300	320.00	4,256,000
エーアイティー	2,400	1,072.00	2,572,800
内外トランスライン	3,500	1,293.00	4,525,500
TBSホールディングス	41,500	2,053.00	85,199,500
日本テレビホールディングス	52,200	1,417.00	73,967,400
朝日放送グループホールディングス	6,200	723.00	4,482,600
テレビ朝日ホールディングス	19,300	2,164.00	41,765,200
スカパーJ S A Tホールディングス	41,200	460.00	18,952,000
テレビ東京ホールディングス	4,600	2,482.00	11,417,200
日本BS放送	3,600	1,168.00	4,204,800
ビジョン	7,800	989.00	7,714,200
USEN-NEXT HOLDINGS	2,400	1,952.00	4,684,800
コネクシオ	3,500	1,396.00	4,886,000
日本通信	55,300	258.00	14,267,400
日本電信電話	731,600	2,818.50	2,062,014,600

KDDI	501,600	3,391.00	1,700,925,600
ソフトバンク	568,500	1,448.00	823,188,000
光通信	7,400	21,200.00	156,880,000
エムティーアイ	6,100	859.00	5,239,900
GMOインターネット	22,400	3,645.00	81,648,000
ファイバーゲート	2,000	2,132.00	4,264,000
アйдママーケティングコミュニケーション	9,600	485.00	4,656,000
KADOKAWA	16,800	4,180.00	70,224,000
学研ホールディングス	8,400	1,585.00	13,314,000
ゼンリン	11,300	1,355.00	15,311,500
インプレスホールディングス	22,600	197.00	4,452,200
東京電力ホールディングス	540,700	358.00	193,570,600
中部電力	195,000	1,322.50	257,887,500
関西電力	241,500	1,072.50	259,008,750
中国電力	91,900	1,304.00	119,837,600
北陸電力	58,300	674.00	39,294,200
東北電力	149,300	945.00	141,088,500
四国電力	53,000	761.00	40,333,000
九州電力	140,800	930.00	130,944,000
北海道電力	59,700	465.00	27,760,500
沖縄電力	12,400	1,457.00	18,066,800
電源開発	50,700	1,761.00	89,282,700
エフオン	3,500	1,048.00	3,668,000
イーレックス	9,400	1,735.00	16,309,000
レノバ	10,700	3,375.00	36,112,500
東京瓦斯	122,600	2,313.00	283,573,800
大阪瓦斯	115,500	1,964.00	226,842,000
東邦瓦斯	31,400	6,470.00	203,158,000
北海道瓦斯	3,400	1,607.00	5,463,800
広島ガス	13,200	381.00	5,029,200
西部瓦斯	7,200	2,936.00	21,139,200
静岡ガス	18,100	957.00	17,321,700
メタウォーター	7,200	2,180.00	15,696,000
アイネット	3,200	1,508.00	4,825,600
松竹	4,100	15,630.00	64,083,000
東宝	36,900	4,230.00	156,087,000
エイチ・アイ・エス	8,800	2,353.00	20,706,400
東映	2,000	21,300.00	42,600,000
ラックランド	1,700	2,366.00	4,022,200
エヌ・ティ・ティ・データ	166,500	1,617.00	269,230,500
共立メンテナンス	10,100	3,890.00	39,289,000
イチネンホールディングス	6,300	1,330.00	8,379,000
建設技術研究所	3,900	2,384.00	9,297,600
スペース	5,300	883.00	4,679,900
アインホールディングス	9,100	7,140.00	64,974,000
燦ホールディングス	3,600	1,121.00	4,035,600
ピー・シー・エー	900	4,230.00	3,807,000
東京テアトル	3,300	1,305.00	4,306,500
タナベ経営	3,000	1,395.00	4,185,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,500	1,709.00	4,272,500
ナガワ	1,900	10,480.00	19,912,000
東京都競馬	4,000	4,810.00	19,240,000
カナモト	10,700	2,398.00	25,658,600
東京ドーム	24,700	1,298.00	32,060,600
DTS	13,000	2,406.00	31,278,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,700	6,510.00	173,817,000
シーイーシー	6,700	1,465.00	9,815,500
カブコン	26,800	6,700.00	179,560,000

西尾レントオール	5,600	2,704.00	15,142,400
アイ・エス・ビー	3,100	1,239.00	3,840,900
日本空港ビルデング	20,100	5,230.00	105,123,000
トランス・コスモス	5,800	2,772.00	16,077,600
乃村工藝社	26,100	822.00	21,454,200
ジャステック	4,000	1,252.00	5,008,000
S C S K	14,400	6,560.00	94,464,000
日本管財	6,500	2,127.00	13,825,500
トーカイ	5,900	2,232.00	13,168,800
セコム	60,000	9,677.00	580,620,000
日本システムウエア	2,100	2,053.00	4,311,300
セントラル警備保障	2,900	3,435.00	9,961,500
アイネス	6,100	1,397.00	8,521,700
丹青社	11,500	823.00	9,464,500
メイテック	7,500	5,830.00	43,725,000
T K C	5,300	6,660.00	35,298,000
富士ソフト	6,700	5,620.00	37,654,000
応用地質	7,100	1,267.00	8,995,700
船井総研ホールディングス	12,500	2,299.00	28,737,500
N S D	20,100	1,914.00	38,471,400
進学会ホールディングス	8,800	472.00	4,153,600
丸紅建材リース	2,400	1,870.00	4,488,000
コナミホールディングス	22,700	7,460.00	169,342,000
学究社	3,200	1,329.00	4,252,800
ベネッセホールディングス	22,300	2,149.00	47,922,700
イオンディライト	7,500	3,135.00	23,512,500
ナック	4,600	979.00	4,503,400
福井コンピュータホールディングス	2,900	3,625.00	10,512,500
ダイセキ	10,200	3,465.00	35,343,000
ステップ	2,700	1,505.00	4,063,500
日鉄物産	4,500	3,935.00	17,707,500
泉州電業	1,800	3,675.00	6,615,000
元気寿司	1,800	2,516.00	4,528,800
トラスコ中山	14,400	2,667.00	38,404,800
ヤマダホールディングス	210,400	542.00	114,036,800
オートバックスセブン	23,300	1,431.00	33,342,300
モリト	6,900	614.00	4,236,600
アークランドサカモト	9,800	1,613.00	15,807,400
ニトリホールディングス	24,900	20,685.00	515,056,500
グルメ杵屋	4,500	985.00	4,432,500
愛眼	18,400	230.00	4,232,000
吉野家ホールディングス	20,600	2,205.00	45,423,000
加藤産業	9,100	3,695.00	33,624,500
イノテック	3,500	1,243.00	4,350,500
イエローハット	11,900	1,745.00	20,765,500
松屋フーズホールディングス	3,000	3,675.00	11,025,000
J B C Cホールディングス	4,200	1,459.00	6,127,800
J Kホールディングス	5,700	813.00	4,634,100
サガミホールディングス	8,500	1,167.00	9,919,500
日伝	5,200	2,199.00	11,434,800
関西スーパーマーケット	4,700	1,145.00	5,381,500
ミロク情報サービス	6,200	2,246.00	13,925,200
北沢産業	15,400	270.00	4,158,000
杉本商事	3,200	2,424.00	7,756,800
因幡電機産業	16,700	2,550.00	42,585,000
王将フードサービス	4,100	5,850.00	23,985,000
プレナス	7,000	1,923.00	13,461,000
ミニストップ	4,700	1,429.00	6,716,300
アークス	12,000	2,404.00	28,848,000
パローホールディングス	12,800	2,347.00	30,041,600

東テク	2,100	2,781.00	5,840,100	
ミスミグループ本社	78,700	3,455.00	271,908,500	
ベルク	3,100	5,710.00	17,701,000	
大 庄	4,300	1,035.00	4,450,500	
タキヒヨー	2,200	1,889.00	4,155,800	
ファーストリテイリング	8,400	104,900.00	881,160,000	
ソフトバンクグループ	496,300	10,530.00	5,226,039,000	
蔵王産業	3,100	1,390.00	4,309,000	
スズケン	26,600	4,265.00	113,449,000	
サンドラッグ	23,600	4,060.00	95,816,000	
サックスパー ホールディングス	7,400	639.00	4,728,600	
ジェコス	4,400	960.00	4,224,000	
やまや	1,900	2,245.00	4,265,500	
ペルーナ	13,500	1,037.00	13,999,500	
合計	66,696,700		169,111,924,060	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	14,133,745	15,207,880
コール・ローン	606,777,680	777,546,348
国債証券	60,286,981,030	60,958,165,760
地方債証券	7,236,402,821	5,989,782,246
特殊債券	8,307,495,386	7,684,192,477
社債券	5,744,449,000	4,585,743,100
未収利息	218,630,794	220,024,816
前払費用	6,634,696	2,183,875
流動資産合計	82,421,505,152	80,232,846,502
資産合計	82,421,505,152	80,232,846,502
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,663,143	22,762,935
その他未払費用	801	1,171
流動負債合計	14,663,944	22,764,106
負債合計	14,663,944	22,764,106
純資産の部		
元本等		
元本	82,709,590,673	82,138,960,938
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	302,749,465	1,928,878,542
純資産合計	82,406,841,208	80,210,082,396
負債純資産合計	82,421,505,152	80,232,846,502



## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	82,709,590,673口	82,138,960,938口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	302,749,465円	1,928,878,542円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9963円 (9,963円)	0.9765円 (9,765円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日	自 2020年2月22日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22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す。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年2月21日現在	2021年2月22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	470,833,190	2,056,738,230
地方債証券	17,477,756	90,419,551
特殊債券	33,594,185	84,888,323
社債券	27,653,300	45,556,500
合計	392,107,949	2,277,602,604

(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	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	93,246,832,729円	82,709,590,673円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	7,513,852,343円	8,108,809,092円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	18,051,094,399円	8,679,438,827円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB（適格機関投資家限定）	77,960,275,163円	73,135,377,015円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,993,604,676円	2,488,850,856円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	41,659,580円	79,904,306円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,913,782,404円	3,650,903,922円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	45,960,871円	121,258,095円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	147,466,511円	474,544,755円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	387,230,112円	1,153,691,426円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（6資産均等型）	90,813,280円	118,512,722円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リー ト/債券）	5,174,232円	9,384,221円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リー ト/債券）	30,971,907円	47,471,437円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラン スファンド（8資産均等型）	35,248,815円	39,992,625円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	3,441,982円	21,509,224円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,361,447円	22,681,372円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	9,618,706円	105,027,760円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	39,980,987円	669,851,202円
計	82,709,590,673円	82,138,960,938円

附属明細表（2021年2月22日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
国債証券	第410回 利付国債（2年）	79,000,000	79,176,170	
	第411回 利付国債（2年）	178,000,000	178,439,660	
	第412回 利付国債（2年）	8,000,000	8,021,280	
	第413回 利付国債（2年）	170,000,000	170,472,600	
	第414回 利付国債（2年）	259,000,000	259,784,770	
	第415回 利付国債（2年）	160,000,000	160,515,200	
	第416回 利付国債（2年）	266,000,000	266,909,720	
	第417回 利付国債（2年）	200,000,000	200,720,000	
	第418回 利付国債（2年）	200,000,000	200,758,000	
	第419回 利付国債（2年）	367,000,000	368,427,630	
	第420回 利付国債（2年）	200,000,000	200,816,000	
	第131回 利付国債（5年）	477,000,000	478,092,330	
	第132回 利付国債（5年）	314,000,000	314,910,600	
	第133回 利付国債（5年）	587,000,000	589,031,020	
	第134回 利付国債（5年）	212,000,000	212,828,920	
	第135回 利付国債（5年）	235,000,000	236,019,900	
	第137回 利付国債（5年）	144,000,000	144,779,040	
	第138回 利付国債（5年）	404,000,000	406,456,320	
	第139回 利付国債（5年）	434,000,000	436,799,300	

第140回 利付国債(5年)	340,000,000	342,318,800
第141回 利付国債(5年)	470,000,000	473,365,200
第142回 利付国債(5年)	150,000,000	151,092,000
第1回 利付国債(40年)	110,000,000	157,570,600
第2回 利付国債(40年)	142,000,000	197,284,860
第3回 利付国債(40年)	122,000,000	170,521,840
第4回 利付国債(40年)	171,000,000	240,381,540
第5回 利付国債(40年)	182,000,000	247,745,680
第6回 利付国債(40年)	176,000,000	236,257,120
第7回 利付国債(40年)	197,000,000	254,681,600
第8回 利付国債(40年)	208,000,000	251,507,360
第9回 利付国債(40年)	335,000,000	302,866,800
第10回 利付国債(40年)	301,000,000	319,252,640
第11回 利付国債(40年)	258,000,000	265,590,360
第12回 利付国債(40年)	2,000,000	1,860,200
第13回 利付国債(40年)	170,000,000	157,634,200
第321回 利付国債(10年)	63,000,000	63,749,070
第322回 利付国債(10年)	51,000,000	51,552,330
第323回 利付国債(10年)	32,000,000	32,428,480
第324回 利付国債(10年)	99,000,000	100,194,930
第325回 利付国債(10年)	631,000,000	640,080,090
第327回 利付国債(10年)	592,000,000	601,815,360
第328回 利付国債(10年)	425,000,000	431,247,500
第329回 利付国債(10年)	269,000,000	274,654,380
第330回 利付国債(10年)	3,000,000	3,069,960
第332回 利付国債(10年)	196,000,000	199,906,280
第333回 利付国債(10年)	193,000,000	197,184,240
第334回 利付国債(10年)	618,000,000	632,399,400
第335回 利付国債(10年)	289,000,000	295,158,590
第336回 利付国債(10年)	53,000,000	54,187,730
第337回 利付国債(10年)	303,000,000	307,469,250
第338回 利付国債(10年)	491,000,000	500,608,870
第339回 利付国債(10年)	536,000,000	547,143,440
第340回 利付国債(10年)	566,000,000	578,457,660
第341回 利付国債(10年)	552,000,000	561,875,280
第342回 利付国債(10年)	510,000,000	514,141,200
第343回 利付国債(10年)	461,000,000	464,807,860
第344回 利付国債(10年)	533,000,000	537,311,970
第345回 利付国債(10年)	532,000,000	536,341,120
第346回 利付国債(10年)	523,000,000	527,288,600
第347回 利付国債(10年)	426,000,000	429,365,400
第348回 利付国債(10年)	499,000,000	502,937,110
第349回 利付国債(10年)	481,000,000	484,775,850
第350回 利付国債(10年)	605,000,000	609,489,100
第351回 利付国債(10年)	540,000,000	543,553,200
第352回 利付国債(10年)	576,000,000	579,479,040
第353回 利付国債(10年)	543,000,000	545,964,780
第354回 利付国債(10年)	512,000,000	514,467,840
第355回 利付国債(10年)	624,000,000	626,583,360
第356回 利付国債(10年)	618,000,000	620,107,380
第357回 利付国債(10年)	520,000,000	521,362,400
第358回 利付国債(10年)	518,000,000	518,932,400
第359回 利付国債(10年)	690,000,000	690,317,400
第360回 利付国債(10年)	571,000,000	570,725,920
第361回 利付国債(10年)	199,000,000	198,709,460
第1回 利付国債(30年)	10,000,000	12,330,800
第2回 利付国債(30年)	83,000,000	100,274,790
第3回 利付国債(30年)	125,000,000	150,432,500
第4回 利付国債(30年)	116,000,000	147,320,000
第5回 利付国債(30年)	95,000,000	114,916,750

第6回	利付国債(30年)	39,000,000	48,272,250
第7回	利付国債(30年)	50,000,000	61,738,500
第8回	利付国債(30年)	39,000,000	46,185,360
第9回	利付国債(30年)	37,000,000	42,126,350
第10回	利付国債(30年)	62,000,000	68,493,260
第11回	利付国債(30年)	50,000,000	58,910,000
第12回	利付国債(30年)	39,000,000	47,968,050
第13回	利付国債(30年)	39,000,000	47,595,600
第14回	利付国債(30年)	61,000,000	77,740,840
第15回	利付国債(30年)	82,000,000	105,847,240
第16回	利付国債(30年)	54,000,000	69,900,300
第17回	利付国債(30年)	67,000,000	86,068,870
第18回	利付国債(30年)	81,000,000	103,211,820
第19回	利付国債(30年)	74,000,000	94,512,060
第20回	利付国債(30年)	93,000,000	121,731,420
第21回	利付国債(30年)	95,000,000	121,870,750
第22回	利付国債(30年)	105,000,000	138,097,050
第23回	利付国債(30年)	108,000,000	142,378,560
第24回	利付国債(30年)	95,000,000	125,528,250
第25回	利付国債(30年)	109,000,000	141,071,070
第26回	利付国債(30年)	182,000,000	238,749,420
第27回	利付国債(30年)	165,000,000	220,042,350
第28回	利付国債(30年)	213,000,000	285,138,840
第29回	利付国債(30年)	225,000,000	298,626,750
第30回	利付国債(30年)	236,000,000	310,238,520
第31回	利付国債(30年)	215,000,000	279,960,100
第32回	利付国債(30年)	268,000,000	355,057,120
第33回	利付国債(30年)	299,000,000	381,326,660
第34回	利付国債(30年)	276,000,000	363,883,920
第35回	利付国債(30年)	241,000,000	309,578,960
第36回	利付国債(30年)	296,000,000	381,345,680
第37回	利付国債(30年)	311,000,000	395,772,380
第38回	利付国債(30年)	207,000,000	259,960,950
第39回	利付国債(30年)	192,000,000	245,228,160
第40回	利付国債(30年)	165,000,000	207,659,100
第41回	利付国債(30年)	170,000,000	210,704,800
第42回	利付国債(30年)	185,000,000	229,486,950
第43回	利付国債(30年)	176,000,000	218,507,520
第44回	利付国債(30年)	173,000,000	214,959,420
第45回	利付国債(30年)	201,000,000	241,214,070
第46回	利付国債(30年)	237,000,000	284,546,940
第47回	利付国債(30年)	217,000,000	265,586,300
第48回	利付国債(30年)	226,000,000	266,711,640
第49回	利付国債(30年)	231,000,000	272,686,260
第50回	利付国債(30年)	227,000,000	236,633,880
第51回	利付国債(30年)	226,000,000	209,029,660
第52回	利付国債(30年)	239,000,000	231,901,700
第53回	利付国債(30年)	217,000,000	215,313,910
第54回	利付国債(30年)	224,000,000	232,785,280
第55回	利付国債(30年)	216,000,000	224,287,920
第56回	利付国債(30年)	231,000,000	239,664,810
第57回	利付国債(30年)	238,000,000	246,715,560
第58回	利付国債(30年)	286,000,000	296,213,060
第59回	利付国債(30年)	219,000,000	221,281,980
第60回	利付国債(30年)	199,000,000	210,631,550
第61回	利付国債(30年)	201,000,000	202,413,030
第62回	利付国債(30年)	130,000,000	124,191,600
第63回	利付国債(30年)	139,000,000	128,992,000
第64回	利付国債(30年)	150,000,000	138,954,000
第65回	利付国債(30年)	177,000,000	163,675,440

第66回	利付国債(30年)	181,000,000	167,278,390
第67回	利付国債(30年)	230,000,000	224,404,100
第68回	利付国債(30年)	151,000,000	147,300,500
第55回	利付国債(20年)	85,000,000	86,922,700
第56回	利付国債(20年)	90,000,000	92,511,900
第57回	利付国債(20年)	95,000,000	97,526,050
第58回	利付国債(20年)	130,000,000	134,118,400
第65回	利付国債(20年)	42,000,000	44,380,980
第66回	利付国債(20年)	13,000,000	13,700,180
第67回	利付国債(20年)	24,000,000	25,479,840
第68回	利付国債(20年)	109,000,000	116,727,010
第69回	利付国債(20年)	73,000,000	77,950,130
第70回	利付国債(20年)	127,000,000	137,568,940
第71回	利付国債(20年)	34,000,000	36,603,040
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	69,031,680
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	32,396,400
第75回	利付国債(20年)	87,000,000	94,736,040
第76回	利付国債(20年)	115,000,000	124,287,400
第77回	利付国債(20年)	88,000,000	95,465,920
第78回	利付国債(20年)	73,000,000	79,245,150
第79回	利付国債(20年)	58,000,000	63,213,040
第80回	利付国債(20年)	86,000,000	94,102,060
第81回	利付国債(20年)	64,000,000	70,089,600
第82回	利付国債(20年)	104,000,000	114,371,920
第83回	利付国債(20年)	69,000,000	76,221,540
第84回	利付国債(20年)	124,000,000	136,377,680
第85回	利付国債(20年)	89,000,000	98,767,750
第86回	利付国債(20年)	74,000,000	82,873,340
第87回	利付国債(20年)	71,000,000	79,152,930
第88回	利付国債(20年)	129,000,000	145,202,400
第89回	利付国債(20年)	73,000,000	81,778,980
第90回	利付国債(20年)	237,000,000	266,707,950
第91回	利付国債(20年)	167,000,000	188,866,980
第92回	利付国債(20年)	297,000,000	334,071,540
第93回	利付国債(20年)	128,000,000	143,833,600
第94回	利付国債(20年)	208,000,000	234,992,160
第95回	利付国債(20年)	202,000,000	231,718,240
第96回	利付国債(20年)	104,000,000	117,983,840
第97回	利付国債(20年)	196,000,000	224,623,840
第98回	利付国債(20年)	166,000,000	189,150,360
第99回	利付国債(20年)	303,000,000	346,744,110
第100回	利付国債(20年)	213,000,000	246,196,050
第101回	利付国債(20年)	151,000,000	176,668,490
第102回	利付国債(20年)	165,000,000	193,835,400
第103回	利付国債(20年)	158,000,000	184,457,100
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	155,632,050
第105回	利付国債(20年)	182,000,000	210,612,220
第106回	利付国債(20年)	134,000,000	156,079,180
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	176,543,440
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	231,465,740
第109回	利付国債(20年)	226,000,000	259,796,040
第110回	利付国債(20年)	265,000,000	308,889,300
第111回	利付国債(20年)	211,000,000	248,576,990
第112回	利付国債(20年)	296,000,000	346,260,800
第113回	利付国債(20年)	415,000,000	487,388,450
第114回	利付国債(20年)	200,000,000	235,688,000
第115回	利付国債(20年)	172,000,000	204,200,120
第116回	利付国債(20年)	194,000,000	231,119,960
第117回	利付国債(20年)	266,000,000	314,502,440
第118回	利付国債(20年)	188,000,000	221,180,120

第119回	利付国債(20年)	159,000,000	184,122,000	
第120回	利付国債(20年)	150,000,000	170,928,000	
第121回	利付国債(20年)	238,000,000	278,607,560	
第122回	利付国債(20年)	178,000,000	206,682,920	
第123回	利付国債(20年)	247,000,000	294,747,570	
第124回	利付国債(20年)	170,000,000	201,210,300	
第125回	利付国債(20年)	143,000,000	172,580,980	
第126回	利付国債(20年)	127,000,000	150,745,190	
第127回	利付国債(20年)	124,000,000	145,951,720	
第128回	利付国債(20年)	214,000,000	252,434,400	
第129回	利付国債(20年)	122,000,000	142,670,460	
第130回	利付国債(20年)	135,000,000	158,259,150	
第131回	利付国債(20年)	72,000,000	83,655,360	
第132回	利付国債(20年)	95,000,000	110,617,050	
第133回	利付国債(20年)	124,000,000	145,704,960	
第134回	利付国債(20年)	130,000,000	153,098,400	
第135回	利付国債(20年)	69,000,000	80,509,890	
第136回	利付国債(20年)	71,000,000	82,071,740	
第137回	利付国債(20年)	102,000,000	119,262,480	
第138回	利付国債(20年)	85,000,000	97,498,400	
第139回	利付国債(20年)	92,000,000	106,548,880	
第140回	利付国債(20年)	273,000,000	319,849,530	
第141回	利付国債(20年)	193,000,000	226,556,910	
第142回	利付国債(20年)	115,000,000	136,323,300	
第143回	利付国債(20年)	188,000,000	218,879,000	
第144回	利付国債(20年)	120,000,000	138,296,400	
第145回	利付国債(20年)	318,000,000	374,667,600	
第146回	利付国債(20年)	280,000,000	330,484,000	
第147回	利付国債(20年)	301,000,000	352,127,860	
第148回	利付国債(20年)	261,000,000	302,467,680	
第149回	利付国債(20年)	289,000,000	335,344,040	
第150回	利付国債(20年)	313,000,000	359,295,830	
第151回	利付国債(20年)	317,000,000	355,800,800	
第152回	利付国債(20年)	318,000,000	357,107,640	
第153回	利付国債(20年)	337,000,000	383,263,360	
第154回	利付国債(20年)	309,000,000	347,334,540	
第155回	利付国債(20年)	342,000,000	374,637,060	
第156回	利付国債(20年)	292,000,000	294,298,040	
第157回	利付国債(20年)	313,000,000	305,729,010	
第158回	利付国債(20年)	305,000,000	311,063,400	
第159回	利付国債(20年)	305,000,000	315,244,950	
第160回	利付国債(20年)	272,000,000	284,960,800	
第161回	利付国債(20年)	289,000,000	297,852,070	
第162回	利付国債(20年)	282,000,000	290,310,540	
第163回	利付国債(20年)	284,000,000	292,028,680	
第164回	利付国債(20年)	370,000,000	373,818,400	
第165回	利付国債(20年)	304,000,000	306,687,360	
第166回	利付国債(20年)	290,000,000	301,803,000	
第167回	利付国債(20年)	315,000,000	316,552,950	
第168回	利付国債(20年)	275,000,000	271,117,000	
第169回	利付国債(20年)	278,000,000	268,667,540	
第170回	利付国債(20年)	265,000,000	255,775,350	
第171回	利付国債(20年)	255,000,000	245,804,700	
第172回	利付国債(20年)	251,000,000	245,987,530	
第173回	利付国債(20年)	302,000,000	295,636,860	
国債証券 合計		56,188,000,000	60,958,165,760	
地方債証券	第708回 東京都公募公債	300,000,000	303,489,000	
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	305,748,300	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	304,517,700	
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,770,600	



第360回 大阪府公募公債(10年)	300,000,000	303,340,500	
第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	146,628,288	
第448回 大阪府公募公債(10年)	38,000,000	37,320,066	
第455回 大阪府公募公債(10年)	180,000,000	178,316,820	
第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	114,198,300	
第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	115,081,300	
平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	303,855,900	
平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	106,522,500	
平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,142,600	
平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	121,241,722	
平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	303,826,200	
平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	115,290,800	
平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	304,637,400	
第10回 群馬県公募公債	300,000,000	305,240,100	
第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,857,500	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,125,100	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	152,710,200	
第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	98,852,000	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	129,391,600	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	323,897,700	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	101,937,200	
第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,143,100	
第26回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,164,200	
第9回 川崎市公募公債(20年)	100,000,000	117,735,300	
第4回 川崎市公募公債(30年)	100,000,000	129,174,900	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	152,947,650	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,278,200	
平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	101,317,900	
平成29年度第1回 仙台市公募公債(20年)	100,000,000	102,081,600	
地方債証券 合計	5,731,000,000	5,989,782,246	
特殊債券			
第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	202,347,400	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	314,914,200	
第163回 政保道路機構債券	300,000,000	303,340,200	
第190回 政保道路機構債券	500,000,000	506,291,000	
第205回 政保道路機構債券	100,000,000	115,208,600	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	114,975,000	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	509,736,000	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	112,973,700	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	182,301,297	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	97,527,100	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	101,781,300	
第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,719,100	
第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,026,000	
第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,786,400	
第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,770,619	
第16回 公営企業債券	200,000,000	219,468,800	
第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,259,700	
第97回 都市再生債券	100,000,000	106,716,900	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	199,756,400	
第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,017,373,000	
第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,497,900	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,484,000	27,038,524	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,880,000	69,589,044	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	85,758,000	92,198,425	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,588,000	75,919,074	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,040,000	84,730,344	
第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	81,384,000	85,892,672	
第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,421,000	41,427,528	
第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	336,104,000	352,405,044	

	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	209,855,000	218,899,750	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	135,555,000	142,793,637	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	121,140,000	126,094,626	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	234,507,000	234,272,493	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	100,110,300	
	第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,090,300	
	第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,124,000	
	第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,136,200	
	第344回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,139,200	
	第353回 利付しんきん中金債券	100,000,000	99,974,900	
	第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,645,000	
	第116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,940,800	
特殊債券 合計		7,468,716,000	7,684,192,477	
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	301,381,800	
	第3回 ノルデア・バンク	200,000,000	203,897,200	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンク	200,000,000	202,690,600	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	203,792,600	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	101,680,100	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	101,745,000	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,215,400	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	204,213,800	
	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	101,684,700	
	第3回 富士フィルムホールディングス	300,000,000	304,351,500	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	101,573,100	
	第71回 伊藤忠商事	200,000,000	203,191,800	
	第46回 住友商事	100,000,000	101,442,700	
	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	101,257,000	
	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	101,305,100	
	第8回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	100,000,000	106,683,100	
	第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	101,451,500	
	第46回 三井不動産	100,000,000	101,363,100	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,339,800	
	第111回 三菱地所	100,000,000	101,362,800	
	第75回 東京急行電鉄	100,000,000	101,183,700	
	第77回 東京急行電鉄	100,000,000	102,052,000	
	第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,109,800	
	第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	202,668,800	
	第381回 中国電力	200,000,000	205,358,200	
	第304回 北陸電力	100,000,000	102,414,700	
	第306回 北陸電力	100,000,000	102,485,500	
	第253回 四国電力	200,000,000	204,282,400	
	第429回 九州電力	200,000,000	205,597,200	
	第331回 北海道電力	100,000,000	100,859,100	
第13回 電源開発	100,000,000	108,109,000		
社債券 合計		4,500,000,000	4,585,743,100	
合計		73,887,716,000	79,217,883,583	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,119,682,869	825,334,407
金銭信託	146,850,868	111,938,476
コール・ローン	6,304,474,246	5,723,174,640
株式	231,824,581,396	328,287,876,560
投資証券	6,540,003,766	6,993,987,190
派生商品評価勘定	234,248,770	481,236,363
未収入金	937,275	1,181,932
未収配当金	300,938,345	353,442,859
差入委託証拠金	2,400,932,652	5,597,510,242
流動資産合計	248,872,650,187	348,375,682,669
資産合計	248,872,650,187	348,375,682,669
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,814,319	18,492,897
未払解約金	665,847,583	1,289,565,337
その他未払費用	6,030	7,313
流動負債合計	681,667,932	1,308,065,547
負債合計	681,667,932	1,308,065,547
純資産の部		
元本等		
元本	117,983,458,933	149,298,469,961
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	130,207,523,322	197,769,147,161
純資産合計	248,190,982,255	347,067,617,122
負債純資産合計	248,872,650,187	348,375,682,669

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	117,983,458,933口	149,298,469,961口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1036円 (21,036円)	2.3247円 (23,247円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日	自 2020年2月22日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年2月21日現在	2021年2月22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	15,236,825,699	27,162,157,255
投資証券	409,353,240	81,351,678
合計	15,646,178,939	27,243,508,933

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2020年2月21日 現在				2021年2月22日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	5,803,139,733	-	5,893,526,850	90,387,117	3,997,515,183	-	4,015,332,160	17,816,977
アメリカ・ドル	3,967,053,862	-	4,038,994,050	71,940,188	2,836,608,859	-	2,844,209,490	7,600,631
イギリス・ポンド	535,591,504	-	541,632,960	6,041,456	388,588,627	-	396,062,150	7,473,523
ユーロ	1,300,494,367	-	1,312,899,840	12,405,473	772,317,697	-	775,060,520	2,742,823
合計	5,803,139,733	-	5,893,526,850	90,387,117	3,997,515,183	-	4,015,332,160	17,816,977

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	2020年2月21日 現在				2021年2月22日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	9,369,455,136	-	9,497,502,470	128,047,334	10,575,321,505	-	11,020,247,995	444,926,490
合計	9,369,455,136	-	9,497,502,470	128,047,334	10,575,321,505	-	11,020,247,995	444,926,490

(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	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	94,844,967,281円	117,983,458,933円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	46,386,791,267円	65,076,716,955円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	23,248,299,615円	33,761,705,927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)	696,655,998円	829,828,081円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,224,381,334円	3,602,743,571円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,452,973,512円	2,817,441,509円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	1,513,732,410円	1,666,188,259円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	3,829,046円	2,042,045円
ニッセイインデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	21,474,187円	13,144,645円
ニッセイインデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	22,999,716円	19,365,332円
ニッセイ外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	11,360,289,899円	11,027,955,139円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	80,906,577,165円	104,296,639,046円
DCニッセイ外国株式インデックス	16,474,845,579円	21,873,514,036円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	643,991,640円	1,074,180,685円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	64,268,965円	102,873,020円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	78,409,740円	130,273,210円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	46,775,884円	103,382,218円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	85,402,524円	220,476,439円



DCニッセイターゲットデートファンド2025	19,418,185円	32,967,652円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバ ランスファンド(6資産均等型)	44,985,994円	51,156,507円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,390,457円	5,634,181円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リ ート)	3,830,933円	5,931,474円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リ ート/債券)	1,044,944円	1,631,338円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバ ランスファンド(8資産均等型)	17,772,213円	17,391,882円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	6,776,594円	35,013,308円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,379,134円	23,491,494円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	8,209,983円	75,868,041円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	7,956,127円	92,538,390円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド202 0-02(適格機関投資家限定)	266,086,770円	263,675,673円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド202 0-06(適格機関投資家限定)	-円	303,245,922円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(G DP型バスケット)	-円	82,346,453円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド202 0-09(適格機関投資家限定)	-円	277,431,333円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド202 1-01(適格機関投資家限定)	-円	250,099,078円
計	117,983,458,933円	149,298,469,961円

## 附属明細表（2021年2月22日現在）

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	10X GENOMICS INC-CLASS A	3,960	190.73	755,290.80	
	3M CO	37,127	176.54	6,554,400.58	
	ABBOTT LABORATORIES	114,075	123.04	14,035,788.00	
	ABBVIE INC	113,768	105.01	11,946,777.68	
	ABIOMED INC	2,884	331.97	957,401.48	
	ACCENTURE PLC	40,955	254.29	10,414,446.95	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	49,625	100.80	5,002,200.00	
	ADOBE INC	30,869	479.12	14,789,955.28	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,445	165.98	737,781.10	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	75,635	89.58	6,775,383.30	
	AES CORP	43,185	28.31	1,222,567.35	
	AFLAC INC	43,398	48.08	2,086,575.84	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,869	126.87	2,520,780.03	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,234	263.88	3,756,067.92	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,424	98.86	1,030,516.64	
	ALBEMARLE CORP	6,846	156.17	1,069,139.82	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	14,050	155.51	2,184,915.50	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,814	599.25	2,884,789.50	
	ALLEGHANY CORP	895	609.03	545,081.85	
	ALLEGION PLC	6,045	109.06	659,267.70	
	ALLIANT ENERGY CORP	16,107	47.63	767,176.41	
	ALLSTATE CORP	19,960	103.45	2,064,862.00	
	ALLY FINANCIAL INC	24,094	42.80	1,031,223.20	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,518	155.06	1,165,741.08	
	ALPHABET INC-CL A	19,260	2,088.81	40,230,480.60	
	ALPHABET INC-CL C	19,435	2,101.14	40,835,655.90	
	ALTICE USA INC- A	19,106	33.83	646,355.98	
	ALTRIA GROUP INC	119,962	43.80	5,254,335.60	
	AMAZON.COM INC	27,428	3,249.90	89,138,257.20	
	AMCOR PLC	101,731	11.42	1,161,768.02	
	AMERCO	702	536.01	376,279.02	
	AMEREN CORPORATION	15,912	72.33	1,150,914.96	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	31,995	79.08	2,530,164.60	
	AMERICAN EXPRESS CO	44,197	131.71	5,821,186.87	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,807	107.49	516,704.43	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,471	42.58	2,361,955.18	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,690	156.66	1,831,355.40	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,692	224.49	1,726,777.08	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	9,957	105.87	1,054,147.59	
	AMETEK INC	14,797	120.86	1,788,365.42	

AMGEN INC	37,735	231.69	8,742,822.15	
AMPHENOL CORP-CL A	19,240	132.43	2,547,953.20	
ANALOG DEVICES INC	23,847	163.80	3,906,138.60	
ANSYS INC	5,512	395.37	2,179,279.44	
ANTHEM INC	16,188	294.97	4,774,974.36	
AON PLC	14,923	228.34	3,407,517.82	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	11,199	51.83	580,444.17	
APPLE INC	1,101,816	129.87	143,092,843.92	
APPLIED MATERIALS INC	58,732	119.46	7,016,124.72	
APTIV PLC	17,449	153.80	2,683,656.20	
ARAMARK	14,769	38.01	561,369.69	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,942	35.09	910,304.78	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	35,708	56.12	2,003,932.96	
ARISTA NETWORKS INC	3,667	310.95	1,140,253.65	
ARROW ELECTRONICS INC	4,942	105.35	520,639.70	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,330	120.18	1,481,819.40	
ASSURANT INC	3,812	123.31	470,057.72	
AT&T INC	459,637	29.00	13,329,473.00	
ATHENE HOLDING LTD- CLASS A	7,914	45.39	359,216.46	
ATMOS ENERGY CORP	7,950	93.56	743,802.00	
AUTODESK INC	14,108	305.40	4,308,583.20	
AUTOLIV INC	5,421	93.51	506,917.71	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	27,724	169.29	4,693,395.96	
AUTOZONE INC	1,504	1,205.73	1,813,417.92	
AVALARA INC	5,114	175.66	898,325.24	
AVANTOR INC	33,482	28.69	960,598.58	
AVERY DENNISON CORP	5,380	175.41	943,705.80	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	13,747	28.46	391,239.62	
BAKER HUGHES COMPANY	42,521	23.40	994,991.40	
BALL CORP	21,092	90.48	1,908,404.16	
BANK OF AMERICA CORP	502,170	34.54	17,344,951.80	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	51,247	42.32	2,168,773.04	
BAXTER INTERNATIONAL INC	32,575	78.44	2,555,183.00	
BECTON DICKINSON & CO	18,687	247.93	4,633,067.91	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,257	241.85	21,828,655.45	
BEST BUY CO INC	14,919	118.00	1,760,442.00	
BIO-RAD LABORATORIES- CL A	1,409	637.01	897,547.09	
BIOGEN INC	10,163	278.35	2,828,871.05	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,642	81.76	951,849.92	
BLACK KNIGHT INC	10,092	81.73	824,819.16	
BLACKROCK INC	9,805	710.11	6,962,628.55	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	43,310	69.97	3,030,400.70	
BOEING CO	34,587	217.47	7,521,634.89	
BOOKING HOLDINGS INC	2,637	2,293.05	6,046,772.85	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,895	78.71	700,125.45	
BORGWARNER INC	15,760	43.56	686,505.60	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	92,153	38.03	3,504,578.59
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	145,316	60.60	8,806,149.60
BROADCOM INC	25,938	489.96	12,708,582.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,423	149.54	1,110,035.42
BROWN & BROWN INC	15,325	45.59	698,666.75
BROWN-FORMAN CORP -CL B	19,931	75.43	1,503,395.33
BUNGE LIMITED	9,001	76.38	687,496.38
BURLINGTON STORES INC	4,286	264.81	1,134,975.66
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,030	90.78	819,743.40
CABLE ONE INC	315	2,037.05	641,670.75
CABOT OIL & GAS CORP	25,328	18.56	470,087.68
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	17,781	139.66	2,483,294.46
CAMPBELL SOUP CO	11,714	46.32	542,592.48
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,407	119.56	3,515,900.92
CARDINAL HEALTH INC	18,912	52.00	983,424.00
CARLYLE GROUP INC/THE	9,140	36.50	333,610.00
CARMAX INC	10,559	121.32	1,281,017.88
CARNIVAL CORP	33,808	24.59	831,338.72
CARRIER GLOBAL CORP	53,075	37.64	1,997,743.00
CARVANA CO	4,039	308.74	1,247,000.86
CATALENT INC	10,623	117.99	1,253,407.77
CATERPILLAR INC	34,908	209.91	7,327,538.28
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,012	96.22	674,694.64
CBRE GROUP INC	21,700	72.74	1,578,458.00
CDW CORP/DE	9,212	160.75	1,480,829.00
CELANESE CORP-SERIES A	7,627	135.22	1,031,322.94
CENTENE CORP	37,367	57.97	2,166,164.99
CENTERPOINT ENERGY INC	35,469	21.43	760,100.67
CENTURYLINK INC	61,039	11.94	728,805.66
CERIDIAN HCM HOLDING INC	8,565	96.23	824,209.95
CERNER CORP	19,462	71.56	1,392,700.72
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,886	45.76	635,423.36
CHARLES SCHWAB CORP	98,462	61.91	6,095,782.42
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,257	607.29	5,621,683.53
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7,151	115.88	828,657.88
CHENIERE ENERGY INC	14,610	69.10	1,009,551.00
CHEVRON CORP	123,941	95.80	11,873,547.80
CHEWY INC - CLASS A	4,866	113.95	554,480.70
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,709	1,473.09	2,517,510.81
CHUBB LTD	29,064	164.70	4,786,840.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,936	81.45	1,297,987.20
CIGNA CORP	23,653	204.26	4,831,361.78
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,817	96.26	944,984.42
CINTAS CORP	5,672	343.49	1,948,275.28
CISCO SYSTEMS INC	271,906	45.68	12,420,666.08
CITIGROUP INC	134,121	65.78	8,822,479.38

CITIZENS FINANCIAL GROUP	27,374	42.51	1,163,668.74	
CITRIX SYSTEMS INC	7,525	132.96	1,000,524.00	
CLOROX CO	8,130	187.05	1,520,716.50	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	9,927	82.17	815,701.59	
CME GROUP INC	23,126	195.07	4,511,188.82	
CMS ENERGY CORP	18,594	55.98	1,040,892.12	
COCA-COLA CO	263,040	50.11	13,180,934.40	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	13,350	52.30	698,205.00	
COGNEX CORP	11,090	87.43	969,598.70	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	34,840	73.64	2,565,617.60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	52,504	77.20	4,053,308.80	
COMCAST CORP	293,762	52.10	15,305,000.20	
CONAGRA BRANDS INC	31,437	34.10	1,072,001.70	
CONOCOPHILLIPS	86,761	48.42	4,200,967.62	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,560	68.18	1,469,960.80	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,826	223.21	2,416,471.46	
COOPER COS INC/THE	3,423	388.51	1,329,869.73	
COPART INC	13,581	117.07	1,589,927.67	
CORNING INC	49,012	38.06	1,865,396.72	
CORTEVA INC	48,108	45.47	2,187,470.76	
COSTAR GROUP INC	2,535	913.25	2,315,088.75	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,424	354.77	10,083,982.48	
COUPA SOFTWARE INC	4,331	369.64	1,600,910.84	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,254	239.20	2,213,556.80	
CROWN HOLDINGS INC	8,729	101.01	881,716.29	
CSX CORP	49,917	92.09	4,596,856.53	
CUMMINS INC	9,484	246.76	2,340,271.84	
CVS HEALTH CORP	84,351	70.42	5,939,997.42	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,547	163.76	417,096.72	
DANAHER CORP	41,128	231.24	9,510,438.72	
DARDEN RESTAURANTS INC	8,367	134.01	1,121,261.67	
DATADOG INC - CLASS A	9,777	105.05	1,027,073.85	
DAVITA INC	5,099	102.07	520,454.93	
DEERE & CO	19,205	330.00	6,337,650.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	15,613	80.77	1,261,062.01	
DELTA AIR LINES INC	10,308	45.67	470,766.36	
DENTSPLY SIRONA INC	14,090	52.76	743,388.40	
DEXCOM INC	6,172	418.94	2,585,697.68	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,821	93.92	1,861,588.32	
DISCOVERY INC-A	9,879	50.79	501,754.41	
DISCOVERY INC-C	21,332	42.80	913,009.60	
DISH NETWORK CORP	15,805	33.67	532,154.35	
DOCUSIGN INC	11,234	265.16	2,978,807.44	
DOLLAR GENERAL CORP	16,040	201.16	3,226,606.40	
DOLLAR TREE INC	15,284	107.90	1,649,143.60	
DOMINION ENERGY INC	54,199	71.15	3,856,258.85	
DOMINO'S PIZZA INC	2,529	371.46	939,422.34	
DOVER CORP	9,294	122.25	1,136,191.50	
DOW INC	47,886	60.39	2,891,835.54	
DR HORTON INC	22,245	79.21	1,762,026.45	

DRAFTKINGS INC - CL A	10,954	60.91	667,208.14	
DROPBOX INC-CLASS A	20,192	23.45	473,603.36	
DTE ENERGY COMPANY	12,466	120.18	1,498,163.88	
DUKE ENERGY CORP	47,466	88.43	4,197,418.38	
DUPONT DE NEMOURS INC	47,324	69.79	3,302,741.96	
DYNATRACE INC	11,784	52.88	623,137.92	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,722	111.92	976,166.24	
EATON CORP PLC	25,821	127.80	3,299,923.80	
EBAY INC	44,909	61.98	2,783,459.82	
ECOLAB INC	16,551	208.08	3,443,932.08	
EDISON INTERNATIONAL	24,486	55.22	1,352,116.92	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,987	84.31	3,371,303.97	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	25,880	30.10	778,988.00	
ELECTRONIC ARTS INC	18,535	145.95	2,705,183.25	
ELI LILLY & CO	55,494	200.92	11,149,854.48	
EMERSON ELECTRIC CO	38,570	85.45	3,295,806.50	
ENPHASE ENERGY INC	7,719	189.74	1,464,603.06	
ENTERGY CORP	12,986	93.18	1,210,035.48	
EOG RESOURCES INC	37,215	62.51	2,326,309.65	
EPAM SYSTEMS INC	3,591	376.00	1,350,216.00	
EQUIFAX INC	7,860	176.54	1,387,604.40	
EQUITABLE HOLDINGS INC	25,925	28.69	743,788.25	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,626	256.16	416,516.16	
ESSENTIAL UTILITIES INC	15,161	45.57	690,886.77	
ESTEE LAUDER COS INC	14,498	285.16	4,134,249.68	
ETSY INC	7,680	227.27	1,745,433.60	
EVEREST RE GROUP LTD	2,540	239.30	607,822.00	
EVERGY INC	14,762	54.23	800,543.26	
EVERSOURCE ENERGY	22,135	81.46	1,803,117.10	
EXACT SCIENCES CORP	10,255	147.81	1,515,791.55	
EXELON CORP	62,777	41.38	2,597,712.26	
EXPEDIA GROUP INC	8,767	158.92	1,393,251.64	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	10,963	93.44	1,024,382.72	
EXXON MOBIL CORP	272,397	52.37	14,265,430.89	
F5 NETWORKS INC	3,921	198.81	779,534.01	
FACEBOOK INC-A	154,857	261.56	40,504,396.92	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,427	313.68	761,301.36	
FAIR ISAAC CORP	1,873	473.82	887,464.86	
FASTENAL CO	36,798	47.23	1,737,969.54	
FEDEX CORP	16,152	254.64	4,112,945.28	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17,707	40.47	716,602.29	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39,981	130.99	5,237,111.19	
FIFTH THIRD BANCORP	45,847	34.54	1,583,555.38	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,020	166.94	1,839,678.80	
FIRSTENERGY CORP	35,232	34.03	1,198,944.96	
FISERV INC	36,741	111.36	4,091,477.76	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,417	273.38	1,480,899.46	
FMC CORP	8,359	105.25	879,784.75	

FORD MOTOR CO	251,770	11.58	2,915,496.60	
FORTINET INC	8,850	171.93	1,521,580.50	
FORTIVE CORP	19,597	67.19	1,316,722.43	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8,908	87.55	779,895.40	
FOX CORP - CLASS A	21,441	33.78	724,276.98	
FOX CORP- CLASS B	11,761	32.37	380,703.57	
FRANKLIN RESOURCES INC	18,731	27.51	515,289.81	
FREEPORT-MCMORAN INC	93,332	37.49	3,499,016.68	
GARMIN LTD	9,216	128.01	1,179,740.16	
GARTNER INC	5,803	183.95	1,067,461.85	
GENERAC HOLDINGS INC	4,033	363.47	1,465,874.51	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,731	164.78	2,592,154.18	
GENERAL ELECTRIC CO	564,123	12.02	6,780,758.46	
GENERAL MILLS INC	39,313	56.50	2,221,184.50	
GENERAL MOTORS CO	82,975	52.57	4,361,995.75	
GENUINE PARTS CO	9,358	102.36	957,884.88	
GILEAD SCIENCES INC	80,761	64.37	5,198,585.57	
GLOBAL PAYMENTS INC	19,324	194.18	3,752,334.32	
GLOBE LIFE INC	6,424	95.30	612,207.20	
GODADDY INC - CLASS A	10,815	84.61	915,057.15	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,014	315.62	6,632,438.68	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,396	125.96	679,680.16	
HALLIBURTON CO	56,534	20.20	1,141,986.80	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	22,859	49.86	1,139,749.74	
HASBRO INC	8,434	90.00	759,060.00	
HCA HEALTHCARE INC	17,425	177.37	3,090,672.25	
HEICO CORP	2,779	132.16	367,272.64	
HEICO CORP-CLASS A	4,664	121.14	564,996.96	
HENRY SCHEIN INC	9,085	63.75	579,168.75	
HERSHEY CO/THE	9,509	148.85	1,415,414.65	
HESS CORP	17,799	63.58	1,131,660.42	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	82,579	14.13	1,166,841.27	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,841	116.91	2,085,791.31	
HOLOGIC INC	16,589	75.69	1,255,621.41	
HOME DEPOT INC	69,362	279.64	19,396,389.68	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	45,229	203.56	9,206,815.24	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,200	4.57	361,944.00	
HORIZON PHARMA PLC	14,150	88.87	1,257,510.50	
HORMEL FOODS CORP	18,953	47.10	892,686.30	
HOWMET AEROSPACE INC	25,284	28.68	725,145.12	
HP INC	92,029	27.10	2,493,985.90	
HUBSPOT INC	2,796	543.49	1,519,598.04	
HUMANA INC	8,509	376.91	3,207,127.19	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	65,837	15.30	1,007,306.10	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,593	182.13	472,263.09	
IAC/INTERACTIVECORP	5,120	262.15	1,342,208.00	
IDEX CORP	4,855	196.75	955,221.25	
IDEXX LABORATORIES INC	5,471	544.13	2,976,935.23	
IHS MARKIT LTD	24,406	93.20	2,274,639.20	

ILLINOIS TOOL WORKS INC	20,406	201.40	4,109,768.40	
ILLUMINA INC	9,410	486.26	4,575,706.60	
INCYTE CORP	11,944	80.54	961,969.76	
INGERSOLL-RAND INC	22,848	43.89	1,002,798.72	
INSULET CORP	4,244	274.03	1,162,983.32	
INTEL CORP	273,886	63.01	17,257,556.86	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34,948	113.35	3,961,355.80	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	57,431	118.99	6,833,714.69	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	5,561	139.50	775,759.50	
INTERNATIONAL PAPER CO	24,049	48.95	1,177,198.55	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	25,599	25.56	654,310.44	
INTUIT INC	16,780	411.35	6,902,453.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,531	750.15	5,649,379.65	
INVESCO LTD	24,941	22.47	560,424.27	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	8,571	57.69	494,460.99	
IPG PHOTONICS CORP	2,390	234.56	560,598.40	
IQVIA HOLDINGS INC	12,390	188.70	2,337,993.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,916	150.89	741,775.24	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,448	112.41	949,639.68	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	14,200	49.60	704,320.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	14,400	24.60	354,240.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,508	160.60	563,384.80	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,731	146.56	839,935.36	
JM SMUCKER CO	7,283	113.76	828,514.08	
JOHNSON & JOHNSON	169,586	162.98	27,639,126.28	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	48,079	56.02	2,693,385.58	
JPMORGAN CHASE & CO	196,303	148.02	29,056,770.06	
JUNIPER NETWORKS INC	21,229	23.97	508,859.13	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,271	212.59	1,333,151.89	
KELLOGG CO	16,593	57.91	960,900.63	
KEURIG DR PEPPER INC	36,617	31.24	1,143,915.08	
KEYCORP	62,929	20.15	1,268,019.35	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	12,064	142.19	1,715,380.16	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,015	130.63	2,875,819.45	
KINDER MORGAN INC	131,381	14.96	1,965,459.76	
KKR & CO INC -A	32,437	46.77	1,517,078.49	
KLA CORPORATION	10,018	330.67	3,312,652.06	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	8,980	44.12	396,197.60	
KRAFT HEINZ CO/THE	43,258	37.48	1,621,309.84	
KROGER CO	49,827	34.02	1,695,114.54	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13,929	189.09	2,633,834.61	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	6,262	246.38	1,542,831.56	



LAM RESEARCH CORP	9,376	598.41	5,610,692.16
LAMB WESTON HOLDING INC	9,443	78.09	737,403.87
LAS VEGAS SANDS CORP	22,164	60.18	1,333,829.52
LEAR CORP	3,672	167.66	615,647.52
LEIDOS HOLDINGS INC	8,750	103.76	907,900.00
LENNAR CORP-CL A	17,745	87.46	1,551,977.70
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,249	293.68	660,486.32
LIBERTY BROADBAND-A	1,507	145.89	219,856.23
LIBERTY BROADBAND-C	7,111	148.99	1,059,467.89
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,100	26.57	374,637.00
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	20,847	26.26	547,442.22
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	5,040	43.98	221,659.20
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	11,923	43.25	515,669.75
LIBERTY MEDIA GROUP-C	13,305	45.20	601,386.00
LINCOLN NATIONAL CORP	12,260	55.56	681,165.60
LINDE PLC	33,899	250.88	8,504,581.12
LIVE NATION INC	10,648	88.09	937,982.32
LKQ CORP	18,590	38.79	721,106.10
LOCKHEED MARTIN CORP	16,203	335.42	5,434,810.26
LOEWS CORP	16,212	48.06	779,148.72
LOWE'S COS INC	48,688	177.54	8,644,067.52
LULULEMON ATHLETICA INC	7,967	332.23	2,646,876.41
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,267	100.22	1,730,498.74
M&T BANK CORP	8,180	149.97	1,226,754.60
MARATHON PETROLEUM CORP	42,105	53.00	2,231,565.00
MARKEL CORP	881	1,091.18	961,329.58
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,435	550.21	1,339,761.35
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	17,783	136.28	2,423,467.24
MARSH & MCLENNAN COS INC	32,714	117.07	3,829,827.98
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,011	336.34	1,349,059.74
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	43,183	51.89	2,240,765.87
MASCO CORP	16,833	54.60	919,081.80
MASIMO CORPORATION	3,344	259.35	867,266.40
MASTERCARD INC-CLASS A	57,557	333.17	19,176,265.69
MATCH GROUP INC	15,918	160.95	2,562,002.10
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	17,164	98.15	1,684,646.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,016	84.12	1,347,265.92
MCDONALD'S CORP	47,958	212.24	10,178,605.92
MCKESSON CORP	10,427	177.62	1,852,043.74
MEDTRONIC PLC	86,523	113.33	9,805,651.59
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED- ADR	14,013	18.68	261,762.84
MERCADOLIBRE INC	2,883	1,910.39	5,507,654.37

MERCK & CO INC	162,941	74.31	12,108,145.71	
METLIFE INC	49,409	56.07	2,770,362.63	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,543	1,165.45	1,798,289.35	
MGM MIRAGE	30,023	36.42	1,093,437.66	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16,318	162.35	2,649,227.30	
MICRON TECHNOLOGY INC	71,547	90.96	6,507,915.12	
MICROSOFT CORP	463,143	240.97	111,603,568.71	
MODERNA INC	17,802	174.74	3,110,721.48	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,903	171.90	670,925.70	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,813	220.83	842,024.79	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	12,187	44.40	541,102.80	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	91,943	54.31	4,993,424.33	
MONGODB INC	3,114	418.30	1,302,586.20	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,742	393.75	1,079,662.50	
MONSTER BEVERAGE CORP	25,304	89.65	2,268,503.60	
MOODY'S CORP	10,881	280.42	3,051,250.02	
MORGAN STANLEY	87,202	76.00	6,627,352.00	
MOSAIC CO/THE	23,285	29.08	677,127.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,962	182.75	2,003,305.50	
MSCI INC	5,387	432.97	2,332,409.39	
NASDAQ INC	7,327	144.43	1,058,238.61	
NETAPP INC	14,294	71.35	1,019,876.90	
NETFLIX INC	28,414	540.22	15,349,811.08	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,698	113.24	645,241.52	
NEWELL BRANDS INC	26,065	24.32	633,900.80	
NEWMONT CORP	51,674	56.67	2,928,365.58	
NEWS CORP - CLASS A	25,085	22.50	564,412.50	
NEXTERA ENERGY INC	126,237	78.10	9,859,109.70	
NIKE INC	80,242	142.02	11,395,968.84	
NISOURCE INC	25,222	22.84	576,070.48	
NORDSON CORP	3,536	187.88	664,343.68	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,676	258.03	4,302,908.28	
NORTHERN TRUST CORP	12,738	96.31	1,226,796.78	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,198	297.24	3,031,253.52	
NORTONLIFELOCK INC	35,987	20.46	736,294.02	
NOVOCURE LTD	5,526	190.17	1,050,879.42	
NRG ENERGY INC	15,414	39.58	610,086.12	
NUCOR CORP	19,337	58.04	1,122,319.48	
NVIDIA CORP	39,745	597.06	23,730,149.70	
NVR INC	227	4,705.45	1,068,137.15	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,990	191.59	3,446,704.10	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,767	460.41	2,194,774.47	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,994	25.42	1,525,047.48	
OGE ENERGY CORP	13,157	31.92	419,971.44	
OKTA INC	7,744	288.36	2,233,059.84	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,266	215.64	1,351,200.24	
OMNICOM GROUP	14,049	67.65	950,414.85	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	26,548	41.87	1,111,564.76	
ONEOK INC	28,710	45.82	1,315,492.20	

ORACLE CORP	128,468	61.13	7,853,248.84	
OTIS WORLDWIDE CORP	26,542	63.04	1,673,207.68	
OWENS CORNING	7,006	85.08	596,070.48	
PACCAR INC	22,344	95.19	2,126,925.36	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,098	134.08	817,619.84	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,236	396.90	2,475,068.40	
PARKER HANNIFIN CORP	8,288	279.73	2,318,402.24	
PAYCHEX INC	20,806	90.25	1,877,741.50	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,207	400.13	1,283,216.91	
PAYPAL HOLDINGS INC	71,854	286.92	20,616,349.68	
PELTON INTERACTIVE INC-A	12,614	139.71	1,762,301.94	
PENTAIR PLC	10,610	56.65	601,056.50	
PEPSICO INC	89,235	132.51	11,824,529.85	
PERKINELMER INC	7,195	136.79	984,204.05	
PERRIGO CO PLC	8,780	42.10	369,638.00	
PFIZER INC	358,052	34.44	12,331,310.88	
PG&E CORP	93,942	11.64	1,093,484.88	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,411	85.45	8,580,119.95	
PHILLIPS 66	28,135	82.31	2,315,791.85	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,274	76.26	554,715.24	
PINTEREST INC- CLASS A	29,785	85.90	2,558,531.50	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,413	133.94	1,394,717.22	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,357	170.41	4,661,906.37	
POOL CORP	2,567	326.08	837,047.36	
PPD INC	7,942	36.90	293,059.80	
PPG INDUSTRIES INC	15,194	136.67	2,076,563.98	
PPL CORPORATION	49,808	27.68	1,378,685.44	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17,616	55.10	970,641.60	
PROCTER & GAMBLE CO	160,392	127.12	20,389,031.04	
PROGRESSIVE CORP	37,624	87.06	3,275,545.44	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,466	84.10	2,141,690.60	
PTC INC	7,101	146.73	1,041,929.73	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,632	57.75	1,884,498.00	
PULTE GROUP INC	17,278	46.39	801,526.42	
QORVO INC	7,328	179.39	1,314,569.92	
QUALCOMM INC	72,691	144.94	10,535,833.54	
QUEST DIAGNOSTICS	8,635	119.23	1,029,551.05	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,846	118.25	927,789.50	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	98,526	74.26	7,316,540.76	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,718	470.37	3,159,945.66	
REGIONS FINANCIAL CORP	61,287	20.37	1,248,416.19	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4,362	123.42	538,358.04	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,256	158.55	516,238.80	
REPUBLIC SERVICES INC	14,504	90.59	1,313,917.36	
RESMED INC	9,319	201.18	1,874,796.42	

RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,790	427.39	2,047,198.10	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	7,354	78.43	576,774.22	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,479	248.23	1,856,512.17	
ROKU INC	6,833	467.31	3,193,129.23	
ROLLINS INC	14,205	35.81	508,681.05	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,745	388.91	2,623,197.95	
ROSS STORES INC	22,951	118.95	2,730,021.45	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,769	78.87	928,221.03	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,336	47.51	348,533.36	
RPM INTERNATIONAL INC	8,403	83.11	698,373.33	
S&P GLOBAL INC	15,521	339.24	5,265,344.04	
SALESFORCE.COM INC	58,634	246.56	14,456,799.04	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,847	85.38	413,836.86	
SCHLUMBERGER LTD	89,489	26.12	2,337,452.68	
SEAGATE TECHNOLOGY	14,931	73.14	1,092,053.34	
SEAGEN INC	7,852	157.75	1,238,653.00	
SEALED AIR CORP	10,054	43.66	438,957.64	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,696	58.02	446,521.92	
SEMPRA ENERGY	18,676	124.57	2,326,469.32	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,188	59.31	604,250.28	
SERVICENOW INC	12,346	570.73	7,046,232.58	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,289	716.91	3,791,736.99	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	71,202	6.01	427,924.02	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,719	192.17	2,059,870.23	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	25,126	43.30	1,087,955.80	
SMITH (A.O.) CORP	8,760	59.64	522,446.40	
SNAP INC - A	58,540	65.52	3,835,540.80	
SNAP-ON INC	3,300	194.96	643,368.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,089	290.00	605,810.00	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	3,229	321.99	1,039,705.71	
SOUTHERN CO	68,267	59.31	4,048,915.77	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,284	52.81	490,288.04	
SPLUNK INC	10,256	169.66	1,740,032.96	
SQUARE INC - A	23,921	276.57	6,615,830.97	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,982	66.44	995,404.08	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,291	175.07	1,801,645.37	
STARBUCKS CORP	75,356	103.37	7,789,549.72	
STATE STREET CORP	22,624	71.93	1,627,344.32	
STEEL DYNAMICS INC	13,414	40.84	547,827.76	
STERIS PLC	5,460	178.73	975,865.80	
STRYKER CORP	21,791	242.09	5,275,383.19	
SUNRUN INC	7,600	68.50	520,600.00	
SVB FINANCIAL GROUP	3,297	540.40	1,781,698.80	
SYNCHRONY FINANCIAL	33,938	38.08	1,292,359.04	
SYNOPSIS INC	9,725	268.07	2,606,980.75	
SYSCO CORP	31,197	76.71	2,393,121.87	

T ROWE PRICE GROUP INC	14,469	162.77	2,355,119.13
T-MOBILE US INC	35,968	120.10	4,319,756.80
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,346	194.86	1,431,441.56
TARGET CORP	32,235	188.82	6,086,612.70
TE CONNECTIVITY LTD	21,269	132.22	2,812,187.18
TELADOC HEALTH INC	7,384	292.51	2,159,893.84
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,376	405.91	964,442.16
TELEFLEX INC	3,003	390.43	1,172,461.29
TERADYNE INC	10,593	142.59	1,510,455.87
TESLA, INC.	48,053	781.30	37,543,808.90
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	70,757	11.04	781,157.28
TEXAS INSTRUMENTS INC	58,984	178.35	10,519,796.40
TEXTRON INC	14,602	50.81	741,927.62
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,481	478.86	12,201,831.66
TJX COS INC	77,327	67.69	5,234,264.63
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,465	171.34	1,279,053.10
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	2,690	903.35	2,430,011.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,805	69.30	402,286.50
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,480	153.96	2,383,300.80
TRANSDIGM GROUP INC	3,326	600.50	1,997,263.00
TRANSUNION	12,346	89.27	1,102,127.42
TRAVELERS COS INC/THE	16,237	145.91	2,369,140.67
TRIMBLE INC	16,110	72.99	1,175,868.90
TRUIST FINANCIAL CORP	86,999	57.58	5,009,402.42
TWILIO INC - A	8,415	425.55	3,581,003.25
TWITTER INC	50,963	72.28	3,683,605.64
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,583	473.88	1,224,032.04
TYSON FOODS INC-CL A	18,937	67.52	1,278,626.24
UBER TECHNOLOGIES INC	62,391	58.39	3,643,010.49
UGI CORP	13,571	40.29	546,775.59
ULTA BEAUTY INC	3,447	321.79	1,109,210.13
UNION PACIFIC CORP	44,061	209.06	9,211,392.66
UNITED PARCEL SERVICE INC	45,698	160.54	7,336,356.92
UNITED RENTALS INC	4,634	290.01	1,343,906.34
UNITEDHEALTH GROUP INC	61,210	324.58	19,867,541.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4,976	129.67	645,237.92
US BANCORP	87,425	50.02	4,372,998.50
VAIL RESORTS INC	2,591	304.26	788,337.66
VALERO ENERGY CORP	26,305	71.53	1,881,596.65
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,850	176.35	1,031,647.50
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,686	313.82	2,725,840.52
VERISIGN INC	6,668	197.95	1,319,930.60
VERISK ANALYTICS INC	9,949	190.49	1,895,185.01
VERIZON COMMUNICATIONS INC	267,025	56.45	15,073,561.25
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,726	207.02	3,462,616.52
VF CORP	21,407	80.40	1,721,122.80
VIACOMCBS INC	36,421	62.69	2,283,232.49

VIATRIS INC	79,122	18.21	1,440,811.62	
VISA INC-CLASS A SHARES	108,613	204.73	22,236,339.49	
VISTRA CORP	28,282	22.91	647,940.62	
VMWARE INC-CLASS A	5,397	144.68	780,837.96	
VOYA FINANCIAL INC	8,087	58.43	472,523.41	
VULCAN MATERIALS CO	8,537	164.38	1,403,312.06	
WABTEC CORP	11,738	73.96	868,142.48	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	47,453	48.86	2,318,553.58	
WALMART INC	91,191	138.34	12,615,362.94	
WALT DISNEY CO	116,477	183.65	21,391,001.05	
WASTE CONNECTIONS INC	17,085	99.80	1,705,083.00	
WASTE MANAGEMENT INC	27,320	111.63	3,049,731.60	
WATERS CORP	3,985	281.72	1,122,654.20	
WAYFAIR INC- CLASS A	4,192	292.73	1,227,124.16	
WEC ENERGY GROUP INC	20,343	83.23	1,693,147.89	
WELLS FARGO & CO	252,096	37.83	9,536,791.68	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,731	281.55	1,332,013.05	
WESTERN DIGITAL CORP	19,494	68.88	1,342,746.72	
WESTERN UNION CO	26,571	23.91	635,312.61	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	16,652	43.95	731,855.40	
WEYERHAEUSER CO	47,978	34.99	1,678,750.22	
WHIRLPOOL CORP	4,008	195.34	782,922.72	
WILLIAMS COS INC	78,211	22.64	1,770,697.04	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,297	224.98	1,866,659.06	
WIX.COM LTD	3,569	353.09	1,260,178.21	
WORKDAY INC-CLASS A	11,402	276.34	3,150,828.68	
WR BERKLEY CORP	9,109	67.88	618,318.92	
WW GRAINGER INC	2,918	379.40	1,107,089.20	
WYNN RESORTS LTD	6,302	123.66	779,305.32	
XCEL ENERGY INC	33,879	62.07	2,102,869.53	
XILINX INC	15,729	138.71	2,181,769.59	
XPO LOGISTICS INC	6,077	119.49	726,140.73	
XYLEM INC	11,622	99.74	1,159,178.28	
YUM! BRANDS INC	19,355	105.13	2,034,791.15	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,428	490.94	1,682,942.32	
ZENDESK INC	7,450	157.69	1,174,790.50	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	9,399	181.22	1,703,286.78	
ZILLOW GROUP INC - CL A	3,815	191.46	730,419.90	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,333	156.67	2,088,881.11	
ZOETIS INC	30,658	160.00	4,905,280.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,142	417.26	4,649,110.92	
ZSCALER INC	4,630	226.03	1,046,518.90	
アメリカ・ドル 小計	20,122,570		2,231,736,251.45 (235,448,174,528)	
イギリス・ポンド				
3I GROUP PLC	61,960	11.36	703,865.60	
ADMIRAL GROUP PLC	12,364	30.67	379,203.88	
ANGLO AMERICAN PLC	78,644	28.70	2,257,082.80	
ANTOFAGASTA PLC	25,111	18.38	461,540.18	

ASHTED GROUP PLC	28,955	39.95	1,156,752.25	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22,893	23.71	542,793.03	
ASTRAZENECA PLC	84,600	72.26	6,113,196.00	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI	62,052	6.07	377,027.95	
AVEVA GROUP PLC	5,273	37.56	198,053.88	
AVIVA PLC	249,500	3.64	909,427.50	
BAE SYSTEMS PLC	207,295	4.65	964,543.63	
BARCLAYS PLC	1,110,789	1.53	1,706,171.90	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	65,876	6.84	450,855.34	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	8,176	43.40	354,838.40	
BHP GROUP PLC	135,374	22.77	3,083,142.85	
BP PLC	1,308,836	2.72	3,563,960.42	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	147,839	25.62	3,787,635.18	
BT GROUP PLC	576,751	1.31	757,850.81	
BUNZL PLC	21,670	22.82	494,509.40	
BURBERRY GROUP PLC	26,204	18.39	482,022.58	
COCA-COLA HBC AG-CDI	12,918	23.25	300,343.50	
COMPASS GROUP PLC	114,808	14.26	1,637,162.08	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,972	64.62	579,770.64	
DCC PLC	6,371	59.96	382,005.16	
DIAGEO PLC	150,825	29.96	4,519,471.12	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	87,117	3.12	272,501.97	
ENTAIN PLC	37,530	13.65	512,472.15	
EVRAZ PLC	32,257	5.56	179,542.46	
EXPERIAN PLC	59,122	24.89	1,471,546.58	
FERGUSON PLC	14,463	87.38	1,263,776.94	
FRESNILLO PLC	11,767	9.84	115,787.28	
GLAXOSMITHKLINE PLC	324,032	12.15	3,937,636.86	
GLENCORE PLC	642,407	3.00	1,927,863.40	
HALMA PLC	24,417	24.66	602,123.22	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,281	15.16	322,619.96	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,052	23.61	260,937.72	
HSBC HOLDINGS PLC	1,312,030	4.23	5,561,695.17	
IMPERIAL BRANDS PLC	61,096	13.94	851,678.24	
INFORMA PLC	98,270	5.09	500,194.30	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	11,238	51.10	574,261.80	
INTERTEK GROUP PLC	10,419	56.94	593,257.86	
JD SPORTS FASHION PLC	28,121	8.50	239,028.50	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,409	31.28	388,153.52	
KINGFISHER PLC	134,171	2.76	370,580.30	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	385,902	2.64	1,021,096.69	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,553,540	0.38	1,734,898.74	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,429	97.22	1,986,107.38	
M&G PLC	168,677	1.89	319,980.26	
MELROSE INDUSTRIES PLC	314,448	1.70	535,190.49	
MONDI PLC/WI	31,109	18.16	564,939.44	

	MORRISON WM SUPERMARKETS	153,296	1.72	264,129.00	
	NATIONAL GRID PLC	227,221	8.44	1,919,108.56	
	NATWEST GROUP PLC	309,880	1.80	558,093.88	
	NEXT PLC	8,581	76.70	658,162.70	
	NMC HEALTH PLC	4,758	0.00	4.75	
	OCADO GROUP PLC	31,416	25.59	803,935.44	
	PEARSON PLC	48,437	7.50	363,277.50	
	PERSIMMON PLC	20,608	27.73	571,459.84	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,208	7.06	255,700.89	
	PRUDENTIAL PLC	168,054	14.16	2,379,644.64	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	45,970	60.72	2,791,298.40	
	RELX PLC	124,714	17.60	2,195,589.97	
	RENTOKIL INITIAL PLC	119,967	4.98	598,035.49	
	RIO TINTO PLC	72,134	63.52	4,581,951.68	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	541,874	0.98	534,287.76	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	264,731	13.97	3,698,821.53	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	238,085	13.40	3,191,291.34	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	66,098	6.76	446,954.67	
	SAGE GROUP PLC	70,001	5.95	416,925.95	
	SAINSBURY (J) PLC	113,104	2.30	261,157.13	
	SCHRODERS PLC	7,966	34.93	278,252.38	
	SEVERN TRENT PLC	15,666	22.56	353,424.96	
	SMITH & NEPHEW PLC	56,197	14.73	828,062.79	
	SMITHS GROUP PLC	25,624	14.91	382,181.96	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,769	113.30	540,327.70	
	SSE PLC	67,517	14.12	953,677.62	
	ST JAMES'S PLACE PLC	34,483	12.14	418,623.62	
	STANDARD CHARTERED PLC	171,782	4.92	846,026.35	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	144,466	3.26	471,681.49	
	TAYLOR WIMPEY PLC	235,443	1.62	382,359.43	
	TESCO PLC	499,808	2.27	1,137,563.00	
	UNILEVER PLC	75,451	39.05	2,946,361.55	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,611	9.12	406,852.32	
	VODAFONE GROUP PLC	1,733,523	1.31	2,272,648.65	
	WHITBREAD PLC	13,028	34.18	445,297.04	
	WPP PLC	80,369	8.42	677,349.93	
	イギリス・ポンド 小計	18,817,200		102,101,619.22 (15,108,997,613)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	2,866	208.00	596,128.00	
	BANK HAPOLIM BM	73,197	24.03	1,758,923.91	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	92,540	20.73	1,918,354.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,724	455.90	785,971.60	
	ICL GROUP LTD	44,742	19.39	867,547.38	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	74,441	12.80	952,844.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,205	80.88	744,500.40	
	NICE LTD	4,040	814.00	3,288,560.00	
	イスラエル・シュケル 小計	302,755		10,912,830.29	



				(351,720,520)	
オーストラリア・ドル	AFTERPAY LTD	13,885	151.92	2,109,409.20	
	AGL ENERGY LTD	45,712	10.10	461,691.20	
	AMP LTD	236,198	1.35	318,867.30	
	AMPOL LTD	17,440	26.49	461,985.60	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	38,419	32.80	1,260,143.20	
	ASX LTD	13,668	69.13	944,868.84	
	AURIZON HOLDINGS LTD	149,738	3.99	597,454.62	
	AUSNET SERVICES	155,719	1.68	262,386.51	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	187,477	26.61	4,988,762.97	
	BHP GROUP LIMITED	191,580	47.32	9,065,565.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,656	17.28	598,855.68	
	BRAMBLES LTD	103,755	10.20	1,058,301.00	
	CIMIC GROUP LIMITED	8,157	21.26	173,417.82	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	36,694	13.38	490,965.72	
	COCHLEAR LTD	4,552	221.68	1,009,087.36	
	COLES GROUP LTD	89,489	16.41	1,468,514.49	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	115,756	82.51	9,551,027.56	
	COMPUTERSHARE LIMITED	37,204	14.00	520,856.00	
	CROWN RESORTS LTD	30,354	10.25	311,128.50	
	CSL LIMITED	29,532	274.43	8,104,466.76	
	EVOLUTION MINING LTD	110,398	4.13	455,943.74	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	110,191	23.97	2,641,278.27	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	169,215	4.95	837,614.25	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	29,813	39.10	1,165,688.30	
	MACQUARIE GROUP LTD	22,954	142.26	3,265,436.04	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8,900	44.99	400,411.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,674	2.79	540,350.46	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	217,134	25.11	5,452,234.74	
	NEWCREST MINING LIMITED	54,188	24.24	1,313,517.12	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,420	10.38	512,979.60	
	OIL SEARCH LTD	134,510	4.05	544,765.50	
	ORICA LTD	31,960	14.94	477,482.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	124,918	4.45	555,885.10	
	QANTAS AIRWAYS LTD	67,418	4.62	311,471.16	
QBE INSURANCE GROUP LTD	99,951	8.99	898,559.49		
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	13,197	62.16	820,325.52		
REA GROUP LTD	3,884	153.60	596,582.40		
RIO TINTO LTD	24,415	123.26	3,009,392.90		
SANTOS LTD	120,673	6.82	822,989.86		
SEEK LTD	23,937	30.37	726,966.69		
SONIC HEALTHCARE LTD	31,302	34.22	1,071,154.44		
SOUTH32 LTD	333,625	2.68	894,115.00		
SUNCORP GROUP LTD	93,117	9.80	912,546.60		
TABCORP HOLDINGS LTD	158,394	4.59	727,028.46		
TELSTRA CORP LTD	295,704	3.31	978,780.24		

	TPG TELECOM LTD	29,652	6.91	204,895.32	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	48,828	11.18	545,897.04	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,773	28.75	223,473.75	
	WESFARMERS LIMITED	76,135	54.01	4,112,051.35	
	WESTPAC BANKING CORP	238,169	24.09	5,737,491.21	
	WISETECH GLOBAL LTD	9,867	31.30	308,837.10	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	66,517	24.00	1,596,408.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	83,489	39.52	3,299,485.28	
	XERO LTD	8,110	124.70	1,011,317.00	
オーストラリア・ドル	小計	4,631,417		90,731,111.26 (7,547,921,146)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	15,504	75.47	1,170,086.88	
	AIR CANADA	9,494	24.02	228,045.88	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	39,173	21.80	853,971.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	55,269	38.09	2,105,196.21	
	ALTAGAS LTD	18,045	19.64	354,403.80	
	ATCO LTD -CL 'I'	5,082	37.76	191,896.32	
	B2GOLD CORP	64,997	5.99	389,332.03	
	BANK OF MONTREAL	41,438	101.25	4,195,597.50	
	BANK OF NOVA SCOTIA	78,048	71.51	5,581,212.48	
	BARRICK GOLD CORP	114,398	24.93	2,851,942.14	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	20,828	40.29	839,160.12	
	BCE INC	10,909	55.00	599,995.00	
	BLACKBERRY LTD	34,830	13.75	478,912.50	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	82,990	54.94	4,559,470.60	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	7,853	62.19	488,378.07	
	CAE INC	18,169	32.45	589,584.05	
	CAMECO CORP	24,878	20.92	520,447.76	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	28,780	114.76	3,302,792.80	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	46,642	137.85	6,429,599.70	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	75,938	34.98	2,656,311.24	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,972	463.75	4,160,765.00	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,690	179.04	660,657.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,796	31.69	278,745.24	
	CANOPY GROWTH CORP	14,494	48.77	706,872.38	
	CCL INDUSTRIES INC -CL B	9,745	65.15	634,886.75	
	CENOVUS ENERGY INC	66,834	8.72	582,792.48	
	CGI INC	14,755	96.54	1,424,447.70	
	CI FINANCIAL CORP	12,800	18.00	230,400.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,297	1,724.27	2,236,378.19	
	DOLLARAMA INC	19,191	48.20	925,006.20	
	EMERA INC	16,556	50.12	829,786.72	
	EMPIRE CO LTD 'A'	10,803	36.77	397,226.31	
	ENBRIDGE INC	131,204	43.70	5,733,614.80	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,707	514.90	878,934.30	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	37,673	29.08	1,095,530.84	
FIRSTSERVICE CORP	2,601	194.40	505,634.40	
FORTIS INC	30,601	50.31	1,539,536.31	
FRANCO-NEVADA CORP	12,278	140.38	1,723,585.64	
GEORGE WESTON LTD	4,990	94.03	469,209.70	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,417	37.78	469,114.26	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,836	34.84	447,206.24	
GREAT-WEST LIFECO INC	18,360	31.36	575,769.60	
HYDRO ONE LTD	21,819	28.04	611,804.76	
IA FINANCIAL CORP INC	6,834	64.75	442,501.50	
IGM FINANCIAL INC	5,578	34.93	194,839.54	
IMPERIAL OIL LTD	16,294	26.70	435,049.80	
INTACT FINANCIAL CORP	9,256	144.33	1,335,918.48	
INTER PIPELINE LTD	27,584	17.91	494,029.44	
KEYERA CORP	14,151	26.23	371,180.73	
KINROSS GOLD CORP	79,406	8.28	657,481.68	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	16,877	45.09	760,983.93	
LOBLAW COS LTD	11,334	61.88	701,347.92	
LUNDIN MINING CORP	41,722	15.21	634,591.62	
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,392	105.12	1,933,367.04	
MANULIFE FINANCIAL CORP	124,800	24.91	3,108,768.00	
METRO INC	16,306	54.32	885,741.92	
NATIONAL BANK OF CANADA	21,671	75.13	1,628,142.23	
NORTHLAND POWER INC	12,459	48.41	603,140.19	
NUTRIEN LTD	36,681	71.27	2,614,254.87	
ONEX CORPORATION	5,225	72.52	378,917.00	
OPEN TEXT CORP	17,788	58.92	1,048,068.96	
PAN AMERICAN SILVER CORP	13,676	41.01	560,852.76	
PARKLAND CORP	9,739	37.50	365,212.50	
PEMBINA PIPELINE CORP	35,480	34.36	1,219,092.80	
POWER CORP OF CANADA	36,303	31.02	1,126,119.06	
QUEBECOR INC -CL B	11,754	32.16	378,008.64	
RESTAURANT BRANDS INTERN	18,633	76.92	1,433,250.36	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	7,076	67.06	474,516.56	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	23,291	55.77	1,298,939.07	
ROYAL BANK OF CANADA	91,797	109.77	10,076,556.69	
SAPUTO INC	15,857	36.96	586,074.72	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,942	22.16	685,674.72	
SHOPIFY INC - CLASS A	6,977	1,810.58	12,632,416.66	
SSR MINING INC	14,330	19.01	272,413.30	
SUN LIFE FINANCIAL INC	37,738	62.93	2,374,852.34	
SUNCOR ENERGY INC	98,253	23.94	2,352,176.82	
TC ENERGY CORP	60,823	56.39	3,429,808.97	
TECK RESOURCES LTD-CL B	30,137	29.01	874,274.37	
THOMSON REUTERS CORP	11,265	103.51	1,166,040.15	
TMX GROUP LTD	3,742	125.75	470,556.50	

	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,410	92.10	498,261.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	116,153	76.38	8,871,766.14	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28,944	47.46	1,373,682.24	
	WSP GLOBAL INC	7,401	119.03	880,941.03	
	YAMANA GOLD INC	60,568	5.56	336,758.08	
カナダ・ドル	小計	2,526,331		137,470,812.23 (11,509,056,400)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	181,700	3.11	565,087.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	30,500	7.13	217,465.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	115,600	25.63	2,962,828.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	384,900	0.84	323,316.00	
	KEPPEL CORP LTD	95,900	5.03	482,377.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	213,300	10.54	2,248,182.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	90,100	4.35	391,935.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	51,400	9.83	505,262.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	100,600	3.75	377,250.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	533,600	2.35	1,253,960.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	75,700	23.60	1,786,520.00	
	UOL Group Limited	30,200	7.31	220,762.00	
	VENTURE CORP LTD	17,700	20.21	357,717.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	123,200	5.57	686,224.00	
シンガポール・ドル	小計	2,044,400		12,378,885.00 (987,216,080)	
スイス・フラン	ABB LTD	118,834	27.08	3,218,024.72	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,044	57.60	578,534.40	
	ALCON INC	31,680	64.48	2,042,726.40	
	BALOISE HOLDING AG	3,011	154.70	465,801.70	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,136	98.50	210,396.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	196	1,974.00	386,904.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	65	8,055.00	523,575.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	85,200.00	511,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	33,652	88.52	2,978,875.04	
	CLARIANT AG	13,020	19.71	256,689.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	156,962	12.58	1,975,366.77	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	521	854.50	445,194.50	
	GEBERIT AG-REG	2,390	555.60	1,327,884.00	
	GIVAUDAN-REG	595	3,565.00	2,121,175.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,469	54.18	783,930.42	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,538	210.10	743,333.80	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	33,651	49.95	1,680,867.45	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,464	104.60	1,094,534.40	
	LONZA GROUP AG	4,806	600.80	2,887,444.80	
	NESTLE SA	185,537	98.21	18,221,588.77	
	NOVARTIS AG	143,064	79.25	11,337,822.00	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,201	1,096.00	1,316,296.00	
	ROCHE HOLDING AG	45,232	303.15	13,712,080.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,439	253.40	364,642.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,515	258.70	650,630.50	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	390	2,705.00	1,054,950.00	
	SIKA AG-BEARER	9,150	248.60	2,274,690.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,521	242.20	852,786.20	
	STRAUMANN HOLDING AG	667	1,154.00	769,718.00	
	SWATCH GROUP AG	1,719	267.80	460,348.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,969	443.70	873,645.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,225	87.40	456,665.00	
	SWISS RE AG	18,437	82.52	1,521,421.24	
	SWISSCOM AG	1,723	464.80	800,850.40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	4,344	134.15	582,747.60	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	3,969	51.60	204,800.40	
	UBS GROUP AG	235,891	13.91	3,281,243.81	
	VIFOR PHARMA AG	2,937	115.50	339,223.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,705	375.00	3,639,375.00	
スイス・フラン	小計	1,118,675		86,947,983.02 (10,228,560,723)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	20,467	257.30	5,266,159.10	
	ASSA ABLOY AB	65,001	216.80	14,092,216.80	
	ATLAS COPCO AB	24,947	436.70	10,894,354.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	43,536	510.40	22,220,774.40	
	BOLIDEN AB	17,389	333.20	5,794,014.80	
	ELECTROLUX AB	14,743	208.60	3,075,389.80	
	EPIROC AB-A	42,508	181.50	7,715,202.00	
	EPIROC AB-B	25,323	167.00	4,228,941.00	
	EQT AB	15,289	253.20	3,871,174.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	39,556	258.00	10,205,448.00	
	EVOLUTION AB	10,264	1,078.00	11,064,592.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,666	401.40	2,675,732.40	
	HENNES & MAURITZ AB	51,764	189.00	9,783,396.00	
	HEXAGON AB-B SHS	18,174	730.00	13,267,020.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,084	103.55	2,804,548.20	
	ICA GRUPPEN AB	6,487	411.20	2,667,454.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,274	294.00	1,844,556.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,464	278.80	2,917,363.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9,501	201.20	1,911,601.20	
	INVESTOR AB	28,901	634.00	18,323,234.00	
	KINNEVIK AB - B	15,204	412.05	6,264,808.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,820	427.80	2,061,996.00	
	LUNDIN ENERGY AB	11,838	259.20	3,068,409.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	20,445	289.20	5,912,694.00	
	NORDEA BANK ABP	208,539	75.05	15,650,851.95	
	SANDVIK AB	72,773	226.00	16,446,698.00	

	SECURITAS AB	20,478	127.20	2,604,801.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	105,406	97.00	10,224,382.00	
	SKANSKA AB-B SHS	22,265	206.90	4,606,628.50	
	SKF AB	24,633	228.20	5,621,250.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB	38,669	153.70	5,943,425.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	100,694	87.00	8,760,378.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	58,073	146.00	8,478,658.00	
	SWEDISH MATCH AB	10,445	591.00	6,172,995.00	
	TELE2 AB	33,982	107.15	3,641,171.30	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	187,688	107.35	20,148,306.80	
	TELIA CO AB	163,174	34.65	5,653,979.10	
	VOLVO AB	91,919	216.50	19,900,463.50	
スウェーデン・クローナ 小計		1,675,383		305,785,070.45 (3,901,817,498)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	205	11,900.00	2,439,500.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	403	12,830.00	5,170,490.00	
	AMBU A/S-B	10,496	299.90	3,147,750.40	
	CARLSBERG AS-B	6,641	1,005.50	6,677,525.50	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,831	548.20	3,744,754.20	
	COLOPLAST-B	7,606	973.80	7,406,722.80	
	DANSKE BANK A/S	44,057	113.15	4,985,049.55	
	DEMANT A/S	6,912	258.60	1,787,443.20	
	DSV PANALPINA A/S	13,431	1,135.00	15,244,185.00	
	GENMAB A/S	4,209	2,460.00	10,354,140.00	
	GN STORE NORD A/S	8,212	548.80	4,506,745.60	
	H LUNDBECK A/S	4,550	252.60	1,149,330.00	
	NOVO-NORDISK A/S	110,815	455.25	50,448,528.75	
	NOVOZYMES A/S	13,343	389.90	5,202,435.70	
	ORSTED A/S	12,203	1,019.00	12,434,857.00	
	PANDORA A/S	6,419	639.60	4,105,592.40	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	517	2,300.00	1,189,100.00		
TRYGVESTA AS	9,982	199.00	1,986,418.00		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,679	1,274.50	16,159,385.50		
デンマーク・クローネ 小計		279,511		158,139,953.60 (2,720,007,201)	
ニュージーラン ド・ドル	A2 MILK CO LTD	47,889	11.17	534,920.13	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,853	6.75	572,757.75	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	37,054	32.95	1,220,929.30	
	MERCURY NZ LTD	46,473	6.40	297,427.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	83,990	5.80	487,142.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	26,546	15.05	399,517.30	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	126,897	4.67	592,608.99	
ニュージーランド・ドル 小計		453,702		4,105,302.67 (316,354,623)	
ノルウェー・ク ローネ	ADEVINTA ASA-B	15,522	130.00	2,017,860.00	
	DNB ASA	61,561	168.40	10,366,872.40	
	EQUINOR ASA	62,531	151.85	9,495,332.35	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,394	202.80	2,716,303.20	

	MOWI ASA	28,569	200.00	5,713,800.00	
	NORSK HYDRO ASA	86,108	43.98	3,787,029.84	
	ORKLA ASA	48,674	79.16	3,853,033.84	
	SCHIBSTED ASA	4,942	359.30	1,775,660.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,331	303.00	1,918,293.00	
	TELENOR ASA	46,881	139.85	6,556,307.85	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,105	417.70	4,638,558.50	
	ノルウェー・クロネ 小計	385,618		52,839,051.58 (659,959,754)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	27,348	9.29	254,062.92	
	ACCOR	11,879	31.46	373,713.34	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	17,368	25.22	438,020.96	
	ADIDAS AG	12,268	295.60	3,626,420.80	
	ADP	2,142	95.70	204,989.40	
	ADYEN NV	1,169	2,211.00	2,584,659.00	
	AEGON NV	113,020	3.93	444,959.74	
	AENA SME SA	4,535	130.80	593,178.00	
	AGEAS	11,190	46.17	516,642.30	
	AIR LIQUIDE	30,528	132.15	4,034,275.20	
	AIRBUS SE	37,939	91.77	3,481,662.03	
	AKZO NOBEL NV	12,452	86.24	1,073,860.48	
	ALLIANZ SE	26,837	195.38	5,243,413.06	
	ALSTOM RGPT	16,173	41.00	663,093.00	
	AMADEUS IT GROUP SA	29,042	55.16	1,601,956.72	
	AMPLIFON SPA	8,008	34.94	279,799.52	
	AMUNDI SA	3,916	65.60	256,889.60	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	49,176	53.36	2,624,031.36	
	ARCELORMITTAL	46,063	19.77	910,757.63	
	ARGENX SE	2,902	302.80	878,725.60	
	ARKEMA	4,433	90.50	401,186.50	
	AROUNDTOWN SA	65,769	5.83	383,959.42	
	ASML HOLDING NV	27,426	494.00	13,548,444.00	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	71,090	15.58	1,107,582.20	
	ATLANTIA SPA	32,312	15.05	486,457.16	
	ATOS SE	6,314	62.96	397,529.44	
	AXA SA	124,508	19.85	2,472,230.84	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	427,545	4.50	1,926,090.22	
	BANCO SANTANDER SA	1,116,229	2.97	3,320,781.27	
	BASF SE	59,178	68.00	4,024,104.00	
	BAYER AG	63,402	53.91	3,418,001.82	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	21,359	71.58	1,528,877.22	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,676	56.75	208,613.00	
	BECHTLE AG	1,755	165.20	289,926.00	
	BEIERSDORF AG	6,482	85.08	551,488.56	
	BIOMERIEUX	2,651	113.70	301,418.70	
	BNP PARIBAS	72,278	48.32	3,492,834.35	
	BOLLORE	59,818	4.08	244,296.71	
	BOUYGUES	14,845	33.39	495,674.55	
	BRENNTAG SE	9,900	66.08	654,192.00	
	BUREAU VERITAS SA	19,353	22.10	427,701.30	
	CAIXABANK	228,497	2.35	536,967.95	
	CAPGEMINI SA	10,365	140.05	1,451,618.25	

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,590	132.40	342,916.00	
CARREFOUR SA	39,041	15.05	587,567.05	
CELLNEX TELECOM SAU	20,556	43.81	900,558.36	
CIE DE SAINT-GOBAIN	33,432	43.25	1,445,934.00	
CNH INDUSTRIAL NV	66,318	12.26	813,390.27	
CNP ASSURANCES	10,990	14.20	156,058.00	
COLRUYT NV	3,406	50.16	170,844.96	
COMMERZBANK AG	63,416	5.32	337,880.44	
CONTINENTAL AG	7,078	120.35	851,837.30	
COVESTRO AG	11,655	58.66	683,682.30	
CREDIT AGRICOLE SA	73,969	11.32	837,698.92	
CRH PLC	50,386	36.16	1,821,957.76	
DAIMLER AG	55,073	67.22	3,702,007.06	
DANONE	39,873	56.82	2,265,583.86	
DASSAULT AVIATION SA	156	899.00	140,244.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,547	188.45	1,610,682.15	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	37,088	9.68	359,160.19	
DELIVERY HERO SE	8,344	121.70	1,015,464.80	
DEUTSCHE BANK AG	126,352	9.56	1,207,925.12	
DEUTSCHE BOERSE AG	12,221	136.70	1,670,610.70	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	19,511	11.04	215,401.44	
DEUTSCHE POST AG	64,228	42.41	2,723,909.48	
DEUTSCHE TELEKOM AG	215,462	14.83	3,195,301.46	
DEUTSCHE WOHNEN SE	22,119	39.86	881,663.34	
DIASORIN SPA	1,595	169.50	270,352.50	
E.ON SE	145,688	8.68	1,265,154.59	
EDENRED	16,117	47.89	771,843.13	
EDF	40,208	10.20	410,121.60	
EIFFAGE	5,562	82.40	458,308.80	
ELIA GROUP SA/NV	2,028	94.30	191,240.40	
ELISA OYJ	9,408	50.52	475,292.16	
ENAGAS SA	15,792	17.11	270,201.12	
ENDESA SA	20,514	21.71	445,358.94	
ENEL SPA	523,953	8.19	4,294,318.78	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	179,691	4.76	855,688.54	
ENGIE	117,925	12.89	1,520,642.87	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	162,637	9.19	1,495,935.12	
ERSTE GROUP BANK AG	18,126	26.41	478,707.66	
ESSILORLUXOTTICA	18,393	136.45	2,509,724.85	
EURAZEO	2,601	62.10	161,522.10	
EUROFINS SCIENTIFIC	8,573	81.11	695,356.03	
EVONIK INDUSTRIES AG	13,396	28.06	375,891.76	
EXOR NV	6,982	66.10	461,510.20	
FAURECIA	5,363	46.65	250,183.95	
FERRARI NV	8,113	163.75	1,328,503.75	
FERROVIAL S.A.	32,167	20.26	651,703.42	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	63,938	13.38	855,490.44	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,660	13.38	945,430.80	
FINECOBANK SPA	39,068	14.85	580,159.80	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	9,927	158.10	1,569,458.70	
FORTUM OYJ	28,562	21.36	610,084.32	



FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	13,717	59.10	810,674.70	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26,880	36.00	967,680.00	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	4,330	47.00	203,510.00	
GALAPAGOS NV	2,774	70.88	196,621.12	
GALP ENERGIA SGPS SA	32,003	9.49	303,836.48	
GEA GROUP AG	9,811	29.97	294,035.67	
GETLINK SE - REGR	30,418	13.44	408,817.92	
GRIFOLS SA	19,189	22.02	422,541.78	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7,339	83.82	615,154.98	
HANNOVER RUECK SE	3,866	140.20	542,013.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	9,479	65.60	621,822.40	
HEINEKEN HOLDING NV	7,503	75.15	563,850.45	
HEINEKEN NV	16,750	86.36	1,446,530.00	
HELLOFRESH SE	9,445	72.60	685,707.00	
HENKEL AG & CO KGAA	6,803	75.20	511,585.60	
HENKEL KGAA-VORZUG	11,310	84.78	958,861.80	
HERMES INTERNATIONAL	2,042	963.60	1,967,671.20	
HOCHTIEF AG	1,712	74.95	128,314.40	
IBERDROLA SA	387,669	10.51	4,074,401.19	
ILIAD SA	972	152.50	148,230.00	
INDITEX SA	70,050	25.90	1,814,295.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	84,107	36.60	3,078,316.20	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	22,014	8.71	191,741.94	
ING GROEP NV-CVA	251,160	8.95	2,247,882.00	
INTESA SANPAOLO	1,057,632	2.10	2,229,488.25	
IPSEN	2,418	70.25	169,864.50	
JDE PEET'S BV	4,985	32.58	162,411.30	
JERONIMO MARTINS	15,635	13.00	203,255.00	
JUST EAT TAKEAWAY	8,159	86.68	707,222.12	
KBC GROEP NV	16,036	58.86	943,878.96	
KERING	4,884	528.00	2,578,752.00	
KERRY GROUP PLC-A	10,244	103.40	1,059,229.60	
KESKO OYJ-B SHS	17,576	21.22	372,962.72	
KINGSPAN GROUP PLC	9,919	62.70	621,921.30	
KION GROUP AG	4,184	74.38	311,205.92	
KNORR-BREMSE AG	4,703	107.24	504,349.72	
KONE OYJ	21,890	69.14	1,513,474.60	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	70,775	22.38	1,583,944.50	
KONINKLIJKE DSM NV	11,102	142.40	1,580,924.80	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	58,554	46.65	2,731,836.87	
L'OREAL SA	16,206	316.10	5,122,716.60	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,477	37.60	205,935.20	
LANXESS	5,287	62.76	331,812.12	
LEG IMMOBILIE AG	4,644	116.48	540,933.12	
LEGRAND SA	17,227	74.64	1,285,823.28	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	17,894	541.80	9,694,969.20	
MEDIOBANCA SPA	40,298	9.08	365,905.84	
MERCK KGAA	8,306	139.00	1,154,534.00	
MICHELIN (C.G.D.E.)	10,915	119.05	1,299,430.75	
MONCLER SPA	12,432	53.32	662,874.24	

MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,422	191.55	655,484.10	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,997	236.00	2,123,292.00	
NATIXIS	61,255	4.05	248,634.04	
NATURGY ENERGY GROUP SA	19,098	20.61	393,609.78	
NEMETSCHKE SE	3,709	55.50	205,849.50	
NESTE OYJ	27,144	56.12	1,523,321.28	
NEXI SPA	28,231	15.52	438,145.12	
NN GROUP NV	18,505	36.67	678,578.35	
NOKIA OYJ	363,247	3.39	1,232,860.31	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	4,396	67.05	294,751.80	
OMV AG	9,340	38.96	363,886.40	
ORANGE S.A.	129,999	9.76	1,269,310.23	
ORION OYJ-CLASS B	6,774	35.89	243,118.86	
ORPEA	3,388	108.65	368,106.20	
PERNOD-RICARD	13,522	163.35	2,208,818.70	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	9,573	64.94	621,670.62	
POSTE ITALIANE SPA	36,023	9.39	338,544.15	
PROSUS	31,397	108.20	3,397,155.40	
PROXIMUS	10,241	17.70	181,316.90	
PRYSMIAN SPA	15,442	26.74	412,919.08	
PUBLICIS GROUPE	14,006	47.71	668,226.26	
PUMA AG	6,337	89.04	564,246.48	
QIAGEN NV	14,824	45.97	681,459.28	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	9,370	17.08	160,039.60	
RANDSTAD NV	7,681	54.90	421,686.90	
RATIONAL AG	326	813.00	265,038.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,704	43.80	293,635.20	
RED ELECTRICA DE ESPANA	27,805	14.82	412,070.10	
REMY COINTREAU	1,445	165.90	239,725.50	
RENAULT SA	12,493	38.03	475,171.25	
REPSOL SA	94,317	9.94	937,510.98	
ROYAL KPN NV	234,383	2.83	664,475.80	
RWE AG	41,338	32.47	1,342,244.86	
SAFRAN SA	20,643	112.05	2,313,048.15	
SAMPO OYJ	30,295	36.64	1,110,008.80	
SANOFI	73,010	77.01	5,622,500.10	
SAP SE	67,261	104.94	7,058,369.34	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,288	466.00	1,066,208.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,782	387.60	690,703.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,686	128.60	4,460,619.60	
SCOR REGROUPE	10,163	27.76	282,124.88	
SCOUT24 AG	6,845	67.50	462,037.50	
SEB SA	1,454	164.80	239,619.20	
SIEMENS AG	49,270	132.48	6,527,289.60	
SIEMENS ENERGY AG	25,710	32.32	830,947.20	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,358	33.23	510,346.34	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,266	46.80	808,048.80	

	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	15,724	41.60	654,118.40	
	SNAM SPA	129,166	4.36	563,551.25	
	SOCIETE GENERALE	52,065	19.80	1,031,199.39	
	SODEXO	5,628	75.24	423,450.72	
	SOFINA	946	286.50	271,029.00	
	SOLVAY SA	4,810	96.42	463,780.20	
	STMICROELECTRONICS NV	41,059	34.62	1,421,462.58	
	STORA ENSO OYJ	37,110	16.37	607,490.70	
	SUEZ	22,436	17.00	381,412.00	
	SYMRISE AG	8,272	101.05	835,885.60	
	TEAMVIEWER AG	9,687	49.13	475,922.31	
	TELECOM ITALIA SPA	905,318	0.37	341,304.88	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	71,254	2.39	170,867.09	
	TELEFONICA SA	312,118	3.73	1,165,448.61	
	TELEPERFORMANCE	3,800	286.10	1,087,180.00	
	TENARIS SA	29,519	7.23	213,599.48	
	TERNA SPA	90,983	5.93	539,893.12	
	THALES SA	6,826	76.74	523,827.24	
	TOTAL SE	162,294	36.95	5,996,763.30	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	5,877	73.32	430,901.64	
	UCB SA	8,113	83.62	678,409.06	
	UMICORE	12,673	48.02	608,557.46	
	UNICREDIT SPA	136,303	8.34	1,137,584.83	
	UNILEVER NV	92,379	45.22	4,177,840.27	
	UNIPER SE	13,008	29.86	388,418.88	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,841	39.03	267,004.23	
	UPM-KYMMENE OYJ	34,327	31.97	1,097,434.19	
	VALEO SA	14,767	32.18	475,202.06	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,991	22.38	783,098.58	
	VINCI SA	33,736	85.02	2,868,234.72	
	VIVENDI SA	53,440	29.34	1,567,929.60	
	VOESTALPINE AG	7,361	32.19	236,950.59	
	VOLKSWAGEN AG	2,314	189.10	437,577.40	
	VOLKSWAGEN AG	11,901	170.54	2,029,596.54	
	VONOVIA SE	33,830	53.82	1,820,730.60	
	VOPAK	4,456	40.85	182,027.60	
	WARTSILA OYJ	28,992	8.68	251,882.49	
	WENDEL	1,825	94.05	171,641.25	
	WOLTERS KLUWER NV	17,624	69.50	1,224,868.00	
	WORLDLINE SA	15,471	77.08	1,192,504.68	
	ZALANDO SE	9,804	97.36	954,517.44	
ユーロ	小計	12,080,474		281,493,174.67 (36,005,791,972)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	779,075	101.50	79,076,112.50	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	19,800	117.80	2,332,440.00	
	BANK OF EAST ASIA	87,200	18.10	1,578,320.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	240,539	24.30	5,845,097.70	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	111,500	27.20	3,032,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	166,409	42.60	7,089,023.40	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,909	55.30	9,617,167.70	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	44,500	42.85	1,906,825.00	
	CLP HOLDINGS LTD	106,643	72.20	7,699,624.60	

ESR CAYMAN LTD	109,400	27.80	3,041,320.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	138,810	66.90	9,286,389.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	135,157	21.65	2,926,149.05	
HANG SENG BANK LTD	49,412	150.60	7,441,447.20	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	101,641	32.15	3,267,758.15	
HONG KONG & CHINA GAS	698,750	11.10	7,756,125.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	77,611	567.00	44,005,437.00	
MTR CORP	110,255	45.20	4,983,526.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	103,917	37.10	3,855,320.70	
PCCW LTD	327,000	4.56	1,491,120.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	90,587	41.65	3,772,948.55	
SANDS CHINA LTD	158,180	35.45	5,607,481.00	
SINO LAND CO	210,000	11.82	2,482,200.00	
SJM HOLDINGS LTD	129,000	9.88	1,274,520.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	85,523	113.90	9,741,069.70	
SWIRE PACIFIC LTD	34,366	56.00	1,924,496.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	78,400	23.35	1,830,640.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	89,000	127.50	11,347,500.00	
WH GROUP LTD	616,500	6.49	4,001,085.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	109,733	45.85	5,031,258.05	
WYNN MACAU LTD	106,503	14.06	1,497,432.18	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	118,000	21.95	2,590,100.00	
香港・ドル 小計	5,407,320		257,332,733.48 (3,502,298,502)	
合計	69,845,356		328,287,876,560 (328,287,876,560)	

## 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	36,721.00	604,427.66	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,130.00	1,351,531.20	
		AMERICAN TOWER REIT INC	28,584.00	6,470,560.08	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	91,885.00	766,320.90	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,029.00	1,607,252.29	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,527.00	878,770.48	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,199.00	651,700.87	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	27,814.00	4,611,561.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,335.00	2,365,360.75	
		DUKE REALTY CORP	23,778.00	974,660.22	
		EQUINIX INC	5,705.00	3,880,655.10	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,095.00	689,998.05	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,955.00	1,604,266.35	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,174.00	1,101,476.86	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,295.00	992,330.85	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	34,491.00	1,027,141.98	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	45,473.00	761,218.02	
	INVITATION HOMES INC	35,991.00	1,079,010.18	
	IRON MOUNTAIN INC	18,892.00	607,755.64	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	34,084.00	745,076.24	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,293.00	1,003,298.01	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,642.00	546,146.60	
	PROLOGIS INC	47,547.00	5,006,699.10	
	PUBLIC STORAGE	10,080.00	2,365,776.00	
	REALTY INCOME CORP	22,092.00	1,349,600.28	
	REGENCY CENTERS CORP	10,914.00	576,259.20	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,208.00	1,886,838.16	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,940.00	2,291,464.20	
	SUN COMMUNITIES INC	6,300.00	960,813.00	
	UDR INC	18,952.00	800,153.44	
	VENTAS INC	23,963.00	1,255,421.57	
	VEREIT	13,628.00	498,239.68	
	VICI PROPERTIES INC	34,226.00	956,958.96	
	VORNADO REALTY TRUST	10,457.00	389,523.25	
	WELLTOWER INC	26,881.00	1,838,391.59	
	WP CAREY INC	11,182.00	764,066.06	
アメリカ・ドル	小計	767,462.00	55,260,724.02 (5,830,006,384)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	57,279.00	267,492.93	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	45,538.00	280,514.08	
	SEGRO PLC	76,484.00	747,554.61	
イギリス・ポンド	小計	179,301.00	1,295,561.62 (191,717,209)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	78,381.00	670,157.55	
	GOODMAN GROUP	110,985.00	1,911,161.70	
	GPT GROUP	135,639.00	560,189.07	
	MIRVAC GROUP	277,274.00	610,002.80	
	SCENTRE GROUP	344,484.00	940,441.32	
	STOCKLAND	160,517.00	709,485.14	
	VICINITY CENTRES	267,167.00	412,773.01	
オーストラリア・ドル	小計	1,374,447.00	5,814,210.59 (483,684,179)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,353.00	263,474.66	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,933.00	179,588.64	
カナダ・ドル	小計	15,286.00	443,063.30 (37,093,259)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	206,200.00	628,910.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	291,696.00	600,893.76	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	140,400.00	277,992.00	

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	188,000.00	359,080.00	
	SUNTEC REIT	121,100.00	176,806.00	
シンガポール・ドル 小計		947,396.00	2,043,681.76 (162,983,620)	
ユーロ	COVIVIO	3,344.00	212,511.20	
	GECINA SA	2,894.00	329,337.20	
	KLEPIERRE	12,526.00	215,760.35	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,935.00	496,428.60	
ユーロ 小計		27,699.00	1,254,037.35 (160,403,917)	
香港・ドル	LINK REIT	134,171.00	9,412,095.65	
香港・ドル 小計		134,171.00	9,412,095.65 (128,098,622)	
投資証券 合計			6,993,987,190 (6,993,987,190)	
合計			6,993,987,190 (6,993,987,190)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 592銘柄	67.84%	-%	71.96%
	投資証券 36銘柄	-%	1.68%	
イギリス・ポンド	株式 86銘柄	4.35%	-%	4.56%
	投資証券 3銘柄	-%	0.06%	
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄	2.17%	-%	2.40%
	投資証券 7銘柄	-%	0.14%	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.32%	-%	3.44%
	投資証券 2銘柄	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.28%	-%	0.34%
	投資証券 5銘柄	-%	0.05%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	2.95%	-%	3.05%
スウェーデン・クローナ	株式 38銘柄	1.12%	-%	1.16%
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	0.78%	-%	0.81%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.09%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.19%	-%	0.20%
	投資証券 1銘柄	-%	0.04%	
ユーロ	株式 232銘柄	10.37%	-%	10.79%
	投資証券 4銘柄	-%	0.05%	
香港・ドル	株式 31銘柄	1.01%	-%	1.08%
	投資証券 1銘柄	-%	0.04%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	114,682,539	64,727,229
金銭信託	2,528,832	3,938,492
コール・ローン	108,565,603	201,366,652
国債証券	27,243,250,522	35,164,234,294
派生商品評価勘定	666,326	157,838
未収入金	-	9,299,811
未収利息	164,229,827	193,647,902
前払費用	13,271,686	15,166,479
流動資産合計	27,647,195,335	35,652,538,697
資産合計	27,647,195,335	35,652,538,697
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,847	31,341
未払金	111,089,592	27,346,895
未払解約金	54,292,395	140,882,965
その他未払費用	159	240
流動負債合計	165,385,993	168,261,441
負債合計	165,385,993	168,261,441
純資産の部		
元本等		
元本	19,109,600,573	24,370,479,823
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,372,208,769	11,113,797,433
純資産合計	27,481,809,342	35,484,277,256
負債純資産合計	27,647,195,335	35,652,538,697



## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 受益権総口数	19,109,600,573口	24,370,479,823口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4381円 (14,381円)	1.4560円 (14,560円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年2月22日 至 2020年2月21日	自 2020年2月22日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年2月21日現在	2021年2月22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	401,034,542	1,022,934,898
合計	401,034,542	1,022,934,898

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2020年2月21日 現在				2021年2月22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	-	-	-	-	9,338,158	-	9,338,631	473
アメリカ・ドル	-	-	-	-	4,299,993	-	4,299,993	-
ユーロ	-	-	-	-	5,038,165	-	5,038,638	473
買 建	87,053,586	-	87,716,065	662,479	59,729,056	-	59,856,026	126,970
アメリカ・ドル	62,894,184	-	63,560,510	666,326	46,988,136	-	47,107,019	118,883
イギリス・ポンド	3,936,513	-	3,936,458	55	1,479,431	-	1,482,145	2,714
ポーランド・ズロチ	2,325,358	-	2,323,220	2,138	-	-	-	-
ユーロ	15,834,244	-	15,833,982	262	11,261,489	-	11,266,862	5,373
南アフリカ・ランド	2,063,287	-	2,061,895	1,392	-	-	-	-
合計	87,053,586	-	87,716,065	662,479	69,067,214	-	69,194,657	126,497

## （注）１．時価の算定方法

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

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

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

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2020年2月21日現在	2021年2月22日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	14,029,005,797円	19,109,600,573円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	8,074,443,613円	10,930,468,360円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,993,848,837円	5,669,589,110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)	1,988,607,958円	2,594,228,746円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,451,344,594円	4,223,730,208円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,166,961,336円	1,468,176,427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)	721,056,120円	774,326,193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)	5,464,511円	3,186,737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)	15,323,186円	10,273,265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)	11,703,617円	10,814,401円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	9,095,999,668円	10,656,832,523円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	919,264,826円	1,679,640,180円
DCニッセイ外国債券インデックス	954,327,693円	1,422,055,010円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	31,780,455円	56,038,401円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	559,809,809円	1,018,059,982円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	23,386,677円	56,475,677円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	43,381,851円	122,829,401円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	13,861,914円	29,985,879円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	64,239,238円	79,983,120円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,659,287円	6,301,042円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	24,931,873円	26,854,231円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	3,359,097円	18,967,154円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,686,625円	12,813,378円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	4,111,612円	41,883,375円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,338,626円	57,024,493円
計	19,109,600,573円	24,370,479,823円

附属明細表(2021年2月22日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	120,000.00	157,414.80	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	80,000.00	105,500.00	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	130,000.00	180,024.00	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	90,000.00	119,066.40	

US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	100,000.00	126,523.00	
US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	120,000.00	161,056.80	
US TREASURY N/B 0.125 2023/09/15	1,580,000.00	1,578,388.40	
US TREASURY N/B 0.125 2023/12/15	1,740,000.00	1,736,589.60	
US TREASURY N/B 0.25 2023/06/15	1,500,000.00	1,503,750.00	
US TREASURY N/B 0.375 2027/09/30	1,090,000.00	1,051,882.70	
US TREASURY N/B 0.5 2027/06/30	910,000.00	889,197.40	
US TREASURY N/B 0.625 2027/03/31	610,000.00	602,850.80	
US TREASURY N/B 0.625 2027/12/31	1,130,000.00	1,104,575.00	
US TREASURY N/B 0.625 2030/08/15	1,700,000.00	1,596,657.00	
US TREASURY N/B 0.875 2030/11/15	1,850,000.00	1,773,965.00	
US TREASURY N/B 1.125 2040/05/15	770,000.00	666,527.40	
US TREASURY N/B 1.125 2040/08/15	990,000.00	853,716.60	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	1,390,000.00	1,430,059.80	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	1,580,000.00	1,629,864.80	
US TREASURY N/B 1.375 2040/11/15	830,000.00	748,162.00	
US TREASURY N/B 1.375 2050/08/15	1,090,000.00	905,550.20	
US TREASURY N/B 1.5 2023/02/28	1,280,000.00	1,315,545.60	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	1,290,000.00	1,327,177.80	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	1,340,000.00	1,397,941.60	
US TREASURY N/B 1.5 2030/02/15	1,010,000.00	1,032,482.60	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	2,380,000.00	2,433,550.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/31	2,030,000.00	2,076,608.80	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	2,460,000.00	2,524,083.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/12/15	2,180,000.00	2,239,775.60	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	1,520,000.00	1,597,124.80	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	1,390,000.00	1,459,986.50	
US TREASURY N/B 1.625 2026/09/30	680,000.00	713,707.60	
US TREASURY N/B 1.625 2029/08/15	730,000.00	756,542.80	
US TREASURY N/B 1.625 2050/11/15	1,220,000.00	1,080,651.60	

US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	1,790,000.00	1,822,721.20	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	2,290,000.00	2,336,693.10	
US TREASURY N/B 1.75 2022/06/15	1,960,000.00	2,002,257.60	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	1,940,000.00	1,990,925.00	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	2,160,000.00	2,237,436.00	
US TREASURY N/B 1.75 2026/12/31	620,000.00	655,017.60	
US TREASURY N/B 1.75 2029/11/15	540,000.00	564,823.80	
US TREASURY N/B 1.875 2026/06/30	600,000.00	638,010.00	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,210,000.00	1,232,687.50	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,940,000.00	2,012,051.60	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	1,320,000.00	1,396,309.20	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	2,430,000.00	2,585,082.60	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	2,540,000.00	2,711,043.60	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	1,340,000.00	1,434,215.40	
US TREASURY N/B 2 2050/02/15	830,000.00	806,137.50	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	1,930,000.00	1,982,766.20	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	2,230,000.00	2,312,911.40	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	1,290,000.00	1,365,581.10	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	1,440,000.00	1,533,196.80	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	2,420,000.00	2,591,094.00	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	1,800,000.00	1,905,462.00	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	2,320,000.00	2,483,838.40	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	1,500,000.00	1,607,985.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	2,730,000.00	2,948,591.10	
US TREASURY N/B 2.25 2026/03/31	840,000.00	908,838.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	1,160,000.00	1,259,504.80	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	1,950,000.00	2,118,480.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	2,200,000.00	2,391,026.00	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	550,000.00	565,873.00	
US TREASURY N/B 2.25 2049/08/15	780,000.00	800,716.80	

US TREASURY N/B 2.375 2022/03/15	1,950,000.00	1,997,073.00	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	2,380,000.00	2,551,978.80	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	1,500,000.00	1,640,910.00	
US TREASURY N/B 2.375 2029/05/15	860,000.00	943,110.40	
US TREASURY N/B 2.375 2049/11/15	670,000.00	706,454.70	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	2,170,000.00	2,296,033.60	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	2,260,000.00	2,424,189.00	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	550,000.00	594,533.50	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	500,000.00	539,980.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	500,000.00	539,665.00	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	1,430,000.00	1,558,471.20	
US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	1,870,000.00	2,054,438.10	
US TREASURY N/B 2.625 2029/02/15	1,000,000.00	1,115,780.00	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	2,460,000.00	2,632,372.20	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	2,090,000.00	2,248,045.80	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	1,540,000.00	1,691,643.80	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	990,000.00	1,109,839.50	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	280,000.00	317,416.40	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	360,000.00	407,865.60	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	530,000.00	600,161.40	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	540,000.00	611,566.20	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	1,060,000.00	1,198,669.20	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	1,050,000.00	1,188,957.00	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	500,000.00	577,910.00	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	460,000.00	531,350.60	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	460,000.00	531,801.40	
US TREASURY N/B 2.875 2049/05/15	780,000.00	907,631.40	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	1,630,000.00	1,814,190.00	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	220,000.00	259,331.60	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	470,000.00	553,918.50	



US TREASURY N/B 3 2045/05/15	360,000.00	424,461.60	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	240,000.00	283,423.20	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	480,000.00	568,104.00	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	370,000.00	438,231.70	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	630,000.00	747,287.10	
US TREASURY N/B 3 2048/08/15	710,000.00	843,231.50	
US TREASURY N/B 3 2049/02/15	780,000.00	928,223.40	
US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	1,030,000.00	1,186,663.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	220,000.00	264,352.00	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	240,000.00	288,636.00	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	350,000.00	420,626.50	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	500,000.00	601,070.00	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	660,000.00	800,606.40	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	480,000.00	599,659.20	
US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	730,000.00	927,012.40	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	130,000.00	163,931.30	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	410,000.00	530,933.60	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	480,000.00	622,161.60	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	380,000.00	501,109.80	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	220,000.00	291,929.00	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	190,000.00	262,139.20	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	200,000.00	278,272.00	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	120,000.00	166,616.40	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	220,000.00	308,763.40	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	130,000.00	179,704.20	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	120,000.00	169,101.60	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	190,000.00	270,193.30	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	210,000.00	304,014.90	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	230,000.00	340,273.50	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	100,000.00	146,980.00	

	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	110,000.00	158,695.90	
	WI TREASURY SEC. 0.625 2030/05/15	1,360,000.00	1,282,425.60	
	WI TREASURY SEC. 1.25 2050/05/15	950,000.00	763,667.00	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	200,000.00	261,992.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	200,000.00	281,702.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	200,000.00	283,444.00	
アメリカ・ドル 小計		134,750,000.00	143,112,702.50 (15,098,390,114)	
イギリス・ポンド	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	210,000.00	305,449.20	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	300,000.00	490,803.00	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	300,000.00	435,600.00	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	270,000.00	449,682.30	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	220,000.00	276,683.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	280,000.00	383,983.60	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	210,000.00	320,445.30	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	260,000.00	402,662.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	270,000.00	501,741.00	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	250,000.00	346,225.00	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	210,000.00	218,794.80	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	200,000.00	375,048.00	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	240,000.00	382,747.20	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	260,000.00	310,575.20	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	160,000.00	226,707.20	
	UK TSY 0 1/4% 2031 0.25 2031/07/31	130,000.00	123,090.50	
	UK TSY 0 1/2% 2061 0.5 2061/10/22	160,000.00	125,259.20	
	UK TSY 0 1/8% 2023 0.125 2023/01/31	540,000.00	540,950.40	
	UK TSY 0 1/8% 2024 0.125 2024/01/31	260,000.00	260,005.20	
	UK TSY 0 1/8% 2026 0.125 2026/01/30	360,000.00	357,559.20	
UK TSY 0 1/8% 2028 0.125 2028/01/31	330,000.00	322,334.10		
UK TSY 0 3/8% 2030 0.375 2030/10/22	400,000.00	387,720.00		
UK TSY 0 5/8% 2025 0.625 2025/06/07	330,000.00	336,220.50		

	UK TSY 0 5/8% 2050 0.625 2050/10/22	300,000.00	253,707.00	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	230,000.00	245,104.10	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	310,000.00	328,162.90	
	UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	310,000.00	326,879.50	
	UK TSY 1 1/4% 2041 1.25 2041/10/22	300,000.00	302,745.00	
	UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	250,000.00	271,215.00	
	UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22	230,000.00	254,676.70	
	UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	100,000.00	120,867.00	
	UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	320,000.00	329,216.00	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	370,000.00	380,115.80	
	UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	170,000.00	190,510.50	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	290,000.00	336,342.00	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	240,000.00	253,425.60	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	170,000.00	185,855.90	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	180,000.00	194,644.80	
	UK TSY 2029 0.875 2029/10/22	240,000.00	245,239.20	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	240,000.00	445,351.20	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	340,000.00	478,329.00	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	210,000.00	347,699.10	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	350,000.00	514,871.00	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	200,000.00	346,040.00	
	UK TSY GILT 0 5/8% 2035 0.625 2035/07/31	220,000.00	207,858.20	
	UK TSY GILT 0 7/8% 2046 0.875 2046/01/31	110,000.00	101,224.20	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	420,000.00	423,158.40	
	UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	320,000.00	325,542.40	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	380,000.00	417,509.80	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	240,000.00	350,390.40	
イギリス・ボンド	小計	13,190,000.00	16,056,966.60 (2,376,109,917)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1 2030/03/31	310,000.00	312,077.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 2022/11/30	800,000.00	818,600.00	

	ISRAEL FIXED BOND 1.5 2023/11/30	790,000.00	821,916.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 2037/05/31	180,000.00	176,499.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 2025/08/31	570,000.00	610,099.50	
	ISRAEL FIXED BOND 2 2027/03/31	280,000.00	308,700.00	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 2028/09/28	270,000.00	301,117.50	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 2024/03/31	300,000.00	343,005.00	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 2047/03/31	340,000.00	462,655.00	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 2042/01/31	330,000.00	542,008.50	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 2026/10/30	250,000.00	335,462.50	
	イスラエル・シュケル 小計	4,420,000.00	5,032,140.00 (162,185,872)	
オーストラリア・ ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 2024/11/21	370,000.00	369,933.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 2025/11/21	420,000.00	415,531.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.5 2026/09/21	450,000.00	445,941.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1 2030/12/21	520,000.00	501,430.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1 2031/11/21	450,000.00	428,404.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.25 2032/05/21	330,000.00	320,631.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.5 2031/06/21	440,000.00	442,917.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2051/06/21	240,000.00	207,124.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	420,000.00	435,712.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	480,000.00	522,465.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	580,000.00	640,482.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	630,000.00	682,126.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	440,000.00	493,605.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	490,000.00	551,093.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	530,000.00	596,700.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	140,000.00	157,372.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	190,000.00	208,623.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	220,000.00	249,924.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	520,000.00	582,223.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	510,000.00	594,068.40	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	150,000.00	177,577.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	200,000.00	251,898.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	530,000.00	629,708.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	230,000.00	305,108.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	500,000.00	620,310.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	540,000.00	602,505.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	410,000.00	442,402.30	
オーストラリア・ドル 小計		10,930,000.00	11,875,822.40 (987,949,665)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	60,000.00	77,563.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2022/08/01	280,000.00	280,187.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2022/11/01	460,000.00	460,262.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2023/02/01	360,000.00	360,147.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2024/04/01	120,000.00	119,580.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2026/03/01	250,000.00	244,062.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	230,000.00	230,745.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2025/09/01	550,000.00	546,601.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2030/12/01	310,000.00	290,522.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	340,000.00	344,086.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	180,000.00	182,170.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2025/03/01	120,000.00	123,379.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2030/06/01	620,000.00	627,241.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/02/01	110,000.00	111,367.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/05/01	170,000.00	172,641.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	200,000.00	205,594.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2024/09/01	200,000.00	207,348.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	180,000.00	187,005.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	320,000.00	329,753.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	390,000.00	406,695.90	
CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	160,000.00	172,475.20		
CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	430,000.00	452,338.50		

	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	150,000.00	158,548.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	190,000.00	203,265.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	170,000.00	186,806.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	160,000.00	170,916.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	190,000.00	196,176.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	200,000.00	243,268.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	220,000.00	298,014.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	150,000.00	210,897.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	110,000.00	165,348.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	140,000.00	192,444.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	150,000.00	224,382.00	
	カナダ・ドル 小計	7,870,000.00	8,381,839.00 (701,727,561)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.75 2022/04/01	70,000.00	71,160.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 1.875 2050/03/01	60,000.00	63,103.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	90,000.00	96,503.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	90,000.00	99,109.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	140,000.00	150,736.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2039/07/01	50,000.00	56,291.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	90,000.00	100,284.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	220,000.00	232,355.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	80,000.00	95,694.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	110,000.00	134,363.90	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	110,000.00	125,624.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	100,000.00	115,219.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	170,000.00	184,936.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	140,000.00	146,022.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	100,000.00	122,221.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	110,000.00	127,073.10	
	シンガポール・ドル 小計	1,730,000.00	1,920,699.50 (153,175,785)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.125 2031/05/12	580,000.00	568,295.60	

	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	860,000.00	901,108.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	900,000.00	942,102.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	1,180,000.00	1,251,260.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	1,470,000.00	1,542,456.30	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	1,160,000.00	1,293,411.60	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,740,000.00	1,825,155.60	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	700,000.00	1,043,644.00	
スウェーデン・クローナ 小計		8,590,000.00	9,367,433.30 (119,528,449)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2022/11/15	1,130,000.00	1,145,526.20	
	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2052/11/15	420,000.00	407,752.80	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	1,240,000.00	1,310,779.20	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2029/11/15	1,830,000.00	1,943,569.80	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	920,000.00	972,200.80	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	1,070,000.00	1,183,505.60	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,990,000.00	3,596,347.90	
デンマーク・クローネ 小計		8,600,000.00	10,559,682.30 (181,626,536)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.375 2030/08/19	780,000.00	785,795.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	710,000.00	732,791.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	830,000.00	863,988.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	640,000.00	668,294.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2029/09/06	630,000.00	656,825.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	1,280,000.00	1,324,416.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	560,000.00	594,456.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	880,000.00	945,128.80	
ノルウェー・クローネ 小計		6,310,000.00	6,571,696.30 (82,080,487)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0 2022/07/25	480,000.00	479,860.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25 2030/10/25	310,000.00	307,678.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.25 2022/04/25	640,000.00	656,934.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2023/01/25	460,000.00	481,224.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	1,060,000.00	1,132,800.80	

	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	700,000.00	766,458.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	540,000.00	594,761.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	550,000.00	616,330.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2029/10/25	750,000.00	846,037.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	1,000,000.00	1,118,510.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	420,000.00	462,701.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	512,685.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	130,000.00	177,729.50	
	ポーランド・ズロチ 小計	7,510,000.00	8,153,711.70 (232,625,395)	
マレーシア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	520,000.00	531,694.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	640,000.00	660,108.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	200,000.00	213,342.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.757 2040/05/22	200,000.00	195,614.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.828 2034/07/05	320,000.00	322,928.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	410,000.00	418,130.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.885 2029/08/15	290,000.00	309,754.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	610,000.00	654,591.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	300,000.00	322,017.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	450,000.00	482,850.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.065 2050/06/15	140,000.00	136,822.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	490,000.00	523,462.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	320,000.00	349,776.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	110,000.00	117,585.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	200,000.00	219,050.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	220,000.00	245,421.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	160,000.00	176,369.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	180,000.00	202,354.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	160,000.00	182,590.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.921 2048/07/06	170,000.00	191,897.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	130,000.00	148,596.50	



マレーシア・リンギット 小計		6,220,000.00	6,604,955.80 (172,521,445)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	6,840,000.00	8,126,946.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	1,100,000.00	1,474,121.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	4,470,000.00	4,635,121.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	4,550,000.00	4,687,410.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.75 2023/03/09	1,900,000.00	1,997,622.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	5,040,000.00	5,651,200.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	2,550,000.00	2,888,997.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	1,520,000.00	1,719,272.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	3,170,000.00	3,461,069.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	6,440,000.00	7,071,313.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2024/09/05	700,000.00	779,422.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	2,780,000.00	3,098,171.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	4,640,000.00	5,509,257.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	3,160,000.00	3,732,339.20	
	メキシコ・ペソ 小計		48,860,000.00	54,832,263.00 (282,386,154)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0 2027/10/22	130,000.00	133,082.30	
	BELGIUM KINGDOM 0 2031/10/22	110,000.00	110,046.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.1 2030/06/22	210,000.00	214,338.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	160,000.00	163,582.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.4 2040/06/22	80,000.00	79,191.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	220,000.00	228,828.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	310,000.00	328,228.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	220,000.00	236,610.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	240,000.00	259,533.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	260,000.00	284,185.20	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	240,000.00	259,017.60	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	230,000.00	254,955.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	140,000.00	160,024.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	90,000.00	106,193.70	

BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	170,000.00	208,078.30	
BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22	120,000.00	151,172.40	
BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	140,000.00	176,367.80	
BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	110,000.00	161,003.70	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	200,000.00	213,630.00	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	100,000.00	145,141.00	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	230,000.00	254,807.80	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	130,000.00	179,080.20	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	150,000.00	256,839.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	210,000.00	220,752.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	130,000.00	187,994.30	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	260,000.00	280,560.80	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	280,000.00	482,826.40	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	180,000.00	226,353.60	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	310,000.00	519,392.60	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	310,000.00	440,159.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2023/04/30	360,000.00	363,726.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2025/01/31	350,000.00	354,389.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2026/01/31	100,000.00	101,136.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.1 2031/04/30	170,000.00	165,828.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2024/07/30	250,000.00	255,485.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	330,000.00	336,570.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	340,000.00	343,767.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	300,000.00	304,872.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5 2030/04/30	350,000.00	358,697.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.6 2029/10/31	340,000.00	352,719.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.8 2027/07/30	320,000.00	337,731.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1 2050/10/31	240,000.00	228,252.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.2 2040/10/31	230,000.00	241,539.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.25 2030/10/31	400,000.00	436,836.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	410,000.00	444,444.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	360,000.00	395,874.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	320,000.00	352,566.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	350,000.00	384,807.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	340,000.00	376,907.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	320,000.00	352,051.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	340,000.00	367,431.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.85 2035/07/30	330,000.00	384,681.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	340,000.00	378,481.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	370,000.00	428,889.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	370,000.00	412,328.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	310,000.00	378,919.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	230,000.00	315,224.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	390,000.00	435,037.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	280,000.00	393,694.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	240,000.00	392,241.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	370,000.00	420,146.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	340,000.00	520,448.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	340,000.00	384,869.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	380,000.00	463,957.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	340,000.00	580,271.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	290,000.00	335,106.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	300,000.00	517,905.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	300,000.00	416,907.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	230,000.00	430,088.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	350,000.00	390,131.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	360,000.00	575,143.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	350,000.00	370,986.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	370,000.00	493,017.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	410,000.00	601,785.70	

BUNDESobligation 0 2022/04/08	340,000.00	342,553.40	
BUNDESobligation 0 2022/10/07	300,000.00	303,351.00	
BUNDESobligation 0 2023/04/14	310,000.00	314,705.80	
BUNDESobligation 0 2023/10/13	290,000.00	295,507.10	
BUNDESobligation 0 2024/10/18	360,000.00	369,100.80	
BUNDESobligation 0 2025/04/11	320,000.00	328,908.80	
BUNDESobligation 0 2025/10/10	390,000.00	401,817.00	
BUNDESobligation 0 2025/10/10	80,000.00	82,561.60	
BUNDESobligation 0 2026/04/10	80,000.00	82,584.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	470,000.00	486,069.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2027/11/15	350,000.00	362,687.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2029/08/15	430,000.00	445,647.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/02/15	400,000.00	414,140.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/08/15	500,000.00	516,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/08/15	100,000.00	103,812.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2031/02/15	80,000.00	82,569.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2035/05/15	360,000.00	365,464.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2050/08/15	300,000.00	282,870.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	490,000.00	515,024.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	420,000.00	443,826.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	420,000.00	444,217.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	430,000.00	450,523.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	490,000.00	518,199.50	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	460,000.00	492,223.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	400,000.00	429,248.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	370,000.00	392,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	440,000.00	473,198.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	410,000.00	529,346.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	330,000.00	341,160.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	320,000.00	334,124.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	380,000.00	398,859.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	700,000.00	750,372.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	430,000.00	444,276.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	590,000.00	633,842.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	360,000.00	384,429.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	460,000.00	720,465.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	490,000.00	784,396.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	310,000.00	524,334.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	430,000.00	713,735.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	310,000.00	556,487.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	390,000.00	653,542.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	320,000.00	617,872.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	180,000.00	289,319.40	

BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/03/11	220,000.00	221,529.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/06/10	250,000.00	252,175.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/09/16	250,000.00	252,637.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/12/15	230,000.00	232,881.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0 2024/01/15	250,000.00	251,590.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2023/01/15	160,000.00	161,201.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2025/02/01	270,000.00	274,941.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.5 2026/02/01	200,000.00	204,598.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	770,000.00	788,980.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.9 2022/08/01	290,000.00	295,292.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.9 2031/04/01	190,000.00	195,318.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	520,000.00	533,748.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2030/08/01	270,000.00	280,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2037/03/01	160,000.00	157,609.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1 2022/07/15	220,000.00	224,254.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	610,000.00	649,515.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	890,000.00	907,497.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2030/04/01	370,000.00	397,864.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	270,000.00	277,668.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2036/03/01	240,000.00	255,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	860,000.00	917,456.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	590,000.00	637,736.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2030/12/01	370,000.00	407,551.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	380,000.00	418,463.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.7 2051/09/01	180,000.00	186,872.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.8 2041/03/01	160,000.00	174,712.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	520,000.00	554,314.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	580,000.00	635,622.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	420,000.00	469,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	600,000.00	670,074.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	270,000.00	303,768.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	260,000.00	306,425.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	300,000.00	357,804.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2050/09/01	260,000.00	317,187.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	590,000.00	648,427.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	270,000.00	343,742.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	340,000.00	403,117.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	150,000.00	194,664.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	250,000.00	322,337.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3 2029/08/01	320,000.00	387,750.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.1 2040/03/01	220,000.00	289,894.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	270,000.00	375,324.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	240,000.00	315,986.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	260,000.00	375,325.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	400,000.00	505,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	310,000.00	352,597.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.85 2049/09/01	210,000.00	324,832.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	440,000.00	629,314.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	480,000.00	530,812.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	370,000.00	422,750.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	380,000.00	465,131.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	370,000.00	416,046.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	380,000.00	503,625.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	290,000.00	487,139.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	440,000.00	530,332.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	400,000.00	608,604.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	360,000.00	589,676.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	340,000.00	561,955.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	460,000.00	647,956.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	300,000.00	326,706.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	420,000.00	461,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	330,000.00	517,651.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	480,000.00	734,630.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	430,000.00	607,418.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	180,000.00	225,054.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	220,000.00	307,285.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	340,000.00	541,419.40	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	270,000.00	387,180.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	220,000.00	321,294.60	
FINNISH GOVERNMENT 0 2022/04/15	80,000.00	80,593.60	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	90,000.00	91,548.90	
FINNISH GOVERNMENT 0 2030/09/15	90,000.00	91,304.10	
FINNISH GOVERNMENT 0.125 2036/04/15	60,000.00	59,787.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.25 2040/09/15	50,000.00	49,752.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	120,000.00	126,339.60	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	110,000.00	116,682.50	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2029/09/15	100,000.00	106,331.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	60,000.00	65,401.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	80,000.00	85,305.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	80,000.00	91,213.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	60,000.00	75,409.20	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	70,000.00	73,288.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	90,000.00	93,252.60	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	140,000.00	151,785.20	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	70,000.00	104,225.80	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	140,000.00	172,445.00	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	90,000.00	108,305.10	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	440,000.00	442,807.20	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	500,000.00	504,020.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/02/25	140,000.00	141,800.40	



FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	770,000.00	780,225.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	700,000.00	712,922.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2025/03/25	710,000.00	725,641.30	
FRANCE (GOVT OF) 0 2026/02/25	500,000.00	511,885.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2029/11/25	650,000.00	658,911.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2030/11/25	520,000.00	523,556.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	580,000.00	602,631.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	640,000.00	668,569.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	660,000.00	693,877.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2029/05/25	580,000.00	614,028.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2040/05/25	220,000.00	222,538.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2072/05/25	110,000.00	91,755.40	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	720,000.00	775,267.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	690,000.00	744,309.90	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2052/05/25	370,000.00	371,998.00	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	570,000.00	611,279.40	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	590,000.00	641,743.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	580,000.00	663,926.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	610,000.00	701,487.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	800,000.00	927,296.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2050/05/25	500,000.00	608,890.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	940,000.00	990,825.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	630,000.00	685,471.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	440,000.00	549,243.20	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	210,000.00	280,822.50	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	450,000.00	604,183.50	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	580,000.00	608,193.80	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	550,000.00	601,403.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	800,000.00	996,384.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	790,000.00	956,413.50	

FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	720,000.00	750,808.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	410,000.00	663,252.90	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	700,000.00	846,265.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	420,000.00	687,099.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	290,000.00	575,676.10	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	270,000.00	561,435.30	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	710,000.00	803,712.90	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	610,000.00	1,093,357.90	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	460,000.00	757,413.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	630,000.00	930,062.70	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	540,000.00	903,079.80	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	490,000.00	641,909.80	
IRISH TSY 0% 2031 0 2031/10/18	80,000.00	79,695.20	
IRISH TSY 0.2% 2030 0.2 2030/10/18	130,000.00	133,062.80	
IRISH TSY 0.20% 2027 0.2 2027/05/15	120,000.00	124,143.60	
IRISH TSY 0.4% 2035 0.4 2035/05/15	80,000.00	82,049.60	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	110,000.00	111,582.90	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	180,000.00	193,521.60	
IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	150,000.00	165,780.00	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	70,000.00	80,222.10	
IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	110,000.00	125,466.00	
IRISH TSY 1.5% 2050 1.5 2050/05/15	100,000.00	121,834.00	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	90,000.00	109,912.50	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	140,000.00	186,540.20	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	140,000.00	172,526.20	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	80,000.00	80,786.40	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	150,000.00	162,763.50	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	120,000.00	134,661.60	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	110,000.00	120,300.40	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	200,000.00	281,040.00	

NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	240,000.00	244,706.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2027/01/15	220,000.00	226,360.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2030/07/15	220,000.00	225,178.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2052/01/15	130,000.00	118,987.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	250,000.00	259,410.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2029/07/15	210,000.00	220,136.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	260,000.00	274,729.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2040/01/15	150,000.00	161,259.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	250,000.00	269,727.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	230,000.00	249,773.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	290,000.00	307,011.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	240,000.00	261,828.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	250,000.00	260,192.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	210,000.00	276,662.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	260,000.00	427,993.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	210,000.00	227,791.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	260,000.00	455,358.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	250,000.00	409,727.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	200,000.00	283,416.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	110,000.00	111,118.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2023/07/15	240,000.00	243,580.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2030/02/20	170,000.00	172,691.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2040/10/20	60,000.00	56,584.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	170,000.00	180,099.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2029/02/20	180,000.00	191,219.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	220,000.00	235,428.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	160,000.00	172,651.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2051/03/20	70,000.00	75,274.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.85 2120/06/30	40,000.00	40,305.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	180,000.00	194,842.80	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	120,000.00	152,283.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	40,000.00	56,262.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	300,000.00	324,990.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	190,000.00	202,046.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	100,000.00	180,004.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	140,000.00	183,661.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	110,000.00	180,236.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	180,000.00	192,778.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	130,000.00	136,467.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	60,000.00	130,789.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	220,000.00	360,580.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	150,000.00	191,527.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	150,000.00	214,986.00	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	180,000.00	223,552.80	
	ユーロ 小計	96,210,000.00	114,251,637.20 (14,613,926,914)	
国債証券 合計			35,164,234,294 (35,164,234,294)	
合計			35,164,234,294 (35,164,234,294)	

(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 130銘柄	42.55%	42.94%
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	6.70%	6.76%
イスラエル・シケル	国債証券 11銘柄	0.46%	0.46%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	2.78%	2.81%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	1.98%	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	0.34%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.51%	0.52%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.23%	0.23%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.66%	0.66%
マレーシア・リンギット	国債証券 21銘柄	0.49%	0.49%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.80%	0.80%
ユーロ	国債証券 311銘柄	41.18%	41.56%

(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（2021年2月23日から2021年8月22日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2021年2月22日現在	第5期中間計算期間 2021年8月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,639,420	27,615,548
コール・ローン	288,331,485	366,666,404
親投資信託受益証券	5,655,922,357	7,339,710,821
未収入金	15,200,734	10,900,711
流動資産合計	5,965,093,996	7,744,893,484
資産合計	5,965,093,996	7,744,893,484
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	15,947,898	11,862,613
未払受託者報酬	594,057	755,346
未払委託者報酬	3,564,606	4,532,354
未払利息	-	1,740
その他未払費用	220,779	260,663
流動負債合計	20,327,340	17,412,716
負債合計	20,327,340	17,412,716
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,572,198,152	7,089,684,346
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	372,568,504	637,796,422
（分配準備積立金）	142,604,222	133,617,721
元本等合計	5,944,766,656	7,727,480,768
純資産合計	5,944,766,656	7,727,480,768
負債純資産合計	5,965,093,996	7,744,893,484



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 2020年2月22日 至 2020年8月21日	第5期中間計算期間 自 2021年2月23日 至 2021年8月22日
<b>営業収益</b>		
受取利息	3,802	1,976
有価証券売買等損益	3,668,035	146,067,669
営業収益合計	3,671,837	146,069,645
<b>営業費用</b>		
支払利息	55,387	81,715
受託者報酬	418,519	755,346
委託者報酬	2,511,347	4,532,354
その他費用	164,380	264,431
営業費用合計	3,149,633	5,633,846
営業利益又は営業損失( )	522,204	140,435,799
経常利益又は経常損失( )	522,204	140,435,799
中間純利益又は中間純損失( )	522,204	140,435,799
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( )	3,435,649	5,951,650
期首剰余金又は期首欠損金( )	177,428,909	372,568,504
剰余金増加額又は欠損金減少額	68,169,469	159,093,088
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	68,169,469	159,093,088
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,015,549	28,349,319
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,015,549	28,349,319
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( )	237,540,682	637,796,422

## ( 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5期中間計算期間	
	自	至
	2021年2月23日	2021年8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月21日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2021年2月23日から2021年8月22日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間
	2021年2月22日現在	2021年8月22日現在
1. 期首元本額	3,009,683,143円	5,572,198,152円
期中追加設定元本額	3,158,136,127円	1,931,338,631円
期中一部解約元本額	595,621,118円	413,852,437円
2. 受益権の総数	5,572,198,152口	7,089,684,346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4期 2021年2月22日現在	第5期中間計算期間 2021年8月22日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年2月22日現在	第5期中間計算期間 2021年8月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0669円 (10,669円)	1.0900円 (10,900円)

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

## ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2021年8月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	242,546,071
コール・ローン	3,393,663,255
株式	144,393,664,040
未収配当金	172,652,166
前払金	85,350,000
差入委託証拠金	142,740,000
流動資産合計	148,430,615,532
資産合計	148,430,615,532
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	111,070,650
未払解約金	206,885,260
未払利息	16,116
その他未払費用	9,665
流動負債合計	317,981,691
負債合計	317,981,691
純資産の部	
元本等	
元本	70,754,643,517
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,357,990,324
元本等合計	148,112,633,841
純資産合計	148,112,633,841
負債純資産合計	148,430,615,532

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月23日 至 2021年8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年8月22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	79,813,755,893円
同期中追加設定元本額	12,035,022,095円
同期中一部解約元本額	21,094,134,471円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,849,121,872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)	3,720,299,141円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,712,448円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,003,629,411円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,667,178,961円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	4,804,304,662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)	5,412,050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)	21,762,641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)	18,526,041円
DCニッセイ国内株式インデックス	647,929,385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	19,413,131,225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)	1,667,254,958円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	148,377,150円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	180,562,232円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	152,478,133円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	328,175,635円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	55,080,730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)	75,794,636円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,173,271円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	8,813,112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)	3,242,987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)	5,734,733円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	24,047,512円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	77,490,652円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	45,820,286円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	121,981,539円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	139,967,737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)	24,538,718,969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)	18,720,328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)	64,978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)	136,102円
計	70,754,643,517円
2. 受益権の総数	70,754,643,517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8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2021年8月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	3,554,115,000	-	3,443,145,000	110,970,000
合計	3,554,115,000	-	3,443,145,000	110,970,000

## （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8月22日現在
1口当たり純資産額	2.0933円
（1万口当たり純資産額）	（20,933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8月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	47,372,518
コール・ローン	662,828,189
国債証券	57,113,061,750
地方債証券	5,215,521,641
特殊債券	8,667,132,672
社債券	5,314,423,100
未収利息	205,786,504
前払費用	9,762,474
流動資産合計	77,235,888,848
資産合計	77,235,888,848
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,372,345
未払利息	3,146
その他未払費用	1,600
流動負債合計	20,377,091
負債合計	20,377,091
純資産の部	
元本等	
元本	78,155,575,132
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	940,063,375
元本等合計	77,215,511,757
純資産合計	77,215,511,757
負債純資産合計	77,235,888,848

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月23日 至 2021年8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>



## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年8月22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	82,138,960,938円
同期中追加設定元本額	6,759,638,387円
同期中一部解約元本額	10,743,024,193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)	67,206,891,286円
DCニッセイ日本債券インデックス	2,675,965,599円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	74,986,527円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	4,706,652,647円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	127,866,855円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	577,603,578円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,451,397,329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)	163,634,795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)	17,523,738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)	58,125,659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)	51,983,702円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	25,892,042円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	30,815,056円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	127,518,020円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	858,718,299円
計	78,155,575,132円
2. 受益権の総数	78,155,575,132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940,063,375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8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2021年8月22日現在
1口当たり純資産額	0.9880円
（1万口当たり純資産額）	（9,880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8月22日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,737,996,576
金銭信託	298,438,044
コール・ローン	4,175,694,212
株式	423,521,916,592
投資証券	9,855,851,509
派生商品評価勘定	155,022,952
未収入金	1,967,932
未収配当金	561,308,578
差入委託証拠金	7,767,082,343
流動資産合計	448,075,278,738
<b>資産合計</b>	
448,075,278,738	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	96,406,412
未払金	902,879
未払解約金	561,208,991
未払利息	19,830
その他未払費用	19,975
流動負債合計	658,558,087
<b>負債合計</b>	
658,558,087	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	165,892,560,420
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	281,524,160,231
元本等合計	447,416,720,651
<b>純資産合計</b>	
447,416,720,651	
<b>負債純資産合計</b>	
448,075,278,738	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月23日 至 2021年8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年8月22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	149,298,469,961円
同期中追加設定元本額	27,686,405,846円
同期中一部解約元本額	11,092,315,387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）	794,868,667円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,527,696,944円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,860,099,434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）	1,774,836,302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）	2,147,258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）	11,512,299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）	11,130,012円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	10,947,426,367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	116,937,309,399円
DCニッセイ外国株式インデックス	24,783,984,924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)	1,322,765,484円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	168,057,445円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	143,264,571円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	172,066,990円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	365,840,600円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	35,347,694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)	60,131,866円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,689,732円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	6,989,424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)	2,571,407円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	19,069,021円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	88,310,024円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	51,931,611円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	137,105,507円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	142,429,804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)	241,050,492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)	249,154,945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)	131,110,708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)	242,988,935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)	237,381,062円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適 格機関投資家限定)	217,486,891円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適 格機関投資家限定)	200,804,601円
計	165,892,560,420円
2. 受益権の総数	165,892,560,420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8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2021年8月22日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建					
アメリカ・ドル	7,159,499,805	-	7,111,326,050		48,173,755
イギリス・ポンド	5,291,527,119	-	5,265,441,217		26,085,902
ユーロ	537,102,006	-	527,831,221		9,270,785
買建	1,330,870,680	-	1,318,053,612		12,817,068
アメリカ・ドル	10,600,153,962	-	10,542,512,805		57,641,157
イギリス・ポンド	7,394,074,547	-	7,373,265,556		20,808,991
ユーロ	1,006,211,797	-	987,473,003		18,738,794
合計	2,199,867,618	-	2,181,774,246		18,093,372
合計	17,759,653,767	-	17,653,838,855		9,467,402

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## 株式関連

種類	2021年8月22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	13,334,731,982	-	13,402,815,924	68,083,942
合計	13,334,731,982	-	13,402,815,924	68,083,942

## (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8月22日現在
1口当たり純資産額	2.6970円
(1万口当たり純資産額)	(26,970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8月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	87,016,258
金銭信託	8,031,735
コール・ローン	112,378,668
国債証券	42,070,746,918
未収入金	4,461,446
未収利息	195,205,972
前払費用	14,360,754
流動資産合計	42,492,201,751
資産合計	
42,492,201,751	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	168,105
未払金	9,389,143
未払解約金	63,192,816
未払利息	532
その他未払費用	447
流動負債合計	72,751,043
負債合計	
72,751,043	
純資産の部	
元本等	
元本	28,163,335,343
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,256,115,365
元本等合計	42,419,450,708
純資産合計	
42,419,450,708	
負債純資産合計	
42,492,201,751	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月23日 至 2021年8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。



## （貸借対照表に関する注記）

項目	2021年8月22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	24,370,479,823円
同期中追加設定元本額	5,756,893,639円
同期中一部解約元本額	1,964,038,119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）	2,837,632,377円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	4,722,383,902円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,701,611,730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）	785,509,682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）	3,832,486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）	10,273,276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）	7,094,019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	11,900,765,712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）	2,361,357,796円
DCニッセイ外国債券インデックス	1,623,026,397円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	101,771,148円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,278,654,187円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	106,193,186円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	233,270,108円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	59,656,100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（6資産均等型）	107,355,179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）	11,482,171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）	34,059,819円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	53,362,839円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	31,613,832円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	84,915,623円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	107,513,774円
計	28,163,335,343円
2. 受益権の総数	28,163,335,343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8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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8月22日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建	4,462,787	-	4,463,043	256	
アメリカ・ドル	4,462,787	-	4,463,043	256	
買建	36,589,409	-	36,421,560	167,849	
アメリカ・ドル	33,810,077	-	33,649,168	160,909	
マレーシア・リングgit	2,779,332	-	2,772,392	6,940	
合計	41,052,196	-	40,884,603	168,105	

## (注) 為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年8月22日現在
1口当たり純資産額	1.5062円
(1万口当たり純資産額)	(15,062円)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2021年8月31日現在

資産総額	7,793,846,863円
負債総額	3,680,657円
純資産総額（ - ）	7,790,166,206円
発行済数量	7,120,875,870口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0940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8月31日現在

資産総額	154,871,887,477円
負債総額	271,558,970円
純資産総額（ - ）	154,600,328,507円
発行済数量	70,828,947,661口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1827円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	78,802,440,111円
負債総額	1,572,793,773円
純資産総額（ - ）	77,229,646,338円
発行済数量	78,239,282,445口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9871円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	461,879,220,184円
負債総額	616,547,955円
純資産総額（ - ）	461,262,672,229円
発行済数量	166,401,530,413口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7720円

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	43,019,405,633円
負債総額	245,469,312円
純資産総額（ - ）	42,773,936,321円
発行済数量	28,318,183,293口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5105円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

ありません。

### (3) 譲渡制限

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

### (4) 受益権の譲渡

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

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

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

### (5) 受益権の再分割

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

### (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額

2021年8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。

最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

##### （2）委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年8月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	404	69,820
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	138	26,566
単位型公社債投資信託	0	0
合計	542	96,387

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 2.監査証明について

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
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
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
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
<b>無形固定資産</b>				
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
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		33,634,499		37,058,043
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		237,055
差入保証金		303,875		382,751
繰延税金資産		1,292,446		1,200,554
その他		17,821		15,154
投資その他の資産合計		35,314,867		38,959,781
固定資産合計		36,751,960		40,810,238
資産合計		79,421,875		90,445,083



## 負債の部

## 流動負債

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

## 固定負債

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

## 負債合計

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

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		10,000,000		10,000,000
資本剰余金				
資本準備金		8,281,840		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840		8,281,840

## 利益剰余金

利益準備金		139,807		139,807
その他利益剰余金				
配当準備積立金		120,000		120,000
研究開発積立金		70,000		70,000
別途積立金		350,000		350,000
繰越利益剰余金		48,745,315		55,045,550
利益剰余金合計		49,425,122		55,725,357
株主資本合計		67,706,962		74,007,197

## 評価・換算差額等

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

## 純資産合計

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

## 負債・純資産合計

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余 金合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,500,048	5,500,048	5,500,048
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	9,052,942	9,052,942	9,052,942
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,552,893	3,552,893	3,552,893
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	711,399	43,878	667,521	64,821,590
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
当期純利益	-	-	-	9,052,942
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	199,216	20,071	219,287	219,287
当期変動額合計	199,216	20,071	219,287	3,333,606
当期末残高	512,183	63,949	448,234	68,155,196

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,500,048	5,500,048	5,500,048
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	11,800,283	11,800,283	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	6,300,235	6,300,235	6,300,235
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	512,183	63,949	448,234	68,155,196
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,500,048
当期純利益	-	-	-	11,800,283
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	730,471	33,255	697,216	697,216
当期変動額合計	730,471	33,255	697,216	6,997,451
当期末残高	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647

## 注記事項

## （重要な会計方針）

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

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

## (未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2021年3月26日）

## (1) 概要

本会計基準により、顧客と約束する財又はサービスを提供する履行義務の実質的な実施主体についての評価を行ったうえで、約束した財又はサービスが顧客に移転された時点で、当該財又はサービスと交換に権利を得ると見込む対価を反映した金額で、収益を認識することが求められます。

## (2) 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

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

#### (1) 概要

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

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

#### (2) 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。



## (貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

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

## (損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

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

2. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	50,716円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月29日

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

2021年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	9,440,289千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	87,049円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の状況に関する事項

当社は、自己勘定の資金運用にあたっては、資金運用規則に沿って、慎重な資金管理、資本金の保全、投機の回避に十分に留意しております。また、資金の管理にあたっては、投資信託委託会社としての業務により当社が受け入れる投資信託財産に属する金銭等との混同を来たさないよう、分離して行っております。

投資有価証券は主として利付国債・地方債と自社設定投資信託であります。これらは金利の変動リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。自己資金運用に係るリスク管理等については、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程に従い、適切なリスク管理を図っております。

上記の自社設定投資信託の一部につきましてはデリバティブを用いてヘッジを行っております。デリバティブを用いたヘッジ取引につきましては、外貨建て資産の為替変動リスクを回避する目的で為替予約、外国株式の価格変動リスクを回避する目的で株価指数先物を使ってヘッジ会計を適用しております。ヘッジ会計の適用にあたっては、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前の有効性の確認、事後の有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運用しております。ヘッジの有効性判定については資金運用リスク管理規程に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	28,674,230	28,674,230	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	-
資産計	68,610,058	68,615,802	5,744
その他未払金	3,591,122	3,591,122	-
負債計	3,591,122	3,591,122	-
デリバティブ取引（ ） ヘッジ会計が適用され ているもの	10,218	10,218	-
デリバティブ取引計	10,218	10,218	-

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

#### 資 産

##### 現金・預金

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

##### 有価証券

決算日の市場価格等によっております。

##### 投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

#### 負 債

##### 其他未払金

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

#### デリバティブ取引

##### デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
関係会社株式	66,222	66,222

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額  
前事業年度(2020年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

## 当事業年度(2021年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	40,822,894	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	-	15,020,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	2,802,653	17,140,145	2,093,118	-
合計	43,625,547	32,160,145	2,093,118	-

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2020年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	11,798,934	11,806,740	7,805
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	11,798,934	11,806,740	7,805
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	6,049,621	6,047,560	2,061
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,049,621	6,047,560	2,061
合計		17,848,556	17,854,300	5,743

当事業年度(2021年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	12,218,123	12,224,015	5,891
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,218,123	12,224,015	5,891
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	2,800,000	2,799,660	340
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,800,000	2,799,660	340
合計		15,018,123	15,023,675	5,551

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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



## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	3,737,763	3,376	49,202
合計	3,737,763	3,376	49,202

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度(2020年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2021年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,239,952	-	65,238
合計			1,239,952	-	65,238

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

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

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	- 千円	1,833,391 千円
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	1,887,492	-
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	54,100	-
勤務費用	-	247,178
利息費用	-	5,766
数理計算上の差異の発生額	-	28,155
退職給付の支払額	-	65,497
その他	-	936
退職給付債務の期末残高	1,833,391	2,049,929

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

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

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

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

## (4) 退職給付費用

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

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において62,535千円、当事業年度において64,693千円であり、退職給付費用に計上しております。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳  
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

## 1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等  
前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,360,908	未収運用受託報酬	802,463
								投資助言報酬の受取	130,557	未収投資助言報酬	11,984
								連結納税	3,123,434	その他未払金	3,123,434

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,562,864	未収運用受託報酬	988,094
								投資助言報酬の受取	128,262	未収投資助言報酬	11,387
								連結納税	4,351,846	その他未払金	4,351,846

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

## 2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	628,459円68銭	692,983円25銭
1株当たり当期純利益金額	83,477円26銭	108,810円52銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,052,942千円	11,800,283千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,052,942千円	11,800,283千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### 定款の変更等

2021年6月30日に開催された定時株主総会において、定款の「任期」の条項に関し以下の変更が決議されました。

##### <変更前>

取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。

##### <変更後>

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。

##### 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	
楽天証券株式会社	7,495	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
日本生命保険相互会社	1,400,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

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】

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

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

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

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
  - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
  - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
- コールセンター 0120-762-506  
(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)  
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- 投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

# 独立監査人の監査報告書

2021年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

2021年3月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政印  
業務執行社員

## 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DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2020年2月22日から2021年2月22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、DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2021年2月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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



# 独立監査人の中間監査報告書

2021年10月1日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政 印  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2021年2月23日から2021年8月22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、DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2021年8月22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（2021年2月23日から2021年8月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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