

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年12月24日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 大関 洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	DCニッセイターゲットデートファンド2025 DCニッセイターゲットデートファンド2030 DCニッセイターゲットデートファンド2035 DCニッセイターゲットデートファンド2040 DCニッセイターゲットデートファンド2045 DCニッセイターゲットデートファンド2050 DCニッセイターゲットデートファンド2055 DCニッセイターゲットデートファンド2060 DCニッセイターゲットデートファンド2065
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	当初設定額 DCニッセイターゲットデートファンド2065 は、1百万円とします。 継続募集額 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCニッセイターゲットデートファンド2025  
 DCニッセイターゲットデートファンド2030  
 DCニッセイターゲットデートファンド2035  
 DCニッセイターゲットデートファンド2040  
 DCニッセイターゲットデートファンド2045  
 DCニッセイターゲットデートファンド2050  
 DCニッセイターゲットデートファンド2055  
 DCニッセイターゲットデートファンド2060  
 DCニッセイターゲットデートファンド2065

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」または「DCニッセイターゲットデートファンド」ということがあります。また、下記の略称で記載することがあります。

ファンド名称	略称
DCニッセイターゲットデートファンド2025	ターゲットデート2025
DCニッセイターゲットデートファンド2030	ターゲットデート2030
DCニッセイターゲットデートファンド2035	ターゲットデート2035
DCニッセイターゲットデートファンド2040	ターゲットデート2040
DCニッセイターゲットデートファンド2045	ターゲットデート2045
DCニッセイターゲットデートファンド2050	ターゲットデート2050
DCニッセイターゲットデートファンド2055	ターゲットデート2055
DCニッセイターゲットデートファンド2060	ターゲットデート2060
DCニッセイターゲットデートファンド2065	ターゲットデート2065

### （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】

当初設定日：「ターゲットデート2065」につき、1百万円とします。

継続申込期間：各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

## (4) 【発行(売出)価格】

当初設定日 : 「ターゲットデート2065」につき、受益権1口当り1円です。

継続申込期間: 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】

当初設定日 : 「ターゲットデート2065」は、2022年1月11日(火)に委託会社の資金により設定されます。当初申込期間は設けません。

継続申込期間: 2022年1月11日(火) ~ 2023年3月20日(月)

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

## (10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

## (11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

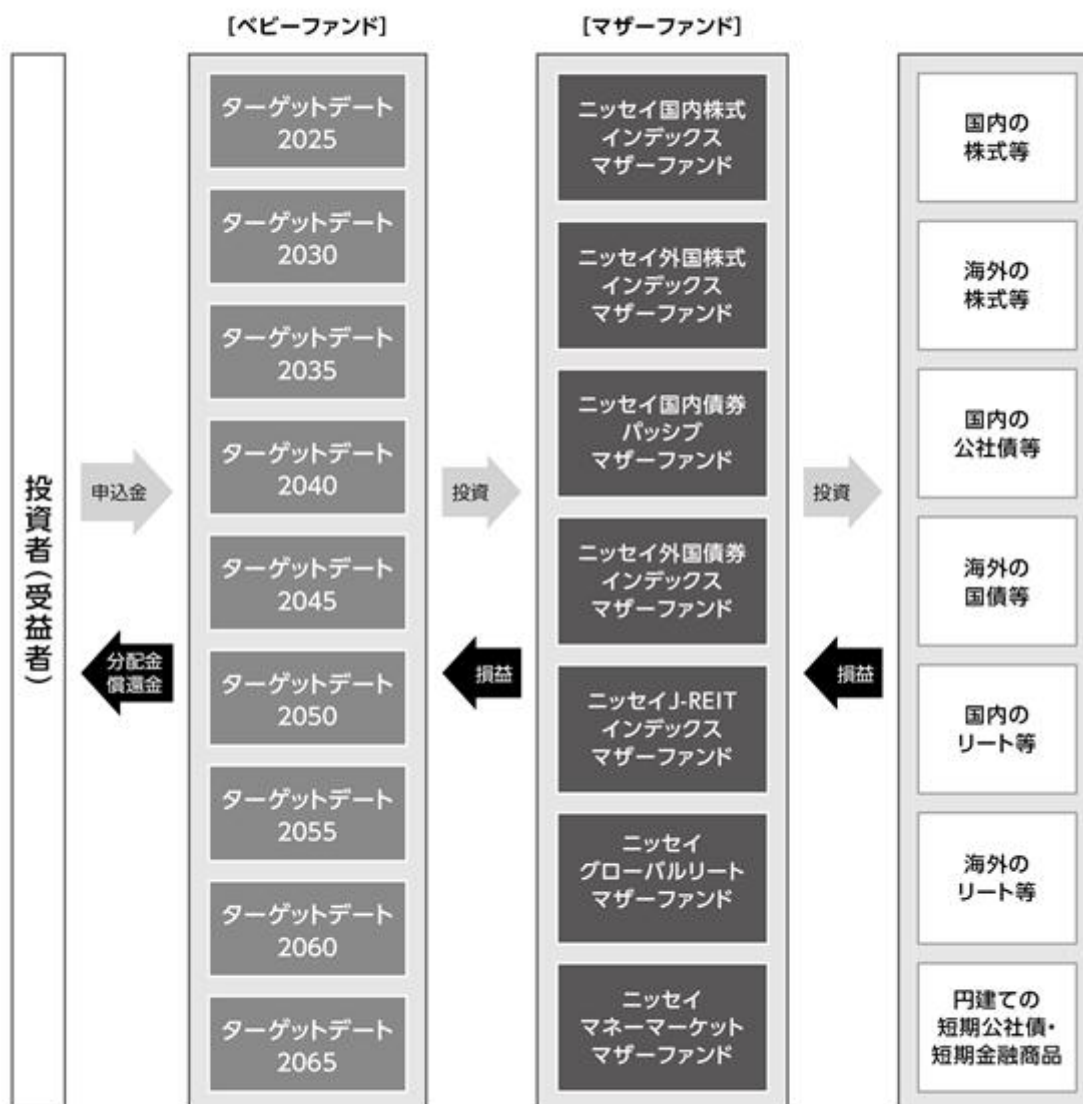
##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### 基本方針

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

###### 運用の形態

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



■ 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。将来の市場構造の変化等によっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

## ファンドの特色

## 1 日本を含む世界各国の株式(リートを含みます。以下同じ)、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資を行います。

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

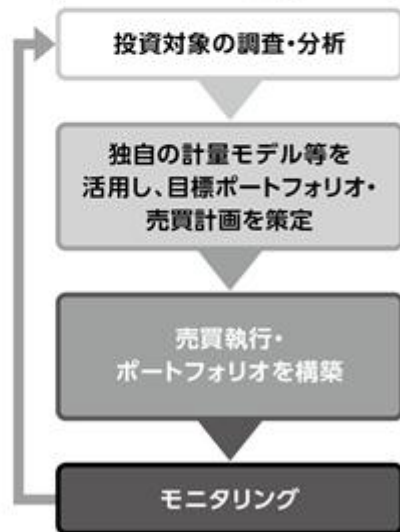
\* 為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

## 2 株式、公社債については、各インデックスの動きに連動する投資成果をめざします。

- マザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債に実質的な投資を行います。

資産	インデックス	投資対象とするマザーファンド
国内株式	TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	ニッセイ 国内株式インデックス マザーファンド
	東証REIT指数 (配当込み)	ニッセイ J-REITインデックス マザーファンド
外国株式	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 外国株式インデックス マザーファンド
	S&Pグローバルリートインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
国内債券	NOMURA-BPI総合	ニッセイ 国内債券パッシブ マザーファンド
外国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、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

### 〈マザーファンドの運用プロセス〉



・将来の市場構造の変化等によっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

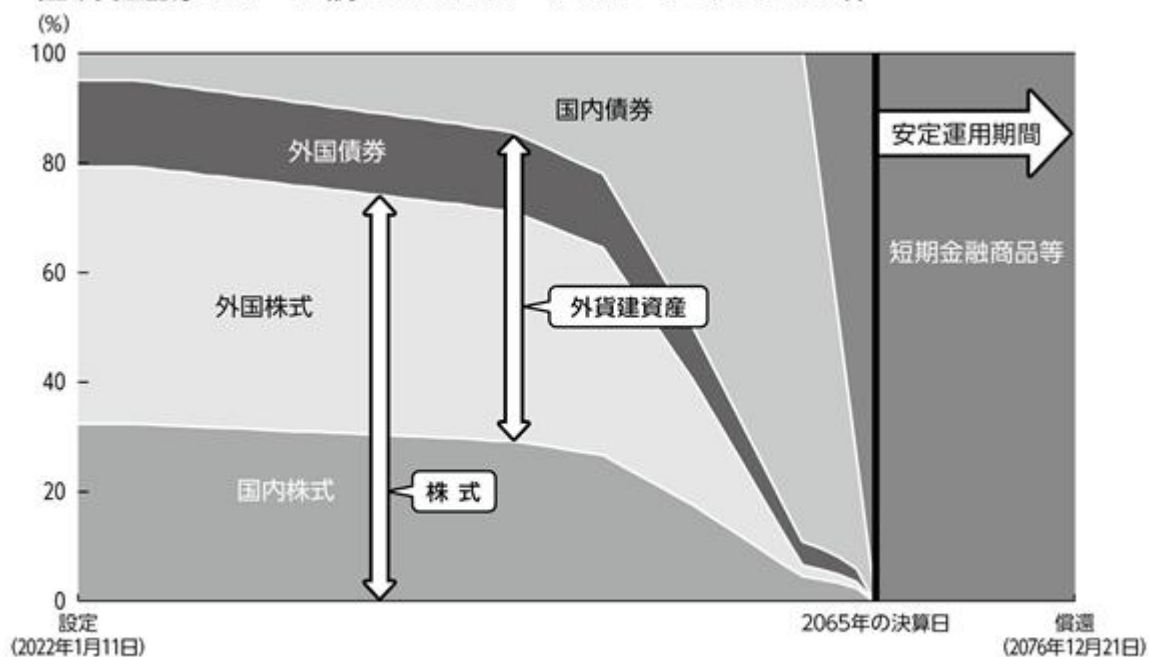
### ③安定運用開始時期(ターゲットデート)の異なる複数のファンドから選択いただけます。各ファンドは、安定運用開始時期に近づくにしたいが、リスクを低減させていく運用を行います。

- 当初設定時の基本資産配分を参考にポートフォリオを構築し、安定運用開始時期に近づくにしたいがって株式の組入れを漸減させ、国内債券や短期金融商品等の組入れを漸増させること等により、長期的にリスクを低減させていく運用を行います。
- 安定運用開始時期の到来以降は、原則として短期金融商品等に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。  
・市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

#### 〈各ファンドの安定運用開始時期(ターゲットデート)〉

DCニッセイターゲットデートファンド2025	2025年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2030	2030年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2035	2035年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2040	2040年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2045	2045年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2050年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2055	2055年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2060年12月の決算日の翌日
DCニッセイターゲットデートファンド2065	2065年12月の決算日の翌日

#### 〈基本資産配分のイメージ(例:DCニッセイターゲットデートファンド2065)〉



・上記は2021年11月末現在で計画している基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。将来の基本資産配分比率は、市況動向等により変更となる場合があります。

## 〈2021年11月末現在の基本資産配分〉

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
DCニッセイターゲットデートファンド2025	6.8%	5.5%	82.5%	5.2%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2030	17.7%	22.7%	50.0%	9.6%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2035	26.9%	37.8%	21.8%	13.5%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2040	29.5%	41.8%	14.2%	14.5%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2045	30.3%	43.1%	11.7%	14.9%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2050	31.0%	44.3%	9.6%	15.1%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2055	31.8%	45.4%	7.4%	15.4%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2060	32.5%	46.7%	5.0%	15.8%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2065	—	—	—	—	—

・DCニッセイターゲットデートファンド2065は、2022年1月11日設定のため、2021年11月末現在の基本資産配分は記載しておりません。

・実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。なお、2021年11月末現在においては、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、および円建ての短期金融商品等を主要投資対象とするニッセイマネーマーケットマザーファンドは組入れを行っていません。

## 〈当初設定時の基本資産配分〉

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
DCニッセイターゲットデートファンド2025	20.6%	14.7%	58.7%	6.0%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2030	29.1%	21.2%	41.8%	7.9%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2035	40.2%	29.8%	19.5%	10.5%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2040	41.4%	30.7%	17.1%	10.8%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2045	43.1%	31.9%	13.8%	11.2%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2050	43.8%	32.4%	12.5%	11.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2055	45.6%	33.8%	8.9%	11.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2060	45.7%	34.0%	8.5%	11.8%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2065	32.6%	46.9%	4.7%	15.8%	0.0%

・各ファンドの設定日は以下の通りです。

DCニッセイターゲットデートファンド2055：2016年7月29日

DCニッセイターゲットデートファンド2025／2035／2045：2017年7月31日

DCニッセイターゲットデートファンド2030／2040／2050／2060：2019年1月10日

DCニッセイターゲットデートファンド2065：2022年1月11日

## 〈各インデックスについて〉

### ●TOPIX(東証株価指数)

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

○ 東京証券取引所の第一部、第二部などの市場は、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。

### ●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

### ●NOMURA-BPI総合

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

### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

### ●東証REIT指数

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

### ●S&Pグローバルリートインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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



#### <MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

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

## ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
追 加 型	海 外	債 券
	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		グローバル (日本含む)		
債券 一般	年1回	日 本		
公債	年2回	北 米	ファミリー ファンド	あ り ( )
社債	年4回	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	ア ジ ア		
不動産投信		オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式・債券・不動 産投信・短期金 融資産)資産配 分変更型))	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
	日 々	アフリカ		
	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマー ジング		

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券・ 不動産投信・短期 金融資産)資産配 分変更型))	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、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、短期金融資産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】

「ターゲットデート2055」

2016年7月29日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

「ターゲットデート2025 / 2035 / 2045」

2017年7月31日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

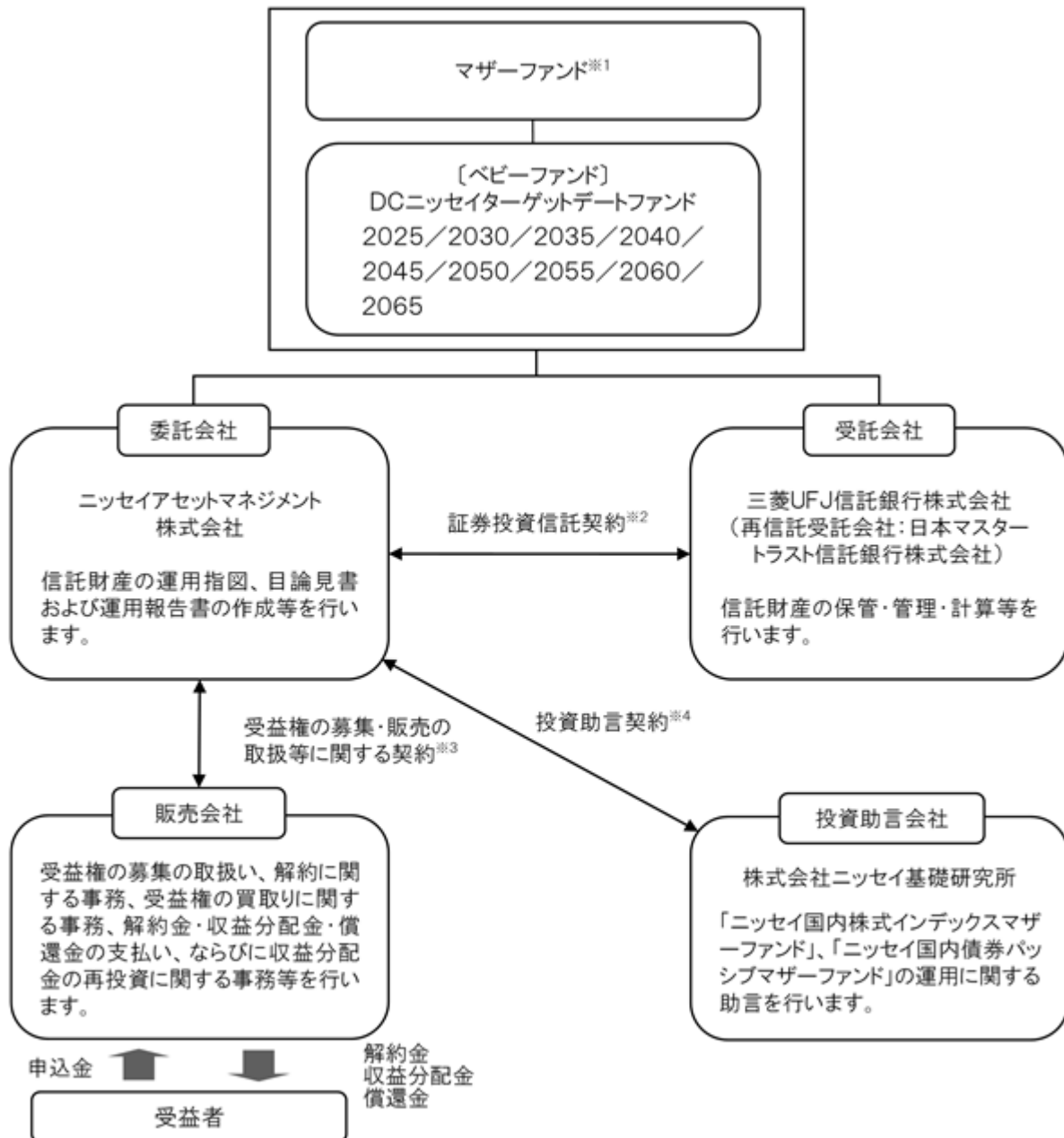
「ターゲットデート2030 / 2040 / 2050 / 2060」

2019年1月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

「ターゲットデート2065」

2022年1月11日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



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

## 委託会社の概況（2021年9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】

「ターゲットデート2025」

主として、複数のマザーファンドを通じて、実質的に国内外の株式（リートを含みます。以下同じ）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資を行います。また、将来の市場構造の変化等によっては、投資対象とするマザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、ニッセイマネーマーケットマザーファンド

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：20.6%

外国株式：14.7%

国内債券：58.7%

外国債券：6.0%

資産配分は、時間の経過により西暦2025年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2025年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

マザーファンドの組入は、原則として高位を維持します。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## 「ターゲットデート2030」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：29.1%

外国株式：21.2%

国内債券：41.8%

外国債券：7.9%

資産配分は、時間の経過により西暦2030年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2030年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2035」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：40.2%

外国株式：29.8%

国内債券：19.5%

外国債券：10.5%

資産配分は、時間の経過により西暦2035年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2035年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2040」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：41.4%

外国株式：30.7%

国内債券：17.1%

外国債券：10.8%

資産配分は、時間の経過により西暦2040年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2040年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2045」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：43.1%

外国株式：31.9%

国内債券：13.8%

外国債券：11.2%

資産配分は、時間の経過により西暦2045年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2045年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2050」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：43.8%

外国株式：32.4%

国内債券：12.5%

外国債券：11.3%

資産配分は、時間の経過により西暦2050年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2050年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2055」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：45.6%

外国株式：33.8%

国内債券：8.9%

外国債券：11.7%

資産配分は、時間の経過により西暦2055年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2055年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2060」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：45.7%

外国株式：34.0%

国内債券：8.5%

外国債券：11.8%

資産配分は、時間の経過により西暦2060年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2060年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2065」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：32.6%

外国株式：46.9%

国内債券：4.7%

外国債券：15.8%

資産配分は、時間の経過により西暦2065年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

西暦2065年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）



## （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（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ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 - B P I 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 - B P I 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。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

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

## b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

## ニッセイグローバルリートマザーファンド

### (1) 基本方針

このマザーファンドは、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして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

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

#### b 投資態度

主として、日本を除く世界各国の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している不動産投資信託証券に投資することにより、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券をS & Pグローバルリートインデックス（除く日本、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

## ニッセイマネーマーケットマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、安定した収益の確保を図ることを目標とした運用を行います。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

円建ての短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

## b 投資態度

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

複数のマザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、株式（リートを含みます）、公社債、ならびに短期金融商品等に投資を行う場合があります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、ニッセイマネーマーケットマザーファンド

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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



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

#### 金融商品

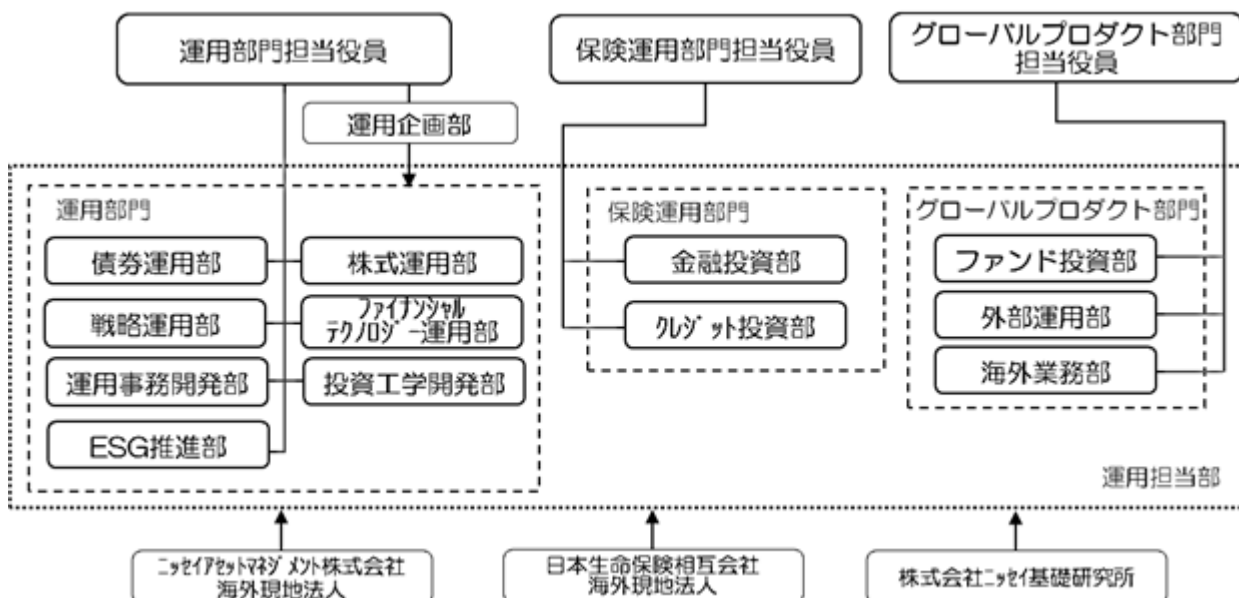
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

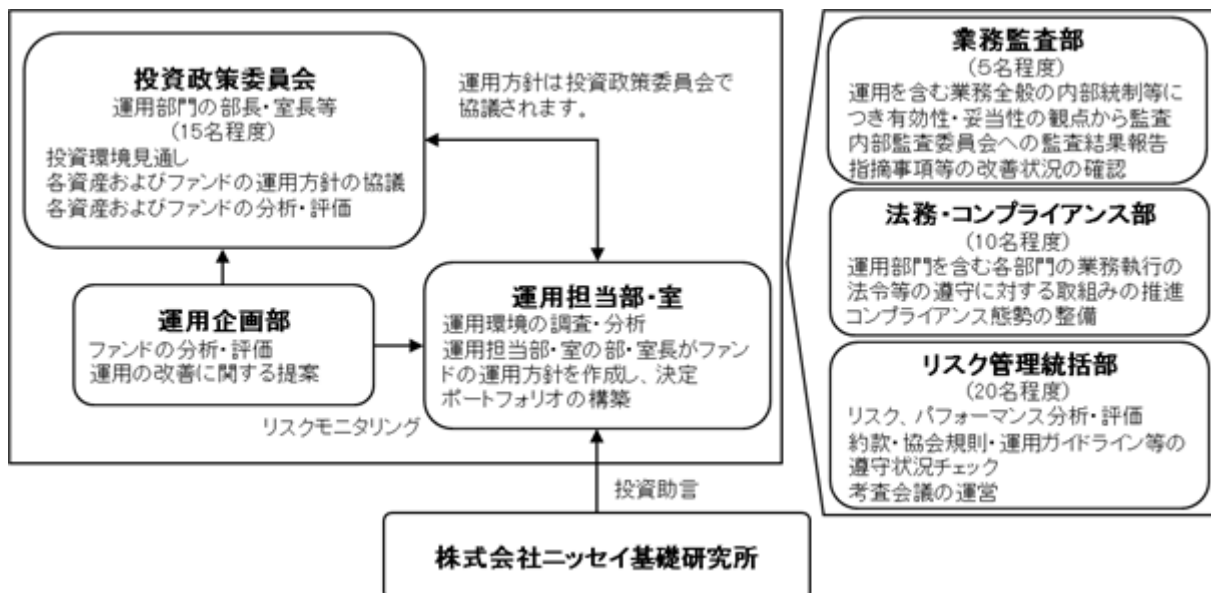
### （3）【運用体制】

#### 委託会社の組織体制



社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネージャー/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、残存信託期間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12月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

## 支払方法

## &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には、制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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20%以下とします。

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

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。

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

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

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. 信託財産に属する資産を効率的に運用するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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. 信託財産に属する資産を効率的に運用するため、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の50%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の50%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られたときは、担保の提供を行うものとしてします。
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てします。
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. 信託財産を効率的に運用するため、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てします。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てします。
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てします。
5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 資金の借入れ

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

##### 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てします。

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。

##### ・不動産投資信託（リート）投資リスク

###### 保有不動産に関するリスク

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

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

###### 金利変動リスク

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

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

###### 信用リスク

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

###### J - R E I T の税制に関するリスク

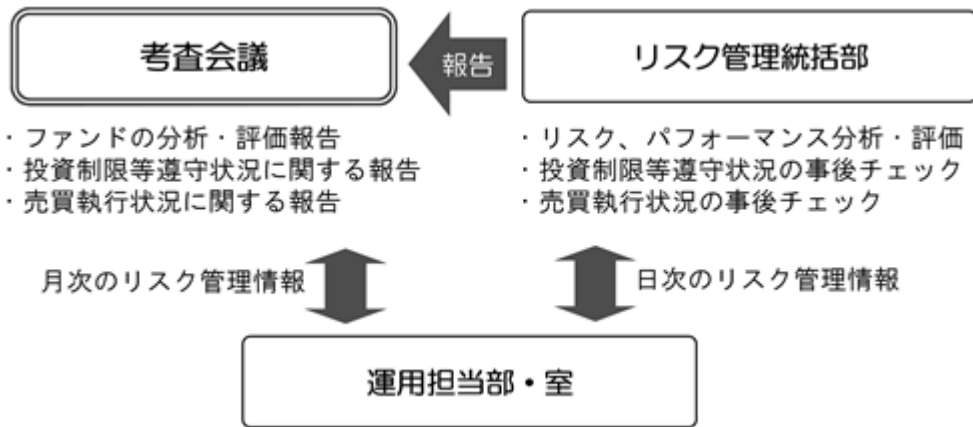
一般に、J - R E I T の発行者には課税の実質免除措置が適用されますが、税法上の一定の要件を満たさない場合、当該措置は適用されず発行者の税負担が増大し、J - R E I T の価格が下落することおよび分配金が減少することがあります。

###### リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

- ・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。
- ・カントリーリスク  
外国の資産に投資するため、各国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受け、ファンドの資産価値が減少する可能性があります。
- ・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  
「ターゲットデート2065」の設定日における信託財産（1百万円（受益権口数1百万口））は、委託会社の資金によるものです。また、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2021年9月末現在、各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6.4%保有しています。  
当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点  
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付け取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

## ( 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。

< 流動性リスクに関する管理体制 >

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。



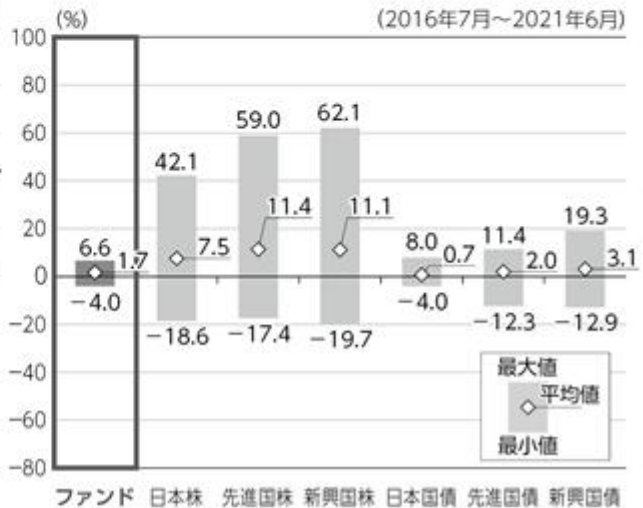
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ●DCニッセイターゲットデートファンド2025

#### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



#### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

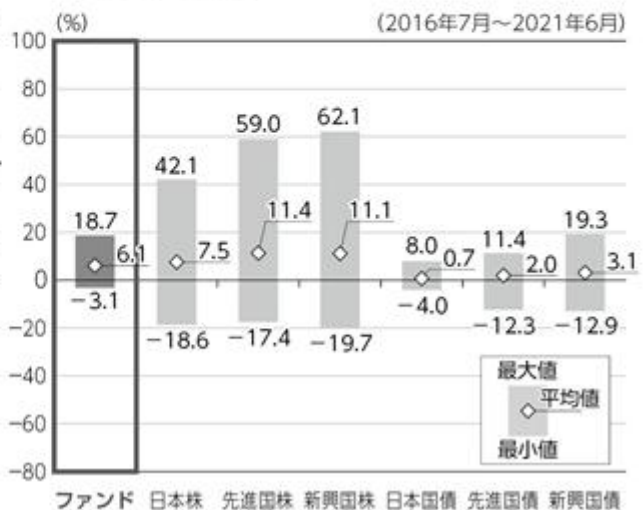


### ●DCニッセイターゲットデートファンド2030

#### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



#### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

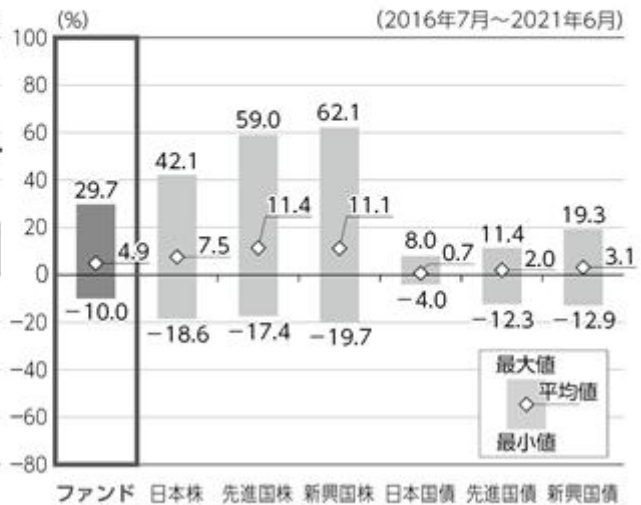


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2035

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

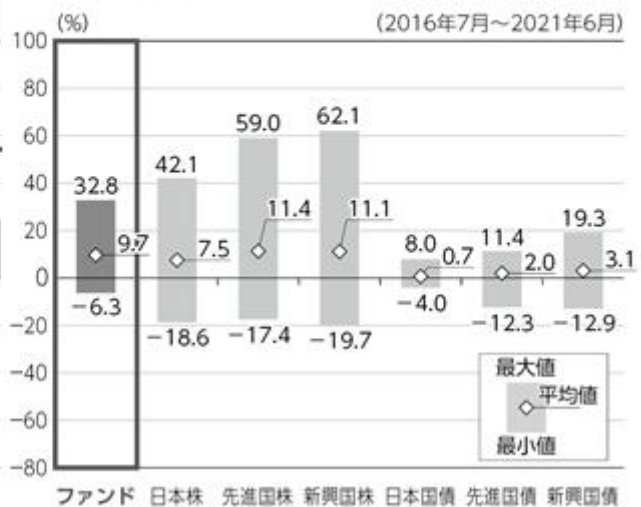


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2040

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

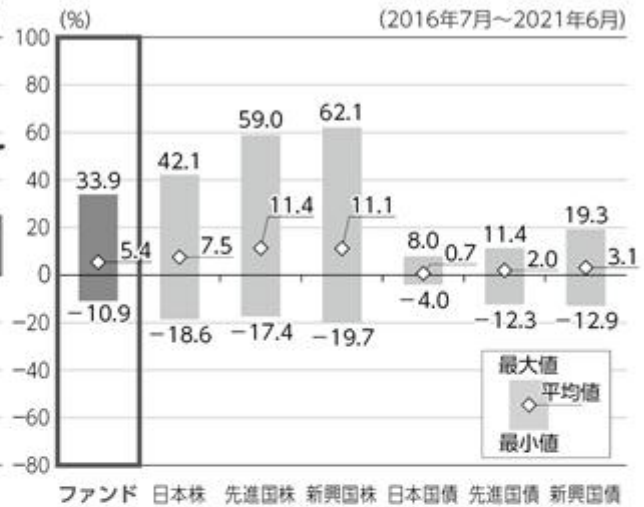


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2045

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

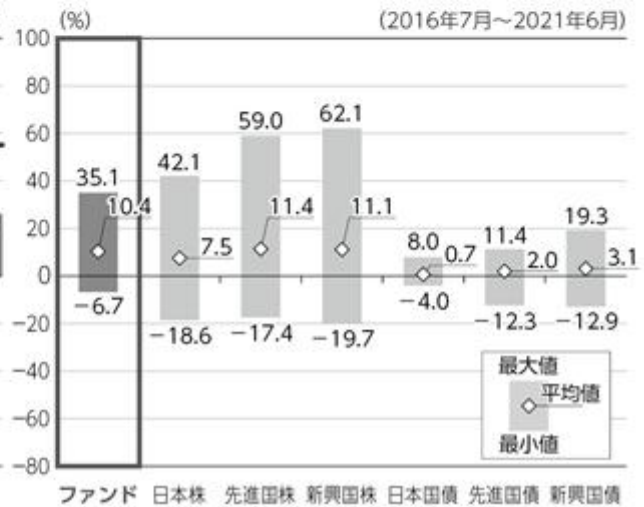


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2050

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

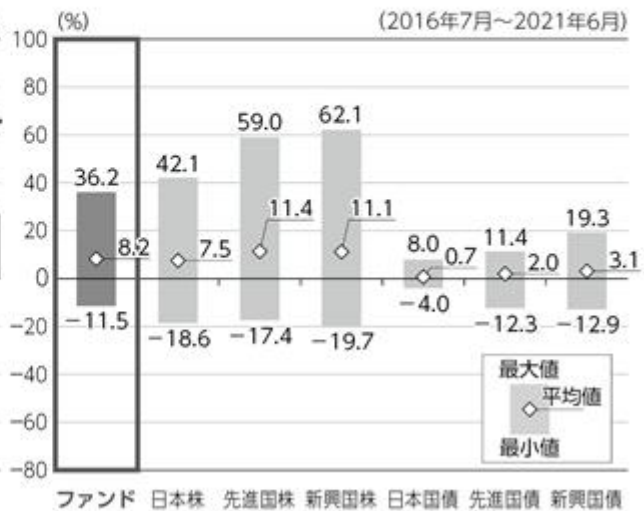


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2055

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

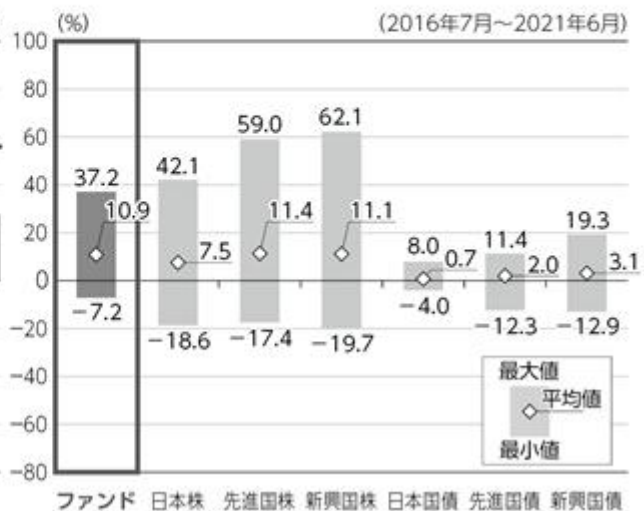


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2060

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

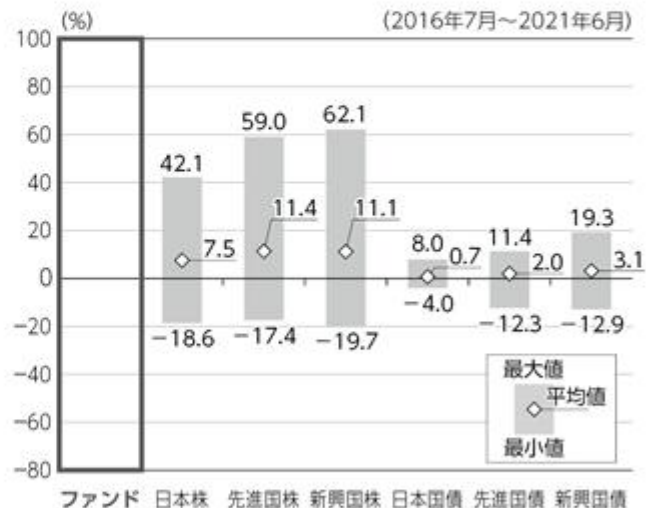
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●DCニッセイターゲットデートファンド2065

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移

該当事項はありません。

②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



グラフ②は、ファンドおよび代表的な資産クラスにおいて、過去5年の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。ただし、ファンドについては2022年1月11日から運用を開始する予定のため、記載すべき事項はありません。

<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 … MSCIE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 … JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

❶ 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。
- ・MSCIE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。
- ・JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

各ファンドにおいて、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以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

## [ターゲットデート2025]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2017年決算日まで	<b>0.3456%</b> (税抜0.32%)	0.145%	0.145%	0.030%
2017年決算日翌日から 2022年決算日まで	<b>0.2970%</b> (税抜0.27%)*	0.120%	0.120%	0.030%
2022年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.1540%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.31%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2030]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2022年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2022年決算日翌日から 2027年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2027年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

## [ターゲットデート2035]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2022年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)*	0.130%	0.130%	0.030%
2022年決算日翌日から 2027年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2027年決算日翌日から 2032年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2032年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## 【ターゲットデート2040】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2027年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)	0.130%	0.130%	0.030%
2027年決算日翌日から 2032年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2032年決算日翌日から 2037年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2037年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

## 【ターゲットデート2045】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2032年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)*	0.130%	0.130%	0.030%
2032年決算日翌日から 2037年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2037年決算日翌日から 2042年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2042年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## 【ターゲットデート2050】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2037年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)	0.130%	0.130%	0.030%
2037年決算日翌日から 2042年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2042年決算日翌日から 2047年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2047年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

## 【ターゲットデート2055】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2042年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)*	0.130%	0.130%	0.030%
2042年決算日翌日から 2047年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2047年決算日翌日から 2052年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2052年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。



## [ターゲットデート2060]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2047年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)	0.130%	0.130%	0.030%
2047年決算日翌日から 2052年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2052年決算日翌日から 2057年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2057年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

## [ターゲットデート2065]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2052年決算日まで	<b>0.319%</b> (税抜0.29%)	0.130%	0.130%	0.030%
2052年決算日翌日から 2057年決算日まで	<b>0.308%</b> (税抜0.28%)	0.125%	0.125%	0.030%
2057年決算日翌日から 2062年決算日まで	<b>0.297%</b> (税抜0.27%)	0.120%	0.120%	0.030%
2062年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

## (4) 【その他の手数料等】

## 証券取引の手数料等

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

## 監査費用

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

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

## 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・収受先等は次の通りです。

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

## （５）【課税上の取扱い】

### 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】

「DCニッセイターゲットデートファンド2065」は、2022年1月11日から運用を開始する予定のため、有価証券届出書提出日現在、「5 運用状況」における該当事項はありません。

## (1)【投資状況】

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,672,252,550	100.00
内 日本	1,672,252,550	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,872	0.00
純資産総額	1,672,238,678	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。

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,641,293,168	100.00
内 日本	1,641,293,168	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,119	0.00
純資産総額	1,641,279,049	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。

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,451,435,767	100.00
内 日本	2,451,435,767	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	21,403	0.00
純資産総額	2,451,414,364	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。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	795,692,274	100.00
内 日本	795,692,274	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,100	0.00
純資産総額	795,685,174	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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2045

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	988,949,331	100.00
内 日本	988,949,331	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,750	0.00
純資産総額	988,940,581	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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	269,614,617	100.00
内 日本	269,614,617	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,397	0.00
純資産総額	269,612,220	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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	940,111,331	100.00
内 日本	940,111,331	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,366	0.00
純資産総額	940,102,965	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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	439,603,909	100.00
内 日本	439,603,909	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,923	0.00
純資産総額	439,599,986	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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	145,533,131,300	96.65
内 日本	145,533,131,300	96.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,047,767,612	3.35
純資産総額	150,580,898,912	100.00

## その他資産の投資状況

2021年6月30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）	5,012,940,000	3.33
内 日本	5,012,940,000	3.33

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	405,762,986,181	94.53
内 アメリカ	283,360,206,432	66.01
内 イギリス	17,774,787,789	4.14
内 カナダ	15,001,252,445	3.49
内 スイス	14,256,248,618	3.32
内 フランス	14,020,189,870	3.27
内 ドイツ	12,195,499,588	2.84
内 オーストラリア	8,556,136,467	1.99
内 オランダ	8,184,702,863	1.91
内 アイルランド	5,935,995,665	1.38
内 スウェーデン	5,015,585,075	1.17
内 香港	3,573,704,375	0.83
内 デンマーク	3,389,984,528	0.79
内 スペイン	3,230,991,553	0.75
内 イタリア	2,767,979,929	0.64
内 フィンランド	1,386,211,578	0.32
内 ベルギー	1,248,739,528	0.29
内 シンガポール	1,171,596,040	0.27
内 ノルウェー	836,389,177	0.19
内 ジャージー	790,692,439	0.18
内 バミューダ	712,117,163	0.17
内 イスラエル	559,108,649	0.13
内 ケイマン諸島	378,075,203	0.09
内 オランダ領キュラソー	342,591,246	0.08
内 ニュージーランド	318,257,863	0.07
内 オーストリア	256,024,032	0.06
内 ポルトガル	244,500,635	0.06
内 ルクセンブルグ	209,044,970	0.05
内 パプアニューギニア	46,372,461	0.01
投資証券	9,231,174,932	2.15
内 アメリカ	7,796,356,558	1.82
内 オーストラリア	607,668,169	0.14
内 イギリス	235,974,512	0.05
内 フランス	210,679,563	0.05
内 シンガポール	171,808,685	0.04
内 香港	157,330,959	0.04
内 カナダ	51,356,486	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,259,691,776	3.32
純資産総額	429,253,852,889	100.00



## その他資産の投資状況

2021年6月30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）	13,721,748,157	3.20
内 アメリカ	10,204,001,718	2.38
内 ドイツ	2,517,826,063	0.59
内 イギリス	999,920,376	0.23

（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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	56,465,074,680	74.14
内 日本	56,465,074,680	74.14
地方債証券	5,210,813,575	6.84
内 日本	5,210,813,575	6.84
特殊債券	8,686,355,250	11.41
内 日本	8,686,355,250	11.41
社債券	5,318,224,200	6.98
内 日本	4,713,382,100	6.19
内 フランス	402,244,500	0.53
内 スウェーデン	202,597,600	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	480,177,256	0.63
純資産総額	76,160,644,961	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	40,605,695,145	99.26
内 アメリカ	18,180,134,746	44.44
内 フランス	4,130,031,304	10.10
内 イタリア	3,860,189,046	9.44
内 ドイツ	3,098,684,460	7.58
内 イギリス	2,661,585,018	6.51
内 スペイン	2,416,091,612	5.91
内 ベルギー	970,293,852	2.37
内 オーストラリア	864,286,126	2.11
内 カナダ	833,680,442	2.04
内 オランダ	792,408,592	1.94
内 オーストリア	608,202,748	1.49
内 アイルランド	338,145,194	0.83
内 メキシコ	328,874,686	0.80
内 ポーランド	255,669,780	0.63
内 フィンランド	253,301,888	0.62
内 デンマーク	205,023,981	0.50
内 マレーシア	196,534,436	0.48
内 イスラエル	189,106,454	0.46
内 シンガポール	175,428,233	0.43
内 スウェーデン	145,675,917	0.36
内 ノルウェー	102,346,630	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	300,796,916	0.74
純資産総額	40,906,492,061	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】

DCニッセイターゲットデットファンド2025

2021年6月30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	1,404,143,801	0.9839 1,381,597,255	0.9831 1,380,413,770	- -	82.55
2	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	52,086,669	2.0127 104,837,318	2.1627 112,647,839	- -	6.74
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	34,757,241	2.2399 77,854,737	2.6677 92,721,891	- -	5.54
4	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	57,626,825	1.4826 85,438,627	1.5005 86,469,050	- -	5.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2021年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイターゲットデットファンド2030

2021年6月30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	835,488,176	0.9837 821,917,381	0.9831 821,368,425	- -	50.04
2	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	140,703,436	2.3523 330,984,435	2.6677 375,354,556	- -	22.87
3	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	133,104,224	2.0194 268,792,423	2.1627 287,864,505	- -	17.54
4	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	104,435,643	1.4802 154,589,008	1.5005 156,705,682	- -	9.55

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2035

2021年6月30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	349,930,578	2.3598 825,779,169	2.6677 933,509,802	- -	38.08
2	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	302,222,035	2.0171 609,636,821	2.1627 653,615,595	- -	26.66
3	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	544,293,116	0.9837 535,451,473	0.9831 535,094,562	- -	21.83
4	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	219,404,071	1.4793 324,572,911	1.5005 329,215,808	- -	13.43

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

2021年6月30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	125,621,435	2.3630 296,845,289	2.6677 335,120,302	- -	42.12
2	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	107,564,971	2.0176 217,029,462	2.1627 232,630,762	- -	29.24
3	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	76,495,374	1.4787 113,118,888	1.5005 114,781,308	- -	14.43
4	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	115,105,180	0.9835 113,206,023	0.9831 113,159,902	- -	14.22

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

2021年6月30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	160,838,600	2.3554 378,847,655	2.6677 429,069,133	- -	43.39
2	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	137,508,916	2.0143 276,997,640	2.1627 297,390,532	- -	30.07
3	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	97,610,695	1.4783 144,304,345	1.5005 146,464,847	- -	14.81
4	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	118,019,346	0.9835 116,073,095	0.9831 116,024,819	- -	11.73

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

2021年6月30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	45,115,010	2.3935 107,983,105	2.6677 120,353,312	- -	44.64
2	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	38,300,085	2.0387 78,083,795	2.1627 82,831,593	- -	30.72
3	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	26,994,255	1.4808 39,973,908	1.5005 40,504,879	- -	15.02
4	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	26,370,495	0.9831 25,925,565	0.9831 25,924,833	- -	9.62

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

2021年6月30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	161,303,399	2.3686 382,069,195	2.6677 430,309,077	- -	45.77
2	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	136,889,152	2.0230 276,937,870	2.1627 296,050,169	- -	31.49
3	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	96,049,463	1.4788 142,038,306	1.5005 144,122,219	- -	15.33
4	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	70,826,840	0.9834 69,656,519	0.9831 69,629,866	- -	7.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2021年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

2021年6月30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	77,284,072	2.4365 188,308,146	2.6677 206,170,718	- -	46.90
2	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	65,801,106	2.0716 136,319,095	2.1627 142,308,051	- -	32.37
3	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	45,907,969	1.4833 68,099,142	1.5005 68,884,907	- -	15.67
4	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	22,622,555	0.9824 22,225,045	0.9831 22,240,233	- -	5.06

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(参考)

## ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	552,800	8,082.53 4,468,022,900	9,710.00 5,367,688,000	- -	3.56
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	341,800	11,959.46 4,087,745,200	10,815.00 3,696,567,000	- -	2.45
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	424,800	10,484.37 4,453,763,200	7,775.00 3,302,820,000	- -	2.19
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	53,600	56,670.98 3,037,565,000	56,070.00 3,005,352,000	- -	2.00
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,681,400	564.75 2,079,095,860	600.10 2,209,208,140	- -	1.47
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	373,500	5,475.33 2,045,039,300	5,470.00 2,043,045,000	- -	1.36
7	任天堂 日本	株式 その他製品	31,200	67,992.44 2,121,364,200	64,620.00 2,016,144,000	- -	1.34
8	信越化学工業 日本	株式 化学	98,800	18,747.03 1,852,207,100	18,580.00 1,835,704,000	- -	1.22
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	626,200	2,821.51 1,766,830,350	2,894.50 1,812,535,900	- -	1.20
10	日本電産 日本	株式 電気機器	131,300	14,603.05 1,917,381,600	12,875.00 1,690,487,500	- -	1.12
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	454,000	3,688.03 1,674,367,400	3,719.00 1,688,426,000	- -	1.12
12	日立製作所 日本	株式 電気機器	262,300	4,952.06 1,298,927,200	6,361.00 1,668,490,300	- -	1.11
13	HOYA 日本	株式 精密機器	107,400	13,088.33 1,405,686,900	14,730.00 1,582,002,000	- -	1.05
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	32,000	46,363.15 1,483,621,100	48,080.00 1,538,560,000	- -	1.02
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	429,600	2,988.93 1,284,044,700	3,550.00 1,525,080,000	- -	1.01



16	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	429,400	3,397.54 1,458,907,100	3,465.00 1,487,871,000	- -	0.99
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	69,500	22,104.76 1,536,281,300	20,690.00 1,437,955,000	- -	0.95
18	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	372,400	3,768.60 1,403,429,200	3,830.00 1,426,292,000	- -	0.95
19	村田製作所 日本	株式 電気機器	160,300	9,846.57 1,578,406,400	8,482.00 1,359,664,600	- -	0.90
20	ファナック 日本	株式 電気機器	47,900	27,551.26 1,319,705,500	26,795.00 1,283,480,500	- -	0.85
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	375,900	3,252.26 1,222,526,200	3,200.00 1,202,880,000	- -	0.80
22	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	731,300	1,590.56 1,163,178,150	1,587.50 1,160,938,750	- -	0.77
23	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	210,200	4,216.62 886,335,400	5,297.00 1,113,429,400	- -	0.74
24	三井物産 日本	株式 卸売業	428,700	2,215.11 949,618,850	2,500.50 1,071,964,350	- -	0.71
25	S M C 日本	株式 機械	16,000	65,860.63 1,053,770,200	65,650.00 1,050,400,000	- -	0.70
26	第一三共 日本	株式 医薬品	428,800	3,257.90 1,396,990,860	2,394.50 1,026,761,600	- -	0.68
27	富士通 日本	株式 電気機器	49,100	15,948.66 783,079,300	20,800.00 1,021,280,000	- -	0.68
28	三菱商事 日本	株式 卸売業	327,200	2,983.19 976,100,000	3,028.00 990,761,600	- -	0.66
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	473,100	1,777.53 840,949,900	1,934.50 915,211,950	- -	0.61
30	デンソー 日本	株式 輸送用機 器	120,100	6,692.79 803,804,900	7,579.00 910,237,900	- -	0.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2021年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	電気機器	17.54
		情報・通信業	8.48
		輸送用機器	7.63
		化学	7.13
		サービス業	5.48
		機械	5.20
		医薬品	5.11
		銀行業	4.77
		卸売業	4.59
		小売業	4.46
		食料品	3.28
		陸運業	3.27
		精密機器	2.64
		その他製品	2.37
		建設業	2.22
		不動産業	1.95
		保険業	1.78
		電気・ガス業	1.17
		その他金融業	1.05
		鉄鋼	0.75
		証券、商品先物取引業	0.74
		ガラス・土石製品	0.74
		非鉄金属	0.70
		ゴム製品	0.67
		金属製品	0.61
		繊維製品	0.48
		空運業	0.44
		石油・石炭製品	0.41
	海運業	0.33	
パルプ・紙	0.23		
鉱業	0.18		
倉庫・運輸関連業	0.17		
水産・農林業	0.09		
	小計		96.65
合計(対純資産総額比)			96.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年6月30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	1,165,697	13,799.74 16,086,325,111	15,075.37 17,573,315,214	- -	4.09
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	497,496	26,925.30 13,395,232,282	30,011.41 14,930,557,424	- -	3.48

3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	29,721	357,768.87 10,633,248,609	381,295.32 11,332,478,241	- -	2.64
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア ア・娯楽	167,006	34,744.74 5,802,581,634	38,911.99 6,498,536,837	- -	1.51
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア ア・娯楽	20,480	255,790.53 5,238,590,084	278,702.51 5,707,827,499	- -	1.33
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア ア・娯楽	20,865	251,672.24 5,251,141,325	270,417.86 5,642,268,669	- -	1.31
7	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	53,319	62,516.96 3,333,342,225	75,278.44 4,013,771,185	- -	0.94
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	42,982	62,623.76 2,691,694,823	88,582.32 3,807,445,304	- -	0.89
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	211,831	17,802.51 3,771,125,023	17,044.80 3,610,617,282	- -	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	182,518	18,793.64 3,430,178,346	18,138.43 3,310,591,317	- -	0.77
11	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	117,784	24,857.59 2,927,826,887	26,091.35 3,073,143,686	- -	0.72
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	95,170	31,645.94 3,011,744,728	30,543.30 2,906,806,032	- -	0.68
13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	65,861	45,264.54 2,981,167,967	44,021.89 2,899,326,224	- -	0.68
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲 料・タバ コ	200,005	13,142.00 2,628,466,163	13,961.81 2,792,432,809	- -	0.65
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	74,761	34,755.93 2,598,388,296	35,190.97 2,630,912,795	- -	0.61
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	171,017	15,101.00 2,582,527,822	14,861.95 2,541,646,445	- -	0.59

17	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	61,579	39,934.74 2,459,141,690	40,693.43 2,505,861,341	- -	0.58
18	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	77,239	27,129.42 2,095,449,753	32,373.40 2,500,489,104	- -	0.58
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	539,286	4,639.74 2,502,149,748	4,521.61 2,438,444,314	- -	0.57
20	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	126,054	18,741.83 2,362,482,679	19,233.17 2,424,419,196	- -	0.56
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	29,121	67,166.75 1,955,963,148	77,619.04 2,260,344,122	- -	0.53
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	33,207	53,306.85 1,770,160,730	65,325.13 2,169,251,757	- -	0.51
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	48,713	36,657.11 1,785,677,886	41,873.43 2,039,780,882	- -	0.48
24	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	293,938	6,534.42 1,920,715,256	6,924.51 2,035,379,442	- -	0.47
25	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	317,254	6,007.61 1,905,940,820	6,252.19 1,983,533,301	- -	0.46
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	30,753	53,957.07 1,659,341,835	58,994.42 1,814,255,705	- -	0.42
27	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信 サービス	287,998	6,294.52 1,812,811,110	6,174.78 1,778,326,364	- -	0.41
28	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	282,107	6,127.84 1,728,706,982	6,275.41 1,770,338,499	- -	0.41
29	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	63,743	24,540.49 1,564,284,884	27,181.66 1,732,641,178	- -	0.40

30	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	293,031	5,805.57 1,701,214,382	5,850.78 1,714,462,199	- -	0.40
----	---------------------------	--------------------------------------	---------	---------------------------	---------------------------	--------	------

(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6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	11.87
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.33
		メディア・娯楽	7.18
		資本財	6.26
		銀行	5.90
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.58
		小売	5.44
		ヘルスケア機器・サービス	4.97
		各種金融	4.56
		半導体・半導体製造装置	4.55
		素材	4.22
		食品・飲料・タバコ	3.79
		エネルギー	3.21
		保険	2.92
		公益事業	2.77
		耐久消費財・アパレル	2.00
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	1.94
		消費者サービス	1.77
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		電気通信サービス	1.65
		食品・生活必需品小売り	1.28
商業・専門サービス	1.18		
不動産	0.46		
その他	0.01		
	小計		94.53
投資証券	外国		2.15
	小計		2.15
合計(対純資産総額比)			96.68

(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。

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年6月30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	101.52 1,015,235,000	0.828 2023/5/19	1.33
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	101.18 779,093,700	0.1 2028/3/20	1.02
3	第328回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	765,000,000	101.43 776,000,100	101.22 774,340,650	0.6 2023/3/20	1.02
4	第70回 利付国債(20 年) 日本	国債証 券	657,000,000	108.03 709,757,100	107.52 706,445,820	2.4 2024/6/20	0.93
5	第127回 利付国債(2 0年) 日本	国債証 券	575,000,000	117.57 676,044,750	117.89 677,873,250	1.9 2031/3/20	0.89
6	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	641,000,000	100.77 645,935,700	101.19 648,627,900	0.1 2028/6/20	0.85
7	第334回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	618,000,000	102.31 632,325,240	102.17 631,447,680	0.6 2024/6/20	0.83
8	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	597,000,000	100.86 602,135,660	101.17 603,984,900	0.1 2027/12/20	0.79
9	第327回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	589,000,000	101.62 598,541,800	101.34 596,892,600	0.8 2022/12/20	0.78
10	第352回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	576,000,000	100.67 579,899,520	101.19 582,894,720	0.1 2028/9/20	0.77
11	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	566,000,000	102.20 578,474,640	102.22 578,610,480	0.4 2025/9/20	0.76
12	第354回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	568,000,000	100.52 570,953,600	101.12 574,372,960	0.1 2029/3/20	0.75
13	第335回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	559,000,000	102.10 570,746,440	102.03 570,392,420	0.5 2024/9/20	0.75
14	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	552,000,000	101.79 561,924,960	101.86 562,294,800	0.3 2025/12/20	0.74
15	第358回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	557,000,000	100.17 557,946,900	100.87 561,851,470	0.1 2030/3/20	0.74

16	第353回 利付国債（10年） 日本	国債証券	543,000,000	100.62 546,372,030	101.16 549,309,660	0.1 2028/12/20	0.72
17	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	536,000,000	102.08 547,154,160	102.11 547,331,040	0.4 2025/6/20	0.72
18	第344回 利付国債（10年） 日本	国債証券	533,000,000	100.83 537,429,230	101.02 538,452,590	0.1 2026/9/20	0.71
19	第345回 利付国債（10年） 日本	国債証券	532,000,000	100.84 536,468,800	101.07 537,703,040	0.1 2026/12/20	0.71
20	第346回 利付国債（10年） 日本	国債証券	523,000,000	100.81 527,262,450	101.09 528,711,160	0.1 2027/3/20	0.69
21	第342回 利付国債（10年） 日本	国債証券	510,000,000	100.83 514,238,100	100.97 514,952,100	0.1 2026/3/20	0.68
22	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	101.95 509,752,000	101.91 509,582,500	0.66 2024/5/31	0.67
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	101.09 505,472,500	0.605 2023/5/31	0.66
24	第348回 利付国債（10年） 日本	国債証券	499,000,000	100.81 503,076,830	101.15 504,773,430	0.1 2027/9/20	0.66
25	第338回 利付国債（10年） 日本	国債証券	491,000,000	101.97 500,716,890	101.98 500,721,800	0.4 2025/3/20	0.66
26	第113回 利付国債（20年） 日本	国債証券	403,000,000	117.35 472,920,500	117.50 473,553,210	2.1 2029/9/20	0.62
27	第141回 利付国債（5年） 日本	国債証券	470,000,000	100.70 473,327,600	100.74 473,496,800	0.1 2024/9/20	0.62
28	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	461,000,000	100.82 464,780,200	101.02 465,720,640	0.1 2026/6/20	0.61
29	第361回 利付国債（10年） 日本	国債証券	457,000,000	99.86 456,370,870	100.56 459,586,620	0.1 2030/12/20	0.60
30	第347回 利付国債（10年） 日本	国債証券	433,000,000	100.82 436,552,660	101.14 437,936,200	0.1 2027/6/20	0.58

（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6月30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	74.14
		特殊債券	11.41
		地方債証券	6.84
		社債券	6.19
	小計		98.58
	外国	社債券	0.79
	小計		0.79
合計(対純資産総額比)			99.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年6月30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	374,866,200	106.31 398,552,285	105.92 397,092,016	2.5 2024/5/15	0.97
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	368,231,400	106.70 392,928,679	106.18 390,999,147	2.75 2024/2/15	0.96
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	316,258,800	103.83 328,396,971	103.60 327,672,580	1.625 2026/5/15	0.80
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	304,095,000	106.18 322,909,357	105.72 321,519,643	2.75 2023/11/15	0.79
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	301,883,400	106.64 321,940,533	106.36 321,104,316	2.25 2025/11/15	0.78
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	308,518,200	103.74 320,071,532	103.61 319,677,303	1.625 2026/2/15	0.78
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	295,248,600	105.14 310,447,997	104.70 309,134,141	2.25 2023/12/31	0.76
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	296,354,400	103.11 305,586,461	102.81 304,711,594	1.75 2023/5/15	0.74
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	283,084,800	105.53 298,742,220	105.21 297,844,841	2 2025/8/15	0.73
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	283,084,800	105.14 297,661,466	104.67 296,319,014	2.125 2024/3/31	0.72
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	281,979,000	103.20 291,010,787	102.90 290,184,588	2 2023/2/15	0.71
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	269,815,200	106.71 287,943,099	106.54 287,477,302	2.25 2026/3/31	0.70
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	267,603,600	105.97 283,584,886	105.57 282,530,528	2.125 2025/5/15	0.69
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	268,709,400	105.38 283,171,339	105.00 282,144,870	2 2025/2/15	0.69
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	263,180,400	106.33 279,844,982	105.88 278,660,671	2.375 2024/8/15	0.68
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	272,026,800	102.22 278,071,235	102.00 277,475,496	1.625 2022/11/15	0.68
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	262,074,600	106.12 278,134,531	105.70 277,039,059	2.25 2024/11/15	0.68



18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	270,921,000	102.48 277,653,585	102.24 276,995,048	1.5 2023/3/31	0.68
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	264,286,200	102.33 270,467,854	102.11 269,870,567	1.625 2022/12/15	0.66
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	257,651,400	105.10 270,814,810	104.69 269,737,827	2.5 2023/8/15	0.66
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	262,074,600	103.19 270,447,883	102.90 269,680,004	2.125 2022/12/31	0.66
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	244,381,800	109.57 267,772,650	110.06 268,981,271	2.75 2028/2/15	0.66
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	263,180,400	101.88 268,154,509	101.70 267,662,362	1.625 2022/8/15	0.65
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	245,487,600	108.37 266,054,551	108.07 265,318,088	2.625 2025/12/31	0.65
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	248,805,000	102.35 254,663,073	102.15 254,159,283	1.5 2023/2/28	0.62
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	237,747,000	106.37 252,893,861	106.86 254,073,086	2.25 2027/11/15	0.62
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	225,583,200	109.85 247,818,250	109.45 246,916,603	3 2025/9/30	0.60
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	233,323,800	101.94 237,852,614	101.74 237,406,966	1.625 2022/8/31	0.58
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	222,265,800	102.22 227,204,546	102.00 226,726,674	1.75 2022/9/30	0.55
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	216,736,800	101.78 220,605,551	101.57 220,156,906	1.75 2022/6/15	0.54

（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。

#### 種類別及び業種別投資比率

2021年6月30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	99.26
	小計		99.26
合計(対純資産総額比)			99.26

（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】

DCニッセイターゲットデートファンド2025

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2030

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2035

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2040  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2045  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2050  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2055  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2060  
該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

DCニッセイターゲットデートファンド2025  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2030  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2035  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2040  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2045  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2050  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2055  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2060  
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6月30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	258	5,059,646,900	5,012,940,000	3.33

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年6月30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	431	10,122,025,170	10,204,001,718	2.38
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 202109	買建	467	2,534,928,700	2,517,826,063	0.59
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202109	買建	93	1,007,251,992	999,920,376	0.23

（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。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

DCニッセイターゲットデットファンド2025

直近日(2021年6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 (2017年12月20日)	1,042,745	1,042,745	1.0427	1.0427
第2計算期間末 (2018年12月20日)	75,725,362	75,725,362	1.0070	1.0070
第3計算期間末 (2019年12月20日)	457,912,286	457,912,286	1.0627	1.0627
第4計算期間末 (2020年12月21日)	1,301,134,378	1,301,134,378	1.0837	1.0837
2020年6月末日	846,722,337	-	1.0494	-
7月末日	887,367,226	-	1.0500	-
8月末日	1,123,382,211	-	1.0620	-
9月末日	1,175,381,443	-	1.0625	-
10月末日	1,215,014,571	-	1.0544	-
11月末日	1,257,435,294	-	1.0784	-
12月末日	1,326,171,831	-	1.0835	-
2021年1月末日	1,334,649,716	-	1.0824	-
2月末日	1,353,079,428	-	1.0795	-
3月末日	1,462,873,198	-	1.0956	-
4月末日	1,481,808,147	-	1.0972	-
5月末日	1,522,248,025	-	1.1001	-
6月末日	1,672,238,678	-	1.1031	-

## DCニッセイターゲットデットファンド2030

直近日(2021年6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 (2019年12月20日)	73,587,808	73,587,808	1.1045	1.1045
第2計算期間末 (2020年12月21日)	1,170,122,248	1,170,122,248	1.1535	1.1535
2020年6月末日	734,373,300	-	1.0728	-
7月末日	763,664,134	-	1.0704	-
8月末日	1,000,419,584	-	1.1057	-
9月末日	1,024,254,318	-	1.1025	-
10月末日	1,056,240,487	-	1.0859	-
11月末日	1,119,163,158	-	1.1420	-
12月末日	1,168,484,034	-	1.1566	-
2021年1月末日	1,189,182,149	-	1.1593	-
2月末日	1,231,110,596	-	1.1689	-
3月末日	1,376,325,653	-	1.2036	-
4月末日	1,392,246,340	-	1.2063	-
5月末日	1,425,636,387	-	1.2144	-
6月末日	1,641,279,049	-	1.2236	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

直近日（2021年6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 （2017年12月20日）	1,082,306	1,082,306	1.0823	1.0823
第2計算期間末 （2018年12月20日）	70,055,216	70,055,216	0.9897	0.9897
第3計算期間末 （2019年12月20日）	564,969,332	564,969,332	1.1252	1.1252
第4計算期間末 （2020年12月21日）	1,687,473,196	1,687,473,196	1.1936	1.1936
2020年6月末日	1,193,458,311	-	1.0753	-
7月末日	1,250,294,867	-	1.0705	-
8月末日	1,423,686,432	-	1.1244	-
9月末日	1,453,769,921	-	1.1182	-
10月末日	1,492,597,819	-	1.0948	-
11月末日	1,619,514,292	-	1.1770	-
12月末日	1,721,109,439	-	1.2004	-
2021年1月末日	1,760,926,984	-	1.2070	-
2月末日	1,819,607,110	-	1.2288	-
3月末日	2,031,524,971	-	1.2821	-
4月末日	2,086,901,604	-	1.2856	-
5月末日	2,154,857,895	-	1.2990	-
6月末日	2,451,414,364	-	1.3147	-

## DCニッセイターゲットデットファンド2040

直近日(2021年6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 (2019年12月20日)	46,572,387	46,572,387	1.1461	1.1461
第2計算期間末 (2020年12月21日)	520,318,560	520,318,560	1.2197	1.2197
2020年6月末日	341,776,264	-	1.0894	-
7月末日	355,465,180	-	1.0838	-
8月末日	408,338,978	-	1.1437	-
9月末日	429,935,898	-	1.1365	-
10月末日	443,830,575	-	1.1109	-
11月末日	483,193,945	-	1.2015	-
12月末日	537,648,604	-	1.2276	-
2021年1月末日	552,723,295	-	1.2354	-
2月末日	568,992,881	-	1.2610	-
3月末日	653,438,233	-	1.3202	-
4月末日	669,501,752	-	1.3240	-
5月末日	706,068,768	-	1.3392	-
6月末日	795,685,174	-	1.3570	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

直近日（2021年6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 (2017年12月20日)	1,088,135	1,088,135	1.0881	1.0881
第2計算期間末 (2018年12月20日)	43,412,324	43,412,324	0.9867	0.9867
第3計算期間末 (2019年12月20日)	264,521,692	264,521,692	1.1346	1.1346
第4計算期間末 (2020年12月21日)	682,760,159	682,760,159	1.2107	1.2107
2020年6月末日	454,216,298	-	1.0779	-
7月末日	491,989,294	-	1.0721	-
8月末日	556,049,969	-	1.1332	-
9月末日	583,496,308	-	1.1258	-
10月末日	599,608,669	-	1.0998	-
11月末日	655,218,287	-	1.1922	-
12月末日	693,927,650	-	1.2188	-
2021年1月末日	712,837,059	-	1.2269	-
2月末日	756,708,231	-	1.2532	-
3月末日	851,461,138	-	1.3136	-
4月末日	874,935,203	-	1.3174	-
5月末日	896,253,942	-	1.3330	-
6月末日	988,940,581	-	1.3512	-



## DCニッセイターゲットデートファンド2050

直近日(2021年6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 (2019年12月20日)	25,150,378	25,150,378	1.1540	1.1540
第2計算期間末 (2020年12月21日)	146,693,410	146,693,410	1.2328	1.2328
2020年6月末日	80,779,742	-	1.0943	-
7月末日	87,820,383	-	1.0882	-
8月末日	103,221,664	-	1.1520	-
9月末日	112,635,032	-	1.1442	-
10月末日	119,364,810	-	1.1172	-
11月末日	135,841,832	-	1.2136	-
12月末日	153,378,779	-	1.2414	-
2021年1月末日	156,410,889	-	1.2500	-
2月末日	167,663,075	-	1.2779	-
3月末日	198,600,990	-	1.3410	-
4月末日	212,121,991	-	1.3449	-
5月末日	235,191,124	-	1.3612	-
6月末日	269,612,220	-	1.3804	-

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

直近日(2021年6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 (2016年12月20日)	1,141,342	1,141,342	1.1413	1.1413
第2計算期間末 (2017年12月20日)	2,854,940	2,854,940	1.3107	1.3107
第3計算期間末 (2018年12月20日)	71,901,230	71,901,230	1.1820	1.1820
第4計算期間末 (2019年12月20日)	359,193,901	359,193,901	1.3682	1.3682
第5計算期間末 (2020年12月21日)	653,687,309	653,687,309	1.4629	1.4629
2020年6月末日	445,142,056	-	1.2944	-
7月末日	478,038,810	-	1.2869	-
8月末日	516,601,182	-	1.3647	-
9月末日	543,463,599	-	1.3551	-
10月末日	567,129,367	-	1.3222	-
11月末日	621,813,501	-	1.4394	-
12月末日	673,053,905	-	1.4734	-
2021年1月末日	700,229,730	-	1.4839	-
2月末日	713,894,408	-	1.5182	-
3月末日	783,230,508	-	1.5949	-
4月末日	822,400,589	-	1.5997	-
5月末日	852,822,851	-	1.6196	-
6月末日	940,102,965	-	1.6430	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

直近日（2021年6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 （2019年12月20日）	32,944,282	32,944,282	1.1609	1.1609
第2計算期間末 （2020年12月21日）	175,309,722	175,309,722	1.2428	1.2428
2020年6月末日	87,268,170	-	1.0966	-
7月末日	120,427,394	-	1.0900	-
8月末日	127,979,800	-	1.1576	-
9月末日	136,981,313	-	1.1492	-
10月末日	143,118,243	-	1.1207	-
11月末日	161,808,723	-	1.2224	-
12月末日	184,467,058	-	1.2519	-
2021年1月末日	200,584,570	-	1.2612	-
2月末日	242,056,554	-	1.2913	-
3月末日	304,105,429	-	1.3579	-
4月末日	323,001,158	-	1.3620	-
5月末日	370,942,540	-	1.3793	-
6月末日	439,599,986	-	1.3997	-

## 【分配の推移】

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

	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
第5計算期間	0.0000
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

	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
2020年12月22日～2021年6月21日	-

## 【収益率の推移】

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

	収益率（％）
第1計算期間	4.3
第2計算期間	3.4
第3計算期間	5.5
第4計算期間	2.0
2020年12月22日～2021年6月21日	1.5

（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。）。

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

	収益率（％）
第1計算期間	10.5
第2計算期間	4.4
2020年12月22日～2021年6月21日	5.0

（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。）。

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

	収益率（％）
第1計算期間	8.2
第2計算期間	8.6
第3計算期間	13.7
第4計算期間	6.1
2020年12月22日～2021年6月21日	8.2

（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。）。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

	収益率（％）
第1計算期間	14.6
第2計算期間	6.4
2020年12月22日～2021年6月21日	9.1

（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。）。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

	収益率（％）
第1計算期間	8.8
第2計算期間	9.3
第3計算期間	15.0
第4計算期間	6.7
2020年12月22日～2021年6月21日	9.4

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しています（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。）。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

	収益率（％）
第1計算期間	15.4
第2計算期間	6.8
2020年12月22日～2021年6月21日	9.7

（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。）。

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

	収益率（％）
第1計算期間	14.1
第2計算期間	14.8
第3計算期間	9.8
第4計算期間	15.8
第5計算期間	6.9
2020年12月22日～2021年6月21日	9.9

（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。）。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

	収益率（％）
第1計算期間	16.1
第2計算期間	7.1
2020年12月22日～2021年6月21日	10.2

（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】

## DCニッセイターゲットデットファンド2025

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	86,246,774	12,050,899	75,195,875
第3計算期間	387,560,915	31,880,755	430,876,035
第4計算期間	922,348,817	152,580,214	1,200,644,638
2020年12月22日～ 2021年6月21日	406,680,370	115,205,761	1,492,119,247

（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。

## D Cニッセイターゲットデートファンド2030

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	73,774,281	7,147,035	66,627,246
第2計算期間	973,321,960	25,560,840	1,014,388,366
2020年12月22日～ 2021年6月21日	396,440,660	93,590,838	1,317,238,188

(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。

## D Cニッセイターゲットデートファンド2035

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	75,898,281	6,116,182	70,782,099
第3計算期間	472,272,256	40,931,452	502,122,903
第4計算期間	1,069,111,112	157,447,877	1,413,786,138
2020年12月22日～ 2021年6月21日	507,512,690	116,516,701	1,804,782,127

(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。

## D Cニッセイターゲットデートファンド2040

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	43,349,876	2,715,954	40,633,922
第2計算期間	409,608,219	23,643,836	426,598,305
2020年12月22日～ 2021年6月21日	184,403,152	37,757,749	573,243,708

(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。

## D Cニッセイターゲットデートファンド2045

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	45,814,915	2,817,018	43,997,897
第3計算期間	215,465,288	26,325,617	233,137,568
第4計算期間	414,415,117	83,597,702	563,954,983
2020年12月22日～ 2021年6月21日	204,845,692	57,753,810	711,046,865

(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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	25,368,600	3,574,381	21,794,219
第2計算期間	113,562,838	16,369,433	118,987,624
2020年12月22日～ 2021年6月21日	84,835,403	14,507,982	189,315,045

(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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	2,178,145	1,000,000	2,178,145
第3計算期間	67,199,823	8,549,894	60,828,074
第4計算期間	228,564,856	26,865,852	262,527,078
第5計算期間	290,087,575	105,775,306	446,839,347
2020年12月22日～ 2021年6月21日	198,573,373	93,654,026	551,758,694

(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。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	37,713,552	9,335,463	28,378,089
第2計算期間	179,902,566	67,216,411	141,064,244
2020年12月22日～ 2021年6月21日	227,649,404	61,887,469	306,826,179

(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6月末現在

### DCニッセイターゲットデートファンド2025

#### ● 基準価額・純資産の推移



基準価額	11,031円
純資産総額	16億円

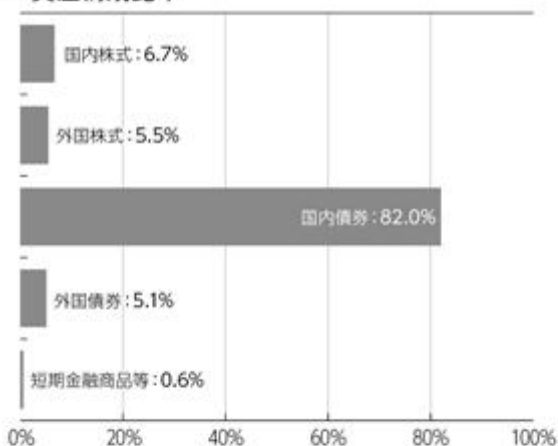
#### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12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。

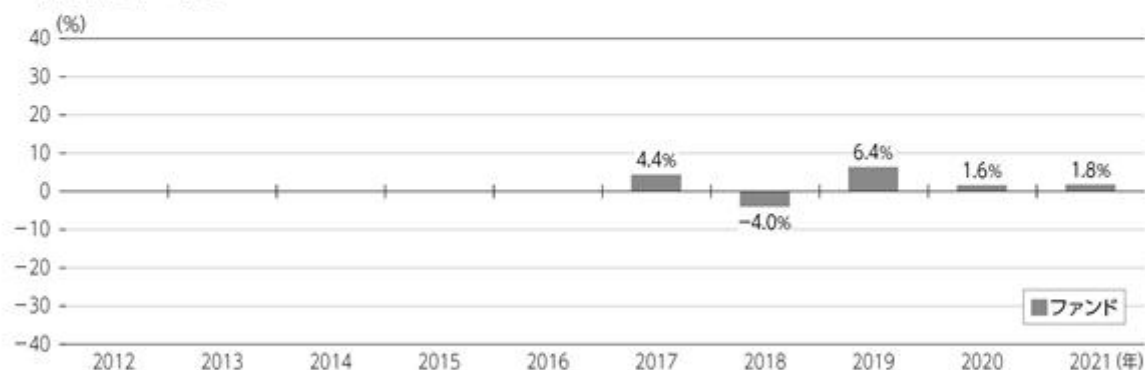
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

#### ● 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)を再投資したもとして計算しております。

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

■ 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。

2021年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,236円
純資産総額	16億円

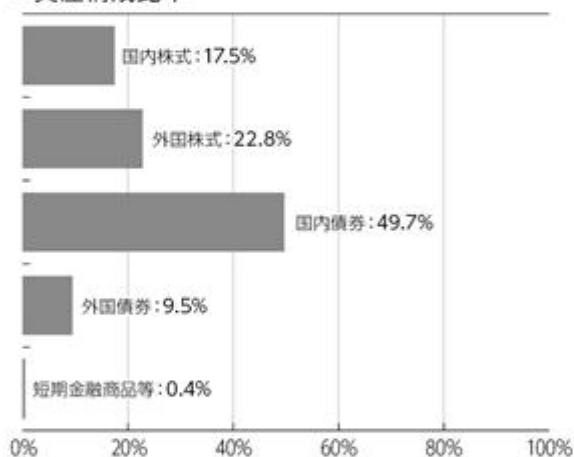
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12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。

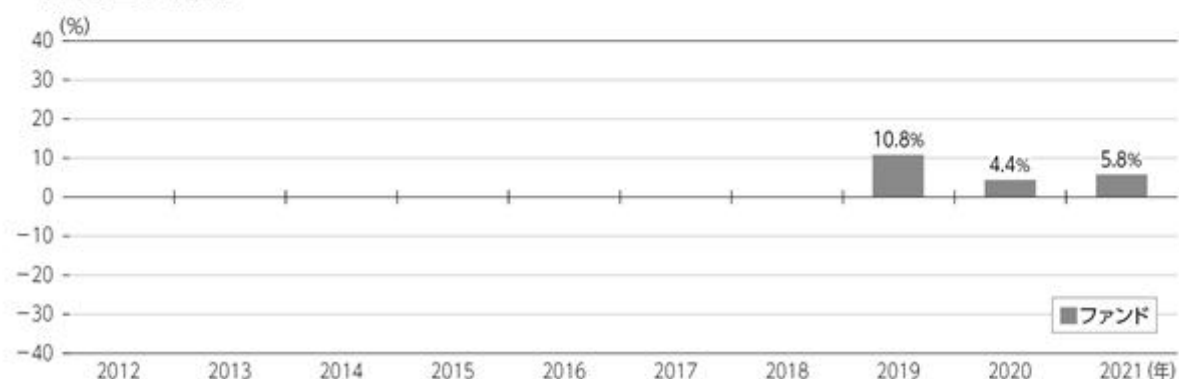
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

## ●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)を再投資したもとして計算しております。

・2019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。

## 3.運用実績

2021年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	13,147円
純資産総額	24億円

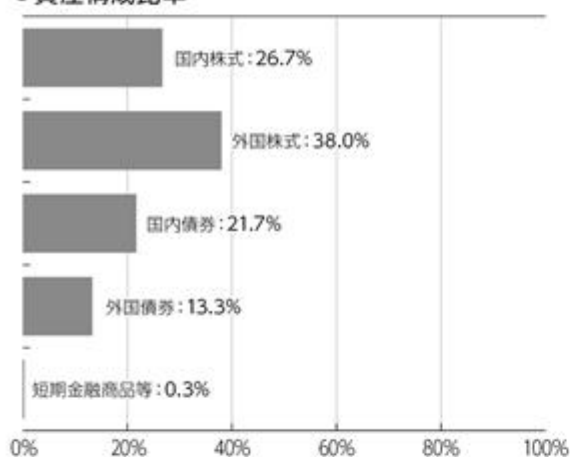
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12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。

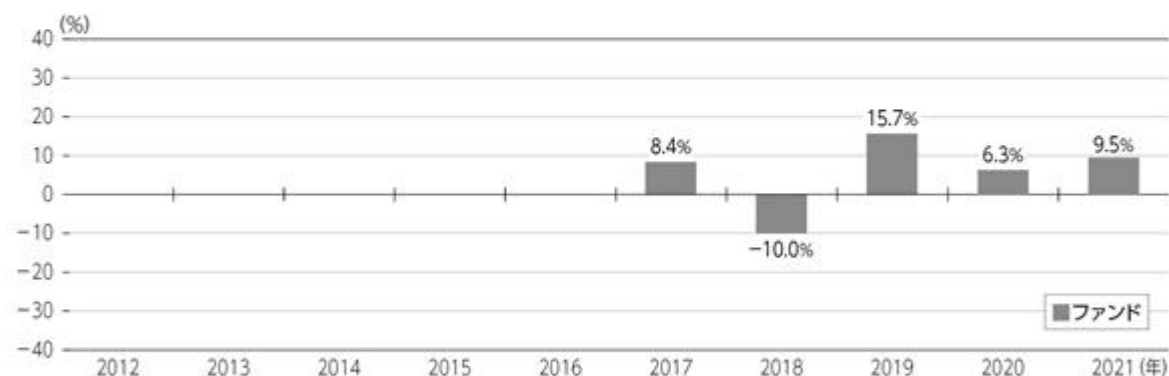
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●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。

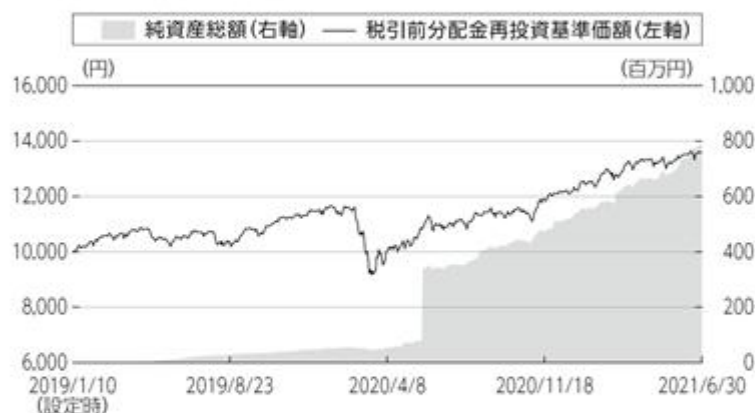
■ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。  
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2021年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

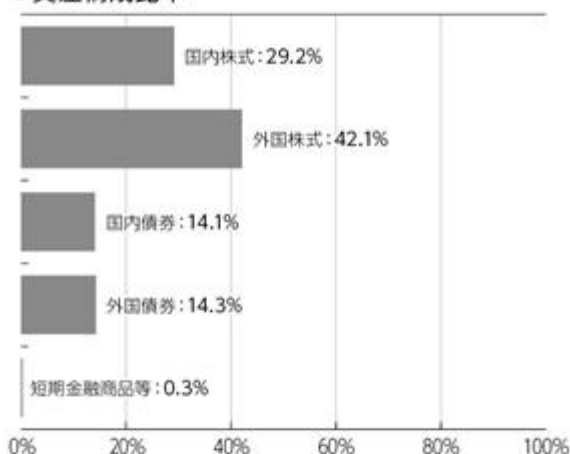
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	13,570円
純資産総額	795百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

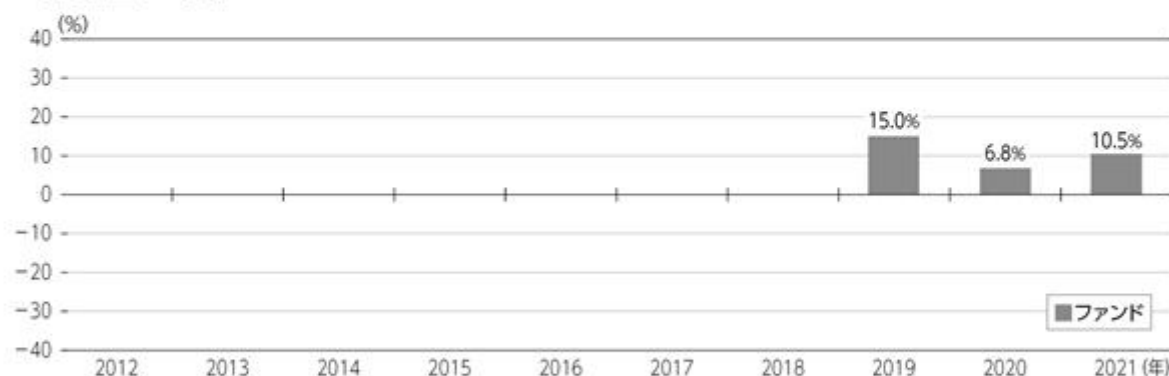
2019年12月	0円
2020年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●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。

・2019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。

## 3.運用実績

2021年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	13,512円
純資産総額	988百万円

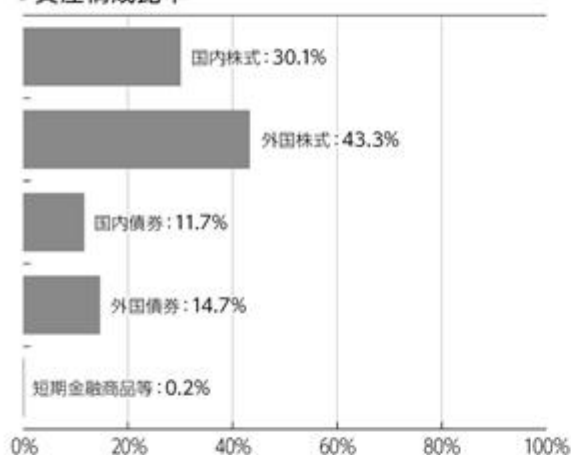
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12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。

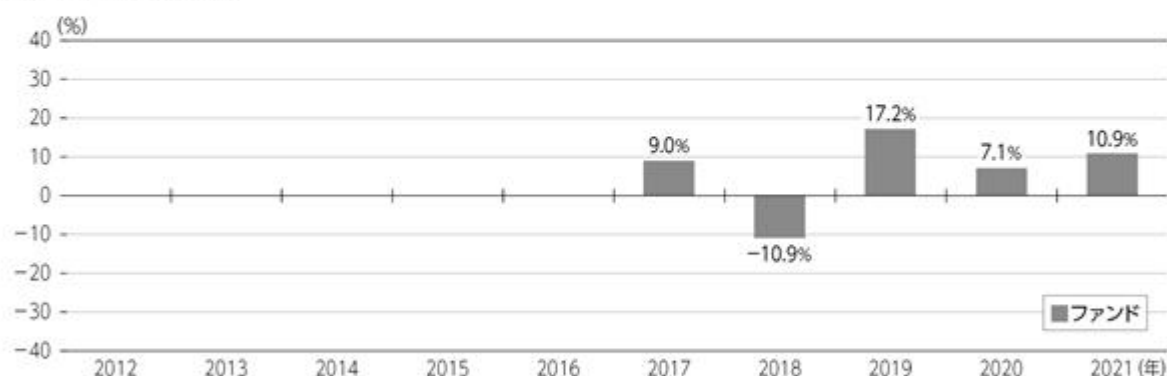
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●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。

2021年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

## ●基準価額・純資産の推移



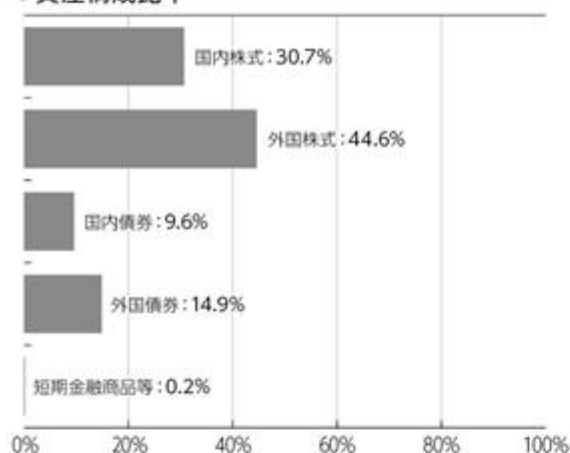
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	13,804円
純資産総額	269百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

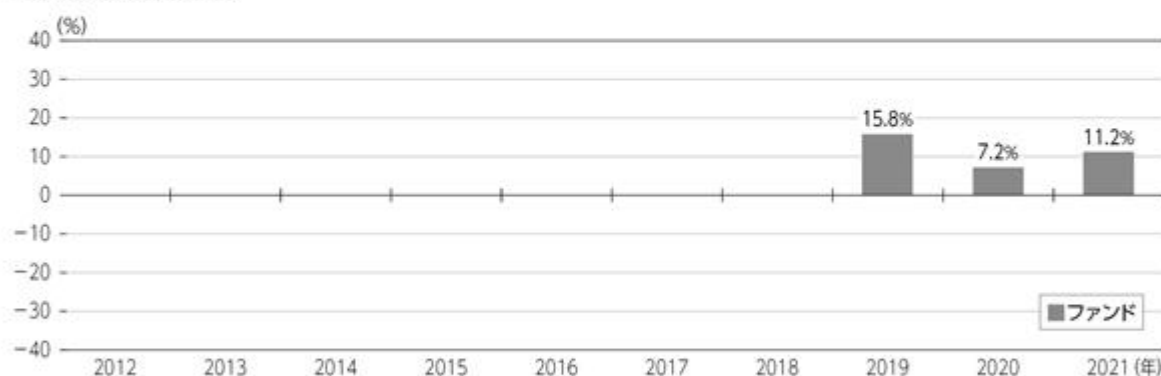
2019年12月	0円
2020年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●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。
- ・2019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。

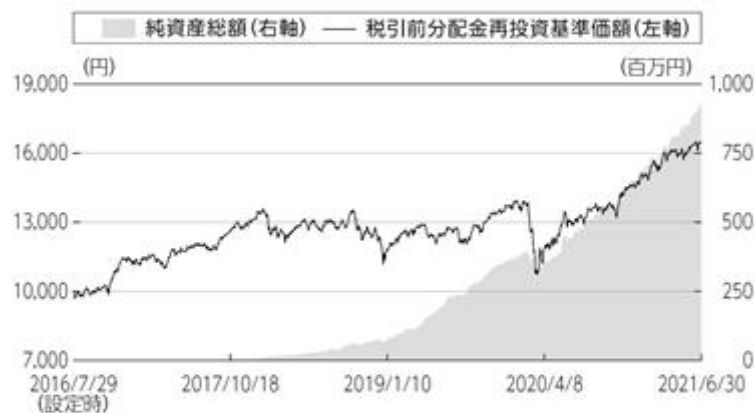
■ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。  
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 3.運用実績

2021年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

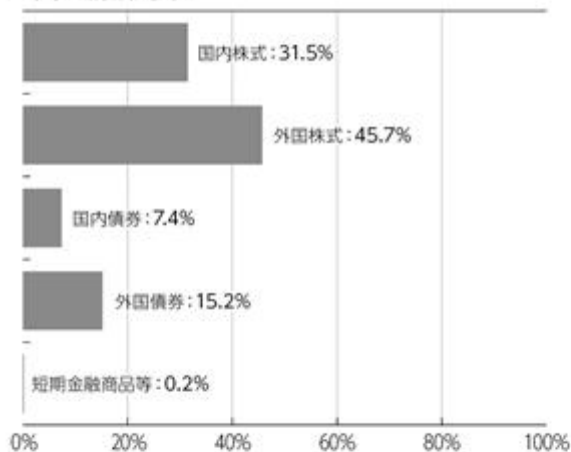
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	16,430円
純資産総額	940百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

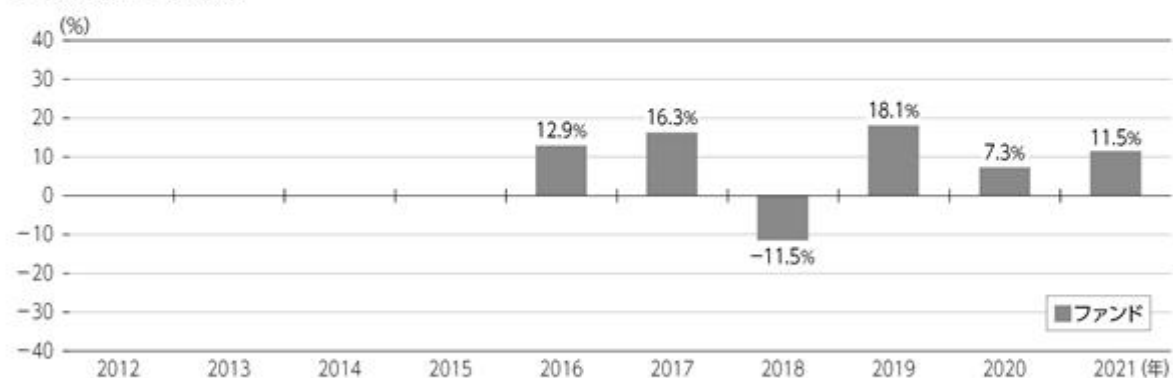
2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●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。

・2016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。

2021年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

## ●基準価額・純資産の推移



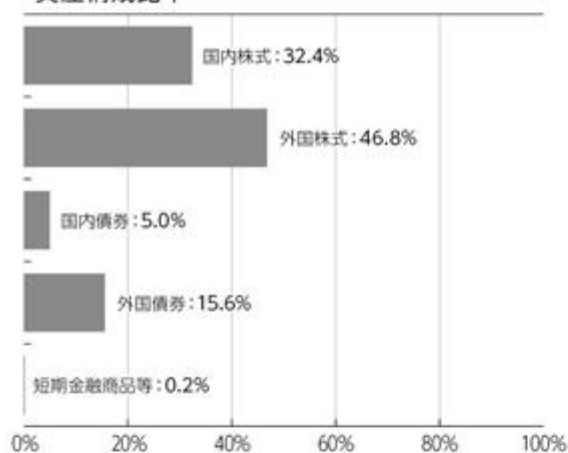
基準価額	13,997円
純資産総額	439百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

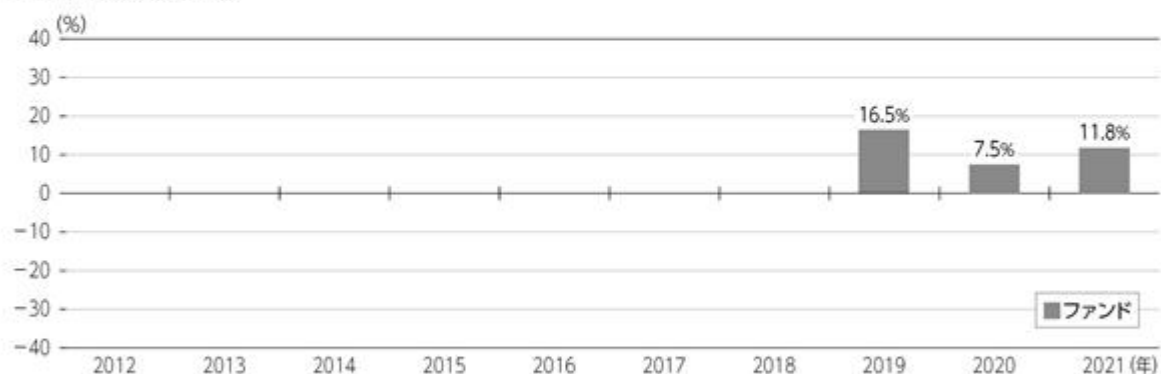
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●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。
- ・2019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。



## DCニッセイターゲットデートファンド2065

### ●基準価額・純資産の推移

ファンドは、2022年1月11日から運用を開始する予定のため、該当事項はありません。

### ●分配の推移

ファンドは、2022年1月11日から運用を開始する予定のため、該当事項はありません。

### ●主要な資産の状況

ファンドは、2022年1月11日から運用を開始する予定のため、該当事項はありません。

### ●年間収益率の推移

ファンドは、2022年1月11日から運用を開始する予定のため、該当事項はありません。  
なお、ファンドにはベンチマークはありません。

■ファンド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開示される予定です。

## 3.運用実績

2021年6月末現在

## ●マザーファンドの状況

## 1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.7%
2	ソニーグループ	2.5%
3	ソフトバンクグループ	2.3%
4	キーエンス	2.1%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	18.1%
2	情報・通信業	8.8%
3	輸送用機器	7.9%
4	化学	7.4%
5	サービス業	5.7%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	4.2%
2	マイクロソフト	情報技術	3.6%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.7%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.6%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.4%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&amp;PおよびMSCI Inc.に帰属します。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	72.1%
2	イギリス	4.6%
3	フランス	3.7%
4	カナダ	3.6%
5	スイス	3.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 3. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.3%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第328回 利付国債(10年)	2023/03/20	0.600%	1.0%
4	第70回 利付国債(20年)	2024/06/20	2.400%	0.9%
5	第127回 利付国債(20年)	2031/03/20	1.900%	0.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入債券種別

	種別	比率
	日本国債	74.6%
	その他	25.4%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 4. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	2024/05/15	2.500%	1.0%
2	アメリカ国債	2024/02/15	2.750%	1.0%
3	アメリカ国債	2026/05/15	1.625%	0.8%
4	アメリカ国債	2023/11/15	2.750%	0.8%
5	アメリカ国債	2025/11/15	2.250%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	44.8%
2	フランス	10.2%
3	イタリア	9.5%
4	ドイツ	7.6%
5	イギリス	6.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

❶ 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（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、申込みの受付けを行いません）。

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

金融商品取引所の取引の停止、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）

当初設定日：「ターゲットデート2065」につき、受益権1口当たり1円とします。

継続申込期間：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（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、換金の受付けを行いません）。

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

金融商品取引所の取引の停止、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6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。
外国株式	金融商品取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内不動産投資信託証券	金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
外国不動産投資信託証券	金融商品取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

「ターゲットデート2025」

2017年7月31日から2036年12月22日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2030」

2019年1月10日から2041年12月20日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2035」

2017年7月31日から2046年12月20日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2040」

2019年1月10日から2051年12月20日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2045」

2017年7月31日から2056年12月20日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2050」

2019年1月10日から2061年12月20日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2055」

2016年7月29日から2066年12月20日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2060」

2019年1月10日から2071年12月21日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

「ターゲットデート2065」

2022年1月11日から2076年12月21日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4) 【計算期間】

「ターゲットデート2025 / 2030 / 2035 / 2040 / 2045 / 2050 / 2055 / 2060」

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

「ターゲットデート2065」

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2022年1月11日から2022年12月20日までとします。

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

#### (5) 【その他】

##### 繰上償還

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

・受益権の口数が10億口を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

5. 前記2.から4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむ

を得ない事情が生じている場合であって、前記2.から4.までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

6. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更等 2. 」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
9. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。

#### 約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1.から7.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

電子公告により行い、委託会社のホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)に掲載します。  
電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の  
公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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



#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

##### (2) 償還金に対する請求権

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

##### (3) 解約請求権

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

##### (4) 帳簿閲覧権

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

##### (5) 書面決議における議決権

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

##### (6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

### 第3【ファンドの経理状況】

#### DCニッセイターゲットデートファンド2065

ファンドの運用は、2022年1月11日から開始する予定であり、ファンドは有価証券届出書提出日現在、何ら資産を保有しておりません。

ファンドの会計監査は、有限責任監査法人トーマツにより行われます。

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）ならびに同規則第2条の2の規定により、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）ならびに同規則第38条の3および第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）に基づき作成されます。監査証明を受けたファンドの財務諸表は計算期間毎に作成する有価証券報告書に掲載され、監査証明を受けた中間財務諸表は計算期間開始後6ヵ月経過後に作成する半期報告書に掲載されます。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2025

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（2019年12月21日から2020年12月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2030

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) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 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2期計算期間（2019年12月21日から2020年12月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2035

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（2019年12月21日から2020年12月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

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) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 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2期計算期間(2019年12月21日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

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(2019年12月21日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

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) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 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2期計算期間(2019年12月21日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

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5期計算期間(2019年12月21日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

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) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 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2期計算期間(2019年12月21日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2025】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2019年12月20日現在)	第4期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,863	10,937
コール・ローン	537,548	1,606,303
親投資信託受益証券	457,916,156	1,301,167,147
未収入金	108,423	3,478,451
流動資産合計	458,567,990	1,306,262,838
資産合計		
	458,567,990	1,306,262,838
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	96,859	3,445,781
未払受託者報酬	59,863	180,499
未払委託者報酬	479,108	1,444,368
その他未払費用	19,874	57,812
流動負債合計	655,704	5,128,460
負債合計		
	655,704	5,128,460
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	430,876,035	1,200,644,638
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	27,036,251	100,489,740
純資産合計	457,912,286	1,301,134,378
負債純資産合計	458,567,990	1,306,262,838

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)	第4期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	8
有価証券売買等損益	12,747,233	32,097,667
営業収益合計	12,747,235	32,097,675
<b>営業費用</b>		
支払利息	37	192
受託者報酬	81,492	268,890
委託者報酬	654,191	2,151,781
その他費用	27,077	87,205
営業費用合計	762,797	2,508,068
営業利益又は営業損失( )	11,984,438	29,589,607
経常利益又は経常損失( )	11,984,438	29,589,607
当期純利益又は当期純損失( )	11,984,438	29,589,607
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( )	527,174	1,265,428
期首剰余金又は期首欠損金( )	529,487	27,036,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,898,729	51,624,133
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	15,898,729	51,624,133
剰余金減少額又は欠損金増加額	849,229	9,025,679
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	849,229	9,025,679
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( )	27,036,251	100,489,740

## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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 2019年12月20日現在	第4期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	430,876,035口	1,200,644,638口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0627円 (10,627円)	1.0837円 (10,837円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日	第4期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(9,572,095円)、収益調整金(18,392,035円)及び分配準備積立金(25,457円)より分配対象収益は27,989,587円(1口当たり0.064960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(30,855,186円)、収益調整金(70,485,387円)及び分配準備積立金(7,508,487円)より分配対象収益は108,849,060円(1口当たり0.090659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2018年12月21日 至2019年12月20日	第4期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	11,279,881	32,338,375
合計	11,279,881	32,338,375

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	75,195,875円	430,876,035円
期中追加設定元本額	387,560,915円	922,348,817円
期中一部解約元本額	31,880,755円	152,580,214円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	77,782,377	152,966,822	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	47,503,883	102,636,889	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	1,010,176,510	994,922,844	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	34,687,713	50,640,592	
親投資信託受益証券 合計		1,170,150,483	1,301,167,147	
合計		1,170,150,483	1,301,167,147	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2030】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	747	9,944
コール・ローン	68,498	1,460,463
親投資信託受益証券	73,588,451	1,170,152,818
未収入金	2,166,291	609,648
流動資産合計	75,823,987	1,172,232,873
資産合計	75,823,987	1,172,232,873
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,164,317	579,176
未払受託者報酬	7,410	158,467
未払委託者報酬	62,045	1,320,920
その他未払費用	2,407	52,062
流動負債合計	2,236,179	2,110,625
負債合計	2,236,179	2,110,625
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,627,246	1,014,388,366
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,960,562	155,733,882
純資産合計	73,587,808	1,170,122,248
負債純資産合計	75,823,987	1,172,232,873

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2019年1月10日 至2019年12月20日)	第2期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	4
有価証券売買等損益	3,260,221	73,768,231
営業収益合計	3,260,221	73,768,235
<b>営業費用</b>		
支払利息	2	137
受託者報酬	8,893	184,734
委託者報酬	74,441	1,540,114
その他費用	2,837	60,745
営業費用合計	86,173	1,785,730
営業利益又は営業損失( )	3,174,048	71,982,505
経常利益又は経常損失( )	3,174,048	71,982,505
当期純利益又は当期純損失( )	3,174,048	71,982,505
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( )	182,640	303,060
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	6,960,562
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,308,833	79,301,832
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,308,833	79,301,832
剰余金減少額又は欠損金増加額	339,679	2,207,957
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	339,679	2,207,957
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( )	6,960,562	155,733,882

## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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1期 2019年12月20日現在	第2期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	66,627,246口	1,014,388,366口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1045円 (11,045円)	1.1535円 (11,535円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,991,410円)、収益調整金(3,969,154円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は6,960,564円(1口当たり0.104470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(71,679,576円)、収益調整金(81,453,024円)及び分配準備積立金(2,601,415円)より分配対象収益は155,734,015円(1口当たり0.153525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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,958,214	69,701,876
合計	2,958,214	69,701,876

## (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1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	1,000,000円	66,627,246円
期中追加設定元本額	72,774,281円	973,321,960円
期中一部解約元本額	7,147,035円	25,560,840円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	156,868,713	308,498,010	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	104,335,597	225,427,490	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	559,640,146	551,189,579	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	58,249,017	85,037,739	
親投資信託受益証券 合計		879,093,473	1,170,152,818	
合計		879,093,473	1,170,152,818	

## 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。



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2035】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2019年12月20日現在)	第4期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	7,697	15,259
コール・ローン	705,672	2,241,162
親投資信託受益証券	564,974,439	1,687,518,709
未収入金	631,935	499,437
流動資産合計	566,319,743	1,690,274,567
資産合計	566,319,743	1,690,274,567
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	616,614	454,150
未払受託者報酬	73,353	235,397
未払委託者報酬	636,063	2,040,557
その他未払費用	24,381	71,267
流動負債合計	1,350,411	2,801,371
負債合計	1,350,411	2,801,371
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	502,122,903	1,413,786,138
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	62,846,429	273,687,058
純資産合計	564,969,332	1,687,473,196
負債純資産合計	566,319,743	1,690,274,567

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第3期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)	第4期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	14
有価証券売買等損益	42,179,531	136,890,863
営業収益合計	42,179,533	136,890,877
<b>営業費用</b>		
支払利息	39	326
受託者報酬	98,566	344,273
委託者報酬	856,589	2,984,507
その他費用	32,709	107,115
営業費用合計	987,903	3,436,221
営業利益又は営業損失（ ）	41,191,630	133,454,656
経常利益又は経常損失（ ）	41,191,630	133,454,656
当期純利益又は当期純損失（ ）	41,191,630	133,454,656
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（ ）	1,138,685	2,850,535
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	726,883	62,846,429
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,845,558	90,895,601
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	24,845,558	90,895,601
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,325,191	16,360,163
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,325,191	16,360,163
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（ ）	62,846,429	273,687,058

## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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 2019年12月20日現在	第4期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	502,122,903口	1,413,786,138口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1252円 (11,252円)	1.1936円 (11,936円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日	第4期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(35,591,124円)、収益調整金(41,276,792円)及び分配準備積立金(50,632円)より分配対象収益は76,918,548円(1口当たり0.153187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(136,305,463円)、収益調整金(187,336,636円)及び分配準備積立金(29,235,726円)より分配対象収益は352,877,825円(1口当たり0.249598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2018年12月21日 至2019年12月20日	第4期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	39,659,119	142,698,625
合計	39,659,119	142,698,625

(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
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	70,782,099円	502,122,903円
期中追加設定元本額	472,272,256円	1,069,111,112円
期中一部解約元本額	40,931,452円	157,447,877円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	326,252,737	641,608,632	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	220,922,231	477,324,572	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	407,054,184	400,907,665	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	114,855,703	167,677,840	
親投資信託受益証券 合計		1,069,084,855	1,687,518,709	
合計		1,069,084,855	1,687,518,709	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2040】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	511	4,474
コール・ローン	46,894	657,083
親投資信託受益証券	46,572,808	520,332,609
未収入金	1,263	86,955
流動資産合計	46,621,476	521,081,121
資産合計	46,621,476	521,081,121
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	73,074
未払受託者報酬	4,884	68,925
未払委託者報酬	42,651	597,665
その他未払費用	1,554	22,897
流動負債合計	49,089	762,561
負債合計	49,089	762,561
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	40,633,922	426,598,305
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,938,465	93,720,255
純資産合計	46,572,387	520,318,560
負債純資産合計	46,621,476	521,081,121

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2019年1月10日 至2019年12月20日)	第2期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	3,244,199	50,813,688
営業収益合計	3,244,199	50,813,689
<b>営業費用</b>		
支払利息	1	29
受託者報酬	5,672	83,584
委託者報酬	49,656	725,067
その他費用	1,746	27,711
営業費用合計	57,075	836,391
営業利益又は営業損失( )	3,187,124	49,977,298
経常利益又は経常損失( )	3,187,124	49,977,298
当期純利益又は当期純損失( )	3,187,124	49,977,298
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( )	74,615	222,433
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	5,938,465
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,975,448	40,450,156
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	2,975,448	40,450,156
剰余金減少額又は欠損金増加額	149,492	2,423,231
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	149,492	2,423,231
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( )	5,938,465	93,720,255



## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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1期 2019年12月20日現在	第2期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	40,633,922口	426,598,305口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1461円 (11,461円)	1.2197円 (12,197円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,112,510円)、収益調整金(2,825,956円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は5,938,466円(1口当たり0.146146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(49,754,892円)、収益調整金(41,344,515円)及び分配準備積立金(2,620,876円)より分配対象収益は93,720,283円(1口当たり0.219692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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,098,467	49,585,571
合計	3,098,467	49,585,571

(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1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	1,000,000円	40,633,922円
期中追加設定元本額	42,349,876円	409,608,219円
期中一部解約元本額	2,715,954円	23,643,836円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	109,012,745	214,384,464	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	73,895,947	159,659,583	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	92,386,523	90,991,486	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	37,877,304	55,297,076	
親投資信託受益証券 合計		313,172,519	520,332,609	
合計		313,172,519	520,332,609	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2045】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2019年12月20日現在)	第4期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,517	6,067
コール・ローン	322,477	891,074
親投資信託受益証券	264,524,096	682,778,651
未収入金	1,149,288	852,988
流動資産合計	265,999,378	684,528,780
資産合計	265,999,378	684,528,780
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,142,158	834,585
未払受託者報酬	33,526	93,371
未払委託者報酬	290,905	809,620
その他未払費用	11,097	31,045
流動負債合計	1,477,686	1,768,621
負債合計	1,477,686	1,768,621
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	233,137,568	563,954,983
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,384,124	118,805,176
純資産合計	264,521,692	682,760,159
負債純資産合計	265,999,378	684,528,780

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)	第4期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	4
有価証券売買等損益	22,124,412	58,308,470
営業収益合計	22,124,412	58,308,474
<b>営業費用</b>		
支払利息	7	64
受託者報酬	46,674	143,592
委託者報酬	406,100	1,245,205
その他費用	15,400	47,719
営業費用合計	468,181	1,436,580
営業利益又は営業損失（ ）	21,656,231	56,871,894
経常利益又は経常損失（ ）	21,656,231	56,871,894
当期純利益又は当期純損失（ ）	21,656,231	56,871,894
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（ ）	933,869	255,075
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	585,573	31,384,124
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,941,789	39,933,179
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	11,941,789	39,933,179
剰余金減少額又は欠損金増加額	694,454	9,639,096
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	694,454	9,639,096
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（ ）	31,384,124	118,805,176

## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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 2019年12月20日現在	第4期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	233,137,568口	563,954,983口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1346円 (11,346円)	1.2107円 (12,107円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日	第4期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(18,002,575円)、収益調整金(20,506,159円)及び分配準備積立金(41,273円)より分配対象収益は38,550,007円(1口当たり0.165353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(57,127,022円)、収益調整金(78,970,919円)及び分配準備積立金(14,280,861円)より分配対象収益は150,378,802円(1口当たり0.266650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2018年12月21日 至2019年12月20日	第4期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	20,576,520	61,295,524
合計	20,576,520	61,295,524

(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
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	43,997,897円	233,137,568円
期中追加設定元本額	215,465,288円	414,415,117円
期中一部解約元本額	26,325,617円	83,597,702円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	147,185,347	289,454,703	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	99,812,627	215,655,161	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	104,674,362	103,093,779	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	51,082,272	74,575,008	
親投資信託受益証券 合計		402,754,608	682,778,651	
合計		402,754,608	682,778,651	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2050】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	291	1,165
コール・ローン	26,647	171,059
親投資信託受益証券	25,150,604	146,697,349
未収入金	677	8,713
流動資産合計	25,178,219	146,878,286
資産合計	25,178,219	146,878,286
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	4,817
未払受託者報酬	2,752	17,976
未払委託者報酬	24,251	156,158
その他未払費用	838	5,925
流動負債合計	27,841	184,876
負債合計	27,841	184,876
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	21,794,219	118,987,624
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,356,159	27,705,786
純資産合計	25,150,378	146,693,410
負債純資産合計	25,178,219	146,878,286

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2019年1月10日 至2019年12月20日)	第2期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
営業収益		
有価証券売買等損益	1,989,457	13,466,036
営業収益合計	1,989,457	13,466,036
営業費用		
受託者報酬	3,302	24,205
委託者報酬	29,186	210,466
その他費用	947	7,935
営業費用合計	33,435	242,606
営業利益又は営業損失( )	1,956,022	13,223,430
経常利益又は経常損失( )	1,956,022	13,223,430
当期純利益又は当期純損失( )	1,956,022	13,223,430
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( )	180,474	113,563
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	3,356,159
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,791,183	13,270,375
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	1,791,183	13,270,375
剰余金減少額又は欠損金増加額	210,572	2,030,615
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	210,572	2,030,615
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( )	3,356,159	27,705,786

## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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1期 2019年12月20日現在	第2期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	21,794,219口	118,987,624口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1540円 (11,540円)	1.2328円 (12,328円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,775,548円)、収益調整金(1,580,611円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は3,356,159円(1口当たり0.153993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(13,109,867円)、収益調整金(13,342,154円)及び分配準備積立金(1,253,765円)より分配対象収益は27,705,786円(1口当たり0.232846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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,773,104	13,424,059
合計	1,773,104	13,424,059

## (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1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	1,000,000円	21,794,219円
期中追加設定元本額	24,368,600円	113,562,838円
期中一部解約元本額	3,574,381円	16,369,433円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	32,439,502	63,795,524	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	22,052,523	47,646,681	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	19,084,521	18,796,344	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	11,273,923	16,458,800	
親投資信託受益証券 合計		84,850,469	146,697,349	
合計		84,850,469	146,697,349	

## 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。



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2055】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年12月20日現在)	第5期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,815	5,775
コール・ローン	441,484	848,215
親投資信託受益証券	359,197,149	653,705,000
未収入金	372,838	73,466
流動資産合計	360,016,286	654,632,456
資産合計	360,016,286	654,632,456
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	363,097	55,884
未払受託者報酬	45,896	88,894
未払委託者報酬	398,175	770,810
その他未払費用	15,217	29,559
流動負債合計	822,385	945,147
負債合計	822,385	945,147
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	262,527,078	446,839,347
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	96,666,823	206,847,962
純資産合計	359,193,901	653,687,309
<b>負債純資産合計</b>	<b>360,016,286</b>	<b>654,632,456</b>

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)	第5期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	5
有価証券売買等損益	33,720,631	51,349,902
営業収益合計	33,720,631	51,349,907
<b>営業費用</b>		
支払利息	12	82
受託者報酬	65,335	151,322
委託者報酬	568,571	1,312,201
その他費用	21,635	50,295
営業費用合計	655,553	1,513,900
営業利益又は営業損失（ ）	33,065,078	49,836,007
経常利益又は経常損失（ ）	33,065,078	49,836,007
当期純利益又は当期純損失（ ）	33,065,078	49,836,007
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（ ）	1,338,766	2,688,981
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,073,156	96,666,823
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,837,509	94,659,487
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	59,837,509	94,659,487
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,970,154	37,003,336
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,970,154	37,003,336
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（ ）	96,666,823	206,847,962

## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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4期 2019年12月20日現在	第5期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	262,527,078口	446,839,347口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3682円 (13,682円)	1.4629円 (14,629円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第4期 自2018年12月21日 至2019年12月20日	第5期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(26,368,896円)、収益調整金(70,130,640円)及び分配準備積立金(167,299円)より分配対象収益は96,666,835円(1口当たり0.368217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(52,525,054円)、収益調整金(135,081,939円)及び分配準備積立金(19,241,046円)より分配対象収益は206,848,039円(1口当たり0.462914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4期 自2018年12月21日 至2019年12月20日	第5期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期	第5期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	31,537,108	58,788,290
合計	31,537,108	58,788,290

## (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4期	第5期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	60,828,074円	262,527,078円
期中追加設定元本額	228,564,856円	290,087,575円
期中一部解約元本額	26,865,852円	105,775,306円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	148,514,407	292,068,432	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	100,995,475	218,210,823	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	69,862,719	68,807,791	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	51,111,689	74,617,954	
親投資信託受益証券 合計		370,484,290	653,705,000	
合計		370,484,290	653,705,000	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2060】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期 (2020年12月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	283	1,422
コール・ローン	25,975	208,922
親投資信託受益証券	32,944,568	175,314,432
未収入金	711,338	805,628
流動資産合計	33,682,164	176,330,404
資産合計	33,682,164	176,330,404
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	710,480	800,960
未払受託者報酬	2,710	21,949
未払委託者報酬	23,843	190,527
その他未払費用	849	7,246
流動負債合計	737,882	1,020,682
負債合計	737,882	1,020,682
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	28,378,089	141,064,244
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,566,193	34,245,478
純資産合計	32,944,282	175,309,722
<b>負債純資産合計</b>	<b>33,682,164</b>	<b>176,330,404</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第1期 (自2019年 1月10日 至2019年12月20日)	第2期 (自2019年12月21日 至2020年12月21日)
営業収益		
有価証券売買等損益	1,911,501	16,753,739
営業収益合計	1,911,501	16,753,739
営業費用		
受託者報酬	3,571	29,092
委託者報酬	31,548	252,812
その他費用	1,078	9,554
営業費用合計	36,197	291,458
営業利益又は営業損失( )	1,875,304	16,462,281
経常利益又は経常損失( )	1,875,304	16,462,281
当期純利益又は当期純損失( )	1,875,304	16,462,281
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( )	164,123	1,064,507
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	4,566,193
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,499,744	22,431,260
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	3,499,744	22,431,260
剰余金減少額又は欠損金増加額	644,732	8,149,749
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	644,732	8,149,749
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( )	4,566,193	34,245,478



## ( 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12月20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、2019年12月21日から2020年12月21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1期 2019年12月20日現在	第2期 2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	28,378,089口	141,064,244口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1609円 (11,609円)	1.2428円 (12,428円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,711,181円)、収益調整金(2,855,012円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は4,566,193円(1口当たり0.160906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(15,397,774円)、収益調整金(18,191,608円)及び分配準備積立金(656,096円)より分配対象収益は34,245,478円(1口当たり0.242765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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日	第2期 自2019年12月21日 至2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,721,409	15,682,758
合計	1,721,409	15,682,758

## (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1期	第2期
	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
期首元本額	1,000,000円	28,378,089円
期中追加設定元本額	36,713,552円	179,902,566円
期中一部解約元本額	9,335,463円	67,216,411円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2020年12月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	40,714,679	80,069,487	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	27,731,351	59,916,356	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	15,023,532	14,796,676	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14,063,918	20,531,913	
親投資信託受益証券 合計		97,533,480	175,314,432	
合計		97,533,480	175,314,432	

## 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ニッセイターゲットデットファンド2060）は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,982,489	33,952,445
コール・ローン	1,557,058,854	4,986,667,516
株式	67,651,741,100	153,345,129,850
派生商品評価勘定	7,334,900	75,730,950
未収入金	-	77,172,500
未収配当金	7,814,340	35,772,456
差入委託証拠金	39,360,000	235,770,000
流動資産合計	69,280,291,683	158,790,195,717
資産合計	69,280,291,683	158,790,195,717
負債の部		
流動負債		
前受金	13,940,000	105,690,000
未払解約金	282,184,177	362,241,108
その他未払費用	2,094	4,422
流動負債合計	296,126,271	467,935,530
負債合計	296,126,271	467,935,530
純資産の部		
元本等		
元本	37,088,154,099	80,506,962,631
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,896,011,313	77,815,297,556
純資産合計	68,984,165,412	158,322,260,187
負債純資産合計	69,280,291,683	158,790,195,717

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1 . 受益権総口数	37,088,154,099口	80,506,962,631口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8600円 (18,600円)	1.9666円 (19,666円)



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,893,505,549	23,861,768,399
合計	4,893,505,549	23,861,768,399

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 株式関連

種類	2019年12月20日 現在			2020年12月21日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,407,940,000	-	1,415,320,000	7,380,000	4,758,760,000	-	4,834,640,000	75,880,000
合計	1,407,940,000	-	1,415,320,000	7,380,000	4,758,760,000	-	4,834,640,000	75,880,000

## (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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	33,490,455,341円	37,088,154,099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	14,453,233,240円	61,160,865,303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	10,855,534,482円	17,742,056,771円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,419,327,977円	5,935,899,360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)	4,490,244,383円	3,974,685,367円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,061,985円	3,915,536円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,468,992,924円	1,789,706,514円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,189,906,169円	6,126,052,143円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,475,361,436円	4,186,239,288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)	8,365,927円	6,001,047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)	35,197,323円	24,974,000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)	43,310,499円	28,716,782円
DCニッセイ国内株式インデックス	305,067,072円	467,123,177円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	14,513,159,469円	17,188,962,531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)	646,384,003円	1,089,549,066円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	86,317,623円	148,514,407円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	77,339,395円	142,344,408円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	60,519,729円	147,185,347円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	117,671,498円	326,252,737円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	36,314,500円	77,782,377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)	43,386,870円	56,245,861円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,618,040円	6,386,327円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,610,276円	6,216,803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)	1,046,984円	1,687,549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)	3,084,499円	4,750,436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)	17,023,422円	19,665,956円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	8,055,589円	40,714,679円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,898,975円	32,439,502円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	10,336,705円	109,012,745円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	11,550,827円	156,868,713円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	-円	38,401,696,464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	7,218,859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	51,250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	103,400円
計	37,088,154,099円	80,506,962,631円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	34,374,685,386円	37,088,154,099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	13,002,541,137円	61,160,865,303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	10,289,072,424円	17,742,056,771円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,419,327,977円	5,935,899,360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)	4,490,244,383円	3,974,685,367円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,061,985円	3,915,536円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,468,992,924円	1,789,706,514円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,189,906,169円	6,126,052,143円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,475,361,436円	4,186,239,288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)	8,365,927円	6,001,047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)	35,197,323円	24,974,000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)	43,310,499円	28,716,782円
DCニッセイ国内株式インデックス	305,067,072円	467,123,177円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	14,513,159,469円	17,188,962,531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)	646,384,003円	1,089,549,066円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	86,317,623円	148,514,407円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	77,339,395円	142,344,408円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	60,519,729円	147,185,347円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	117,671,498円	326,252,737円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	36,314,500円	77,782,377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)	43,386,870円	56,245,861円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,618,040円	6,386,327円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,610,276円	6,216,803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)	1,046,984円	1,687,549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)	3,084,499円	4,750,436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)	17,023,422円	19,665,956円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	8,055,589円	40,714,679円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,898,975円	32,439,502円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	10,336,705円	109,012,745円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	11,550,827円	156,868,713円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	-円	38,401,696,464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	7,218,859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	51,250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	103,400円
計	37,088,154,099円	80,506,962,631円

附属明細表(2020年12月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,000	2,947.00	8,841,000	
日本水産	84,100	427.00	35,910,700	
マルハニチロ	12,200	2,209.00	26,949,800	
雪国まいたけ	5,200	1,605.00	8,346,000	
カネコ種苗	2,600	1,596.00	4,149,600	
サカタのタネ	10,100	3,535.00	35,703,500	
ホクト	6,500	2,130.00	13,845,000	
ヒノキヤグループ	2,100	2,224.00	4,670,400	
ショーボンドホールディングス	13,100	5,030.00	65,893,000	
ミライト・ホールディングス	25,000	1,687.00	42,175,000	
タマホーム	4,500	1,450.00	6,525,000	
ファーストコーポレーション	5,500	710.00	3,905,000	
スペースバリューホールディングス	10,300	650.00	6,695,000	
住石ホールディングス	33,100	112.00	3,707,200	
日鉄鉱業	1,900	5,920.00	11,248,000	
三井松島ホールディングス	700	713.00	499,100	
国際石油開発帝石	309,200	575.00	177,790,000	
石油資源開発	11,000	1,929.00	21,219,000	
K&Oエナジーグループ	4,100	1,490.00	6,109,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,700	696.00	3,967,200	
安藤・間	50,100	711.00	35,621,100	
東急建設	24,600	505.00	12,423,000	
コムシスホールディングス	29,800	3,090.00	92,082,000	
ピーアールホールディングス	9,200	683.00	6,283,600	
高松コンストラクショングループ	5,200	2,048.00	10,649,600	
東建コーポレーション	2,600	7,940.00	20,644,000	
ソネック	4,600	874.00	4,020,400	
ヤマウラ	4,300	949.00	4,080,700	
大成建設	64,700	3,505.00	226,773,500	
大林組	194,200	884.00	171,672,800	
清水建設	197,000	765.00	150,705,000	
飛鳥建設	5,600	1,093.00	6,120,800	
長谷工コーポレーション	75,200	1,183.00	88,961,600	
松井建設	7,600	768.00	5,836,800	
銭高組	800	4,540.00	3,632,000	
鹿島建設	152,400	1,377.00	209,854,800	
不動テトラ	5,100	1,724.00	8,792,400	
大末建設	4,500	861.00	3,874,500	
鉄建建設	4,200	1,827.00	7,673,400	
西松建設	15,000	2,011.00	30,165,000	
三井住友建設	46,900	425.00	19,932,500	
大豊建設	4,600	3,570.00	16,422,000	
前田建設工業	48,600	916.00	44,517,600	
佐田建設	8,800	457.00	4,021,600	
ナカノフドー建設	9,700	418.00	4,054,600	
奥村組	9,100	2,507.00	22,813,700	
東鉄工業	8,300	2,753.00	22,849,900	
浅沼組	2,200	3,935.00	8,657,000	
戸田建設	80,600	658.00	53,034,800	
熊谷組	9,000	2,515.00	22,635,000	
北野建設	1,500	2,520.00	3,780,000	
植木組	1,400	2,824.00	3,953,600	
矢作建設工業	8,600	874.00	7,516,400	
ピーエス三菱	6,900	601.00	4,146,900	
日本ハウスホールディングス	16,400	294.00	4,821,600	

大東建託	21,200	9,350.00	198,220,000
新日本建設	8,300	825.00	6,847,500
N I P P O	16,100	2,721.00	43,808,100
東亜道路工業	1,200	3,785.00	4,542,000
前田道路	17,100	1,723.00	29,463,300
日本道路	1,900	7,610.00	14,459,000
東亜建設工業	6,100	1,932.00	11,785,200
日本国土開発	18,900	560.00	10,584,000
若築建設	3,500	1,179.00	4,126,500
東洋建設	21,800	420.00	9,156,000
五洋建設	77,000	855.00	65,835,000
世紀東急工業	9,300	833.00	7,746,900
福田組	2,200	5,460.00	12,012,000
住友林業	49,200	2,215.00	108,978,000
日本基礎技術	7,700	499.00	3,842,300
巴コーポレーション	5,200	410.00	2,132,000
大和ハウス工業	192,100	3,024.00	580,910,400
ライト工業	11,100	1,793.00	19,902,300
積水ハウス	210,600	2,013.50	424,043,100
日特建設	5,100	806.00	4,110,600
北陸電気工事	3,400	1,284.00	4,365,600
ユアテック	11,100	721.00	8,003,100
日本リーテック	4,100	2,306.00	9,454,600
四電工	1,500	2,851.00	4,276,500
中電工	7,800	2,158.00	16,832,400
関電工	27,600	806.00	22,245,600
きんでん	46,100	1,659.00	76,479,900
東京エネシス	6,400	862.00	5,516,800
トーエネック	2,000	3,955.00	7,910,000
住友電設	5,500	2,487.00	13,678,500
日本電設工業	10,600	2,084.00	22,090,400
協和エクシオ	29,400	2,853.00	83,878,200
新日本空調	5,100	2,260.00	11,526,000
日本工営	4,000	2,647.00	10,588,000
九電工	13,600	3,175.00	43,180,000
三機工業	13,800	1,190.00	16,422,000
日揮ホールディングス	59,800	956.00	57,168,800
中外炉工業	2,400	1,605.00	3,852,000
ヤマト	6,200	712.00	4,414,400
太平電業	4,700	2,391.00	11,237,700
高砂熱学工業	14,900	1,520.00	22,648,000
三晃金属工業	1,500	2,789.00	4,183,500
N E C ネットエスアイ	17,200	1,824.00	31,372,800
朝日工業社	1,300	3,125.00	4,062,500
明星工業	12,600	786.00	9,903,600
大気社	9,400	2,737.00	25,727,800
ダイダン	4,600	2,846.00	13,091,600
日比谷総合設備	6,200	1,885.00	11,687,000
日本製粉	18,200	1,635.00	29,757,000
日清製粉グループ本社	70,200	1,646.00	115,549,200
昭和産業	5,700	3,085.00	17,584,500
鳥越製粉	5,500	1,009.00	5,549,500
中部飼料	7,600	1,405.00	10,678,000
フィード・ワン	8,300	887.00	7,362,100
日本甜菜製糖	3,200	1,616.00	5,171,200
三井製糖	5,400	1,823.00	9,844,200
塩水港精糖	17,700	222.00	3,929,400
日新製糖	2,900	1,863.00	5,402,700
L I F U L L	20,600	382.00	7,869,200
ミクシィ	11,300	2,552.00	28,837,600

ジェイエシーリクルートメント	4,000	1,874.00	7,496,000
日本M&Aセンター	45,300	6,750.00	305,775,000
メンバーズ	1,700	2,183.00	3,711,100
UTグループ	9,300	3,300.00	30,690,000
アイティメディア	2,400	2,269.00	5,445,600
タケエイ	6,500	1,277.00	8,300,500
ビーネックスグループ	7,400	1,138.00	8,421,200
コシダカホールディングス	14,200	434.00	6,162,800
アルトナー	4,300	962.00	4,136,600
パソナグループ	6,400	2,248.00	14,387,200
CDS	3,000	1,370.00	4,110,000
リンクアンドモチベーション	10,900	571.00	6,223,900
GCA	7,700	757.00	5,828,900
エス・エム・エス	18,400	3,825.00	70,380,000
サニーサイドアップグループ	6,000	645.00	3,870,000
パーソルホールディングス	59,100	2,008.00	118,672,800
リニカル	5,400	731.00	3,947,400
クックパッド	18,600	326.00	6,063,600
アイ・ケイ・ケイ	6,300	634.00	3,994,200
森永製菓	14,600	3,855.00	56,283,000
中村屋	1,600	3,995.00	6,392,000
江崎グリコ	17,100	4,565.00	78,061,500
名糖産業	3,000	1,520.00	4,560,000
井村屋グループ	3,500	2,617.00	9,159,500
不二家	4,000	2,435.00	9,740,000
山崎製パン	46,600	1,751.00	81,596,600
モロゾフ	1,100	5,980.00	6,578,000
亀田製菓	3,500	4,885.00	17,097,500
寿スピリッツ	6,000	5,010.00	30,060,000
カルビー	28,300	3,020.00	85,466,000
森永乳業	11,500	4,995.00	57,442,500
六甲バター	4,100	1,898.00	7,781,800
ヤクルト本社	42,700	5,230.00	223,321,000
明治ホールディングス	41,100	7,170.00	294,687,000
雪印メグミルク	15,000	2,189.00	32,835,000
プリマハム	9,700	3,190.00	30,943,000
日本ハム	23,700	4,595.00	108,901,500
林兼産業	6,600	594.00	3,920,400
丸大食品	6,600	1,721.00	11,358,600
S Foods	5,000	3,350.00	16,750,000
柿安本店	2,200	2,566.00	5,645,200
伊藤ハム米久ホールディングス	40,000	687.00	27,480,000
学情	3,600	1,397.00	5,029,200
スタジオアリス	3,000	1,980.00	5,940,000
クロスキャット	2,900	1,198.00	3,474,200
シミックホールディングス	2,900	1,341.00	3,888,900
システナ	21,700	2,156.00	46,785,200
NJS	2,000	2,094.00	4,188,000
デジタルアーツ	3,000	9,190.00	27,570,000
日鉄ソリューションズ	9,100	2,993.00	27,236,300
総合警備保障	23,500	5,270.00	123,845,000
キューブシステム	3,200	1,297.00	4,150,400
いちご	77,700	311.00	24,164,700
日本駐車場開発	60,300	150.00	9,045,000
コア	2,700	1,425.00	3,847,500
カカクコム	43,700	2,851.00	124,588,700
アイロムグループ	2,100	1,675.00	3,517,500
セントケア・ホールディング	4,400	873.00	3,841,200
ルネサンス	4,500	920.00	4,140,000
ディップ	8,100	2,801.00	22,688,100

SBSホールディングス	4,600	2,616.00	12,033,600
デジタルホールディングス	4,100	1,802.00	7,388,200
新日本科学	6,400	662.00	4,236,800
ツクイホールディングス	13,900	550.00	7,645,000
ベネフィット・ワン	21,500	3,095.00	66,542,500
エムスリー	130,500	9,361.00	1,221,610,500
ツカダ・グローバルホールディング	14,700	259.00	3,807,300
アウトソーシング	33,900	1,427.00	48,375,300
ウェルネット	7,800	467.00	3,642,600
ワールドホールディングス	2,000	2,077.00	4,154,000
ディー・エヌ・エー	25,000	1,877.00	46,925,000
博報堂DYホールディングス	82,300	1,409.00	115,960,700
ぐるなび	10,300	533.00	5,489,900
タカミヤ	7,000	525.00	3,675,000
ジャパンベストレスキューシステム	4,700	894.00	4,201,800
ファンコミュニケーションズ	16,300	437.00	7,123,100
ライク	2,000	2,046.00	4,092,000
ビジネス・ブレークスルー	9,200	443.00	4,075,600
エスプール	15,200	730.00	11,096,000
WDBホールディングス	2,700	2,744.00	7,408,800
パリュコマース	4,000	3,240.00	12,960,000
インフォマート	59,800	936.00	55,972,800
サッポロホールディングス	21,200	2,068.00	43,841,600
アサヒグループホールディングス	135,800	4,220.00	573,076,000
麒麟ホールディングス	263,500	2,413.50	635,957,250
宝ホールディングス	46,100	1,254.00	57,809,400
オエノンホールディングス	17,600	398.00	7,004,800
養命酒製造	2,100	1,883.00	3,954,300
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	47,600	1,617.00	76,969,200
サントリー食品インターナショナル	41,600	3,795.00	157,872,000
ダイドーグループホールディングス	3,200	5,600.00	17,920,000
伊藤園	18,900	6,440.00	121,716,000
キーコーヒー	6,100	2,151.00	13,121,100
日清オイリオグループ	8,000	3,045.00	24,360,000
不二製油グループ本社	15,100	2,915.00	44,016,500
かどや製油	1,000	3,965.00	3,965,000
J・オイルミルズ	3,200	3,495.00	11,184,000
ローソン	15,400	4,760.00	73,304,000
サンエー	5,100	4,125.00	21,037,500
カワチ薬品	4,700	2,942.00	13,827,400
エービーシー・マート	9,500	5,370.00	51,015,000
ハードオフコーポレーション	5,800	714.00	4,141,200
アスクル	6,400	3,825.00	24,480,000
ゲオホールディングス	11,000	1,219.00	13,409,000
アダストリア	8,400	1,905.00	16,002,000
ジーフット	9,100	412.00	3,749,200
伊藤忠食品	1,600	5,500.00	8,800,000
くら寿司	3,600	6,490.00	23,364,000
キャンドウ	2,900	1,890.00	5,481,000
エレマテック	5,700	1,014.00	5,779,800
パルグループホールディングス	6,200	1,183.00	7,334,600
エディオン	28,000	1,013.00	28,364,000
あらた	4,900	5,000.00	24,500,000
サーラコーポレーション	12,400	571.00	7,080,400
トーメンデバイス	1,200	3,350.00	4,020,000
ハローズ	2,300	3,595.00	8,268,500
JPホールディングス	18,600	287.00	5,338,200
フジオフードグループ本社	5,100	1,371.00	6,992,100
あみやき亭	1,400	2,852.00	3,992,800



東京エレクトロン デバイス	2,200	3,160.00	6,952,000
双日	336,800	234.00	78,811,200
アルフレッサ ホールディングス	67,800	2,023.00	137,159,400
大黒天物産	1,500	6,050.00	9,075,000
ハニーズホールディングス	5,400	961.00	5,189,400
キッコーマン	44,700	6,510.00	290,997,000
味の素	137,200	2,297.00	315,148,400
キュービー	34,600	2,199.00	76,085,400
ハウス食品グループ本社	23,200	3,800.00	88,160,000
カゴメ	25,400	3,715.00	94,361,000
アリアケジャパン	5,700	7,080.00	40,356,000
ピエトロ	1,000	1,718.00	1,718,000
エバラ食品工業	1,700	2,440.00	4,148,000
ニチレイ	29,600	2,758.00	81,636,800
横浜冷凍	15,900	865.00	13,753,500
東洋水産	32,000	4,955.00	158,560,000
イトアンドホールディングス	2,100	1,844.00	3,872,400
大冷	2,000	1,997.00	3,994,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,500	791.00	3,559,500
日清食品ホールディングス	26,400	8,670.00	228,888,000
永谷園ホールディングス	3,000	2,274.00	6,822,000
一正蒲鉾	3,400	1,217.00	4,137,800
フジッコ	6,700	2,027.00	13,580,900
ロック・フィールド	6,700	1,638.00	10,974,600
日本たばこ産業	333,200	2,190.00	729,708,000
ケンコーマヨネーズ	3,500	1,931.00	6,758,500
わらべや日洋ホールディングス	4,100	1,452.00	5,953,200
なとり	3,500	1,909.00	6,681,500
ピックルスコーポレーション	1,400	3,120.00	4,368,000
北の達人コーポレーション	21,700	490.00	10,633,000
ユーグレナ	26,900	835.00	22,461,500
スター・マイカ・ホールディングス	3,200	1,337.00	4,278,400
A Dワークスグループ	25,100	161.00	4,041,100
片倉工業	8,100	1,384.00	11,210,400
ゲンゼ	4,500	3,475.00	15,637,500
ヒューリック	129,500	1,088.00	140,896,000
ラサ商事	4,300	903.00	3,882,900
アルペン	4,700	2,382.00	11,195,400
ラクーンホールディングス	3,000	1,801.00	5,403,000
クオールホールディングス	9,000	1,120.00	10,080,000
アルコニックス	6,500	1,505.00	9,782,500
神戸物産	42,100	3,175.00	133,667,500
ソリトンシステムズ	3,000	1,922.00	5,766,000
ジンズホールディングス	3,200	6,890.00	22,048,000
ピックカメラ	36,200	1,126.00	40,761,200
D C Mホールディングス	37,300	1,169.00	43,603,700
MonotaRO	43,400	5,430.00	235,662,000
東京一番フーズ	6,700	565.00	3,785,500
あい ホールディングス	8,700	2,104.00	18,304,800
ディー・ブイエックス	3,700	1,020.00	3,774,000
きちりホールディングス	5,900	657.00	3,876,300
アークランドサービスホールディングス	5,100	2,200.00	11,220,000
J . フロント リテイリング	72,800	845.00	61,516,000
ドトール・日レスホールディングス	8,800	1,513.00	13,314,400
マツモトキヨシホールディングス	25,200	4,425.00	111,510,000
ブロンコビリー	3,200	2,399.00	7,676,800
Z O Z O	41,900	2,540.00	106,426,000
トレジャー・ファクトリー	5,400	694.00	3,747,600
物語コーポレーション	1,600	12,680.00	20,288,000
ココカラファイン	6,400	7,410.00	47,424,000

三越伊勢丹ホールディングス	106,700	613.00	65,407,100
東洋紡	24,000	1,378.00	33,072,000
ユニチカ	17,800	395.00	7,031,000
富士紡ホールディングス	2,900	3,785.00	10,976,500
日清紡ホールディングス	37,800	772.00	29,181,600
倉敷紡績	6,000	1,883.00	11,298,000
ダイワボウホールディングス	5,200	8,670.00	45,084,000
日東紡績	9,300	4,365.00	40,594,500
トヨタ紡織	18,000	1,719.00	30,942,000
マクニカ・富士エレホールディングス	14,500	1,974.00	28,623,000
Hamee	2,300	1,998.00	4,595,400
ラクト・ジャパン	2,700	2,909.00	7,854,300
ウエルシアホールディングス	36,300	3,805.00	138,121,500
クリエイトSDホールディングス	10,300	3,680.00	37,904,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,500	839.00	9,648,500
八洲電機	4,700	991.00	4,657,700
メディアスホールディングス	4,400	795.00	3,498,000
レスターホールディングス	6,400	2,155.00	13,792,000
ジューテックホールディングス	3,800	1,034.00	3,929,200
丸善CHIホールディングス	10,800	374.00	4,039,200
OCHIホールディングス	3,000	1,304.00	3,912,000
TOKAIホールディングス	32,200	1,007.00	32,425,400
ミサワ	4,900	685.00	3,356,500
ティーライフ	2,600	1,188.00	3,088,800
Cominix	5,200	739.00	3,842,800
三洋貿易	6,100	969.00	5,910,900
チムニー	3,100	1,184.00	3,670,400
シュッピン	4,700	863.00	4,056,100
ビューティガレージ	1,300	2,774.00	3,606,200
オイシックス・ラ・大地	6,000	3,205.00	19,230,000
ウイン・パートナーズ	4,400	1,251.00	5,504,400
ネクステージ	10,400	1,282.00	13,332,800
ジョイフル本田	17,900	1,425.00	25,507,500
鳥貴族	2,800	1,442.00	4,037,600
ホットランド	4,500	1,286.00	5,787,000
すかいらーくホールディングス	68,300	1,633.00	111,533,900
SFPホールディングス	3,500	1,249.00	4,371,500
綿半ホールディングス	4,600	1,312.00	6,035,200
日本毛織	19,900	1,006.00	20,019,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,700	1,133.00	20,054,100
三栄建築設計	2,400	1,710.00	4,104,000
野村不動産ホールディングス	37,100	2,233.00	82,844,300
三重交通グループホールディングス	12,400	472.00	5,852,800
サムティ	8,700	1,758.00	15,294,600
ディア・ライフ	9,400	420.00	3,948,000
コーセーアールイー	6,600	631.00	4,164,600
日本商業開発	3,900	1,723.00	6,719,700
プレサンスコーポレーション	10,000	1,754.00	17,540,000
日本管理センター	3,300	1,192.00	3,933,600
サンセイランディック	5,300	740.00	3,922,000
エストラスト	5,400	712.00	3,844,800
フージャースホールディングス	12,200	711.00	8,674,200
オープンハウス	19,200	3,780.00	72,576,000
東急不動産ホールディングス	166,000	525.00	87,150,000
飯田グループホールディングス	50,900	2,149.00	109,384,100
イーグランド	5,000	797.00	3,985,000
ムゲンエステート	7,700	492.00	3,788,400
帝国繊維	6,800	2,538.00	17,258,400

日本コークス工業	55,900	72.00	4,024,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,200	919.00	3,859,800
B E E N O S	2,800	2,815.00	7,882,000
あさひ	4,500	1,702.00	7,659,000
日本調剤	3,700	1,493.00	5,524,100
コスモス薬品	5,400	16,410.00	88,614,000
シップヘルスケアホールディングス	9,800	5,540.00	54,292,000
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	2,857.00	7,428,200
オンリー	8,500	439.00	3,731,500
セブン&アイ・ホールディングス	238,500	3,528.00	841,428,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,800	607.00	19,909,600
明治電機工業	2,800	1,460.00	4,088,000
ツルハホールディングス	13,300	14,990.00	199,367,000
サンマルクホールディングス	4,800	1,412.00	6,777,600
フェリシモ	2,800	1,404.00	3,931,200
トリドールホールディングス	15,100	1,380.00	20,838,000
帝人	49,500	1,933.00	95,683,500
東レ	439,000	618.80	271,653,200
クラレ	95,500	1,133.00	108,201,500
旭化成	401,900	1,050.50	422,195,950
サカイオーベックス	1,900	2,173.00	4,128,700
T O K Y O B A S E	100	512.00	51,200
稲葉製作所	3,400	1,398.00	4,753,200
宮地エンジニアリンググループ	1,900	2,581.00	4,903,900
トーカロ	17,000	1,380.00	23,460,000
アルファ	4,000	1,023.00	4,092,000
S U M C O	78,400	2,104.00	164,953,600
川田テクノロジーズ	1,300	4,190.00	5,447,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,000	5,100.00	10,200,000
ハウズドゥ	3,200	1,208.00	3,865,600
ケイアイスター不動産	1,900	2,599.00	4,938,100
グッドコムアセット	2,900	1,280.00	3,712,000
日本フェルト	8,600	456.00	3,921,600
イチカワ	3,000	1,296.00	3,888,000
芦森工業	3,200	984.00	3,148,800
アツギ	7,400	539.00	3,988,600
J M ホールディングス	4,600	2,259.00	10,391,400
コメダホールディングス	13,300	1,837.00	24,432,100
アレンザホールディングス	3,000	1,270.00	3,810,000
パロックジャパンリミテッド	5,800	675.00	3,915,000
クスリのアオキホールディングス	5,500	9,000.00	49,500,000
スシローグローバルホールディングス	33,500	3,650.00	122,275,000
アセンテック	1,900	1,865.00	3,543,500
セーレン	14,900	1,620.00	24,138,000
ソトー	4,200	902.00	3,788,400
東海染工	2,700	1,136.00	3,067,200
小松マテーレ	10,000	965.00	9,650,000
ワコールホールディングス	15,100	2,080.00	31,408,000
ホギメディカル	6,900	3,390.00	23,391,000
クラウドシアホールディングス	13,300	276.00	3,670,800
T S I ホールディングス	19,200	213.00	4,089,600
マツオカコーポレーション	1,700	2,268.00	3,855,600
ワールド	8,600	1,307.00	11,240,200
T I S	60,700	2,044.00	124,070,800
電算システム	2,300	3,200.00	7,360,000
グリー	37,300	612.00	22,827,600
コーエーテクモホールディングス	12,400	6,290.00	77,996,000
三菱総合研究所	2,600	4,235.00	11,011,000
電算	1,600	2,448.00	3,916,800

AGS	4,500	903.00	4,063,500
ファインデックス	5,100	1,275.00	6,502,500
ブレインパッド	1,600	4,605.00	7,368,000
KLab	11,000	963.00	10,593,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,300	1,139.00	8,314,700
イーブックイニシアティブジャパン	1,300	2,718.00	3,533,400
ネクソン	153,300	3,250.00	498,225,000
アイスタイル	17,000	392.00	6,664,000
エムアップホールディングス	1,800	2,633.00	4,739,400
エイチーム	4,200	1,125.00	4,725,000
エニグモ	5,700	1,281.00	7,301,700
テクノスジャパン	5,100	686.00	3,498,600
コロプラ	19,900	994.00	19,780,600
ブロードリーフ	30,100	708.00	21,310,800
クロス・マーケティンググループ	10,600	379.00	4,017,400
システム情報	4,500	1,066.00	4,797,000
メディアドゥ	2,000	7,370.00	14,740,000
じげん	15,000	400.00	6,000,000
ブイキューブ	3,300	3,195.00	10,543,500
サイバーリンクス	1,000	5,300.00	5,300,000
フィックスターズ	6,500	956.00	6,214,000
CARTA HOLDINGS	2,900	1,247.00	3,616,300
オブティム	3,200	2,883.00	9,225,600
セレス	2,000	2,824.00	5,648,000
SHIFT	2,700	13,970.00	37,719,000
特種東海製紙	3,700	5,100.00	18,870,000
ティーガイア	5,400	1,846.00	9,968,400
セック	1,300	2,907.00	3,779,100
日本アジアグループ	6,400	747.00	4,780,800
テクマトリックス	8,600	2,077.00	17,862,200
プロシップ	2,700	1,523.00	4,112,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	14,600	2,677.00	39,084,200
GMOペイメントゲートウェイ	12,900	14,070.00	181,503,000
ザッパラス	5,200	523.00	2,719,600
インターネットイニシアティブ	9,000	4,170.00	37,530,000
さくらインターネット	6,500	671.00	4,361,500
ヴィンクス	3,100	1,197.00	3,710,700
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,300	9,170.00	11,921,000
SRAホールディングス	3,200	2,544.00	8,140,800
朝日ネット	4,500	863.00	3,883,500
eBASE	7,300	1,020.00	7,446,000
アバント	5,800	1,157.00	6,710,600
アドソル日進	2,200	3,180.00	6,996,000
フリービット	4,100	981.00	4,022,100
コムチュア	6,800	2,885.00	19,618,000
サイバーコム	2,200	1,725.00	3,795,000
アステリア	3,700	1,131.00	4,184,700
アイル	3,400	1,492.00	5,072,800
王子ホールディングス	253,500	598.00	151,593,000
日本製紙	26,800	1,207.00	32,347,600
三菱製紙	700	326.00	228,200
北越コーポレーション	36,100	399.00	14,403,900
中越パルプ工業	3,000	1,295.00	3,885,000
大王製紙	29,200	1,970.00	57,524,000
阿波製紙	8,600	469.00	4,033,400
マークラインズ	2,500	2,633.00	6,582,500
メディカル・データ・ビジョン	6,900	2,714.00	18,726,600

gumi	7,800	854.00	6,661,200
モバイルファクトリー	3,900	1,002.00	3,907,800
テラスカイ	2,200	4,055.00	8,921,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,600	1,554.00	4,040,400
ランドコンピュータ	3,500	1,134.00	3,969,000
ダブルスタンダード	900	4,185.00	3,766,500
オープンドア	3,100	1,309.00	4,057,900
アカツキ	2,200	4,320.00	9,504,000
Ubicomホールディングス	1,400	3,580.00	5,012,000
カナミックネットワーク	5,600	745.00	4,172,000
レンゴー	57,300	857.00	49,106,100
トーモク	3,700	1,716.00	6,349,200
ザ・パック	4,600	2,821.00	12,976,600
チェンジ	4,200	7,780.00	32,676,000
シンクロ・フード	12,300	304.00	3,739,200
オークネット	3,200	1,464.00	4,684,800
AOI TYO HOLDINGS	9,100	433.00	3,940,300
マクロミル	12,400	666.00	8,258,400
オロ	1,900	4,685.00	8,901,500
ユーザーローカル	1,000	3,890.00	3,890,000
昭和電工	46,000	2,245.00	103,270,000
住友化学	445,500	405.00	180,427,500
住友精化	2,700	4,025.00	10,867,500
日産化学	33,400	6,210.00	207,414,000
ラサ工業	2,100	2,268.00	4,762,800
クレハ	5,200	6,800.00	35,360,000
多木化学	2,400	6,480.00	15,552,000
テイカ	4,400	1,569.00	6,903,600
石原産業	10,900	642.00	6,997,800
片倉コープアグリ	3,200	1,216.00	3,891,200
日本曹達	9,000	3,045.00	27,405,000
東ソー	93,700	1,611.00	150,950,700
トクヤマ	17,500	2,320.00	40,600,000
セントラル硝子	12,400	2,268.00	28,123,200
東亜合成	38,100	1,262.00	48,082,200
大阪ソーダ	6,200	2,699.00	16,733,800
関東電化工業	14,400	790.00	11,376,000
デンカ	22,100	3,970.00	87,737,000
イビデン	37,900	4,855.00	184,004,500
信越化学工業	104,100	17,195.00	1,789,999,500
日本カーバイド工業	2,900	1,310.00	3,799,000
堺化学工業	3,900	1,987.00	7,749,300
第一稀元素化学工業	6,600	844.00	5,570,400
エア・ウォーター	56,400	1,836.00	103,550,400
日本酸素ホールディングス	58,300	2,001.00	116,658,300
日本化学工業	1,900	2,666.00	5,065,400
日本パーカライジング	30,600	1,095.00	33,507,000
高压ガス工業	9,600	810.00	7,776,000
四国化成工業	8,900	1,236.00	11,000,400
ステラ ケミファ	3,300	3,310.00	10,923,000
保土谷化学工業	2,300	4,540.00	10,442,000
日本触媒	9,400	5,710.00	53,674,000
大日精化工業	5,400	2,370.00	12,798,000
カネカ	15,700	3,675.00	57,697,500
協和キリン	62,300	2,686.00	167,337,800
三菱瓦斯化学	56,400	2,336.00	131,750,400
三井化学	56,300	3,005.00	169,181,500
JSR	56,500	2,818.00	159,217,000
東京応化工業	10,400	7,130.00	74,152,000

大阪有機化学工業	5,600	3,075.00	17,220,000
三菱ケミカルホールディングス	405,300	639.20	259,067,760
KHネオケム	10,000	2,770.00	27,700,000
ダイセル	75,700	751.00	56,850,700
住友ベークライト	9,500	3,515.00	33,392,500
積水化学工業	128,200	1,947.00	249,605,400
日本ゼオン	54,700	1,449.00	79,260,300
アイカ工業	18,200	3,565.00	64,883,000
宇部興産	30,600	1,913.00	58,537,800
積水樹脂	10,900	2,182.00	23,783,800
タキロンシーアイ	13,100	701.00	9,183,100
旭有機材	3,400	1,556.00	5,290,400
ニチパン	3,200	1,652.00	5,286,400
リケンテクノス	14,800	469.00	6,941,200
大倉工業	2,900	1,951.00	5,657,900
積水化成品工業	8,100	543.00	4,398,300
群栄化学工業	1,500	2,427.00	3,640,500
タイガースポリマー	9,100	397.00	3,612,700
ダイキョーニシカワ	12,800	841.00	10,764,800
森六ホールディングス	3,300	2,248.00	7,418,400
日本化薬	37,500	981.00	36,787,500
カーリットホールディングス	6,500	663.00	4,309,500
E P Sホールディングス	8,000	993.00	7,944,000
レグス	2,300	1,911.00	4,395,300
プレステージ・インターナショナル	22,200	901.00	20,002,200
プロトコーポレーション	5,400	1,054.00	5,691,600
ハイマックス	3,200	1,189.00	3,804,800
アミューズ	3,200	2,666.00	8,531,200
野村総合研究所	86,100	3,530.00	303,933,000
ドリームインキュベータ	2,700	1,335.00	3,604,500
サイバネットシステム	4,300	963.00	4,140,900
クイック	3,700	1,091.00	4,036,700
T A C	17,600	244.00	4,294,400
C Eホールディングス	6,400	577.00	3,692,800
ケネディクス	50,900	748.00	38,073,200
電通グループ	66,500	3,235.00	215,127,500
インテージホールディングス	7,600	1,126.00	8,557,600
東邦システムサイエンス	4,200	941.00	3,952,200
ぴあ	1,700	2,658.00	4,518,600
イオンファンタジー	2,300	2,402.00	5,524,600
ソースネクスト	28,800	287.00	8,265,600
シーティーエス	6,700	1,013.00	6,787,100
ネクシィーズグループ	4,400	908.00	3,995,200
インフォコム	6,600	3,335.00	22,011,000
メディカルシステムネットワーク	6,000	640.00	3,840,000
日本精化	4,900	1,453.00	7,119,700
扶桑化学工業	6,100	3,730.00	22,753,000
トリケミカル研究所	1,400	15,130.00	21,182,000
HEROZ	1,300	2,627.00	3,415,100
ラクスル	4,900	4,440.00	21,756,000
F I G	14,400	292.00	4,204,800
A D E K A	27,900	1,799.00	50,192,100
日油	22,800	5,170.00	117,876,000
ミヨシ油脂	3,200	1,288.00	4,121,600
新日本理化	3,000	245.00	735,000
ハリマ化成グループ	5,000	1,050.00	5,250,000
イーソル	3,300	1,287.00	4,247,100
アルテリア・ネットワークス	6,700	1,519.00	10,177,300
E D U L A B	600	6,880.00	4,128,000

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,511.00	3,928,600
花王	148,200	7,839.00	1,161,739,800
第一工業製薬	2,300	4,400.00	10,120,000
日華化学	4,000	939.00	3,756,000
ニイタカ	1,300	3,090.00	4,017,000
三洋化成工業	3,600	5,140.00	18,504,000
武田薬品工業	515,100	3,862.00	1,989,316,200
アステラス製薬	536,800	1,553.00	833,650,400
大日本住友製薬	45,900	1,319.00	60,542,100
塩野義製薬	77,900	5,640.00	439,356,000
わかもと製薬	14,400	263.00	3,787,200
あすか製薬	7,000	1,743.00	12,201,000
日本新薬	16,200	7,020.00	113,724,000
ピオフェルミン製薬	1,600	2,478.00	3,964,800
中外製薬	193,600	5,010.00	969,936,000
科研製薬	10,600	3,915.00	41,499,000
エーザイ	74,100	7,380.00	546,858,000
理研ビタミン	5,900	1,391.00	8,206,900
ロート製薬	31,800	3,110.00	98,898,000
小野薬品工業	142,200	3,186.00	453,049,200
久光製薬	16,400	6,170.00	101,188,000
有機合成薬品工業	12,700	313.00	3,975,100
持田製薬	8,600	3,910.00	33,626,000
参天製薬	115,400	1,664.00	192,025,600
扶桑薬品工業	2,200	2,845.00	6,259,000
ツムラ	19,200	3,195.00	61,344,000
日医工	17,500	996.00	17,430,000
テルモ	175,200	4,151.00	727,255,200
H・U・グループホールディングス	16,500	2,918.00	48,147,000
キッセイ薬品工業	11,000	2,214.00	24,354,000
生化学工業	12,000	1,033.00	12,396,000
栄研化学	10,900	2,070.00	22,563,000
日水製薬	500	980.00	490,000
鳥居薬品	3,900	3,250.00	12,675,000
JCRファーマ	17,400	2,428.00	42,247,200
東和薬品	7,900	1,884.00	14,883,600
富士製薬工業	4,200	1,238.00	5,199,600
沢井製薬	12,700	4,720.00	59,944,000
ゼリア新薬工業	11,200	1,911.00	21,403,200
第一三共	531,500	3,311.00	1,759,796,500
キョーリン製薬ホールディングス	13,700	1,903.00	26,071,100
大幸薬品	7,600	1,648.00	12,524,800
ダイト	4,000	3,700.00	14,800,000
大塚ホールディングス	128,700	4,500.00	579,150,000
大正製薬ホールディングス	13,100	6,820.00	89,342,000
ペプチドリーム	31,500	5,360.00	168,840,000
大日本塗料	6,900	963.00	6,644,700
日本ペイントホールディングス	50,000	11,800.00	590,000,000
関西ペイント	68,100	3,090.00	210,429,000
中国塗料	17,300	1,029.00	17,801,700
日本特殊塗料	4,500	1,291.00	5,809,500
藤倉化成	8,200	553.00	4,534,600
太陽ホールディングス	4,500	6,150.00	27,675,000
D I C	25,600	2,649.00	67,814,400
サカタイクス	13,200	1,185.00	15,642,000
東洋インキSCホールディングス	12,800	2,005.00	25,664,000
T & K T O K A	4,700	909.00	4,272,300
アルプス技研	5,200	2,140.00	11,128,000
日本空調サービス	6,200	778.00	4,823,600

オリエンタルランド	63,000	16,645.00	1,048,635,000
フォーカスシステムズ	4,200	915.00	3,843,000
ダスキン	14,700	2,904.00	42,688,800
パーク24	32,800	1,815.00	59,532,000
明光ネットワークジャパン	7,500	572.00	4,290,000
ファルコホールディングス	3,300	1,655.00	5,461,500
クレスコ	3,700	1,341.00	4,961,700
フジ・メディア・ホールディングス	58,500	1,105.00	64,642,500
秀英予備校	9,300	422.00	3,924,600
ラウンドワン	16,500	924.00	15,246,000
リゾートトラスト	27,100	1,528.00	41,408,800
オービック	21,100	21,000.00	443,100,000
ジャストシステム	9,900	7,210.00	71,379,000
TDCソフト	5,300	1,019.00	5,400,700
Zホールディングス	834,300	610.50	509,340,150
ビー・エム・エル	7,600	3,390.00	25,764,000
トレンドマイクロ	32,400	5,710.00	185,004,000
りらいあコミュニケーションズ	10,300	1,354.00	13,946,200
IDホールディングス	3,200	1,260.00	4,032,000
リソー教育	27,000	304.00	8,208,000
日本オラクル	12,300	11,710.00	144,033,000
早稲田アカデミー	4,000	1,016.00	4,064,000
アルファシステムズ	1,900	3,520.00	6,688,000
フューチャー	7,300	1,807.00	13,191,100
CAC Holdings	3,900	1,466.00	5,717,400
SBテクノロジー	2,200	3,565.00	7,843,000
トーセ	4,400	855.00	3,762,000
ユー・エス・エス	66,200	2,080.00	137,696,000
オービックビジネスコンサルタント	6,200	7,150.00	44,330,000
伊藤忠テクノソリューションズ	27,700	3,750.00	103,875,000
アイティフォー	7,400	947.00	7,007,800
東京個別指導学院	6,300	648.00	4,082,400
東計電算	900	4,465.00	4,018,500
サイバーエージェント	36,500	7,020.00	256,230,000
楽天	275,700	1,035.00	285,349,500
クリーク・アンド・リバー社	3,700	1,096.00	4,055,200
テー・オー・ダブリュー	13,800	270.00	3,726,000
大塚商会	32,900	5,170.00	170,093,000
サイボウズ	7,100	2,611.00	18,538,100
山田コンサルティンググループ	3,900	992.00	3,868,800
セントラルスポーツ	2,200	2,228.00	4,901,600
電通国際情報サービス	3,800	6,820.00	25,916,000
ACCESS	5,700	747.00	4,257,900
デジタルガレージ	10,900	4,435.00	48,341,500
イーエムシステムズ	8,600	872.00	7,499,200
ウェザーニューズ	2,000	5,730.00	11,460,000
C I J	4,100	917.00	3,759,700
ビジネスエンジニアリング	1,100	3,275.00	3,602,500
日本エンタープライズ	17,500	211.00	3,692,500
WOWOW	2,900	2,862.00	8,299,800
スカラ	4,500	853.00	3,838,500
フルキャストホールディングス	5,200	1,752.00	9,110,400
エン・ジャパン	10,500	3,300.00	34,650,000
富士フイルムホールディングス	118,700	5,542.00	657,835,400
コニカミノルタ	135,300	398.00	53,849,400
資生堂	123,000	7,133.00	877,359,000
ライオン	80,500	2,522.00	203,021,000
高砂香料工業	3,900	2,504.00	9,765,600
マンダム	13,900	1,671.00	23,226,900
ミルボン	8,300	6,500.00	53,950,000



ファンケル	25,100	4,130.00	103,663,000
コーセー	11,600	17,540.00	203,464,000
コタ	3,600	1,393.00	5,014,800
シーボン	2,000	1,969.00	3,938,000
ポーラ・オルビスホールディングス	26,400	2,074.00	54,753,600
ノエビアホールディングス	5,300	4,435.00	23,505,500
アジュバンコスメジャパン	3,800	1,014.00	3,853,200
エステー	4,000	1,977.00	7,908,000
アグロ カネショウ	2,300	1,681.00	3,866,300
コニシ	10,200	1,628.00	16,605,600
長谷川香料	10,700	2,106.00	22,534,200
星光PMC	5,200	732.00	3,806,400
小林製薬	17,300	12,400.00	214,520,000
荒川化学工業	5,600	1,167.00	6,535,200
メック	4,200	2,236.00	9,391,200
日本高純度化学	1,700	2,660.00	4,522,000
タカラバイオ	16,200	2,847.00	46,121,400
JCU	7,500	3,820.00	28,650,000
新田ゼラチン	5,600	684.00	3,830,400
OATアグリオ	2,600	1,433.00	3,725,800
デクセリアルズ	16,000	1,330.00	21,280,000
アース製薬	4,700	6,000.00	28,200,000
北興化学工業	5,800	1,080.00	6,264,000
大成ラミック	2,000	3,065.00	6,130,000
クマイ化学工業	25,600	938.00	24,012,800
日本農薬	11,000	518.00	5,698,000
ニチレキ	7,300	1,650.00	12,045,000
ユシロ化学工業	3,500	1,171.00	4,098,500
富士石油	21,200	179.00	3,794,800
MORESCO	3,900	1,018.00	3,970,200
出光興産	68,700	2,282.00	156,773,400
ENEOSホールディングス	931,400	367.10	341,916,940
コスモエネルギーホールディングス	17,900	1,810.00	32,399,000
横浜ゴム	35,800	1,565.00	56,027,000
TOYO TIRE	32,600	1,568.00	51,116,800
ブリヂストン	164,600	3,467.00	570,668,200
住友ゴム工業	55,700	928.00	51,689,600
オカモト	3,800	3,960.00	15,048,000
アキレス	4,300	1,452.00	6,243,600
フコク	5,600	699.00	3,914,400
ニッタ	7,000	2,332.00	16,324,000
住友理工	12,000	606.00	7,272,000
三ツ星ベルト	8,100	1,700.00	13,770,000
バンドー化学	10,900	637.00	6,943,300
AGC	56,800	3,695.00	209,876,000
日本板硝子	29,600	469.00	13,882,400
有沢製作所	9,800	974.00	9,545,200
日本山村硝子	4,500	904.00	4,068,000
日本電気硝子	23,000	2,362.00	54,326,000
オハラ	2,700	1,535.00	4,144,500
住友大阪セメント	11,700	3,100.00	36,270,000
太平洋セメント	39,100	2,594.00	101,425,400
日本ヒューム	6,200	807.00	5,003,400
日本コンクリート工業	13,300	318.00	4,229,400
三谷セキサン	2,900	4,175.00	12,107,500
アジアパイルホールディングス	8,800	468.00	4,118,400
東海カーボン	60,500	1,255.00	75,927,500
日本カーボン	3,400	4,030.00	13,702,000
東洋炭素	3,600	1,965.00	7,074,000
ノリタケカンパニーリミテド	3,400	3,075.00	10,455,000

TOTO	44,300	5,980.00	264,914,000
日本碍子	74,300	1,607.00	119,400,100
日本特殊陶業	47,100	1,813.00	85,392,300
MARUWA	2,400	11,950.00	28,680,000
品川リフラクトリーズ	1,600	2,536.00	4,057,600
黒崎播磨	1,300	4,200.00	5,460,000
ヨータイ	4,900	841.00	4,120,900
イソライト工業	8,600	483.00	4,153,800
ニッカトー	5,500	799.00	4,394,500
フジミインコーポレーテッド	5,500	3,815.00	20,982,500
クニミネ工業	3,600	1,089.00	3,920,400
ニチアス	16,900	2,359.00	39,867,100
日本製鉄	274,000	1,348.00	369,352,000
神戸製鋼所	112,100	569.00	63,784,900
中山製鋼所	10,400	387.00	4,024,800
合同製鐵	3,300	2,029.00	6,695,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	165,300	1,061.00	175,383,300
東京製鐵	29,800	650.00	19,370,000
共英製鋼	6,900	1,479.00	10,205,100
大和工業	13,000	2,810.00	36,530,000
東京鐵鋼	2,500	2,110.00	5,275,000
大阪製鐵	1,200	1,348.00	1,617,600
淀川製鋼所	8,300	2,064.00	17,131,200
丸一鋼管	19,900	2,281.00	45,391,900
モリ工業	1,800	2,500.00	4,500,000
大同特殊鋼	10,000	4,435.00	44,350,000
日本高周波鋼業	11,500	342.00	3,933,000
日本冶金工業	5,100	1,856.00	9,465,600
山陽特殊製鋼	4,200	1,311.00	5,506,200
愛知製鋼	3,400	2,876.00	9,778,400
日立金属	66,000	1,534.00	101,244,000
大平洋金属	4,100	2,349.00	9,630,900
新日本電工	39,500	303.00	11,968,500
栗本鐵工所	3,000	1,694.00	5,082,000
日本製鋼所	18,600	2,937.00	54,628,200
三菱製鋼	7,200	683.00	4,917,600
日亜鋼業	13,200	314.00	4,144,800
日本精線	1,200	3,645.00	4,374,000
大紀アルミニウム工業所	10,100	823.00	8,312,300
日本軽金属ホールディングス	15,500	1,937.00	30,023,500
三井金属鉱業	16,500	3,845.00	63,442,500
東邦亜鉛	3,100	2,657.00	8,236,700
三菱マテリアル	40,400	2,305.00	93,122,000
住友金属鉱山	78,300	4,628.00	362,372,400
DOWAホールディングス	15,500	3,795.00	58,822,500
古河機械金属	10,900	1,237.00	13,483,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,400	939.00	6,009,600
東邦チタニウム	11,000	915.00	10,065,000
UACJ	9,300	2,017.00	18,758,100
CKサンエツ	1,300	3,800.00	4,940,000
古河電気工業	19,000	2,907.00	55,233,000
住友電気工業	228,900	1,356.50	310,502,850
フジクラ	73,900	472.00	34,880,800
昭和電線ホールディングス	7,100	1,726.00	12,254,600
東京特殊電線	1,600	2,404.00	3,846,400
タツタ電線	12,100	713.00	8,627,300
カナレ電気	2,200	1,834.00	4,034,800
リョービ	7,500	1,312.00	9,840,000
アーレスティ	10,700	359.00	3,841,300
アサヒホールディングス	10,700	3,560.00	38,092,000

東洋製罐グループホールディングス	39,000	1,175.00	45,825,000
ホッカンホールディングス	3,400	1,443.00	4,906,200
コロナ	4,300	943.00	4,054,900
横河ブリッジホールディングス	11,400	2,151.00	24,521,400
OSJBホールディングス	30,600	271.00	8,292,600
三和ホールディングス	57,700	1,211.00	69,874,700
文化シャッター	18,000	958.00	17,244,000
三協立山	7,900	850.00	6,715,000
アルインコ	4,400	930.00	4,092,000
LIXIL	90,300	2,321.00	209,586,300
日本フィルコン	7,300	528.00	3,854,400
ノーリツ	12,700	1,648.00	20,929,600
長府製作所	6,200	2,081.00	12,902,200
リンナイ	11,900	11,980.00	142,562,000
ユニプレス	12,000	1,055.00	12,660,000
ダイニチ工業	4,200	859.00	3,607,800
日東精工	9,200	477.00	4,388,400
三洋工業	2,000	1,850.00	3,700,000
岡部	12,400	774.00	9,597,600
ジーテクト	7,600	1,566.00	11,901,600
東プレ	11,400	1,549.00	17,658,600
高周波熱錬	11,800	475.00	5,605,000
東京製綱	3,500	798.00	2,793,000
サンコール	9,300	438.00	4,073,400
モリテックスチール	8,300	455.00	3,776,500
パイオラックス	9,100	1,653.00	15,042,300
エイチワン	6,000	863.00	5,178,000
日本発条	65,700	742.00	48,749,400
三浦工業	26,500	5,490.00	145,485,000
タクマ	20,700	1,784.00	36,928,800
テクノプロ・ホールディングス	11,800	8,470.00	99,946,000
インターワークス	12,000	343.00	4,116,000
アイ・アールジャパンホールディングス	2,400	15,570.00	37,368,000
Keeper 技研	4,300	2,269.00	9,756,700
三機サービス	4,000	980.00	3,920,000
Gunosy	5,200	735.00	3,822,000
イー・ガーディアン	2,600	3,015.00	7,839,000
リブセンス	15,700	233.00	3,658,100
ジャパンマテリアル	18,200	1,408.00	25,625,600
ベクトル	7,400	933.00	6,904,200
ウチヤマホールディングス	13,200	307.00	4,052,400
チャーム・ケア・コーポレーション	5,000	1,285.00	6,425,000
IBJ	5,100	803.00	4,095,300
アサンテ	3,100	1,474.00	4,569,400
N・フィールド	4,800	883.00	4,238,400
パリュール	2,300	1,760.00	4,048,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,800	6,060.00	29,088,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,300	1,980.00	4,554,000
ERIホールディングス	5,700	685.00	3,904,500
アビスト	1,300	2,994.00	3,892,200
シグマクシス	4,000	1,800.00	7,200,000
ウィルグループ	4,000	1,009.00	4,036,000
メドピア	2,800	6,940.00	19,432,000
リクルートホールディングス	423,800	4,156.00	1,761,312,800
エラン	4,100	2,956.00	12,119,600
ツガミ	12,700	1,588.00	20,167,600
オークマ	7,100	5,680.00	40,328,000
芝浦機械	6,900	2,249.00	15,518,100
アマダ	75,900	1,090.00	82,731,000

アイダエンジニアリング	16,000	943.00	15,088,000
滝澤鉄工所	3,900	997.00	3,888,300
F U J I	26,300	2,681.00	70,510,300
牧野フライス製作所	7,200	3,955.00	28,476,000
オーエスジー	30,200	1,878.00	56,715,600
ダイジェット工業	2,800	1,443.00	4,040,400
旭ダイヤモンド工業	16,100	454.00	7,309,400
D M G 森精機	38,700	1,635.00	63,274,500
ソディック	13,300	909.00	12,089,700
ディスコ	8,300	33,250.00	275,975,000
日東工器	3,400	1,816.00	6,174,400
日進工具	2,400	2,671.00	6,410,400
日本郵政	484,900	802.10	388,938,290
ベルシステム24ホールディングス	9,900	1,653.00	16,364,700
鎌倉新書	4,500	1,173.00	5,278,500
S M N	5,000	754.00	3,770,000
一蔵	10,500	337.00	3,538,500
L I T A L I C O	2,000	3,590.00	7,180,000
エアトリ	3,200	1,243.00	3,977,600
ハイアス・アンド・カンパニー	21,600	162.00	3,499,200
アトラエ	1,800	2,560.00	4,608,000
ストライク	2,200	5,980.00	13,156,000
ソラスト	16,300	1,495.00	24,368,500
セラク	1,900	2,316.00	4,400,400
インソース	2,500	3,485.00	8,712,500
豊田自動織機	50,100	7,950.00	398,295,000
豊和工業	4,800	880.00	4,224,000
東洋機械金属	9,800	416.00	4,076,800
エンシュウ	4,300	937.00	4,029,100
島精機製作所	9,600	1,638.00	15,724,800
オプトラン	7,700	2,341.00	18,025,700
N C ホールディングス	6,500	585.00	3,802,500
イワキ	4,800	820.00	3,936,000
フリュー	6,000	1,065.00	6,390,000
ヤマシンフィルタ	13,700	1,085.00	14,864,500
日阪製作所	7,500	859.00	6,442,500
やまびこ	11,900	1,324.00	15,755,600
平田機工	2,900	8,020.00	23,258,000
ベガサスミシン製造	12,800	320.00	4,096,000
マルマエ	3,600	1,291.00	4,647,600
タツモ	2,600	1,428.00	3,712,800
ナプテスコ	36,100	4,450.00	160,645,000
三井海洋開発	6,500	1,875.00	12,187,500
レオン自動機	6,000	1,205.00	7,230,000
S M C	19,400	63,540.00	1,232,676,000
ホソカワミクロン	2,200	6,490.00	14,278,000
ユニオンツール	2,300	3,195.00	7,348,500
オイレス工業	7,900	1,710.00	13,509,000
日精エー・エス・ビー機械	1,800	6,030.00	10,854,000
サトーホールディングス	8,700	2,195.00	19,096,500
技研製作所	5,400	4,245.00	22,923,000
カワタ	4,200	983.00	4,128,600
日精樹脂工業	5,100	896.00	4,569,600
オカダアイヨン	3,800	1,077.00	4,092,600
小松製作所	280,400	2,773.50	777,689,400
住友重機械工業	35,400	2,550.00	90,270,000
日立建機	24,800	2,834.00	70,283,200
日工	8,500	687.00	5,839,500
巴工業	2,400	1,986.00	4,766,400
井関農機	6,200	1,413.00	8,760,600

T O W A	6,300	1,888.00	11,894,400
丸山製作所	2,800	1,500.00	4,200,000
北川鉄工所	2,900	1,391.00	4,033,900
シンニッタン	21,100	204.00	4,304,400
ローツェ	2,700	5,940.00	16,038,000
タカキタ	5,600	731.00	4,093,600
クボタ	325,200	2,162.50	703,245,000
荏原実業	1,500	3,995.00	5,992,500
三菱化工機	2,100	2,827.00	5,936,700
月島機械	11,400	1,393.00	15,880,200
帝国電機製作所	5,100	1,209.00	6,165,900
新東工業	14,700	767.00	11,274,900
澁谷工業	5,400	3,580.00	19,332,000
アイチコーポレーション	10,700	939.00	10,047,300
小森コーポレーション	15,700	737.00	11,570,900
鶴見製作所	4,800	1,777.00	8,529,600
荏原製作所	25,700	3,370.00	86,609,000
石井鐵工所	1,400	2,887.00	4,041,800
西島製作所	6,200	893.00	5,536,600
北越工業	6,400	1,059.00	6,777,600
ダイキン工業	78,900	22,095.00	1,743,295,500
オルガノ	2,200	6,080.00	13,376,000
トーヨーカネツ	2,700	2,151.00	5,807,700
栗田工業	33,500	3,915.00	131,152,500
椿本チエイン	8,800	2,793.00	24,578,400
大同工業	5,600	735.00	4,116,000
日機装	20,000	1,025.00	20,500,000
レイズネクスト	10,400	1,183.00	12,303,200
アネスト岩田	9,600	1,099.00	10,550,400
ダイフク	31,600	12,470.00	394,052,000
サムコ	1,500	3,225.00	4,837,500
加藤製作所	3,800	999.00	3,796,200
タダノ	29,900	890.00	26,611,000
フジテック	22,500	2,177.00	48,982,500
C K D	17,000	2,156.00	36,652,000
キトー	4,700	1,567.00	7,364,900
平和	17,300	1,455.00	25,171,500
理想科学工業	5,500	1,394.00	7,667,000
S A N K Y O	13,800	2,736.00	37,756,800
日本金銭機械	7,200	523.00	3,765,600
マースグループホールディングス	3,900	1,534.00	5,982,600
フクシマガリレイ	3,800	4,515.00	17,157,000
ダイコク電機	4,400	851.00	3,744,400
竹内製作所	10,400	2,415.00	25,116,000
アマノ	16,200	2,574.00	41,698,800
J U K I	8,600	528.00	4,540,800
蛇の目ミシン工業	5,600	818.00	4,580,800
ブラザー工業	75,600	2,066.00	156,189,600
マックス	9,400	1,431.00	13,451,400
モリタホールディングス	10,800	1,708.00	18,446,400
グローリー	15,900	2,118.00	33,676,200
新晃工業	5,800	1,730.00	10,034,000
大和冷機工業	9,900	1,112.00	11,008,800
セガサミーホールディングス	61,400	1,623.00	99,652,200
日本ピストンリング	4,100	976.00	4,001,600
リケン	2,900	2,222.00	6,443,800
T P R	8,300	1,502.00	12,466,600
ツバキ・ナカシマ	11,800	1,216.00	14,348,800
ホシザキ	19,500	9,620.00	187,590,000
大豊工業	6,400	762.00	4,876,800

日本精工	116,600	917.00	106,922,200
NTN	143,300	269.00	38,547,700
ジェイテクト	59,400	820.00	48,708,000
不二越	5,700	4,515.00	25,735,500
ミネベアミツミ	114,900	2,085.00	239,566,500
日本トムソン	18,400	375.00	6,900,000
THK	38,600	3,305.00	127,573,000
ユーシン精機	4,800	912.00	4,377,600
前澤給装工業	2,200	2,368.00	5,209,600
イーグル工業	7,700	1,000.00	7,700,000
日本ピラー工業	6,300	1,535.00	9,670,500
キッツ	22,600	633.00	14,305,800
日立製作所	297,500	4,181.00	1,243,847,500
三菱電機	619,100	1,552.50	961,152,750
富士電機	37,300	3,655.00	136,331,500
東洋電機製造	3,500	1,169.00	4,091,500
安川電機	66,600	4,840.00	322,344,000
シンフォニアテクノロジー	8,000	1,453.00	11,624,000
明電舎	11,400	2,201.00	25,091,400
オリジン	2,900	1,371.00	3,975,900
山洋電気	3,000	5,340.00	16,020,000
デンヨー	5,300	2,092.00	11,087,600
ベイカレント・コンサルティング	3,600	16,460.00	59,256,000
MS-Japan	4,900	962.00	4,713,800
グレイステクノロジー	2,700	7,120.00	19,224,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,800	4,775.00	32,470,000
グリーンズ	8,400	465.00	3,906,000
ミダック	1,200	3,520.00	4,224,000
日総工業	5,000	694.00	3,470,000
キュービーネットホールディングス	2,500	1,452.00	3,630,000
RPAホールディングス	5,900	639.00	3,770,100
三櫻工業	7,800	871.00	6,793,800
マキタ	80,700	5,100.00	411,570,000
東芝テック	7,800	3,725.00	29,055,000
芝浦メカトロニクス	1,100	4,260.00	4,686,000
マブチモーター	17,100	4,410.00	75,411,000
日本電産	149,000	12,725.00	1,896,025,000
トレックス・セミコンダクター	3,600	1,393.00	5,014,800
東光高岳	3,400	1,610.00	5,474,000
ダブル・スコープ	10,200	802.00	8,180,400
ダイヘン	6,800	5,020.00	34,136,000
ヤーマン	10,100	1,907.00	19,260,700
JVCケンウッド	50,400	175.00	8,820,000
ミマキエンジニアリング	7,500	521.00	3,907,500
I-PEX	2,900	1,999.00	5,797,100
日新電機	14,500	1,180.00	17,110,000
大崎電気工業	12,300	562.00	6,912,600
オムロン	55,500	8,960.00	497,280,000
日東工業	9,100	2,015.00	18,336,500
IDEC	8,900	1,824.00	16,233,600
不二電機工業	3,000	1,298.00	3,894,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	20,700	2,778.00	57,504,600
サクサホールディングス	2,700	1,407.00	3,798,900
メルコホールディングス	2,100	3,455.00	7,255,500
日本電気	75,100	5,560.00	417,556,000
富士通	59,700	14,240.00	850,128,000
沖電気工業	25,100	915.00	22,966,500
電気興業	3,000	2,734.00	8,202,000
サンケン電気	6,800	4,615.00	31,382,000

アイホン	3,500	1,712.00	5,992,000
ルネサスエレクトロニクス	265,400	1,066.00	282,916,400
セイコーエプソン	76,800	1,599.00	122,803,200
ワコム	41,600	891.00	37,065,600
アルパック	11,400	4,440.00	50,616,000
E I Z O	4,800	3,735.00	17,928,000
ジャパンディスプレイ	178,900	48.00	8,587,200
日本信号	15,800	950.00	15,010,000
京三製作所	14,500	428.00	6,206,000
能美防災	8,200	2,303.00	18,884,600
ホーチキ	4,500	1,300.00	5,850,000
エレコム	7,100	5,070.00	35,997,000
パナソニック	707,300	1,186.50	839,211,450
シャープ	71,600	1,477.00	105,753,200
アンリツ	39,900	2,360.00	94,164,000
富士通ゼネラル	16,800	2,816.00	47,308,800
ソニー	387,800	10,405.00	4,035,059,000
T D K	29,900	14,590.00	436,241,000
帝国通信工業	3,400	1,136.00	3,862,400
タムラ製作所	20,700	575.00	11,902,500
アルプスアルパイン	54,800	1,402.00	76,829,600
池上通信機	4,000	888.00	3,552,000
鈴木	4,200	1,089.00	4,573,800
日本トリム	900	4,120.00	3,708,000
ローランド ディー . ジー .	3,600	1,843.00	6,634,800
フォスター電機	6,500	1,282.00	8,333,000
S M K	1,600	3,150.00	5,040,000
ヨコオ	4,000	3,040.00	12,160,000
ホシデン	16,900	1,024.00	17,305,600
ヒロセ電機	9,500	15,110.00	143,545,000
日本航空電子工業	14,200	1,581.00	22,450,200
T O A	6,600	886.00	5,847,600
マクセルホールディングス	13,300	1,267.00	16,851,100
古野電気	8,000	1,189.00	9,512,000
ユニデンホールディングス	1,700	2,247.00	3,819,900
スミダコーポレーション	5,300	1,072.00	5,681,600
アイコム	3,400	2,696.00	9,166,400
リオン	2,600	3,430.00	8,918,000
横河電機	56,800	1,948.00	110,646,400
新電元工業	2,200	2,396.00	5,271,200
アズビル	39,100	5,400.00	211,140,000
東亜ディーケーケー	2,400	907.00	2,176,800
日本光電工業	25,600	3,525.00	90,240,000
共和電業	9,700	404.00	3,918,800
日本電子材料	2,400	1,675.00	4,020,000
堀場製作所	12,300	6,030.00	74,169,000
アドバンテスト	46,000	7,180.00	330,280,000
小野測器	7,800	528.00	4,118,400
エスベック	5,500	2,009.00	11,049,500
キーエンス	56,100	55,530.00	3,115,233,000
日置電機	3,000	4,215.00	12,645,000
シスメックス	44,300	11,825.00	523,847,500
日本マイクロニクス	10,800	1,255.00	13,554,000
メガチップス	5,800	2,935.00	17,023,000
O B A R A G R O U P	3,600	3,920.00	14,112,000
I M A G I C A G R O U P	9,600	346.00	3,321,600
澤藤電機	2,100	2,174.00	4,565,400
デンソー	136,300	5,896.00	803,624,800
原田工業	4,600	856.00	3,937,600
コーセル	8,200	1,195.00	9,799,000

イリソ電子工業	5,200	4,315.00	22,438,000
オプテックスグループ	10,200	1,865.00	19,023,000
千代田インテグレ	2,600	1,725.00	4,485,000
レーザーテック	27,200	11,820.00	321,504,000
スタンレー電気	43,400	3,435.00	149,079,000
岩崎電気	2,700	1,429.00	3,858,300
ウシオ電機	34,200	1,309.00	44,767,800
岡谷電機産業	9,200	400.00	3,680,000
エノモト	2,900	1,435.00	4,161,500
日本セラミック	6,300	2,974.00	18,736,200
遠藤照明	7,000	521.00	3,647,000
古河電池	4,400	1,644.00	7,233,600
双信電機	8,600	453.00	3,895,800
山一電機	4,500	1,530.00	6,885,000
図研	4,000	2,768.00	11,072,000
日本電子	12,200	4,595.00	56,059,000
カシオ計算機	54,800	1,874.00	102,695,200
ファナック	58,200	25,435.00	1,480,317,000
日本シイエムケイ	14,500	403.00	5,843,500
エンプラス	3,200	4,175.00	13,360,000
大真空	2,300	2,522.00	5,800,600
ローム	25,700	9,980.00	256,486,000
浜松ホトニクス	44,400	6,030.00	267,732,000
三井ハイテック	6,800	3,510.00	23,868,000
新光電気工業	20,800	2,325.00	48,360,000
京セラ	87,100	6,248.00	544,200,800
協栄産業	3,000	1,333.00	3,999,000
太陽誘電	27,500	4,640.00	127,600,000
村田製作所	181,900	8,927.00	1,623,821,300
双葉電子工業	9,800	911.00	8,927,800
日東電工	42,700	8,770.00	374,479,000
北陸電気工業	4,300	925.00	3,977,500
東海理化電機製作所	16,300	1,777.00	28,965,100
ニチコン	21,000	1,336.00	28,056,000
日本ケミコン	5,000	1,874.00	9,370,000
K O A	9,300	1,487.00	13,829,100
三井E & Sホールディングス	22,400	397.00	8,892,800
日立造船	49,100	490.00	24,059,000
三菱重工業	103,800	2,959.00	307,144,200
川崎重工業	48,200	2,102.00	101,316,400
I H I	44,600	1,922.00	85,721,200
スプリックス	4,600	801.00	3,684,600
マネジメントソリューションズ	2,900	1,785.00	5,176,500
プロレド・パートナーズ	800	3,985.00	3,188,000
カーブスホールディングス	16,200	738.00	11,955,600
日本車輛製造	2,300	2,476.00	5,694,800
三菱ロジスネクスト	8,200	1,250.00	10,250,000
近畿車輛	3,000	1,312.00	3,936,000
F P G	18,900	500.00	9,450,000
島根銀行	6,300	644.00	4,057,200
じもとホールディングス	4,300	849.00	3,650,700
全国保証	17,300	4,625.00	80,012,500
めぶきフィナンシャルグループ	317,300	207.00	65,681,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,100	1,315.00	4,076,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8,200	1,143.00	9,372,600
九州フィナンシャルグループ	133,600	440.00	58,784,000
かんぽ生命保険	21,600	2,110.00	45,576,000
ゆうちょ銀行	173,000	860.00	148,780,000
富山第一銀行	14,600	285.00	4,161,000



コンコルディア・フィナンシャルグループ	348,800	366.00	127,660,800
西日本フィナンシャルホールディングス	40,600	687.00	27,892,200
イントラスト	4,300	859.00	3,693,700
アルヒ	9,700	1,739.00	16,868,300
プレミアグループ	3,300	2,223.00	7,335,900
日産自動車	730,200	562.60	410,810,520
いすゞ自動車	179,400	991.00	177,785,400
トヨタ自動車	690,800	7,850.00	5,422,780,000
日野自動車	77,300	1,060.00	81,938,000
三菱自動車工業	229,200	216.00	49,507,200
エフテック	6,900	645.00	4,450,500
武蔵精密工業	13,800	1,643.00	22,673,400
日産車体	12,100	920.00	11,132,000
新明和工業	16,700	914.00	15,263,800
極東開発工業	11,500	1,458.00	16,767,000
トビー工業	5,100	1,243.00	6,339,300
ティラド	3,100	1,385.00	4,293,500
曙ブレーキ工業	34,000	127.00	4,318,000
タチエス	10,200	1,231.00	12,556,200
N O K	33,300	1,155.00	38,461,500
フタバ産業	17,200	540.00	9,288,000
K Y B	6,900	2,455.00	16,939,500
市光工業	9,300	676.00	6,286,800
大同メタル工業	11,900	504.00	5,997,600
プレス工業	30,700	313.00	9,609,100
ミクニ	14,200	280.00	3,976,000
太平洋工業	13,000	1,097.00	14,261,000
河西工業	11,200	409.00	4,580,800
アイシン精機	51,000	3,125.00	159,375,000
マツダ	182,200	701.00	127,722,200
今仙電機製作所	5,700	795.00	4,531,500
本田技研工業	487,500	3,015.00	1,469,812,500
スズキ	122,700	5,061.00	620,984,700
S U B A R U	192,200	2,132.00	409,770,400
ヤマハ発動機	87,500	2,114.00	184,975,000
小糸製作所	37,100	6,860.00	254,506,000
T B K	8,700	460.00	4,002,000
エクセディ	8,400	1,346.00	11,306,400
ミツバ	11,400	504.00	5,745,600
豊田合成	20,000	3,015.00	60,300,000
愛三工業	9,700	501.00	4,859,700
ヨロズ	5,800	1,098.00	6,368,400
エフ・シー・シー	10,100	1,889.00	19,078,900
シマノ	23,200	24,270.00	563,064,000
テイ・エス テック	14,400	3,300.00	47,520,000
関西みらいフィナンシャルグループ	35,800	507.00	18,150,600
三十三フィナンシャルグループ	5,700	1,284.00	7,318,800
第四北越フィナンシャルグループ	10,600	2,293.00	24,305,800
ひろぎんホールディングス	90,100	597.00	53,789,700
ダイレクトマーケティングミックス	2,300	2,657.00	6,111,100
ジャムコ	6,100	627.00	3,824,700
小野建	5,500	1,242.00	6,831,000
ノジマ	10,800	2,738.00	29,570,400
佐島電機	4,900	786.00	3,851,400
カッパ・クリエイト	8,500	1,460.00	12,410,000
伯東	3,700	1,066.00	3,944,200
コンドーテック	4,700	1,060.00	4,982,000
中山福	8,000	558.00	4,464,000
ライトオン	6,300	587.00	3,698,100

ナガイレーベン	8,100	2,769.00	22,428,900
三菱食品	6,700	2,875.00	19,262,500
良品計画	81,000	2,029.00	164,349,000
松田産業	4,400	1,878.00	8,263,200
第一興商	9,100	3,495.00	31,804,500
メディバルホールディングス	65,800	2,008.00	132,126,400
アドヴァン	9,300	1,232.00	11,457,600
S P K	3,100	1,285.00	3,983,500
萩原電気ホールディングス	2,300	2,468.00	5,676,400
アルビス	2,300	2,513.00	5,779,900
アズワン	4,000	15,970.00	63,880,000
スズデン	3,200	1,260.00	4,032,000
シモジマ	3,700	1,423.00	5,265,100
ドウシシャ	5,700	1,950.00	11,115,000
小津産業	2,100	1,900.00	3,990,000
コナカ	15,200	290.00	4,408,000
高速	3,600	1,633.00	5,878,800
G - 7ホールディングス	3,600	2,344.00	8,438,400
イオン北海道	8,000	999.00	7,992,000
コジマ	10,500	717.00	7,528,500
ヒマラヤ	4,300	994.00	4,274,200
コーナン商事	8,700	3,220.00	28,014,000
ネットワンシステムズ	23,100	3,660.00	84,546,000
エコス	2,200	2,105.00	4,631,000
ワタミ	7,200	865.00	6,228,000
マルシェ	7,700	501.00	3,857,700
システムソフト	44,000	89.00	3,916,000
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	134,100	2,397.00	321,437,700
丸文	7,800	509.00	3,970,200
西松屋チェーン	13,400	1,527.00	20,461,800
ゼンショーホールディングス	29,200	2,637.00	77,000,400
ハビネット	5,100	1,605.00	8,185,500
幸楽苑ホールディングス	3,900	1,728.00	6,739,200
橋本総業ホールディングス	1,700	2,761.00	4,693,700
日本ライフライン	18,100	1,567.00	28,362,700
サイゼリヤ	9,000	1,888.00	16,992,000
V Tホールディングス	25,200	407.00	10,256,400
マルカ	2,000	1,982.00	3,964,000
アルゴグラフィックス	5,200	3,185.00	16,562,000
I D O M	16,400	536.00	8,790,400
日本エム・ディ・エム	3,600	2,289.00	8,240,400
ユナイテッドアローズ	6,400	1,608.00	10,291,200
進和	3,600	2,200.00	7,920,000
ダイトロン	2,600	1,620.00	4,212,000
ハイデイ日高	8,800	1,734.00	15,259,200
シークス	7,700	1,652.00	12,720,400
京都きもの友禅	17,300	221.00	3,823,300
コロワイド	20,300	1,588.00	32,236,400
ピーシーデポコーポレーション	8,100	574.00	4,649,400
田中商事	5,600	703.00	3,936,800
オーハシテクニカ	3,100	1,477.00	4,578,700
壱番屋	4,300	5,140.00	22,102,000
白銅	2,800	1,499.00	4,197,200
スギホールディングス	12,200	6,950.00	84,790,000
ダイコー通産	2,800	1,445.00	4,046,000
薬王堂ホールディングス	2,700	2,408.00	6,501,600
島津製作所	74,000	3,810.00	281,940,000
J M S	5,200	909.00	4,726,800
長野計器	400	1,004.00	401,600

バイ・テクノロジー	2,900	5,640.00	16,356,000
スター精密	9,500	1,627.00	15,456,500
東京計器	4,300	961.00	4,132,300
愛知時計電機	900	4,530.00	4,077,000
インターアクション	3,300	1,895.00	6,253,500
オーバル	16,700	296.00	4,943,200
東京精密	11,200	4,850.00	54,320,000
マニー	24,700	2,691.00	66,467,700
ニコン	94,500	672.00	63,504,000
トプコン	31,200	1,261.00	39,343,200
オリンパス	342,600	2,246.00	769,479,600
理研計器	5,500	2,932.00	16,126,000
S C R E E Nホールディングス	10,700	7,190.00	76,933,000
キヤノン電子	5,700	1,528.00	8,709,600
タムロン	5,000	1,856.00	9,280,000
HOYA	122,800	13,960.00	1,714,288,000
ノーリツ鋼機	4,200	2,385.00	10,017,000
エー・アンド・デイ	5,600	1,157.00	6,479,200
朝日インテック	70,100	3,620.00	253,762,000
キヤノン	307,600	2,062.50	634,425,000
リコー	157,500	698.00	109,935,000
シチズン時計	72,500	296.00	21,460,000
リズム	6,100	642.00	3,916,200
大研医器	7,600	524.00	3,982,400
メニコン	8,800	6,320.00	55,616,000
スノーピーク	3,700	1,848.00	6,837,600
パラマウントベッドホールディングス	6,500	4,515.00	29,347,500
トランザクション	4,200	920.00	3,864,000
粧美堂	10,000	395.00	3,950,000
ニホンフラッシュ	5,800	1,303.00	7,557,400
前田工織	6,800	2,609.00	17,741,200
永大産業	13,500	290.00	3,915,000
アートネイチャー	6,600	657.00	4,336,200
バンダイナムコホールディングス	64,000	9,196.00	588,544,000
共立印刷	31,700	120.00	3,804,000
S H O E I	5,400	3,700.00	19,980,000
フランスベッドホールディングス	8,800	899.00	7,911,200
マーベラス	9,300	923.00	8,583,900
パイロットコーポレーション	10,900	3,055.00	33,299,500
萩原工業	3,400	1,477.00	5,021,800
エイベックス	10,400	1,020.00	10,608,000
トッパン・フォームズ	13,300	1,051.00	13,978,300
フジシールインターナショナル	13,900	2,046.00	28,439,400
タカラトミー	27,800	918.00	25,520,400
廣済堂	900	683.00	614,700
レック	6,600	1,309.00	8,639,400
三光合成	13,300	344.00	4,575,200
プロネックス	5,300	1,048.00	5,554,400
ホクシン	35,200	109.00	3,836,800
大建工業	4,200	1,883.00	7,908,600
凸版印刷	87,400	1,475.00	128,915,000
大日本印刷	81,000	1,909.00	154,629,000
共同印刷	1,900	3,120.00	5,928,000
N I S S H A	12,700	1,441.00	18,300,700
藤森工業	5,600	4,740.00	26,544,000
T A K A R A & C O M P A N Y	3,000	1,959.00	5,877,000
前澤化成工業	4,000	979.00	3,916,000
未来工業	3,300	1,695.00	5,593,500
アシックス	54,700	2,008.00	109,837,600
ツツミ	1,900	2,170.00	4,123,000

ウェーブロックホールディングス	5,300	765.00	4,054,500
J S P	3,600	1,741.00	6,267,600
ニチハ	8,600	3,170.00	27,262,000
エフピコ	13,000	4,265.00	55,445,000
小松ウオール工業	2,200	1,731.00	3,808,200
ヤマハ	36,800	5,750.00	211,600,000
河合楽器製作所	1,900	3,075.00	5,842,500
ビジョン	39,800	4,410.00	175,518,000
天馬	4,100	2,056.00	8,429,600
オリバー	1,700	2,324.00	3,950,800
キングジム	5,100	859.00	4,380,900
象印マホービン	16,700	1,832.00	30,594,400
リンテック	14,700	2,300.00	33,810,000
信越ポリマー	11,100	946.00	10,500,600
東リ	15,600	247.00	3,853,200
イトーキ	12,300	348.00	4,280,400
任天堂	38,000	65,250.00	2,479,500,000
三菱鉛筆	10,200	1,452.00	14,810,400
松風	2,800	1,886.00	5,280,800
タカラスタANDARD	12,800	1,489.00	19,059,200
コクヨ	29,700	1,448.00	43,005,600
ナカバヤシ	6,400	630.00	4,032,000
ニフコ	22,700	3,845.00	87,281,500
立川ブラインド工業	3,100	1,329.00	4,119,900
グローブライド	2,800	4,340.00	12,152,000
オカムラ	21,600	934.00	20,174,400
バルカー	5,000	2,031.00	10,155,000
M U T O Hホールディングス	2,700	1,479.00	3,993,300
伊藤忠商事	426,500	2,909.00	1,240,688,500
丸紅	634,700	677.70	430,136,190
スクロール	9,400	735.00	6,909,000
高島	2,500	1,645.00	4,112,500
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,931.00	11,972,200
三陽商会	7,100	549.00	3,897,900
長瀬産業	34,300	1,524.00	52,273,200
蝶理	3,900	1,590.00	6,201,000
豊田通商	68,100	3,890.00	264,909,000
オンワードホールディングス	36,400	210.00	7,644,000
三共生興	9,200	468.00	4,305,600
兼松	22,700	1,260.00	28,602,000
美津濃	5,600	1,983.00	11,104,800
三井物産	528,000	1,904.50	1,005,576,000
日本紙パルプ商事	3,500	3,570.00	12,495,000
東京エレクトロン	39,300	36,440.00	1,432,092,000
カメイ	7,900	1,175.00	9,282,500
O U Gホールディングス	1,400	2,832.00	3,964,800
スターゼン	2,300	4,160.00	9,568,000
セイコーホールディングス	8,800	1,357.00	11,941,600
山善	23,800	1,056.00	25,132,800
椿本興業	1,100	3,960.00	4,356,000
住友商事	384,700	1,340.00	515,498,000
日本ユニシス	19,000	3,890.00	73,910,000
内田洋行	2,500	4,285.00	10,712,500
三菱商事	399,800	2,588.00	1,034,682,400
第一実業	3,000	4,120.00	12,360,000
キヤノンマーケティングジャパン	15,100	2,300.00	34,730,000
西華産業	3,400	1,317.00	4,477,800
佐藤商事	5,000	907.00	4,535,000
菱洋エレクトロ	6,200	2,851.00	17,676,200
東京産業	6,900	590.00	4,071,000

ユアサ商事	5,800	3,335.00	19,343,000
神鋼商事	2,100	1,886.00	3,960,600
阪和興業	11,400	2,783.00	31,726,200
正栄食品工業	3,900	3,550.00	13,845,000
カナデン	4,900	1,266.00	6,203,400
菱電商事	4,400	1,562.00	6,872,800
ニプロ	42,800	1,218.00	52,130,400
フルサト工業	3,400	1,327.00	4,511,800
岩谷産業	15,800	6,250.00	98,750,000
ナイス	2,600	1,690.00	4,394,000
昭光通商	6,600	607.00	4,006,200
イワキ	8,000	515.00	4,120,000
兼松エレクトロニクス	3,300	4,070.00	13,431,000
三愛石油	15,000	1,166.00	17,490,000
稲畑産業	13,400	1,451.00	19,443,400
明和産業	9,600	452.00	4,339,200
ヤマエ久野	4,400	1,207.00	5,310,800
ゴールドウイン	10,900	7,320.00	79,788,000
ユニ・チャーム	131,300	4,971.00	652,692,300
デサント	11,800	1,922.00	22,679,600
ワキタ	13,000	1,076.00	13,988,000
ヤマトインターナショナル	11,400	349.00	3,978,600
東邦ホールディングス	19,600	1,930.00	37,828,000
サンゲツ	16,500	1,534.00	25,311,000
ミツウロコグループホールディングス	9,000	1,407.00	12,663,000
シナネンホールディングス	2,500	2,963.00	7,407,500
伊藤忠エネクス	13,500	1,026.00	13,851,000
サンリオ	17,100	1,450.00	24,795,000
サンワテクノス	4,300	987.00	4,244,100
リョーサン	6,700	1,897.00	12,709,900
新光商事	9,100	727.00	6,615,700
トーヨー	2,800	2,100.00	5,880,000
三信電気	3,300	2,172.00	7,167,600
東陽テクニカ	6,500	1,150.00	7,475,000
モスフードサービス	8,000	2,952.00	23,616,000
加賀電子	6,100	2,368.00	14,444,800
三益半導体工業	4,800	2,678.00	12,854,400
都築電気	2,400	1,658.00	3,979,200
ソーダニッカ	7,300	540.00	3,942,000
立花エレテック	4,500	1,699.00	7,645,500
木曽路	8,000	2,399.00	19,192,000
S R Sホールディングス	7,200	841.00	6,055,200
リテールパートナーズ	8,100	1,463.00	11,850,300
ケーヨー	12,500	741.00	9,262,500
上新電機	7,200	2,712.00	19,526,400
日本瓦斯	9,600	5,460.00	52,416,000
ロイヤルホールディングス	10,600	1,960.00	20,776,000
東天紅	4,200	892.00	3,746,400
いなげや	7,600	1,804.00	13,710,400
島忠	11,300	5,480.00	61,924,000
チヨダ	6,400	914.00	5,849,600
ライフコーポレーション	4,600	3,610.00	16,606,000
リンガーハット	7,500	2,299.00	17,242,500
MrMaxHD	8,400	802.00	6,736,800
テンアライド	11,200	307.00	3,438,400
AOKIホールディングス	12,200	512.00	6,246,400
オークワ	9,600	1,339.00	12,854,400
コメリ	9,400	2,891.00	27,175,400
青山商事	12,600	568.00	7,156,800
しまむら	7,100	10,590.00	75,189,000

はせがわ	13,400	299.00	4,006,600
高島屋	44,400	859.00	38,139,600
松屋	12,300	755.00	9,286,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	28,900	700.00	20,230,000
近鉄百貨店	2,300	3,255.00	7,486,500
丸井グループ	55,900	1,794.00	100,284,600
クレディセゾン	42,800	1,216.00	52,044,800
アクシアル リテイリング	5,100	4,890.00	24,939,000
イオン	234,600	3,095.00	726,087,000
イズミ	12,400	3,740.00	46,376,000
フォーバル	4,400	850.00	3,740,000
平和堂	12,400	2,174.00	26,957,600
フジ	7,400	1,942.00	14,370,800
ヤオコー	6,900	7,020.00	48,438,000
ゼビオホールディングス	7,400	848.00	6,275,200
ケーズホールディングス	58,800	1,397.00	82,143,600
PALTAC	9,800	5,780.00	56,644,000
三谷産業	9,300	498.00	4,631,400
新生銀行	44,900	1,249.00	56,080,100
あおぞら銀行	36,400	1,924.00	70,033,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,177,100	457.90	1,912,694,090
りそなホールディングス	663,900	364.20	241,792,380
三井住友トラスト・ホールディングス	115,500	3,131.00	361,630,500
三井住友フィナンシャルグループ	422,400	3,181.00	1,343,654,400
千葉銀行	203,800	560.00	114,128,000
群馬銀行	117,300	321.00	37,653,300
武蔵野銀行	9,100	1,541.00	14,023,100
千葉興業銀行	16,700	254.00	4,241,800
筑波銀行	25,400	186.00	4,724,400
七十七銀行	20,700	1,423.00	29,456,100
青森銀行	4,800	2,396.00	11,500,800
秋田銀行	4,000	1,355.00	5,420,000
山形銀行	6,900	1,010.00	6,969,000
岩手銀行	4,000	2,092.00	8,368,000
東邦銀行	54,600	213.00	11,629,800
みちのく銀行	3,900	1,055.00	4,114,500
ふくおかフィナンシャルグループ	51,500	1,878.00	96,717,000
静岡銀行	148,800	757.00	112,641,600
十六銀行	7,700	1,917.00	14,760,900
スルガ銀行	62,500	332.00	20,750,000
八十二銀行	147,400	348.00	51,295,200
山梨中央銀行	7,100	775.00	5,502,500
大垣共立銀行	12,100	2,198.00	26,595,800
福井銀行	5,300	1,836.00	9,730,800
北國銀行	6,100	2,757.00	16,817,700
清水銀行	2,600	1,744.00	4,534,400
富山銀行	1,200	3,060.00	3,672,000
滋賀銀行	12,300	2,168.00	26,666,400
南都銀行	10,200	1,805.00	18,411,000
百五銀行	55,000	307.00	16,885,000
京都銀行	21,900	5,410.00	118,479,000
紀陽銀行	21,700	1,516.00	32,897,200
ほくほくフィナンシャルグループ	40,600	1,007.00	40,884,200
山陰合同銀行	36,200	526.00	19,041,200
中国銀行	52,500	844.00	44,310,000
鳥取銀行	3,400	1,170.00	3,978,000
伊予銀行	87,100	662.00	57,660,200
百十四銀行	6,500	1,531.00	9,951,500
四国銀行	9,300	689.00	6,407,700
阿波銀行	10,000	2,420.00	24,200,000

大分銀行	3,600	2,060.00	7,416,000
宮崎銀行	4,100	2,221.00	9,106,100
佐賀銀行	3,800	1,346.00	5,114,800
沖縄銀行	5,600	2,910.00	16,296,000
琉球銀行	14,100	798.00	11,251,800
セブン銀行	204,000	219.00	44,676,000
みずほフィナンシャルグループ	829,800	1,315.50	1,091,601,900
山口フィナンシャルグループ	76,200	610.00	46,482,000
芙蓉総合リース	6,500	6,830.00	44,395,000
みずほリース	9,400	2,971.00	27,927,400
東京センチュリー	12,300	7,890.00	97,047,000
SBIホールディングス	70,100	2,965.00	207,846,500
日本証券金融	26,900	521.00	14,014,900
アイフル	93,200	256.00	23,859,200
長野銀行	2,700	1,473.00	3,977,100
名古屋銀行	4,600	2,621.00	12,056,600
北洋銀行	92,000	225.00	20,700,000
愛知銀行	2,300	3,050.00	7,015,000
中京銀行	2,600	2,030.00	5,278,000
大光銀行	3,200	1,331.00	4,259,200
愛媛銀行	8,500	1,009.00	8,576,500
京葉銀行	26,000	435.00	11,310,000
栃木銀行	29,500	175.00	5,162,500
北日本銀行	2,000	2,008.00	4,016,000
東和銀行	10,700	615.00	6,580,500
リコーリース	4,800	3,045.00	14,616,000
イオンフィナンシャルサービス	37,400	1,268.00	47,423,200
アコム	122,800	458.00	56,242,400
ジャックス	6,700	1,846.00	12,368,200
オリエントコーポレーション	165,200	116.00	19,163,200
日立キャピタル	14,400	2,460.00	35,424,000
オリックス	378,800	1,584.50	600,208,600
三菱UFJリース	155,000	491.00	76,105,000
ジャフコグループ	9,400	4,755.00	44,697,000
九州リースサービス	6,500	622.00	4,043,000
トモニホールディングス	47,200	321.00	15,151,200
大和証券グループ本社	490,000	473.30	231,917,000
野村ホールディングス	1,074,500	532.10	571,741,450
岡三証券グループ	52,100	377.00	19,641,700
丸三証券	18,200	469.00	8,535,800
東洋証券	28,200	132.00	3,722,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	70,200	307.00	21,551,400
光世証券	5,700	666.00	3,796,200
水戸証券	17,700	228.00	4,035,600
いちよし証券	11,500	466.00	5,359,000
松井証券	34,900	803.00	28,024,700
SOMPOホールディングス	114,800	4,038.00	463,562,400
日本取引所グループ	175,300	2,460.50	431,325,650
マネックスグループ	44,900	384.00	17,241,600
極東証券	8,200	690.00	5,658,000
岩井コスモホールディングス	5,800	1,272.00	7,377,600
藍澤證券	11,000	744.00	8,184,000
フィデアホールディングス	59,300	106.00	6,285,800
池田泉州ホールディングス	70,200	150.00	10,530,000
アニコムホールディングス	20,300	1,071.00	21,741,300
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	159,700	3,037.00	485,008,900
スパークス・グループ	28,200	255.00	7,191,000
第一生命ホールディングス	345,500	1,579.00	545,544,500

東京海上ホールディングス	215,900	5,247.00	1,132,827,300
イー・ギャランティ	7,000	2,154.00	15,078,000
アサックス	5,500	715.00	3,932,500
NECキャピタルソリューション	2,500	1,874.00	4,685,000
T&Dホールディングス	182,500	1,205.00	219,912,500
アドバンスクリエイト	1,300	1,975.00	2,567,500
三井不動産	296,800	2,171.50	644,501,200
三菱地所	427,800	1,649.00	705,442,200
平和不動産	11,200	3,590.00	40,208,000
東京建物	60,300	1,413.00	85,203,900
ダイビル	15,700	1,290.00	20,253,000
京阪神ビルディング	9,800	1,853.00	18,159,400
住友不動産	137,300	3,238.00	444,577,400
テオオーシー	12,000	705.00	8,460,000
東京楽天地	1,000	4,385.00	4,385,000
レオパレス21	80,000	126.00	10,080,000
スターツコーポレーション	8,300	2,929.00	24,310,700
フジ住宅	7,100	660.00	4,686,000
空港施設	8,400	486.00	4,082,400
ゴールドクレスト	4,800	1,625.00	7,800,000
リログループ	32,300	2,612.00	84,367,600
エスリード	3,000	1,407.00	4,221,000
日神グループホールディングス	10,200	418.00	4,263,600
日本エスコン	11,100	899.00	9,978,900
タカラレーベン	27,900	310.00	8,649,000
AVANTIA	4,800	849.00	4,075,200
イオンモール	30,600	1,644.00	50,306,400
毎日コムネット	5,500	704.00	3,872,000
ファースト住建	2,800	1,058.00	2,962,400
カチタス	15,100	3,205.00	48,395,500
東祥	3,700	1,572.00	5,816,400
トーセイ	8,400	1,201.00	10,088,400
穴吹興産	2,400	1,678.00	4,027,200
サンフロンティア不動産	8,400	904.00	7,593,600
エフ・ジェー・ネクスト	5,300	1,023.00	5,421,900
グランディハウス	10,100	390.00	3,939,000
東武鉄道	64,500	2,998.00	193,371,000
相鉄ホールディングス	19,800	2,522.00	49,935,600
東急	156,100	1,228.00	191,690,800
京浜急行電鉄	79,500	1,697.00	134,911,500
小田急電鉄	92,100	3,045.00	280,444,500
京王電鉄	32,100	7,460.00	239,466,000
京成電鉄	43,100	3,395.00	146,324,500
富士急行	8,400	4,395.00	36,918,000
新京成電鉄	1,300	2,370.00	3,081,000
東日本旅客鉄道	109,000	6,636.00	723,324,000
西日本旅客鉄道	55,200	5,115.00	282,348,000
東海旅客鉄道	51,500	13,845.00	713,017,500
西武ホールディングス	80,800	1,018.00	82,254,400
鴻池運輸	9,900	1,010.00	9,999,000
西日本鉄道	17,200	2,955.00	50,826,000
ハマキョウレックス	4,800	2,956.00	14,188,800
サカイ引越センター	3,300	5,310.00	17,523,000
近鉄グループホールディングス	58,600	4,380.00	256,668,000
阪急阪神ホールディングス	78,200	3,310.00	258,842,000
南海電気鉄道	27,800	2,543.00	70,695,400
京阪ホールディングス	26,100	4,815.00	125,671,500
神戸電鉄	1,400	3,710.00	5,194,000
名古屋鉄道	48,200	2,644.00	127,440,800
山陽電気鉄道	4,200	1,974.00	8,290,800



トランコム	1,600	8,420.00	13,472,000
日本通運	20,300	6,870.00	139,461,000
ヤマトホールディングス	97,100	2,589.00	251,391,900
山九	16,300	3,915.00	63,814,500
日新	5,100	1,225.00	6,247,500
丸全昭和運輸	4,800	3,320.00	15,936,000
センコーグループホールディングス	32,300	995.00	32,138,500
トナミホールディングス	1,400	6,080.00	8,512,000
ニッコンホールディングス	21,000	2,040.00	42,840,000
日本石油輸送	1,500	2,647.00	3,970,500
福山通運	7,500	4,500.00	33,750,000
セイノーホールディングス	43,900	1,482.00	65,059,800
神奈川中央交通	1,500	4,000.00	6,000,000
日立物流	10,700	3,120.00	33,384,000
丸和運輸機関	6,200	4,325.00	26,815,000
C & F ロジホールディングス	5,900	1,993.00	11,758,700
日本郵船	49,100	2,345.00	115,139,500
商船三井	37,100	3,130.00	116,123,000
川崎汽船	18,100	2,001.00	36,218,100
NSユナイテッド海運	3,300	1,393.00	4,596,900
飯野海運	27,800	417.00	11,592,600
九州旅客鉄道	51,400	2,134.00	109,687,600
SGホールディングス	123,100	3,020.00	371,762,000
日本航空	131,600	1,910.00	251,356,000
ANAホールディングス	107,200	2,202.50	236,108,000
パスコ	1,100	1,430.00	1,573,000
Genky DrugStores	2,700	4,395.00	11,866,500
国際紙パルプ商事	15,600	250.00	3,900,000
ブックオフグループホールディングス	4,700	824.00	3,872,800
三菱倉庫	18,600	2,893.00	53,809,800
三井倉庫ホールディングス	6,700	2,221.00	14,880,700
住友倉庫	21,100	1,358.00	28,653,800
澁澤倉庫	3,200	2,286.00	7,315,200
ヤマタネ	3,100	1,370.00	4,247,000
東陽倉庫	12,200	324.00	3,952,800
乾汽船	4,300	940.00	4,042,000
日本トランスシティ	12,900	581.00	7,494,900
ケイヒン	2,800	1,376.00	3,852,800
中央倉庫	3,600	1,210.00	4,356,000
安田倉庫	4,800	986.00	4,732,800
東洋埠頭	2,700	1,438.00	3,882,600
宇徳	8,400	486.00	4,082,400
上組	32,700	1,897.00	62,031,900
キューソー流通システム	2,400	1,670.00	4,008,000
近鉄エクスプレス	12,500	2,426.00	30,325,000
東海運	12,700	322.00	4,089,400
エーアイティー	4,100	957.00	3,923,700
内外トランスライン	1,000	1,363.00	1,363,000
TBSホールディングス	36,900	1,886.00	69,593,400
日本テレビホールディングス	50,700	1,137.00	57,645,900
朝日放送グループホールディングス	6,000	707.00	4,242,000
テレビ朝日ホールディングス	16,700	1,683.00	28,106,100
スカパーJ S A Tホールディングス	40,000	516.00	20,640,000
テレビ東京ホールディングス	5,000	2,300.00	11,500,000
日本BS放送	3,600	1,083.00	3,898,800
ビジョン	7,500	1,007.00	7,552,500
USEN-NEXT HOLDINGS	2,800	1,369.00	3,833,200
コネクシオ	3,400	1,406.00	4,780,400
日本通信	47,400	177.00	8,389,800
日本電信電話	812,100	2,666.50	2,165,464,650

KDDI	442,900	3,028.00	1,341,101,200
ソフトバンク	552,100	1,320.50	729,048,050
光通信	6,300	24,730.00	155,799,000
エムティーアイ	5,900	879.00	5,186,100
GMOインターネット	21,800	2,925.00	63,765,000
ファイバーゲート	2,000	2,566.00	5,132,000
アйдママーケティングコミュニケーション	10,200	431.00	4,396,200
KADOKAWA	16,400	3,630.00	59,532,000
学研ホールディングス	8,100	1,706.00	13,818,600
ゼンリン	12,100	1,276.00	15,439,600
インプレスホールディングス	22,500	172.00	3,870,000
東京電力ホールディングス	494,200	272.00	134,422,400
中部電力	189,400	1,229.50	232,867,300
関西電力	234,600	957.30	224,582,580
中国電力	89,300	1,233.00	110,106,900
北陸電力	56,600	666.00	37,695,600
東北電力	154,700	852.00	131,804,400
四国電力	55,700	666.00	37,096,200
九州電力	127,600	884.00	112,798,400
北海道電力	57,900	374.00	21,654,600
沖縄電力	12,000	1,390.00	16,680,000
電源開発	49,300	1,382.00	68,132,600
エフオン	3,400	1,205.00	4,097,000
イーレックス	9,000	2,035.00	18,315,000
レノバ	10,400	3,155.00	32,812,000
東京瓦斯	119,100	2,320.00	276,312,000
大阪瓦斯	120,100	2,021.00	242,722,100
東邦瓦斯	30,400	6,400.00	194,560,000
北海道瓦斯	3,300	1,561.00	5,151,300
広島ガス	12,700	375.00	4,762,500
西部瓦斯	7,000	3,120.00	21,840,000
静岡ガス	17,600	1,003.00	17,652,800
メタウォーター	6,000	2,319.00	13,914,000
アイネット	3,100	1,574.00	4,879,400
松竹	4,000	13,820.00	55,280,000
東宝	35,800	4,310.00	154,298,000
エイチ・アイ・エス	8,600	1,634.00	14,052,400
東映	2,300	16,010.00	36,823,000
ラックランド	1,700	2,380.00	4,046,000
エヌ・ティ・ティ・データ	161,700	1,376.00	222,499,200
共立メンテナンス	9,800	3,950.00	38,710,000
イチネンホールディングス	6,600	1,283.00	8,467,800
建設技術研究所	3,800	2,176.00	8,268,800
スペース	4,900	822.00	4,027,800
アインホールディングス	7,500	6,580.00	49,350,000
燦ホールディングス	3,200	1,245.00	3,984,000
ピー・シー・エー	1,000	4,420.00	4,420,000
東京テアトル	3,000	1,300.00	3,900,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	1,534.00	3,528,200
ナガワ	1,900	9,370.00	17,803,000
よみうりランド	1,300	6,020.00	7,826,000
東京都競馬	3,900	4,565.00	17,803,500
カナモト	10,400	2,257.00	23,472,800
東京ドーム	24,000	1,300.00	31,200,000
DTS	13,600	2,239.00	30,450,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	25,900	6,470.00	167,573,000
シーイーシー	6,500	1,534.00	9,971,000
カブコン	28,600	6,670.00	190,762,000

西尾レントオール	5,500	2,157.00	11,863,500
アイ・エス・ビー	1,400	3,085.00	4,319,000
日本空港ビルデング	19,500	6,690.00	130,455,000
トランス・コスモス	5,600	2,708.00	15,164,800
乃村工藝社	25,400	835.00	21,209,000
ジャステック	3,900	1,353.00	5,276,700
S C S K	14,000	5,670.00	79,380,000
日本管財	6,300	2,046.00	12,889,800
トーカイ	5,700	2,073.00	11,816,100
セコム	62,800	9,394.00	589,943,200
日本システムウエア	2,000	2,126.00	4,252,000
セントラル警備保障	2,800	3,575.00	10,010,000
アイネス	6,000	1,407.00	8,442,000
丹青社	11,200	835.00	9,352,000
メイテック	7,200	5,160.00	37,152,000
T K C	5,100	6,940.00	35,394,000
富士ソフト	6,500	5,210.00	33,865,000
応用地質	6,900	1,233.00	8,507,700
船井総研ホールディングス	12,200	2,568.00	31,329,600
N S D	19,500	2,140.00	41,730,000
進学会ホールディングス	8,700	449.00	3,906,300
丸紅建材リース	2,300	1,676.00	3,854,800
コナミホールディングス	22,100	5,750.00	127,075,000
学究社	3,100	1,288.00	3,992,800
ベネッセホールディングス	19,700	2,068.00	40,739,600
イオンディライト	7,300	2,614.00	19,082,200
ナック	4,300	928.00	3,990,400
福井コンピュータホールディングス	2,400	3,880.00	9,312,000
ダイセキ	9,900	3,045.00	30,145,500
ステップ	2,500	1,597.00	3,992,500
日鉄物産	4,300	3,740.00	16,082,000
泉州電業	1,700	3,235.00	5,499,500
元気寿司	1,700	2,301.00	3,911,700
トラスコ中山	14,000	2,944.00	41,216,000
ヤマダホールディングス	185,800	530.00	98,474,000
オートバックスセブン	22,600	1,394.00	31,504,400
モリト	6,400	658.00	4,211,200
アークランドサカモト	9,500	1,676.00	15,922,000
ニトリホールディングス	26,400	21,875.00	577,500,000
グルメ杵屋	4,300	1,002.00	4,308,600
愛眼	17,400	235.00	4,089,000
吉野家ホールディングス	20,000	1,905.00	38,100,000
加藤産業	8,800	3,400.00	29,920,000
イノテック	4,200	1,017.00	4,271,400
イエローハット	11,500	1,614.00	18,561,000
松屋フーズホールディングス	2,900	3,330.00	9,657,000
J B C Cホールディングス	4,100	1,438.00	5,895,800
J Kホールディングス	5,500	887.00	4,878,500
サガミホールディングス	8,200	1,250.00	10,250,000
日伝	5,500	2,278.00	12,529,000
関西スーパーマーケット	5,100	1,229.00	6,267,900
ミロク情報サービス	5,400	2,005.00	10,827,000
北沢産業	14,200	273.00	3,876,600
杉本商事	3,300	2,505.00	8,266,500
因幡電機産業	17,400	2,561.00	44,561,400
王将フードサービス	4,500	5,780.00	26,010,000
プレナス	6,800	1,755.00	11,934,000
ミニストップ	4,500	1,411.00	6,349,500
アークス	12,500	2,252.00	28,150,000
パローホールディングス	13,500	2,641.00	35,653,500

東テク	2,000	2,788.00	5,576,000	
ミスミグループ本社	76,400	3,400.00	259,760,000	
ベルク	3,000	6,140.00	18,420,000	
大 庄	4,000	984.00	3,936,000	
タキヒヨー	2,000	1,946.00	3,892,000	
ファーストリテイリング	8,200	83,930.00	688,226,000	
ソフトバンクグループ	482,000	8,489.00	4,091,698,000	
蔵王産業	3,000	1,363.00	4,089,000	
スズケン	25,800	3,905.00	100,749,000	
サンドラッグ	22,900	4,125.00	94,462,500	
サックスパー ホールディングス	7,300	536.00	3,912,800	
ジェコス	4,200	979.00	4,111,800	
やまや	1,900	2,167.00	4,117,300	
ペルーナ	13,100	1,013.00	13,270,300	
合計	65,343,500		153,345,129,850	

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

第4 不動産等明細表  
該当事項はありません。

第5 商品明細表  
該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表  
該当事項はありません。

第8 借入金明細表  
該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	503,769,850	1,388,538,582
金銭信託	64,589,250	21,138,500
コール・ローン	5,921,938,811	3,104,656,279
株式	208,192,680,647	299,486,562,574
投資証券	5,627,632,097	6,476,499,796
派生商品評価勘定	57,222,541	123,456,735
未収入金	2,196,503	2,864,294
未収配当金	201,755,393	217,667,218
差入委託証拠金	2,253,270,280	5,205,905,905
流動資産合計	222,825,055,372	316,027,289,883
資産合計	222,825,055,372	316,027,289,883
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,598,250	6,609,394
未払金	-	9,829
未払解約金	977,642,318	641,349,414
その他未払費用	4,485	2,061
流動負債合計	988,245,053	647,970,698
負債合計	988,245,053	647,970,698
純資産の部		
元本等		
元本	112,742,781,870	145,971,623,211
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	109,094,028,449	169,407,695,974
純資産合計	221,836,810,319	315,379,319,185
負債純資産合計	222,825,055,372	316,027,289,883

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 受益権総口数	112,742,781,870口	145,971,623,211口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9676円 (19,676円)	2.1606円 (21,606円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,927,550,423	11,450,111,336
投資証券	106,773,841	130,833,529
合計	4,820,776,582	11,319,277,807

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年12月20日 現在				2020年12月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	4,610,641,799	-	4,636,541,870	25,900,071	2,056,290,944	-	2,051,109,440	5,181,504
アメリカ・ドル	3,331,033,077	-	3,355,360,080	24,327,003	1,291,311,731	-	1,286,498,200	4,813,531
イギリス・ポンド	368,569,867	-	365,053,070	3,516,797	274,616,442	-	273,022,300	1,594,142
ユーロ	911,038,855	-	916,128,720	5,089,865	490,362,771	-	491,588,940	1,226,169
合計	4,610,641,799	-	4,636,541,870	25,900,071	2,056,290,944	-	2,051,109,440	5,181,504

## (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	2019年12月20日 現在				2020年12月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,531,780,502	-	7,552,504,722	20,724,220	8,825,793,512	-	8,947,822,356	122,028,844
合計	7,531,780,502	-	7,552,504,722	20,724,220	8,825,793,512	-	8,947,822,356	122,028,844

(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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	91,047,657,387円	112,742,781,870円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	43,722,320,193円	65,763,746,962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	22,027,195,710円	32,534,905,621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)	710,084,786円	819,685,039円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,303,464,505円	3,668,993,876円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,489,520,821円	2,822,894,572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)	1,491,869,965円	1,663,034,175円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,043,768円	2,748,521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)	22,684,869円	15,250,437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)	31,332,640円	19,384,544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)	11,368,150,601円	11,035,593,568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	76,690,722,917円	101,892,071,226円
DCニッセイ外国株式インデックス	15,623,093,548円	21,220,927,883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)	624,880,559円	997,756,188円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	61,886,852円	100,995,475円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	74,770,417円	130,409,719円

DCニッセイターゲットデートファンド2045	43,154,714円	99,812,627円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	83,849,166円	220,922,231円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	24,284,062円	47,503,883円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバ ランスファンド(6資産均等型)	41,935,568円	51,511,835円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,437,499円	5,846,663円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リ ート)	3,507,322円	5,692,174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)	1,017,232円	1,545,442円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバ ランスファンド(8資産均等型)	16,533,824円	18,010,375円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,788,980円	27,731,351円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,218,552円	22,052,523円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,410,424円	73,895,947円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	8,138,279円	104,335,597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)	-円	263,780,094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	303,353,904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	58,346,733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	277,536,609円
計	112,742,781,870円	145,971,623,211円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	92,598,912,036円	112,742,781,870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	41,205,321,117円	65,763,746,962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	21,061,451,283円	32,534,905,621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)	710,084,786円	819,685,039円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,303,464,505円	3,668,993,876円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,489,520,821円	2,822,894,572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)	1,491,869,965円	1,663,034,175円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,043,768円	2,748,521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)	22,684,869円	15,250,437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)	31,332,640円	19,384,544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)	11,368,150,601円	11,035,593,568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	76,690,722,917円	101,892,071,226円
DCニッセイ外国株式インデックス	15,623,093,548円	21,220,927,883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)	624,880,559円	997,756,188円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	61,886,852円	100,995,475円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	74,770,417円	130,409,719円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	43,154,714円	99,812,627円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	83,849,166円	220,922,231円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	24,284,062円	47,503,883円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	41,935,568円	51,511,835円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,437,499円	5,846,663円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,507,322円	5,692,174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)	1,017,232円	1,545,442円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	16,533,824円	18,010,375円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,788,980円	27,731,351円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,218,552円	22,052,523円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,410,424円	73,895,947円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	8,138,279円	104,335,597円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	-円	263,780,094円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定)	-円	303,353,904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	58,346,733円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定)	-円	277,536,609円
計	112,742,781,870円	145,971,623,211円

## 附属明細表（2020年12月21日現在）

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	10X GENOMICS INC-CLASS A	3,877	152.90	592,793.30	
	3M CO	36,352	176.42	6,413,219.84	
	ABBOTT LABORATORIES	111,694	108.97	12,171,295.18	
	ABBVIE INC	111,394	104.45	11,635,103.30	
	ABIOMED INC	2,824	293.39	828,533.36	
	ACCENTURE PLC	40,100	266.25	10,676,625.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	48,589	90.37	4,390,987.93	
	ADOBE INC	30,225	502.95	15,201,663.75	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,352	159.99	696,276.48	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	74,057	95.92	7,103,547.44	
	AES CORP	42,284	22.54	953,081.36	
	AFLAC INC	42,492	43.89	1,864,973.88	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,454	119.30	2,320,862.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,937	269.55	3,756,718.35	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,206	107.08	1,092,858.48	
	ALBEMARLE CORP	6,703	138.90	931,046.70	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,757	156.75	2,156,409.75	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,714	529.92	2,498,042.88	
	ALLEGHANY CORP	876	593.00	519,468.00	
	ALLEGION PLC	5,919	113.75	673,286.25	
	ALLIANT ENERGY CORP	15,771	51.05	805,109.55	
	ALLSTATE CORP	19,543	107.40	2,098,918.20	
	ALLY FINANCIAL INC	23,591	33.56	791,713.96	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,361	142.39	1,048,132.79	
	ALPHABET INC-CL A	18,858	1,726.22	32,553,056.76	
	ALPHABET INC-CL C	19,029	1,731.01	32,939,389.29	
	ALTICE USA INC- A	18,707	35.28	659,982.96	
	ALTRIA GROUP INC	117,458	43.78	5,142,311.24	
	AMAZON.COM INC	26,856	3,201.65	85,983,512.40	
	AMCOR PLC	99,608	11.66	1,161,429.28	
	AMERCO	687	443.49	304,677.63	
	AMEREN CORPORATION	15,580	78.86	1,228,638.80	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	31,327	83.29	2,609,225.83	
	AMERICAN EXPRESS CO	43,275	117.51	5,085,245.25	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,707	85.35	401,742.45	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	54,313	37.48	2,035,651.24	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,446	150.24	1,719,647.04	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,531	186.94	1,407,845.14	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	9,749	98.61	961,348.89	
	AMETEK INC	14,488	118.10	1,711,032.80	

AMGEN INC	36,947	228.49	8,442,020.03
AMPHENOL CORP-CL A	18,838	130.65	2,461,184.70
ANALOG DEVICES INC	23,349	144.56	3,375,331.44
ANSYS INC	5,397	357.81	1,931,100.57
ANTHEM INC	15,850	308.64	4,891,944.00
AON PLC	14,612	205.49	3,002,619.88
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10,965	47.78	523,907.70
APPLE INC	1,078,821	126.65	136,638,073.75
APPLIED MATERIALS INC	57,506	86.09	4,950,691.54
APTIV PLC	17,085	124.30	2,123,665.50
ARAMARK	14,461	37.48	541,998.28
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,401	34.43	874,556.43
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,963	49.68	1,736,961.84
ARISTA NETWORKS INC	3,590	287.72	1,032,914.80
ARROW ELECTRONICS INC	4,839	97.86	473,544.54
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,073	125.32	1,512,988.36
ASSURANT INC	3,732	131.29	489,974.28
AT&T INC	450,044	29.40	13,231,293.60
ATHENE HOLDING LTD- CLASS A	7,749	42.03	325,690.47
ATMOS ENERGY CORP	7,784	95.11	740,336.24
AUTODESK INC	13,814	305.00	4,213,270.00
AUTOLIV INC	5,308	91.87	487,645.96
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	27,145	179.24	4,865,469.80
AUTOZONE INC	1,473	1,181.90	1,740,938.70
AVALARA INC	5,007	179.79	900,208.53
AVANTOR INC	32,783	27.56	903,499.48
AVERY DENNISON CORP	5,268	152.96	805,793.28
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	13,460	29.00	390,340.00
BAKER HUGHES COMPANY	41,634	21.17	881,391.78
BALL CORP	20,652	92.19	1,903,907.88
BANK OF AMERICA CORP	491,690	28.67	14,096,752.30
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	50,177	40.79	2,046,719.83
BAXTER INTERNATIONAL INC	31,895	80.86	2,579,029.70
BECTON DICKINSON & CO	18,297	252.09	4,612,490.73
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	88,373	223.43	19,745,179.39
BEST BUY CO INC	14,608	101.95	1,489,285.60
BIO-RAD LABORATORIES- CL A	1,380	605.87	836,100.60
BIOGEN INC	9,951	249.62	2,483,968.62
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,399	88.85	1,012,801.15
BLACK KNIGHT INC	9,881	90.81	897,293.61
BLACKROCK INC	9,600	698.80	6,708,480.00
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	42,406	64.60	2,739,427.60
BOEING CO	33,865	219.75	7,441,833.75
BOOKING HOLDINGS INC	2,582	2,099.65	5,421,296.30
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,709	89.80	782,068.20
BORGWARNER INC	15,431	38.62	595,945.22

BOSTON SCIENTIFIC CORP	90,230	35.45	3,198,653.50	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142,283	63.12	8,980,902.96	
BROADCOM INC	25,397	434.56	11,036,520.32	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,268	153.88	1,118,399.84	
BROWN & BROWN INC	15,005	45.97	689,779.85	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	19,515	79.42	1,549,881.30	
BUNGE LIMITED	8,813	64.38	567,380.94	
BURLINGTON STORES INC	4,197	240.85	1,010,847.45	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,842	92.60	818,769.20	
CABLE ONE INC	308	2,237.83	689,251.64	
CABOT OIL & GAS CORP	24,799	16.97	420,839.03	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	17,410	132.02	2,298,468.20	
CAMPBELL SOUP CO	11,470	47.57	545,627.90	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	28,793	91.57	2,636,575.01	
CARDINAL HEALTH INC	18,517	54.96	1,017,694.32	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,949	30.85	276,076.65	
CARMAX INC	10,339	98.25	1,015,806.75	
CARNIVAL CORP	33,102	21.46	710,368.92	
CARRIER GLOBAL CORP	51,967	38.79	2,015,799.93	
CARVANA CO	3,955	266.24	1,052,979.20	
CATALENT INC	10,401	105.00	1,092,105.00	
CATERPILLAR INC	34,179	180.96	6,185,031.84	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,866	90.78	623,295.48	
CBRE GROUP INC	21,247	63.29	1,344,722.63	
CDW CORP/DE	9,020	134.37	1,212,017.40	
CELANESE CORP-SERIES A	7,468	131.76	983,983.68	
CENTENE CORP	36,587	61.15	2,237,295.05	
CENTERPOINT ENERGY INC	34,729	21.87	759,523.23	
CENTURYLINK INC	59,765	10.16	607,212.40	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	8,386	97.65	818,892.90	
CERNER CORP	19,056	77.60	1,478,745.60	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,596	37.64	511,753.44	
CHARLES SCHWAB CORP	96,407	51.98	5,011,235.86	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,064	652.00	5,909,728.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7,002	122.25	855,994.50	
CHENIERE ENERGY INC	14,305	58.15	831,835.75	
CHEVRON CORP	121,354	87.19	10,580,855.26	
CHEWY INC - CLASS A	4,764	100.13	477,019.32	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,673	1,418.57	2,373,267.61	
CHUBB LTD	28,457	152.36	4,335,708.52	
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,603	88.15	1,375,404.45	
CIGNA CORP	23,159	197.08	4,564,175.72	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,612	83.04	798,180.48	
CINTAS CORP	5,554	354.35	1,968,059.90	
CISCO SYSTEMS INC	266,231	45.44	12,097,536.64	
CITIGROUP INC	131,322	59.06	7,755,877.32	

CITIZENS FINANCIAL GROUP	26,803	34.21	916,930.63	
CITRIX SYSTEMS INC	7,368	132.65	977,365.20	
CLOROX CO	7,960	203.17	1,617,233.20	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	9,720	83.81	814,633.20	
CME GROUP INC	22,643	183.98	4,165,859.14	
CMS ENERGY CORP	18,206	59.23	1,078,341.38	
COCA-COLA CO	257,550	53.74	13,840,737.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	13,071	47.25	617,604.75	
COGNEX CORP	10,859	79.06	858,512.54	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	34,113	81.02	2,763,835.26	
COLGATE-PALMOLIVE CO	51,408	85.93	4,417,489.44	
COMCAST CORP	287,631	50.90	14,640,417.90	
CONAGRA BRANDS INC	30,781	36.12	1,111,809.72	
CONCHO RESOURCES INC	12,285	59.56	731,694.60	
CONOCOPHILLIPS	67,389	40.98	2,761,601.22	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,110	71.15	1,501,976.50	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,600	218.68	2,318,008.00	
COOPER COS INC/THE	3,352	349.63	1,171,959.76	
COPART INC	13,298	122.36	1,627,143.28	
CORNING INC	47,989	36.24	1,739,121.36	
CORTEVA INC	47,104	39.41	1,856,368.64	
COSTAR GROUP INC	2,482	904.70	2,245,465.40	
COSTCO WHOLESALE CORP	27,831	367.00	10,213,977.00	
COUPA SOFTWARE INC	4,241	366.90	1,556,022.90	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,061	203.75	1,846,178.75	
CROWN HOLDINGS INC	8,547	96.29	822,990.63	
CSX CORP	48,875	90.66	4,431,007.50	
CUMMINS INC	9,286	224.31	2,082,942.66	
CVS HEALTH CORP	82,591	69.55	5,744,204.05	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,494	145.08	361,829.52	
DANAHER CORP	40,270	226.11	9,105,449.70	
DARDEN RESTAURANTS INC	8,192	116.16	951,582.72	
DATADOG INC - CLASS A	9,573	107.72	1,031,203.56	
DAVITA INC	4,993	115.36	575,992.48	
DEERE & CO	18,804	270.70	5,090,242.80	
DELL TECHNOLOGIES -C	15,287	72.92	1,114,728.04	
DELTA AIR LINES INC	10,093	40.68	410,583.24	
DENTSPLY SIRONA INC	13,796	52.60	725,669.60	
DEXCOM INC	6,043	358.57	2,166,838.51	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,407	85.99	1,668,807.93	
DISCOVERY INC-A	9,673	27.80	268,909.40	
DISCOVERY INC-C	20,887	24.52	512,149.24	
DISH NETWORK CORP	15,475	30.49	471,832.75	
DOCUSIGN INC	11,000	241.00	2,651,000.00	
DOLLAR GENERAL CORP	15,705	210.48	3,305,588.40	
DOLLAR TREE INC	14,965	111.88	1,674,284.20	
DOMINION ENERGY INC	53,068	75.37	3,999,735.16	
DOMINO'S PIZZA INC	2,476	396.71	982,253.96	
DOVER CORP	9,100	123.86	1,127,126.00	
DOW INC	46,887	55.66	2,609,730.42	

DR HORTON INC	21,781	73.23	1,595,022.63	
DRAFTKINGS INC - CL A	10,725	53.90	578,077.50	
DROPBOX INC-CLASS A	19,771	23.68	468,177.28	
DTE ENERGY COMPANY	12,206	121.70	1,485,470.20	
DUKE ENERGY CORP	46,475	90.32	4,197,622.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,336	71.33	3,305,146.88	
DYNATRACE INC	11,538	44.12	509,056.56	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,540	103.68	885,427.20	
EATON CORP PLC	25,282	116.08	2,934,734.56	
EBAY INC	43,972	53.06	2,333,154.32	
ECOLAB INC	16,206	218.58	3,542,307.48	
EDISON INTERNATIONAL	23,975	62.54	1,499,396.50	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,152	86.82	3,399,176.64	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	25,340	30.01	760,453.40	
ELECTRONIC ARTS INC	18,148	142.61	2,588,086.28	
ELI LILLY & CO	54,336	171.40	9,313,190.40	
EMERSON ELECTRIC CO	37,765	80.90	3,055,188.50	
ENPHASE ENERGY INC	7,558	164.41	1,242,610.78	
ENTERGY CORP	12,715	100.02	1,271,754.30	
EOG RESOURCES INC	36,438	51.77	1,886,395.26	
EPAM SYSTEMS INC	3,516	346.53	1,218,399.48	
EQUIFAX INC	7,696	195.17	1,502,028.32	
EQUITABLE HOLDINGS INC	25,384	25.17	638,915.28	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,592	247.65	394,258.80	
ESSENTIAL UTILITIES INC	14,845	45.90	681,385.50	
ESTEE LAUDER COS INC	14,195	261.31	3,709,295.45	
ETSY INC	7,520	190.76	1,434,515.20	
EVEREST RE GROUP LTD	2,487	232.53	578,302.11	
EVERGY INC	14,454	53.35	771,120.90	
EVERSOURCE ENERGY	21,673	84.71	1,835,919.83	
EXACT SCIENCES CORP	10,041	137.05	1,376,119.05	
EXELON CORP	61,467	42.57	2,616,650.19	
EXPEDIA GROUP INC	8,584	125.54	1,077,635.36	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	10,734	95.40	1,024,023.60	
EXXON MOBIL CORP	266,712	42.73	11,396,603.76	
F5 NETWORKS INC	3,839	175.23	672,707.97	
FACEBOOK INC-A	151,625	276.40	41,909,150.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,376	347.03	824,543.28	
FAIR ISAAC CORP	1,834	521.98	957,311.32	
FASTENAL CO	36,030	49.34	1,777,720.20	
FEDEX CORP	15,815	275.57	4,358,139.55	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17,337	38.66	670,248.42	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39,147	145.22	5,684,927.34	
FIFTH THIRD BANCORP	44,890	26.63	1,195,420.70	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,790	135.78	1,465,066.20	
FIRSTENERGY CORP	34,497	30.34	1,046,638.98	
FISERV INC	35,974	114.81	4,130,174.94	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,304	279.47	1,482,308.88	



FMC CORP	8,185	115.65	946,595.25
FORD MOTOR CO	246,516	8.95	2,206,318.20
FORTINET INC	8,665	145.85	1,263,790.25
FORTIVE CORP	19,188	69.83	1,339,898.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8,722	89.63	781,752.86
FOX CORP - CLASS A	20,994	28.16	591,191.04
FOX CORP- CLASS B	11,516	27.79	320,029.64
FRANKLIN RESOURCES INC	18,340	25.01	458,683.40
FREEPORT-MCMORAN INC	91,384	24.63	2,250,787.92
GARMIN LTD	9,024	119.49	1,078,277.76
GARTNER INC	5,682	157.94	897,415.08
GENERAC HOLDINGS INC	3,949	216.79	856,103.71
GENERAL DYNAMICS CORP	15,403	152.67	2,351,576.01
GENERAL ELECTRIC CO	552,350	10.81	5,970,903.50
GENERAL MILLS INC	38,493	59.40	2,286,484.20
GENERAL MOTORS CO	81,243	41.01	3,331,775.43
GENUINE PARTS CO	9,163	97.53	893,667.39
GILEAD SCIENCES INC	79,076	59.08	4,671,810.08
GLOBAL PAYMENTS INC	18,921	196.33	3,714,759.93
GLOBE LIFE INC	6,290	92.81	583,774.90
GODADDY INC - CLASS A	10,589	85.03	900,382.67
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,575	242.13	4,981,824.75
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,283	125.72	664,178.76
HALLIBURTON CO	55,354	19.68	1,089,366.72
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	22,382	47.65	1,066,502.30
HASBRO INC	8,258	93.81	774,682.98
HCA HEALTHCARE INC	17,061	164.34	2,803,804.74
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10,181	55.86	568,710.66
HEICO CORP	2,721	133.09	362,137.89
HEICO CORP-CLASS A	4,567	120.14	548,679.38
HENRY SCHEIN INC	8,895	67.78	602,903.10
HERSHEY CO/THE	9,311	150.88	1,404,843.68
HESS CORP	17,428	55.95	975,096.60
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	80,856	12.12	979,974.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,469	104.61	1,827,432.09
HOLOGIC INC	16,243	74.77	1,214,489.11
HOME DEPOT INC	67,914	270.45	18,367,341.30
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44,285	210.04	9,301,621.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	77,500	4.16	322,400.00
HORIZON PHARMA PLC	13,855	69.68	965,416.40
HORMEL FOODS CORP	18,557	47.94	889,622.58
HOWMET AEROSPACE INC	24,756	27.27	675,096.12
HP INC	90,108	24.46	2,204,041.68
HUBSPOT INC	2,738	404.55	1,107,657.90
HUMANA INC	8,331	391.62	3,262,586.22
HUNTINGTON BANCSHARES INC	64,463	12.39	798,696.57
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,539	169.62	430,665.18
IAC/INTERACTIVECORP	5,013	164.00	822,132.00
IDEX CORP	4,754	198.55	943,906.70
IDEXX LABORATORIES INC	5,357	485.52	2,600,930.64

IHS MARKIT LTD	23,897	87.98	2,102,458.06	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	19,980	203.88	4,073,522.40	
ILLUMINA INC	9,214	366.06	3,372,876.84	
INCYTE CORP	11,695	88.34	1,033,136.30	
INGERSOLL-RAND INC	22,371	45.22	1,011,616.62	
INSULET CORP	4,155	240.65	999,900.75	
INTEL CORP	268,170	47.46	12,727,348.20	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34,219	112.83	3,860,929.77	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	56,232	125.85	7,076,797.20	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	5,445	114.29	622,309.05	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,547	49.98	1,176,879.06	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	25,065	23.94	600,056.10	
INTUIT INC	16,430	380.11	6,245,207.30	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,374	789.09	5,818,749.66	
INVESCO LTD	24,420	17.45	426,129.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	8,392	54.33	455,937.36	
IPG PHOTONICS CORP	2,340	216.82	507,358.80	
IQVIA HOLDINGS INC	12,131	180.39	2,188,311.09	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,813	161.63	777,925.19	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,272	106.58	881,629.76	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	13,900	56.24	781,736.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	14,100	24.91	351,231.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,435	150.60	517,311.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,611	140.46	788,121.06	
JM SMUCKER CO	7,131	115.88	826,340.28	
JOHNSON & JOHNSON	166,047	154.51	25,655,921.97	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	47,076	46.24	2,176,794.24	
JPMORGAN CHASE & CO	192,206	119.08	22,887,890.48	
JUNIPER NETWORKS INC	20,786	22.68	471,426.48	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,140	197.62	1,213,386.80	
KELLOGG CO	16,247	62.08	1,008,613.76	
KEURIG DR PEPPER INC	35,853	30.93	1,108,933.29	
KEYCORP	61,616	15.42	950,118.72	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,812	128.26	1,515,007.12	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,556	135.08	2,911,784.48	
KINDER MORGAN INC	128,639	14.21	1,827,960.19	
KKR & CO INC -A	31,760	40.04	1,271,670.40	
KLA CORPORATION	9,809	262.15	2,571,429.35	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	8,793	42.05	369,745.65	
KRAFT HEINZ CO/THE	42,355	34.77	1,472,683.35	
KROGER CO	48,787	30.87	1,506,054.69	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13,638	187.21	2,553,169.98	

LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	6,131	205.11	1,257,529.41	
LAM RESEARCH CORP	9,180	480.97	4,415,304.60	
LAMB WESTON HOLDING INC	9,246	78.66	727,290.36	
LAS VEGAS SANDS CORP	21,701	57.43	1,246,288.43	
LEAR CORP	3,595	159.69	574,085.55	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,567	105.67	905,274.89	
LENNAR CORP-CL A	17,375	80.84	1,404,595.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,202	277.56	611,187.12	
LIBERTY BROADBAND-A	1,476	155.69	229,798.44	
LIBERTY BROADBAND-C	6,963	157.88	1,099,318.44	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13,806	25.10	346,530.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,412	24.33	496,623.96	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,935	43.17	213,043.95	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11,674	43.16	503,849.84	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	13,027	41.66	542,704.82	
LINCOLN NATIONAL CORP	12,004	48.61	583,514.44	
LINDE PLC	33,192	257.67	8,552,582.64	
LIVE NATION INC	10,426	73.43	765,581.18	
LKQ CORP	18,202	36.15	658,002.30	
LOCKHEED MARTIN CORP	15,865	356.03	5,648,415.95	
LOEWS CORP	15,874	43.80	695,281.20	
LOWE'S COS INC	47,672	163.20	7,780,070.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,801	378.05	2,949,168.05	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,907	90.93	1,537,353.51	
M&T BANK CORP	8,009	123.73	990,953.57	
MARATHON PETROLEUM CORP	41,226	40.35	1,663,469.10	
MARKEL CORP	863	988.01	852,652.63	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,384	578.88	1,380,049.92	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	17,412	128.82	2,243,013.84	
MARSH & MCLENNAN COS INC	32,031	116.27	3,724,244.37	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,927	276.35	1,085,226.45	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	42,282	47.51	2,008,817.82	
MASCO CORP	16,482	55.59	916,234.38	
MASIMO CORPORATION	3,274	265.66	869,770.84	
MASTERCARD INC-CLASS A	56,356	340.33	19,179,637.48	
MATCH GROUP INC	15,586	155.07	2,416,921.02	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	16,806	86.45	1,452,878.70	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,682	93.37	1,464,228.34	
MCDONALD'S CORP	46,957	215.08	10,099,511.56	
MCKESSON CORP	10,209	173.55	1,771,771.95	
MEDTRONIC PLC	84,717	116.71	9,887,321.07	

MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	13,721	18.97	260,287.37	
MERCADOLIBRE INC	2,823	1,723.68	4,865,948.64	
MERCK & CO INC	159,540	79.53	12,688,216.20	
METLIFE INC	48,378	45.65	2,208,455.70	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,511	1,134.83	1,714,728.13	
MGM MIRAGE	29,396	31.67	930,971.32	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,977	138.01	2,204,985.77	
MICRON TECHNOLOGY INC	70,054	71.46	5,006,058.84	
MICROSOFT CORP	453,477	218.59	99,125,537.43	
MODERNA INC	17,430	140.23	2,444,208.90	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,822	138.43	529,079.46	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,733	201.96	753,916.68	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	11,933	45.51	543,070.83	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	90,024	58.32	5,250,199.68	
MONGODB INC	3,049	376.87	1,149,076.63	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,685	348.23	934,997.55	
MONSTER BEVERAGE CORP	24,776	90.13	2,233,060.88	
MOODY'S CORP	10,654	283.37	3,019,023.98	
MORGAN STANLEY	85,382	64.18	5,479,816.76	
MOSAIC CO/THE	22,799	23.39	533,268.61	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,733	170.26	1,827,400.58	
MSCI INC	5,275	443.06	2,337,141.50	
NASDAQ INC	7,174	128.60	922,576.40	
NETAPP INC	13,996	64.82	907,220.72	
NETFLIX INC	27,821	534.45	14,868,933.45	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,579	101.43	565,877.97	
NEWELL BRANDS INC	25,521	20.60	525,732.60	
NEWMONT CORP	50,596	60.50	3,061,058.00	
NEWS CORP - CLASS A	24,561	17.35	426,133.35	
NEXTERA ENERGY INC	123,602	74.51	9,209,585.02	
NIKE INC	78,567	137.28	10,785,677.76	
NISOURCE INC	24,696	22.40	553,190.40	
NORDSON CORP	3,462	198.73	688,003.26	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,328	232.39	3,794,463.92	
NORTHERN TRUST CORP	12,472	91.90	1,146,176.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,985	303.13	3,026,753.05	
NORTONLIFELOCK INC	35,236	21.24	748,412.64	
NOVOCURE LTD	5,411	160.19	866,788.09	
NRG ENERGY INC	15,092	33.79	509,958.68	
NUCOR CORP	18,933	53.93	1,021,056.69	
NVIDIA CORP	38,916	530.88	20,659,726.08	
NVR INC	222	4,226.87	938,365.14	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,615	155.51	2,739,308.65	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,668	451.15	2,105,968.20	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	58,742	18.52	1,087,901.84	
OGE ENERGY CORP	12,882	31.14	401,145.48	
OKTA INC	7,582	271.81	2,060,863.42	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,135	199.54	1,224,177.90	

OMNICOM GROUP	13,756	61.62	847,644.72
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	25,994	31.54	819,850.76
ONEOK INC	28,111	39.87	1,120,785.57
ORACLE CORP	125,787	65.06	8,183,702.22
OTIS WORLDWIDE CORP	25,988	65.61	1,705,072.68
OWENS CORNING	6,860	76.91	527,602.60
PACCAR INC	21,878	86.01	1,881,726.78
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,971	134.86	805,249.06
PALO ALTO NETWORKS INC	6,106	355.53	2,170,866.18
PARKER HANNIFIN CORP	8,115	272.00	2,207,280.00
PAYCHEX INC	20,372	96.92	1,974,454.24
PAYCOM SOFTWARE INC	3,140	439.84	1,381,097.60
PAYPAL HOLDINGS INC	70,354	236.45	16,635,203.30
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,351	139.84	1,727,163.84
PENTAIR PLC	10,389	52.26	542,929.14
PEPSICO INC	87,373	146.93	12,837,714.89
PERKINELMER INC	7,045	142.70	1,005,321.50
PERRIGO CO PLC	8,597	46.09	396,235.73
PFIZER INC	350,580	37.68	13,209,854.40
PG&E CORP	91,981	12.27	1,128,606.87
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	98,315	86.09	8,463,938.35
PHILLIPS 66	27,548	66.85	1,841,583.80
PINNACLE WEST CAPITAL	7,122	78.65	560,145.30
PINTEREST INC- CLASS A	29,163	70.36	2,051,908.68
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,196	114.36	1,166,014.56
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,786	144.91	3,881,559.26
POOL CORP	2,513	364.37	915,661.81
PPD INC	7,776	35.31	274,570.56
PPG INDUSTRIES INC	14,877	145.43	2,163,562.11
PPL CORPORATION	48,769	26.95	1,314,324.55
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17,248	47.95	827,041.60
PROCTER & GAMBLE CO	157,045	139.04	21,835,536.80
PROGRESSIVE CORP	36,839	96.95	3,571,541.05
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,935	76.51	1,907,776.85
PTC INC	6,953	118.39	823,165.67
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	31,951	56.82	1,815,455.82
PULTE GROUP INC	16,917	45.10	762,956.70
QORVO INC	7,175	162.66	1,167,085.50
QUALCOMM INC	71,174	147.42	10,492,471.08
QUEST DIAGNOSTICS	8,455	120.36	1,017,643.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,682	93.86	721,032.52
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	96,470	70.17	6,769,299.90
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,578	498.89	3,281,698.42
REGIONS FINANCIAL CORP	60,008	15.26	915,722.08
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4,271	114.46	488,858.66

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,188	165.88	528,825.44	
REPUBLIC SERVICES INC	14,201	96.78	1,374,372.78	
RESMED INC	9,125	218.45	1,993,356.25	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,690	387.83	1,818,922.70	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	7,201	63.05	454,023.05	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,323	247.95	1,815,737.85	
ROKU INC	6,690	340.71	2,279,349.90	
ROLLINS INC	13,909	40.60	564,705.40	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,604	426.19	2,814,558.76	
ROSS STORES INC	22,472	117.66	2,644,055.52	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,523	72.29	832,997.67	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,183	44.40	318,925.20	
RPM INTERNATIONAL INC	8,228	89.01	732,374.28	
S&P GLOBAL INC	15,197	322.50	4,901,032.50	
SALESFORCE.COM INC	57,410	227.43	13,056,756.30	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,746	175.40	832,448.40	
SCHLUMBERGER LTD	87,621	22.31	1,954,824.51	
SEAGATE TECHNOLOGY	14,619	64.72	946,141.68	
SEAGEN INC	7,688	201.15	1,546,441.20	
SEALED AIR CORP	9,844	45.41	447,016.04	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,535	56.16	423,165.60	
SEMPRA ENERGY	18,286	130.70	2,389,980.20	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,975	50.59	504,635.25	
SERVICENOW INC	12,088	565.43	6,834,917.84	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,179	728.23	3,771,503.17	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	69,716	6.31	439,907.96	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,495	148.19	1,555,254.05	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	24,602	42.79	1,052,719.58	
SMITH (A.O.) CORP	8,577	55.64	477,224.28	
SNAP INC - A	57,318	52.99	3,037,280.82	
SNAP-ON INC	3,231	169.86	548,817.66	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,045	334.25	683,541.25	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,162	314.50	994,449.00	
SOUTHERN CO	66,842	60.14	4,019,877.88	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,090	46.03	418,412.70	
SPLUNK INC	10,042	165.89	1,665,867.38	
SQUARE INC - A	23,422	235.45	5,514,709.90	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,669	71.20	1,044,432.80	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,076	181.52	1,828,995.52	
STARBUCKS CORP	73,783	103.28	7,620,308.24	
STATE STREET CORP	22,152	70.66	1,565,260.32	
STEEL DYNAMICS INC	13,134	36.12	474,400.08	
STERIS PLC	5,346	184.90	988,475.40	
STRYKER CORP	21,336	240.00	5,120,640.00	
SUNRUN INC	7,441	62.70	466,550.70	

SVB FINANCIAL GROUP	3,228	357.80	1,154,978.40	
SYNCHRONY FINANCIAL	33,230	32.35	1,074,990.50	
SYNOPSYS INC	9,522	255.00	2,428,110.00	
SYSCO CORP	30,546	72.28	2,207,864.88	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,167	150.44	2,131,283.48	
T-MOBILE US INC	35,217	131.92	4,645,826.64	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,193	203.39	1,462,984.27	
TARGET CORP	31,562	170.42	5,378,796.04	
TE CONNECTIVITY LTD	20,825	117.49	2,446,729.25	
TELADOC HEALTH INC	7,230	196.34	1,419,538.20	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,326	380.47	884,973.22	
TELEFLEX INC	2,940	408.90	1,202,166.00	
TERADYNE INC	10,372	120.59	1,250,759.48	
TESLA, INC.	47,050	695.00	32,699,750.00	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	69,280	10.01	693,492.80	
TEXAS INSTRUMENTS INC	57,753	164.07	9,475,534.71	
TEXTRON INC	14,297	47.37	677,248.89	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,949	466.68	11,643,199.32	
TIFFANY & CO	6,883	131.10	902,361.30	
TJX COS INC	75,713	67.70	5,125,770.10	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,309	147.08	1,075,007.72	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	2,634	951.50	2,506,251.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,684	68.37	388,615.08	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,157	141.06	2,138,046.42	
TRANSDIGM GROUP INC	3,257	608.33	1,981,330.81	
TRANSUNION	12,088	99.36	1,201,063.68	
TRAVELERS COS INC/THE	15,898	138.86	2,207,596.28	
TRIMBLE INC	15,774	66.15	1,043,450.10	
TRUIST FINANCIAL CORP	85,183	45.90	3,909,899.70	
TWILIO INC - A	8,239	365.03	3,007,482.17	
TWITTER INC	49,899	55.87	2,787,857.13	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,529	448.81	1,135,040.49	
TYSON FOODS INC-CL A	18,542	64.95	1,204,302.90	
UBER TECHNOLOGIES INC	61,089	50.62	3,092,325.18	
UGI CORP	13,288	35.54	472,255.52	
ULTA BEAUTY INC	3,375	268.43	905,951.25	
UNION PACIFIC CORP	43,141	203.60	8,783,507.60	
UNITED PARCEL SERVICE INC	44,744	175.18	7,838,253.92	
UNITED RENTALS INC	4,537	227.54	1,032,348.98	
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,933	338.38	20,280,128.54	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4,872	137.29	668,876.88	
US BANCORP	85,600	44.86	3,840,016.00	
VAIL RESORTS INC	2,537	274.21	695,670.77	
VALERO ENERGY CORP	25,756	54.77	1,410,656.12	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,728	174.80	1,001,254.40	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,505	275.71	2,344,913.55	
VERISIGN INC	6,529	217.82	1,422,146.78	
VERISK ANALYTICS INC	9,741	204.47	1,991,742.27	

VERIZON COMMUNICATIONS INC	261,452	60.46	15,807,387.92	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,377	236.72	3,876,763.44	
VF CORP	20,960	84.88	1,779,084.80	
VIACOMCBS INC	35,661	35.26	1,257,406.86	
VIATRIS INC	77,471	17.75	1,375,110.25	
VISA INC-CLASS A SHARES	106,346	211.31	22,471,973.26	
VISTRA CORP	27,692	17.65	488,763.80	
VMWARE INC-CLASS A	5,284	140.14	740,499.76	
VOYA FINANCIAL INC	7,918	56.06	443,883.08	
VULCAN MATERIALS CO	8,359	145.22	1,213,893.98	
WABTEC CORP	11,493	73.44	844,045.92	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,463	40.69	1,890,579.47	
WALMART INC	89,288	145.95	13,031,583.60	
WALT DISNEY CO	114,046	172.89	19,717,412.94	
WASTE CONNECTIONS INC	16,728	101.04	1,690,197.12	
WASTE MANAGEMENT INC	26,750	117.41	3,140,717.50	
WATERS CORP	3,902	250.38	976,982.76	
WAYFAIR INC- CLASS A	4,105	276.73	1,135,976.65	
WEC ENERGY GROUP INC	19,918	91.32	1,818,911.76	
WELLS FARGO & CO	246,835	29.01	7,160,683.35	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,632	277.66	1,286,121.12	
WESTERN DIGITAL CORP	19,087	53.19	1,015,237.53	
WESTERN UNION CO	26,016	22.77	592,384.32	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	16,304	44.62	727,484.48	
WEYERHAEUSER CO	46,977	33.74	1,585,003.98	
WHIRLPOOL CORP	3,924	188.37	739,163.88	
WILLIAMS COS INC	76,579	21.18	1,621,943.22	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,124	204.89	1,664,526.36	
WIX.COM LTD	3,495	273.45	955,707.75	
WORKDAY INC-CLASS A	11,164	241.39	2,694,877.96	
WR BERKLEY CORP	8,919	66.28	591,151.32	
WW GRAINGER INC	2,857	410.46	1,172,684.22	
WYNN RESORTS LTD	6,170	115.93	715,288.10	
XCEL ENERGY INC	33,172	66.10	2,192,669.20	
XILINX INC	15,401	149.19	2,297,675.19	
XPO LOGISTICS INC	5,950	119.11	708,704.50	
XYLEM INC	11,379	100.05	1,138,468.95	
YUM! BRANDS INC	18,951	109.78	2,080,440.78	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,356	373.00	1,251,788.00	
ZENDESK INC	7,295	140.27	1,023,269.65	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	9,203	135.20	1,244,245.60	
ZILLOW GROUP INC - CL A	3,735	140.15	523,460.25	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,055	151.85	1,982,401.75	
ZOETIS INC	30,018	163.63	4,911,845.34	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,909	406.01	4,429,163.09	
ZSCALER INC	4,533	195.88	887,924.04	
アメリカ・ドル 小計	19,714,340		2,073,193,051.64	



(214,368,161,540)

イギリス・ボン ド	3I GROUP PLC	60,667	11.57	702,220.52	
	ADMIRAL GROUP PLC	12,106	29.43	356,279.58	
	ANGLO AMERICAN PLC	77,003	24.24	1,866,552.72	
	ANTOFAGASTA PLC	24,587	14.38	353,561.06	
	ASHTREAD GROUP PLC	28,351	33.50	949,758.50	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22,415	22.49	504,113.35	
	ASTRAZENECA PLC	82,834	75.08	6,219,176.72	
	AUTO TRADER GROUP PLC- WI	60,757	5.89	357,858.73	
	AVEVA GROUP PLC	5,163	32.09	165,680.67	
	AVIVA PLC	244,293	3.26	796,639.47	
	BAE SYSTEMS PLC	202,969	4.92	999,013.41	
	BARCLAYS PLC	1,087,607	1.45	1,577,030.15	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,501	6.50	419,256.50	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	8,005	43.76	350,298.80	
	BHP GROUP PLC	132,549	19.73	2,615,191.77	
	BP PLC	1,281,521	2.71	3,476,766.47	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	144,754	27.85	4,031,398.90	
	BT GROUP PLC	564,714	1.35	764,058.04	
	BUNZL PLC	21,218	24.50	519,841.00	
	BURBERRY GROUP PLC	25,657	18.20	467,085.68	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	12,648	23.86	301,781.28	
	COMPASS GROUP PLC	112,412	14.06	1,580,512.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,785	63.34	556,441.90	
	DCC PLC	6,238	54.50	339,971.00	
	DIAGEO PLC	147,677	29.49	4,354,994.73	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	85,299	3.12	266,132.88	
	ENTAIN PLC	36,747	11.50	422,774.23	
	EVRAZ PLC	31,584	4.79	151,571.61	
	EXPERIAN PLC	57,888	28.23	1,634,178.24	
	FERGUSON PLC	14,161	88.74	1,256,647.14	
	FRESNILLO PLC	11,521	11.39	131,281.79	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	317,270	13.56	4,303,450.28	
	GLENCORE PLC	629,000	2.42	1,522,180.00	
	HALMA PLC	23,907	24.54	586,677.78	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,837	14.97	311,929.89	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,821	25.80	279,181.80	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,284,648	3.87	4,980,580.29	
	IMPERIAL BRANDS PLC	59,821	15.73	940,984.33	
	INFORMA PLC	96,219	5.33	512,847.27	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	11,003	46.47	511,309.41	
INTERTEK GROUP PLC	10,202	58.72	599,061.44		
JD SPORTS FASHION PLC	27,534	8.11	223,355.80		
JOHNSON MATTHEY PLC	12,150	24.82	301,563.00		
KINGFISHER PLC	131,371	2.70	355,884.03		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	377,848	2.56	967,290.88		

LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,458,509	0.34	1,556,019.64		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,003	89.22	1,784,667.66		
M&G PLC	165,157	1.97	326,515.38		
MELROSE INDUSTRIES PLC	307,886	1.69	520,943.11		
MONDI PLC/WI	30,460	17.46	531,983.90		
MORRISON WM SUPERMARKETS	150,097	1.74	261,919.26		
NATIONAL GRID PLC	222,479	8.67	1,930,227.80		
NATWEST GROUP PLC	303,413	1.57	477,268.64		
NEXT PLC	8,402	67.84	569,991.68		
NMC HEALTH PLC	4,758	0.00	4.75		
OCADO GROUP PLC	30,760	22.09	679,488.40		
PEARSON PLC	47,426	6.78	321,548.28		
PERSIMMON PLC	20,178	27.04	545,613.12		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	35,452	7.09	251,354.68		
PRUDENTIAL PLC	164,547	13.39	2,204,107.06		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	45,011	64.54	2,905,009.94		
RELX PLC	122,111	18.01	2,199,219.11		
RENTOKIL INITIAL PLC	117,463	5.24	615,975.97		
RIO TINTO PLC	70,629	56.54	3,993,363.66		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	530,565	1.13	604,313.53		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	259,206	13.81	3,580,153.27		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	233,116	13.41	3,126,085.56		
RSA INSURANCE GROUP PLC	64,719	6.77	438,147.63		
SAGE GROUP PLC	68,540	5.87	402,603.96		
SAINSBURY (J) PLC	110,744	2.26	250,613.67		
SCHRODERS PLC	7,800	32.99	257,322.00		
SEVERN TRENT PLC	15,339	23.09	354,177.51		
SMITH & NEPHEW PLC	55,024	15.34	844,343.28		
SMITHS GROUP PLC	25,089	15.46	388,001.38		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,669	112.90	527,130.10		
SSE PLC	66,108	14.82	979,720.56		
ST JAMES'S PLACE PLC	33,763	11.28	381,015.45		
STANDARD CHARTERED PLC	168,197	4.65	783,293.42		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	141,451	2.86	404,832.76		
TAYLOR WIMPEY PLC	230,529	1.61	372,304.33		
TESCO PLC	619,879	2.26	1,404,645.81		
UNILEVER PLC	73,876	43.48	3,212,128.48		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	43,680	9.09	397,313.28		
VODAFONE GROUP PLC	1,697,345	1.25	2,136,957.35		
WHITBREAD PLC	12,756	30.75	392,247.00		
WPP PLC	78,692	8.14	640,552.88		
イギリス・ポンド 小計	18,555,090		98,437,491.01 (13,647,373,754)		
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	2,806	187.20	525,283.20	
	BANK HAPOALIM BM	71,669	21.45	1,537,300.05	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,609	18.89	1,711,604.01	

	ELBIT SYSTEMS LTD	1,688	397.70	671,317.60	
	ICL GROUP LTD	43,808	15.11	661,938.88	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	72,887	11.55	841,844.85	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,013	69.40	625,502.20	
	NICE LTD	3,956	882.00	3,489,192.00	
イスラエル・シュケル	小計	296,436		10,063,982.79 (321,242,330)	
オーストラリア・ドル	AFTERPAY LTD	13,595	111.29	1,512,987.55	
	AGL ENERGY LTD	44,758	13.22	591,700.76	
	AMP LTD	231,269	1.69	392,000.95	
	AMPOL LTD	17,076	28.51	486,836.76	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,617	30.46	1,145,813.82	
	ASX LTD	13,383	74.16	992,483.28	
	AURIZON HOLDINGS LTD	146,613	4.02	589,384.26	
	AUSNET SERVICES	152,469	1.84	281,305.30	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	183,564	23.24	4,266,027.36	
	BHP GROUP LIMITED	187,582	43.15	8,094,163.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	33,933	17.75	602,310.75	
	BRAMBLES LTD	101,590	10.68	1,084,981.20	
	CIMIC GROUP LIMITED	7,987	25.81	206,144.47	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,928	12.90	463,471.20	
	COCHLEAR LTD	4,457	198.48	884,625.36	
	COLES GROUP LTD	87,621	18.30	1,603,464.30	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	113,340	83.16	9,425,354.40	
	COMPUTERSHARE LIMITED	36,428	14.88	542,048.64	
	CROWN RESORTS LTD	29,721	9.79	290,968.59	
	CSL LIMITED	28,916	288.98	8,356,145.68	
	EVOLUTION MINING LTD	108,094	5.09	550,198.46	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	107,891	22.91	2,471,782.81	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	165,684	4.91	813,508.44	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	29,191	37.71	1,100,792.61	
	MACQUARIE GROUP LTD	22,475	137.96	3,100,651.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8,714	55.29	481,797.06	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	189,632	2.93	555,621.76	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	212,602	23.37	4,968,508.74	
	NEWCREST MINING LIMITED	53,057	27.28	1,447,394.96	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	48,389	12.84	621,314.76	
	OIL SEARCH LTD	131,703	3.59	472,813.77	
	ORICA LTD	31,293	15.52	485,667.36	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	122,311	4.90	599,323.90	
	QANTAS AIRWAYS LTD	66,011	4.92	324,774.12	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	97,865	8.71	852,404.15	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	12,922	62.64	809,434.08	
	REA GROUP LTD	3,803	147.35	560,372.05	
	RIO TINTO LTD	23,905	117.53	2,809,554.65	

	SANTOS LTD	118,155	6.36	751,465.80	
	SEEK LTD	23,437	28.85	676,157.45	
	SONIC HEALTHCARE LTD	30,649	33.40	1,023,676.60	
	SOUTH32 LTD	326,662	2.57	839,521.34	
	SUNCORP GROUP LTD	91,174	9.74	888,034.76	
	TABCORP HOLDINGS LTD	155,088	4.00	620,352.00	
	TELSTRA CORP LTD	289,533	3.03	877,284.99	
	TPG TELECOM LTD	29,033	7.35	213,392.55	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	47,809	9.43	450,838.87	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,611	30.18	229,699.98	
	WESFARMERS LIMITED	74,546	51.21	3,817,500.66	
	WESTPAC BANKING CORP	233,198	19.90	4,640,640.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	9,661	32.95	318,329.95	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	65,129	23.64	1,539,649.56	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	81,747	39.99	3,269,062.53	
	XERO LTD	7,941	150.59	1,195,835.19	
オーストラリア・ドル	小計	4,534,762		86,189,575.04 (6,765,881,640)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	15,180	91.59	1,390,336.20	
	AIR CANADA	9,296	23.06	214,365.76	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	38,355	20.42	783,209.10	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	54,116	44.82	2,425,479.12	
	ALTAGAS LTD	17,668	18.61	328,801.48	
	ATCO LTD -CL 'I'	4,976	36.56	181,922.56	
	B2GOLD CORP	63,641	7.16	455,669.56	
	BANK OF MONTREAL	40,573	96.44	3,912,860.12	
	BANK OF NOVA SCOTIA	76,419	67.93	5,191,142.67	
	BARRICK GOLD CORP	112,011	29.75	3,332,327.25	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	20,393	26.47	539,802.71	
	BCE INC	10,681	55.51	592,902.31	
	BLACKBERRY LTD	34,103	8.85	301,811.55	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	81,258	51.36	4,173,410.88	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	7,689	66.98	515,009.22	
	CAE INC	17,790	33.49	595,787.10	
	CAMECO CORP	24,359	17.13	417,269.67	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	28,179	111.98	3,155,484.42	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	45,669	141.54	6,463,990.26	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	74,353	30.86	2,294,533.58	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,785	439.73	3,863,028.05	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,613	170.18	614,860.34	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,612	31.11	267,919.32	
	CANOPY GROWTH CORP	14,192	33.28	472,309.76	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,542	60.15	573,951.30	
	CENOVUS ENERGY INC	65,439	7.57	495,373.23	
	CGI INC	14,447	101.07	1,460,158.29	

CI FINANCIAL CORP	12,533	16.30	204,287.90	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,270	1,645.75	2,090,102.50	
DOLLARAMA INC	18,790	54.00	1,014,660.00	
EMERA INC	16,210	54.34	880,851.40	
EMPIRE CO LTD 'A'	10,578	34.65	366,527.70	
ENBRIDGE INC	128,466	41.93	5,386,579.38	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,671	430.21	718,880.91	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	36,887	21.65	798,603.55	
FIRSTSERVICE CORP	2,547	169.65	432,098.55	
FORTIS INC	29,962	52.52	1,573,604.24	
FRANCO-NEVADA CORP	12,022	169.45	2,037,127.90	
GEORGE WESTON LTD	4,886	98.17	479,658.62	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,158	35.44	430,879.52	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,568	35.79	449,808.72	
GREAT-WEST LIFECO INC	17,977	29.33	527,265.41	
HYDRO ONE LTD	21,364	28.84	616,137.76	
IA FINANCIAL CORP INC	6,691	54.23	362,852.93	
IGM FINANCIAL INC	5,462	35.06	191,497.72	
IMPERIAL OIL LTD	15,954	24.41	389,437.14	
INTACT FINANCIAL CORP	9,063	148.88	1,349,299.44	
INTER PIPELINE LTD	27,008	12.89	348,133.12	
KEYERA CORP	13,856	23.42	324,507.52	
KINROSS GOLD CORP	77,749	9.37	728,508.13	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	16,525	53.65	886,566.25	
LOBLAW COS LTD	11,097	64.60	716,866.20	
LUNDIN MINING CORP	40,851	10.31	421,173.81	
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,008	81.52	1,468,012.16	
MANULIFE FINANCIAL CORP	122,195	22.21	2,713,950.95	
METRO INC	15,966	57.96	925,389.36	
NATIONAL BANK OF CANADA	21,219	71.63	1,519,916.97	
NORTHLAND POWER INC	12,199	42.94	523,825.06	
NUTRIEN LTD	35,915	61.14	2,195,843.10	
ONEX CORPORATION	5,116	71.90	367,840.40	
OPEN TEXT CORP	17,417	57.77	1,006,180.09	
PAN AMERICAN SILVER CORP	13,391	42.85	573,804.35	
PARKLAND CORP	9,536	41.85	399,081.60	
PEMBINA PIPELINE CORP	34,740	32.08	1,114,459.20	
POWER CORP OF CANADA	35,545	29.05	1,032,582.25	
QUEBECOR INC -CL B	11,509	32.89	378,531.01	
RESTAURANT BRANDS INTERN	18,244	79.29	1,446,566.76	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,928	87.06	603,151.68	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	22,805	59.72	1,361,914.60	
ROYAL BANK OF CANADA	89,881	104.05	9,352,118.05	
SAPUTO INC	15,526	35.56	552,104.56	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,296	22.63	685,598.48	
SHOPIFY INC - CLASS A	6,831	1,500.92	10,252,784.52	
SSR MINING INC	14,031	25.51	357,930.81	

	SUN LIFE FINANCIAL INC	36,950	55.82	2,062,549.00	
	SUNCOR ENERGY INC	96,202	22.13	2,128,950.26	
	TC ENERGY CORP	59,554	54.81	3,264,154.74	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	29,508	22.87	674,847.96	
	THOMSON REUTERS CORP	11,030	103.31	1,139,509.30	
	TMX GROUP LTD	3,664	127.09	465,657.76	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,297	91.06	482,344.82	
	TORONTO-DOMINION BANK	113,729	71.78	8,163,467.62	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28,340	53.79	1,524,408.60	
	WSP GLOBAL INC	7,247	120.53	873,480.91	
	YAMANA GOLD INC	59,304	7.26	430,547.04	
カナダ・ドル 小計		2,473,607		128,781,136.10 (10,392,637,683)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND LTD	177,900	3.29	585,291.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,900	8.08	241,592.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	113,200	25.09	2,840,188.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	376,900	0.87	327,903.00	
	KEPPEL CORP LTD	93,900	5.41	507,999.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	208,800	10.08	2,104,704.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	88,200	4.43	390,726.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	50,300	9.22	463,766.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	98,500	3.90	384,150.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	522,500	2.33	1,217,425.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	74,100	22.69	1,681,329.00	
	UOL Group Limited	29,600	7.74	229,104.00	
	VENTURE CORP LTD	17,300	19.44	336,312.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	120,600	4.36	525,816.00	
シンガポール・ドル 小計		2,001,700		11,836,305.00 (919,680,899)	
スイス・フラン	ABB LTD	116,354	24.14	2,808,785.56	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,834	59.22	582,369.48	
	ALCON INC	31,019	57.52	1,784,212.88	
	BALOISE HOLDING AG	2,948	156.70	461,951.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,091	95.50	199,690.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	192	2,068.00	397,056.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	64	8,470.00	542,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	88,200.00	529,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	32,950	80.06	2,637,977.00	
	CLARIANT AG	12,748	18.30	233,288.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	153,686	11.17	1,717,441.05	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	510	828.00	422,280.00	
	GEBERIT AG-REG	2,340	536.80	1,256,112.00	
	GIVAUDAN-REG	583	3,697.00	2,155,351.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,167	49.92	707,216.64	

	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,464	203.00	703,192.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	32,949	48.01	1,581,881.49	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,246	82.68	847,139.28	
	LONZA GROUP AG	4,706	556.60	2,619,359.60	
	NESTLE SA	181,665	102.30	18,584,329.50	
	NOVARTIS AG	140,078	80.51	11,277,679.78	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,176	998.60	1,174,353.60	
	ROCHE HOLDING AG	44,288	309.95	13,727,065.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,409	238.60	336,187.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,463	239.20	589,149.60	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	382	2,643.00	1,009,626.00	
	SIKA AG-BEARER	8,959	237.00	2,123,283.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,448	224.80	775,110.40	
	STRAUMANN HOLDING AG	653	1,021.00	666,713.00	
	SWATCH GROUP AG	1,683	238.20	400,890.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,928	404.90	780,647.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,116	87.40	447,138.40	
	SWISS RE AG	18,052	82.80	1,494,705.60	
	SWISSCOM AG	1,687	472.70	797,444.90	
	TEMENOS GROUP AG-REG	4,253	119.90	509,934.70	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	3,886	46.26	179,766.36	
	UBS GROUP AG	230,968	12.43	2,872,087.08	
	VIFOR PHARMA AG	2,876	134.75	387,541.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,502	368.50	3,501,487.00	
スイス・フラン	小計	1,095,329		83,821,725.20 (9,790,377,504)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	20,040	225.00	4,509,000.00	
	ASSA ABLOY AB	63,644	205.80	13,097,935.20	
	ATLAS COPCO AB	24,426	374.30	9,142,651.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	42,627	430.50	18,350,923.50	
	BOLIDEN AB	17,026	286.40	4,876,246.40	
	ELECTROLUX AB	14,435	196.65	2,838,642.75	
	EPIROC AB-A	41,621	152.05	6,328,473.05	
	EPIROC AB-B	24,795	142.70	3,538,246.50	
	EQT AB	14,970	190.05	2,845,048.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	38,730	262.40	10,162,752.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	10,050	791.20	7,951,560.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,527	422.30	2,756,352.10	
	HENNES & MAURITZ AB	50,684	173.80	8,808,879.20	
	HEXAGON AB-B SHS	17,795	732.40	13,033,058.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	26,519	107.50	2,850,792.50	
	ICA GRUPPEN AB	6,352	415.50	2,639,256.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,143	273.00	1,677,039.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,246	264.00	2,704,944.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9,303	196.50	1,828,039.50	

	INVESTOR AB	28,298	589.60	16,684,500.80	
	KINNEVIK AB - B	14,887	422.35	6,287,524.45	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,719	437.00	2,062,203.00	
	LUNDIN ENERGY AB	11,591	221.70	2,569,724.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	20,018	264.10	5,286,753.80	
	NORDEA BANK ABP	204,187	68.58	14,003,144.46	
	SANDVIK AB	71,254	202.80	14,450,311.20	
	SECURITAS AB	20,051	134.50	2,696,859.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	103,206	85.48	8,822,048.88	
	SKANSKA AB-B SHS	21,800	204.90	4,466,820.00	
	SKF AB	24,119	215.60	5,200,056.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB	37,862	143.15	5,419,945.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	98,593	83.36	8,218,712.48	
	SWEDBANK AB - A SHARES	56,861	145.16	8,253,942.76	
	SWEDISH MATCH AB	10,227	637.40	6,518,689.80	
	TELE2 AB	33,273	111.50	3,709,939.50	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	183,771	98.90	18,174,951.90	
	TELIA CO AB	159,769	34.63	5,532,800.47	
	VOLVO AB	90,001	198.35	17,851,698.35	
スウェーデン・クローナ 小計		1,640,420		276,150,467.75 (3,446,357,838)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	201	13,190.00	2,651,190.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	395	14,115.00	5,575,425.00	
	AMBU A/S-B	10,277	224.60	2,308,214.20	
	CARLSBERG AS-B	6,502	964.00	6,267,928.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,688	621.00	4,153,248.00	
	COLOPLAST-B	7,447	936.00	6,970,392.00	
	DANSKE BANK A/S	43,138	97.78	4,218,033.64	
	DEMANT A/S	6,768	231.80	1,568,822.40	
	DSV PANALPINA A/S	13,151	1,028.00	13,519,228.00	
	GENMAB A/S	4,121	2,425.00	9,993,425.00	
	GN STORE NORD A/S	8,041	486.40	3,911,142.40	
	H LUNDBECK A/S	4,455	211.00	940,005.00	
	NOVO-NORDISK A/S	108,502	446.40	48,435,292.80	
	NOVOZYMES A/S	13,065	350.20	4,575,363.00	
	ORSTED A/S	11,948	1,110.50	13,268,254.00	
	PANDORA A/S	6,285	653.00	4,104,105.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	506	2,264.00	1,145,584.00	
	TRYGVESTA AS	9,774	191.00	1,866,834.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,414	1,333.00	16,547,862.00		
デンマーク・クローネ 小計		273,678		152,020,348.44 (2,581,305,517)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	46,890	11.00	515,790.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	83,082	7.75	644,300.91	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,281	34.21	1,241,173.01	
	MERCURY NZ LTD	45,503	5.92	269,605.27	
	MERIDIAN ENERGY LTD	82,237	6.58	541,119.46	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	25,992	15.25	396,378.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	124,249	4.64	577,136.60	



ニュージーランド・ドル	小計	444,234		4,185,503.25 (307,215,938)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	15,198	143.10	2,174,833.80	
	DNB ASA	60,276	161.60	9,740,601.60	
	EQUINOR ASA	61,226	146.00	8,938,996.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,114	187.70	2,461,497.80	
	MOWI ASA	27,973	182.60	5,107,869.80	
	NORSK HYDRO ASA	84,311	40.35	3,401,948.85	
	ORKLA ASA	47,658	85.50	4,074,759.00	
	SCHIBSTED ASA	4,839	365.00	1,766,235.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,199	320.60	1,987,399.40	
	TELENOR ASA	45,903	147.00	6,747,741.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	10,873	354.00	3,849,042.00		
ノルウェー・クローネ	小計	377,570		50,250,924.25 (602,508,581)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	26,777	7.99	214,001.78	
	ACCOR	11,631	29.54	343,579.74	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	17,006	26.31	447,427.86	
	ADIDAS AG	12,012	289.90	3,482,278.80	
	ADP	2,097	102.10	214,103.70	
	ADYEN NV	1,145	1,949.50	2,232,177.50	
	AEGON NV	110,661	3.09	342,717.11	
	AENA SME SA	4,440	136.10	604,284.00	
	AGEAS	10,956	43.60	477,681.60	
	AIR LIQUIDE	29,891	134.40	4,017,350.40	
	AIRBUS SE	37,147	89.00	3,306,083.00	
	AKZO NOBEL NV	12,192	87.28	1,064,117.76	
	ALLIANZ SE	26,277	199.98	5,254,874.46	
	ALSTOM RGPT	15,835	46.00	728,410.00	
	ALTICE NV - A-W/I	41,128	5.33	219,212.24	
	AMADEUS IT GROUP SA	28,436	57.68	1,640,188.48	
	AMPLIFON SPA	7,841	33.95	266,201.95	
	AMUNDI SA	3,834	67.50	258,795.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	48,150	58.03	2,794,144.50	
	ARCELORMITTAL	45,102	18.78	847,195.96	
	ARGENX SE	2,841	247.60	703,431.60	
	ARKEMA	4,340	96.66	419,504.40	
	AROUNDTOWN SA	64,396	5.96	384,315.32	
	ASML HOLDING NV	26,854	389.55	10,460,975.70	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	69,606	14.38	1,000,934.28	
	ATLANTIA SPA	31,638	14.43	456,694.53	
	ATOS SE	6,182	75.02	463,773.64	
	AXA SA	121,910	19.88	2,424,058.44	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	418,622	4.05	1,697,093.58	
	BANCO SANTANDER SA	1,092,934	2.57	2,817,583.85	
	BASF SE	57,943	64.52	3,738,482.36	
	BAYER AG	62,079	49.05	3,044,974.95	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,913	74.19	1,551,535.47	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,599	56.10	201,903.90	
BECHTLE AG	1,718	181.30	311,473.40		
BEIERSDORF AG	6,347	93.22	591,667.34		

BIOMERIEUX	2,596	118.20	306,847.20
BNP PARIBAS	70,770	43.56	3,083,095.05
BOLLORE	58,570	3.45	202,535.06
BOUYGUES	14,535	34.15	496,370.25
BRENTAG AG	9,693	64.96	629,657.28
BUREAU VERITAS SA	18,949	22.50	426,352.50
CAIXABANK	223,728	2.19	491,977.87
CAPGEMINI SA	10,149	120.50	1,222,954.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,536	109.20	276,931.20
CARREFOUR SA	38,226	13.56	518,344.56
CELLNEX TELECOM SAU	20,127	50.10	1,008,362.70
CIE DE SAINT-GOBAIN	32,734	37.42	1,224,906.28
CNH INDUSTRIAL NV	64,934	9.77	634,794.78
CNP ASSURANCES	10,761	13.44	144,627.84
COLRUYT NV	3,335	49.39	164,715.65
COMMERZBANK AG	62,093	5.28	328,223.59
CONTINENTAL AG	6,930	119.35	827,095.50
COVESTRO AG	11,412	50.80	579,729.60
CREDIT AGRICOLE SA	72,425	10.30	745,977.50
CRH PLC	49,334	34.75	1,714,356.50
DAIMLER AG	53,924	58.67	3,163,721.08
DANONE	39,041	54.08	2,111,337.28
DASSAULT AVIATION SA	153	883.50	135,175.50
DASSAULT SYSTEMES SA	8,369	161.55	1,352,011.95
DAVIDE CAMPARI -MILANO NV	36,314	9.25	336,122.38
DELIVERY HERO SE	8,170	119.00	972,230.00
DEUTSCHE BANK AG	123,715	9.03	1,117,146.45
DEUTSCHE BOERSE AG	11,966	140.30	1,678,829.80
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	19,104	9.68	185,003.13
DEUTSCHE POST AG	62,888	41.17	2,589,098.96
DEUTSCHE TELEKOM AG	210,965	15.09	3,184,516.67
DEUTSCHE WOHNEN SE	21,657	42.90	929,085.30
DIASORIN SPA	1,562	170.70	266,633.40
E.ON SE	142,648	9.02	1,287,255.55
EDENRED	15,781	47.41	748,177.21
EDF	39,369	12.48	491,521.96
EIFFAGE	5,446	79.06	430,560.76
ELIA GROUP SA/NV	1,986	95.70	190,060.20
ELISA OYJ	9,212	45.50	419,146.00
ENAGAS SA	15,462	19.07	294,860.34
ENDESA SA	20,086	22.70	455,952.20
ENEL SPA	513,018	8.16	4,186,226.88
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	175,941	4.88	860,175.54
ENGIE	115,464	12.62	1,457,733.00
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	159,243	8.62	1,372,833.90
ERSTE GROUP BANK AG	17,748	24.95	442,812.60
ESSILORLUXOTTICA	18,009	129.80	2,337,568.20
EURAZEO	2,547	56.90	144,924.30
EUROFINS SCIENTIFIC	8,394	70.00	587,580.00
EVONIK INDUSTRIES AG	13,116	26.92	353,082.72
EXOR NV	6,836	62.56	427,660.16
FAURECIA	5,251	42.39	222,589.89
FERRARI NV	7,944	184.15	1,462,887.60
FERROVIAL S.A.	31,496	22.84	719,368.64

FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	69,185	14.52	1,005,119.68	
FINECOBANK SPA	38,253	12.79	489,447.13	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	9,720	165.10	1,604,772.00	
FORTUM OYJ	27,966	19.24	538,205.67	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	13,431	69.54	933,991.74	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26,319	38.58	1,015,387.02	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	4,240	47.92	203,180.80	
GALAPAGOS NV	2,716	80.24	217,931.84	
GALP ENERGIA SGPS SA	31,335	8.78	275,246.64	
GEA GROUP AG	9,606	29.52	283,569.12	
GETLINK SE - REGR	29,783	13.70	408,027.10	
GRIFOLS SA	18,789	24.90	467,846.10	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7,186	81.56	586,090.16	
HANNOVER RUECK SE	3,785	132.70	502,269.50	
HEIDELBERGCEMENT AG	9,281	60.78	564,099.18	
HEINEKEN HOLDING NV	7,346	77.35	568,213.10	
HEINEKEN NV	16,400	89.36	1,465,504.00	
HELLOFRESH SE	9,248	62.00	573,376.00	
HENKEL AG & CO KGAA	6,661	79.80	531,547.80	
HENKEL KGAA-VORZUG	11,074	91.16	1,009,505.84	
HERMES INTERNATIONAL	1,999	859.80	1,718,740.20	
HOCHTIEF AG	1,676	77.40	129,722.40	
IBERDROLA SA	379,578	11.41	4,330,984.98	
ILIAD SA	952	173.15	164,838.80	
INDITEX SA	68,588	26.16	1,794,262.08	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,352	30.88	2,543,029.76	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	21,555	10.05	216,627.75	
ING GROEP NV-CVA	245,918	7.87	1,936,850.16	
INTESA SANPAOLO	1,035,559	1.93	2,003,806.66	
IPSEN	2,368	70.15	166,115.20	
JDE PEET'S BV	4,881	35.00	170,835.00	
JERONIMO MARTINS	15,309	14.08	215,627.26	
JUST EAT TAKEAWAY	7,989	88.00	703,032.00	
KBC GROEP NV	15,701	58.58	919,764.58	
KERING	4,782	558.00	2,668,356.00	
KERRY GROUP PLC-A	10,030	120.80	1,211,624.00	
KESKO OYJ-B SHS	17,209	20.72	356,570.48	
KINGSPAN GROUP PLC	9,712	57.85	561,839.20	
KION GROUP AG	4,097	74.32	304,489.04	
KNORR-BREMSE AG	4,605	107.72	496,050.60	
KONE OYJ	21,433	66.96	1,435,153.68	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	69,298	23.42	1,622,959.16	
KONINKLIJKE DSM NV	10,870	139.55	1,516,908.50	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	57,332	44.79	2,568,186.94	
L'OREAL SA	15,868	305.40	4,846,087.20	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,363	36.83	197,519.29	
LANXESS	5,177	62.60	324,080.20	
LEG IMMOBILIEN AG	4,547	124.34	565,373.98	
LEGRAND SA	16,867	72.74	1,226,905.58	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	17,521	499.55	8,752,615.55	

MEDIOBANCA SPA	39,457	7.39	291,666.14
MERCK KGAA	8,133	136.90	1,113,407.70
MICHELIN (C.G.D.E.)	10,687	108.40	1,158,470.80
MONCLER SPA	12,173	48.50	590,390.50
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,351	205.20	687,625.20
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,809	245.20	2,159,966.80
NATIXIS	59,977	2.63	158,039.39
NATURGY ENERGY GROUP SA	18,699	18.88	353,037.12
NEMETSCHKE SE	3,632	60.75	220,644.00
NESTE OYJ	26,578	57.90	1,538,866.20
NEXI SPA	27,642	16.24	448,906.08
NN GROUP NV	18,119	35.26	638,875.94
NOKIA OYJ	355,666	3.24	1,154,491.83
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	4,304	62.95	270,936.80
OMV AG	9,145	32.58	297,944.10
ORANGE S.A.	127,286	9.95	1,266,495.70
ORION OYJ-CLASS B	6,633	37.89	251,324.37
ORPEA	3,317	108.30	359,231.10
PERNOD-RICARD	13,240	157.40	2,083,976.00
PEUGEOT SA	36,704	22.20	814,828.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	9,373	57.38	537,822.74
POSTE ITALIANE SPA	35,271	8.35	294,795.01
PROSUS	30,742	89.98	2,766,165.16
PROXIMUS	10,027	17.19	172,364.13
PRYSMIAN SPA	15,120	27.73	419,277.60
PUBLICIS GROUPE	13,714	41.51	569,268.14
PUMA AG	6,205	89.52	555,471.60
QIAGEN NV	14,515	43.16	626,467.40
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	9,174	16.66	152,838.84
RANDSTAD NV	7,521	54.96	413,354.16
RATIONAL AG	319	730.50	233,029.50
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,564	44.77	293,870.28
RED ELECTRICA DE ESPANA	27,225	16.61	452,343.37
REMY COINTREAU	1,415	151.80	214,797.00
RENAULT SA	12,232	36.16	442,309.12
REPSOL SA	92,349	8.14	751,905.55
REPSOL SA-RTS	92,349	0.27	25,765.37
ROYAL KPN NV	229,491	2.52	579,923.75
RWE AG	40,475	33.51	1,356,317.25
SAFRAN SA	20,212	115.05	2,325,390.60
SAMPO OYJ	29,663	34.40	1,020,407.20
SANOFI	71,486	79.01	5,648,108.86
SAP SE	65,857	104.26	6,866,250.82
SARTORIUS AG-VORZUG	2,240	346.00	775,040.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,745	291.20	508,144.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	33,962	117.35	3,985,440.70
SCOR REGROUPE	9,951	27.00	268,677.00
SCOUT24 AG	6,702	69.25	464,113.50
SEB SA	1,424	149.00	212,176.00
SIEMENS AG	48,242	117.82	5,683,872.44

SIEMENS ENERGY AG	25,173	26.42	665,070.66	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,037	29.48	443,290.76	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,906	41.68	704,642.08	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	15,396	38.72	596,133.12	
SNAM SPA	126,470	4.51	571,012.05	
SOCIETE GENERALE	50,978	17.04	868,665.12	
SODEXO	5,511	70.48	388,415.28	
SOFINA	926	262.50	243,075.00	
SOLVAY SA	4,710	99.00	466,290.00	
STMICROELECTRONICS NV	40,202	30.01	1,206,462.02	
STORA ENSO OYJ	36,336	15.68	569,748.48	
SUEZ	21,968	16.00	351,597.84	
SYMRISE AG	8,099	107.80	873,072.20	
TEAMVIEWER AG	9,485	43.75	414,968.75	
TELECOM ITALIA SPA	886,424	0.37	335,954.69	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	69,767	2.31	161,371.07	
TELEFONICA SA	305,604	3.32	1,015,522.09	
TELEFONICA SA-RTS	305,604	0.18	56,536.74	
TELEPERFORMANCE	3,721	272.20	1,012,856.20	
TENARIS SA	28,903	6.72	194,401.57	
TERNA SPA	89,084	6.12	545,550.41	
THALES SA	6,684	74.66	499,027.44	
TOTAL SE	158,907	35.99	5,719,062.93	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,754	78.92	454,105.68	
UCB SA	7,944	86.76	689,221.44	
UMICORE	12,409	39.06	484,695.54	
UNICREDIT SPA	133,458	7.72	1,030,429.21	
UNILEVER NV	92,379	47.92	4,426,801.68	
UNIPER SE	12,737	28.36	361,221.32	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,698	35.72	239,252.56	
UPM-KYMMENE OYJ	33,611	30.20	1,015,052.20	
VALEO SA	14,459	32.56	470,785.04	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,261	19.71	675,455.61	
VINCI SA	33,032	83.94	2,772,706.08	
VIVENDI SA	52,325	26.60	1,391,845.00	
VOESTALPINE AG	7,207	29.73	214,264.11	
VOLKSWAGEN AG	11,653	153.38	1,787,337.14	
VOLKSWAGEN AG	2,266	164.00	371,624.00	
VONOVIA SE	33,124	58.56	1,939,741.44	
VOPAK	4,363	43.11	188,088.93	
WARTSILA OYJ	28,387	8.05	228,515.35	
WENDEL	1,787	98.20	175,483.40	
WOLTERS KLUWER NV	17,256	69.36	1,196,876.16	
WORLDLINE SA	15,148	75.72	1,147,006.56	
ZALANDO SE	9,599	91.10	874,468.90	
ユーロ 小計	12,243,471		264,389,795.72 (33,392,431,200)	
香港・ドル				
AIA GROUP LTD	762,875	89.50	68,277,312.50	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	19,400	99.35	1,927,390.00	
BANK OF EAST ASIA	85,400	17.00	1,451,800.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	235,539	23.65	5,570,497.35	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	109,200	25.80	2,817,360.00	

CK ASSET HOLDINGS LTD	162,909	40.40	6,581,523.60	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	170,409	54.45	9,278,770.05	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	43,500	40.10	1,744,350.00	
CLP HOLDINGS LTD	104,643	72.15	7,549,992.45	
ESR CAYMAN LTD	107,200	25.45	2,728,240.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	135,810	57.80	7,849,818.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	132,157	19.86	2,624,638.02	
HANG SENG BANK LTD	48,412	134.50	6,511,414.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	99,641	30.50	3,039,050.50	
HONG KONG & CHINA GAS	683,750	11.46	7,835,775.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	76,011	394.00	29,948,334.00	
MTR CORP	107,755	44.05	4,746,607.75	
NEW WORLD DEVELOPMENT	101,917	37.40	3,811,695.80	
PCCW LTD	320,000	4.78	1,529,600.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	88,587	40.60	3,596,632.20	
SANDS CHINA LTD	154,980	34.55	5,354,559.00	
SINO LAND CO	206,000	10.46	2,154,760.00	
SJM HOLDINGS LTD	126,000	8.95	1,127,700.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	83,523	102.50	8,561,107.50	
SWIRE PACIFIC LTD	33,866	44.25	1,498,570.50	
SWIRE PROPERTIES LTD	76,800	23.00	1,766,400.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	87,000	107.40	9,343,800.00	
WH GROUP LTD	603,500	6.55	3,952,925.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	107,733	40.30	4,341,639.90	
WYNN MACAU LTD	104,103	13.46	1,401,226.38	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	116,000	20.00	2,320,000.00	
香港・ドル 小計	5,294,620		221,243,489.50 (2,951,388,150)	
合計	68,945,257		299,486,562,574 (299,486,562,574)	

## 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	35,955.00	554,426.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,960.00	1,395,069.60	
		AMERICAN TOWER REIT INC	27,987.00	6,199,680.24	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	89,967.00	755,722.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,841.00	1,400,768.04	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,328.00	896,514.08	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,070.00	585,633.60	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	27,234.00	4,188,861.54	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,973.00	2,274,721.46	
		DUKE REALTY CORP	23,282.00	913,585.68	

	EQUINIX INC	5,586.00	3,964,551.78	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,863.00	663,403.41	
	EQUITY RESIDENTIAL	23,455.00	1,352,180.75	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,087.00	957,870.19	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,122.00	913,643.78	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	33,771.00	1,007,388.93	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	44,524.00	627,343.16	
	INVITATION HOMES INC	35,240.00	1,000,111.20	
	IRON MOUNTAIN INC	18,498.00	545,321.04	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,373.00	703,502.84	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,141.00	885,769.64	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,336.00	534,446.08	
	PROLOGIS INC	46,555.00	4,565,648.85	
	PUBLIC STORAGE	9,870.00	2,259,539.10	
	REALTY INCOME CORP	21,631.00	1,287,477.12	
	REGENCY CENTERS CORP	10,686.00	490,807.98	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,058.00	1,954,571.94	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,503.00	1,751,571.29	
	SUN COMMUNITIES INC	6,169.00	904,683.85	
	UDR INC	18,556.00	686,757.56	
	VENTAS INC	23,463.00	1,192,624.29	
	VEREIT	13,344.00	505,203.84	
	VICI PROPERTIES INC	33,512.00	864,274.48	
	VORNADO REALTY TRUST	10,239.00	375,873.69	
	WELLTOWER INC	26,320.00	1,685,006.40	
	WP CAREY INC	10,949.00	760,408.05	
アメリカ・ドル	小計	751,448.00	51,604,964.38 (5,335,953,317)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	56,084.00	268,361.94	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,588.00	297,401.96	
	SEGRO PLC	74,888.00	691,216.24	
イギリス・ポンド	小計	175,560.00	1,256,980.14 (174,267,726)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	76,745.00	733,682.20	
	GOODMAN GROUP	108,669.00	2,041,890.51	
	GPT GROUP	132,808.00	608,260.64	
	MIRVAC GROUP	271,487.00	724,870.29	
	SCENTRE GROUP	337,295.00	914,069.45	
	STOCKLAND	157,167.00	666,388.08	
	VICINITY CENTRES	261,591.00	413,313.78	
オーストラリア・ドル	小計	1,345,762.00	6,102,474.95 (479,044,284)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,241.00	265,194.60	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,726.00	169,232.40	
カナダ・ドル	小計	14,967.00	434,427.00 (35,058,259)	

シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	201,900.00	605,700.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	285,596.00	611,175.44	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	137,500.00	288,750.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	184,100.00	360,836.00	
	SUNTEC REIT	118,600.00	182,644.00	
シンガポール・ドル 小計		927,696.00	2,049,105.44 (159,215,493)	
ユーロ	COVIVIO	3,274.00	240,966.40	
	GECINA SA	2,834.00	353,683.20	
	KLEPIERRE	12,265.00	218,746.27	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,749.00	550,137.12	
ユーロ 小計		27,122.00	1,363,532.99 (172,214,216)	
香港・ドル	LINK REIT	131,371.00	9,051,461.90	
香港・ドル 小計		131,371.00	9,051,461.90 (120,746,501)	
投資証券 合計			6,476,499,796 (6,476,499,796)	
合計			6,476,499,796 (6,476,499,796)	

(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 595銘柄	67.97%	-%	71.81%
	投資証券 36銘柄	-%	1.69%	
イギリス・ポンド	株式 86銘柄	4.33%	-%	4.52%
	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	2.15%	-%	2.37%
	投資証券 7銘柄	-%	0.15%	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.30%	-%	3.41%
	投資証券 2銘柄	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.29%	-%	0.35%
	投資証券 5銘柄	-%	0.05%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.10%	-%	3.20%
スウェーデン・クローナ	株式 38銘柄	1.09%	-%	1.13%
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	0.82%	-%	0.84%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.10%	-%	0.10%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.19%	-%	0.20%
ユーロ	株式 235銘柄	10.59%	-%	10.97%
	投資証券 4銘柄	-%	0.05%	
香港・ドル	株式 31銘柄	0.94%	-%	1.00%
	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。

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,747,143	6,174,144
コール・ローン	801,991,714	906,809,549
国債証券	57,556,949,870	59,841,384,580
地方債証券	7,194,972,966	6,933,109,174
特殊債券	8,297,600,981	7,942,354,219
社債券	5,727,607,300	4,796,442,500
未収利息	117,745,701	116,255,283
前払費用	1,039,911	1,122,722
流動資産合計	79,706,655,586	80,543,652,171
資産合計	79,706,655,586	80,543,652,171
負債の部		
流動負債		
未払金	-	422,064,650
未払解約金	59,199,520	6,366,855
その他未払費用	873	648
流動負債合計	59,200,393	428,432,153
負債合計	59,200,393	428,432,153
純資産の部		
元本等		
元本	80,678,394,417	81,342,544,413
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,030,939,224	1,227,324,395
純資産合計	79,647,455,193	80,115,220,018
負債純資産合計	79,706,655,586	80,543,652,171

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 受益権総口数	80,678,394,417口	81,342,544,413口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	1,030,939,224円	1,227,324,395円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9872円 (9,872円)	0.9849円 (9,849円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	56,035,160	1,315,169,300
地方債証券	58,907,611	68,343,423
特殊債券	69,443,080	57,879,471
社債券	44,495,000	39,786,400
合計	228,880,851	1,481,178,594

(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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	92,267,281,358円	80,678,394,417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	6,791,748,562円	9,181,688,084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	18,380,635,503円	8,517,538,088円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	76,301,963,543円	73,017,893,679円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,941,715,464円	2,448,813,549円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	36,321,282円	69,862,719円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,720,704,118円	3,395,674,587円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	38,861,533円	104,674,362円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	125,831,324円	407,054,184円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	325,714,099円	1,010,176,510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)	79,888,009円	110,904,565円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リー ト/債券)	4,828,283円	8,368,192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)	26,641,035円	43,975,511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)	31,405,110円	39,011,833円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,777,513円	15,023,532円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3,118,191円	19,084,521円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,907,384円	92,386,523円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	30,717,529円	559,640,146円
計	80,678,394,417円	81,342,544,413円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	92,029,121,671円	80,678,394,417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	6,631,883,889円	9,181,688,084円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	17,982,611,143円	8,517,538,088円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	76,301,963,543円	73,017,893,679円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,941,715,464円	2,448,813,549円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	36,321,282円	69,862,719円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,720,704,118円	3,395,674,587円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	38,861,533円	104,674,362円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	125,831,324円	407,054,184円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	325,714,099円	1,010,176,510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)	79,888,009円	110,904,565円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	4,828,283円	8,368,192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)	26,641,035円	43,975,511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)	31,405,110円	39,011,833円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,777,513円	15,023,532円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3,118,191円	19,084,521円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,907,384円	92,386,523円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	30,717,529円	559,640,146円
計	80,678,394,417円	81,342,544,413円

### 附属明細表(2020年12月21日現在)

#### 第1 有価証券明細表

##### 株式

該当事項はありません。

##### 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額(円)	備考
国債証券	第408回 利付国債(2年)	5,000,000	5,011,800	
	第409回 利付国債(2年)	1,000,000	1,002,560	
	第410回 利付国債(2年)	79,000,000	79,220,410	
	第411回 利付国債(2年)	200,000,000	200,586,000	
	第412回 利付国債(2年)	8,000,000	8,026,080	
	第413回 利付国債(2年)	186,000,000	186,643,560	
	第414回 利付国債(2年)	74,000,000	74,276,760	
	第415回 利付国債(2年)	160,000,000	160,657,600	
	第416回 利付国債(2年)	266,000,000	267,149,120	
	第417回 利付国債(2年)	200,000,000	200,872,000	
	第418回 利付国債(2年)	200,000,000	200,912,000	
	第131回 利付国債(5年)	477,000,000	478,302,210	
	第132回 利付国債(5年)	314,000,000	315,080,160	
	第133回 利付国債(5年)	587,000,000	589,412,570	
	第134回 利付国債(5年)	212,000,000	213,017,600	
	第135回 利付国債(5年)	235,000,000	236,266,650	
	第137回 利付国債(5年)	144,000,000	144,951,840	
	第138回 利付国債(5年)	404,000,000	406,912,840	
	第139回 利付国債(5年)	434,000,000	437,389,540	

第140回	利付国債(5年)	340,000,000	342,862,800
第141回	利付国債(5年)	470,000,000	474,244,100
第142回	利付国債(5年)	150,000,000	151,476,000
第1回	利付国債(40年)	110,000,000	160,685,800
第2回	利付国債(40年)	142,000,000	201,239,560
第3回	利付国債(40年)	122,000,000	173,581,600
第4回	利付国債(40年)	171,000,000	244,157,220
第5回	利付国債(40年)	182,000,000	251,684,160
第6回	利付国債(40年)	176,000,000	239,752,480
第7回	利付国債(40年)	197,000,000	258,127,130
第8回	利付国債(40年)	208,000,000	254,904,000
第9回	利付国債(40年)	335,000,000	307,024,150
第10回	利付国債(40年)	301,000,000	323,544,900
第11回	利付国債(40年)	258,000,000	269,199,780
第12回	利付国債(40年)	2,000,000	1,885,020
第13回	利付国債(40年)	95,000,000	89,564,100
第321回	利付国債(10年)	63,000,000	63,876,960
第322回	利付国債(10年)	51,000,000	51,646,170
第323回	利付国債(10年)	32,000,000	32,490,560
第324回	利付国債(10年)	99,000,000	100,369,170
第325回	利付国債(10年)	631,000,000	641,203,270
第327回	利付国債(10年)	199,000,000	202,679,510
第328回	利付国債(10年)	263,000,000	267,313,200
第329回	利付国債(10年)	269,000,000	275,256,940
第330回	利付国債(10年)	3,000,000	3,076,860
第332回	利付国債(10年)	196,000,000	200,300,240
第333回	利付国債(10年)	193,000,000	197,585,680
第334回	利付国債(10年)	618,000,000	633,826,980
第335回	利付国債(10年)	289,000,000	295,852,190
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	54,340,370
第337回	利付国債(10年)	303,000,000	308,229,780
第338回	利付国債(10年)	491,000,000	502,204,620
第339回	利付国債(10年)	536,000,000	548,960,480
第340回	利付国債(10年)	566,000,000	580,319,800
第341回	利付国債(10年)	552,000,000	563,647,200
第342回	利付国債(10年)	510,000,000	515,778,300
第343回	利付国債(10年)	461,000,000	466,476,680
第344回	利付国債(10年)	533,000,000	539,625,190
第345回	利付国債(10年)	532,000,000	538,900,040
第346回	利付国債(10年)	523,000,000	530,065,730
第347回	利付国債(10年)	426,000,000	431,848,980
第348回	利付国債(10年)	499,000,000	505,946,080
第349回	利付国債(10年)	481,000,000	487,945,640
第350回	利付国債(10年)	605,000,000	613,820,900
第351回	利付国債(10年)	540,000,000	547,943,400
第352回	利付国債(10年)	576,000,000	584,305,920
第353回	利付国債(10年)	543,000,000	550,640,010
第354回	利付国債(10年)	512,000,000	518,999,040
第355回	利付国債(10年)	624,000,000	632,249,280
第356回	利付国債(10年)	618,000,000	625,867,140
第357回	利付国債(10年)	520,000,000	526,094,400
第358回	利付国債(10年)	518,000,000	523,749,800
第359回	利付国債(10年)	690,000,000	696,879,300
第360回	利付国債(10年)	321,000,000	323,811,960
第1回	利付国債(30年)	10,000,000	12,486,800
第2回	利付国債(30年)	83,000,000	101,440,940
第3回	利付国債(30年)	125,000,000	152,191,250
第4回	利付国債(30年)	116,000,000	149,122,640
第5回	利付国債(30年)	95,000,000	116,389,250
第6回	利付国債(30年)	39,000,000	48,999,990



第7回 利付国債(30年)	50,000,000	62,725,500
第8回 利付国債(30年)	39,000,000	46,946,640
第9回 利付国債(30年)	37,000,000	42,802,340
第10回 利付国債(30年)	62,000,000	69,539,200
第11回 利付国債(30年)	50,000,000	59,871,000
第12回 利付国債(30年)	39,000,000	48,754,680
第13回 利付国債(30年)	39,000,000	48,381,060
第14回 利付国債(30年)	61,000,000	79,076,130
第15回 利付国債(30年)	82,000,000	107,770,140
第16回 利付国債(30年)	54,000,000	71,186,040
第17回 利付国債(30年)	67,000,000	87,662,800
第18回 利付国債(30年)	81,000,000	105,134,760
第19回 利付国債(30年)	74,000,000	96,294,720
第20回 利付国債(30年)	93,000,000	123,991,320
第21回 利付国債(30年)	95,000,000	124,223,900
第22回 利付国債(30年)	105,000,000	140,717,850
第23回 利付国債(30年)	108,000,000	145,218,960
第24回 利付国債(30年)	95,000,000	128,059,050
第25回 利付国債(30年)	109,000,000	143,918,150
第26回 利付国債(30年)	182,000,000	243,641,580
第27回 利付国債(30年)	165,000,000	224,487,450
第28回 利付国債(30年)	213,000,000	291,249,810
第29回 利付国債(30年)	225,000,000	305,120,250
第30回 利付国債(30年)	236,000,000	317,080,160
第31回 利付国債(30年)	215,000,000	286,478,900
第32回 利付国債(30年)	268,000,000	363,517,880
第33回 利付国債(30年)	299,000,000	390,476,060
第34回 利付国債(30年)	276,000,000	372,161,160
第35回 利付国債(30年)	241,000,000	316,683,640
第36回 利付国債(30年)	296,000,000	390,246,400
第37回 利付国債(30年)	311,000,000	405,133,480
第38回 利付国債(30年)	207,000,000	266,187,510
第39回 利付国債(30年)	192,000,000	251,172,480
第40回 利付国債(30年)	165,000,000	212,714,700
第41回 利付国債(30年)	170,000,000	215,854,100
第42回 利付国債(30年)	185,000,000	235,140,550
第43回 利付国債(30年)	176,000,000	223,931,840
第44回 利付国債(30年)	173,000,000	220,336,260
第45回 利付国債(30年)	201,000,000	246,972,720
第46回 利付国債(30年)	237,000,000	291,389,130
第47回 利付国債(30年)	217,000,000	272,052,900
第48回 利付国債(30年)	226,000,000	272,892,740
第49回 利付国債(30年)	231,000,000	279,050,310
第50回 利付国債(30年)	227,000,000	241,991,080
第51回 利付国債(30年)	226,000,000	213,843,460
第52回 利付国債(30年)	239,000,000	237,107,120
第53回 利付国債(30年)	217,000,000	220,218,110
第54回 利付国債(30年)	224,000,000	237,932,800
第55回 利付国債(30年)	216,000,000	229,281,840
第56回 利付国債(30年)	231,000,000	245,035,560
第57回 利付国債(30年)	238,000,000	252,280,000
第58回 利付国債(30年)	286,000,000	302,579,420
第59回 利付国債(30年)	219,000,000	226,034,280
第60回 利付国債(30年)	199,000,000	215,246,360
第61回 利付国債(30年)	201,000,000	206,808,900
第62回 利付国債(30年)	130,000,000	126,860,500
第63回 利付国債(30年)	139,000,000	131,753,930
第64回 利付国債(30年)	150,000,000	141,775,500
第65回 利付国債(30年)	177,000,000	167,018,970
第66回 利付国債(30年)	181,000,000	170,509,240

第67回	利付国債(30年)	230,000,000	228,281,900
第68回	利付国債(30年)	151,000,000	149,677,240
第55回	利付国債(20年)	85,000,000	87,244,000
第56回	利付国債(20年)	103,000,000	106,273,340
第57回	利付国債(20年)	106,000,000	109,210,740
第58回	利付国債(20年)	130,000,000	134,615,000
第65回	利付国債(20年)	42,000,000	44,562,840
第66回	利付国債(20年)	13,000,000	13,754,260
第67回	利付国債(20年)	24,000,000	25,585,680
第68回	利付国債(20年)	109,000,000	117,265,470
第69回	利付国債(20年)	73,000,000	78,298,340
第70回	利付国債(20年)	127,000,000	138,273,790
第71回	利付国債(20年)	34,000,000	36,779,840
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	69,370,880
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	32,565,600
第75回	利付国債(20年)	87,000,000	95,293,710
第76回	利付国債(20年)	115,000,000	124,982,000
第77回	利付国債(20年)	88,000,000	96,013,280
第78回	利付国債(20年)	73,000,000	79,697,020
第79回	利付国債(20年)	58,000,000	63,583,080
第80回	利付国債(20年)	86,000,000	94,667,080
第81回	利付国債(20年)	64,000,000	70,491,520
第82回	利付国債(20年)	104,000,000	115,045,840
第83回	利付国債(20年)	69,000,000	76,696,260
第84回	利付国債(20年)	124,000,000	137,208,480
第85回	利付国債(20年)	89,000,000	99,394,310
第86回	利付国債(20年)	74,000,000	83,422,420
第87回	利付国債(20年)	71,000,000	79,666,260
第88回	利付国債(20年)	129,000,000	146,221,500
第89回	利付国債(20年)	73,000,000	82,341,810
第90回	利付国債(20年)	237,000,000	268,729,560
第91回	利付国債(20年)	167,000,000	190,323,220
第92回	利付国債(20年)	297,000,000	336,708,900
第93回	利付国債(20年)	128,000,000	145,017,600
第94回	利付国債(20年)	208,000,000	236,959,840
第95回	利付国債(20年)	202,000,000	233,837,220
第96回	利付国債(20年)	104,000,000	119,031,120
第97回	利付国債(20年)	196,000,000	226,689,680
第98回	利付国債(20年)	166,000,000	190,865,140
第99回	利付国債(20年)	303,000,000	349,952,880
第100回	利付国債(20年)	213,000,000	248,641,290
第101回	利付国債(20年)	151,000,000	178,468,410
第102回	利付国債(20年)	165,000,000	195,993,600
第103回	利付国債(20年)	158,000,000	186,487,400
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	157,303,350
第105回	利付国債(20年)	182,000,000	212,919,980
第106回	利付国債(20年)	134,000,000	157,810,460
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	178,516,400
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	233,990,740
第109回	利付国債(20年)	226,000,000	262,792,800
第110回	利付国債(20年)	265,000,000	312,535,700
第111回	利付国債(20年)	211,000,000	251,598,510
第112回	利付国債(20年)	296,000,000	350,428,480
第113回	利付国債(20年)	415,000,000	493,152,800
第114回	利付国債(20年)	200,000,000	238,420,000
第115回	利付国債(20年)	172,000,000	206,592,640
第116回	利付国債(20年)	194,000,000	233,872,820
第117回	利付国債(20年)	266,000,000	318,207,820
第118回	利付国債(20年)	188,000,000	223,798,960
第119回	利付国債(20年)	159,000,000	186,257,370

第120回	利付国債(20年)	150,000,000	172,864,500
第121回	利付国債(20年)	238,000,000	281,792,000
第122回	利付国債(20年)	178,000,000	209,018,280
第123回	利付国債(20年)	247,000,000	298,245,090
第124回	利付国債(20年)	170,000,000	203,573,300
第125回	利付国債(20年)	143,000,000	174,770,310
第126回	利付国債(20年)	127,000,000	152,620,980
第127回	利付国債(20年)	124,000,000	147,749,720
第128回	利付国債(20年)	214,000,000	255,858,400
第129回	利付国債(20年)	122,000,000	144,587,080
第130回	利付国債(20年)	135,000,000	160,420,500
第131回	利付国債(20年)	72,000,000	84,787,200
第132回	利付国債(20年)	95,000,000	112,200,700
第133回	利付国債(20年)	124,000,000	147,808,000
第134回	利付国債(20年)	130,000,000	155,343,500
第135回	利付国債(20年)	69,000,000	81,680,130
第136回	利付国債(20年)	71,000,000	83,254,600
第137回	利付国債(20年)	102,000,000	121,093,380
第138回	利付国債(20年)	85,000,000	98,970,600
第139回	利付国債(20年)	92,000,000	108,171,760
第140回	利付国債(20年)	273,000,000	324,837,240
第141回	利付国債(20年)	193,000,000	230,144,780
第142回	利付国債(20年)	115,000,000	138,499,100
第143回	利付国債(20年)	188,000,000	222,370,160
第144回	利付国債(20年)	120,000,000	140,485,200
第145回	利付国債(20年)	318,000,000	380,779,560
第146回	利付国債(20年)	280,000,000	335,955,200
第147回	利付国債(20年)	301,000,000	357,997,360
第148回	利付国債(20年)	261,000,000	307,544,130
第149回	利付国債(20年)	289,000,000	341,048,900
第150回	利付国債(20年)	313,000,000	365,690,420
第151回	利付国債(20年)	317,000,000	362,124,950
第152回	利付国債(20年)	318,000,000	363,540,780
第153回	利付国債(20年)	337,000,000	390,310,030
第154回	利付国債(20年)	309,000,000	353,761,740
第155回	利付国債(20年)	342,000,000	381,552,300
第156回	利付国債(20年)	292,000,000	299,527,760
第157回	利付国債(20年)	313,000,000	311,359,880
第158回	利付国債(20年)	305,000,000	317,029,200
第159回	利付国債(20年)	305,000,000	321,415,100
第160回	利付国債(20年)	272,000,000	290,648,320
第161回	利付国債(20年)	289,000,000	303,817,030
第162回	利付国債(20年)	282,000,000	296,195,880
第163回	利付国債(20年)	284,000,000	298,015,400
第164回	利付国債(20年)	370,000,000	381,817,800
第165回	利付国債(20年)	304,000,000	313,323,680
第166回	利付国債(20年)	290,000,000	308,502,000
第167回	利付国債(20年)	315,000,000	323,820,000
第168回	利付国債(20年)	275,000,000	277,356,750
第169回	利付国債(20年)	278,000,000	275,106,020
第170回	利付国債(20年)	265,000,000	261,976,350
第171回	利付国債(20年)	255,000,000	251,830,350
第172回	利付国債(20年)	240,000,000	241,075,200
第173回	利付国債(20年)	227,000,000	227,821,740
国債証券 合計		54,339,000,000	59,841,384,580
地方債証券	第708回 東京都公募公債	300,000,000	303,912,000
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	306,207,900
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	305,366,700
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,893,400
	第360回 大阪府公募公債(10年)	300,000,000	303,756,300

第378回 大阪府公募公債（10年）	144,000,000	146,809,440	
第448回 大阪府公募公債（10年）	38,000,000	37,648,804	
第455回 大阪府公募公債（10年）	180,000,000	180,033,120	
第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	116,177,700	
平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	303,861,600	
第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	117,051,100	
平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	303,725,100	
平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	304,151,700	
平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	107,569,200	
平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,313,700	
平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	121,414,510	
平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	304,065,000	
平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	116,965,800	
平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	304,980,600	
第10回 群馬県公募公債	300,000,000	305,613,000	
第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,693,900	
第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,351,600	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,601,200	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	152,916,900	
第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,594,000	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	131,721,500	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	325,316,400	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	102,080,100	
第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,864,000	
第26回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,019,000	
第9回 川崎市公募公債（20年）	100,000,000	119,145,700	
第4回 川崎市公募公債（30年）	100,000,000	132,087,700	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	153,152,400	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,544,000	
平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	101,425,900	
平成29年度第1回 仙台市公募公債（20年）	100,000,000	104,078,200	
地方債証券 合計	6,631,000,000	6,933,109,174	
特殊債券			
第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	202,602,400	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	316,186,500	
第163回 政保道路機構債券	300,000,000	303,816,300	
第190回 政保道路機構債券	500,000,000	506,995,500	
第205回 政保道路機構債券	100,000,000	117,129,400	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	116,900,300	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	510,845,500	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	114,890,300	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	182,955,900	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	99,147,900	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	103,647,400	
第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,483,600	
第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,102,500	
第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,542,400	
第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,525,800	
第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,076,632	
第16回 公営企業債券	200,000,000	220,657,200	
第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,378,200	
第97回 都市再生債券	100,000,000	107,886,800	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	200,328,600	
第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,018,968,000	
第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,521,100	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,951,000	27,611,864	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,712,000	72,889,689	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	88,665,000	95,696,134	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,960,000	77,709,696	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	81,404,000	86,581,294	

	第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,654,000	87,646,300	
	第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,958,000	42,187,656	
	第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	341,024,000	359,336,988	
	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	213,170,000	223,444,794	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	137,343,000	145,377,565	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	123,012,000	128,596,744	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	236,943,000	238,340,963	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	100,087,800	
	第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,088,600	
	第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,112,700	
	第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,111,700	
	第344回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,150,900	
	第353回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,043,400	
	第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,784,200	
	第116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,967,000	
特殊債券 合計		7,693,796,000	7,942,354,219	
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	301,454,700	
	第3回 ノルデア・バンク	200,000,000	204,556,400	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンク	200,000,000	203,157,800	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	204,060,400	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	101,911,400	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	101,881,300	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,687,400	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	204,834,400	
	第14回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,017,900	
	第3回 富士フィルムホールディングス	300,000,000	304,632,000	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	101,666,900	
	第71回 伊藤忠商事	200,000,000	203,345,000	
	第45回 住友商事	100,000,000	101,367,900	
	第46回 住友商事	100,000,000	101,523,500	
	第79回 三菱商事	100,000,000	101,341,000	
	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	101,340,900	
	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	101,365,900	
	第8回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	100,000,000	106,934,400	
	第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	101,610,300	
	第46回 三井不動産	100,000,000	101,509,900	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,620,100	
	第111回 三菱地所	100,000,000	101,507,800	
	第75回 東京急行電鉄	100,000,000	101,351,500	
	第77回 東京急行電鉄	100,000,000	102,256,800	
	第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,241,900	
	第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	202,852,400	
	第381回 中国電力	200,000,000	205,717,400	
	第304回 北陸電力	100,000,000	102,558,800	
	第306回 北陸電力	100,000,000	102,646,400	
	第253回 四国電力	200,000,000	204,613,600	
	第429回 九州電力	200,000,000	206,106,000	
	第331回 北海道電力	100,000,000	101,111,800	
	第13回 電源開発	100,000,000	108,658,600	
社債券 合計		4,700,000,000	4,796,442,500	
合計		73,363,796,000	79,513,290,473	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

第4 不動産等明細表  
該当事項はありません。

第5 商品明細表  
該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表  
該当事項はありません。

第8 借入金明細表  
該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	20,171,353	26,170,868
金銭信託	1,751,943	781,680
コール・ローン	160,628,921	114,806,956
国債証券	25,337,125,462	33,685,069,996
派生商品評価勘定	-	1,019
未収利息	159,445,352	184,159,887
前払費用	15,350,586	15,006,712
流動資産合計	25,694,473,617	34,025,997,118
資産合計	25,694,473,617	34,025,997,118
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,972	193,979
未払金	22,852,130	30,452,073
未払解約金	100,051,340	65,975,266
その他未払費用	158	147
流動負債合計	122,978,600	96,621,465
負債合計	122,978,600	96,621,465
純資産の部		
元本等		
元本	18,425,435,154	23,241,498,035
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,146,059,863	10,687,877,618
純資産合計	25,571,495,017	33,929,375,653
負債純資産合計	25,694,473,617	34,025,997,118

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 受益権総口数	18,425,435,154口	23,241,498,035口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3878円 (13,878円)	1.4599円 (14,599円)



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	173,580,696	67,515,802
合計	173,580,696	67,515,802

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年12月20日 現在				2020年12月21日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	56,498,263	-	56,423,291	74,972	62,554,937	-	62,361,977	192,960
アメリカ・ドル	44,954,755	-	44,910,973	43,782	46,047,584	-	45,857,887	189,697
イギリス・ポンド	1,437,523	-	1,425,924	11,599	1,392,017	-	1,392,057	40
デンマーク・クローネ	1,221,373	-	1,218,379	2,994	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	1,986,620	-	1,984,900	1,720	2,755,789	-	2,751,507	4,282
ユーロ	6,897,992	-	6,883,115	14,877	12,359,547	-	12,360,526	979
合計	56,498,263	-	56,423,291	74,972	62,554,937	-	62,361,977	192,960

## （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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	13,614,520,319円	18,425,435,154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	7,848,485,042円	10,270,381,580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	3,037,570,207円	5,454,318,699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)	1,946,967,139円	2,394,319,286円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,396,628,027円	4,019,434,120円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,137,700,596円	1,374,624,332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)	703,528,953円	765,182,389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)	5,543,732円	4,014,599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)	15,541,267円	11,137,245円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	15,333,036円	10,112,388円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	8,724,136,622円	10,398,606,582円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	856,773,731円	1,457,522,074円
DCニッセイ外国債券インデックス	908,433,502円	1,373,927,943円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	29,558,606円	51,111,689円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	512,517,884円	952,221,405円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	20,667,302円	51,082,272円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	41,002,415円	114,855,703円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	15,164,223円	34,687,713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)	57,507,116円	75,243,811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)	3,455,001円	5,643,233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)	22,470,642円	26,307,089円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,758,911円	14,063,918円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,017,446円	11,273,923円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	3,573,727円	37,877,304円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,155,276円	58,249,017円
計	18,425,435,154円	23,241,498,035円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年12月21日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	13,507,570,734円	18,425,435,154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	7,552,683,269円	10,270,381,580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	2,634,818,849円	5,454,318,699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)	1,946,967,139円	2,394,319,286円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,396,628,027円	4,019,434,120円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,137,700,596円	1,374,624,332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)	703,528,953円	765,182,389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)	5,543,732円	4,014,599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)	15,541,267円	11,137,245円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	15,333,036円	10,112,388円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	8,724,136,622円	10,398,606,582円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	856,773,731円	1,457,522,074円
DCニッセイ外国債券インデックス	908,433,502円	1,373,927,943円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	29,558,606円	51,111,689円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	512,517,884円	952,221,405円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	20,667,302円	51,082,272円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	41,002,415円	114,855,703円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	15,164,223円	34,687,713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)	57,507,116円	75,243,811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)	3,455,001円	5,643,233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)	22,470,642円	26,307,089円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,758,911円	14,063,918円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,017,446円	11,273,923円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	3,573,727円	37,877,304円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,155,276円	58,249,017円
計	18,425,435,154円	23,241,498,035円

### 附属明細表(2020年12月21日現在)

#### 第1 有価証券明細表

##### 株式

該当事項はありません。

##### 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	120,000.00	161,638.80	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	80,000.00	108,428.00	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	130,000.00	186,443.40	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	90,000.00	122,142.60	

US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	100,000.00	128,437.00	
US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	120,000.00	164,676.00	
US TREASURY N/B 0.125 2023/09/15	1,580,000.00	1,578,514.80	
US TREASURY N/B 0.25 2023/06/15	1,500,000.00	1,503,855.00	
US TREASURY N/B 0.375 2027/09/30	1,090,000.00	1,070,412.70	
US TREASURY N/B 0.5 2027/06/30	910,000.00	903,630.00	
US TREASURY N/B 0.625 2027/03/31	590,000.00	591,793.60	
US TREASURY N/B 0.625 2030/08/15	1,650,000.00	1,602,562.50	
US TREASURY N/B 0.875 2030/11/15	620,000.00	615,833.60	
US TREASURY N/B 1.125 2040/05/15	820,000.00	771,308.40	
US TREASURY N/B 1.125 2040/08/15	1,070,000.00	1,003,959.60	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	1,390,000.00	1,433,437.50	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	1,580,000.00	1,633,325.00	
US TREASURY N/B 1.375 2040/11/15	390,000.00	382,016.70	
US TREASURY N/B 1.375 2050/08/15	1,090,000.00	1,006,375.20	
US TREASURY N/B 1.5 2023/02/28	1,280,000.00	1,318,489.60	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	1,290,000.00	1,329,899.70	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	1,340,000.00	1,415,897.60	
US TREASURY N/B 1.5 2030/02/15	1,010,000.00	1,064,519.80	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	2,380,000.00	2,439,500.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/31	2,030,000.00	2,081,683.80	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	2,460,000.00	2,530,725.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/12/15	2,060,000.00	2,121,552.80	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	1,520,000.00	1,613,799.20	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	1,390,000.00	1,477,472.70	
US TREASURY N/B 1.625 2026/09/30	680,000.00	723,479.20	
US TREASURY N/B 1.625 2029/08/15	710,000.00	757,115.60	
US TREASURY N/B 1.625 2050/11/15	440,000.00	432,300.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	1,790,000.00	1,827,751.10	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	2,290,000.00	2,342,418.10	

US TREASURY N/B 1.75 2022/06/15	1,960,000.00	2,007,608.40	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	1,940,000.00	1,996,376.40	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	2,160,000.00	2,243,851.20	
US TREASURY N/B 1.75 2026/12/31	620,000.00	664,925.20	
US TREASURY N/B 1.75 2029/11/15	510,000.00	549,443.40	
US TREASURY N/B 1.875 2026/06/30	600,000.00	646,242.00	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	2,170,000.00	2,217,631.50	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,840,000.00	1,913,876.00	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	1,240,000.00	1,317,103.20	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	2,250,000.00	2,407,657.50	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	2,490,000.00	2,679,464.10	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	1,190,000.00	1,292,673.20	
US TREASURY N/B 2 2050/02/15	790,000.00	847,275.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	1,710,000.00	1,745,397.00	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	1,930,000.00	1,989,251.00	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	1,200,000.00	1,248,744.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	1,260,000.00	1,338,888.60	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	1,290,000.00	1,380,545.10	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	2,230,000.00	2,405,434.10	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	1,200,000.00	1,275,036.00	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	2,320,000.00	2,498,872.00	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	1,400,000.00	1,510,460.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	2,630,000.00	2,868,541.00	
US TREASURY N/B 2.25 2026/03/31	840,000.00	919,892.40	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	1,160,000.00	1,279,665.60	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	1,950,000.00	2,157,714.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	1,560,000.00	1,728,667.20	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	530,000.00	598,629.70	
US TREASURY N/B 2.25 2049/08/15	750,000.00	848,115.00	
US TREASURY N/B 2.375 2022/03/15	1,720,000.00	1,768,039.60	

US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	2,290,000.00	2,468,184.90	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	1,500,000.00	1,670,025.00	
US TREASURY N/B 2.375 2029/05/15	800,000.00	901,528.00	
US TREASURY N/B 2.375 2049/11/15	650,000.00	754,552.50	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	2,170,000.00	2,304,930.60	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	2,170,000.00	2,338,413.70	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	530,000.00	625,892.90	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	500,000.00	591,425.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	480,000.00	567,600.00	
US TREASURY N/B 2.625 2021/12/15	1,510,000.00	1,547,387.60	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	1,430,000.00	1,570,754.90	
US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	1,000,000.00	1,110,740.00	
US TREASURY N/B 2.625 2029/02/15	980,000.00	1,122,100.00	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	2,460,000.00	2,644,401.60	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	1,930,000.00	2,085,673.80	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	1,540,000.00	1,707,043.80	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	970,000.00	1,110,456.00	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	280,000.00	344,279.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	360,000.00	442,335.60	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	510,000.00	632,935.50	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	520,000.00	645,772.40	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	1,000,000.00	1,156,640.00	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	1,020,000.00	1,182,792.00	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	500,000.00	627,010.00	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	460,000.00	579,742.60	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	440,000.00	556,459.20	
US TREASURY N/B 2.875 2049/05/15	750,000.00	957,592.50	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	1,630,000.00	1,833,293.60	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	200,000.00	255,250.00	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	470,000.00	602,807.90	



US TREASURY N/B 3 2045/05/15	440,000.00	565,466.00	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	240,000.00	309,271.20	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	480,000.00	621,316.80	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	340,000.00	440,657.00	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	600,000.00	779,178.00	
US TREASURY N/B 3 2048/08/15	710,000.00	923,994.00	
US TREASURY N/B 3 2049/02/15	750,000.00	978,480.00	
US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	980,000.00	1,157,772.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	220,000.00	285,509.40	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	240,000.00	312,232.80	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	350,000.00	455,640.50	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	500,000.00	653,710.00	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	630,000.00	836,936.10	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	460,000.00	623,764.60	
US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	710,000.00	986,672.80	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	130,000.00	175,503.90	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	390,000.00	546,471.90	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	480,000.00	674,020.80	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	380,000.00	542,670.40	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	190,000.00	270,630.30	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	190,000.00	280,250.00	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	200,000.00	298,796.00	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	100,000.00	147,855.00	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	200,000.00	300,592.00	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	130,000.00	189,926.10	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	120,000.00	180,256.80	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	190,000.00	288,910.20	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	200,000.00	309,968.00	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	210,000.00	333,570.30	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	100,000.00	155,914.00	

	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	110,000.00	163,765.80	
	WI TREASURY SEC. 0.625 2030/05/15	1,300,000.00	1,266,070.00	
	WI TREASURY SEC. 1.25 2050/05/15	930,000.00	831,764.10	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	200,000.00	282,250.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	200,000.00	301,976.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	180,000.00	274,260.60	
アメリカ・ドル 小計		127,860,000.00	139,475,458.60 (14,421,762,419)	
イギリス・ポンド	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	210,000.00	322,788.90	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	300,000.00	529,281.00	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	280,000.00	431,844.00	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	260,000.00	471,538.60	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	220,000.00	284,160.80	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	270,000.00	388,540.80	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	210,000.00	343,167.30	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	240,000.00	399,319.20	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	260,000.00	539,658.60	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	250,000.00	360,950.00	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	210,000.00	220,434.90	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	190,000.00	402,093.20	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	230,000.00	392,110.90	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	230,000.00	279,284.40	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	160,000.00	234,235.20	
	UK TSY 0 1/4% 2031 0.25 2031/07/31	60,000.00	59,497.20	
	UK TSY 0 1/2% 2061 0.5 2061/10/22	160,000.00	148,259.20	
	UK TSY 0 1/8% 2023 0.125 2023/01/31	520,000.00	521,918.80	
	UK TSY 0 1/8% 2024 0.125 2024/01/31	110,000.00	110,506.00	
	UK TSY 0 1/8% 2026 0.125 2026/01/30	290,000.00	291,809.60	
	UK TSY 0 1/8% 2028 0.125 2028/01/31	290,000.00	290,397.30	
	UK TSY 0 3/8% 2030 0.375 2030/10/22	400,000.00	404,552.00	
UK TSY 0 5/8% 2025 0.625 2025/06/07	410,000.00	422,468.10		

UK TSY 0 5/8% 2050 0.625 2050/10/22	280,000.00	267,360.80	
UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	230,000.00	249,619.00	
UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	310,000.00	362,625.60	
UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	280,000.00	302,010.80	
UK TSY 1 1/4% 2041 1.25 2041/10/22	260,000.00	285,831.00	
UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	250,000.00	279,775.00	
UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22	190,000.00	238,043.40	
UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	110,000.00	157,944.60	
UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	320,000.00	331,577.60	
UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	370,000.00	381,788.20	
UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	170,000.00	211,352.50	
UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	290,000.00	384,247.10	
UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	220,000.00	233,939.20	
UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	170,000.00	187,797.30	
UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	180,000.00	197,479.80	
UK TSY 2029 0.875 2029/10/22	240,000.00	254,426.40	
UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	240,000.00	512,659.20	
UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	330,000.00	503,177.40	
UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	210,000.00	385,368.90	
UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	340,000.00	543,214.60	
UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	200,000.00	379,996.00	
UK TSY GILT 0 5/8% 2035 0.625 2035/07/31	190,000.00	191,428.80	
UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	400,000.00	403,816.00	
UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	320,000.00	327,014.40	
UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	370,000.00	435,993.20	
UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	230,000.00	387,644.30	
イギリス・ボンド 小計	12,460,000.00	16,244,947.10 (2,252,199,466)	
イスラエル・シュケ ル	ISRAEL FIXED BOND 1 2030/03/31	210,000.00	214,431.00
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 2022/11/30	800,000.00	818,120.00
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 2023/11/30	720,000.00	747,288.00

	ISRAEL FIXED BOND 1.5 2037/05/31	180,000.00	181,044.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 2025/08/31	490,000.00	524,422.50	
	ISRAEL FIXED BOND 2 2027/03/31	280,000.00	309,722.00	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 2028/09/28	270,000.00	303,682.50	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 2024/03/31	300,000.00	342,270.00	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 2047/03/31	320,000.00	449,056.00	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 2042/01/31	290,000.00	503,918.50	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 2026/10/30	250,000.00	336,037.50	
	イスラエル・シュケル 小計	4,110,000.00	4,729,992.00 (150,981,345)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 2024/11/21	310,000.00	310,210.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 2025/11/21	380,000.00	377,815.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.5 2026/09/21	420,000.00	420,281.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1 2030/12/21	480,000.00	480,672.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1 2031/11/21	410,000.00	407,253.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.25 2032/05/21	300,000.00	304,866.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.5 2031/06/21	400,000.00	418,924.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2051/06/21	230,000.00	218,776.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	260,000.00	265,064.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	410,000.00	426,818.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	450,000.00	500,782.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	550,000.00	628,166.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	630,000.00	685,358.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	440,000.00	503,461.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	490,000.00	565,151.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	490,000.00	568,860.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	140,000.00	166,055.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	190,000.00	223,531.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	200,000.00	246,322.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	500,000.00	563,680.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	490,000.00	586,598.60		

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	150,000.00	189,354.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	180,000.00	239,970.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	510,000.00	613,198.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	210,000.00	291,438.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	460,000.00	580,460.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	530,000.00	596,467.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	360,000.00	392,036.40	
オーストラリア・ドル 小計		10,570,000.00	11,771,573.10 (924,068,488)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	60,000.00	89,479.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2022/08/01	260,000.00	260,137.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2022/11/01	460,000.00	460,151.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2023/02/01	150,000.00	150,004.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2024/04/01	120,000.00	119,708.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2026/03/01	130,000.00	128,584.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	230,000.00	230,848.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2025/09/01	550,000.00	551,952.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2030/12/01	220,000.00	214,189.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	340,000.00	344,484.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	180,000.00	185,380.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2025/03/01	200,000.00	207,258.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2030/06/01	580,000.00	607,434.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/02/01	110,000.00	111,619.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/05/01	170,000.00	173,010.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	200,000.00	206,000.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2024/09/01	200,000.00	208,482.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	180,000.00	189,894.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	320,000.00	330,496.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	370,000.00	387,008.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	160,000.00	176,577.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	380,000.00	449,737.60	

	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	150,000.00	159,202.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	170,000.00	183,846.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	170,000.00	192,365.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	160,000.00	171,878.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	170,000.00	176,254.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	200,000.00	270,286.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	220,000.00	327,808.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	150,000.00	228,627.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	130,000.00	208,600.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	140,000.00	198,534.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	170,000.00	267,340.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	60,000.00	88,305.00	
カナダ・ドル 小計		7,460,000.00	8,255,489.60 (666,218,011)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.75 2022/04/01	70,000.00	71,267.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 1.875 2050/03/01	60,000.00	70,884.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	70,000.00	75,719.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	90,000.00	104,216.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	120,000.00	130,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2039/07/01	50,000.00	59,643.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	90,000.00	101,745.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	220,000.00	233,134.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	60,000.00	76,710.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	110,000.00	145,530.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	110,000.00	128,337.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	100,000.00	118,344.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	170,000.00	186,235.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	140,000.00	146,620.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	100,000.00	127,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	110,000.00	128,645.00	
	シンガポール・ドル 小計		1,670,000.00	1,904,430.00 (147,974,211)

スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.125 2031/05/12	450,000.00	456,138.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	860,000.00	919,365.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	900,000.00	968,958.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	1,050,000.00	1,128,487.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	1,370,000.00	1,446,035.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	1,160,000.00	1,306,218.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,620,000.00	1,711,465.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	700,000.00	1,099,049.00	
スウェーデン・クローナ 小計		8,110,000.00	9,035,716.50 (112,765,742)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2022/11/15	1,010,000.00	1,027,462.90	
	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2052/11/15	420,000.00	459,799.20	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	1,240,000.00	1,330,768.00	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2029/11/15	1,660,000.00	1,807,059.40	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	920,000.00	977,840.40	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	950,000.00	1,061,340.00	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,900,000.00	3,640,476.00	
デンマーク・クローネ 小計		8,100,000.00	10,304,745.90 (174,974,585)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.375 2030/08/19	660,000.00	686,657.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	560,000.00	584,752.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	600,000.00	630,066.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	640,000.00	679,084.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2029/09/06	630,000.00	675,599.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	1,280,000.00	1,331,852.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	560,000.00	607,006.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	880,000.00	952,793.60	
ノルウェー・クローネ 小計		5,810,000.00	6,147,812.40 (73,712,271)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0 2022/07/25	480,000.00	479,894.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25 2030/10/25	200,000.00	199,826.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.25 2022/04/25	640,000.00	659,609.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2023/01/25	460,000.00	483,529.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	990,000.00	1,065,269.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	700,000.00	770,035.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	460,000.00	508,318.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	510,000.00	574,020.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2029/10/25	690,000.00	783,384.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	830,000.00	935,949.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	420,000.00	466,359.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	517,465.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	130,000.00	180,368.50	
ポーランド・ズロチ	小計	6,980,000.00	7,624,029.90 (214,845,163)	
マレーシア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	470,000.00	482,605.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	560,000.00	579,236.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.62 2021/11/30	150,000.00	152,643.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	200,000.00	218,012.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.757 2040/05/22	200,000.00	208,922.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.828 2034/07/05	220,000.00	234,209.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	410,000.00	437,047.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.885 2029/08/15	290,000.00	318,219.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	510,000.00	555,854.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	300,000.00	327,024.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	450,000.00	486,976.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.065 2050/06/15	140,000.00	144,774.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	490,000.00	526,064.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	260,000.00	290,833.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	110,000.00	121,328.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	200,000.00	221,546.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	220,000.00	252,566.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	160,000.00	183,024.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	180,000.00	210,474.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	160,000.00	187,097.60	



	MALAYSIA GOVERNMENT 4.921 2048/07/06	170,000.00	199,744.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	130,000.00	153,388.30	
マレーシア・リンギット 小計		5,980,000.00	6,491,592.10 (165,860,178)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	6,840,000.00	8,177,562.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	1,100,000.00	1,533,774.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	3,970,000.00	4,143,766.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	4,550,000.00	4,690,003.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.75 2023/03/09	1,400,000.00	1,469,734.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.25 2021/12/09	3,150,000.00	3,236,341.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	4,640,000.00	5,263,337.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	2,050,000.00	2,401,329.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	1,520,000.00	1,784,008.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	2,870,000.00	3,282,505.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	6,440,000.00	7,076,980.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	2,780,000.00	3,251,960.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	4,640,000.00	5,640,755.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	3,160,000.00	3,889,454.40	
	メキシコ・ペソ 小計		49,110,000.00	55,841,513.00 (287,583,792)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0 2027/10/22	130,000.00	135,136.30	
	BELGIUM KINGDOM 0.1 2030/06/22	190,000.00	198,931.90	
	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	160,000.00	164,225.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.4 2040/06/22	80,000.00	84,410.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	200,000.00	209,464.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	290,000.00	309,824.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	220,000.00	240,438.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	240,000.00	264,535.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	260,000.00	290,552.60	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	230,000.00	251,258.90	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	230,000.00	262,522.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	140,000.00	166,229.00	

BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	90,000.00	111,790.80	
BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	170,000.00	226,640.60	
BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22	110,000.00	152,287.30	
BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	140,000.00	185,992.80	
BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	110,000.00	185,704.20	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	200,000.00	215,102.00	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	90,000.00	146,553.30	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	230,000.00	257,151.50	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	130,000.00	186,253.60	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	150,000.00	275,649.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	210,000.00	222,654.60	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	120,000.00	179,142.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	240,000.00	261,364.80	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	260,000.00	474,037.20	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	170,000.00	217,056.00	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	290,000.00	506,070.30	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	290,000.00	420,378.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2023/04/30	340,000.00	344,726.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2025/01/31	330,000.00	336,880.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0 2026/01/31	60,000.00	61,303.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2024/07/30	250,000.00	257,342.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	330,000.00	337,976.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	320,000.00	324,483.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	300,000.00	305,805.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5 2030/04/30	330,000.00	345,998.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.6 2029/10/31	340,000.00	360,386.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.8 2027/07/30	280,000.00	300,056.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1 2050/10/31	200,000.00	207,486.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.2 2040/10/31	210,000.00	233,139.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.25 2030/10/31	370,000.00	413,878.30	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	390,000.00	429,046.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	340,000.00	380,599.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	320,000.00	359,091.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	350,000.00	391,338.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	320,000.00	362,003.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	300,000.00	335,370.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	320,000.00	349,641.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.85 2035/07/30	300,000.00	363,876.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	340,000.00	383,622.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	350,000.00	415,695.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	360,000.00	406,317.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	290,000.00	366,531.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	220,000.00	324,046.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	370,000.00	417,463.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	270,000.00	405,534.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	230,000.00	419,418.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	330,000.00	378,843.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	320,000.00	510,243.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	320,000.00	365,968.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	360,000.00	446,205.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	340,000.00	610,218.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	270,000.00	315,554.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	280,000.00	507,200.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	300,000.00	426,126.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	220,000.00	435,142.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	330,000.00	372,015.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	350,000.00	576,352.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	340,000.00	364,480.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	360,000.00	488,660.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	390,000.00	585,471.90	

BUNDES Obligation 0 2022/04/08	310,000.00	312,938.80	
BUNDES Obligation 0 2022/10/07	300,000.00	304,092.00	
BUNDES Obligation 0 2023/04/14	270,000.00	274,878.90	
BUNDES Obligation 0 2023/10/13	290,000.00	296,469.90	
BUNDES Obligation 0 2024/10/18	360,000.00	370,728.00	
BUNDES Obligation 0 2025/04/11	320,000.00	330,691.20	
BUNDES Obligation 0 2025/10/10	350,000.00	362,869.50	
BUNDES Obligation 0 2025/10/10	80,000.00	82,990.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	450,000.00	469,444.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2027/11/15	350,000.00	367,143.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2029/08/15	410,000.00	433,013.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/02/15	380,000.00	401,629.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/08/15	480,000.00	507,384.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2030/08/15	100,000.00	106,018.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2035/05/15	340,000.00	359,822.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2050/08/15	270,000.00	283,419.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	470,000.00	499,229.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	380,000.00	407,808.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	400,000.00	430,472.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	420,000.00	442,579.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	470,000.00	501,128.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	460,000.00	498,308.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	380,000.00	413,489.40	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	340,000.00	362,436.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	420,000.00	455,133.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	390,000.00	550,169.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	370,000.00	384,389.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	320,000.00	335,830.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	360,000.00	379,911.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	680,000.00	733,393.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	400,000.00	415,456.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	570,000.00	616,095.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	360,000.00	370,270.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	340,000.00	365,343.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	430,000.00	722,047.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	470,000.00	811,050.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	310,000.00	558,155.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	430,000.00	746,032.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	290,000.00	548,053.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	380,000.00	660,504.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	310,000.00	632,012.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	180,000.00	296,215.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/12/10	240,000.00	241,704.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/03/11	210,000.00	211,856.40	

BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/06/10	220,000.00	222,327.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/09/16	180,000.00	182,302.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2022/12/15	90,000.00	91,320.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0 2024/01/15	130,000.00	131,170.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2023/01/15	60,000.00	60,595.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2025/02/01	220,000.00	224,886.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.5 2026/02/01	140,000.00	143,693.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	750,000.00	771,577.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.9 2022/08/01	270,000.00	275,934.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.9 2031/04/01	140,000.00	144,656.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	500,000.00	515,265.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2030/08/01	270,000.00	281,726.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1 2022/07/15	200,000.00	204,638.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	610,000.00	652,742.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	860,000.00	880,442.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2030/04/01	340,000.00	367,543.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	290,000.00	299,709.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2036/03/01	220,000.00	236,403.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	820,000.00	879,696.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	570,000.00	619,384.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2030/12/01	350,000.00	387,891.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	380,000.00	421,382.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.7 2051/09/01	120,000.00	127,700.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.8 2041/03/01	160,000.00	177,030.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	500,000.00	536,155.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	560,000.00	617,433.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	360,000.00	404,557.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	520,000.00	583,871.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	240,000.00	246,367.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	270,000.00	305,415.90	

BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	240,000.00	285,756.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	300,000.00	361,008.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2050/09/01	240,000.00	299,923.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	560,000.00	619,606.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	270,000.00	350,141.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	300,000.00	358,053.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	150,000.00	201,262.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	230,000.00	300,016.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3 2029/08/01	320,000.00	390,393.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.1 2040/03/01	200,000.00	267,118.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	250,000.00	354,170.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	220,000.00	292,815.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	260,000.00	382,816.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	400,000.00	509,592.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	300,000.00	344,157.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.85 2049/09/01	200,000.00	316,284.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	440,000.00	635,650.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	480,000.00	536,044.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	350,000.00	403,872.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	380,000.00	469,110.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	370,000.00	420,308.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	360,000.00	480,924.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	280,000.00	478,237.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	440,000.00	535,823.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	390,000.00	599,792.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	350,000.00	580,779.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	340,000.00	569,751.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	430,000.00	611,030.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	300,000.00	330,282.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	490,000.00	544,027.40	

BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	310,000.00	490,947.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	460,000.00	710,525.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	410,000.00	584,766.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	180,000.00	228,486.60	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	220,000.00	313,599.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	330,000.00	539,513.70	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	270,000.00	394,529.40	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	200,000.00	297,426.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2022/04/15	80,000.00	80,760.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	90,000.00	91,818.90	
FINNISH GOVERNMENT 0 2030/09/15	70,000.00	72,874.20	
FINNISH GOVERNMENT 0.125 2036/04/15	60,000.00	62,771.40	
FINNISH GOVERNMENT 0.25 2040/09/15	50,000.00	53,215.50	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	100,000.00	106,355.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	100,000.00	107,561.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2029/09/15	100,000.00	108,798.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	60,000.00	67,288.20	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	80,000.00	86,094.40	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	80,000.00	94,890.40	
FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	50,000.00	68,627.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	70,000.00	73,664.50	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	90,000.00	93,730.50	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	140,000.00	152,850.60	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	70,000.00	111,640.90	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	140,000.00	175,814.80	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	90,000.00	109,603.80	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	440,000.00	443,718.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	480,000.00	485,001.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/02/25	110,000.00	111,707.20	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	770,000.00	782,504.80	



FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	600,000.00	613,992.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2025/03/25	690,000.00	710,016.90	
FRANCE (GOVT OF) 0 2026/02/25	420,000.00	433,771.80	
FRANCE (GOVT OF) 0 2029/11/25	630,000.00	653,133.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2030/11/25	420,000.00	434,259.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	560,000.00	588,840.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	610,000.00	642,366.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	630,000.00	669,349.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2029/05/25	560,000.00	605,740.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2040/05/25	150,000.00	161,701.50	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	700,000.00	767,123.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	630,000.00	692,962.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2052/05/25	290,000.00	322,842.50	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	550,000.00	595,705.00	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	570,000.00	629,006.40	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	560,000.00	667,027.20	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	530,000.00	637,839.10	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	760,000.00	906,778.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2050/05/25	480,000.00	639,230.40	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	910,000.00	964,909.40	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	600,000.00	658,746.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	410,000.00	541,474.70	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	200,000.00	305,662.00	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	410,000.00	597,128.10	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	560,000.00	591,052.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	550,000.00	606,518.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	750,000.00	958,477.50	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	770,000.00	948,439.80	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	700,000.00	734,916.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	390,000.00	673,596.30	

FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	680,000.00	833,510.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	420,000.00	723,219.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	280,000.00	607,068.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	260,000.00	597,615.20	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	680,000.00	777,559.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	560,000.00	1,060,718.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	460,000.00	788,895.40	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	610,000.00	921,093.90	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	490,000.00	846,455.40	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	470,000.00	624,968.40	
IRISH TSY 0.2% 2030 0.2 2030/10/18	120,000.00	125,857.20	
IRISH TSY 0.20% 2027 0.2 2027/05/15	100,000.00	104,567.00	
IRISH TSY 0.4% 2035 0.4 2035/05/15	70,000.00	74,815.30	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	110,000.00	112,038.30	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	180,000.00	195,672.60	
IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	130,000.00	146,620.50	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	70,000.00	82,983.60	
IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	90,000.00	105,318.90	
IRISH TSY 1.5% 2050 1.5 2050/05/15	100,000.00	133,019.00	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	90,000.00	115,216.20	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	130,000.00	185,747.90	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	140,000.00	176,792.00	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	80,000.00	81,043.20	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	150,000.00	165,375.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	120,000.00	135,975.60	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	110,000.00	121,432.30	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	180,000.00	255,661.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	230,000.00	231,754.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	240,000.00	245,476.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2027/01/15	180,000.00	187,207.20	

NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2030/07/15	220,000.00	230,606.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2052/01/15	90,000.00	92,959.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	230,000.00	240,453.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2029/07/15	180,000.00	192,729.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	260,000.00	277,464.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2040/01/15	140,000.00	160,858.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	250,000.00	273,450.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	230,000.00	254,071.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	270,000.00	287,469.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	240,000.00	263,762.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	230,000.00	240,791.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	210,000.00	286,129.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	250,000.00	447,442.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	210,000.00	229,643.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	250,000.00	467,495.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	240,000.00	412,082.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	190,000.00	274,132.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	110,000.00	111,358.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2023/07/15	240,000.00	244,324.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2030/02/20	150,000.00	156,001.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2040/10/20	60,000.00	60,387.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	150,000.00	160,824.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2029/02/20	160,000.00	173,304.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	200,000.00	216,630.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	160,000.00	175,324.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2051/03/20	60,000.00	71,732.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	180,000.00	196,731.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	110,000.00	152,091.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	40,000.00	67,548.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	280,000.00	305,706.80	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	190,000.00	203,338.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	90,000.00	200,997.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	130,000.00	177,149.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	110,000.00	193,366.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	150,000.00	161,899.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	130,000.00	137,521.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	60,000.00	146,553.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	220,000.00	376,765.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	150,000.00	194,313.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	150,000.00	219,166.50	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	180,000.00	226,580.40	
	ユーロ 小計	91,600,000.00	111,576,598.00 (14,092,124,327)	
国債証券 合計			33,685,069,996 (33,685,069,996)	
合計			33,685,069,996 (33,685,069,996)	

(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	42.51%	42.81%
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	6.64%	6.69%
イスラエル・シケル	国債証券 11銘柄	0.44%	0.45%
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	2.72%	2.74%
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	1.96%	1.98%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.44%	0.44%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.33%	0.33%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.52%	0.52%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.22%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.63%	0.64%
マレーシア・リンギット	国債証券 22銘柄	0.49%	0.49%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.85%	0.85%
ユーロ	国債証券 307銘柄	41.53%	41.83%

(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

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。



【DCニッセイターゲットデートファンド2025】  
(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	10,937	13,733
コール・ローン	1,606,303	2,097,956
親投資信託受益証券	1,301,167,147	1,641,567,916
未収入金	3,478,451	1,258,393
流動資産合計	1,306,262,838	1,644,937,998
資産合計	1,306,262,838	1,644,937,998
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,445,781	1,216,979
未払受託者報酬	180,499	235,876
未払委託者報酬	1,444,368	1,887,275
その他未払費用	57,812	71,409
流動負債合計	5,128,460	3,411,539
負債合計	5,128,460	3,411,539
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,200,644,638	1,492,119,247
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	100,489,740	149,407,212
(分配準備積立金)	38,363,673	35,120,453
元本等合計	1,301,134,378	1,641,526,459
純資産合計	1,301,134,378	1,641,526,459
負債純資産合計	1,306,262,838	1,644,937,998

## （ 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 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第5期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	4	2
有価証券売買等損益	3,409,927	23,599,659
営業収益合計	3,409,923	23,599,661
<b>営業費用</b>		
支払利息	48	121
受託者報酬	86,126	235,876
委託者報酬	689,293	1,887,275
その他費用	28,629	71,409
営業費用合計	804,096	2,194,681
営業利益又は営業損失（ ）	4,214,019	21,404,980
経常利益又は経常損失（ ）	4,214,019	21,404,980
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,214,019	21,404,980
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（ ）	1,807,862	939,177
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,036,251	100,489,740
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,560,080	38,148,081
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	22,560,080	38,148,081
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,452,911	9,696,412
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,452,911	9,696,412
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（ ）	41,737,263	149,407,212

## (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
	2020年12月22日	2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	430,876,035円	1,200,644,638円
期中追加設定元本額	922,348,817円	406,680,370円
期中一部解約元本額	152,580,214円	115,205,761円
2. 受益権の総数	1,200,644,638口	1,492,119,247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 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0837円 (10,837円)	1.1001円 (11,001円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2030】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	9,944	13,137
コール・ローン	1,460,463	2,006,959
親投資信託受益証券	1,170,152,818	1,595,161,913
未収入金	609,648	5,709,256
流動資産合計	1,172,232,873	1,602,891,265
資産合計	1,172,232,873	1,602,891,265
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	579,176	5,667,108
未払受託者報酬	158,467	218,204
未払委託者報酬	1,320,920	1,818,710
その他未払費用	52,062	67,294
流動負債合計	2,110,625	7,771,316
負債合計	2,110,625	7,771,316
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,014,388,366	1,317,238,188
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	155,733,882	277,881,761
(分配準備積立金)	74,280,991	68,291,867
元本等合計	1,170,122,248	1,595,119,949
純資産合計	1,170,122,248	1,595,119,949
負債純資産合計	1,172,232,873	1,602,891,265

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	4,034,827	63,493,728
営業収益合計	4,034,827	63,493,729
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	107
受託者報酬	24,293	218,204
委託者報酬	202,739	1,818,710
その他費用	8,017	67,294
営業費用合計	235,049	2,104,315
営業利益又は営業損失（ ）	3,799,778	61,389,414
経常利益又は経常損失（ ）	3,799,778	61,389,414
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,799,778	61,389,414
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（ ）	458,982	3,402,123
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,960,562	155,733,882
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,731,789	78,857,341
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	42,731,789	78,857,341
剰余金減少額又は欠損金増加額	997,201	14,696,753
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	997,201	14,696,753
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（ ）	52,953,910	277,881,761

## ( 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3期中間計算期間	
	自 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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2期	第3期中間計算期間
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	66,627,246円	1,014,388,366円
期中追加設定元本額	973,321,960円	396,440,660円
期中一部解約元本額	25,560,840円	93,590,838円
2. 受益権の総数	1,014,388,366口	1,317,238,188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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額	1,153円	1,211円
（1万口当たり純資産額）	（11,535円）	（12,110円）



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2035】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	15,259	20,155
コール・ローン	2,241,162	3,079,014
親投資信託受益証券	1,687,518,709	2,331,672,929
未収入金	499,437	6,595,705
流動資産合計	1,690,274,567	2,341,367,803
資産合計	1,690,274,567	2,341,367,803
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	454,150	6,531,759
未払受託者報酬	235,397	324,238
未払委託者報酬	2,040,557	2,810,442
その他未払費用	71,267	92,026
流動負債合計	2,801,371	9,758,465
負債合計	2,801,371	9,758,465
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,413,786,138	1,804,782,127
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	273,687,058	526,827,211
(分配準備積立金)	165,541,189	153,555,113
元本等合計	1,687,473,196	2,331,609,338
純資産合計	1,687,473,196	2,331,609,338
負債純資産合計	1,690,274,567	2,341,367,803

## (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 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第5期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	6	2
有価証券売買等損益	11,155,853	149,743,895
営業収益合計	11,155,847	149,743,897
<b>営業費用</b>		
支払利息	87	191
受託者報酬	105,624	324,238
委託者報酬	915,753	2,810,442
その他費用	34,807	92,026
営業費用合計	1,056,271	3,226,897
営業利益又は営業損失( )	12,212,118	146,517,000
経常利益又は経常損失( )	12,212,118	146,517,000
中間純利益又は中間純損失( )	12,212,118	146,517,000
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( )	5,592,352	7,090,497
期首剰余金又は期首欠損金( )	62,846,429	273,687,058
剰余金増加額又は欠損金減少額	45,326,849	136,943,305
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	45,326,849	136,943,305
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,855,004	23,229,655
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,855,004	23,229,655
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( )	91,698,508	526,827,211

## ( 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 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	502,122,903円	1,413,786,138円
期中追加設定元本額	1,069,111,112円	507,512,690円
期中一部解約元本額	157,447,877円	116,516,701円
2. 受益権の総数	1,413,786,138口	1,804,782,127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 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額	1,1936円	1,2919円
（1万口当たり純資産額）	(11,936円)	(12,919円)

【DCニッセイターゲットデートファンド2040】  
(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,474	6,472
コール・ローン	657,083	988,760
親投資信託受益証券	520,332,609	762,933,818
未収入金	86,955	521,109
流動資産合計	521,081,121	764,450,159
資産合計	521,081,121	764,450,159
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	73,074	500,149
未払受託者報酬	68,925	103,695
未払委託者報酬	597,665	898,994
その他未払費用	22,897	34,479
流動負債合計	762,561	1,537,317
負債合計	762,561	1,537,317
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	426,598,305	573,243,708
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	93,720,255	189,669,134
(分配準備積立金)	52,375,768	48,427,060
元本等合計	520,318,560	762,912,842
純資産合計	520,318,560	762,912,842
負債純資産合計	521,081,121	764,450,159

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	3,145,229	52,608,132
<b>営業収益合計</b>	<b>3,145,229</b>	<b>52,608,132</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	23
受託者報酬	13,735	103,695
委託者報酬	119,380	898,994
その他費用	4,505	34,479
<b>営業費用合計</b>	<b>137,620</b>	<b>1,037,191</b>
営業利益又は営業損失( )	3,007,609	51,570,941
経常利益又は経常損失( )	3,007,609	51,570,941
中間純利益又は中間純損失( )	3,007,609	51,570,941
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( )	578,755	2,594,306
期首剰余金又は期首欠損金( )	5,938,465	93,720,255
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>21,682,848</b>	<b>55,539,447</b>
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	21,682,848	55,539,447
剰余金減少額又は欠損金増加額	863,830	8,567,203
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	863,830	8,567,203
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金( )	30,343,847	189,669,134

## ( 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3期中間計算期間	
	自 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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2期	第3期中間計算期間
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	40,633,922円	426,598,305円
期中追加設定元本額	409,608,219円	184,403,152円
期中一部解約元本額	23,643,836円	37,757,749円
2. 受益権の総数	426,598,305口	573,243,708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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,219円 (12,197円)	1,330円 (13,309円)



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2045】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	6,067	8,390
コール・ローン	891,074	1,281,731
親投資信託受益証券	682,778,651	941,714,708
未収入金	852,988	530,939
流動資産合計	684,528,780	943,535,768
資産合計	684,528,780	943,535,768
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	834,585	504,990
未払受託者報酬	93,371	134,166
未払委託者報酬	809,620	1,163,085
その他未払費用	31,045	44,652
流動負債合計	1,768,621	1,846,893
負債合計	1,768,621	1,846,893
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	563,954,983	711,046,865
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	118,805,176	230,642,010
(分配準備積立金)	71,407,883	65,116,608
元本等合計	682,760,159	941,688,875
純資産合計	682,760,159	941,688,875
負債純資産合計	684,528,780	943,535,768

## (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 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第5期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	-
有価証券売買等損益	7,765,737	69,918,279
営業収益合計	7,765,735	69,918,279
<b>営業費用</b>		
支払利息	4	38
受託者報酬	49,012	134,166
委託者報酬	425,112	1,163,085
その他費用	16,269	44,652
営業費用合計	490,397	1,341,941
営業利益又は営業損失( )	8,256,132	68,576,338
経常利益又は経常損失( )	8,256,132	68,576,338
中間純利益又は中間純損失( )	8,256,132	68,576,338
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( )	1,905,487	3,899,758
期首剰余金又は期首欠損金( )	31,384,124	118,805,176
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,245,943	59,783,316
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	15,245,943	59,783,316
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,942,941	12,623,062
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,942,941	12,623,062
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( )	35,336,481	230,642,010

## ( 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 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	233,137,568円	563,954,983円
期中追加設定元本額	414,415,117円	204,845,692円
期中一部解約元本額	83,597,702円	57,753,810円
2. 受益権の総数	563,954,983口	711,046,865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 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 2020年12月21日現在	第5期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額	1,2107円	1,3244円
（1万口当たり純資産額）	（12,107円）	（13,244円）

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2050】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,165	1,986
コール・ローン	171,059	303,400
親投資信託受益証券	146,697,349	255,978,129
未収入金	8,713	367,984
流動資産合計	146,878,286	256,651,499
資産合計	146,878,286	256,651,499
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,817	360,901
未払受託者報酬	17,976	31,914
未払委託者報酬	156,158	277,034
その他未払費用	5,925	10,562
流動負債合計	184,876	680,411
負債合計	184,876	680,411
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	118,987,624	189,315,045
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	27,705,786	66,656,043
（分配準備積立金）	14,363,632	12,987,008
元本等合計	146,693,410	255,971,088
純資産合計	146,693,410	255,971,088
負債純資産合計	146,878,286	256,651,499

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	16,882	16,351,674
営業収益合計	16,882	16,351,674
営業費用		
受託者報酬	6,013	31,914
委託者報酬	52,421	277,034
その他費用	1,938	10,562
営業費用合計	60,372	319,510
営業利益又は営業損失( )	43,490	16,032,164
経常利益又は経常損失( )	43,490	16,032,164
中間純利益又は中間純損失( )	43,490	16,032,164
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( )	428,298	1,048,444
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,356,159	27,705,786
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,892,716	27,538,053
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	4,892,716	27,538,053
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,151,372	3,571,516
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,151,372	3,571,516
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( )	7,482,311	66,656,043

## ( 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3期中間計算期間	
	自 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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2期	第3期中間計算期間
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	21,794,219円	118,987,624円
期中追加設定元本額	113,562,838円	84,835,403円
期中一部解約元本額	16,369,433円	14,507,982円
2. 受益権の総数	118,987,624口	189,315,045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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2328円 (12,328円)	1,3521円 (13,521円)



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2055】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2020年12月21日現在	第6期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,775	7,948
コール・ローン	848,215	1,214,186
親投資信託受益証券	653,705,000	887,462,559
未収入金	73,466	2,914,301
流動資産合計	654,632,456	891,598,994
資産合計	654,632,456	891,598,994
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	55,884	2,889,772
未払受託者報酬	88,894	127,090
未払委託者報酬	770,810	1,101,757
その他未払費用	29,559	42,287
流動負債合計	945,147	4,160,906
負債合計	945,147	4,160,906
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	446,839,347	551,758,694
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	206,847,962	335,679,394
(分配準備積立金)	71,766,100	59,262,513
元本等合計	653,687,309	887,438,088
純資産合計	653,687,309	887,438,088
負債純資産合計	654,632,456	891,598,994

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第6期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	3	-
有価証券売買等損益	14,881,866	70,168,321
営業収益合計	14,881,863	70,168,321
<b>営業費用</b>		
支払利息	28	38
受託者報酬	61,231	127,090
委託者報酬	531,014	1,101,757
その他費用	20,334	42,287
営業費用合計	612,607	1,271,172
営業利益又は営業損失（ ）	15,494,470	68,897,149
経常利益又は経常損失（ ）	15,494,470	68,897,149
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,494,470	68,897,149
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（ ）	4,126,687	8,242,695
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	96,666,823	206,847,962
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,086,074	112,650,513
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	40,086,074	112,650,513
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,082,136	44,473,535
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,082,136	44,473,535
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（ ）	103,302,978	335,679,394

## ( 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6期中間計算期間	
	自 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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5期	第6期中間計算期間
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	262,527,078円	446,839,347円
期中追加設定元本額	290,087,575円	198,573,373円
期中一部解約元本額	105,775,306円	93,654,026円
2. 受益権の総数	446,839,347口	551,758,694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5期 2020年12月21日現在	第6期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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5期 2020年12月21日現在	第6期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額	1,4629円	1,6084円
（1万口当たり純資産額）	（14,629円）	（16,084円）

【DCニッセイターゲットデートファンド2060】  
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,422	2,872
コール・ローン	208,922	438,787
親投資信託受益証券	175,314,432	420,203,033
未収入金	805,628	726,035
流動資産合計	176,330,404	421,370,727
資産合計	176,330,404	421,370,727
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	800,960	714,521
未払受託者報酬	21,949	46,440
未払委託者報酬	190,527	402,793
その他未払費用	7,246	15,397
流動負債合計	1,020,682	1,179,151
負債合計	1,020,682	1,179,151
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	141,064,244	306,826,179
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	34,245,478	113,365,397
（分配準備積立金）	16,053,870	11,931,525
元本等合計	175,309,722	420,191,576
純資産合計	175,309,722	420,191,576
負債純資産合計	176,330,404	421,370,727

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年6月20日	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	470,188	23,180,357
営業収益合計	470,188	23,180,357
営業費用		
受託者報酬	6,909	46,440
委託者報酬	60,245	402,793
その他費用	2,230	15,397
営業費用合計	69,384	464,630
営業利益又は営業損失( )	539,572	22,715,727
経常利益又は経常損失( )	539,572	22,715,727
中間純利益又は中間純損失( )	539,572	22,715,727
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( )	1,207,468	3,988,727
期首剰余金又は期首欠損金( )	4,566,193	34,245,478
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,224,131	77,154,973
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	6,224,131	77,154,973
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,171,981	16,762,054
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,171,981	16,762,054
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( )	8,286,239	113,365,397

## ( 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3期中間計算期間	
	自 2020年12月22日	至 2021年6月21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12月20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、2020年12月22日から2021年6月21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2期	第3期中間計算期間
	2020年12月21日現在	2021年6月21日現在
1. 期首元本額	28,378,089円	141,064,244円
期中追加設定元本額	179,902,566円	227,649,404円
期中一部解約元本額	67,216,411円	61,887,469円
2. 受益権の総数	141,064,244口	306,826,179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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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2期 2020年12月21日現在	第3期中間計算期間 2021年6月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2428円 (12,428円)	1,3695円 (13,695円)



（参考）

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」、「DCニッセイターゲットデートファンド2055」、「DCニッセイターゲットデートファンド2060」は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。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6月21日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	26,465,346
コール・ローン	4,043,060,318
株式	142,234,228,600
未収配当金	795,175,174
前払金	53,675,000
差入委託証拠金	197,640,000
流動資産合計	147,350,244,438
資産合計	147,350,244,438
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	153,849,200
未払解約金	160,000,606
その他未払費用	4,312
流動負債合計	313,854,118
負債合計	313,854,118
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	69,636,771,675
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,399,618,645
元本等合計	147,036,390,320
純資産合計	147,036,390,320
負債純資産合計	147,350,244,438

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年6月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,506,962,631円
同期中追加設定元本額	11,382,037,019円
同期中一部解約元本額	22,252,227,975円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,831,453,179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)	3,753,266,014円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,699,821円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,922,236,189円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,540,211,784円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	4,697,204,026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)	5,382,524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)	21,479,174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)	25,243,479円
DCニッセイ国内株式インデックス	628,750,162円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	18,709,573,570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)	1,481,038,669円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	184,238,659円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	164,069,551円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	185,221,659円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	404,584,691円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	65,652,333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)	68,320,015円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,929,573円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	8,114,207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)	2,391,437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)	5,242,059円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	21,594,222円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	89,451,301円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	51,806,537円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	145,732,810円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	173,411,124円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	24,424,139,571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)	16,135,790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)	63,938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)	133,607円
計	69,636,771,675円
2. 受益権の総数	69,636,771,675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6月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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6月21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 先物取引 買建	4,789,715,000	-		4,636,000,000	153,715,000
合計	4,789,715,000	-		4,636,000,000	153,715,000

## （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6月21日現在
1口当たり純資産額	2.1115円
（1万口当たり純資産額）	（21,115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6月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	695,782,926
金銭信託	15,668,501
コール・ローン	2,393,646,862
株式	394,487,724,038
投資証券	9,129,626,766
派生商品評価勘定	79,175,559
未収入金	5,989,341
未収配当金	343,753,861
差入委託証拠金	7,460,426,024
流動資産合計	414,611,793,878
資産合計	
414,611,793,878	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	256,174,285
未払金	35,860,795
未払解約金	369,591,703
その他未払費用	5,375
流動負債合計	661,632,158
負債合計	
661,632,158	
純資産の部	
元本等	
元本	159,591,700,491
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	254,358,461,229
元本等合計	413,950,161,720
純資産合計	413,950,161,720
負債純資産合計	414,611,793,878

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年6月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	145,971,623,211円
同期中追加設定元本額	27,178,961,419円
同期中一部解約元本額	13,558,884,139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）	802,296,145円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,538,668,811円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,863,502,015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）	1,755,303,779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）	2,246,768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）	11,953,543円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	15,302,241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）	10,954,877,167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	112,183,813,896円
DCニッセイ外国株式インデックス	23,899,942,220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)	1,236,180,382円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	114,032,206円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	136,959,633円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	114,288,574円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	248,879,710円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,629,530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)	57,014,510円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,783,470円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	6,771,426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)	1,995,876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)	18,021,573円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	55,312,855円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	31,977,993円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	89,865,447円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	104,646,710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)	241,137,895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)	249,245,134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)	118,934,068円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適 格機関投資家限定)	243,077,048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)	237,467,394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)	217,572,472円
計	159,591,700,491円
2. 受益権の総数	159,591,700,491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6月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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6月21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	8,193,294,467	-	8,159,709,400	33,585,067	
イギリス・ポンド	6,065,359,063	-	6,071,909,740	6,550,677	
ユーロ	612,561,064	-	602,171,910	10,389,154	
買建	1,515,374,340	-	1,485,627,750	29,746,590	
アメリカ・ドル	10,059,867,968	-	10,056,734,410	3,133,558	
イギリス・ポンド	7,396,546,957	-	7,435,427,860	38,880,903	
ユーロ	854,446,567	-	841,303,200	13,143,367	
合計	1,808,874,444	-	1,780,003,350	28,871,094	
合計	18,253,162,435	-	18,216,443,810	30,451,509	

## (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6月21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	10,050,634,401	-	9,843,184,167	207,450,234
合計	10,050,634,401	-	9,843,184,167	207,450,234

## (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6月21日現在
1口当たり純資産額	2.5938円
(1万口当たり純資産額)	(25,938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6月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,564,387
コール・ローン	697,292,656
国債証券	59,982,322,220
地方債証券	5,394,707,681
特殊債券	7,315,043,933
社債券	4,176,399,400
未収利息	111,770,664
前払費用	5,091,679
流動資産合計	77,687,192,620
資産合計	77,687,192,620
負債の部	
流動負債	
未払解約金	17,099,790
その他未払費用	744
流動負債合計	17,100,534
負債合計	17,100,534
純資産の部	
元本等	
元本	78,914,446,890
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,244,354,804
元本等合計	77,670,092,086
純資産合計	77,670,092,086
負債純資産合計	77,687,192,620

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年6月21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6月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	81,342,544,413円
同期中追加設定元本額	6,549,612,276円
同期中一部解約元本額	8,977,709,799円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B (適格機関投資家限定)	68,360,456,297円
DCニッセイ日本債券インデックス	2,577,168,351円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	101,044,760円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	4,383,100,480円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	152,880,065円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	611,103,494円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,382,627,131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)	150,661,157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)	13,266,300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)	54,277,169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)	47,913,583円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	38,721,670円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	35,219,331円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	141,929,578円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	864,077,524円
計	78,914,446,890円
2. 受益権の総数	78,914,446,890口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,244,354,804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6月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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6月21日現在
1口当たり純資産額	0.9842円
（1万口当たり純資産額）	（9,842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6月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	63,133,847
金銭信託	864,323
コール・ローン	132,041,048
国債証券	39,836,376,302
派生商品評価勘定	147,763
未収利息	213,882,567
前払費用	17,380,579
流動資産合計	40,263,826,429
資産合計	
40,263,826,429	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	122,118
未払金	96,933,817
未払解約金	64,534,751
その他未払費用	161
流動負債合計	161,590,847
負債合計	
161,590,847	
純資産の部	
元本等	
元本	26,782,053,216
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,320,182,366
元本等合計	40,102,235,582
純資産合計	40,102,235,582
負債純資産合計	40,263,826,429

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年6月21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6月21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	23,241,498,035円
同期中追加設定元本額	5,744,955,367円
同期中一部解約元本額	2,204,400,186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)	2,783,015,542円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,603,144,222円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,655,529,150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)	777,228,098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)	3,896,629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)	10,365,984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)	9,475,367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	11,411,946,166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)	2,144,284,158円
DCニッセイ外国債券インデックス	1,550,429,472円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	68,931,244円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,187,709,414円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	69,261,997円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	153,866,773円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,953,466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)	98,909,224円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	8,656,262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)	31,264,125円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	33,221,759円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	19,354,377円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	55,054,698円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	71,555,089円
計	26,782,053,216円
2. 受益権の総数	26,782,053,216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6月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2021年6月21日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	104,267,175	-	104,292,820	25,645	
イギリス・ポンド	60,404,640	-	60,544,637	139,997	
オーストラリア・ドル	5,528,262	-	5,515,453	12,809	
カナダ・ドル	5,171,301	-	5,137,099	34,202	
デンマーク・クローネ	2,080,663	-	2,073,759	6,904	
ポーランド・ズロチ	741,433	-	741,644	211	
メキシコ・ペソ	575,505	-	573,797	1,708	
ユーロ	1,428,750	-	1,415,097	13,653	
ユーロ	28,336,621	-	28,291,334	45,287	
合計	104,267,175	-	104,292,820	25,645	

## (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6月21日現在
1口当たり純資産額	1.4974円
(1万口当たり純資産額)	(14,974円)



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

DCニッセイターゲットデートファンド2025

2021年6月30日現在

資産総額	1,672,710,347円
負債総額	471,669円
純資産総額（ - ）	1,672,238,678円
発行済数量	1,515,979,430口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1031円

DCニッセイターゲットデートファンド2030

2021年6月30日現在

資産総額	1,641,454,834円
負債総額	175,785円
純資産総額（ - ）	1,641,279,049円
発行済数量	1,341,370,718口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2236円

DCニッセイターゲットデートファンド2035

2021年6月30日現在

資産総額	2,455,292,992円
負債総額	3,878,628円
純資産総額（ - ）	2,451,414,364円
発行済数量	1,864,550,473口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3147円

DCニッセイターゲットデートファンド2040

2021年6月30日現在

資産総額	796,013,123円
負債総額	327,949円
純資産総額（ - ）	795,685,174円
発行済数量	586,354,917口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3570円

DCニッセイターゲットデートファンド2045

2021年6月30日現在

資産総額	989,490,607円
負債総額	550,026円
純資産総額（ - ）	988,940,581円
発行済数量	731,900,324口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3512円

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

2021年6月30日現在

資産総額	270,851,370円
負債総額	1,239,150円
純資産総額（ - ）	269,612,220円
発行済数量	195,319,441口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3804円

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

2021年6月30日現在

資産総額	940,992,713円
負債総額	889,748円
純資産総額（ - ）	940,102,965円
発行済数量	572,198,425口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6430円

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

2021年6月30日現在

資産総額	440,383,529円
負債総額	783,543円
純資産総額（ - ）	439,599,986円
発行済数量	314,071,341口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3997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6月30日現在

資産総額	150,936,904,376円
負債総額	356,005,464円
純資産総額（ - ）	150,580,898,912円
発行済数量	69,624,843,010口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1627円

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	429,868,721,142円
負債総額	614,868,253円
純資産総額（ - ）	429,253,852,889円
発行済数量	160,908,658,537口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6677円

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	80,962,059,428円
負債総額	4,801,414,467円
純資産総額( - )	76,160,644,961円
発行済数量	77,473,066,358口
1口当たり純資産額( / )	0.9831円

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	41,254,223,557円
負債総額	347,731,496円
純資産総額( - )	40,906,492,061円
発行済数量	27,262,638,014口
1口当たり純資産額( / )	1.5005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9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9月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	403	69,093
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	139	26,305
単位型公社債投資信託	0	0
合計	542	95,399

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 で示しております。

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

#### 資 産

##### 現金・預金

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

##### 有価証券

決算日の市場価格等によっております。

##### 投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

#### 負 債

##### 其他未払金

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

#### デリバティブ取引

##### デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

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

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

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

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



## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度(2020年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(注2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〃 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
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
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、継続企業的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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2025の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2025の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2030の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2030の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2035の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2035の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2040の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2040の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2045の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2045の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2050の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2050の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2055の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2055の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年1月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
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ニッセイターゲットデートファンド2060の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2060の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2025の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2025の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2030の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2030の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2035の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2035の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的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。継続企業的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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2040の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2040の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2045の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2045の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的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。継続企業的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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2050の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2050の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2055の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2055の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的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。継続企業的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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 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ニッセイターゲットデートファンド2060の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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ニッセイターゲットデートファンド2060の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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