

【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】	2022年2月18日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 大関 洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）
【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

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

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「(8)申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2022年2月19日(土)～2022年8月19日(金)

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

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(1 0) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

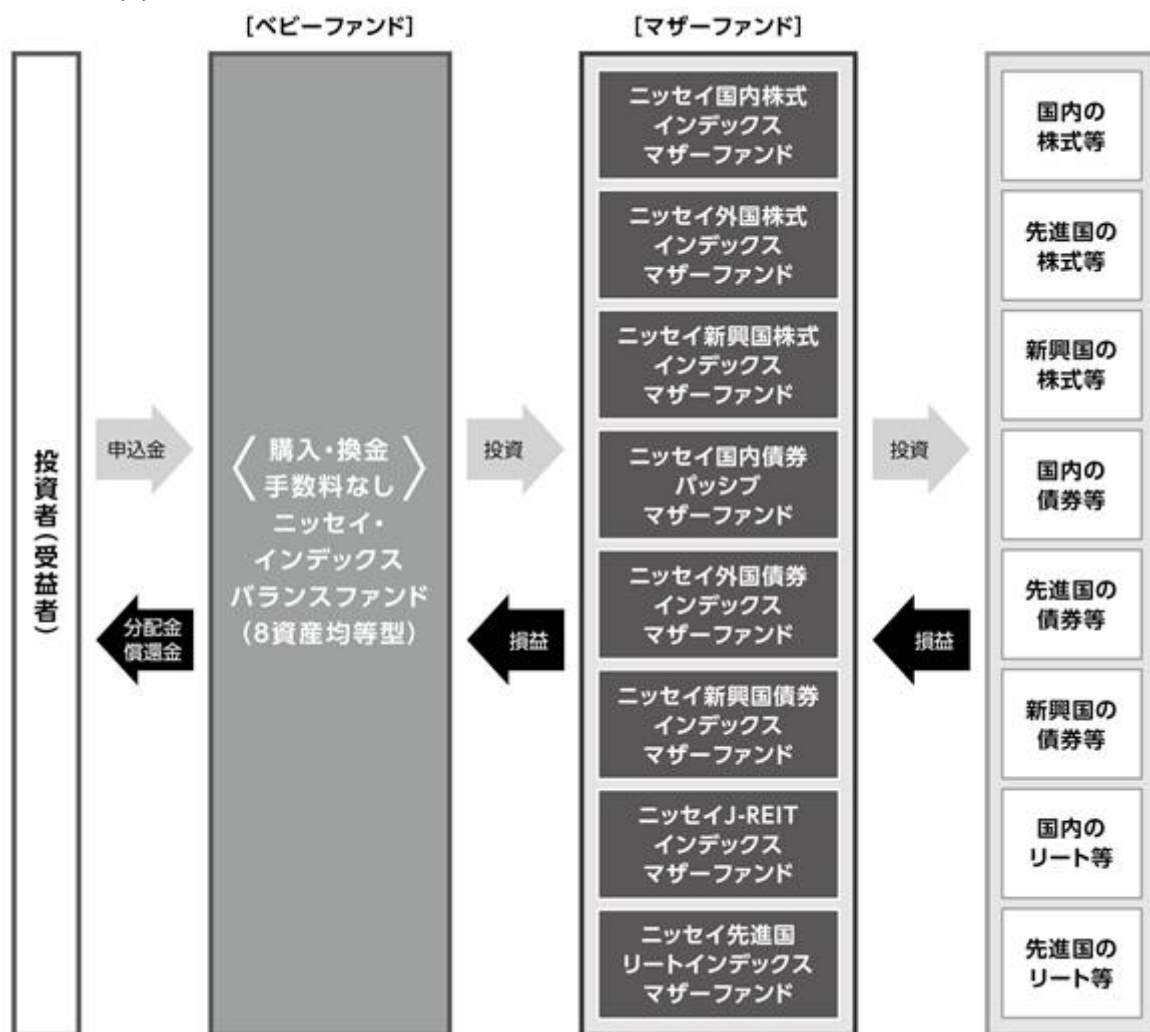
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 国内外の株式・債券・リート(不動産投資信託証券)に分散投資を行います。

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

【投資対象とするマザーファンド】

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

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

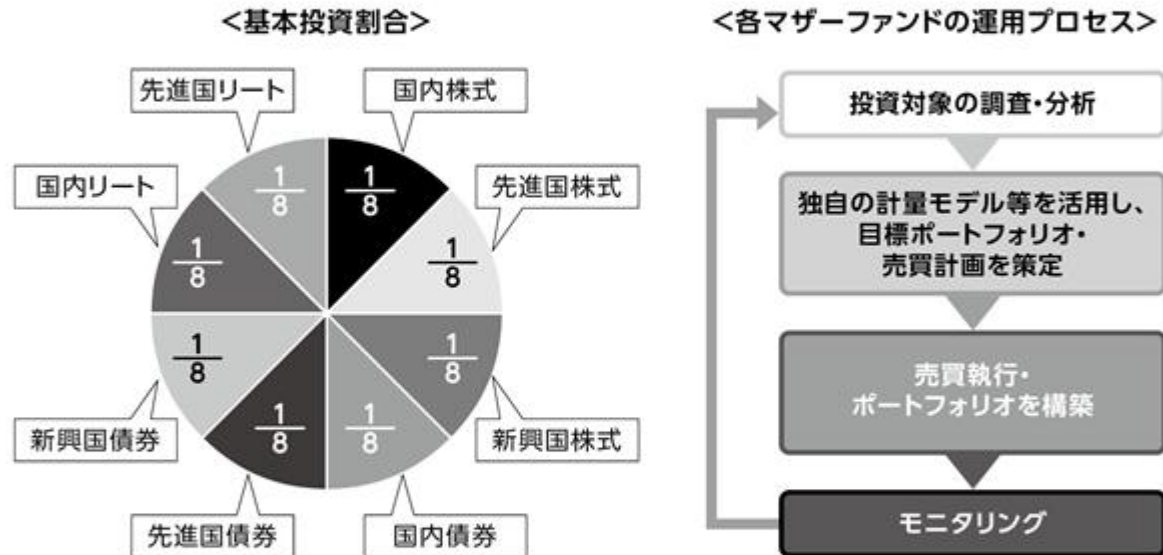
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ[※]を行いません。

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

2 8つの資産への投資割合は均等を基本とします。

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

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



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

3 購入時および換金時の手数料は無料です。

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

・保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

〈各指数について〉

●TOPIX(東証株価指数)

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

○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。

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●NOMURA-BPI総合

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

●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

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

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

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

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

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

●東証REIT指数

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

●S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)

S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)〔「当インデックス」〕はS&P Dow Jones Indices LLC〔「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」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

<MSCI 指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

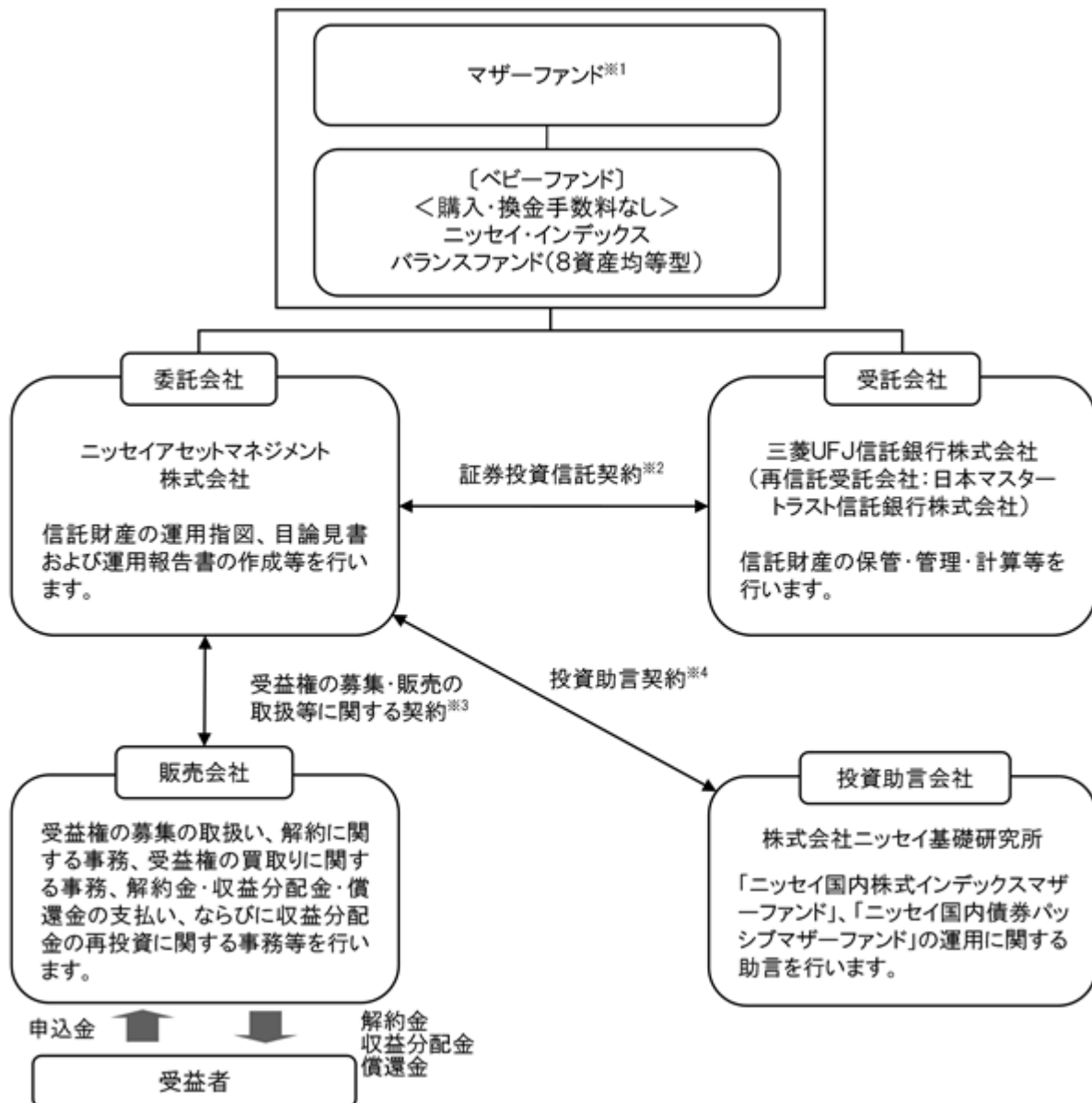
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式・債券・ 不動産投信） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる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

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

（２）【ファンドの沿革】

2018年2月13日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2021年11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・ピ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】

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

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

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

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

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

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

b 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

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

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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

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

金融商品

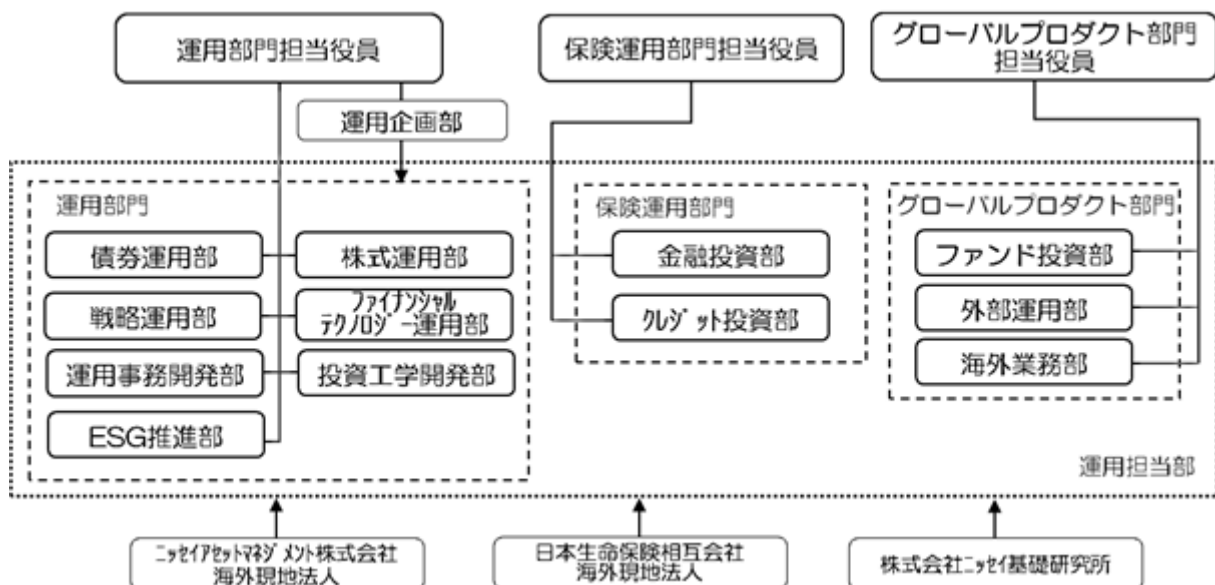
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

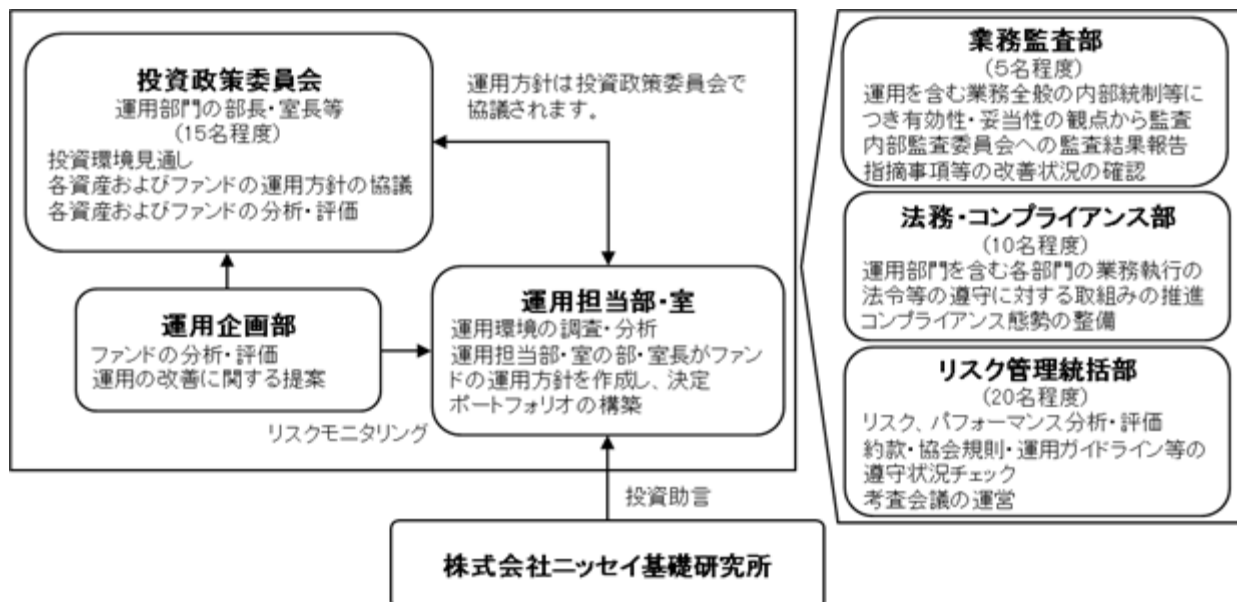
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

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

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

信用取引の範囲

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

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

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

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

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

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

J - R E I T の税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・新興国の株式および債券投資に関する留意点

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

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社および委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2021年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に以下の通り保有しています。

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

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（％）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	-	6.4
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	95.8	-
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	-	59.3

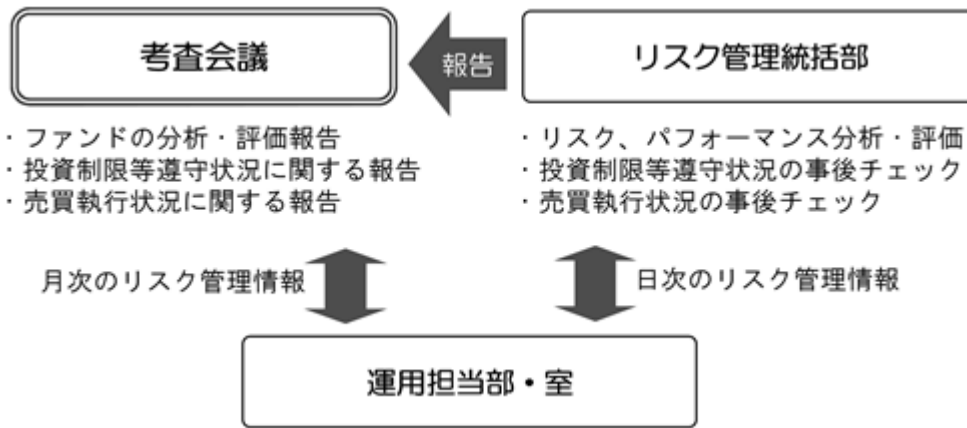
委託会社については実質保有比率が5％超のマザーファンドを記載しています。

・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を取消する可能性、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、月次の考査会議で報告します。
 - ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

< 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。



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

なお、2022年2月19日現在の信託報酬率は年0.1749%（税抜0.159%）であり、その配分は次の通りとします。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税対象

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

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

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

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

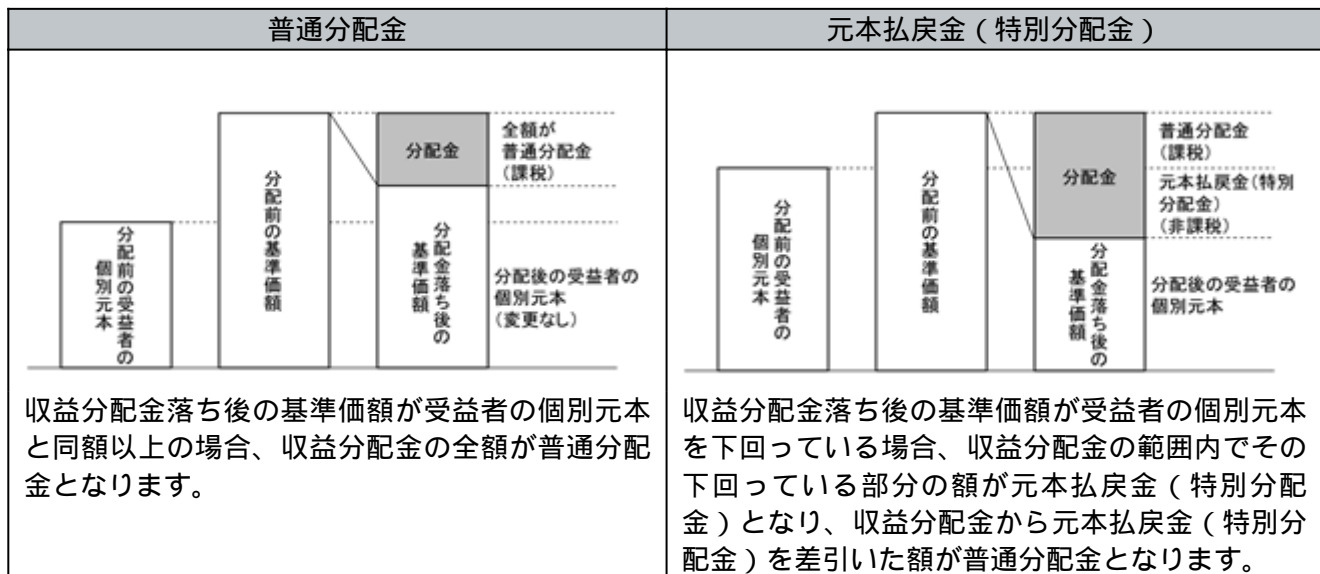
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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



投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	435,499,221	100.00
内 日本	435,499,221	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,096	0.00
純資産総額	435,497,125	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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	109,170,720,870	96.12
内 日本	109,170,720,870	96.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,406,278,254	3.88
純資産総額	113,576,999,124	100.00

その他資産の投資状況

2021年11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）	4,664,160,000	4.11
内 日本	4,664,160,000	4.11

（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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	59,361,864,580	76.49
内 日本	59,361,864,580	76.49
地方債証券	4,890,938,383	6.30
内 日本	4,890,938,383	6.30
特殊債券	7,584,430,347	9.77
内 日本	7,584,430,347	9.77
社債券	5,100,095,000	6.57
内 日本	4,496,511,300	5.79
内 フランス	401,463,900	0.52
内 スウェーデン	202,119,800	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	668,601,396	0.86
純資産総額	77,605,929,706	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	30,770,311,400	98.42
内 日本	30,770,311,400	98.42
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	495,184,906	1.58
純資産総額	31,265,496,306	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	481,948,554,308	95.36
内 アメリカ	346,424,449,555	68.55
内 イギリス	19,235,623,234	3.81
内 カナダ	17,431,239,609	3.45
内 スイス	16,326,095,043	3.23
内 フランス	15,218,835,092	3.01
内 ドイツ	12,535,871,045	2.48
内 オランダ	10,194,696,410	2.02
内 オーストラリア	8,892,817,246	1.76
内 アイルランド	7,009,353,284	1.39
内 スウェーデン	5,642,196,394	1.12
内 デンマーク	3,885,884,097	0.77
内 香港	3,617,123,901	0.72
内 スペイン	3,214,626,179	0.64
内 イタリア	2,873,575,302	0.57
内 フィンランド	1,453,514,161	0.29
内 シンガポール	1,305,461,962	0.26
内 ベルギー	1,264,435,536	0.25
内 ノルウェー	958,481,256	0.19
内 ジャージー	941,717,785	0.19
内 イスラエル	882,630,473	0.17
内 バミューダ	802,774,025	0.16
内 オランダ領キュラソー	358,100,711	0.07
内 オーストリア	323,246,623	0.06
内 ニューゼーランド	314,661,469	0.06
内 ケイマン諸島	303,723,702	0.06
内 ポルトガル	288,261,188	0.06
内 ルクセンブルグ	197,517,021	0.04
内 パプアニューギニア	51,642,005	0.01
投資証券	11,105,559,249	2.20
内 アメリカ	9,486,992,327	1.88
内 オーストラリア	698,317,556	0.14
内 イギリス	308,246,785	0.06
内 フランス	200,073,960	0.04
内 シンガポール	194,806,058	0.04
内 香港	159,843,045	0.03
内 カナダ	57,279,518	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,319,898,615	2.44
純資産総額	505,374,012,172	100.00

その他資産の投資状況

2021年11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）	12,263,538,180	2.43
内 アメリカ	9,180,653,084	1.82
内 ドイツ	2,198,638,588	0.44
内 イギリス	884,246,508	0.17

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	46,266,865,196	99.48
内 アメリカ	21,788,922,717	46.85
内 フランス	4,617,593,746	9.93
内 イタリア	4,204,025,563	9.04
内 ドイツ	3,364,245,088	7.23
内 イギリス	2,859,712,273	6.15
内 スペイン	2,732,390,741	5.88
内 ベルギー	1,047,349,868	2.25
内 カナダ	919,726,260	1.98
内 オランダ	877,145,585	1.89
内 オーストラリア	799,321,578	1.72
内 オーストリア	679,376,295	1.46
内 アイルランド	363,898,098	0.78
内 メキシコ	306,128,411	0.66
内 フィンランド	276,011,454	0.59
内 ポーランド	233,453,779	0.50
内 デンマーク	231,798,120	0.50
内 イスラエル	221,783,828	0.48
内 マレーシア	219,976,646	0.47
内 シンガポール	199,618,361	0.43
内 スウェーデン	134,265,133	0.29
内 ノルウェー	110,293,348	0.24
内 中国	79,828,304	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	240,047,996	0.52
純資産総額	46,506,913,192	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	4,418,219,704	98.19
内 アメリカ	3,380,367,392	75.12
内 オーストラリア	303,358,496	6.74
内 イギリス	252,712,928	5.62
内 シンガポール	143,176,758	3.18
内 カナダ	85,543,367	1.90
内 フランス	77,944,325	1.73
内 香港	58,874,587	1.31
内 ベルギー	55,303,745	1.23
内 スペイン	16,829,250	0.37
内 ドイツ	15,016,155	0.33
内 ニュージーランド	14,686,145	0.33
内 オランダ	5,637,118	0.13
内 アイルランド	3,323,066	0.07
内 イスラエル	2,820,559	0.06
内 ガーンジー	2,116,135	0.05
内 イタリア	509,678	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	81,559,467	1.81
純資産総額	4,499,779,171	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	3,701,641,325	85.78
内 台湾	589,105,078	13.65
内 韓国	490,723,425	11.37
内 インド	485,968,619	11.26
内 香港	441,756,633	10.24
内 中国	392,049,741	9.08
内 ケイマン諸島	372,044,206	8.62
内 ブラジル	162,208,807	3.76
内 アメリカ	145,852,997	3.38
内 ロシア	119,014,858	2.76
内 南アフリカ	116,980,717	2.71
内 メキシコ	69,718,906	1.62
内 タイ	61,795,080	1.43
内 インドネシア	58,707,900	1.36
内 マレーシア	46,499,966	1.08
内 フィリピン	26,831,279	0.62
内 ポーランド	25,876,960	0.60
内 チリ	16,760,016	0.39
内 イギリス	16,192,436	0.38
内 バミューダ	15,313,940	0.35
内 オランダ	12,087,242	0.28
内 ハンガリー	9,004,496	0.21
内 トルコ	8,218,504	0.19
内 ギリシャ	7,587,554	0.18
内 チェコ	5,456,131	0.13
内 コロンビア	4,742,834	0.11
内 イギリス領バージン諸島	718,525	0.02
内 ペルー	424,475	0.01
社債券	14,554	0.00
内 インド	14,554	0.00
投資信託受益証券	234,921,647	5.44
内 アメリカ	234,921,647	5.44
投資証券	1,716,123	0.04
内 メキシコ	905,563	0.02
内 南アフリカ	810,560	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	377,177,893	8.74
純資産総額	4,315,471,542	100.00

その他資産の投資状況

2021年11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）	365,255,740	8.46
内 アメリカ	365,255,740	8.46

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	1,247,068,454	97.63
内 メキシコ	227,171,562	17.79
内 インドネシア	182,548,739	14.29
内 ロシア	166,378,298	13.03
内 ブラジル	130,462,559	10.21
内 フィリピン	129,966,295	10.18
内 コロンビア	99,141,679	7.76
内 パナマ	84,530,198	6.62
内 南アフリカ	68,407,625	5.36
内 ペルー	57,072,696	4.47
内 ハンガリー	36,292,821	2.84
内 ルーマニア	35,022,203	2.74
内 クロアチア	30,073,779	2.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	30,240,935	2.37
純資産総額	1,277,309,389	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2021年11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	56,717,149	0.9835 55,786,725	0.9849 55,860,720	- -	12.83
2	ニッセイ外国債券インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	36,421,476	1.5209 55,396,625	1.5151 55,182,178	- -	12.67
3	ニッセイ新興国債券イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	44,492,014	1.2599 56,057,411	1.2377 55,067,765	- -	12.64
4	ニッセイ先進国リートイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	38,685,632	1.4373 55,605,903	1.4213 54,983,888	- -	12.63
5	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	18,913,549	2.9524 55,840,858	2.8942 54,739,593	- -	12.57
6	ニッセイJ-REITイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	28,413,432	1.9354 54,991,731	1.8903 53,709,910	- -	12.33
7	ニッセイ新興国株式イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	45,626,054	1.2242 55,856,472	1.1753 53,624,301	- -	12.31
8	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	24,191,414	2.2925 55,461,064	2.1632 52,330,866	- -	12.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11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11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	2,092,900	1,633.53 3,418,818,140	2,001.00 4,187,892,900	- -	3.69
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	258,800	11,946.87 3,091,851,495	13,825.00 3,577,910,000	- -	3.15

3	キーエンス 日本	株式 電気機器	37,400	56,893.10 2,127,802,100	70,330.00 2,630,342,000	- -	2.32
4	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	304,600	5,656.76 1,723,049,756	6,901.00 2,102,044,600	- -	1.85
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,613,400	567.42 1,482,915,806	601.40 1,571,698,760	- -	1.38
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	26,200	46,844.74 1,227,332,278	59,840.00 1,567,808,000	- -	1.38
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	474,200	2,829.38 1,341,693,767	3,125.00 1,481,875,000	- -	1.30
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	243,100	10,286.67 2,500,689,819	6,030.00 1,465,893,000	- -	1.29
9	HOYA 日本	株式 精密機器	80,600	13,218.41 1,065,404,344	18,020.00 1,452,412,000	- -	1.28
10	日本電産 日本	株式 電気機器	107,100	14,326.09 1,534,324,620	13,000.00 1,392,300,000	- -	1.23
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	198,700	5,026.14 998,695,794	6,688.00 1,328,905,600	- -	1.17
12	信越化学工業 日本	株式 化学	69,500	18,719.78 1,301,024,958	19,000.00 1,320,500,000	- -	1.16
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	52,600	22,174.64 1,166,386,252	23,150.00 1,217,690,000	- -	1.07
14	任天堂 日本	株式 その他製品	23,300	67,317.39 1,568,495,256	50,100.00 1,167,330,000	- -	1.03
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	282,100	3,770.41 1,063,634,654	3,703.00 1,044,616,300	- -	0.92
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	304,900	3,106.56 947,193,124	3,391.00 1,033,915,900	- -	0.91
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	121,400	9,792.89 1,188,857,312	8,380.00 1,017,332,000	- -	0.90
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	325,300	3,012.89 980,094,736	3,101.00 1,008,755,300	- -	0.89
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	324,800	3,677.39 1,194,416,946	3,031.00 984,468,800	- -	0.87
20	KDDI 日本	株式 情報・通信業	295,600	3,405.06 1,006,537,004	3,300.00 975,480,000	- -	0.86
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	614,100	1,489.31 914,586,640	1,562.50 959,531,250	- -	0.84
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	284,600	3,252.33 925,615,372	3,260.00 927,796,000	- -	0.82

23	第一三共 日本	株式 医薬品	324,700	3,222.63 1,046,390,011	2,824.50 917,115,150	- -	0.81
24	S M C 日本	株式 機械	12,100	65,780.46 795,943,638	72,650.00 879,065,000	- -	0.77
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	46,700	17,916.74 836,711,932	17,840.00 833,128,000	- -	0.73
26	三井物産 日本	株式 卸売業	316,000	2,223.62 702,664,521	2,557.00 808,012,000	- -	0.71
27	ファナック 日本	株式 電気機器	36,300	27,384.07 994,041,848	22,245.00 807,493,500	- -	0.71
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	134,200	5,364.02 719,852,448	5,708.00 766,013,600	- -	0.67
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	91,000	6,723.94 611,879,436	8,331.00 758,121,000	- -	0.67
30	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	521,200	1,589.53 828,467,680	1,402.00 730,722,400	- -	0.64

(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11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	19.03
		情報・通信業	8.29
		輸送用機器	7.76
		化学	6.53
		サービス業	6.17
		機械	5.16
		卸売業	4.90
		医薬品	4.63
		銀行業	4.48
		小売業	4.03
		食料品	3.13
		精密機器	2.90
		陸運業	2.87
		建設業	2.10
		その他製品	2.10
		保険業	1.84
		不動産業	1.80
		その他金融業	1.08
		電気・ガス業	1.04
		ガラス・土石製品	0.75
		証券、商品先物取引業	0.71
		鉄鋼	0.68
		非鉄金属	0.67
		ゴム製品	0.63
		金属製品	0.61
		繊維製品	0.44
		海運業	0.41
		石油・石炭製品	0.39
空運業	0.36		
鉱業	0.21		
パルプ・紙	0.20		
倉庫・運輸関連業	0.16		
水産・農林業	0.08		
	小計		96.12
合計(対純資産総額比)			96.12

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年11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	101.20 1,012,022,000	0.828 2023/5/19	1.30
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	744,000,000	100.83 750,175,200	101.20 752,950,320	0.1 2028/3/20	0.97
3	第363回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	643,000,000	100.65 647,182,760	100.57 646,665,100	0.1 2031/6/20	0.83
4	第429回 利付国債(2 年) 日本	国債証 券	600,000,000	100.22 601,346,000	100.24 601,488,000	0.005 2023/10/1	0.78

5	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	585,000,000	101.96 596,493,490	101.72 595,073,700	0.4 2025/3/20	0.77
6	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	566,000,000	102.20 578,474,640	101.98 577,240,760	0.4 2025/9/20	0.74
7	第351回 利付国債(10年) 日本	国債証券	570,000,000	100.77 574,389,000	101.21 576,942,600	0.1 2028/6/20	0.74
8	第349回 利付国債(10年) 日本	国債証券	570,000,000	100.86 574,902,000	101.18 576,760,200	0.1 2027/12/20	0.74
9	第352回 利付国債(10年) 日本	国債証券	556,000,000	100.67 559,725,200	101.26 563,033,400	0.1 2028/9/20	0.73
10	第341回 利付国債(10年) 日本	国債証券	552,000,000	101.79 561,924,960	101.68 561,323,280	0.3 2025/12/20	0.72
11	第353回 利付国債(10年) 日本	国債証券	543,000,000	100.62 546,372,030	101.31 550,124,160	0.1 2028/12/20	0.71
12	第339回 利付国債(10年) 日本	国債証券	536,000,000	102.08 547,154,160	101.85 545,937,440	0.4 2025/6/20	0.70
13	第344回 利付国債(10年) 日本	国債証券	533,000,000	100.83 537,429,230	100.96 538,143,450	0.1 2026/9/20	0.69
14	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	532,000,000	100.84 536,468,800	101.01 537,399,800	0.1 2026/12/20	0.69
15	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	525,000,000	100.17 525,892,500	101.20 531,336,750	0.1 2030/3/20	0.68
16	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	523,000,000	100.81 527,262,450	101.06 528,569,950	0.1 2027/3/20	0.68
17	第354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	518,000,000	100.52 520,693,600	101.32 524,842,780	0.1 2029/3/20	0.68
18	第144回 利付国債(5年) 日本	国債証券	512,000,000	100.78 516,008,960	100.78 516,014,080	0.1 2025/6/20	0.66
19	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	510,000,000	100.83 514,238,100	100.90 514,625,700	0.1 2026/3/20	0.66
20	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	101.75 508,779,000	0.66 2024/5/31	0.66
21	第334回 利付国債(10年) 日本	国債証券	496,000,000	102.31 507,457,600	101.85 505,200,800	0.6 2024/6/20	0.65

22	第348回 利付国債（10年） 日本	国債証券	499,000,000	100.81 503,076,830	101.13 504,673,630	0.1 2027/9/20	0.65
23	第430回 利付国債（2年） 日本	国債証券	500,000,000	100.25 501,263,000	100.25 501,295,000	0.005 2023/11/1	0.65
24	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	461,000,000	100.82 464,780,200	100.96 465,425,600	0.1 2026/6/20	0.60
25	第361回 利付国債（10年） 日本	国債証券	457,000,000	99.86 456,370,870	100.85 460,925,630	0.1 2030/12/20	0.59
26	第347回 利付国債（10年） 日本	国債証券	433,000,000	100.82 436,552,660	101.08 437,711,040	0.1 2027/6/20	0.56
27	第357回 利付国債（10年） 日本	国債証券	429,000,000	100.26 430,115,400	101.25 434,375,370	0.1 2029/12/20	0.56
28	第355回 利付国債（10年） 日本	国債証券	422,000,000	100.45 423,899,000	101.32 427,604,160	0.1 2029/6/20	0.55
29	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	418,000,000	100.33 419,379,400	101.29 423,408,920	0.1 2029/9/20	0.55
30	第427回 利付国債（2年） 日本	国債証券	416,000,000	100.23 416,977,600	100.22 416,936,000	0.005 2023/8/1	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11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	76.49
		特殊債券	9.77
		地方債証券	6.30
		社債券	5.79
	小計	98.36	
	外国	社債券	0.78
	小計	0.78	
合計（対純資産総額比）			99.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年11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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,182	712,018.86 2,265,644,018	700,000.00 2,227,400,000	- -	7.12
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,808	674,000.97 1,892,594,743	655,000.00 1,839,240,000	- -	5.88
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	4,448	371,522.11 1,652,530,363	369,500.00 1,643,536,000	- -	5.26
4	GLP投資法人 日本	投資証券	9,094	184,900.58 1,681,485,920	180,300.00 1,639,648,200	- -	5.24
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	9,080	168,203.54 1,527,288,160	161,400.00 1,465,512,000	- -	4.69
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,167	101,500.36 1,437,955,729	97,800.00 1,385,532,600	- -	4.43
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,216	325,004.89 1,370,220,634	323,500.00 1,363,876,000	- -	4.36
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,594	186,101.43 1,041,051,440	180,500.00 1,009,717,000	- -	3.23
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	2,807	361,500.63 1,014,732,288	348,500.00 978,239,500	- -	3.13
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	6,321	141,495.80 894,394,984	144,600.00 914,016,600	- -	2.92
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	3,986	206,801.23 824,309,714	202,800.00 808,360,800	- -	2.59
12	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	1,845	416,011.93 767,542,016	404,500.00 746,302,500	- -	2.39
13	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	8,523	84,501.53 720,206,561	82,500.00 703,147,500	- -	2.25
14	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	1,496	455,003.28 680,684,920	432,000.00 646,272,000	- -	2.07
15	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証券	3,437	188,904.10 649,263,415	187,200.00 643,406,400	- -	2.06
16	三井不動産ロジスティクス パーク投資法人 日本	投資証券	1,044	585,019.43 610,760,290	583,000.00 608,652,000	- -	1.95
17	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	969	637,008.86 617,261,592	620,000.00 600,780,000	- -	1.92

18	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	869	710,005.88 616,995,112	689,000.00 598,741,000	- -	1.92
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,835	329,995.54 605,541,819	314,000.00 576,190,000	- -	1.84
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	8,602	68,498.33 589,222,674	58,600.00 504,077,200	- -	1.61
21	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,302	154,899.90 511,479,470	152,000.00 501,904,000	- -	1.61
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,302	155,202.17 512,477,585	150,400.00 496,620,800	- -	1.59
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	984	511,028.17 502,851,720	497,000.00 489,048,000	- -	1.56
24	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,358	44,698.38 552,382,620	38,050.00 470,221,900	- -	1.50
25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,619	172,299.61 451,252,699	166,700.00 436,587,300	- -	1.40
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	594	731,991.47 434,802,936	714,000.00 424,116,000	- -	1.36
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	3,794	113,400.46 430,241,351	109,400.00 415,063,600	- -	1.33
28	N T T都市開発リート投資法人 日本	投資証券	2,691	152,204.34 409,581,900	150,200.00 404,188,200	- -	1.29
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,264	320,022.09 404,507,925	319,000.00 403,216,000	- -	1.29
30	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	1,918	214,199.92 410,835,456	206,100.00 395,299,800	- -	1.26

(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。

種類別及び業種別投資比率

2021年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	国内		98.42
	小計		98.42
合計(対純資産総額比)			98.42

(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11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	1,254,294	18,265.77 22,910,650,106	18,230.50 22,866,412,787	- -	4.52
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	541,681	39,033.41 21,143,659,469	38,298.39 20,745,512,956	- -	4.10
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	34,586	418,160.87 14,462,512,152	405,199.81 14,014,240,936	- -	2.77
4	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	63,850	129,363.14 8,259,836,765	129,355.35 8,259,339,244	- -	1.63
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア ・エンターテインメント	22,839	338,818.67 7,738,279,819	331,140.09 7,562,908,737	- -	1.50
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア ・エンターテインメント	21,866	341,201.91 7,460,721,149	332,467.79 7,269,740,818	- -	1.44
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	189,689	37,530.75 7,119,171,032	37,971.87 7,202,847,034	- -	1.43
8	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア ・エンターテインメント	180,868	39,284.68 7,105,341,590	38,457.67 6,955,762,418	- -	1.38
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	226,696	18,307.86 4,150,320,534	18,343.13 4,158,315,808	- -	0.82
10	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	80,079	46,496.66 3,723,406,140	46,283.91 3,706,369,341	- -	0.73
11	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア 機器・ サービス	71,534	50,064.72 3,581,329,742	51,424.03 3,678,567,277	- -	0.73
12	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	199,770	18,530.19 3,701,776,258	18,174.75 3,630,771,305	- -	0.72

13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	100,618	31,855.62 3,205,249,156	32,096.79 3,229,515,057	- -	0.64
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	213,566	15,130.16 3,231,289,886	14,802.32 3,161,273,340	- -	0.63
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	184,281	16,703.71 3,078,176,640	16,954.00 3,124,301,069	- -	0.62
16	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	574,416	5,165.15 2,966,949,397	5,186.77 2,979,366,146	- -	0.59
17	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	128,087	22,850.28 2,926,824,949	22,331.91 2,860,427,778	- -	0.57
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	31,354	97,578.75 3,059,484,409	90,503.36 2,837,642,600	- -	0.56
19	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	36,129	78,315.65 2,829,466,229	78,215.73 2,825,856,372	- -	0.56
20	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	33,579	77,221.50 2,593,020,931	75,525.07 2,536,056,553	- -	0.50
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	425,392	5,780.74 2,459,083,190	5,961.54 2,535,994,826	- -	0.50
22	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	74,287	34,257.70 2,544,902,363	33,760.10 2,507,937,276	- -	0.50
23	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	66,872	38,647.67 2,584,447,053	36,748.84 2,457,468,943	- -	0.49
24	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	53,281	45,587.76 2,428,961,451	44,061.87 2,347,660,761	- -	0.46

25	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・ ア・娯楽	137,916	17,516.70 2,415,834,050	16,816.34 2,319,242,857	- -	0.46
26	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネ ル ギ ー	321,286	6,902.96 2,217,824,589	7,007.09 2,251,281,299	- -	0.45
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	29,848	72,372.29 2,160,168,115	73,810.56 2,203,097,681	- -	0.44
28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生 活必需品 小売り	33,523	60,739.95 2,036,185,631	63,128.69 2,116,263,329	- -	0.42
29	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア ア・娯楽	347,449	5,905.61 2,051,900,003	5,862.56 2,036,943,423	- -	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	319,659	6,059.74 1,937,051,751	6,343.81 2,027,857,623	- -	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11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	12.36
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.65
		メディア・娯楽	7.00
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.05
		資本財	5.92
		銀行	5.74
		小売	5.69
		半導体・半導体製造装置	5.47
		各種金融	4.62
		ヘルスケア機器・サービス	4.46
		素材	3.91
		食品・飲料・タバコ	3.50
		エネルギー	3.25
		保険	2.77
		公益事業	2.70
		自動車・自動車部品	2.63
		耐久消費財・アパレル	1.90
		運輸	1.88
		消費者サービス	1.72
		家庭用品・パーソナル用品	1.63
食品・生活必需品小売り	1.43		
電気通信サービス	1.40		
商業・専門サービス	1.25		
不動産	0.44		
	小計		95.36
投資証券	外国		2.20
	小計		2.20
合計(対純資産総額比)			97.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。株式(外国)の業種はGICS分類(産業グループ)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&P及びMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年11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	538,132,100	104.41 561,906,776	104.44 562,073,597	2.5 2024/5/15	1.21
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	422,086,700	104.74 442,135,818	104.74 442,118,934	2.75 2024/2/15	0.95
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	419,811,300	103.54 434,714,601	103.51 434,584,459	2.5 2023/8/15	0.93
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	424,362,100	102.02 432,963,919	102.04 433,061,523	1.75 2023/5/15	0.93
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	423,224,400	99.36 420,528,460	99.42 420,773,930	0.125 2023/9/15	0.90
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	394,781,900	104.33 411,883,851	104.35 411,958,860	2.375 2024/8/15	0.89
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	397,057,300	103.54 411,152,834	103.62 411,434,744	2 2025/8/15	0.88

8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	372,027,900	104.58 389,085,379	104.65 389,334,637	2.25 2025/11/15	0.84
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	362,926,300	102.10 370,565,898	102.10 370,551,381	2 2023/2/15	0.80
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	353,824,700	103.40 365,861,816	103.44 365,999,807	2.125 2024/3/31	0.79
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	353,824,700	102.04 361,063,532	102.15 361,439,007	1.625 2026/5/15	0.78
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	343,585,400	104.37 358,627,568	104.37 358,627,568	2.75 2023/11/15	0.77
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	351,549,300	101.58 357,110,809	101.58 357,135,418	1.5 2023/3/31	0.77
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	348,136,200	102.07 355,356,544	102.17 355,722,087	1.625 2026/2/15	0.76
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	346,998,500	99.76 346,169,173	99.80 346,304,503	0.25 2023/6/15	0.74
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	306,041,300	109.42 334,885,692	109.48 335,078,498	2.875 2028/8/15	0.72
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	325,382,200	101.45 330,132,780	101.55 330,451,654	1.5 2026/8/15	0.71
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	311,729,800	103.49 322,627,873	103.52 322,712,040	2.25 2023/12/31	0.69
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	309,454,400	103.94 321,677,598	104.00 321,841,859	2.125 2025/5/15	0.69
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	303,765,900	103.45 314,254,936	103.50 314,418,970	2 2025/2/15	0.68
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	288,975,800	104.70 302,586,560	104.80 302,869,756	2.25 2026/3/31	0.65
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	285,562,700	104.13 297,384,995	104.19 297,542,055	2.25 2024/11/15	0.64
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	284,425,000	101.50 288,699,907	101.44 288,546,318	1.625 2022/12/15	0.62
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	269,634,900	105.19 283,653,218	105.27 283,863,533	2.25 2027/8/15	0.61
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	259,395,600	106.17 275,423,654	106.25 275,625,982	2.625 2025/12/31	0.59
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	266,221,800	103.18 274,694,820	103.28 274,967,186	1.875 2026/6/30	0.59
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	251,431,700	108.31 272,330,702	108.36 272,458,933	2.75 2028/2/15	0.59
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	249,156,300	105.85 263,744,401	105.93 263,938,743	2.375 2027/5/15	0.57
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	242,330,100	105.28 255,137,245	105.37 255,362,612	2.25 2027/11/15	0.55
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	233,228,500	109.21 254,718,173	109.26 254,846,449	2.875 2028/5/15	0.55

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11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	99.48
	小計		99.48
合 計 (対純資産総額比)			99.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2021年11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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	17,971	17,090.52 307,133,903	17,438.66 313,390,259	- -	6.96
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	2,181	89,711.05 195,659,817	93,291.39 203,468,543	- -	4.52
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	8,062	18,970.00 152,936,219	18,196.37 146,699,165	- -	3.26
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	3,678	37,742.05 138,815,295	37,759.12 138,878,062	- -	3.09
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	6,869	18,838.03 129,398,473	19,203.23 131,907,043	- -	2.93
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	13,559	8,067.43 109,386,292	7,941.14 107,673,998	- -	2.39
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	10,373	9,578.29 99,355,667	9,333.69 96,818,374	- -	2.15
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	3,413	27,533.47 93,971,759	27,393.54 93,494,154	- -	2.08
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	41,054	1,991.60 81,763,351	1,995.66 81,930,215	- -	1.82
10	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	8,164	9,788.77 79,915,524	9,809.24 80,082,712	- -	1.78
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	3,319	23,504.88 78,012,703	23,352.42 77,506,715	- -	1.72
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	3,275	22,999.74 75,324,158	23,100.99 75,655,770	- -	1.68
13	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	2,809	22,906.45 64,344,223	23,891.69 67,111,785	- -	1.49
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	14,199	4,654.33 66,086,841	4,695.28 66,668,392	- -	1.48
15	SEGRO PLC イギリス	投資証券	29,447	2,124.87 62,571,082	2,148.36 63,262,844	- -	1.41
16	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	2,789	22,310.29 62,223,418	22,384.24 62,429,666	- -	1.39
17	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証券	9,055	6,677.16 60,461,695	6,763.62 61,244,637	- -	1.36

18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,551	39,525.97 61,304,784	39,421.30 61,142,444	- -	1.36
19	VENTAS INC アメリカ	投資証券	9,569	5,842.08 55,902,954	5,588.38 53,475,231	- -	1.19
20	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	13,480	3,892.07 52,465,126	3,875.00 52,235,083	- -	1.16
21	LINK REIT 香港	投資証券	49,900	1,042.45 52,018,529	1,002.33 50,016,416	- -	1.11
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	15,243	3,237.89 49,355,221	3,200.35 48,782,936	- -	1.08
23	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	2,381	18,914.26 45,034,859	19,210.06 45,739,163	- -	1.02
24	UDR INC アメリカ	投資証券	6,831	6,388.18 43,637,695	6,538.36 44,663,550	- -	0.99
25	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	3,420	13,304.26 45,500,582	12,553.38 42,932,565	- -	0.95
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	4,242	9,645.42 40,915,874	9,649.97 40,935,178	- -	0.91
27	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	15,098	2,715.68 41,001,486	2,648.56 39,988,043	- -	0.89
28	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	4,436	8,809.21 39,077,660	8,959.38 39,743,842	- -	0.88
29	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	6,992	5,302.81 37,077,315	5,331.26 37,276,185	- -	0.83
30	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC アメリカ	投資証券	14,465	2,465.39 35,661,951	2,444.91 35,365,728	- -	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	外国		98.19
	小計		98.19
合計(対純資産総額比)			98.19

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年11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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	116,000	2,530.46 293,533,684	2,428.09 281,659,344	- -	6.53
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・ 娯楽	27,100	7,236.64 196,112,944	6,746.41 182,827,873	- -	4.24

3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	22,518	6,820.95 153,594,377	6,926.33 155,967,324	- -	3.61
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 小売	71,600	2,032.38 145,518,909	1,896.70 135,803,720	- -	3.15
5	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	30,012	4,893.24 146,856,149	4,498.46 135,007,955	- -	3.13
6	MEITUAN-B 香港	株式 小売	19,300	4,096.87 79,069,629	3,574.55 68,988,815	- -	1.60
7	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	13,471	3,784.14 50,976,271	3,735.49 50,320,853	- -	1.17
8	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	15,968	2,722.48 43,472,592	2,595.41 41,443,594	- -	0.96
9	JD.COM INC-ADR ケイマン諸島	株式 小売	4,125	10,415.64 42,964,529	10,001.52 41,256,272	- -	0.96
10	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	21,408	1,891.08 40,484,345	1,848.76 39,578,307	- -	0.92
11	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 銀行	8,182	4,475.86 36,621,502	4,152.11 33,972,596	- -	0.79
12	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	458,000	76.01 34,814,366	73.97 33,878,855	- -	0.79
13	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	14,403	2,406.23 34,657,009	2,296.21 33,072,454	- -	0.77
14	NIO INC - ADR アメリカ	株式 自動車・自動車部品	6,457	4,398.34 28,400,134	4,603.13 29,722,437	- -	0.69
15	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	7,000	4,463.11 31,241,798	4,217.43 29,522,066	- -	0.68
16	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	2,647	10,681.69 28,274,459	11,112.79 29,415,581	- -	0.68

17	PJSC GAZPROM ADR ロシア	株式 エネルギー	27,971	1,035.76 28,971,300	1,028.02 28,754,906	- -	0.67
18	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信託受益証券 -	6,935	4,119.61 28,569,507	3,931.20 27,262,931	- -	0.63
19	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC 香港	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	17,500	1,613.65 28,238,945	1,552.37 27,166,580	- -	0.63
20	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	24,484	1,167.23 28,578,630	1,099.15 26,911,637	- -	0.62
21	VALE SA ブラジル	株式 素材	18,867	1,299.07 24,509,603	1,410.05 26,603,427	- -	0.62
22	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	60,200	436.07 26,251,708	423.79 25,512,224	- -	0.59
23	NETEASE.COM INC -ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	2,021	13,146.12 26,568,315	12,528.35 25,319,800	- -	0.59
24	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	30,500	836.73 25,520,463	810.47 24,719,472	- -	0.57
25	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,832	6,341.95 24,302,390	6,303.63 24,155,548	- -	0.56
26	SBERBANK PAO -SPONSORED ADR ロシア	株式 銀行	12,460	2,013.16 25,083,975	1,914.74 23,857,773	- -	0.55
27	BAIDU INC - SPON ADR ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	1,391	17,266.87 24,018,220	17,098.49 23,784,004	- -	0.55
28	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	4,355	5,317.82 23,159,110	5,358.05 23,334,351	- -	0.54
29	NAVER CORP 韓国	株式 メディア・娯楽	592	38,703.19 22,912,294	37,026.69 21,919,806	- -	0.51

30	LUKOIL PJSC-SPON ADR ロシア	株式 エネルギー	2,064	10,323.48 21,307,682	10,059.54 20,762,897	- -	0.48
----	-----------------------------	-------------	-------	-------------------------	-------------------------	--------	------

（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11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	銀行	10.54
		半導体・半導体製造装置	9.23
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.80
		メディア・娯楽	7.37
		小売	7.35
		素材	6.80
		エネルギー	4.87
		自動車・自動車部品	3.88
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.17
		食品・飲料・タバコ	3.13
		ソフトウェア・サービス	2.76
		資本財	2.46
		保険	2.36
		各種金融	2.24
		電気通信サービス	2.08
		公益事業	1.70
		不動産	1.65
		耐久消費財・アパレル	1.51
		運輸	1.35
		食品・生活必需品小売り	1.06
消費者サービス	0.87		
家庭用品・パーソナル用品	0.78		
ヘルスケア機器・サービス	0.76		
商業・専門サービス	0.05		
その他	0.02		
	小計		85.78
公社債券	外国	社債券	0.00
	小計		0.00
投資信託受益証券	外国		5.44
	小計		5.44
投資証券	外国		0.04
	小計		0.04
合 計（対純資産総額比）			91.26

（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。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。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2021年11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	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	45,508,000	126.68 57,650,899	125.79 57,247,698	5.25 2047/6/23	4.48
2	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	22,754,000	137.94 31,388,915	137.58 31,307,228	6.375 2034/10/23	2.45
3	CROATIA クロアチア	国債証券	27,304,800	110.56 30,188,732	110.14 30,073,779	6 2024/1/26	2.35
4	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	123.45 28,090,723	122.18 27,802,202	5.25 2042/1/17	2.18
5	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	122.58 27,892,763	121.22 27,583,308	5.125 2045/1/15	2.16
6	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	22,754,000	118.60 26,988,064	117.32 26,696,585	5.1 2035/3/28	2.09
7	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	116.26 26,455,165	115.90 26,374,161	4.75 2029/2/11	2.06
8	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	112.27 25,546,370	112.01 25,487,210	4.75 2026/1/8	2.00
9	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	113.19 25,757,300	111.84 25,449,666	4.35 2048/1/11	1.99
10	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	112.77 25,661,733	111.24 25,313,142	4.75 2032/4/27	1.98
11	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	112.40 25,575,951	110.99 25,256,484	4.2 2050/10/15	1.98
12	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	22,754,000	111.85 25,450,804	110.50 25,143,397	4.375 2029/3/21	1.97
13	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	110.87 25,228,725	110.14 25,063,303	4.15 2027/3/28	1.96
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	22,754,000	111.37 25,342,267	110.00 25,029,400	5.875 2025/9/16	1.96
15	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	22,754,000	111.07 25,274,233	109.98 25,026,441	4.75 2026/5/27	1.96
16	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	112.87 25,682,667	109.96 25,021,663	5 2051/4/27	1.96
17	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券	22,754,000	109.93 25,015,520	108.37 24,659,419	4.25 2027/6/23	1.93
18	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	22,754,000	108.39 24,664,653	108.09 24,595,708	3.5 2028/1/11	1.93
19	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券	18,203,200	136.98 24,935,471	134.45 24,475,658	5.625 2050/11/18	1.92
20	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証券	22,754,000	108.45 24,677,850	107.29 24,413,904	3.875 2028/3/17	1.91
21	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	22,754,000	107.31 24,418,682	106.67 24,273,284	3.7 2042/2/2	1.90

22	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	107.21 24,395,701	106.43 24,217,537	3.6 2025/1/30	1.90
23	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	22,754,000	106.21 24,168,843	106.07 24,136,988	3 2028/2/1	1.89
24	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証券	22,754,000	109.54 24,926,551	105.98 24,115,144	4.5 2056/4/1	1.89
25	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	106.51 24,235,740	103.85 23,632,076	4.6 2048/2/10	1.85
26	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	105.25 23,949,950	102.54 23,332,861	4.5 2050/1/31	1.83
27	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	22,754,000	102.76 23,383,375	101.90 23,188,373	4.625 2028/1/13	1.82
28	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	22,754,000	102.62 23,351,292	101.48 23,091,214	3.25 2030/4/16	1.81
29	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	22,754,000	100.81 22,939,672	99.00 22,526,460	4.3 2028/10/12	1.76
30	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券	22,754,000	99.76 22,699,617	98.36 22,381,744	2.783 2031/1/23	1.75

(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11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	97.63
	小計		97.63
合計(対純資産総額比)			97.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年11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 0 312月	買建	246	4,953,330,300	4,664,160,000	4.11

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年11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 202112	買建	347	9,258,936,514	9,180,653,084	1.82
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 202112	買建	417	2,318,621,039	2,198,638,588	0.44
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202112	買建	82	901,507,676	884,246,508	0.17

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年11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	NYSE LIFE EUS	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202112	買建	53	380,126,446	365,255,740	8.46

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

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

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2021年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	123,377,684	123,377,684	1.0166	1.0166
第2計算期間末 (2019年11月20日)	240,300,010	240,300,010	1.1250	1.1250
第3計算期間末 (2020年11月20日)	292,325,819	292,325,819	1.1316	1.1316
第4計算期間末 (2021年11月22日)	442,125,000	442,125,000	1.3536	1.3536
2020年11月末日	294,799,222	-	1.1422	-
12月末日	311,892,232	-	1.1667	-
2021年1月末日	317,744,196	-	1.1886	-
2月末日	315,696,807	-	1.2138	-
3月末日	334,558,504	-	1.2586	-
4月末日	348,020,484	-	1.2763	-
5月末日	360,036,185	-	1.2913	-
6月末日	386,948,425	-	1.3148	-
7月末日	395,398,821	-	1.3085	-
8月末日	416,299,767	-	1.3223	-
9月末日	416,059,144	-	1.3127	-
10月末日	434,726,847	-	1.3506	-
11月末日	435,497,125	-	1.3246	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.7
第2計算期間	10.7
第3計算期間	0.6
第4計算期間	19.6

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

（4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	155,808,418	34,441,297	121,367,121
第2計算期間	186,191,794	93,957,053	213,601,862
第3計算期間	139,113,792	94,394,937	258,320,717
第4計算期間	121,867,494	53,556,365	326,631,846

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 参考情報 >

3.運用実績

2021年11月末現在

●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	13,246円
純資産総額	435百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

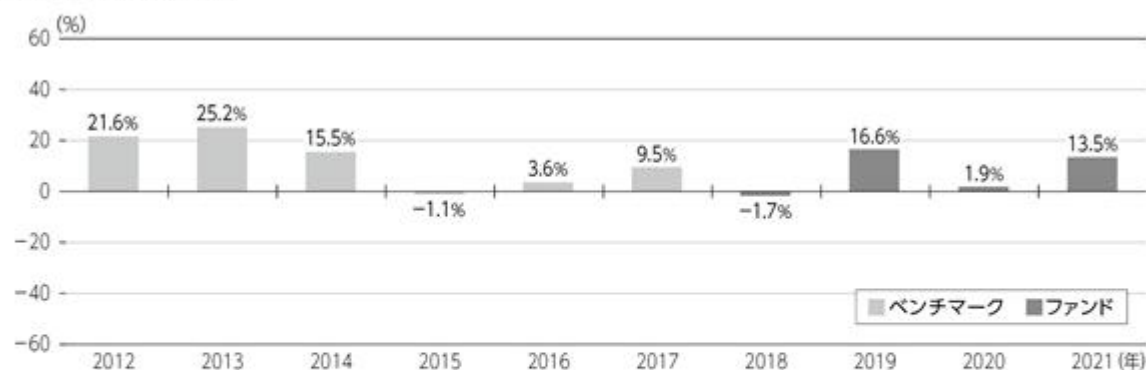
2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

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

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2021年11月末現在

3.運用実績

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.8%
2	ソニーグループ	3.3%
3	キーエンス	2.4%
4	リクルートホールディングス	1.9%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.4%

・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	4.6%
2	マイクロソフト	情報技術	4.2%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.8%
4	テスラ	一般消費財・サービス	1.7%
5	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.5%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

3. ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	7.2%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	4.6%
3	サムスン電子	情報技術	4.0%
4	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	3.4%
5	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	3.4%

・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&PおよびMSCI Inc.に帰属します。

・比率は対組入株式等評価額比です。「その他」にはETFを含みます。

4. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第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363回 利付国債(10年)	2031/06/20	0.100%	0.8%
4	第429回 利付国債(2年)	2023/10/01	0.005%	0.8%
5	第338回 利付国債(10年)	2025/03/20	0.400%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	19.8%
2	情報・通信業	8.6%
3	輸送用機器	8.1%
4	化学	6.8%
5	サービス業	6.4%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	74.1%
2	イギリス	4.2%
3	カナダ	3.5%
4	フランス	3.3%
5	スイス	3.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	34.2%
2	台湾	15.1%
3	韓国	12.5%
4	インド	12.3%
5	その他	6.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	—
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2021年11月末現在

5. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2024/05/15	2.500%	1.2%
2	アメリカ国債	米ドル	2024/02/15	2.750%	1.0%
3	アメリカ国債	米ドル	2023/08/15	2.500%	0.9%
4	アメリカ国債	米ドル	2023/05/15	1.750%	0.9%
5	アメリカ国債	米ドル	2023/09/15	0.125%	0.9%

・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	47.1%
2	フランス	10.0%
3	イタリア	9.1%
4	ドイツ	7.3%
5	イギリス	6.2%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

6. ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	ロシア国債	米ドル	2047/06/23	5.250%	4.6%
2	フィリピン国債	米ドル	2034/10/23	6.375%	2.5%
3	クロアチア国債	米ドル	2024/01/26	6.000%	2.4%
4	インドネシア国債	米ドル	2042/01/17	5.250%	2.2%
5	インドネシア国債	米ドル	2045/01/15	5.125%	2.2%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	メキシコ	18.2%
2	インドネシア	14.6%
3	ロシア	13.3%
4	ブラジル	10.5%
5	フィリピン	10.4%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

7. ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.0%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.3%
4	GLP投資法人	5.3%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.8%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.4%
短期金融資産等	1.6%

・比率は対純資産総額比です。

8. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	7.1%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.6%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.3%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.1%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	76.5%
2	オーストラリア	6.9%
3	イギリス	5.8%
4	シンガポール	3.3%
5	カナダ	1.9%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

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

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

換金受付

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

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

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

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限です。

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

繰上償還

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

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

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

約款の変更等

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

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2020年11月21日から2021年11月22日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,084	2,246
コール・ローン	237,606	339,470
親投資信託受益証券	292,327,222	442,131,426
未収入金	9,114,208	1,431,403
流動資産合計	301,680,120	443,904,545
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,104,171	1,416,477
未払受託者報酬	31,247	45,369
未払委託者報酬	217,422	315,522
その他未払費用	1,461	2,177
流動負債合計	9,354,301	1,779,545
負債合計	9,354,301	1,779,545
純資産の部		
元本等		
元本	258,320,717	326,631,846
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	34,005,102	115,493,154
(分配準備積立金)	18,952,743	71,782,270
元本等合計	292,325,819	442,125,000
純資産合計	292,325,819	442,125,000
負債純資産合計	301,680,120	443,904,545

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2019年11月21日 至 2020年11月20日	自	2020年11月21日 至 2021年11月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,947,805		62,284,401
営業収益合計		4,947,805		62,284,401
営業費用				
受託者報酬		58,864		80,509
委託者報酬		409,606		560,002
その他費用		2,764		3,839
営業費用合計		471,234		644,350
営業利益又は営業損失（ ）		4,476,571		61,640,051
経常利益又は経常損失（ ）		4,476,571		61,640,051
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,476,571		61,640,051
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（ ）		2,893,521		5,520,121
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		26,698,148		34,005,102
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,926,163		33,298,500
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		10,926,163		33,298,500
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,989,301		7,930,378
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,989,301		7,930,378
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（ ）		34,005,102		115,493,154

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	
	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年11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、2020年11月21日から2021年11月22日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期
	2020年11月20日現在	
1. 期首元本額	213,601,862円	258,320,717円
期中追加設定元本額	139,113,792円	121,867,494円
期中一部解約元本額	94,394,937円	53,556,365円
2. 受益権の総数	258,320,717口	326,631,846口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年11月21日 至 2020年11月20日	
	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日	
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(7,370,085円)、収益調整金(15,052,359円)及び分配準備積立金(11,582,658円)より分配対象収益は34,005,102円(1万口当たり1,316.39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(56,119,930円)、収益調整金(43,710,884円)及び分配準備積立金(15,662,340円)より分配対象収益は115,493,154円(1万口当たり3,535.88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）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	第4期
	自 2019年11月21日 至 2020年11月20日	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、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。	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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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。	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	10,866,321	51,386,542
合計	10,866,321	51,386,542

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期 2021年11月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1316円 (11,316円)	1,3536円 (13,536円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	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	24,032,183	55,103,392	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	36,185,694	55,038,440	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	18,791,742	55,482,618	
	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	28,228,485	54,633,409	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	56,352,722	55,428,537	
	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	38,438,254	55,247,302	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	45,330,698	55,498,373	
	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	44,205,838	55,699,355	
親投資信託受益証券 合計		291,565,616	442,131,426	
合計			442,131,426	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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11月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,328,489
コール・ローン	1,259,017,269
株式	115,648,485,140
派生商品評価勘定	25,986,650
未収入金	10,941,559,100
未収配当金	1,302,673,541
差入委託証拠金	182,850,000
流動資産合計	129,368,900,189
資産合計	
負債の部	
流動負債	
前受金	48,480,000
未払金	38,645,100
未払解約金	9,616,058,774
その他未払費用	3,249
流動負債合計	9,703,187,123
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	52,189,089,554
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	67,476,623,512
元本等合計	119,665,713,066
純資産合計	
負債純資産合計	
129,368,900,189	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22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11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,797,703,529円
同期中追加設定元本額	22,635,548,105円
同期中一部解約元本額	51,244,162,080円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,818,839,727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)	3,611,745,342円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,584,242円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,990,833,199円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,782,946,869円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,046,092,719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)	3,858,339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)	19,278,584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)	20,056,017円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,045,969,139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	20,264,104,361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)	1,850,681,197円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	177,743,758円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	185,894,961円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	197,316,755円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	420,167,790円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	61,557,909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)	83,246,186円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,088,654円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	9,357,908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)	3,488,696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)	5,931,944円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	24,032,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	116,171,721円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	81,387,246円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	172,610,529円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	184,868,914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)	3,979,672,502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)	20,369,721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)	61,987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)	130,455円
計	52,189,089,554円
2. 受益権の総数	52,189,089,554口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	6,145,255,613	
合計	6,145,255,613	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年2月23日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年11月22日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,003,540,000	-	4,029,635,000	26,095,000
合計	4,003,540,000	-	4,029,635,000	26,095,000

（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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2929円 (22,929円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年11月22日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	2,000	3,045.00	6,090,000	
日本水産	56,100	601.00	33,716,100	
マルハニチロ	8,800	2,376.00	20,908,800	
雪国まいたけ	4,100	1,319.00	5,407,900	
カネコ種苗	2,000	1,414.00	2,828,000	
サカタのタネ	6,700	3,245.00	21,741,500	
ホクト	4,700	1,915.00	9,000,500	
ヒノキヤグループ	1,300	2,230.00	2,899,000	
ショーボンドホールディングス	8,000	5,030.00	40,240,000	

ミライト・ホールディングス	18,100	2,040.00	36,924,000
タマホーム	3,400	2,321.00	7,891,400
ファーストコーポレーション	3,900	756.00	2,948,400
スペースバリューホールディングス	5,900	1,146.00	6,761,400
住石ホールディングス	9,900	137.00	1,356,300
日鉄鉱業	1,300	6,490.00	8,437,000
三井松島ホールディングス	2,300	1,375.00	3,162,500
I N P E X	225,100	920.00	207,092,000
石油資源開発	6,600	2,255.00	14,883,000
K & O エナジーグループ	2,700	1,520.00	4,104,000
安藤・間	30,800	882.00	27,165,600
東急建設	16,400	684.00	11,217,600
コムシスホールディングス	18,100	2,706.00	48,978,600
ビーアールホールディングス	7,600	384.00	2,918,400
高松コンストラクショングループ	3,500	1,932.00	6,762,000
東建コーポレーション	1,700	9,270.00	15,759,000
ソネック	2,900	1,010.00	2,929,000
ヤマウラ	3,200	938.00	3,001,600
オリエンタル白石	18,900	242.00	4,573,800
大成建設	37,400	3,545.00	132,583,000
大林組	129,600	895.00	115,992,000
清水建設	121,400	747.00	90,685,800
飛鳥建設	3,500	1,030.00	3,605,000
長谷工コーポレーション	38,600	1,431.00	55,236,600
松井建設	5,100	744.00	3,794,400
銭高組	800	3,810.00	3,048,000
鹿島建設	94,900	1,333.00	126,501,700
不動テトラ	2,700	1,709.00	4,614,300
鉄建建設	2,800	1,793.00	5,020,400
西松建設	7,800	3,430.00	26,754,000
三井住友建設	29,200	414.00	12,088,800
大豊建設	1,900	3,720.00	7,068,000
佐田建設	6,100	483.00	2,946,300
ナカノフドー建設	8,700	346.00	3,010,200
奥村組	7,600	3,250.00	24,700,000
東鉄工業	6,000	2,366.00	14,196,000
浅沼組	1,500	5,500.00	8,250,000
戸田建設	53,800	709.00	38,144,200
熊谷組	6,600	2,718.00	17,938,800
北野建設	1,400	2,108.00	2,951,200
植木組	2,100	1,431.00	3,005,100
矢作建設工業	5,700	723.00	4,121,100
ピーエス三菱	4,700	625.00	2,937,500
日本ハウスホールディングス	8,800	382.00	3,361,600
大東建託	13,300	13,320.00	177,156,000
新日本建設	5,500	838.00	4,609,000
N I P P O	10,700	4,035.00	43,174,500
東亜道路工業	700	4,860.00	3,402,000
日本道路	1,300	7,910.00	10,283,000
東亜建設工業	3,200	2,492.00	7,974,400

日本国土開発	12,600	576.00	7,257,600
若築建設	2,200	2,037.00	4,481,400
東洋建設	14,500	561.00	8,134,500
五洋建設	51,400	708.00	36,391,200
世紀東急工業	6,200	815.00	5,053,000
福田組	1,400	4,155.00	5,817,000
住友林業	33,200	2,442.00	81,074,400
日本基礎技術	1,000	552.00	552,000
バコーポレーション	6,800	443.00	3,012,400
大和ハウス工業	119,600	3,451.00	412,739,600
ライト工業	8,200	2,034.00	16,678,800
積水ハウス	140,500	2,394.50	336,427,250
日特建設	4,300	683.00	2,936,900
北陸電気工事	2,900	1,001.00	2,902,900
ユアテック	7,400	632.00	4,676,800
日本リーテック	2,700	1,451.00	3,917,700
四電工	1,800	1,588.00	2,858,400
中電工	6,000	2,118.00	12,708,000
関電工	21,100	846.00	17,850,600
きんでん	28,900	1,745.00	50,430,500
東京エネシス	4,300	1,094.00	4,704,200
トーエネック	1,300	3,140.00	4,082,000
住友電設	3,200	2,011.00	6,435,200
日本電設工業	7,100	1,632.00	11,587,200
エクシオグループ	19,600	2,562.00	50,215,200
新日本空調	3,400	2,281.00	7,755,400
日本工営	2,300	3,490.00	8,027,000
九電工	10,000	3,535.00	35,350,000
三機工業	8,400	1,426.00	11,978,400
日揮ホールディングス	39,900	1,052.00	41,974,800
中外炉工業	1,700	1,689.00	2,871,300
ヤマト	3,800	787.00	2,990,600
太平電業	2,900	2,680.00	7,772,000
高砂熱学工業	11,700	1,994.00	23,329,800
三晃金属工業	1,200	2,421.00	2,905,200
NEC ネットエスアイ	13,400	1,917.00	25,687,800
朝日工業社	900	3,125.00	2,812,500
明星工業	8,400	665.00	5,586,000
大気社	6,300	2,981.00	18,780,300
ダイダン	2,900	2,207.00	6,400,300
日比谷総合設備	4,200	1,856.00	7,795,200
ニッポン	12,100	1,602.00	19,384,200
日清製粉グループ本社	46,900	1,720.00	80,668,000
昭和産業	3,900	2,768.00	10,795,200
鳥越製粉	4,000	745.00	2,980,000
中部飼料	4,700	1,020.00	4,794,000
フィード・ワン	5,600	750.00	4,200,000
日本甜菜製糖	2,200	1,632.00	3,590,400
DM三井製糖ホールディングス	3,800	1,955.00	7,429,000
塩水港精糖	13,500	216.00	2,916,000

日新製糖	2,000	1,666.00	3,332,000
L I F U L L	12,100	270.00	3,267,000
ミクシィ	9,000	2,280.00	20,520,000
ジェイエイシーリクルートメント	3,200	2,211.00	7,075,200
日本M&Aセンターホールディングス	64,800	3,645.00	236,196,000
メンバーズ	1,200	2,469.00	2,962,800
UTグループ	5,700	4,480.00	25,536,000
アイティメディア	1,900	2,197.00	4,174,300
夢真ビーネックスグループ	10,500	1,740.00	18,270,000
コシダカホールディングス	10,600	664.00	7,038,400
アルトナー	3,400	837.00	2,845,800
パソナグループ	4,300	3,650.00	15,695,000
C D S	1,800	1,618.00	2,912,400
リンクアンドモチベーション	8,700	884.00	7,690,800
エス・エム・エス	13,400	4,565.00	61,171,000
サニーサイドアップグループ	3,800	772.00	2,933,600
パーソルホールディングス	39,500	3,555.00	140,422,500
クックパッド	12,400	270.00	3,348,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,400	659.00	2,899,600
森永製菓	9,700	3,930.00	38,121,000
中村屋	1,000	3,705.00	3,705,000
江崎グリコ	11,400	3,700.00	42,180,000
名糖産業	1,900	1,720.00	3,268,000
井村屋グループ	2,400	2,305.00	5,532,000
不二家	2,300	2,303.00	5,296,900
山崎製パン	31,100	1,581.00	49,169,100
モロゾフ	700	5,530.00	3,871,000
亀田製菓	2,400	4,385.00	10,524,000
寿スピリッツ	4,000	7,190.00	28,760,000
カルビー	18,900	2,726.00	51,521,400
森永乳業	7,700	5,770.00	44,429,000
六甲バター	3,000	1,618.00	4,854,000
ヤクルト本社	30,700	5,970.00	183,279,000
明治ホールディングス	27,400	7,030.00	192,622,000
雪印メグミルク	10,000	2,049.00	20,490,000
プリマハム	5,200	2,556.00	13,291,200
日本ハム	15,800	3,890.00	61,462,000
林兼産業	5,200	560.00	2,912,000
丸大食品	4,100	1,522.00	6,240,200
S F o o d s	3,700	3,385.00	12,524,500
柿安本店	1,400	2,680.00	3,752,000
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	659.00	17,595,300
学情	2,200	1,235.00	2,717,000
スタジオアリス	1,800	2,167.00	3,900,600
シミックホールディングス	2,200	1,587.00	3,491,400
システナ	14,500	2,097.00	30,406,500
N J S	1,500	1,984.00	2,976,000
デジタルアーツ	2,200	10,500.00	23,100,000
日鉄ソリューションズ	5,900	3,580.00	21,122,000
総合警備保障	15,700	5,080.00	79,756,000

キューブシステム	3,000	994.00	2,982,000	
いちご	45,400	310.00	14,074,000	
日本駐車場開発	44,700	141.00	6,302,700	
コア	1,800	1,677.00	3,018,600	
カカクコム	29,200	3,635.00	106,142,000	
アイロムグループ	1,600	1,827.00	2,923,200	
セントケア・ホールディング	3,600	815.00	2,934,000	
ルネサンス	2,700	1,287.00	3,474,900	
ディップ	6,900	4,590.00	31,671,000	
SBSホールディングス	3,100	3,590.00	11,129,000	
デジタルホールディングス	2,700	1,508.00	4,071,600	
新日本科学	4,800	1,742.00	8,361,600	
ベネフィット・ワン	14,400	5,600.00	80,640,000	
エムスリー	69,700	6,476.00	451,377,200	
ツカダ・グローバルホールディング	9,200	317.00	2,916,400	
アウトソーシング	22,600	1,553.00	35,097,800	
ウェルネット	5,800	495.00	2,871,000	
ワールドホールディングス	1,600	2,708.00	4,332,800	
ディー・エヌ・エー	15,000	1,801.00	27,015,000	
博報堂DYホールディングス	55,000	1,778.00	97,790,000	
ぐるなび	6,500	554.00	3,601,000	
ファンコミュニケーションズ	9,900	424.00	4,197,600	
ビジネス・ブレークスルー	6,400	450.00	2,880,000	
エスプール	11,100	1,286.00	14,274,600	
WDBホールディングス	1,800	3,375.00	6,075,000	
手間いらず	500	6,040.00	3,020,000	
アドウェイズ	5,900	868.00	5,121,200	
バリューコマース	3,100	5,010.00	15,531,000	
インフォマート	43,300	1,060.00	45,898,000	
サッポロホールディングス	14,200	2,302.00	32,688,400	
アサヒグループホールディングス	97,600	4,546.00	443,689,600	
キリンホールディングス	152,400	1,865.50	284,302,200	
宝ホールディングス	28,200	1,350.00	38,070,000	
オエノンホールディングス	11,800	370.00	4,366,000	
養命酒製造	1,600	1,799.00	2,878,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	29,100	1,442.00	41,962,200	
サントリー食品インターナショナル	27,700	4,430.00	122,711,000	
ダイドーグループホールディングス	2,100	5,290.00	11,109,000	
伊藤園	12,600	7,550.00	95,130,000	
キーコーヒー	4,100	2,017.00	8,269,700	
日清オイリオグループ	5,200	2,930.00	15,236,000	
不二製油グループ本社	9,000	2,432.00	21,888,000	
J-オイルミルズ	3,900	1,721.00	6,711,900	
ローソン	9,000	5,850.00	52,650,000	
サンエー	3,100	4,210.00	13,051,000	
カワチ薬品	3,200	2,270.00	7,264,000	
エービーシー・マート	6,400	5,540.00	35,456,000	
ハードオフコーポレーション	3,900	747.00	2,913,300	
アスクル	6,600	1,570.00	10,362,000	

ゲオホールディングス	5,400	1,200.00	6,480,000
アダストリア	4,400	1,987.00	8,742,800
オルパヘルスケアホールディングス	1,900	1,577.00	2,996,300
伊藤忠食品	1,000	5,090.00	5,090,000
くら寿司	4,200	3,970.00	16,674,000
キャンドウ	1,900	2,318.00	4,404,200
エレマテック	3,300	1,021.00	3,369,300
アイケイ	6,200	473.00	2,932,600
パルグループホールディングス	3,600	1,602.00	5,767,200
JALUX	1,200	2,555.00	3,066,000
エディオン	18,700	1,044.00	19,522,800
あらた	3,200	4,100.00	13,120,000
サーラコーポレーション	8,300	613.00	5,087,900
トーメンデバイス	600	7,290.00	4,374,000
ハローズ	1,900	2,767.00	5,257,300
J Pホールディングス	11,100	258.00	2,863,800
フジオフードグループ本社	3,400	1,418.00	4,821,200
あみやき亭	1,000	2,982.00	2,982,000
東京エレクトロン デバイス	1,200	7,340.00	8,808,000
双日	45,000	1,690.00	76,050,000
アルフレッサ ホールディングス	45,200	1,592.00	71,958,400
大黒天物産	1,300	6,500.00	8,450,000
ハニーズホールディングス	3,200	1,073.00	3,433,600
キッコーマン	29,800	9,370.00	279,226,000
味の素	91,600	3,492.00	319,867,200
ブルドックソース	1,700	2,147.00	3,649,900
キューピー	21,800	2,464.00	53,715,200
ハウス食品グループ本社	15,500	2,981.00	46,205,500
カゴメ	15,700	2,933.00	46,048,100
アリアケジャパン	3,800	6,690.00	25,422,000
ピエトロ	1,600	1,786.00	2,857,600
ニチレイ	19,800	2,669.00	52,846,200
横浜冷凍	11,400	842.00	9,598,800
東洋水産	19,900	4,715.00	93,828,500
イートアンドホールディングス	1,600	2,184.00	3,494,400
大冷	1,500	1,937.00	2,905,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,000	725.00	2,900,000
日清食品ホールディングス	16,300	8,680.00	141,484,000
永谷園ホールディングス	1,800	1,920.00	3,456,000
一正蒲鉾	3,200	902.00	2,886,400
フジッコ	4,500	1,917.00	8,626,500
ロック・フィールド	4,500	1,532.00	6,894,000
日本たばこ産業	222,300	2,309.00	513,290,700
ケンコーマヨネーズ	2,300	1,353.00	3,111,900
わらべや日洋ホールディングス	2,700	1,991.00	5,375,700
なとり	2,300	1,926.00	4,429,800
ピクルスコーポレーション	2,000	1,851.00	3,702,000
ファーマフーズ	3,900	2,606.00	10,163,400
北の達人コーポレーション	14,500	395.00	5,727,500
ユーグレナ	21,100	921.00	19,433,100

紀文食品	2,800	1,065.00	2,982,000
スター・マイカ・ホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600
S R Eホールディングス	1,000	10,190.00	10,190,000
A Dワークスグループ	18,400	160.00	2,944,000
片倉工業	4,500	2,200.00	9,900,000
ゲンゼ	2,700	4,170.00	11,259,000
ヒューリック	97,300	1,127.00	109,657,100
ラサ商事	3,200	919.00	2,940,800
アルペン	3,100	2,334.00	7,235,400
ハブ	4,000	716.00	2,864,000
ラクーンホールディングス	2,900	1,682.00	4,877,800
クオールホールディングス	5,000	1,456.00	7,280,000
アルコニックス	4,300	1,586.00	6,819,800
神戸物産	31,600	4,155.00	131,298,000
ソリトンシステムズ	2,300	1,293.00	2,973,900
ジーンズホールディングス	2,800	7,100.00	19,880,000
ビックカメラ	24,100	990.00	23,859,000
D C Mホールディングス	25,100	1,092.00	27,409,200
ハイパー	5,300	556.00	2,946,800
M o n o t a R O	51,400	2,365.00	121,561,000
東京一番フーズ	4,900	597.00	2,925,300
あい ホールディングス	5,800	2,052.00	11,901,600
ディー・ブイエックス	2,700	1,066.00	2,878,200
アークランドサービスホールディングス	3,000	2,293.00	6,879,000
J . フロント リテイリング	48,600	1,013.00	49,231,800
ドトール・日レスホールディングス	7,000	1,604.00	11,228,000
マツキヨココカラ&カンパニー	25,000	4,690.00	117,250,000
ブロンコビリー	2,300	2,438.00	5,607,400
Z O Z O	28,000	3,910.00	109,480,000
トレジャー・ファクトリー	3,100	970.00	3,007,000
物語コーポレーション	2,200	7,700.00	16,940,000
三越伊勢丹ホールディングス	71,200	827.00	58,882,400
東洋紡	16,000	1,320.00	21,120,000
ユニチカ	11,100	306.00	3,396,600
富士紡ホールディングス	1,800	4,100.00	7,380,000
日清紡ホールディングス	25,300	854.00	21,606,200
倉敷紡績	3,500	1,891.00	6,618,500
ダイワボウホールディングス	19,800	2,044.00	40,471,200
日東紡績	6,100	3,000.00	18,300,000
トヨタ紡織	16,900	2,341.00	39,562,900
マクニカ・富士エレホールディングス	9,700	2,832.00	27,470,400
H a m e e	2,400	1,245.00	2,988,000
マーケットエンタープライズ	4,100	1,016.00	4,165,600
ラクト・ジャパン	1,400	2,545.00	3,563,000
ウエルシアホールディングス	21,500	4,320.00	92,880,000
クリエイトSDホールディングス	6,000	3,375.00	20,250,000
グリムス	1,800	2,961.00	5,329,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,100	805.00	5,715,500

八洲電機	3,200	913.00	2,921,600
メディアスホールディングス	3,100	950.00	2,945,000
レスターホールディングス	3,900	1,905.00	7,429,500
ジューテックホールディングス	2,600	1,119.00	2,909,400
丸善CHIホールディングス	7,900	375.00	2,962,500
OCHIホールディングス	2,300	1,294.00	2,976,200
TOKAIホールディングス	19,700	879.00	17,316,300
ミサワ	4,300	694.00	2,984,200
ティーライフ	2,000	1,470.00	2,940,000
Cominix	4,100	726.00	2,976,600
三洋貿易	4,100	1,001.00	4,104,100
シュッピン	3,400	1,059.00	3,600,600
オイシックス・ラ・大地	5,900	3,620.00	21,358,000
ウイン・パートナーズ	3,200	925.00	2,960,000
ネクステージ	8,200	2,265.00	18,573,000
ジョイフル本田	11,900	1,624.00	19,325,600
ホットランド	3,000	1,365.00	4,095,000
すかいらーくホールディングス	52,500	1,527.00	80,167,500
SFPホールディングス	2,000	1,444.00	2,888,000
綿半ホールディングス	3,100	1,237.00	3,834,700
日本毛織	12,200	920.00	11,224,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	11,800	1,028.00	12,130,400
三栄建築設計	1,700	1,741.00	2,959,700
野村不動産ホールディングス	21,100	2,681.00	56,569,100
三重交通グループホールディングス	8,300	478.00	3,967,400
サムティ	6,600	2,526.00	16,671,600
ディア・ライフ	5,200	550.00	2,860,000
コーセーアールイー	4,300	697.00	2,997,100
日本商業開発	2,600	1,797.00	4,672,200
プレサンスコーポレーション	5,300	1,735.00	9,195,500
日本管理センター	2,600	1,111.00	2,888,600
サンセイランディック	3,600	809.00	2,912,400
エストラスト	4,700	619.00	2,909,300
フージャースホールディングス	5,200	658.00	3,421,600
オープンハウス	12,900	7,030.00	90,687,000
東急不動産ホールディングス	120,000	643.00	77,160,000
飯田グループホールディングス	34,000	2,504.00	85,136,000
イーグランド	1,800	1,750.00	3,150,000
ムゲンエステート	5,800	504.00	2,923,200
帝国繊維	4,600	2,052.00	9,439,200
日本コークス工業	34,900	127.00	4,432,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	1,031.00	2,886,800
BENOS	2,100	3,090.00	6,489,000
あさひ	3,400	1,361.00	4,627,400
日本調剤	2,500	1,408.00	3,520,000
コスモス薬品	4,100	19,400.00	79,540,000
シップヘルスケアホールディングス	13,000	2,653.00	34,489,000
ソフトクリエイイトホールディングス	1,800	4,345.00	7,821,000
セブン&アイ・ホールディングス	159,200	4,777.00	760,498,400

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	21,700	710.00	15,407,000	
明治電機工業	2,300	1,308.00	3,008,400	
ツルハホールディングス	8,900	14,260.00	126,914,000	
サンマルクホールディングス	3,200	1,456.00	4,659,200	
フェリシモ	2,100	1,445.00	3,034,500	
トリドールホールディングス	10,100	2,479.00	25,037,900	
帝人	38,100	1,410.00	53,721,000	
東レ	293,000	718.30	210,461,900	
クラレ	59,200	1,019.00	60,324,800	
旭化成	268,200	1,135.50	304,541,100	
TOKYO BASE	3,700	790.00	2,923,000	
稲葉製作所	2,300	1,384.00	3,183,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,200	2,954.00	3,544,800	
トーカロ	10,500	1,617.00	16,978,500	
アルファ	2,400	1,201.00	2,882,400	
SUMCO	62,900	2,542.00	159,891,800	
川田テクノロジーズ	800	3,780.00	3,024,000	
RS Technologies	1,300	7,040.00	9,152,000	
ファーストブラザーズ	2,900	1,012.00	2,934,800	
ハウスドゥ	2,800	1,002.00	2,805,600	
ケイアイスター不動産	1,800	9,020.00	16,236,000	
グッドコムアセット	500	1,385.00	692,500	
ジェイ・エス・ビー	1,000	2,941.00	2,941,000	
日本フェルト	6,800	437.00	2,971,600	
芦森工業	3,000	957.00	2,871,000	
アツギ	4,400	681.00	2,996,400	
ウイルプラスホールディングス	3,000	895.00	2,685,000	
JMホールディングス	2,700	1,831.00	4,943,700	
コメダホールディングス	8,900	2,019.00	17,969,100	
アレザホールディングス	3,100	1,105.00	3,425,500	
バロックジャパンリミテッド	3,300	873.00	2,880,900	
クスリのアオキホールディングス	4,000	7,730.00	30,920,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	23,800	5,100.00	121,380,000	
アセンテック	2,400	1,280.00	3,072,000	
セーレン	8,300	2,306.00	19,139,800	
ソトー	3,400	860.00	2,924,000	
東海染工	2,600	1,139.00	2,961,400	
小松マテーレ	6,600	1,197.00	7,900,200	
ワコールホールディングス	10,100	2,115.00	21,361,500	
ホギメディカル	5,500	3,135.00	17,242,500	
クラウドシアホールディングス	10,400	279.00	2,901,600	
TSIホールディングス	13,500	362.00	4,887,000	
マツオカコーポレーション	700	1,421.00	994,700	
ワールド	5,300	1,297.00	6,874,100	
TIS	38,700	3,550.00	137,385,000	
グリー	24,900	1,044.00	25,995,600	
コーエーテクモホールディングス	12,900	5,070.00	65,403,000	
三菱総合研究所	1,700	3,925.00	6,672,500	

電算	1,300	2,387.00	3,103,100
A G S	3,400	872.00	2,964,800
ファインデックス	3,400	1,068.00	3,631,200
ブレインパッド	1,000	6,290.00	6,290,000
K L a b	7,400	683.00	5,054,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	1,028.00	6,065,200
イーブックイニシアティブジャパン	700	4,720.00	3,304,000
ネクソン	91,300	2,497.00	227,976,100
アイスタイル	12,400	313.00	3,881,200
エムアップホールディングス	1,200	4,580.00	5,496,000
エイチーム	2,800	1,255.00	3,514,000
エニグモ	4,400	1,047.00	4,606,800
テクノスジャパン	5,200	576.00	2,995,200
コロプラ	13,300	761.00	10,121,300
ブロードリーフ	20,100	527.00	10,592,700
デジタルハーツホールディングス	1,800	2,551.00	4,591,800
システム情報	3,000	1,027.00	3,081,000
メディアドゥ	1,400	5,110.00	7,154,000
じげん	11,500	347.00	3,990,500
ブイキューブ	4,100	1,260.00	5,166,000
サイバーリンクス	2,500	1,191.00	2,977,500
フィックスターズ	4,300	877.00	3,771,100
C A R T A H O L D I N G S	1,600	2,267.00	3,627,200
オブティム	2,800	1,643.00	4,600,400
セレス	1,500	2,496.00	3,744,000
S H I F T	2,000	29,470.00	58,940,000
特種東海製紙	2,500	4,190.00	10,475,000
ティーガイア	3,600	1,756.00	6,321,600
テクマトリックス	6,900	2,034.00	14,034,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11,000	2,840.00	31,240,000
G M O ペイメントゲートウェイ	7,900	16,670.00	131,693,000
ザッパラス	5,000	586.00	2,930,000
インターネットイニシアティブ	10,800	4,875.00	52,650,000
さくらインターネット	5,200	575.00	2,990,000
ヴィンクス	3,100	924.00	2,864,400
G M O グローバルサイン・ホールディングス	900	4,565.00	4,108,500
S R A ホールディングス	2,000	2,929.00	5,858,000
朝日ネット	4,400	673.00	2,961,200
e B A S E	4,800	683.00	3,278,400
アバント	4,300	1,413.00	6,075,900
アドソル日進	1,500	1,924.00	2,886,000
フリービット	2,400	1,298.00	3,115,200
コムチュア	4,500	3,430.00	15,435,000
サイバーコム	2,300	1,260.00	2,898,000
アステリア	1,100	929.00	1,021,900
アイル	2,200	1,663.00	3,658,600
王子ホールディングス	169,200	568.00	96,105,600

日本製紙	19,400	1,135.00	22,019,000
三菱製紙	5,700	331.00	1,886,700
北越コーポレーション	26,500	824.00	21,836,000
大王製紙	19,500	1,885.00	36,757,500
阿波製紙	7,900	385.00	3,041,500
マークライNZ	2,000	3,115.00	6,230,000
メディカル・データ・ビジョン	5,100	1,531.00	7,808,100
g u m i	5,600	888.00	4,972,800
テラスカイ	1,500	2,435.00	3,652,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	1,900	1,589.00	3,019,100
P R T I M E S	900	3,505.00	3,154,500
ラクス	13,900	3,620.00	50,318,000
ランドコンピュータ	3,400	856.00	2,910,400
ダブルスタンダード	1,200	4,355.00	5,226,000
オーブンドア	2,400	2,178.00	5,227,200
アカツキ	1,800	2,923.00	5,261,400
U b i c o mホールディングス	1,100	3,070.00	3,377,000
カナミックネットワーク	5,200	552.00	2,870,400
ノムラシステムコーポレーション	11,100	267.00	2,963,700
レンゴー	38,200	820.00	31,324,000
トーモク	2,500	1,870.00	4,675,000
ザ・バック	3,100	2,832.00	8,779,200
チェンジ	7,500	2,539.00	19,042,500
シンクロ・フード	7,300	412.00	3,007,600
オークネット	2,200	1,818.00	3,999,600
キャピタル・アセット・プランニング	3,500	795.00	2,782,500
マクロミル	8,300	920.00	7,636,000
ビーグリー	1,600	1,791.00	2,865,600
オロ	1,300	3,725.00	4,842,500
ユーザーローカル	1,500	1,907.00	2,860,500
マネーフォワード	6,100	8,500.00	51,850,000
昭和電工	35,100	2,676.00	93,927,600
住友化学	297,300	556.00	165,298,800
住友精化	1,800	3,135.00	5,643,000
日産化学	22,000	7,150.00	157,300,000
ラサ工業	1,600	1,797.00	2,875,200
クレハ	3,200	8,460.00	27,072,000
多木化学	1,600	6,050.00	9,680,000
テイカ	3,000	1,235.00	3,705,000
石原産業	6,700	1,325.00	8,877,500
片倉コープアグリ	900	1,164.00	1,047,600
日本曹達	5,200	3,310.00	17,212,000
東ソー	58,400	1,761.00	102,842,400
トクヤマ	12,900	1,941.00	25,038,900
セントラル硝子	6,600	2,104.00	13,886,400
東亜合成	23,000	1,255.00	28,865,000
大阪ソーダ	3,800	2,720.00	10,336,000
関東電化工業	8,900	1,051.00	9,353,900
デンカ	14,800	3,565.00	52,762,000

イビデン	21,700	7,000.00	151,900,000
信越化学工業	69,500	20,070.00	1,394,865,000
日本カーバイド工業	2,200	1,318.00	2,899,600
電算システムホールディングス	1,700	2,462.00	4,185,400
堺化学工業	2,800	2,252.00	6,305,600
第一稀元素化学工業	3,800	1,522.00	5,783,600
エア・ウォーター	38,300	1,763.00	67,522,900
日本酸素ホールディングス	38,900	2,684.00	104,407,600
日本化学工業	1,300	2,743.00	3,565,900
日本パーカライジング	20,400	1,115.00	22,746,000
高压ガス工業	6,400	765.00	4,896,000
四国化成工業	5,300	1,380.00	7,314,000
戸田工業	900	3,635.00	3,271,500
ステラ ケミファ	2,000	2,717.00	5,434,000
保土谷化学工業	1,300	4,915.00	6,389,500
日本触媒	6,800	5,490.00	37,332,000
大日精化学工業	3,300	2,269.00	7,487,700
カネカ	10,500	3,995.00	41,947,500
協和キリン	48,500	3,375.00	163,687,500
三菱瓦斯化学	37,600	2,001.00	75,237,600
三井化学	36,800	3,310.00	121,808,000
J S R	37,700	4,320.00	162,864,000
東京応化学工業	6,900	7,670.00	52,923,000
大阪有機化学工業	3,400	3,965.00	13,481,000
三菱ケミカルホールディングス	270,500	948.90	256,677,450
K Hネオケム	6,700	3,450.00	23,115,000
ダイセル	58,300	831.00	48,447,300
住友ベークライト	6,400	5,550.00	35,520,000
積水化学工業	84,700	1,898.00	160,760,600
日本ゼオン	36,500	1,327.00	48,435,500
アイカ工業	11,300	3,340.00	37,742,000
宇部興産	19,100	2,019.00	38,562,900
積水樹脂	6,100	2,110.00	12,871,000
タキロンシーアイ	8,800	547.00	4,813,600
旭有機材	2,300	1,482.00	3,408,600
ニチバン	2,400	1,890.00	4,536,000
リケンテクノス	9,900	521.00	5,157,900
大倉工業	2,100	2,152.00	4,519,200
積水化成成品工業	5,700	510.00	2,907,000
群栄化学工業	900	3,405.00	3,064,500
ダイキョーニシカワ	8,500	567.00	4,819,500
森六ホールディングス	2,200	1,761.00	3,874,200
恵和	1,000	6,440.00	6,440,000
日本化薬	31,900	1,218.00	38,854,200
カーリットホールディングス	4,000	747.00	2,988,000
レグス	1,900	1,532.00	2,910,800
プレステージ・インターナショナル	14,800	750.00	11,100,000
プロトコーポレーション	4,300	1,343.00	5,774,900
ハイマックス	2,500	1,150.00	2,875,000
アミューズ	2,200	2,010.00	4,422,000

野村総合研究所	78,300	5,040.00	394,632,000	
ドリームインキュベータ	3,600	831.00	2,991,600	
サイバネットシステム	4,100	741.00	3,038,100	
クイック	2,700	1,467.00	3,960,900	
T A C	12,000	237.00	2,844,000	
C Eホールディングス	5,800	505.00	2,929,000	
電通グループ	40,700	3,990.00	162,393,000	
インテージホールディングス	5,100	1,914.00	9,761,400	
東邦システムサイエンス	2,900	1,000.00	2,900,000	
ぴあ	1,400	4,170.00	5,838,000	
イオンファンタジー	1,500	1,915.00	2,872,500	
ソースネクスト	17,500	208.00	3,640,000	
シーティーエス	4,500	836.00	3,762,000	
ネクシィーズグループ	3,600	831.00	2,991,600	
インフォコム	4,400	2,087.00	9,182,800	
メディカルシステムネットワーク	4,800	622.00	2,985,600	
日本精化	3,300	2,000.00	6,600,000	
扶桑化学工業	3,600	5,150.00	18,540,000	
トリケミカル研究所	4,200	3,710.00	15,582,000	
シンプレクス・ホールディングス	4,200	2,851.00	11,974,200	
HEROZ	1,700	1,653.00	2,810,100	
ラクスル	4,400	6,910.00	30,404,000	
F I G	9,200	362.00	3,330,400	
A D E K A	18,600	2,516.00	46,797,600	
日油	13,800	5,990.00	82,662,000	
ミヨシ油脂	2,200	1,317.00	2,897,400	
新日本理化	10,700	271.00	2,899,700	
ハリマ化成グループ	3,500	839.00	2,936,500	
イーソル	3,900	741.00	2,889,900	
アルテリア・ネットワークス	5,100	1,625.00	8,287,500	
E D U L A B	2,000	1,408.00	2,816,000	
ウイングアーク1 s t	2,300	2,169.00	4,988,700	
サーバーワークス	700	4,180.00	2,926,000	
トピラシステムズ	2,900	1,000.00	2,900,000	
S a n s a n	3,600	14,000.00	50,400,000	
ギフティ	3,500	3,385.00	11,847,500	
花王	91,400	6,219.00	568,416,600	
第一工業製薬	1,500	3,255.00	4,882,500	
石原ケミカル	2,200	1,349.00	2,967,800	
日華化学	3,300	897.00	2,960,100	
三洋化成工業	2,400	5,430.00	13,032,000	
ベース	700	4,700.00	3,290,000	
武田薬品工業	324,800	3,185.00	1,034,488,000	
アステラス製薬	358,200	1,953.50	699,743,700	
大日本住友製薬	25,500	1,478.00	37,689,000	
塩野義製薬	52,000	8,083.00	420,316,000	
わかもと製薬	9,400	317.00	2,979,800	
日本新薬	10,800	8,760.00	94,608,000	
中外製薬	129,200	4,168.00	538,505,600	
科研製薬	6,500	4,260.00	27,690,000	

エーザイ	49,500	7,326.00	362,637,000
理研ビタミン	4,300	1,645.00	7,073,500
ロート製薬	21,200	3,385.00	71,762,000
小野薬品工業	94,900	2,461.50	233,596,350
久光製薬	10,900	4,025.00	43,872,500
有機合成薬品工業	10,000	295.00	2,950,000
持田製薬	5,200	3,355.00	17,446,000
参天製薬	77,000	1,569.00	120,813,000
扶桑薬品工業	1,500	2,609.00	3,913,500
ツムラ	12,800	3,530.00	45,184,000
日医工	12,800	700.00	8,960,000
テルモ	117,000	5,022.00	587,574,000
H.U.グループホールディングス	10,300	2,744.00	28,263,200
キッセイ薬品工業	7,300	2,234.00	16,308,200
生化学工業	7,300	976.00	7,124,800
栄研化学	7,300	1,888.00	13,782,400
日水製薬	1,200	960.00	1,152,000
鳥居薬品	2,200	2,936.00	6,459,200
JCRファーマ	11,600	2,661.00	30,867,600
東和薬品	5,900	2,809.00	16,573,100
富士製薬工業	2,600	1,104.00	2,870,400
ゼリア新薬工業	7,500	2,006.00	15,045,000
第一三共	324,700	3,000.00	974,100,000
キョーリン製薬ホールディングス	8,300	1,729.00	14,350,700
大幸薬品	6,200	828.00	5,133,600
ダイト	2,600	2,977.00	7,740,200
大塚ホールディングス	85,900	4,158.00	357,172,200
大正製薬ホールディングス	9,800	5,810.00	56,938,000
ペプチドリーム	21,700	2,941.00	63,819,700
大日本塗料	5,000	836.00	4,180,000
日本ペイントホールディングス	152,000	1,247.00	189,544,000
関西ペイント	42,000	2,774.00	116,508,000
中国塗料	9,500	872.00	8,284,000
日本特殊塗料	3,200	907.00	2,902,400
藤倉化成	5,800	515.00	2,987,000
太陽ホールディングス	6,000	3,350.00	20,100,000
DIC	17,100	3,070.00	52,497,000
サカタインクス	8,000	999.00	7,992,000
東洋インキSCホールディングス	8,600	1,975.00	16,985,000
T&K TOKA	3,600	810.00	2,916,000
アルプス技研	3,500	2,015.00	7,052,500
日本空調サービス	4,100	788.00	3,230,800
オリエンタルランド	46,700	19,470.00	909,249,000
フォーカスシステムズ	2,700	1,116.00	3,013,200
ダスキン	9,200	2,706.00	24,895,200
パーク24	21,900	1,802.00	39,463,800
明光ネットワークジャパン	5,100	555.00	2,830,500
ファルコホールディングス	1,900	1,746.00	3,317,400
クレスコ	3,000	2,062.00	6,186,000
フジ・メディア・ホールディングス	39,100	1,240.00	48,484,000

秀英予備校	7,100	415.00	2,946,500
ラウンドワン	11,000	1,394.00	15,334,000
リゾートトラスト	18,100	2,052.00	37,141,200
オービック	12,800	21,960.00	281,088,000
ジャストシステム	5,800	5,850.00	33,930,000
TDCソフト	3,500	1,247.00	4,364,500
Zホールディングス	589,300	835.00	492,065,500
ビー・エム・エル	5,100	3,700.00	18,870,000
トレンドマイクロ	21,700	6,870.00	149,079,000
りらいあコミュニケーションズ	6,000	1,091.00	6,546,000
IDホールディングス	3,300	884.00	2,917,200
リソー教育	18,000	430.00	7,740,000
日本オラクル	8,200	10,540.00	86,428,000
早稲田アカデミー	2,900	1,033.00	2,995,700
アルファシステムズ	1,100	4,110.00	4,521,000
フューチャー	4,300	4,175.00	17,952,500
CAC Holdings	2,400	1,599.00	3,837,600
SBテクノロジー	1,800	3,005.00	5,409,000
トーセ	3,900	748.00	2,917,200
ユー・エス・エス	44,200	1,819.00	80,399,800
オービックビジネスコンサルタント	3,900	5,440.00	21,216,000
伊藤忠テクノソリューションズ	18,500	3,815.00	70,577,500
アイティフォー	4,900	846.00	4,145,400
東京個別指導学院	4,400	665.00	2,926,000
東計電算	600	4,940.00	2,964,000
サイバーエージェント	97,300	2,182.00	212,308,600
楽天グループ	202,700	1,269.00	257,226,300
クリーク・アンド・リバー社	2,100	2,128.00	4,468,800
モーニングスター	6,900	560.00	3,864,000
テー・オー・ダブリュー	8,400	342.00	2,872,800
大塚商会	21,900	5,530.00	121,107,000
サイボウズ	5,400	2,361.00	12,749,400
山田コンサルティンググループ	2,400	1,203.00	2,887,200
セントラルスポーツ	1,500	2,625.00	3,937,500
電通国際情報サービス	5,900	3,865.00	22,803,500
ACCESS	4,600	841.00	3,868,600
デジタルガレージ	6,700	5,210.00	34,907,000
イーエムシステムズ	6,700	763.00	5,112,100
ウェザーニューズ	1,200	9,700.00	11,640,000
CIJ	3,500	840.00	2,940,000
ビジネスエンジニアリング	800	3,510.00	2,808,000
日本エンタープライズ	15,000	193.00	2,895,000
WOWOW	1,900	2,093.00	3,976,700
スカラ	4,700	652.00	3,064,400
フルキャストホールディングス	3,400	2,902.00	9,866,800
エン・ジャパン	6,400	3,875.00	24,800,000
あすか製薬ホールディングス	4,700	1,020.00	4,794,000
サワイグループホールディングス	9,000	4,470.00	40,230,000
富士フイルムホールディングス	72,600	9,356.00	679,245,600
コニカミノルタ	90,300	486.00	43,885,800

資生堂	77,000	7,341.00	565,257,000	
ライオン	49,900	1,764.00	88,023,600	
高砂香料工業	2,800	2,700.00	7,560,000	
マンダム	8,700	1,561.00	13,580,700	
ミルボン	5,100	6,090.00	31,059,000	
ファンケル	16,700	3,615.00	60,370,500	
コーセー	7,800	14,250.00	111,150,000	
コタ	2,600	1,520.00	3,952,000	
シーボン	1,700	1,768.00	3,005,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	17,600	2,188.00	38,508,800	
ノエビアホールディングス	3,500	5,670.00	19,845,000	
アジュバンホールディングス	2,500	1,189.00	2,972,500	
エステー	2,700	1,547.00	4,176,900	
アグロ カネショウ	2,300	1,315.00	3,024,500	
コニシ	6,800	1,722.00	11,709,600	
長谷川香料	7,100	2,999.00	21,292,900	
星光PMC	3,900	766.00	2,987,400	
小林製薬	11,600	9,500.00	110,200,000	
荒川化学工業	3,400	1,192.00	4,052,800	
メック	3,100	4,215.00	13,066,500	
日本高純度化学	1,100	2,709.00	2,979,900	
タカラバイオ	10,800	2,768.00	29,894,400	
JCU	4,600	5,010.00	23,046,000	
新田ゼラチン	4,800	616.00	2,956,800	
デクセリアルズ	10,700	3,545.00	37,931,500	
アース製薬	3,400	6,460.00	21,964,000	
北興化学工業	3,800	920.00	3,496,000	
大成ラミック	1,300	2,870.00	3,731,000	
クミアイ化学工業	15,400	861.00	13,259,400	
日本農薬	7,400	502.00	3,714,800	
ニチレキ	5,300	1,278.00	6,773,400	
ユシロ化学工業	2,700	1,091.00	2,945,700	
富士石油	10,300	245.00	2,523,500	
MORESCO	2,600	1,137.00	2,956,200	
出光興産	45,900	2,979.00	136,736,100	
ENEOSホールディングス	621,600	432.30	268,717,680	
コスモエネルギーホールディングス	12,000	2,238.00	26,856,000	
テスホールディングス	2,400	2,788.00	6,691,200	
インフロニア・ホールディングス	55,200	1,005.00	55,476,000	
横浜ゴム	23,900	1,925.00	46,007,500	
TOYO TIRE	21,700	1,920.00	41,664,000	
ブリヂストン	119,000	4,930.00	586,670,000	
住友ゴム工業	37,100	1,229.00	45,595,900	
藤倉コンポジット	3,500	844.00	2,954,000	
オカモト	2,500	4,005.00	10,012,500	
アキレス	2,600	1,270.00	3,302,000	
フコク	1,600	984.00	1,574,400	
ニッタ	4,300	2,696.00	11,592,800	
住友理工	8,000	620.00	4,960,000	
三ツ星ベルト	5,000	1,993.00	9,965,000	

バンドー化学	6,700	891.00	5,969,700
A G C	37,900	5,750.00	217,925,000
日本板硝子	19,800	582.00	11,523,600
有沢製作所	6,000	965.00	5,790,000
日本山村硝子	3,800	800.00	3,040,000
日本電気硝子	16,600	3,125.00	51,875,000
住友大阪セメント	7,600	3,375.00	25,650,000
太平洋セメント	23,500	2,340.00	54,990,000
日本ヒューム	4,100	706.00	2,894,600
日本コンクリート工業	10,800	276.00	2,980,800
三谷セキサン	1,900	7,220.00	13,718,000
アジアパイルホールディングス	6,700	435.00	2,914,500
東海カーボン	34,600	1,277.00	44,184,200
日本カーボン	2,200	4,335.00	9,537,000
東洋炭素	2,700	3,115.00	8,410,500
ノリタケカンパニーリミテド	2,300	4,860.00	11,178,000
T O T O	29,500	5,510.00	162,545,000
日本碍子	44,800	2,000.00	89,600,000
日本特殊陶業	31,400	1,956.00	61,418,400
M A R U W A	1,400	14,170.00	19,838,000
品川リフラクトリーズ	1,000	3,620.00	3,620,000
黒崎播磨	700	4,215.00	2,950,500
ヨータイ	2,600	1,245.00	3,237,000
イソライト工業	3,100	1,045.00	3,239,500
ニッカトー	4,000	723.00	2,892,000
フジインコーポレーテッド	3,400	7,470.00	25,398,000
クニミネ工業	2,700	1,064.00	2,872,800
ニチアス	9,600	2,644.00	25,382,400
日本製鉄	182,900	1,862.00	340,559,800
神戸製鋼所	76,300	592.00	45,169,600
中山製鋼所	6,700	457.00	3,061,900
合同製鐵	2,200	1,411.00	3,104,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	110,300	1,411.00	155,633,300
東京製鐵	13,900	1,313.00	18,250,700
共英製鋼	4,600	1,345.00	6,187,000
大和工業	7,800	3,710.00	28,938,000
東京鐵鋼	2,200	1,334.00	2,934,800
大阪製鐵	2,800	1,054.00	2,951,200
淀川製鋼所	5,400	2,387.00	12,889,800
丸一鋼管	14,500	2,560.00	37,120,000
モリ工業	1,200	2,696.00	3,235,200
大同特殊鋼	6,700	4,135.00	27,704,500
日本高周波鋼業	6,100	369.00	2,250,900
日本冶金工業	3,000	2,216.00	6,648,000
山陽特殊製鋼	4,200	1,948.00	8,181,600
愛知製鋼	2,300	2,621.00	6,028,300
日立金属	44,000	2,134.00	93,896,000
大平洋金属	2,500	2,211.00	5,527,500
新日本電工	26,400	315.00	8,316,000

日本製鋼所	12,400	3,410.00	42,284,000
三菱製鋼	2,900	1,019.00	2,955,100
日亜鋼業	10,500	278.00	2,919,000
日本精線	700	4,560.00	3,192,000
エンビプロ・ホールディングス	1,700	2,073.00	3,524,100
大紀アルミニウム工業所	6,200	1,464.00	9,076,800
日本軽金属ホールディングス	10,300	1,775.00	18,282,500
三井金属鉱業	11,000	3,070.00	33,770,000
東邦亜鉛	2,300	2,304.00	5,299,200
三菱マテリアル	27,000	2,071.00	55,917,000
住友金属鉱山	52,200	4,412.00	230,306,400
DOWAホールディングス	11,100	4,655.00	51,670,500
古河機械金属	6,700	1,225.00	8,207,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,700	874.00	4,107,800
東邦チタニウム	7,300	1,032.00	7,533,600
UACJ	6,200	2,618.00	16,231,600
CKサンエツ	600	3,390.00	2,034,000
古河電気工業	12,700	2,466.00	31,318,200
住友電気工業	152,800	1,626.50	248,529,200
フジクラ	45,500	603.00	27,436,500
昭和電線ホールディングス	3,600	1,988.00	7,156,800
東京特殊電線	1,000	2,799.00	2,799,000
タツタ電線	7,200	478.00	3,441,600
平河ヒューテック	2,500	1,188.00	2,970,000
リョービ	5,000	1,080.00	5,400,000
アールスティ	7,400	400.00	2,960,000
アサヒホールディングス	16,400	2,020.00	33,128,000
東洋製罐グループホールディングス	26,000	1,477.00	38,402,000
ホッカンホールディングス	2,200	1,465.00	3,223,000
コロナ	3,300	907.00	2,993,100
横河ブリッジホールディングス	7,000	2,211.00	15,477,000
三和ホールディングス	38,500	1,307.00	50,319,500
文化シヤッター	13,000	1,060.00	13,780,000
三協立山	5,300	744.00	3,943,200
アルインコ	3,100	962.00	2,982,200
LIXIL	64,300	3,045.00	195,793,500
日本ファイルコン	5,100	575.00	2,932,500
ノーリツ	7,800	1,706.00	13,306,800
長府製作所	4,200	2,071.00	8,698,200
リンナイ	7,700	12,050.00	92,785,000
ユニプレス	6,200	774.00	4,798,800
ダイニチ工業	3,700	817.00	3,022,900
日東精工	5,100	623.00	3,177,300
三洋工業	1,600	1,884.00	3,014,400
岡部	8,300	692.00	5,743,600
ジーテクト	5,100	1,409.00	7,185,900
東プレ	7,600	1,188.00	9,028,800
高周波熱錬	7,300	584.00	4,263,200
東京製綱	3,600	822.00	2,959,200
サンコール	6,200	472.00	2,926,400

モリテックスチール	7,300	409.00	2,985,700
パイオラックス	6,000	1,688.00	10,128,000
エイチワン	4,400	679.00	2,987,600
日本発条	37,600	859.00	32,298,400
三浦工業	17,700	4,255.00	75,313,500
タクマ	13,800	1,514.00	20,893,200
テクノプロ・ホールディングス	23,600	3,580.00	84,488,000
インターワークス	7,200	402.00	2,894,400
アイ・アールジャパンホールディングス	1,800	7,850.00	14,130,000
Keepers 技研	2,500	2,803.00	7,007,500
三機サービス	2,900	997.00	2,891,300
Gunosy	4,700	626.00	2,942,200
イー・ガーディアン	1,600	3,770.00	6,032,000
リブセンス	13,400	214.00	2,867,600
ジャパンマテリアル	12,100	1,541.00	18,646,100
ベクトル	5,500	1,324.00	7,282,000
ウチヤマホールディングス	8,600	316.00	2,717,600
チャーム・ケア・コーポレーション	2,900	1,535.00	4,451,500
キャリアリンク	2,100	1,354.00	2,843,400
I B J	3,200	1,114.00	3,564,800
アサンテ	1,700	1,725.00	2,932,500
バリューHR	1,600	2,280.00	3,648,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,300	5,870.00	19,371,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,528.00	916,800
アビスト	1,000	2,870.00	2,870,000
シグマックス・ホールディングス	2,400	3,205.00	7,692,000
ウィルグループ	2,900	1,497.00	4,341,300
メドピア	3,000	4,020.00	12,060,000
リクルートホールディングス	304,600	7,569.00	2,305,517,400
エラン	5,400	1,291.00	6,971,400
ツガミ	9,900	1,566.00	15,503,400
オークマ	4,800	5,170.00	24,816,000
芝浦機械	4,600	3,320.00	15,272,000
アマダ	64,500	1,158.00	74,691,000
アイダエンジニアリング	10,700	998.00	10,678,600
滝澤鉄工所	2,600	1,131.00	2,940,600
F U J I	18,800	2,754.00	51,775,200
牧野フライス製作所	4,500	3,835.00	17,257,500
オーエスジー	18,900	1,877.00	35,475,300
ダイジェット工業	2,600	1,110.00	2,886,000
旭ダイヤモンド工業	10,700	672.00	7,190,400
D M G 森精機	24,200	1,897.00	45,907,400
ソディック	9,100	825.00	7,507,500
ディスコ	6,000	33,100.00	198,600,000
日東工器	2,200	1,725.00	3,795,000
日進工具	3,200	1,555.00	4,976,000
日本郵政	515,600	875.20	451,253,120
ベルシステム24ホールディングス	5,700	1,382.00	7,877,400

鎌倉新書	4,500	897.00	4,036,500
S M N	4,500	658.00	2,961,000
エアトリ	2,600	3,540.00	9,204,000
アトラエ	2,700	2,643.00	7,136,100
ストライク	1,500	5,940.00	8,910,000
ソラスト	9,700	1,288.00	12,493,600
インソース	3,800	2,685.00	10,203,000
豊田自動織機	33,400	10,110.00	337,674,000
豊和工業	3,600	826.00	2,973,600
東洋機械金属	5,500	541.00	2,975,500
エンシュウ	4,400	675.00	2,970,000
島精機製作所	6,000	2,116.00	12,696,000
オプトラン	5,100	2,420.00	12,342,000
N C ホールディングス	2,000	1,461.00	2,922,000
イワキ	2,800	1,071.00	2,998,800
フリー	3,600	1,337.00	4,813,200
ヤマシンフィルタ	8,200	624.00	5,116,800
日阪製作所	5,000	846.00	4,230,000
やまびこ	7,900	1,284.00	10,143,600
野村マイクロ・サイエンス	1,100	5,180.00	5,698,000
平田機工	1,900	6,480.00	12,312,000
ペガサスマシン製造	6,100	485.00	2,958,500
マルマエ	1,700	3,215.00	5,465,500
タツモ	1,900	1,825.00	3,467,500
ナプテスコ	23,300	3,465.00	80,734,500
三井海洋開発	4,300	1,535.00	6,600,500
レオン自動機	4,400	1,382.00	6,080,800
S M C	12,100	76,820.00	929,522,000
ホソカワミクロン	2,900	3,010.00	8,729,000
ユニオンツール	1,500	3,885.00	5,827,500
オイレス工業	5,700	1,704.00	9,712,800
日精エー・エス・ビー機械	1,400	3,115.00	4,361,000
サトーホールディングス	5,400	2,355.00	12,717,000
技研製作所	3,600	4,420.00	15,912,000
カワタ	3,100	933.00	2,892,300
日精樹脂工業	2,900	1,055.00	3,059,500
オカダアイヨン	900	1,475.00	1,327,500
ワイエイシイホールディングス	2,800	1,029.00	2,881,200
小松製作所	187,300	2,930.00	548,789,000
住友重機械工業	23,600	2,716.00	64,097,600
日立建機	16,600	3,650.00	60,590,000
日工	5,600	641.00	3,589,600
巴工業	1,600	2,344.00	3,750,400
井関農機	3,800	1,533.00	5,825,400
T O W A	3,500	3,565.00	12,477,500
丸山製作所	1,900	1,558.00	2,960,200
北川鉄工所	2,000	1,459.00	2,918,000
シンニッタン	13,000	230.00	2,990,000
ローツェ	2,000	12,890.00	25,780,000
タカキタ	4,600	619.00	2,847,400

クボタ	201,500	2,454.00	494,481,000
荏原実業	1,900	2,692.00	5,114,800
東洋エンジニアリング	5,400	741.00	4,001,400
三菱化工機	1,300	2,456.00	3,192,800
月島機械	7,600	1,146.00	8,709,600
帝国電機製作所	2,900	1,420.00	4,118,000
新東工業	9,100	713.00	6,488,300
澁谷工業	3,600	3,090.00	11,124,000
アイチコーポレーション	6,000	806.00	4,836,000
小森コーポレーション	10,500	659.00	6,919,500
鶴見製作所	3,200	1,533.00	4,905,600
荏原製作所	17,200	6,400.00	110,080,000
石井鐵工所	1,000	3,005.00	3,005,000
西島製作所	3,700	919.00	3,400,300
北越工業	3,900	994.00	3,876,600
ダイキン工業	52,600	25,205.00	1,325,783,000
オルガノ	1,200	7,120.00	8,544,000
トヨーカネツ	1,600	2,566.00	4,105,600
栗田工業	22,400	5,720.00	128,128,000
椿本チエイン	5,400	3,100.00	16,740,000
大同工業	3,200	928.00	2,969,600
日機装	12,400	928.00	11,507,200
木村化工機	3,400	1,082.00	3,678,800
レイズネクスト	6,300	1,195.00	7,528,500
アネスト岩田	6,400	864.00	5,529,600
ダイフク	22,700	10,050.00	228,135,000
サムコ	1,000	3,215.00	3,215,000
加藤製作所	3,500	861.00	3,013,500
タダノ	21,600	1,148.00	24,796,800
フジテック	15,300	2,530.00	38,709,000
C K D	12,200	2,374.00	28,962,800
キトー	3,500	1,889.00	6,611,500
平和	11,500	1,933.00	22,229,500
理想科学工業	3,500	2,121.00	7,423,500
SANKYO	8,900	3,010.00	26,789,000
日本金銭機械	4,200	745.00	3,129,000
マースグループホールディングス	2,600	1,632.00	4,243,200
フクシマガリレイ	2,800	4,410.00	12,348,000
ダイコク電機	2,400	1,243.00	2,983,200
竹内製作所	6,300	2,920.00	18,396,000
アマノ	10,800	2,683.00	28,976,400
JUKI	5,700	908.00	5,175,600
ジャノメ	4,400	669.00	2,943,600
ブラザー工業	50,500	2,098.00	105,949,000
マックス	5,500	1,849.00	10,169,500
モリタホールディングス	6,600	1,353.00	8,929,800
グローリー	10,600	2,252.00	23,871,200
新晃工業	3,800	1,985.00	7,543,000
大和冷機工業	6,000	1,265.00	7,590,000
セガサミーホールディングス	41,000	1,949.00	79,909,000

日本ピストンリング	2,200	1,327.00	2,919,400
リケン	1,800	2,573.00	4,631,400
T P R	5,600	1,487.00	8,327,200
ツバキ・ナカシマ	9,100	1,456.00	13,249,600
ホシザキ	12,100	8,980.00	108,658,000
大豊工業	3,700	795.00	2,941,500
日本精工	77,800	756.00	58,816,800
N T N	88,700	231.00	20,489,700
ジェイテクト	39,600	1,069.00	42,332,400
不二越	3,500	4,250.00	14,875,000
ミネベアミツミ	71,200	3,210.00	228,552,000
日本トムソン	11,300	742.00	8,384,600
T H K	24,000	2,712.00	65,088,000
ユーシン精機	3,900	774.00	3,018,600
前澤給装工業	3,100	1,024.00	3,174,400
イーグル工業	5,100	1,083.00	5,523,300
日本ピラー工業	4,200	3,280.00	13,776,000
キッツ	13,900	743.00	10,327,700
日立製作所	198,700	7,329.00	1,456,272,300
東芝	72,200	4,747.00	342,733,400
三菱電機	413,200	1,497.00	618,560,400
富士電機	24,900	6,010.00	149,649,000
東洋電機製造	3,000	1,010.00	3,030,000
安川電機	44,500	5,270.00	234,515,000
シンフォニア テクノロジー	5,000	1,362.00	6,810,000
明電舎	7,000	2,731.00	19,117,000
オリジン	2,200	1,357.00	2,985,400
山洋電気	1,800	6,180.00	11,124,000
デンヨー	3,500	1,677.00	5,869,500
ベイカレント・コンサルティング	2,800	55,500.00	155,400,000
Orchestra Holdings	800	4,805.00	3,844,000
MS - Japan	2,900	1,013.00	2,937,700
グレイステクノロジー	5,900	479.00	2,826,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	12,500	2,282.00	28,525,000
G A M E W I T H	5,500	589.00	3,239,500
ウェルビー	2,600	1,483.00	3,855,800
ミダックホールディングス	1,700	5,280.00	8,976,000
日総工産	3,500	827.00	2,894,500
キュービーネットホールディングス	1,800	1,900.00	3,420,000
R P Aホールディングス	6,900	420.00	2,898,000
三櫻工業	5,700	1,026.00	5,848,200
マキタ	50,300	5,240.00	263,572,000
東芝テック	4,400	4,635.00	20,394,000
芝浦メカトロニクス	700	8,920.00	6,244,000
マブチモーター	9,700	3,805.00	36,908,500
日本電産	107,100	13,335.00	1,428,178,500
トレックス・セミコンダクター	2,100	3,770.00	7,917,000
東光高岳	2,300	1,403.00	3,226,900

ダブル・スコープ	11,900	950.00	11,305,000
ダイヘン	4,500	4,645.00	20,902,500
ヤーマン	6,700	1,190.00	7,973,000
JVCケンウッド	33,700	178.00	5,998,600
ミマキエンジニアリング	3,700	961.00	3,555,700
I - P E X	1,900	2,199.00	4,178,100
日新電機	9,700	1,494.00	14,491,800
大崎電気工業	7,600	492.00	3,739,200
オムロン	34,400	11,295.00	388,548,000
日東工業	5,500	1,600.00	8,800,000
I D E C	5,100	2,758.00	14,065,800
不二電機工業	2,300	1,271.00	2,923,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	13,800	2,451.00	33,823,800
サクサホールディングス	2,000	1,458.00	2,916,000
メルコホールディングス	1,100	4,160.00	4,576,000
日本電気	52,500	5,270.00	276,675,000
富士通	37,200	20,420.00	759,624,000
沖電気工業	16,800	923.00	15,506,400
岩崎通信機	3,400	870.00	2,958,000
電気興業	2,200	2,623.00	5,770,600
サンケン電気	3,900	6,010.00	23,439,000
アイホン	2,300	2,198.00	5,055,400
ルネサスエレクトロニクス	223,700	1,554.00	347,629,800
セイコーエプソン	51,300	1,952.00	100,137,600
ワコム	32,000	912.00	29,184,000
アルバック	7,600	6,940.00	52,744,000
E I Z O	3,200	4,100.00	13,120,000
ジャパンディスプレイ	141,200	40.00	5,648,000
日本信号	10,500	914.00	9,597,000
京三製作所	8,900	464.00	4,129,600
能美防災	5,500	2,065.00	11,357,500
ホーチキ	3,000	1,297.00	3,891,000
エレコム	9,500	1,469.00	13,955,500
パナソニック	440,700	1,380.50	608,386,350
シャープ	47,100	1,369.00	64,479,900
アンリツ	26,600	1,912.00	50,859,200
富士通ゼネラル	11,200	2,771.00	31,035,200
ソニーグループ	258,800	14,280.00	3,695,664,000
T D K	59,800	4,790.00	286,442,000
タムラ製作所	15,900	756.00	12,020,400
アルプスアルパイン	36,600	1,107.00	40,516,200
池上通信機	3,900	736.00	2,870,400
日本電波工業	3,700	1,697.00	6,278,900
メイコー	3,400	4,140.00	14,076,000
日本トリム	900	3,565.00	3,208,500
ローランド ディー・ジー・	2,400	2,798.00	6,715,200
フォスター電機	4,200	781.00	3,280,200
S M K	1,200	2,468.00	2,961,600
ヨコオ	3,100	2,799.00	8,676,900
ホシデン	10,000	1,275.00	12,750,000

ヒロセ電機	6,400	20,140.00	128,896,000	
日本航空電子工業	9,500	1,881.00	17,869,500	
TOA	4,400	795.00	3,498,000	
マクセル	8,200	1,388.00	11,381,600	
古野電気	4,900	1,236.00	6,056,400	
ユニデンホールディングス	900	3,495.00	3,145,500	
スミダコーポレーション	3,900	1,331.00	5,190,900	
アイコム	1,500	2,300.00	3,450,000	
リオン	1,600	2,280.00	3,648,000	
横河電機	41,400	2,268.00	93,895,200	
新電元工業	1,600	3,750.00	6,000,000	
アズビル	24,200	5,490.00	132,858,000	
東亜ディーケーケー	3,400	850.00	2,890,000	
日本光電工業	17,100	3,490.00	59,679,000	
共和電業	7,300	402.00	2,934,600	
日本電子材料	2,000	2,269.00	4,538,000	
堀場製作所	7,600	7,300.00	55,480,000	
アドバンテスト	30,700	10,530.00	323,271,000	
小野測器	5,800	500.00	2,900,000	
エスベック	3,400	2,258.00	7,677,200	
キーエンス	37,400	74,280.00	2,778,072,000	
日置電機	2,000	9,560.00	19,120,000	
シスメックス	34,900	14,950.00	521,755,000	
日本マイクロニクス	7,200	1,939.00	13,960,800	
メガチップス	3,800	4,855.00	18,449,000	
OBARA GROUP	1,900	3,555.00	6,754,500	
澤藤電機	1,500	1,934.00	2,901,000	
デンソー	91,000	8,822.00	802,802,000	
原田工業	3,000	981.00	2,943,000	
コーセル	5,000	938.00	4,690,000	
イリソ電子工業	3,500	5,110.00	17,885,000	
オブテックスグループ	6,800	1,552.00	10,553,600	
千代田インテグレ	1,700	2,375.00	4,037,500	
アイ・オー・データ機器	3,000	867.00	2,601,000	
レーザーテック	18,100	31,600.00	571,960,000	
スタンレー電気	28,900	3,235.00	93,491,500	
岩崎電気	1,500	2,306.00	3,459,000	
ウシオ電機	21,200	2,267.00	48,060,400	
岡谷電機産業	8,700	335.00	2,914,500	
日本セラミック	3,800	2,939.00	11,168,200	
遠藤照明	2,500	1,132.00	2,830,000	
古河電池	2,900	1,622.00	4,703,800	
山一電機	3,000	2,380.00	7,140,000	
図研	2,700	4,070.00	10,989,000	
日本電子	8,600	9,590.00	82,474,000	
カシオ計算機	29,900	1,581.00	47,271,900	
ファナック	36,300	23,350.00	847,605,000	
日本シイエムケイ	8,100	531.00	4,301,100	
エンプラス	1,100	2,690.00	2,959,000	
大真空	5,600	1,666.00	9,329,600	

ローム	18,500	11,450.00	211,825,000
浜松ホトニクス	29,600	7,300.00	216,080,000
三井ハイテック	4,100	9,300.00	38,130,000
新光電気工業	12,100	5,340.00	64,614,000
京セラ	58,100	7,141.00	414,892,100
協栄産業	2,000	1,540.00	3,080,000
太陽誘電	20,000	6,880.00	137,600,000
村田製作所	121,400	8,910.00	1,081,674,000
双葉電子工業	7,100	736.00	5,225,600
日東電工	25,000	8,690.00	217,250,000
北陸電気工業	2,400	1,291.00	3,098,400
東海理化電機製作所	10,900	1,628.00	17,745,200
ニチコン	13,000	1,191.00	15,483,000
日本ケミコン	3,900	1,896.00	7,394,400
K O A	6,200	1,680.00	10,416,000
三井E & Sホールディングス	14,900	408.00	6,079,200
日立造船	34,900	882.00	30,781,800
三菱重工業	64,900	2,831.50	183,764,350
川崎重工業	30,200	2,063.00	62,302,600
I H I	25,800	2,501.00	64,525,800
マネジメントソリューションズ	1,900	3,475.00	6,602,500
プロレド・パートナーズ	2,200	1,309.00	2,879,800
a n d f a c t o r y	6,300	466.00	2,935,800
カーブスホールディングス	10,800	876.00	9,460,800
フォーラムエンジニアリング	3,400	853.00	2,900,200
日本車輛製造	1,500	2,045.00	3,067,500
三菱ロジスネクスト	5,500	1,141.00	6,275,500
近畿車輛	2,800	1,043.00	2,920,400
フルサト・マルカホールディングス	3,900	2,070.00	8,073,000
ヤマエグループホールディングス	2,700	1,054.00	2,845,800
F P G	13,700	591.00	8,096,700
島根銀行	5,200	554.00	2,880,800
じもとホールディングス	4,500	642.00	2,889,000
全国保証	9,700	5,160.00	50,052,000
めぶきフィナンシャルグループ	211,700	232.00	49,114,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,100	1,216.00	3,769,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,100	1,428.00	7,282,800
九州フィナンシャルグループ	83,300	390.00	32,487,000
かんぼ生命保険	41,000	1,794.00	73,554,000
ゆうちょ銀行	96,200	922.00	88,696,400
富山第一銀行	10,500	277.00	2,908,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	232,800	436.00	101,500,800
ジェイリース	800	2,095.00	1,676,000
西日本フィナンシャルホールディングス	26,600	727.00	19,338,200
イントラスト	3,800	801.00	3,043,800
アルヒ	6,000	1,035.00	6,210,000
プレミアグループ	2,100	3,660.00	7,686,000

日産自動車	487,300	614.50	299,445,850
いすゞ自動車	129,600	1,636.00	212,025,600
トヨタ自動車	2,092,900	2,105.00	4,405,554,500
日野自動車	51,600	1,067.00	55,057,200
三菱自動車工業	152,900	395.00	60,395,500
エフテック	3,300	565.00	1,864,500
武蔵精密工業	9,200	2,020.00	18,584,000
日産車体	6,100	702.00	4,282,200
新明和工業	11,700	904.00	10,576,800
極東開発工業	7,700	1,466.00	11,288,200
トピー工業	3,400	1,129.00	3,838,600
ティラド	1,200	3,000.00	3,600,000
曙ブレーキ工業	22,700	209.00	4,744,300
タチエス	7,200	1,164.00	8,380,800
NOK	20,000	1,318.00	26,360,000
フタバ産業	10,300	405.00	4,171,500
KYB	4,300	3,150.00	13,545,000
市光工業	5,400	540.00	2,916,000
大同メタル工業	7,900	597.00	4,716,300
プレス工業	20,500	406.00	8,323,000
ミクニ	9,600	314.00	3,014,400
太平洋工業	8,700	1,145.00	9,961,500
河西工業	9,600	314.00	3,014,400
アイシン	30,200	4,475.00	135,145,000
マツダ	129,700	1,040.00	134,888,000
今仙電機製作所	5,000	588.00	2,940,000
本田技研工業	325,300	3,292.00	1,070,887,600
スズキ	94,500	5,281.00	499,054,500
SUBARU	118,400	2,292.00	271,372,800
ヤマハ発動機	53,900	3,085.00	166,281,500
小糸製作所	22,700	7,240.00	164,348,000
エクセディ	6,200	1,725.00	10,695,000
ミツバ	7,600	506.00	3,845,600
豊田合成	13,300	2,418.00	32,159,400
愛三工業	6,500	816.00	5,304,000
ヨロズ	3,900	1,163.00	4,535,700
エフ・シー・シー	6,800	1,549.00	10,533,200
シマノ	16,700	32,670.00	545,589,000
テイ・エス テック	17,400	1,439.00	25,038,600
三十三フィナンシャルグループ	3,800	1,403.00	5,331,400
第四北越フィナンシャルグループ	6,600	2,434.00	16,064,400
ひろぎんホールディングス	60,100	634.00	38,103,400
おきなわフィナンシャルグループ	3,700	2,003.00	7,411,100
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	3,940.00	8,274,000
ポピンズホールディングス	900	3,580.00	3,222,000
LITALICO	3,200	4,030.00	12,896,000
十六フィナンシャルグループ	5,500	2,010.00	11,055,000
北國フィナンシャルホールディングス	3,800	1,986.00	7,546,800
ジャムコ	3,000	975.00	2,925,000
小野建	3,900	1,611.00	6,282,900

南陽	1,500	1,953.00	2,929,500
ノジマ	6,600	2,303.00	15,199,800
カップ・クリエイト	5,700	1,400.00	7,980,000
伯東	2,500	2,312.00	5,780,000
コンドーテック	3,100	1,001.00	3,103,100
中山福	7,800	368.00	2,870,400
ライトオン	4,200	715.00	3,003,000
ナガイレーベン	5,400	2,421.00	13,073,400
三菱食品	3,900	2,811.00	10,962,900
良品計画	46,800	2,036.00	95,284,800
松田産業	3,000	2,973.00	8,919,000
第一興商	7,700	3,980.00	30,646,000
メディカルホールディングス	43,900	2,050.00	89,995,000
アドヴァングループ	4,100	967.00	3,964,700
S P K	2,200	1,371.00	3,016,200
萩原電気ホールディングス	1,500	2,086.00	3,129,000
アルビス	1,300	2,232.00	2,901,600
アズワン	2,900	14,860.00	43,094,000
スズデン	1,800	1,692.00	3,045,600
シモジマ	2,600	1,114.00	2,896,400
ドウシシャ	3,800	1,637.00	6,220,600
小津産業	1,500	1,912.00	2,868,000
コナカ	8,800	337.00	2,965,600
高速	2,400	1,555.00	3,732,000
G - 7ホールディングス	4,500	1,743.00	7,843,500
イオン北海道	7,200	1,450.00	10,440,000
コジマ	7,000	560.00	3,920,000
ヒマラヤ	3,000	983.00	2,949,000
コーナン商事	5,800	3,540.00	20,532,000
ネットワンシステムズ	15,400	3,725.00	57,365,000
エコス	1,600	1,856.00	2,969,600
ワタミ	4,900	935.00	4,581,500
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	81,400	2,193.00	178,510,200
丸文	3,600	941.00	3,387,600
西松屋チェーン	8,900	1,517.00	13,501,300
ゼンショーホールディングス	19,900	2,688.00	53,491,200
ハビネット	3,400	1,512.00	5,140,800
幸楽苑ホールディングス	2,600	1,469.00	3,819,400
橋本総業ホールディングス	1,400	2,065.00	2,891,000
日本ライフライン	12,100	1,141.00	13,806,100
サイゼリヤ	6,000	2,999.00	17,994,000
V Tホールディングス	15,300	456.00	6,976,800
アルゴグラフィックス	3,200	3,060.00	9,792,000
I D O M	12,300	714.00	8,782,200
日本エム・ディ・エム	2,400	2,211.00	5,306,400
フジ・コーポレーション	2,400	1,201.00	2,882,400
ユナイテッドアローズ	4,300	1,968.00	8,462,400
進和	2,400	2,097.00	5,032,800
ダイトロン	1,700	2,138.00	3,634,600

ハイデイ日高	5,900	1,637.00	9,658,300
シークス	5,800	1,384.00	8,027,200
YU-WA CREATION HOLDINGS	13,900	213.00	2,960,700
コロワイド	16,700	1,666.00	27,822,200
ピーシーデポコーポレーション	7,700	368.00	2,833,600
田中商事	4,500	655.00	2,947,500
オーハシテクニカ	2,300	1,545.00	3,553,500
壱番屋	2,900	4,630.00	13,427,000
白銅	1,300	2,410.00	3,133,000
スギホールディングス	8,100	7,780.00	63,018,000
薬王堂ホールディングス	2,000	2,283.00	4,566,000
島津製作所	53,200	5,010.00	266,532,000
JMS	4,500	645.00	2,902,500
長野計器	3,000	1,825.00	5,475,000
ブイ・テクノロジー	1,800	3,710.00	6,678,000
スター精密	6,400	1,583.00	10,131,200
東京計器	2,900	1,023.00	2,966,700
愛知時計電機	600	4,500.00	2,700,000
インターアクション	2,100	2,488.00	5,224,800
オーバル	11,300	263.00	2,971,900
東京精密	7,000	5,060.00	35,420,000
マニー	16,500	1,826.00	30,129,000
ニコン	63,100	1,215.00	76,666,500
トプコン	19,400	1,981.00	38,431,400
オリンパス	216,700	2,600.00	563,420,000
理研計器	3,300	4,975.00	16,417,500
SCREENホールディングス	7,200	12,080.00	86,976,000
キャノン電子	3,800	1,596.00	6,064,800
タムロン	3,300	2,650.00	8,745,000
HOYA	80,600	18,960.00	1,528,176,000
ノーリツ鋼機	3,700	2,374.00	8,783,800
エー・アンド・デイ	3,800	1,356.00	5,152,800
朝日インテック	45,300	2,870.00	130,011,000
キャノン	205,300	2,589.00	531,521,700
リコー	114,700	1,046.00	119,976,200
シチズン時計	48,400	511.00	24,732,400
リズム	2,300	1,259.00	2,895,700
メニコン	13,700	4,030.00	55,211,000
スノーピーク	2,700	8,260.00	22,302,000
パラマウントベッドホールディングス	7,900	1,974.00	15,594,600
トランザクション	2,700	1,089.00	2,940,300
粧美堂	7,500	392.00	2,940,000
ニホンフラッシュ	3,500	1,160.00	4,060,000
前田工織	4,600	3,670.00	16,882,000
永大産業	10,300	284.00	2,925,200
アートネイチャー	4,400	662.00	2,912,800
バンダイナムコホールディングス	37,000	9,319.00	344,803,000
共立印刷	19,500	149.00	2,905,500
SHOEI	3,900	5,300.00	20,670,000

フランスベッドホールディングス	5,300	885.00	4,690,500
マーベラス	6,400	755.00	4,832,000
パイロットコーポレーション	7,000	4,175.00	29,225,000
萩原工業	2,700	1,464.00	3,952,800
エイベックス	7,000	1,815.00	12,705,000
トッパン・フォームズ	5,900	1,546.00	9,121,400
フジシールインターナショナル	10,000	2,194.00	21,940,000
タカラトミー	17,300	1,075.00	18,597,500
広済堂ホールディングス	3,200	885.00	2,832,000
レック	5,400	889.00	4,800,600
三光合成	7,100	418.00	2,967,800
プロネクス	3,200	1,047.00	3,350,400
大建工業	2,400	2,341.00	5,618,400
凸版印刷	62,800	1,850.00	116,180,000
大日本印刷	48,800	2,800.00	136,640,000
共同印刷	1,300	2,765.00	3,594,500
N I S S H A	8,500	1,720.00	14,620,000
藤森工業	3,700	3,965.00	14,670,500
TAKARA & COMPANY	2,000	1,813.00	3,626,000
前澤化成工業	2,600	1,305.00	3,393,000
未来工業	1,800	1,595.00	2,871,000
アシックス	36,500	3,040.00	110,960,000
ツツミ	1,300	2,245.00	2,918,500
J S P	2,400	1,591.00	3,818,400
ニチハ	5,700	3,020.00	17,214,000
ローランド	2,900	4,595.00	13,325,500
エフピコ	7,600	4,185.00	31,806,000
小松ウオール工業	1,500	1,899.00	2,848,500
ヤマハ	24,600	6,440.00	158,424,000
河合楽器製作所	1,200	3,330.00	3,996,000
ピジョン	25,000	2,368.00	59,200,000
天馬	3,400	2,567.00	8,727,800
キングジム	3,300	880.00	2,904,000
象印マホービン	11,200	1,666.00	18,659,200
リンテック	8,900	2,634.00	23,442,600
信越ポリマー	7,400	1,028.00	7,607,200
東リ	12,600	235.00	2,961,000
イトーキ	8,300	363.00	3,012,900
任天堂	23,300	51,440.00	1,198,552,000
三菱鉛筆	6,800	1,208.00	8,214,400
松風	1,700	2,136.00	3,631,200
タカラスタンダード	8,500	1,420.00	12,070,000
コクヨ	19,800	1,769.00	35,026,200
ナカバヤシ	5,600	524.00	2,934,400
ニフコ	13,800	3,550.00	48,990,000
グローブライド	3,700	3,560.00	13,172,000
オカムラ	14,200	1,326.00	18,829,200
パルカー	3,400	2,590.00	8,806,000
M U T O Hホールディングス	1,700	1,710.00	2,907,000
伊藤忠商事	284,600	3,390.00	964,794,000

丸紅	401,400	1,047.00	420,265,800
スクロール	6,300	827.00	5,210,100
ヨンドシーホールディングス	3,700	1,661.00	6,145,700
三陽商会	3,200	896.00	2,867,200
長瀬産業	22,300	1,749.00	39,002,700
蝶理	2,300	1,803.00	4,146,900
豊田通商	40,900	5,520.00	225,768,000
オンワードホールディングス	24,300	320.00	7,776,000
三共生興	5,400	555.00	2,997,000
兼松	15,200	1,287.00	19,562,400
美津濃	4,100	2,294.00	9,405,400
三井物産	316,000	2,646.00	836,136,000
日本紙パルプ商事	2,100	3,860.00	8,106,000
東京エレクトロン	26,200	63,040.00	1,651,648,000
カメイ	4,800	1,017.00	4,881,600
OUGホールディングス	1,200	2,536.00	3,043,200
スターゼン	3,000	1,918.00	5,754,000
セイコーホールディングス	5,800	2,440.00	14,152,000
山善	17,100	1,033.00	17,664,300
椿本興業	800	3,810.00	3,048,000
住友商事	256,800	1,675.50	430,268,400
日本ユニシス	12,700	3,445.00	43,751,500
内田洋行	1,700	4,800.00	8,160,000
三菱商事	304,900	3,544.00	1,080,565,600
第一実業	1,800	5,110.00	9,198,000
キャノンマーケティングジャパン	10,100	2,341.00	23,644,100
西華産業	2,100	1,644.00	3,452,400
佐藤商事	3,400	1,186.00	4,032,400
菱洋エレクトロ	2,400	2,424.00	5,817,600
東京産業	3,800	795.00	3,021,000
ユアサ商事	3,900	2,937.00	11,454,300
神鋼商事	900	3,295.00	2,965,500
阪和興業	8,100	3,305.00	26,770,500
正栄食品工業	2,600	4,070.00	10,582,000
カナデン	3,300	1,054.00	3,478,200
菱電商事	3,200	1,742.00	5,574,400
ニプロ	30,800	1,147.00	35,327,600
岩谷産業	9,800	6,180.00	60,564,000
ナイス	1,700	1,740.00	2,958,000
極東貿易	1,200	2,480.00	2,976,000
アステナホールディングス	5,700	565.00	3,220,500
兼松エレクトロニクス	2,200	3,745.00	8,239,000
三愛石油	10,000	1,202.00	12,020,000
稲畑産業	9,000	1,607.00	14,463,000
明和産業	3,800	843.00	3,203,400
ゴールドウイン	7,300	7,030.00	51,319,000
ユニ・チャーム	79,600	4,923.00	391,870,800
デサント	7,900	5,000.00	39,500,000
ワキタ	8,700	1,049.00	9,126,300
ヤマトインターナショナル	9,300	314.00	2,920,200

東邦ホールディングス	13,100	1,703.00	22,309,300
サンゲツ	10,800	1,567.00	16,923,600
ミツウロコグループホールディングス	6,000	1,246.00	7,476,000
シナネンホールディングス	1,500	3,410.00	5,115,000
伊藤忠エネクス	9,000	975.00	8,775,000
サンリオ	12,600	2,823.00	35,569,800
サンワテクノス	2,500	1,717.00	4,292,500
リョーサン	4,500	2,250.00	10,125,000
新光商事	6,100	899.00	5,483,900
トーホー	2,000	1,484.00	2,968,000
三信電気	1,900	1,533.00	2,912,700
東陽テクニカ	4,000	1,139.00	4,556,000
モスフードサービス	5,300	3,090.00	16,377,000
加賀電子	3,700	3,055.00	11,303,500
三益半導体工業	3,200	2,523.00	8,073,600
都築電気	2,100	1,861.00	3,908,100
ソーダニッカ	3,800	669.00	2,542,200
立花エレテック	3,300	1,590.00	5,247,000
木曽路	5,300	2,201.00	11,665,300
S R Sホールディングス	5,500	777.00	4,273,500
千趣会	7,300	403.00	2,941,900
リテールパートナーズ	4,900	1,277.00	6,257,300
ケーヨー	7,500	820.00	6,150,000
上新電機	4,700	2,137.00	10,043,900
日本瓦斯	19,800	1,499.00	29,680,200
ロイヤルホールディングス	7,000	1,973.00	13,811,000
東天紅	2,800	1,091.00	3,054,800
いなげや	5,000	1,376.00	6,880,000
チヨダ	4,000	773.00	3,092,000
ライフコーポレーション	3,800	3,560.00	13,528,000
リンガーハット	5,000	2,229.00	11,145,000
MrMaxHD	5,100	572.00	2,917,200
AOKIホールディングス	7,900	665.00	5,253,500
オークワ	6,400	1,000.00	6,400,000
コメリ	6,300	2,572.00	16,203,600
青山商事	8,400	760.00	6,384,000
しまむら	4,700	9,820.00	46,154,000
はせがわ	11,400	253.00	2,884,200
高島屋	29,600	1,068.00	31,612,800
松屋	8,200	913.00	7,486,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	19,300	849.00	16,385,700
近鉄百貨店	1,600	2,619.00	4,190,400
丸井グループ	34,400	2,322.00	79,876,800
クレディセゾン	26,200	1,224.00	32,068,800
アクシアルリテイリング	3,200	3,350.00	10,720,000
イオン	156,600	2,719.50	425,873,700
イズミ	7,400	3,410.00	25,234,000
フォーバル	2,700	1,054.00	2,845,800
平和堂	7,500	1,904.00	14,280,000
フジ	4,900	1,949.00	9,550,100

ヤオコー	4,600	6,950.00	31,970,000
ゼビオホールディングス	5,500	914.00	5,027,000
ケーズホールディングス	37,500	1,209.00	45,337,500
PALTAC	5,700	4,900.00	27,930,000
三谷産業	9,100	313.00	2,848,300
日産東京販売ホールディングス	12,600	237.00	2,986,200
新生銀行	26,600	1,894.00	50,380,400
あおぞら銀行	22,800	2,591.00	59,074,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,613,400	629.30	1,644,612,620
りそなホールディングス	466,400	428.10	199,665,840
三井住友トラスト・ホールディングス	77,000	3,678.00	283,206,000
三井住友フィナンシャルグループ	282,100	3,825.00	1,079,032,500
千葉銀行	136,000	676.00	91,936,000
群馬銀行	78,300	339.00	26,543,700
武蔵野銀行	6,100	1,643.00	10,022,300
千葉興業銀行	11,300	261.00	2,949,300
七十七銀行	12,800	1,213.00	15,526,400
青森銀行	3,200	1,720.00	5,504,000
秋田銀行	2,600	1,467.00	3,814,200
山形銀行	4,600	834.00	3,836,400
岩手銀行	2,700	1,647.00	4,446,900
東邦銀行	34,000	200.00	6,800,000
みちのく銀行	3,500	799.00	2,796,500
ふくおかフィナンシャルグループ	34,300	1,948.00	66,816,400
静岡銀行	99,200	848.00	84,121,600
スルガ銀行	35,700	450.00	16,065,000
八十二銀行	91,800	372.00	34,149,600
山梨中央銀行	4,400	821.00	3,612,400
大垣共立銀行	8,000	1,865.00	14,920,000
福井銀行	3,500	1,422.00	4,977,000
清水銀行	1,700	1,559.00	2,650,300
富山銀行	1,600	1,867.00	2,987,200
滋賀銀行	7,700	1,840.00	14,168,000
南都銀行	6,400	1,875.00	12,000,000
百五銀行	39,100	326.00	12,746,600
京都銀行	14,600	4,945.00	72,197,000
紀陽銀行	14,400	1,414.00	20,361,600
ほくほくフィナンシャルグループ	25,400	807.00	20,497,800
山陰合同銀行	24,200	589.00	14,253,800
中国銀行	32,600	863.00	28,133,800
伊予銀行	54,000	553.00	29,862,000
百十四銀行	4,300	1,385.00	5,955,500
四国銀行	6,200	732.00	4,538,400
阿波銀行	6,200	2,122.00	13,156,400
大分銀行	2,300	1,783.00	4,100,900
宮崎銀行	2,500	1,990.00	4,975,000
佐賀銀行	2,300	1,405.00	3,231,500
琉球銀行	8,800	735.00	6,468,000
セブン銀行	121,000	233.00	28,193,000
みずほフィナンシャルグループ	521,200	1,460.00	760,952,000

山口フィナンシャルグループ	47,500	645.00	30,637,500	
芙蓉総合リース	4,300	7,770.00	33,411,000	
みずほリース	6,300	3,115.00	19,624,500	
東京センチュリー	7,900	5,790.00	45,741,000	
SBIホールディングス	50,300	2,979.00	149,843,700	
日本証券金融	16,000	867.00	13,872,000	
アイフル	68,400	385.00	26,334,000	
長野銀行	2,700	1,116.00	3,013,200	
名古屋銀行	3,000	2,200.00	6,600,000	
北洋銀行	61,400	224.00	13,753,600	
愛知銀行	1,500	3,590.00	5,385,000	
中京銀行	2,300	1,280.00	2,944,000	
大光銀行	2,200	1,301.00	2,862,200	
愛媛銀行	5,700	755.00	4,303,500	
京葉銀行	17,400	440.00	7,656,000	
栃木銀行	19,700	178.00	3,506,600	
北日本銀行	1,900	1,498.00	2,846,200	
東和銀行	7,200	501.00	3,607,200	
リコーリース	3,600	3,675.00	13,230,000	
イオンフィナンシャルサービス	22,200	1,322.00	29,348,400	
アコム	80,400	362.00	29,104,800	
ジャックス	4,500	2,929.00	13,180,500	
オリエントコーポレーション	110,200	135.00	14,877,000	
オリックス	247,400	2,356.50	582,998,100	
三菱HCキャピタル	150,500	556.00	83,678,000	
ジャフコグループ	5,200	7,600.00	39,520,000	
九州リースサービス	4,900	586.00	2,871,400	
トモニホールディングス	31,500	298.00	9,387,000	
大和証券グループ本社	305,200	645.70	197,067,640	
野村ホールディングス	622,200	493.20	306,869,040	
岡三証券グループ	32,100	386.00	12,390,600	
丸三証券	12,100	537.00	6,497,700	
東洋証券	19,600	150.00	2,940,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	46,800	388.00	18,158,400	
光世証券	4,400	531.00	2,336,400	
水戸証券	10,900	283.00	3,084,700	
いちよし証券	7,600	637.00	4,841,200	
松井証券	20,000	815.00	16,300,000	
SOMPOホールディングス	71,800	4,866.00	349,378,800	
日本取引所グループ	103,200	2,443.50	252,169,200	
マネックスグループ	33,200	846.00	28,087,200	
極東証券	5,500	755.00	4,152,500	
岩井コスモホールディングス	3,900	1,353.00	5,276,700	
アイザワ証券グループ	6,700	1,025.00	6,867,500	
フィデアホールディングス	3,700	1,219.00	4,510,300	
池田泉州ホールディングス	46,900	152.00	7,128,800	
アニコムホールディングス	12,500	805.00	10,062,500	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	91,400	3,549.00	324,378,600	

スパークス・グループ	18,800	325.00	6,110,000
第一生命ホールディングス	200,600	2,356.50	472,713,900
東京海上ホールディングス	134,200	6,087.00	816,875,400
イー・ギャランティ	6,000	2,626.00	15,756,000
アサックス	4,200	698.00	2,931,600
NECキャピタルソリューション	1,700	1,973.00	3,354,100
T&Dホールディングス	105,800	1,421.00	150,341,800
アドバンスクリエイト	2,100	1,026.00	2,154,600
三井不動産	185,800	2,543.00	472,489,400
三菱地所	267,700	1,657.50	443,712,750
平和不動産	7,000	3,405.00	23,835,000
東京建物	40,200	1,695.00	68,139,000
ダイビル	10,300	1,537.00	15,831,100
京阪神ビルディング	6,500	1,421.00	9,236,500
住友不動産	85,500	3,887.00	332,338,500
テーオーシー	7,300	603.00	4,401,900
東京楽天地	700	4,060.00	2,842,000
レオパレス21	42,300	216.00	9,136,800
スターツコーポレーション	5,500	2,624.00	14,432,000
フジ住宅	4,700	670.00	3,149,000
空港施設	5,200	554.00	2,880,800
ゴールドクレスト	3,200	1,550.00	4,960,000
リログループ	21,600	2,454.00	53,006,400
エスリード	1,800	1,651.00	2,971,800
日神グループホールディングス	6,600	490.00	3,234,000
日本エスコン	7,600	812.00	6,171,200
タカラレーベン	17,100	279.00	4,770,900
AVANTIA	3,400	866.00	2,944,400
イオンモール	20,400	1,711.00	34,904,400
ファースト住建	2,400	1,250.00	3,000,000
カチタス	10,100	4,750.00	47,975,000
東祥	2,900	1,931.00	5,599,900
トーセイ	5,600	1,059.00	5,930,400
穴吹興産	1,500	1,995.00	2,992,500
サンフロンティア不動産	5,600	1,027.00	5,751,200
FJネクストホールディングス	4,000	1,035.00	4,140,000
グランディハウス	6,000	494.00	2,964,000
東武鉄道	40,400	2,738.00	110,615,200
相鉄ホールディングス	13,200	2,087.00	27,548,400
東急	104,200	1,700.00	177,140,000
京浜急行電鉄	53,100	1,222.00	64,888,200
小田急電鉄	61,500	2,266.00	139,359,000
京王電鉄	21,400	5,300.00	113,420,000
京成電鉄	28,800	3,585.00	103,248,000
富士急行	4,900	4,885.00	23,936,500
新京成電鉄	1,500	2,036.00	3,054,000
東日本旅客鉄道	72,700	7,033.00	511,299,100
西日本旅客鉄道	50,100	5,217.00	261,371,700
東海旅客鉄道	34,400	16,660.00	573,104,000
西武ホールディングス	54,000	1,251.00	67,554,000

鴻池運輸	6,600	1,156.00	7,629,600
西日本鉄道	11,500	2,721.00	31,291,500
ハマキョウレックス	2,900	2,998.00	8,694,200
サカイ引越センター	1,900	4,400.00	8,360,000
近鉄グループホールディングス	39,100	3,435.00	134,308,500
阪急阪神ホールディングス	48,900	3,540.00	173,106,000
南海電気鉄道	17,500	2,202.00	38,535,000
京阪ホールディングス	17,400	2,775.00	48,285,000
神戸電鉄	900	3,415.00	3,073,500
名古屋鉄道	32,200	1,826.00	58,797,200
山陽電気鉄道	3,000	2,000.00	6,000,000
アルプス物流	3,000	995.00	2,985,000
トランコム	1,100	8,540.00	9,394,000
日本通運	13,500	6,900.00	93,150,000
ヤマトホールディングス	54,800	2,626.00	143,904,800
山九	10,900	4,695.00	51,175,500
日新	3,100	1,744.00	5,406,400
丸全昭和運輸	3,200	3,310.00	10,592,000
センコーグループホールディングス	19,600	943.00	18,482,800
トナミホールディングス	900	3,575.00	3,217,500
ニッコンホールディングス	13,100	2,113.00	27,680,300
日本石油輸送	300	2,679.00	803,700
福山通運	6,400	4,060.00	25,984,000
セイノーホールディングス	26,600	1,217.00	32,372,200
神奈川中央交通	1,000	3,375.00	3,375,000
日立物流	7,600	4,615.00	35,074,000
丸和運輸機関	8,300	1,505.00	12,491,500
C & F ロジホールディングス	4,000	1,608.00	6,432,000
日本郵船	32,700	7,570.00	247,539,000
商船三井	21,700	6,490.00	140,833,000
川崎汽船	12,100	4,865.00	58,866,500
NSユナイテッド海運	2,200	3,295.00	7,249,000
明治海運	4,700	714.00	3,355,800
飯野海運	18,200	518.00	9,427,600
九州旅客鉄道	30,300	2,576.00	78,052,800
S Gホールディングス	73,900	2,654.00	196,130,600
日本航空	89,700	2,358.00	211,512,600
A N Aホールディングス	99,400	2,655.00	263,907,000
パスコ	800	1,392.00	1,113,600
T R Eホールディングス	5,400	1,841.00	9,941,400
人・夢・技術グループ	1,600	1,888.00	3,020,800
西本W i s m e t t a cホールディングス	900	3,510.00	3,159,000
Genky DrugStores	1,800	5,620.00	10,116,000
国際紙パルプ商事	8,700	362.00	3,149,400
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,175.00	3,055,000
ブックオフグループホールディングス	2,900	996.00	2,888,400
三菱倉庫	12,400	2,978.00	36,927,200
三井倉庫ホールディングス	4,100	2,382.00	9,766,200
住友倉庫	13,800	1,924.00	26,551,200

澁澤倉庫	2,300	2,162.00	4,972,600
ヤマタネ	1,900	1,580.00	3,002,000
東陽倉庫	9,000	327.00	2,943,000
乾汽船	2,700	2,066.00	5,578,200
日本トランスシティ	8,600	598.00	5,142,800
中央倉庫	3,000	974.00	2,922,000
安田倉庫	3,200	957.00	3,062,400
東洋埠頭	2,100	1,427.00	2,996,700
宇徳	5,600	526.00	2,945,600
上組	21,500	2,195.00	47,192,500
近鉄エクスプレス	7,400	2,820.00	20,868,000
東海運	9,800	304.00	2,979,200
エーアイテイー	2,200	1,197.00	2,633,400
内外トランスライン	1,600	1,921.00	3,073,600
日本コンセプト	1,500	1,900.00	2,850,000
TBSホールディングス	24,700	1,913.00	47,251,100
日本テレビホールディングス	33,800	1,258.00	42,520,400
朝日放送グループホールディングス	4,200	708.00	2,973,600
テレビ朝日ホールディングス	9,700	1,631.00	15,820,700
スカパーJ S A Tホールディングス	34,300	422.00	14,474,600
テレビ東京ホールディングス	2,900	2,127.00	6,168,300
日本BS放送	2,600	1,124.00	2,922,400
ビジョン	6,900	1,410.00	9,729,000
USEN-NEXT HOLDINGS	3,900	3,555.00	13,864,500
コネクシオ	2,900	1,467.00	4,254,300
日本通信	33,700	264.00	8,896,800
日本電信電話	474,200	3,209.00	1,521,707,800
KDDI	295,600	3,420.00	1,010,952,000
ソフトバンク	614,100	1,593.50	978,568,350
光通信	4,800	18,450.00	88,560,000
エムティーアイ	4,600	625.00	2,875,000
GMOインターネット	14,400	3,140.00	45,216,000
ファイバーゲート	2,300	1,220.00	2,806,000
アйдママーケティングコミュニケーション	8,900	329.00	2,928,100
KADOKAWA	11,800	6,650.00	78,470,000
学研ホールディングス	5,700	1,072.00	6,110,400
ゼンリン	6,600	1,005.00	6,633,000
インプレスホールディングス	13,100	228.00	2,986,800
東京電力ホールディングス	309,200	308.00	95,233,600
中部電力	126,400	1,165.00	147,256,000
関西電力	156,500	1,023.00	160,099,500
中国電力	64,600	887.00	57,300,200
北陸電力	37,800	568.00	21,470,400
東北電力	96,800	760.00	73,568,000
四国電力	37,200	752.00	27,974,400
九州電力	85,200	816.00	69,523,200
北海道電力	35,900	472.00	16,944,800
沖縄電力	8,800	1,388.00	12,214,400

電源開発	35,200	1,447.00	50,934,400
エフオン	4,300	692.00	2,975,600
イーレックス	6,100	2,699.00	16,463,900
レノバ	8,100	5,570.00	45,117,000
東京瓦斯	79,200	1,980.00	156,816,000
大阪瓦斯	74,800	1,820.00	136,136,000
東邦瓦斯	19,000	3,120.00	59,280,000
北海道瓦斯	2,000	1,490.00	2,980,000
広島ガス	3,400	363.00	1,234,200
西部ガスホールディングス	4,700	2,189.00	10,288,300
静岡ガス	10,800	1,004.00	10,843,200
メタウォーター	4,600	2,035.00	9,361,000
アイネット	2,100	1,402.00	2,944,200
松竹	2,700	11,670.00	31,509,000
東宝	23,900	5,420.00	129,538,000
エイチ・アイ・エス	8,800	2,268.00	19,958,400
東映	1,300	20,230.00	26,299,000
ラックランド	1,100	2,992.00	3,291,200
エヌ・ティ・ティ・データ	107,900	2,550.00	275,145,000
共立メンテナンス	7,000	4,400.00	30,800,000
イチネンホールディングス	4,000	1,419.00	5,676,000
建設技術研究所	2,400	2,635.00	6,324,000
スペース	3,100	961.00	2,979,100
アインホールディングス	5,900	6,190.00	36,521,000
ピー・シー・エー	2,400	1,617.00	3,880,800
東京テアトル	2,400	1,246.00	2,990,400
タナベ経営	3,900	745.00	2,905,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,600	1,832.00	2,931,200
ナガワ	1,300	11,820.00	15,366,000
東京都競馬	3,000	4,220.00	12,660,000
カナモト	7,000	2,397.00	16,779,000
D T S	7,800	2,433.00	18,977,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	18,900	6,470.00	122,283,000
シーイーシー	4,300	1,336.00	5,744,800
カブコン	38,200	3,050.00	116,510,000
西尾レントオール	3,600	2,715.00	9,774,000
アイ・エス・ビー	2,700	1,107.00	2,988,900
日本空港ビルデング	15,500	5,700.00	88,350,000
トランス・コスモス	5,000	3,195.00	15,975,000
乃村工藝社	16,900	1,052.00	17,778,800
ジャステック	2,300	1,264.00	2,907,200
S C S K	28,100	2,246.00	63,112,600
藤田観光	1,700	2,497.00	4,244,900
K N T - C Tホールディングス	2,500	1,643.00	4,107,500
日本管財	4,200	2,844.00	11,944,800
トーカイ	3,500	2,072.00	7,252,000
セコム	38,900	7,987.00	310,694,300
日本システムウエア	1,500	2,355.00	3,532,500
セントラル警備保障	1,900	2,593.00	4,926,700

アイネス	3,700	1,473.00	5,450,100
丹青社	8,100	875.00	7,087,500
メイテック	4,800	6,960.00	33,408,000
T K C	6,900	3,375.00	23,287,500
富士ソフト	4,300	5,500.00	23,650,000
応用地質	4,400	1,982.00	8,720,800
船井総研ホールディングス	8,100	2,633.00	21,327,300
N S D	13,000	2,198.00	28,574,000
進学会ホールディングス	7,900	368.00	2,907,200
丸紅建材リース	1,600	1,823.00	2,916,800
コナミホールディングス	14,700	6,290.00	92,463,000
学究社	2,000	1,486.00	2,972,000
ベネッセホールディングス	13,200	2,317.00	30,584,400
イオンディライト	4,900	3,690.00	18,081,000
ナック	3,200	939.00	3,004,800
福井コンピュータホールディングス	1,900	4,000.00	7,600,000
ダイセキ	7,300	5,210.00	38,033,000
ステップ	1,600	1,850.00	2,960,000
日鉄物産	2,900	4,845.00	14,050,500
泉州電業	1,100	4,675.00	5,142,500
元気寿司	1,100	2,644.00	2,908,400
トラスコ中山	8,500	2,839.00	24,131,500
ヤマダホールディングス	148,800	408.00	60,710,400
オートバックスセブン	13,700	1,369.00	18,755,300
モリト	4,300	689.00	2,962,700
アークランドサカモト	6,400	1,790.00	11,456,000
ニトリホールディングス	16,100	20,845.00	335,604,500
グルメ杵屋	3,200	1,005.00	3,216,000
愛眼	14,800	198.00	2,930,400
吉野家ホールディングス	14,200	2,334.00	33,142,800
加藤産業	5,900	3,165.00	18,673,500
イノテック	2,500	1,464.00	3,660,000
イエローハット	7,000	1,627.00	11,389,000
松屋フーズホールディングス	2,000	3,545.00	7,090,000
J B C Cホールディングス	2,700	1,883.00	5,084,100
J Kホールディングス	3,300	1,032.00	3,405,600
サガミホールディングス	6,200	1,053.00	6,528,600
日伝	3,400	2,300.00	7,820,000
関西スーパーマーケット	3,100	1,504.00	4,662,400
ミロク情報サービス	3,600	1,708.00	6,148,800
北沢産業	11,800	253.00	2,985,400
杉本商事	1,900	2,266.00	4,305,400
因幡電機産業	10,900	2,555.00	27,849,500
王将フードサービス	2,700	6,130.00	16,551,000
プレナス	4,600	1,983.00	9,121,800
ミニストップ	3,000	1,401.00	4,203,000
アークス	7,800	2,146.00	16,738,800
パローホールディングス	9,000	2,272.00	20,448,000
東テク	1,300	2,524.00	3,281,200
ミスミグループ本社	51,100	5,050.00	258,055,000

ベルク	1,800	5,290.00	9,522,000	
タキヒヨー	1,700	1,762.00	2,995,400	
ファーストリテイリング	5,400	74,120.00	400,248,000	
ソフトバンクグループ	243,100	6,822.00	1,658,428,200	
蔵王産業	1,600	1,849.00	2,958,400	
スズケン	15,900	3,020.00	48,018,000	
サンドラッグ	15,300	3,180.00	48,654,000	
サックスパー ホールディングス	5,200	554.00	2,880,800	
ジェコス	3,700	807.00	2,985,900	
ヤマザワ	1,700	1,746.00	2,968,200	
やまや	1,200	2,412.00	2,894,400	
ベルーナ	8,700	712.00	6,194,400	
合計	45,302,900		115,648,485,140	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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11月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,018,046
コール・ローン	607,407,727
国債証券	58,968,646,420
地方債証券	4,888,143,254
特殊債券	7,581,022,859
社債券	5,100,841,500
未収入金	1,233,631,200
未収利息	183,564,011
前払費用	3,725,294
流動資産合計	78,571,000,311
資産合計	78,571,000,311
負債の部	
流動負債	
未払解約金	26,577,647
その他未払費用	851
流動負債合計	26,578,498
負債合計	26,578,498
純資産の部	
元本等	
元本	79,850,448,372
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,306,026,559
元本等合計	78,544,421,813
純資産合計	78,544,421,813
負債純資産合計	78,571,000,311

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	81,027,549,554円
同期中追加設定元本額	12,091,790,225円
同期中一部解約元本額	13,268,891,407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）	66,785,660,048円
DCニッセイ日本債券インデックス	3,222,758,768円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	96,226,092円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	5,195,971,979円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	177,258,641円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	792,116,955円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,738,282,881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）	192,477,647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）	20,449,309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）	64,432,042円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	56,352,722円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	41,584,210円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	58,616,659円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	193,258,066円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	1,215,002,353円
計	79,850,448,372円
2. 受益権の総数	79,850,448,372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1,306,026,559円であります。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、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。
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。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		28,842,050
地方債証券		13,273,952
特殊債券		19,918,354
社債券		19,189,600
合計		23,539,856

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年3月11日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

（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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額	0.9836円
（1万口当たり純資産額）	（9,836円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第419回 利付国債（2年）	15,000,000	15,036,600	
	第420回 利付国債（2年）	225,000,000	225,596,250	
	第421回 利付国債（2年）	229,000,000	229,638,910	
	第422回 利付国債（2年）	96,000,000	96,285,120	
	第424回 利付国債（2年）	150,000,000	150,300,000	
	第425回 利付国債（2年）	415,000,000	415,879,800	
	第426回 利付国債（2年）	413,000,000	413,925,120	
	第427回 利付国債（2年）	416,000,000	416,981,760	
	第428回 利付国債（2年）	399,000,000	399,989,520	
	第429回 利付国債（2年）	600,000,000	601,554,000	
	第430回 利付国債（2年）	200,000,000	200,542,000	
	第134回 利付国債（5年）	83,000,000	83,209,160	
	第135回 利付国債（5年）	130,000,000	130,393,900	
	第137回 利付国債（5年）	37,000,000	37,158,730	
	第138回 利付国債（5年）	81,000,000	81,395,280	
	第139回 利付国債（5年）	87,000,000	87,475,020	
	第140回 利付国債（5年）	322,000,000	323,909,460	
	第141回 利付国債（5年）	377,000,000	379,454,270	
	第142回 利付国債（5年）	160,000,000	161,134,400	
	第143回 利付国債（5年）	50,000,000	50,383,000	
	第1回 利付国債（40年）	90,000,000	129,019,500	
	第2回 利付国債（40年）	112,000,000	155,518,720	
	第3回 利付国債（40年）	113,000,000	157,716,360	
	第4回 利付国債（40年）	153,000,000	215,105,760	
	第5回 利付国債（40年）	158,000,000	215,015,880	
	第6回 利付国債（40年）	160,000,000	214,553,600	
	第7回 利付国債（40年）	175,000,000	225,884,750	
	第8回 利付国債（40年）	167,000,000	201,854,570	
	第9回 利付国債（40年）	283,000,000	257,017,770	
	第10回 利付国債（40年）	288,000,000	305,173,440	
	第11回 利付国債（40年）	199,000,000	204,464,540	

第12回 利付国債(40年)	2,000,000	1,856,920	
第13回 利付国債(40年)	170,000,000	157,348,600	
第14回 利付国債(40年)	58,000,000	57,380,560	
第327回 利付国債(10年)	372,000,000	375,708,840	
第328回 利付国債(10年)	430,000,000	434,110,800	
第329回 利付国債(10年)	229,000,000	232,329,660	
第330回 利付国債(10年)	3,000,000	3,050,940	
第332回 利付国債(10年)	138,000,000	140,092,080	
第333回 利付国債(10年)	114,000,000	115,934,580	
第334回 利付国債(10年)	618,000,000	629,630,760	
第335回 利付国債(10年)	480,000,000	488,563,200	
第336回 利付国債(10年)	230,000,000	234,466,600	
第337回 利付国債(10年)	386,000,000	391,114,500	
第338回 利付国債(10年)	585,000,000	595,231,650	
第339回 利付国債(10年)	536,000,000	545,991,040	
第340回 利付国債(10年)	566,000,000	577,297,360	
第341回 利付国債(10年)	552,000,000	561,367,440	
第342回 利付国債(10年)	510,000,000	514,646,100	
第343回 利付国債(10年)	461,000,000	465,338,010	
第344回 利付国債(10年)	533,000,000	538,031,520	
第345回 利付国債(10年)	532,000,000	537,144,440	
第346回 利付国債(10年)	523,000,000	528,308,450	
第347回 利付国債(10年)	433,000,000	437,602,790	
第348回 利付国債(10年)	499,000,000	504,399,180	
第349回 利付国債(10年)	570,000,000	576,258,600	
第350回 利付国債(10年)	744,000,000	752,258,400	
第351回 利付国債(10年)	570,000,000	576,395,400	

第352回 利付国債(10年)	556,000,000	562,282,800	
第353回 利付国債(10年)	543,000,000	549,363,960	
第354回 利付国債(10年)	518,000,000	524,091,680	
第355回 利付国債(10年)	422,000,000	426,806,580	
第356回 利付国債(10年)	418,000,000	422,589,640	
第357回 利付国債(10年)	429,000,000	433,508,790	
第358回 利付国債(10年)	525,000,000	530,244,750	
第359回 利付国債(10年)	337,000,000	340,033,000	
第360回 利付国債(10年)	293,000,000	295,323,490	
第361回 利付国債(10年)	457,000,000	460,098,460	
第362回 利付国債(10年)	354,000,000	355,968,240	
第363回 利付国債(10年)	643,000,000	645,752,040	
第364回 利付国債(10年)	51,000,000	51,148,920	
第1回 利付国債(30年)	10,000,000	12,218,800	
第2回 利付国債(30年)	82,000,000	98,420,500	
第3回 利付国債(30年)	123,000,000	147,127,680	
第4回 利付国債(30年)	79,000,000	99,459,420	
第5回 利付国債(30年)	104,000,000	125,167,120	
第6回 利付国債(30年)	78,000,000	96,027,360	
第7回 利付国債(30年)	39,000,000	47,927,490	
第8回 利付国債(30年)	21,000,000	24,828,300	
第9回 利付国債(30年)	12,000,000	13,670,760	
第10回 利付国債(30年)	21,000,000	23,258,970	
第11回 利付国債(30年)	30,000,000	35,328,300	
第12回 利付国債(30年)	32,000,000	39,271,040	
第13回 利付国債(30年)	39,000,000	47,526,180	
第14回 利付国債(30年)	59,000,000	74,918,790	
第15回 利付国債(30年)	76,000,000	97,732,200	
第16回 利付国債(30年)	53,000,000	68,409,750	
第17回 利付国債(30年)	54,000,000	69,220,980	
第18回 利付国債(30年)	76,000,000	96,703,160	
第19回 利付国債(30年)	55,000,000	70,212,450	
第20回 利付国債(30年)	65,000,000	84,993,350	
第21回 利付国債(30年)	66,000,000	84,736,740	
第22回 利付国債(30年)	79,000,000	103,929,240	
第23回 利付国債(30年)	85,000,000	112,200,850	
第24回 利付国債(30年)	70,000,000	92,642,200	
第25回 利付国債(30年)	78,000,000	101,150,400	

第26回	利付国債(30年)	154,000,000	202,546,960	
第27回	利付国債(30年)	148,000,000	197,927,800	
第28回	利付国債(30年)	194,000,000	260,596,320	
第29回	利付国債(30年)	208,000,000	277,280,640	
第30回	利付国債(30年)	219,000,000	289,436,970	
第31回	利付国債(30年)	215,000,000	281,486,600	
第32回	利付国債(30年)	268,000,000	356,732,120	
第33回	利付国債(30年)	299,000,000	383,407,700	
第34回	利付国債(30年)	276,000,000	365,412,960	
第35回	利付国債(30年)	304,000,000	392,606,880	
第36回	利付国債(30年)	287,000,000	371,888,860	
第37回	利付国債(30年)	311,000,000	397,986,700	
第38回	利付国債(30年)	207,000,000	261,356,130	
第39回	利付国債(30年)	192,000,000	246,737,280	
第40回	利付国債(30年)	165,000,000	208,845,450	
第41回	利付国債(30年)	147,000,000	183,338,400	
第42回	利付国債(30年)	151,000,000	188,514,440	
第43回	利付国債(30年)	143,000,000	178,708,530	
第44回	利付国債(30年)	146,000,000	182,635,780	
第45回	利付国債(30年)	190,000,000	229,776,500	
第46回	利付国債(30年)	226,000,000	273,480,340	
第47回	利付国債(30年)	206,000,000	254,045,380	
第48回	利付国債(30年)	216,000,000	257,106,960	
第49回	利付国債(30年)	231,000,000	275,074,800	
第50回	利付国債(30年)	212,000,000	223,607,000	
第51回	利付国債(30年)	214,000,000	201,112,920	
第52回	利付国債(30年)	222,000,000	218,381,400	
第53回	利付国債(30年)	204,000,000	205,115,880	
第54回	利付国債(30年)	213,000,000	223,837,440	
第55回	利付国債(30年)	201,000,000	211,080,150	
第56回	利付国債(30年)	205,000,000	214,887,150	
第57回	利付国債(30年)	208,000,000	217,869,600	
第58回	利付国債(30年)	257,000,000	268,680,650	
第59回	利付国債(30年)	199,000,000	202,862,590	
第60回	利付国債(30年)	181,000,000	193,098,040	
第61回	利付国債(30年)	178,000,000	180,880,040	
第62回	利付国債(30年)	175,000,000	168,714,000	
第63回	利付国債(30年)	188,000,000	176,186,080	
第64回	利付国債(30年)	191,000,000	178,487,590	
第65回	利付国債(30年)	169,000,000	157,658,410	
第66回	利付国債(30年)	174,000,000	162,237,600	
第67回	利付国債(30年)	220,000,000	216,046,600	
第68回	利付国債(30年)	223,000,000	218,963,700	
第69回	利付国債(30年)	215,000,000	216,831,800	
第70回	利付国債(30年)	209,000,000	210,536,150	
第71回	利付国債(30年)	213,000,000	214,312,080	
第72回	利付国債(30年)	80,000,000	80,396,000	
第61回	利付国債(20年)	139,000,000	141,062,760	
第62回	利付国債(20年)	218,000,000	221,169,720	
第70回	利付国債(20年)	437,000,000	465,505,510	

第71回 利付国債(20年)	52,000,000	55,123,640	
第72回 利付国債(20年)	149,000,000	158,387,000	
第73回 利付国債(20年)	126,000,000	134,254,260	
第74回 利付国債(20年)	80,000,000	85,487,200	
第75回 利付国債(20年)	80,000,000	85,929,600	
第76回 利付国債(20年)	115,000,000	122,757,900	
第77回 利付国債(20年)	83,000,000	88,875,570	
第78回 利付国債(20年)	84,000,000	90,066,480	
第79回 利付国債(20年)	69,000,000	74,230,890	
第80回 利付国債(20年)	86,000,000	92,827,540	
第81回 利付国債(20年)	64,000,000	69,182,720	
第82回 利付国債(20年)	104,000,000	112,821,280	
第83回 利付国債(20年)	102,000,000	111,217,740	
第84回 利付国債(20年)	124,000,000	134,698,720	
第85回 利付国債(20年)	136,000,000	149,038,320	
第86回 利付国債(20年)	145,000,000	160,159,750	
第87回 利付国債(20年)	122,000,000	134,225,620	
第88回 利付国債(20年)	249,000,000	276,434,820	
第89回 利付国債(20年)	189,000,000	208,954,620	
第90回 利付国債(20年)	260,000,000	288,904,200	
第91回 利付国債(20年)	185,000,000	206,461,850	
第92回 利付国債(20年)	336,000,000	373,484,160	
第93回 利付国債(20年)	219,000,000	243,455,730	
第94回 利付国債(20年)	267,000,000	298,244,340	
第95回 利付国債(20年)	229,000,000	259,637,910	
第96回 利付国債(20年)	134,000,000	150,427,060	
第97回 利付国債(20年)	196,000,000	222,138,560	
第98回 利付国債(20年)	166,000,000	187,166,660	
第99回 利付国債(20年)	303,000,000	343,192,950	
第100回 利付国債(20年)	252,000,000	288,300,600	
第101回 利付国債(20年)	175,000,000	202,429,500	
第102回 利付国債(20年)	182,000,000	211,600,480	
第103回 利付国債(20年)	131,000,000	151,441,240	
第104回 利付国債(20年)	104,000,000	118,855,360	
第105回 利付国債(20年)	88,000,000	101,019,600	
第106回 利付国債(20年)	64,000,000	73,907,200	
第107回 利付国債(20年)	85,000,000	98,037,300	
第108回 利付国債(20年)	99,000,000	112,778,820	
第109回 利付国債(20年)	79,000,000	90,347,560	
第110回 利付国債(20年)	191,000,000	221,241,030	

第111回 利付国債(20年)	137,000,000	160,361,240	
第112回 利付国債(20年)	197,000,000	229,095,240	
第113回 利付国債(20年)	333,000,000	388,914,030	
第114回 利付国債(20年)	200,000,000	234,466,000	
第115回 利付国債(20年)	138,000,000	162,897,960	
第116回 利付国債(20年)	160,000,000	189,593,600	
第117回 利付国債(20年)	238,000,000	280,037,940	
第118回 利付国債(20年)	155,000,000	181,642,950	
第119回 利付国債(20年)	140,000,000	161,665,000	
第120回 利付国債(20年)	145,000,000	164,952,000	
第121回 利付国債(20年)	221,000,000	257,814,180	
第122回 利付国債(20年)	160,000,000	185,243,200	
第123回 利付国債(20年)	257,000,000	305,400,810	
第124回 利付国債(20年)	170,000,000	200,477,600	
第125回 利付国債(20年)	193,000,000	231,806,510	
第126回 利付国債(20年)	179,000,000	211,665,710	
第127回 利付国債(20年)	189,000,000	221,736,690	
第128回 利付国債(20年)	253,000,000	297,576,070	
第129回 利付国債(20年)	169,000,000	197,167,230	
第130回 利付国債(20年)	250,000,000	292,330,000	
第131回 利付国債(20年)	164,000,000	190,167,840	
第132回 利付国債(20年)	95,000,000	110,374,800	
第133回 利付国債(20年)	156,000,000	182,807,040	
第134回 利付国債(20年)	164,000,000	192,668,840	
第135回 利付国債(20年)	114,000,000	132,762,120	

第136回 利付国債(20年)	118,000,000	136,214,480	
第137回 利付国債(20年)	35,000,000	40,856,900	
第138回 利付国債(20年)	39,000,000	44,710,770	
第139回 利付国債(20年)	42,000,000	48,588,960	
第140回 利付国債(20年)	104,000,000	121,684,160	
第141回 利付国債(20年)	163,000,000	191,138,690	
第142回 利付国債(20年)	95,000,000	112,437,250	
第143回 利付国債(20年)	160,000,000	186,232,000	
第144回 利付国債(20年)	98,000,000	112,974,400	
第145回 利付国債(20年)	255,000,000	300,290,550	
第146回 利付国債(20年)	243,000,000	286,749,720	
第147回 利付国債(20年)	266,000,000	311,360,980	
第148回 利付国債(20年)	235,000,000	272,708,100	
第149回 利付国債(20年)	254,000,000	295,211,500	
第150回 利付国債(20年)	274,000,000	315,497,300	
第151回 利付国債(20年)	267,000,000	301,010,460	
第152回 利付国債(20年)	251,000,000	283,190,750	
第153回 利付国債(20年)	256,000,000	292,620,800	
第154回 利付国債(20年)	242,000,000	273,626,980	
第155回 利付国債(20年)	269,000,000	297,027,110	
第156回 利付国債(20年)	226,000,000	230,684,980	
第157回 利付国債(20年)	234,000,000	231,865,920	
第158回 利付国債(20年)	220,000,000	227,209,400	
第159回 利付国債(20年)	203,000,000	212,392,810	
第160回 利付国債(20年)	178,000,000	188,840,200	

	第161回 利付国債(20年)	189,000,000	197,433,180	
	第162回 利付国債(20年)	212,000,000	221,270,760	
	第163回 利付国債(20年)	215,000,000	224,199,850	
	第164回 利付国債(20年)	298,000,000	305,604,960	
	第165回 利付国債(20年)	274,000,000	280,655,460	
	第166回 利付国債(20年)	262,000,000	276,567,200	
	第167回 利付国債(20年)	278,000,000	284,029,820	
	第168回 利付国債(20年)	245,000,000	245,793,800	
	第169回 利付国債(20年)	266,000,000	261,847,740	
	第170回 利付国債(20年)	239,000,000	234,827,060	
	第171回 利付国債(20年)	254,000,000	249,087,640	
	第172回 利付国債(20年)	243,000,000	242,171,370	
	第173回 利付国債(20年)	309,000,000	307,405,560	
	第174回 利付国債(20年)	305,000,000	303,142,550	
	第175回 利付国債(20年)	287,000,000	290,027,850	
	第176回 利付国債(20年)	292,000,000	294,855,760	
	第177回 利付国債(20年)	266,000,000	263,369,260	
	第178回 利付国債(20年)	95,000,000	95,689,700	
	国債証券 合計	54,444,000,000	58,968,646,420	
地方債証券	第730回 東京都公募公債	300,000,000	304,580,100	
	第34回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,557,100	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	304,308,300	
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,401,600	
	第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	145,994,256	
	第448回 大阪府公募公債(10年)	38,000,000	37,671,908	
	第455回 大阪府公募公債(10年)	180,000,000	180,043,560	

第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	114,457,600	
平成29年度第5回 京都府公募公債（20年）	100,000,000	103,941,100	
第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	115,226,100	
平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	106,873,000	
平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,520,900	
平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	120,793,330	
平成20年度第1回 福岡県公募公債	100,000,000	114,815,600	
平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	115,403,400	
第10回 群馬県公募公債	300,000,000	303,975,900	
第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,067,400	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,976,400	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	151,844,250	
第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,196,600	
第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	129,098,200	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	319,742,400	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	101,536,800	
第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,233,100	
第26回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,333,300	
第9回 川崎市公募公債（20年）	100,000,000	117,383,800	
第4回 川崎市公募公債（30年）	100,000,000	130,224,900	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	152,272,950	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,087,400	
平成30年度第5回 広島市公募公債	200,000,000	201,902,000	
平成29年度第1回 仙台市公募公債（20年）	100,000,000	103,680,000	
地方債証券 合計	4,631,000,000	4,888,143,254	
特殊債券			
第9回 新関西国際空港	300,000,000	322,889,400	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	310,535,700	
第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,590,100	

第115回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,344,900	
第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,764,400	
第205回 政保道路機構債券	100,000,000	115,539,500	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	115,266,100	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	508,882,000	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	113,416,700	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	182,259,053	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	98,878,600	
第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,982,600	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	103,255,300	
第17回 地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	233,458,200	
第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	404,835,600	
第1回 地方公共団体金融機構債券(30年)	100,000,000	126,621,600	
第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,735,400	
第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,129,162	
第120回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,649,800	
第136回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,402,400	
第16回 公営企業債券	200,000,000	217,039,000	
第97回 都市再生債券	100,000,000	106,997,300	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	200,611,400	
第59回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,099,400	
第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,012,194,000	
第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,490,500	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,872,000	24,161,980	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,904,000	61,059,768	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,631,000	72,755,723	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,834,000	64,058,202	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,376,000	73,378,995	
第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,986,000	78,040,432	
第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,068,000	37,882,220	

	第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	309,576,000	324,559,478	
	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	193,965,000	202,363,684	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	125,787,000	132,315,345	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	110,802,000	115,222,999	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	222,393,000	223,082,418	
	い第845号 利付商工債券	200,000,000	200,714,200	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	100,171,100	
	第344回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,166,100	
	第353回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,152,700	
	第116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,069,400	
	特殊債券 合計	7,234,194,000	7,581,022,859	
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	301,314,000	
	第13回 クレディ・アグリコル	100,000,000	100,153,800	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	202,165,000	
	第25回 首都高速道路債券	400,000,000	400,146,800	
	第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	203,110,200	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	101,601,800	
	第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	101,383,200	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,105,600	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	204,015,000	
	第14回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,838,500	
	第5回 電通グループ	400,000,000	402,689,600	
	第24回 豊田自動織機	100,000,000	101,156,700	
	第1回 オリックス銀行	200,000,000	200,732,600	
	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	101,401,800	
	第29回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	107,544,400	
	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	101,501,900	
	第8回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	100,000,000	106,006,400	
	第18回 NTTファイナンス	100,000,000	101,009,300	
	第96回 トヨタファイナンス	100,000,000	99,861,600	
	第6回 三井住友海上火災保険	100,000,000	100,163,600	
	第66回 三井不動産	100,000,000	100,695,000	
	第7回 野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	230,571,400	

第77回 東京急行電鉄	100,000,000	101,455,200	
第27回 KDDI	200,000,000	201,240,400	
第510回 関西電力	100,000,000	101,651,400	
第381回 中国電力	200,000,000	204,413,000	
第304回 北陸電力	100,000,000	101,843,300	
第306回 北陸電力	100,000,000	102,076,300	
第253回 四国電力	200,000,000	203,030,000	
第429回 九州電力	200,000,000	204,856,600	
第331回 北海道電力	100,000,000	101,111,800	
第13回 電源開発	100,000,000	106,995,300	
社債券 合計	5,000,000,000	5,100,841,500	
合計		76,538,654,033	

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。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,445,296
コール・ローン	369,655,191
投資証券	31,590,841,400
未収配当金	150,637,686
流動資産合計	32,113,579,573
資産合計	32,113,579,573
負債の部	
流動負債	
未払解約金	76,653,844
その他未払費用	376
流動負債合計	76,654,220
負債合計	76,654,220
純資産の部	
元本等	
元本	16,553,467,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,483,458,319
元本等合計	32,036,925,353
純資産合計	32,036,925,353
負債純資産合計	32,113,579,573

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,261,892,310円
同期中追加設定元本額	7,821,681,126円
同期中一部解約元本額	7,530,106,402円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,369,863,917円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,254,523,882円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	8,051,991,861円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02（適格機関投資家限定）	1,744,832,702円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,593,687,653円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,391,874,106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）	96,254,021円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	10,992,362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）	4,097,440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）	6,900,140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）	28,228,485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）	71,012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）	149,453円
計	16,553,467,034円
2. 受益権の総数	16,553,467,034口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、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。
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。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	68,620,137
合計	68,620,137

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年11月13日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

（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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額	1.9354円
（1万口当たり純資産額）	（19,354円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	1,087	236,422,500	
	GLP投資法人	9,094	1,680,571,200	
	NTT都市開発リート投資法人	2,691	413,068,500	
	Oneリート投資法人	487	146,100,000	
	SOSILA物流リート投資法人	1,178	194,605,600	
	いちごオフィスリート投資法人	2,301	199,266,600	
	いちごホテルリート投資法人	465	41,896,500	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	1,496	679,932,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,807	1,006,309,500	
	イオンリート投資法人	3,302	514,451,600	
	インヴィンシブル投資法人	12,358	521,507,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	565	78,026,500	
	オリックス不動産投資法人	5,594	1,022,583,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,950	236,925,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	869	614,383,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人	1,918	413,904,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,121	316,234,100	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	1,264	409,536,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	636	77,528,400	

サンケイリアルエステート投資法人	889	109,435,900	
ザイマックス・リート投資法人	408	46,879,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,602	557,409,600	
ジャパンエクセレント投資法人	2,605	356,624,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,808	1,895,400,000	
スターアジア不動産投資法人	2,902	177,892,600	
スターツプロシード投資法人	437	101,340,300	
タカラレーベン不動産投資法人	1,107	125,201,700	
トーセイ・リート投資法人	587	75,488,200	
ヒューリックリート投資法人	2,619	447,063,300	
フロンティア不動産投資法人	984	503,808,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	599	95,959,800	
マリモ地方創生リート投資法人	263	35,294,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,321	885,572,100	
ラサールロジポート投資法人	3,437	653,373,700	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,095	180,894,000	
阪急阪神リート投資法人	1,268	213,784,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,044	620,136,000	
三菱地所物流リート投資法人	714	340,578,000	
産業ファンド投資法人	3,986	831,081,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	659	87,778,800	
森トラスト総合リート投資法人	2,007	289,008,000	
森ヒルズリート投資法人	3,302	509,168,400	
星野リゾート・リート投資法人	433	290,110,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,523	725,307,300	
大江戸温泉リート投資法人	453	36,421,200	
大和ハウスリート投資法人	4,216	1,359,660,000	
大和証券オフィス投資法人	594	437,184,000	
大和証券リビング投資法人	3,794	425,686,800	
投資法人みらい	3,201	165,811,800	
東海道リート投資法人	215	23,005,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,882	358,709,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	969	625,005,000	
日本ビルファンド投資法人	3,182	2,300,586,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,845	767,520,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,448	1,699,136,000	
日本リート投資法人	866	363,287,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,835	607,385,000	
日本都市ファンド投資法人	14,167	1,420,950,100	

	福岡リート投資法人	1,452	241,612,800	
	平和不動産リート投資法人	1,819	288,311,500	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,080	1,512,728,000	
投資証券	合計	162,800	31,590,841,400	
合計			31,590,841,400	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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
貸借対照表

(単位：円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,830,089,085
金銭信託	29,112,823
コール・ローン	4,400,983,811
株式	487,369,676,341
投資証券	11,043,955,063
派生商品評価勘定	563,191,191
未収入金	17,257,107
未収配当金	452,315,583
差入委託証拠金	8,710,888,281
流動資産合計	514,417,469,285
資産合計	
514,417,469,285	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,268,200
未払金	1,243,949
未払解約金	631,988,046
その他未払費用	5,753
流動負債合計	655,505,948
負債合計	
655,505,948	
純資産の部	
元本等	
元本	174,007,653,499
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	339,754,309,838
元本等合計	513,761,963,337
純資産合計	513,761,963,337
負債純資産合計	514,417,469,285

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	145,169,780,539円
同期中追加設定元本額	55,097,619,773円
同期中一部解約元本額	26,259,746,813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）	773,420,733円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,492,406,987円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,922,882,164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）	1,788,512,420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）	1,498,948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）	9,984,994円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	11,726,239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）	10,878,039,552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	122,197,928,567円
DCニッセイ外国株式インデックス	27,196,292,331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)	1,437,543,963円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	197,151,288円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	144,457,796円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	218,012,951円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	458,538,673円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	38,683,975円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	64,661,782円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,544,776円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	7,317,522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)	2,727,779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)	18,791,742円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	129,686,377円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	90,287,551円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	189,928,484円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	184,089,952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)	237,940,760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)	245,015,301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)	140,681,761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)	239,598,388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)	234,179,609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)	215,312,521円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適 格機関投資家限定)	200,685,991円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	33,783,784円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	337,838円
計	174,007,653,499円
2. 受益権の総数	174,007,653,499口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	51,860,673,120	
投資証券	1,215,420,725	
合計	53,076,093,845	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年5月21日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年11月22日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	306,202,827	-	305,827,032	375,795
アメリカ・ドル	306,202,827	-	305,827,032	375,795
買建	3,880,274,357	-	3,873,047,565	7,226,792
アメリカ・ドル	2,373,794,686	-	2,373,496,104	298,582
イギリス・ポンド	545,076,046	-	546,661,733	1,585,687
ユーロ	961,403,625	-	952,889,728	8,513,897
合計	4,186,477,184	-	4,178,874,597	6,850,997

（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11月22日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	14,175,179,278	-	14,722,953,265	547,773,987
合計	14,175,179,278	-	14,722,953,265	547,773,987

(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。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額	2.9525円
(1万口当たり純資産額)	(29,525円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年11月22日現在

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	5,602	149.960	840,075.92	
	3M CO	43,773	179.230	7,845,434.79	
	ABBOTT LABORATORIES	134,116	126.840	17,011,273.44	
	ABBVIE INC	133,356	116.240	15,501,301.44	
	ABIOMED INC	3,414	339.990	1,160,725.86	
	ACCENTURE PLC	47,954	369.790	17,732,909.66	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	58,618	62.380	3,656,590.84	
	ADOBE INC	36,055	688.370	24,819,180.35	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,929	230.000	1,133,670.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	91,724	155.410	14,254,826.84	
	AES CORP	50,509	24.580	1,241,511.22	
	AFLAC INC	48,552	55.440	2,691,722.88	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	22,988	164.300	3,776,928.40	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,722	297.740	4,978,808.28	
	AIRBNB INC-CLASS A	9,476	196.420	1,861,275.92	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	12,265	110.980	1,361,169.70	
	ALBEMARLE CORP	8,801	281.430	2,476,865.43	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	5,669	683.290	3,873,571.01	
	ALLEGHANY CORP	1,036	676.480	700,833.28	
	ALLEGION PLC	6,878	133.800	920,276.40	
	ALLIANT ENERGY CORP	18,885	56.790	1,072,479.15	
	ALLSTATE CORP	22,497	111.940	2,518,314.18	
	ALLY FINANCIAL INC	27,934	47.930	1,338,876.62	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,885	181.000	1,608,185.00	
	ALPHABET INC-CL A	22,695	2,978.530	67,597,738.35	
	ALPHABET INC-CL C	21,984	2,999.050	65,931,115.20	

ALTICE USA INC- A	16,550	16.840	278,702.00	
ALTRIA GROUP INC	139,849	43.400	6,069,446.60	
AMAZON.COM INC	34,262	3,676.570	125,966,641.34	
AMC ENTERTAINMENT HLDS- CL A	37,906	40.870	1,549,218.22	
AMCOR PLC	117,324	11.900	1,396,155.60	
AMERCO	779	742.860	578,687.94	
AMEREN CORPORATION	19,283	85.380	1,646,382.54	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	37,748	83.380	3,147,428.24	
AMERICAN EXPRESS CO	51,582	173.540	8,951,540.28	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,397	140.450	758,008.65	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	64,732	54.950	3,557,023.40	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,701	173.380	2,375,479.38	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,711	299.550	2,609,380.05	
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,716	120.520	1,412,012.32	
AMETEK INC	17,435	142.480	2,484,138.80	
AMGEN INC	43,368	206.080	8,937,277.44	
AMPHENOL CORP-CL A	45,160	85.140	3,844,922.40	
ANALOG DEVICES INC	40,643	188.800	7,673,398.40	
ANSYS INC	6,572	402.520	2,645,361.44	
ANTHEM INC	18,471	415.210	7,669,343.91	
AON PLC	17,029	296.790	5,054,036.91	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	13,243	74.950	992,562.85	
APPLE INC	1,259,625	160.550	202,232,793.75	
APPLIED MATERIALS INC	69,234	150.030	10,387,177.02	
APTIV PLC	20,443	176.060	3,599,194.58	
ARAMARK	17,397	36.490	634,816.53	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	30,294	42.060	1,274,165.64	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,100	65.340	2,750,814.00	
ARISTA NETWORKS INC	17,248	128.960	2,224,302.08	
ARROW ELECTRONICS INC	5,514	126.220	695,977.08	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,530	163.410	2,537,757.30	
ASSURANT INC	4,554	159.480	726,271.92	
AT&T INC	539,711	24.130	13,023,226.43	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,024	85.730	859,357.52	
ATMOS ENERGY CORP	9,864	94.900	936,093.60	
AUTODESK INC	16,610	322.520	5,357,057.20	
AUTOLIV INC	6,346	105.160	667,345.36	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	32,113	237.910	7,640,003.83	
AUTOZONE INC	1,631	1,859.680	3,033,138.08	
AVALARA INC	6,491	150.120	974,428.92	

AVANTOR INC	39,637	39.660	1,572,003.42	
AVERY DENNISON CORP	6,264	218.520	1,368,809.28	
BAKER HUGHES COMPANY	55,616	22.550	1,254,140.80	
BALL CORP	24,857	95.700	2,378,814.90	
BANK OF AMERICA CORP	581,947	45.400	26,420,393.80	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	62,792	57.070	3,583,539.44	
BATH & BODY WORKS INC	19,955	76.410	1,524,761.55	
BAXTER INTERNATIONAL INC	38,003	79.260	3,012,117.78	
BECTON DICKINSON & CO	21,962	248.610	5,459,972.82	
BENTLEY SYSTEMS INC- CLASS B	12,993	55.170	716,823.81	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	100,137	279.990	28,037,358.63	
BEST BUY CO INC	16,975	136.130	2,310,806.75	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,677	776.630	1,302,408.51	
BIO-TECHNE CORP	2,932	501.500	1,470,398.00	
BIOGEN INC	11,357	257.190	2,920,906.83	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,808	91.470	1,263,017.76	
BLACK KNIGHT INC	11,829	74.690	883,508.01	
BLACKROCK INC	11,503	914.950	10,524,669.85	
BLACKSTONE INC	51,597	146.440	7,555,864.68	
BOEING CO	42,007	214.130	8,994,958.91	
BOOKING HOLDINGS INC	3,099	2,339.990	7,251,629.01	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,281	87.340	897,942.54	
BORGWARNER INC	18,183	45.860	833,872.38	
BOSTON BEER COMPANY INC- A	684	464.750	317,889.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,259	41.030	4,400,836.77	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	168,754	57.830	9,759,043.82	
BROADCOM INC	30,842	568.720	17,540,462.24	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,794	174.130	1,531,299.22	
BROWN & BROWN INC	17,950	64.540	1,158,493.00	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	23,412	75.230	1,761,284.76	
BUNGE LIMITED	10,608	94.110	998,318.88	
BURLINGTON STORES INC	5,035	264.970	1,334,123.95	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,488	96.270	1,009,679.76	
CABLE ONE INC	412	1,829.720	753,844.64	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	20,928	188.120	3,936,975.36	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,742	95.400	1,501,786.80	
CAMPBELL SOUP CO	14,927	40.580	605,737.66	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,058	151.320	5,153,656.56	
CARDINAL HEALTH INC	21,977	48.440	1,064,565.88	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,112	59.000	714,608.00	
CARMAX INC	12,326	146.990	1,811,798.74	
CARNIVAL CORP	62,434	20.490	1,279,272.66	
CARRIER GLOBAL CORP	62,404	57.150	3,566,388.60	
CARVANA CO	5,508	291.720	1,606,793.76	
CATALENT INC	12,885	127.110	1,637,812.35	
CATERPILLAR INC	41,374	200.440	8,293,004.56	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,044	129.480	1,041,537.12	
CBRE GROUP INC	25,359	99.690	2,528,038.71	
CDW CORP/DE	10,590	196.060	2,076,275.40	
CELANESE CORP-SERIES A	8,494	165.740	1,407,795.56	
CENTENE CORP	43,987	73.010	3,211,490.87	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,968	26.550	1,167,350.40	
CENTURYLINK INC	71,742	13.340	957,038.28	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,150	114.880	1,166,032.00	
CERNER CORP	22,603	72.740	1,644,142.22	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,150	65.190	1,052,818.50	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,788	379.880	1,438,985.44	
CHARLES SCHWAB CORP	109,093	80.170	8,745,985.81	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,962	682.340	6,797,471.08	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,252	115.310	951,538.12	
CHENIERE ENERGY INC	18,236	104.230	1,900,738.28	
CHEVRON CORP	145,859	111.910	16,323,080.69	
CHEWY INC - CLASS A	6,701	72.920	488,636.92	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,122	1,754.900	3,723,897.80	
CHUBB LTD	33,898	188.250	6,381,298.50	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,546	92.230	1,710,497.58	
CIGNA CORP	25,908	210.510	5,453,893.08	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,513	118.810	1,367,859.53	
CINTAS CORP	7,140	446.050	3,184,797.00	
CISCO SYSTEMS INC	317,990	53.250	16,932,967.50	
CITIGROUP INC	155,966	66.340	10,346,784.44	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	31,945	49.610	1,584,791.45	
CITRIX SYSTEMS INC	9,379	85.100	798,152.90	
CLARIVATE PLC	26,790	23.450	628,225.50	
CLOROX CO	9,419	166.980	1,572,784.62	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,385	211.040	3,668,930.40	
CME GROUP INC	27,122	223.310	6,056,613.82	
CMS ENERGY CORP	21,964	60.900	1,337,607.60	
COCA-COLA CO	309,385	55.130	17,056,395.05	

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	15,485	51.790	801,968.15	
COGNEX CORP	13,292	79.970	1,062,961.24	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	39,764	81.990	3,260,250.36	
COLGATE-PALMOLIVE CO	60,773	77.200	4,691,675.60	
COMCAST CORP	345,952	51.910	17,958,368.32	
CONAGRA BRANDS INC	36,258	30.720	1,113,845.76	
CONOCOPHILLIPS	101,536	69.610	7,067,920.96	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,908	78.030	2,021,601.24	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,854	235.400	3,025,831.60	
COOPER COS INC/THE	3,700	405.070	1,498,759.00	
COPART INC	16,053	152.410	2,446,637.73	
CORNING INC	61,093	37.650	2,300,151.45	
CORTEVA INC	55,545	47.810	2,655,606.45	
COSTAR GROUP INC	29,851	81.570	2,434,946.07	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,374	533.790	17,814,707.46	
COUPA SOFTWARE INC	5,515	212.880	1,174,033.20	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,280	257.630	3,678,956.40	
CROWN HOLDINGS INC	10,252	111.550	1,143,610.60	
CSX CORP	173,782	36.080	6,270,054.56	
CUMMINS INC	11,050	223.890	2,473,984.50	
CVS HEALTH CORP	99,388	93.160	9,258,986.08	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,012	195.760	589,629.12	
DANAHER CORP	48,443	314.130	15,217,399.59	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,847	143.160	1,409,696.52	
DATADOG INC - CLASS A	14,129	192.600	2,721,245.40	
DAVITA INC	5,187	99.550	516,365.85	
DEERE & CO	22,487	346.150	7,783,875.05	
DELL TECHNOLOGIES -C	20,949	55.020	1,152,613.98	
DELTA AIR LINES INC	12,218	39.690	484,932.42	
DENTSPLY SIRONA INC	16,447	52.690	866,592.43	
DEVON ENERGY CORPORATION	48,082	40.600	1,952,129.20	
DEXCOM INC	7,301	641.180	4,681,255.18	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,055	114.380	2,637,030.90	
DISCOVERY INC-A	12,647	25.260	319,463.22	
DISCOVERY INC-C	23,586	24.730	583,281.78	
DISH NETWORK CORP	18,537	33.580	622,472.46	
DOCUSIGN INC	14,682	263.340	3,866,357.88	
DOLLAR GENERAL CORP	17,828	224.550	4,003,277.40	
DOLLAR TREE INC	17,505	134.960	2,362,474.80	
DOMINION ENERGY INC	60,993	74.190	4,525,070.67	
DOMINO'S PIZZA INC	2,930	535.590	1,569,278.70	
DOORDASH INC - A	5,562	215.250	1,197,220.50	
DOVER CORP	10,837	176.050	1,907,853.85	

DOW INC	56,419	57.340	3,235,065.46	
DR HORTON INC	25,862	102.170	2,642,320.54	
DRAFTKINGS INC - CL A	24,176	36.140	873,720.64	
DROPBOX INC-CLASS A	23,962	25.030	599,768.86	
DTE ENERGY COMPANY	14,675	111.180	1,631,566.50	
DUKE ENERGY CORP	58,084	98.420	5,716,627.28	
DUPONT DE NEMOURS INC	40,133	80.020	3,211,442.66	
DYNATRACE INC	13,848	66.980	927,539.04	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,321	113.180	1,168,130.78	
EATON CORP PLC	30,070	172.300	5,181,061.00	
EBAY INC	51,369	74.630	3,833,668.47	
ECOLAB INC	19,459	234.860	4,570,140.74	
EDISON INTERNATIONAL	28,836	64.900	1,871,456.40	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	46,891	117.030	5,487,653.73	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	32,202	32.110	1,034,006.22	
ELECTRONIC ARTS INC	21,662	132.390	2,867,832.18	
ELI LILLY & CO	61,532	260.700	16,041,392.40	
EMERSON ELECTRIC CO	45,294	93.340	4,227,741.96	
ENPHASE ENERGY INC	9,734	267.740	2,606,181.16	
ENTERGY CORP	15,217	105.950	1,612,241.15	
EOG RESOURCES INC	43,839	85.680	3,756,125.52	
EPAM SYSTEMS INC	4,244	663.840	2,817,336.96	
EQUIFAX INC	9,193	288.860	2,655,489.98	
EQUITABLE HOLDINGS INC	29,172	32.760	955,674.72	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	1,927	215.780	415,808.06	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,788	48.570	863,963.16	
ESTEE LAUDER COS INC	17,509	352.850	6,178,050.65	
ETSY INC	9,591	294.380	2,823,398.58	
EVEREST RE GROUP LTD	3,000	267.110	801,330.00	
EVERGY INC	17,359	65.610	1,138,923.99	
EVERSOURCE ENERGY	25,979	83.860	2,178,598.94	
EXACT SCIENCES CORP	12,990	84.050	1,091,809.50	
EXELON CORP	73,697	53.610	3,950,896.17	
EXPEDIA GROUP INC	10,674	175.160	1,869,657.84	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	13,083	128.790	1,684,959.57	
EXXON MOBIL CORP	319,647	60.670	19,392,983.49	
F5 INC	4,482	231.940	1,039,555.08	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,848	461.200	1,313,497.60	
FAIR ISAAC CORP	2,177	357.510	778,299.27	
FASTENAL CO	43,243	61.030	2,639,120.29	
FEDEX CORP	19,177	242.690	4,654,066.13	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	20,676	52.220	1,079,700.72	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	46,867	109.940	5,152,557.98	

FIFTH THIRD BANCORP	53,098	43.550	2,312,417.90	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,256	218.750	2,899,750.00	
FIRSTENERGY CORP	41,221	38.530	1,588,245.13	
FISERV INC	45,374	100.060	4,540,122.44	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,984	227.670	1,362,377.28	
FMC CORP	9,784	104.050	1,018,025.20	
FORD MOTOR CO	295,995	19.390	5,739,343.05	
FORTINET INC	10,461	342.510	3,582,997.11	
FORTIVE CORP	24,314	79.130	1,923,966.82	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,496	107.350	1,126,745.60	
FOX CORP - CLASS A	23,622	38.990	921,021.78	
FOX CORP- CLASS B	12,504	36.320	454,145.28	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,714	34.680	787,721.52	
FREEMONT-MCMORAN INC	110,418	38.280	4,226,801.04	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,857	54.600	210,592.20	
GARMIN LTD	11,571	142.800	1,652,338.80	
GARTNER INC	6,499	334.550	2,174,240.45	
GENERAC HOLDINGS INC	4,743	434.250	2,059,647.75	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,153	196.310	3,563,615.43	
GENERAL ELECTRIC CO	82,883	99.960	8,284,984.68	
GENERAL MILLS INC	45,981	62.040	2,852,661.24	
GENERAL MOTORS CO	98,546	61.800	6,090,142.80	
GENUINE PARTS CO	10,892	135.240	1,473,034.08	
GILEAD SCIENCES INC	94,655	68.690	6,501,851.95	
GLOBAL PAYMENTS INC	22,321	125.930	2,810,883.53	
GLOBE LIFE INC	7,349	92.450	679,415.05	
GODADDY INC - CLASS A	12,727	71.310	907,562.37	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,629	387.390	9,928,418.31	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,021	122.930	740,161.53	
HALLIBURTON CO	67,155	22.040	1,480,096.20	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	26,843	69.680	1,870,420.24	
HASBRO INC	9,907	100.480	995,455.36	
HCA HEALTHCARE INC	20,335	239.060	4,861,285.10	
HEICO CORP	3,272	145.460	475,945.12	
HEICO CORP-CLASS A	5,499	135.950	747,589.05	
HENRY SCHEIN INC	10,546	76.140	802,972.44	
HERSHEY CO/THE	11,060	179.330	1,983,389.80	
HESS CORP	20,850	76.070	1,586,059.50	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,833	14.390	1,407,816.87	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,972	144.370	3,027,727.64	
HOLOGIC INC	19,309	75.330	1,454,546.97	
HOME DEPOT INC	80,264	408.690	32,803,094.16	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,447	218.490	11,459,145.03	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	93,200	5.780	538,696.00	
HORIZON PHARMA PLC	16,091	107.190	1,724,794.29	
HORMEL FOODS CORP	22,313	42.630	951,203.19	
HOWMET AEROSPACE INC	29,481	30.180	889,736.58	
HP INC	94,531	31.450	2,972,999.95	
HUBSPOT INC	3,350	822.340	2,754,839.00	
HUMANA INC	9,733	434.870	4,232,589.71	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	111,404	16.020	1,784,692.08	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,013	184.780	556,742.14	
IAC/INTERACTIVECORP	5,953	128.760	766,508.28	
IDEX CORP	5,742	234.420	1,346,039.64	
IDEXX LABORATORIES INC	6,426	647.270	4,159,357.02	
IHS MARKIT LTD	28,561	129.150	3,688,653.15	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	23,900	241.940	5,782,366.00	
ILLUMINA INC	11,020	379.340	4,180,326.80	
INCYTE CORP	14,117	64.510	910,687.67	
INGERSOLL-RAND INC	30,726	61.450	1,888,112.70	
INSULET CORP	5,018	301.000	1,510,418.00	
INTEL CORP	304,790	49.520	15,093,200.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,492	133.300	5,664,183.60	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	67,494	116.050	7,832,678.70	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	18,832	150.030	2,825,364.96	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,093	47.580	1,336,664.94	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,594	34.350	1,016,553.90	
INTUIT INC	20,607	692.340	14,267,050.38	
INTUITIVE SURGICAL INC	26,790	348.650	9,340,333.50	
INVESCO LTD	25,937	24.150	626,378.55	
IPG PHOTONICS CORP	2,826	163.900	463,181.40	
IQVIA HOLDINGS INC	14,478	268.170	3,882,565.26	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,585	153.210	855,677.85	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,851	146.420	1,442,383.42	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,400	60.120	985,968.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,557	128.370	584,982.09	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,742	194.260	1,309,700.92	
JM SMUCKER CO	8,158	124.310	1,014,120.98	
JOHNSON & JOHNSON	198,760	162.890	32,376,016.40	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	54,219	80.850	4,383,606.15	

JPMORGAN CHASE & CO	228,435	160.920	36,759,760.20	
JUNIPER NETWORKS INC	24,592	32.200	791,862.40	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,966	304.490	2,121,077.34	
KELLOGG CO	19,284	61.930	1,194,258.12	
KEURIG DR PEPPER INC	53,731	35.160	1,889,181.96	
KEYCORP	73,023	23.370	1,706,547.51	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	13,897	194.630	2,704,773.11	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,543	134.440	3,434,000.92	
KINDER MORGAN INC	153,786	16.160	2,485,181.76	
KKR & CO INC -A	39,465	78.310	3,090,504.15	
KLA CORPORATION	11,578	422.380	4,890,315.64	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,669	57.000	722,133.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	50,660	35.340	1,790,324.40	
KROGER CO	53,947	40.890	2,205,892.83	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,480	220.000	3,405,600.00	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,352	283.320	2,082,968.64	
LAM RESEARCH CORP	10,768	644.500	6,939,976.00	
LAMB WESTON HOLDING INC	11,137	56.370	627,792.69	
LAS VEGAS SANDS CORP	26,034	38.260	996,060.84	
LEAR CORP	4,560	177.450	809,172.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	10,191	92.040	937,979.64	
LENNAR CORP-CL A	20,836	111.430	2,321,755.48	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,601	323.820	842,255.82	
LIBERTY BROADBAND-A	2,185	162.880	355,892.80	
LIBERTY BROADBAND-C	11,187	165.860	1,855,475.82	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,452	27.910	403,355.32	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	24,428	28.010	684,228.28	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	5,936	52.360	310,808.96	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	13,287	52.090	692,119.83	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	14,692	59.680	876,818.56	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,550	69.550	942,402.50	
LINDE PLC	39,308	332.190	13,057,724.52	
LIVE NATION INC	12,438	112.540	1,399,772.52	
LKQ CORP	21,583	58.230	1,256,778.09	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,891	341.440	6,450,143.04	
LOEWS CORP	16,720	55.630	930,133.60	
LOWE'S COS INC	53,358	249.520	13,313,888.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,347	473.000	4,421,131.00	
LYFT INC-A	19,709	47.510	936,374.59	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,260	89.400	1,811,244.00	
M&T BANK CORP	9,672	157.370	1,522,082.64	
MARATHON PETROLEUM CORP	49,272	60.280	2,970,116.16	
MARKEL CORP	1,035	1,241.500	1,284,952.50	

MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,860	359.790	1,028,999.40	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	20,842	154.920	3,228,842.64	
MARSH & MCLENNAN COS INC	38,409	169.320	6,503,411.88	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,710	417.430	1,966,095.30	
MARVELL TECHNOLOGY INC	61,853	74.580	4,612,996.74	
MASCO CORP	19,329	67.600	1,306,640.40	
MASIMO CORPORATION	3,933	303.290	1,192,839.57	
MASTERCARD INC-CLASS A	66,792	339.720	22,690,578.24	
MATCH GROUP INC	19,388	140.950	2,732,738.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,872	83.970	1,584,681.84	
MCDONALD'S CORP	56,343	251.950	14,195,618.85	
MCKESSON CORP	11,968	220.900	2,643,731.20	
MEDTRONIC PLC	101,760	117.220	11,928,307.20	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED- ADR	16,660	10.940	182,260.40	
MERCADOLIBRE INC	3,387	1,401.270	4,746,101.49	
MERCK & CO INC	191,253	80.700	15,434,117.10	
META PLATFORMS INC-A	180,846	345.300	62,446,123.80	
METLIFE INC	55,948	61.150	3,421,220.20	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,756	1,552.070	2,725,434.92	
MGM MIRAGE	29,438	44.280	1,303,514.64	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	41,393	82.680	3,422,373.24	
MICRON TECHNOLOGY INC	84,612	83.030	7,025,334.36	
MICROSOFT CORP	540,056	343.110	185,298,614.16	
MODERNA INC	25,755	263.780	6,793,653.90	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,472	177.340	793,064.48	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,394	298.000	1,309,412.00	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	14,318	45.910	657,339.38	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	105,969	60.520	6,413,243.88	
MONGODB INC	4,222	569.770	2,405,568.94	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,279	570.590	1,870,964.61	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,836	89.300	2,664,354.80	
MOODY'S CORP	12,712	387.420	4,924,883.04	
MORGAN STANLEY	105,270	96.910	10,201,715.70	
MOSAIC CO/THE	27,080	36.250	981,650.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,826	253.110	3,246,388.86	
MSCI INC	6,216	656.880	4,083,166.08	
NASDAQ INC	8,610	207.770	1,788,899.70	
NETAPP INC	16,787	86.000	1,443,682.00	
NETFLIX INC	33,469	678.800	22,718,757.20	

NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	7,150	86.020	615,043.00	
NEWELL BRANDS INC	28,878	22.670	654,664.26	
NEWMONT CORP	60,337	56.550	3,412,057.35	
NEWS CORP - CLASS A	29,335	22.130	649,183.55	
NEXTERA ENERGY INC	148,090	88.310	13,077,827.90	
NIKE INC	96,264	174.880	16,834,648.32	
NISOURCE INC	29,992	25.220	756,398.24	
NORDSON CORP	3,950	266.960	1,054,492.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,185	273.720	5,251,318.20	
NORTHERN TRUST CORP	14,921	120.610	1,799,621.81	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,540	353.130	4,075,120.20	
NORTONLIFELOCK INC	43,797	25.000	1,094,925.00	
NOVAVAX INC	5,315	192.340	1,022,287.10	
NOVOCURE LTD	7,038	103.510	728,503.38	
NRG ENERGY INC	18,437	36.290	669,078.73	
NUCOR CORP	22,527	112.850	2,542,171.95	
NVIDIA CORP	188,106	329.850	62,046,764.10	
NVR INC	262	5,216.010	1,366,594.62	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,808	221.260	4,603,978.08	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,260	636.170	3,346,254.20	
OAK STREET HEALTH INC	7,325	36.330	266,117.25	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	70,505	29.120	2,053,105.60	
OKTA INC	9,447	240.680	2,273,703.96	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,679	351.820	2,701,625.78	
OMNICOM GROUP	16,263	67.120	1,091,572.56	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,247	63.340	2,042,524.98	
ONEOK INC	33,683	61.380	2,067,462.54	
ORACLE CORP	141,445	93.970	13,291,586.65	
OTIS WORLDWIDE CORP	30,837	86.260	2,659,999.62	
OWENS CORNING	7,887	89.210	703,599.27	
PACCAR INC	26,306	86.370	2,272,049.22	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,160	133.090	952,924.40	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	115,867	21.410	2,480,712.47	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,357	530.340	3,901,711.38	
PARKER HANNIFIN CORP	9,748	329.750	3,214,403.00	
PAYCHEX INC	24,467	124.990	3,058,130.33	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,864	470.520	1,818,089.28	
PAYPAL HOLDINGS INC	84,230	193.610	16,307,770.30	
PELTON INTERACTIVE INC- A	19,275	47.140	908,623.50	
PENTAIR PLC	12,452	79.340	987,941.68	
PEPSICO INC	104,333	163.810	17,090,788.73	
PERKINELMER INC	8,452	188.820	1,595,906.64	

PFIZER INC	422,519	50.800	21,463,965.20	
PG&E CORP	112,593	12.380	1,393,901.34	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	117,701	90.400	10,640,170.40	
PHILLIPS 66	33,065	69.640	2,302,646.60	
PINNACLE WEST CAPITAL	8,544	66.960	572,106.24	
PINTEREST INC- CLASS A	41,318	44.760	1,849,393.68	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,408	176.460	3,071,815.68	
PLUG POWER INC	38,663	44.550	1,722,436.65	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,030	199.360	6,385,500.80	
POOL CORP	3,020	577.000	1,742,540.00	
PPD INC	9,348	47.250	441,693.00	
PPG INDUSTRIES INC	17,917	160.840	2,881,770.28	
PPL CORPORATION	58,536	28.400	1,662,422.40	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,443	70.870	1,448,795.41	
PROCTER & GAMBLE CO	184,813	146.820	27,134,244.66	
PROGRESSIVE CORP	44,141	90.300	3,985,932.30	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,684	106.530	3,162,236.52	
PTC INC	8,378	117.330	982,990.74	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	38,178	63.070	2,407,886.46	
PULTE GROUP INC	19,986	52.250	1,044,268.50	
QORVO INC	8,481	155.190	1,316,166.39	
QUALCOMM INC	85,178	185.000	15,757,930.00	
QUEST DIAGNOSTICS	9,833	148.440	1,459,610.52	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,878	98.140	1,361,986.92	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	114,404	85.430	9,773,533.72	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,893	652.680	5,151,603.24	
REGIONS FINANCIAL CORP	72,058	23.690	1,707,054.02	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,734	163.660	611,106.44	
REPUBLIC SERVICES INC	16,939	136.450	2,311,326.55	
RESMED INC	10,966	260.310	2,854,559.46	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,809	229.800	1,334,908.20	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	8,450	117.740	994,903.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,770	348.170	3,053,450.90	
ROKU INC	8,696	234.100	2,035,733.60	
ROLLINS INC	16,732	35.420	592,647.44	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,950	498.430	3,962,518.50	
ROSS STORES INC	26,944	112.780	3,038,744.32	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,305	80.470	1,392,533.35	

ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,444	41.560	558,732.64	
RPM INTERNATIONAL INC	9,889	94.640	935,894.96	
S&P GLOBAL INC	18,177	461.310	8,385,231.87	
SALESFORCE.COM INC	73,342	301.170	22,088,410.14	
SCHLUMBERGER LTD	105,626	30.050	3,174,061.30	
SEA LTD-ADR	5,205	309.990	1,613,497.95	
SEAGATE TECHNOLOGY	15,524	100.780	1,564,508.72	
SEAGEN INC	10,284	183.620	1,888,348.08	
SEALED AIR CORP	11,509	64.500	742,330.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,967	63.410	568,597.47	
SEMPRA ENERGY	23,977	122.760	2,943,416.52	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	11,986	59.900	717,961.40	
SERVICENOW INC	14,900	675.970	10,071,953.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,205	332.250	6,380,861.25	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	77,827	6.190	481,749.13	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,442	160.710	1,999,553.82	
SMITH (A.O.) CORP	10,226	82.460	843,235.96	
SNAP INC - A	71,783	51.320	3,683,903.56	
SNAP-ON INC	4,069	215.650	877,479.85	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,531	392.150	5,698,331.65	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,928	365.130	1,434,230.64	
SOUTHERN CO	80,091	62.670	5,019,302.97	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,059	46.830	517,892.97	
SPLUNK INC	12,401	132.490	1,643,008.49	
SQUARE INC - A	29,594	225.140	6,662,793.16	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,497	80.130	1,402,034.61	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,206	190.250	2,322,191.50	
STARBUCKS CORP	88,980	110.780	9,857,204.40	
STATE STREET CORP	26,150	94.750	2,477,712.50	
STEEL DYNAMICS INC	15,816	63.110	998,147.76	
STERIS PLC	7,506	233.540	1,752,951.24	
STRYKER CORP	25,604	263.690	6,751,518.76	
SUNRUN INC	13,126	54.860	720,092.36	
SVB FINANCIAL GROUP	4,201	727.790	3,057,445.79	
SYNCHRONY FINANCIAL	43,941	47.880	2,103,895.08	
SYNOPSIS INC	11,492	357.950	4,113,561.40	
SYSCO CORP	38,692	74.170	2,869,785.64	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,024	210.540	3,584,232.96	
T-MOBILE US INC	47,197	115.620	5,456,917.14	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,721	170.500	1,486,930.50	
TARGET CORP	37,311	250.700	9,353,867.70	
TE CONNECTIVITY LTD	24,905	165.250	4,115,551.25	
TELADOC HEALTH INC	10,510	116.990	1,229,564.90	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,507	444.220	1,557,879.54	
TELEFLEX INC	3,537	318.830	1,127,701.71	
TERADYNE INC	12,529	151.270	1,895,261.83	
TESLA, INC.	61,809	1,137.060	70,280,541.54	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	83,530	8.880	741,746.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	69,721	195.160	13,606,750.36	
TEXTRON INC	16,949	75.340	1,276,937.66	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,665	636.050	18,868,423.25	
TJX COS INC	91,116	71.020	6,471,058.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,689	230.560	2,003,335.84	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	32,548	107.790	3,508,348.92	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	7,856	97.900	769,102.40	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,103	195.990	3,548,006.97	
TRANSDIGM GROUP INC	3,946	631.840	2,493,240.64	
TRANSUNION	14,485	117.400	1,700,539.00	
TRAVELERS COS INC/THE	18,920	152.530	2,885,867.60	
TRIMBLE INC	18,935	88.650	1,678,587.75	
TRUIST FINANCIAL CORP	101,638	60.640	6,163,328.32	
TWILIO INC - A	12,258	285.000	3,493,530.00	
TWITTER INC	60,207	48.400	2,914,018.80	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,067	547.880	1,680,347.96	
TYSON FOODS INC-CL A	22,222	81.510	1,811,315.22	
UBER TECHNOLOGIES INC	92,242	44.230	4,079,863.66	
UGI CORP	15,814	43.900	694,234.60	
ULTA BEAUTY INC	3,923	407.710	1,599,446.33	
UNION PACIFIC CORP	50,584	241.310	12,206,425.04	
UNITED PARCEL SERVICE INC	54,787	208.470	11,421,445.89	
UNITED RENTALS INC	5,448	375.260	2,044,416.48	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,224	440.000	31,338,560.00	
UNITY SOFTWARE INC	4,218	189.750	800,365.50	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,849	123.980	725,159.02	
US BANCORP	106,795	57.590	6,150,324.05	
VAIL RESORTS INC	3,043	342.430	1,042,014.49	
VALERO ENERGY CORP	30,873	69.070	2,132,398.11	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,414	305.140	3,177,727.96	
VERISIGN INC	7,661	245.700	1,882,307.70	
VERISK ANALYTICS INC	11,655	230.030	2,680,999.65	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	313,300	50.860	15,934,438.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,532	182.880	3,572,012.16	

VF CORP	25,249	75.990	1,918,671.51	
VIACOMCBS INC	45,678	33.660	1,537,521.48	
VIATRIS INC	91,462	13.080	1,196,322.96	
VISA INC-CLASS A SHARES	127,704	200.860	25,650,625.44	
VISTRA CORP	33,015	20.050	661,950.75	
VMWARE INC-CLASS A	15,361	120.550	1,851,768.55	
VOYA FINANCIAL INC	9,047	65.270	590,497.69	
VULCAN MATERIALS CO	10,027	196.150	1,966,796.05	
WABTEC CORP	13,632	95.360	1,299,947.52	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	55,400	46.980	2,602,692.00	
WALMART INC	116,744	142.390	16,623,178.16	
WALT DISNEY CO	137,157	154.000	21,122,178.00	
WASTE CONNECTIONS INC	19,804	137.530	2,723,644.12	
WASTE MANAGEMENT INC	31,945	163.390	5,219,493.55	
WATERS CORP	4,641	349.710	1,623,004.11	
WAYFAIR INC- CLASS A	5,572	274.810	1,531,241.32	
WEC ENERGY GROUP INC	23,834	90.520	2,157,453.68	
WELLS FARGO & CO	311,885	48.820	15,226,225.70	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,549	448.450	2,488,449.05	
WESTERN DIGITAL CORP	23,121	56.020	1,295,238.42	
WESTERN UNION CO	31,123	16.650	518,197.95	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	20,155	46.770	942,649.35	
WEYERHAEUSER CO	56,377	38.040	2,144,581.08	
WHIRLPOOL CORP	4,732	229.290	1,085,000.28	
WILLIAMS COS INC	91,827	27.420	2,517,896.34	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,722	232.800	2,263,281.60	
WIX.COM LTD	4,240	169.590	719,061.60	
WORKDAY INC-CLASS A	14,266	286.600	4,088,635.60	
WR BERKLEY CORP	10,632	80.290	853,643.28	
WW GRAINGER INC	3,342	482.620	1,612,916.04	
WYNN RESORTS LTD	7,870	90.710	713,887.70	
XCEL ENERGY INC	40,687	65.100	2,648,723.70	
XILINX INC	18,562	220.870	4,099,788.94	
XYLEM INC	13,602	129.100	1,756,018.20	
YUM! BRANDS INC	22,450	126.960	2,850,252.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	4,029	596.750	2,404,305.75	
ZENDESK INC	8,990	97.210	873,917.90	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	12,231	56.110	686,281.41	
ZILLOW GROUP INC - CL A	4,650	56.390	262,213.50	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,743	128.810	2,027,855.83	
ZOETIS INC	35,864	226.430	8,120,685.52	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,047	251.300	4,032,611.10	
ZSCALER INC	6,159	368.780	2,271,316.02	
アメリカ・ドル 小計	23,783,687		3,145,419,436.66	

(358,892,357,721)

イギリス・ボン ド	3I GROUP PLC	73,091	14.430	1,054,703.13	
	ABRDN PLC	162,662	2.533	412,022.84	
	ADMIRAL GROUP PLC	14,578	29.800	434,424.40	
	ANGLO AMERICAN PLC	97,354	28.440	2,768,747.76	
	ANTOFAGASTA PLC	29,499	14.085	415,493.41	
	ASHTED GROUP PLC	33,834	63.060	2,133,572.04	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	26,916	19.000	511,404.00	
	ASTRAZENECA PLC	116,981	84.790	9,918,818.99	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	72,536	7.350	533,139.60	
	AVEVA GROUP PLC	9,166	34.390	315,218.74	
	AVIVA PLC	296,407	3.918	1,161,322.62	
	BAE SYSTEMS PLC	243,642	5.650	1,376,577.30	
	BARCLAYS PLC	1,277,480	1.909	2,438,709.32	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	77,351	6.846	529,544.94	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS- UNIT	8,332	44.540	371,107.28	
	BHP GROUP PLC	159,014	18.842	2,996,141.78	
	BP PLC	1,529,095	3.265	4,992,495.17	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	164,583	25.445	4,187,814.43	
	BT GROUP PLC	676,438	1.606	1,086,359.42	
	BUNZL PLC	25,494	28.370	723,264.78	
	BURBERRY GROUP PLC	30,652	19.330	592,503.16	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	15,097	24.670	372,442.99	
	COMPASS GROUP PLC	134,588	14.795	1,991,229.46	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,527	100.350	1,056,384.45	
	DCC PLC	7,467	58.020	433,235.34	
	DIAGEO PLC	176,594	38.780	6,848,315.32	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	101,821	2.706	275,527.62	
	ENTAIN PLC	44,044	19.185	844,984.14	
	EVRAZ PLC	37,959	5.900	223,958.10	
	EXPERIAN PLC	69,734	34.000	2,370,956.00	
	FERGUSON PLC	16,857	120.200	2,026,211.40	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	380,496	15.216	5,789,627.13	
	GLENCORE PLC	752,873	3.694	2,781,112.86	
	HALMA PLC	28,592	31.650	904,936.80	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	26,850	14.985	402,347.25		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,068	23.000	300,564.00		
HSBC HOLDINGS PLC	1,541,876	4.317	6,656,278.69		
IMPERIAL BRANDS PLC	71,443	15.840	1,131,657.12		
INFORMA PLC	114,238	5.142	587,411.79		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	13,941	49.050	683,806.05		
INTERTEK GROUP PLC	12,222	52.460	641,166.12		

JD SPORTS FASHION PLC	38,739	11.670	452,084.13	
JOHNSON MATTHEY PLC	14,614	22.340	326,476.76	
KINGFISHER PLC	157,716	3.225	508,634.10	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	451,011	2.918	1,316,050.09	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,340,183	0.490	2,616,689.67	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,855	67.040	1,666,279.20	
M&G PLC	198,612	1.935	384,314.22	
MELROSE INDUSTRIES PLC	329,806	1.594	525,710.76	
MONDI PLC/WI	36,647	18.250	668,807.75	
NATIONAL GRID PLC	269,189	9.835	2,647,473.81	
NATWEST GROUP PLC	434,983	2.206	959,572.49	
NEXT PLC	10,045	82.740	831,123.30	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	36,901	18.975	700,196.47	
PEARSON PLC	56,787	6.300	357,758.10	
PERSIMMON PLC	24,177	27.860	673,571.22	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	50,757	6.590	334,488.63	
PRUDENTIAL PLC	197,475	14.510	2,865,362.25	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,019	62.480	3,375,107.12	
RELX PLC	146,209	23.670	3,460,767.03	
RENTOKIL INITIAL PLC	141,049	6.306	889,454.99	
RIO TINTO PLC	84,535	44.550	3,766,034.25	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	632,953	1.360	860,816.08	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	310,622	16.094	4,999,150.46	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	278,797	16.102	4,489,189.29	
SAGE GROUP PLC	81,230	7.996	649,515.08	
SAINSBURY (J) PLC	124,523	2.926	364,354.29	
SCHRODERS PLC	9,221	36.550	337,027.55	
SEVERN TRENT PLC	19,038	28.100	534,967.80	
SMITH & NEPHEW PLC	66,432	12.775	848,668.80	
SMITHS GROUP PLC	30,133	14.955	450,639.01	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,574	165.650	923,333.10	
SSE PLC	79,074	15.965	1,262,416.41	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,678	15.530	631,729.34	
STANDARD CHARTERED PLC	199,479	4.515	900,647.68	
TAYLOR WIMPEY PLC	277,422	1.563	433,610.58	
TESCO PLC	582,599	2.788	1,624,286.01	
UNILEVER PLC	197,901	38.490	7,617,209.49	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,720	10.565	546,421.80	
VODAFONE GROUP PLC	2,128,800	1.136	2,418,316.80	
WHITBREAD PLC	15,220	30.130	458,578.60	

	WPP PLC	91,279	11.015	1,005,438.18	
イギリス・ポンド	小計	22,021,154		135,957,815.18 (20,850,490,536)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	3,284	303.300	996,037.20	
	BANK HAPOALIM BM	85,174	30.080	2,562,033.92	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,490	30.750	3,336,067.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,045	468.800	958,696.00	
	ICL GROUP LTD	52,830	29.500	1,558,485.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	87,292	19.090	1,666,404.28	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,689	114.700	1,226,028.30	
	NICE LTD	4,762	907.000	4,319,134.00	
イスラエル・シュケル	小計	354,566		16,622,886.20 (612,958,955)	
オーストラリ ア・ドル	AFTERPAY LTD	16,565	116.420	1,928,497.30	
	AGL ENERGY LTD	57,705	5.130	296,026.65	
	AMPOL LTD	19,731	30.250	596,862.75	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	44,665	44.900	2,005,458.50	
	ASX LTD	15,751	93.750	1,476,656.25	
	AURIZON HOLDINGS LTD	167,557	3.410	571,369.37	
	AUSNET SERVICES	182,248	2.560	466,554.88	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	219,341	27.300	5,988,009.30	
	BHP GROUP LIMITED	223,770	36.450	8,156,416.50	
	BLUESCOPE STEEL LTD	40,364	20.710	835,938.44	
	BRAMBLES LTD	117,776	10.410	1,226,048.16	
	COCHLEAR LTD	5,289	229.510	1,213,878.39	
	COLES GROUP LTD	104,800	18.010	1,887,448.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	135,231	97.810	13,226,944.11	
	COMPUTERSHARE LIMITED	45,879	19.620	900,145.98	
	CROWN RESORTS LTD	33,282	11.540	384,074.28	
	CSL LIMITED	34,631	315.500	10,926,080.50	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	4,805	125.230	601,730.15	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	115,449	7.130	823,151.37	
	EVOLUTION MINING LTD	146,016	4.420	645,390.72	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	128,838	15.470	1,993,123.86	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	198,402	4.530	898,761.06	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	34,656	54.760	1,897,762.56	
MACQUARIE GROUP LTD	26,773	208.000	5,568,784.00		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	11,804	34.860	411,487.44		
MEDIBANK PRIVATE LTD	223,893	3.580	801,536.94		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	255,275	28.570	7,293,206.75	
	NEWCREST MINING LIMITED	64,165	24.840	1,593,858.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	86,869	10.460	908,649.74	
	OIL SEARCH LTD	159,998	4.200	671,991.60	
	ORICA LTD	37,495	15.120	566,924.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	145,811	5.000	729,055.00	
	QANTAS AIRWAYS LTD	79,340	5.480	434,783.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	116,170	12.200	1,417,274.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	15,192	67.870	1,031,081.04	
	REA GROUP LTD	4,522	171.980	777,693.56	
	REECE LTD	23,570	22.650	533,860.50	
	RIO TINTO LTD	28,436	90.250	2,566,349.00	
	SANTOS LTD	151,142	6.740	1,018,697.08	
	SEEK LTD	27,480	35.550	976,914.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	36,225	41.020	1,485,949.50	
	SOUTH32 LTD	383,052	3.510	1,344,512.52	
	SUNCORP GROUP LTD	105,030	11.030	1,158,480.90	
	TABCORP HOLDINGS LTD	181,800	5.140	934,452.00	
	TELSTRA CORP LTD	344,972	4.060	1,400,586.32	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,560	12.010	679,285.60	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9,270	31.560	292,561.20	
	WESFARMERS LIMITED	87,773	59.210	5,197,039.33	
	WESTPAC BANKING CORP	282,345	22.140	6,251,118.30	
	WISETECH GLOBAL LTD	11,537	57.270	660,723.99	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	77,047	22.110	1,703,509.17	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	97,951	40.220	3,939,589.22	
	XERO LTD	10,339	151.000	1,561,189.00	
	オーストラリア・ドル 小計	5,234,587		112,857,472.98 (9,309,612,946)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	18,333	68.760	1,260,577.08	
	AIR CANADA	13,560	23.550	319,338.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	47,683	17.960	856,386.68	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	62,282	50.960	3,173,890.72	
	ALTAGAS LTD	21,574	24.720	533,309.28	
	ATCO LTD -CL 'I'	6,049	42.290	255,812.21	
	B2GOLD CORP	77,212	5.570	430,070.84	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	18,155	20.580	373,629.90	
	BANK OF MONTREAL	48,895	137.890	6,742,131.55	
	BANK OF NOVA SCOTIA	91,681	82.560	7,569,183.36	
	BARRICK GOLD CORP	134,236	25.620	3,439,126.32	

BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	23,156	32.890	761,600.84	
BCE INC	6,793	64.720	439,642.96	
BLACKBERRY LTD	40,753	13.210	538,347.13	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	97,058	75.400	7,318,173.20	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	9,886	49.200	486,391.20	
CAE INC	22,153	35.270	781,336.31	
CAMECO CORP	29,990	32.010	959,979.90	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	33,868	147.100	4,981,982.80	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	54,404	163.680	8,904,846.72	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	89,329	51.060	4,561,138.74	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	51,532	94.710	4,880,595.72	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,334	173.720	752,902.48	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10,429	35.710	372,419.59	
CANOPY GROWTH CORP	17,694	15.410	272,664.54	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	11,511	66.040	760,186.44	
CENOVUS ENERGY INC	98,561	15.340	1,511,925.74	
CGI INC	16,737	109.080	1,825,671.96	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,522	2,249.950	3,424,423.90	
DOLLARAMA INC	22,459	57.480	1,290,943.32	
EMERA INC	19,787	59.360	1,174,556.32	
EMPIRE CO LTD 'A'	12,840	37.920	486,892.80	
ENBRIDGE INC	153,567	50.270	7,719,813.09	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,973	579.800	1,143,945.40	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	44,192	27.050	1,195,393.60	
FIRSTSERVICE CORP	3,038	248.340	754,456.92	
FORTIS INC	36,293	56.320	2,044,021.76	
FRANCO-NEVADA CORP	14,366	182.300	2,618,921.80	
GEORGE WESTON LTD	5,768	141.480	816,056.64	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	12,097	50.990	616,826.03	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,088	53.070	800,720.16	
GREAT-WEST LIFECO INC	21,560	37.940	817,986.40	
HYDRO ONE LTD	25,799	30.830	795,383.17	
IA FINANCIAL CORP INC	8,094	72.410	586,086.54	
IGM FINANCIAL INC	6,482	50.080	324,618.56	
IMPERIAL OIL LTD	19,344	42.760	827,149.44	
INTACT FINANCIAL CORP	13,368	165.370	2,210,666.16	
IVANHOE MINES LTD-CL A	45,835	10.130	464,308.55	

KEYERA CORP	16,771	29.660	497,427.86		
KINROSS GOLD CORP	92,331	8.430	778,350.33		
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	20,108	54.140	1,088,647.12		
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,021	73.590	590,265.39		
LOBLAW COS LTD	12,788	98.000	1,253,224.00		
LUNDIN MINING CORP	49,920	10.590	528,652.80		
MAGNA INTERNATIONAL INC	21,740	108.540	2,359,659.60		
MANULIFE FINANCIAL CORP	146,929	24.430	3,589,475.47		
METRO INC	18,755	62.760	1,177,063.80		
NATIONAL BANK OF CANADA	25,524	104.810	2,675,170.44		
NORTHLAND POWER INC	17,284	40.010	691,532.84		
NUTRIEN LTD	43,171	85.880	3,707,525.48		
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,279	126.080	539,496.32		
ONEX CORPORATION	5,705	93.620	534,102.10		
OPEN TEXT CORP	20,839	65.990	1,375,165.61		
PAN AMERICAN SILVER CORP	15,882	33.910	538,558.62		
PARKLAND CORP	11,674	34.200	399,250.80		
PEMBINA PIPELINE CORP	41,646	41.610	1,732,890.06		
POWER CORP OF CANADA	42,535	42.940	1,826,452.90		
QUEBECOR INC -CL B	13,190	28.880	380,927.20		
RESTAURANT BRANDS INTERN	20,993	72.390	1,519,683.27		
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	8,480	92.000	780,160.00		
ROGERS COMMUNICATIONS INC	27,327	58.830	1,607,647.41		
ROYAL BANK OF CANADA	107,731	131.960	14,216,182.76		
SAPUTO INC	18,981	30.180	572,846.58		
SHAW COMMUNICATIONS INC- B	34,554	36.960	1,277,115.84		
SHOPIFY INC - CLASS A	8,514	2,139.820	18,218,427.48		
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,504	70.670	3,145,097.68		
SUNCOR ENERGY INC	113,864	31.670	3,606,072.88		
TC ENERGY CORP	74,284	60.230	4,474,125.32		
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,482	33.040	1,172,325.28		
THOMSON REUTERS CORP	13,117	156.010	2,046,383.17		
TMX GROUP LTD	4,398	133.520	587,220.96		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,381	112.850	720,095.85		
TORONTO-DOMINION BANK	137,457	91.830	12,622,676.31		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,160	109.700	785,452.00		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,877	55.890	1,893,385.53		
WSP GLOBAL INC	8,892	178.560	1,587,755.52		
YAMANA GOLD INC	71,342	5.440	388,100.48		
カナダ・ドル 小計	3,047,750		192,661,025.83 (17,374,171,309)		
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	206,500	3.370	695,905.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	33,300	7.170	238,761.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,000	32.480	4,417,280.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	444,900	0.830	369,267.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,100	5.340	598,614.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	253,100	11.790	2,984,049.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	101,600	5.310	539,496.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	60,300	9.390	566,217.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	120,800	3.950	477,160.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	635,400	2.490	1,582,146.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	88,900	27.630	2,456,307.00	
	UOL Group Limited	35,500	7.070	250,985.00	
	VENTURE CORP LTD	20,700	19.350	400,545.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	144,400	4.270	616,588.00	
	シンガポール・ドル 小計	2,393,500		16,193,320.00 (1,355,866,684)	
スイス・フラン	ABB LTD	130,817	33.250	4,349,665.25	
	ADECCO GROUP AG-REG	11,763	46.230	543,803.49	
	ALCON INC	37,713	77.160	2,909,935.08	
	BALOISE HOLDING AG	3,516	142.700	501,733.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,532	73.300	185,595.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	270	2,300.000	621,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	79	11,520.000	910,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	8	115,200.000	921,600.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	39,404	137.900	5,433,811.60	
	CLARIANT AG	16,684	19.720	329,008.48	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	192,794	9.150	1,764,065.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	525	938.500	492,712.50	
	GEBERIT AG-REG	2,801	740.400	2,073,860.40	
	GIVAUDAN-REG	697	4,637.000	3,231,989.00	
	HOLCIM LTD	39,452	46.620	1,839,252.24	
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,916	62.800	1,062,324.80	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	4,134	291.300	1,204,234.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	13,014	76.160	991,146.24	
	LONZA GROUP AG	5,624	758.000	4,262,992.00	
	NESTLE SA	217,443	122.760	26,693,302.68	
	NOVARTIS AG	167,625	76.040	12,746,205.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,706	1,650.000	2,814,900.00	
	ROCHE HOLDING AG	52,983	369.950	19,601,060.85	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,435	397.400	967,669.00	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,644	249.200	409,684.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,976	257.600	766,617.60	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	460	2,930.000	1,347,800.00	
	SIKA AG-BEARER	10,704	369.400	3,954,057.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,124	363.800	1,500,311.20	
	STRAUMANN HOLDING AG	780	1,986.000	1,549,080.00	
	SWATCH GROUP AG	2,079	292.400	607,899.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG- REG	2,413	506.800	1,222,908.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,914	94.100	556,507.40	
	SWISS RE AG	22,798	87.500	1,994,825.00	
	SWISSCOM AG	2,013	517.000	1,040,721.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	5,060	133.600	676,016.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,387	56.150	246,330.05	
	UBS GROUP AG	276,511	16.240	4,490,538.64	
	VIFOR PHARMA AG	3,692	118.950	439,163.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,352	392.500	4,455,660.00	
スイス・フラン	小計	1,317,842		121,710,067.40 (14,948,430,478)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	23,723	376.800	8,938,826.40	
	ASSA ABLOY AB	76,113	271.000	20,626,623.00	
	ATLAS COPCO AB	29,616	495.000	14,659,920.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	50,544	578.400	29,234,649.60	
	BOLIDEN AB	20,271	312.700	6,338,741.70	
	ELECTROLUX AB	17,116	214.200	3,666,247.20	
	EMBRACER GROUP AB	35,309	87.550	3,091,302.95	
	EPIROC AB-A	49,029	221.900	10,879,535.10	
	EPIROC AB-B	30,330	185.550	5,627,731.50	
	EQT AB	17,922	542.600	9,724,477.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	46,203	302.000	13,953,306.00	
	EVOLUTION AB	12,785	1,441.400	18,428,299.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	8,006	717.800	5,746,706.80	
	HENNES & MAURITZ AB	55,303	161.420	8,927,010.26	
	HEXAGON AB-B SHS	148,391	140.300	20,819,257.30	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,455	136.250	4,285,743.75	
	ICA GRUPPEN AB	7,425	534.000	3,964,950.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	9,749	291.400	2,840,858.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,827	286.000	3,382,522.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,008	358.400	3,945,267.20	
	INVESTOR AB	136,487	215.500	29,412,948.50	
	KINNEVIK AB - B	18,010	364.800	6,570,048.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,637	532.200	3,000,011.40	
	LUNDIN ENERGY AB	15,111	315.500	4,767,520.50	

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,745	129.000	13,899,105.00	
	NORDEA BANK ABP	244,006	109.000	26,596,654.00	
	SANDVIK AB	85,209	232.400	19,802,571.60	
	SECURITAS AB	23,783	136.550	3,247,568.65	
	SINCH AB	38,097	126.600	4,823,080.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	123,100	135.900	16,729,290.00	
	SKANSKA AB-B SHS	25,996	218.300	5,674,926.80	
	SKF AB	28,865	212.200	6,125,153.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB	45,665	145.550	6,646,540.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	110,552	99.620	11,013,190.24	
	SWEDBANK AB - A SHARES	68,165	191.500	13,053,597.50	
	SWEDISH MATCH AB	119,286	65.340	7,794,147.24	
	TELE2 AB	39,371	124.200	4,889,878.20	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	220,309	98.210	21,636,546.89	
	TELIA CO AB	207,629	35.030	7,273,243.87	
	VOLVO AB	107,363	209.550	22,497,916.65	
	VOLVO AB-A SHS	15,750	212.600	3,348,450.00	
	スウェーデン・クロナ 小計	2,478,261		437,884,364.55 (5,574,267,961)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	447	19,830.000	8,864,010.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	236	18,650.000	4,401,400.00	
	AMBU A/S-B	12,644	189.800	2,399,831.20	
	CARLSBERG AS-B	7,575	1,078.000	8,165,850.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,005	537.800	4,305,089.00	
	COLOPLAST-B	8,954	1,174.000	10,511,996.00	
	DANSKE BANK A/S	51,993	112.150	5,831,014.95	
	DEMANT A/S	8,089	341.100	2,759,157.90	
	DSV A/S	15,369	1,560.000	23,975,640.00	
	GENMAB A/S	4,950	2,734.000	13,533,300.00	
	GN STORE NORD A/S	9,364	407.800	3,818,639.20	
	NOVO-NORDISK A/S	127,045	751.300	95,448,908.50	
	NOVOZYMES A/S	15,431	513.200	7,919,189.20	
	ORSTED A/S	14,276	848.400	12,111,758.40	
	PANDORA A/S	7,510	911.000	6,841,610.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	638	3,061.000	1,952,918.00	
	TRYGVESTA AS	27,413	162.000	4,440,906.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	76,255	224.700	17,134,498.50	
	デンマーク・クローネ 小計	396,194		234,415,716.85 (4,055,391,902)	
ニュージーラン ド・ドル	A2 MILK CO LTD	56,654	6.480	367,117.92	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	100,754	7.930	798,979.22	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	43,632	31.600	1,378,771.20	
	MERCURY NZ LTD	52,582	5.780	303,923.96	

	MERIDIAN ENERGY LTD	97,360	4.630	450,776.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	32,829	12.990	426,448.71	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	148,786	4.430	659,121.98	
ニュージーランド・ドル 小計		532,597		4,385,139.79 (349,539,493)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	20,854	150.000	3,128,100.00	
	DNB BANK ASA	70,619	208.600	14,731,123.40	
	EQUINOR ASA	73,885	220.450	16,287,948.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	15,499	215.600	3,341,584.40	
	MOWI ASA	33,213	235.000	7,805,055.00	
	NORSK HYDRO ASA	100,610	62.500	6,288,125.00	
	ORKLA ASA	57,294	86.040	4,929,575.76	
	SCHIBSTED ASA	5,378	460.000	2,473,880.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	7,484	404.800	3,029,523.20	
	TELENOR ASA	55,453	139.350	7,727,375.55	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,090	446.300	5,842,067.00	
ノルウェー・クローネ 小計		453,379		75,584,357.56 (965,212,246)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	31,807	12.780	406,493.46	
	ACCOR	12,818	29.410	376,977.38	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,930	21.730	411,348.90	
	ADIDAS AG	14,383	282.350	4,061,040.05	
	ADP	2,602	108.950	283,487.90	
	ADYEN NV	1,491	2,616.500	3,901,201.50	
	AEGON NV	133,796	4.217	564,217.73	
	AENA SME SA	5,997	136.600	819,190.20	
	AGEAS	13,170	47.110	620,438.70	
	AIR LIQUIDE	35,743	153.500	5,486,550.50	
	AIRBUS SE	44,511	109.400	4,869,503.40	
	AKZO NOBEL NV	14,388	103.500	1,489,158.00	
	ALLIANZ SE	31,084	202.750	6,302,281.00	
	ALSTOM RGPT	23,940	33.180	794,329.20	
	AMADEUS IT GROUP SA	34,021	60.200	2,048,064.20	
	AMPLIFON SPA	9,332	44.550	415,740.60	
	AMUNDI SA	4,604	76.200	350,824.80	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,563	51.860	2,985,217.18	
	ARCELORMITTAL	53,556	26.430	1,415,485.08	
	ARGENX SE	3,470	253.900	881,033.00	
	ARKEMA	4,577	121.850	557,707.45	
	AROUNDTOWN SA	77,281	5.982	462,294.94	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,551	431.400	1,531,901.40	
	ASML HOLDING NV	31,659	759.900	24,057,674.10	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	83,264	18.285	1,522,482.24	
	ATLANTIA SPA	38,365	16.670	639,544.55	

ATOS SE	7,411	39.060	289,473.66	
AXA SA	145,662	25.165	3,665,584.23	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	500,648	5.403	2,705,001.14	
BANCO SANTANDER SA	1,304,355	3.058	3,988,717.59	
BASF SE	69,330	61.610	4,271,421.30	
BAYER AG	74,257	48.135	3,574,360.69	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,018	93.200	2,331,677.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,250	77.600	329,800.00	
BECHTLE AG	6,141	64.780	397,813.98	
BEIERSDORF AG	7,583	93.540	709,313.82	
BIOMERIEUX	3,118	122.050	380,551.90	
BNP PARIBAS	84,648	57.720	4,885,882.56	
BOLLORE	66,929	4.942	330,763.11	
BOUYGUES	17,318	30.960	536,165.28	
BRENTAG SE	11,576	79.900	924,922.40	
BUREAU VERITAS SA	22,301	29.780	664,123.78	
CAIXABANK	329,824	2.374	783,002.17	
CAPGEMINI SA	12,080	215.800	2,606,864.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,015	187.400	565,011.00	
CARREFOUR SA	45,816	15.870	727,099.92	
CELLNEX TELECOM SAU	38,643	52.480	2,027,984.64	
CIE DE SAINT-GOBAIN	38,245	60.920	2,329,885.40	
CNH INDUSTRIAL NV	77,209	16.265	1,255,804.38	
CNP ASSURANCES	12,937	21.580	279,180.46	
COLRUYT NV	3,937	42.480	167,243.76	
COMMERZBANK AG	75,279	6.690	503,616.51	
CONTINENTAL AG	8,300	105.840	878,472.00	
COVESTRO AG	14,512	56.300	817,025.60	
CREDIT AGRICOLE SA	88,052	12.478	1,098,712.85	
CRH PLC	59,045	43.620	2,575,542.90	
DAIMLER AG	64,485	89.790	5,790,108.15	
DANONE	49,303	56.190	2,770,335.57	
DASSAULT AVIATION SA	1,869	89.050	166,434.45	
DASSAULT SYSTEMES SA	49,998	56.220	2,810,887.56	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	39,245	13.325	522,939.62	
DELIVERY HERO SE	12,254	128.300	1,572,188.20	
DEUTSCHE BANK AG	155,632	10.824	1,684,560.76	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,346	147.650	2,118,186.90	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	22,850	6.049	138,219.65	
DEUTSCHE POST AG	75,306	57.140	4,302,984.84	
DEUTSCHE TELEKOM AG	252,953	16.482	4,169,171.34	
DIASORIN SPA	1,880	188.900	355,132.00	
E.ON SE	170,220	11.030	1,877,526.60	
EDENRED	18,741	43.720	819,356.52	
EDF	35,190	12.595	443,218.05	

EDP RENOVAVEIS SA	21,621	22.400	484,310.40	
EIFFAGE	6,572	85.120	559,408.64	
ELIA GROUP SA/NV	2,401	103.600	248,743.60	
ELISA OYJ	10,964	53.600	587,670.40	
ENAGAS SA	18,582	19.720	366,437.04	
ENDESA SA	24,054	19.195	461,716.53	
ENEL SPA	613,762	6.950	4,265,645.90	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	210,226	4.779	1,004,670.05	
ENGIE	138,134	13.112	1,811,213.00	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	189,658	12.168	2,307,758.54	
ERSTE GROUP BANK AG	21,145	38.290	809,642.05	
ESSILORLUXOTTICA	21,560	193.360	4,168,841.60	
EURAZEO	2,970	77.900	231,363.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,066	110.220	1,109,474.52	
EVONIK INDUSTRIES AG	15,701	27.720	435,231.72	
EXOR NV	8,195	83.840	687,068.80	
FAURECIA	8,892	46.000	409,032.00	
FERRARI NV	9,530	239.700	2,284,341.00	
FERROVIAL S.A.	36,612	25.980	951,179.76	
FERROVIAL SA-RTS	35,854	0.306	10,971.32	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	152,990	17.514	2,679,466.86	
FINECOBANK SPA	45,703	17.030	778,322.09	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	12,521	136.700	1,711,620.70	
FORTUM OYJ	33,648	24.950	839,517.60	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	15,449	55.780	861,745.22	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,481	35.695	1,123,714.29	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	5,163	42.600	219,943.80	
GALP ENERGIA SGPS SA	38,155	8.472	323,249.16	
GEA GROUP AG	11,493	45.160	519,023.88	
GETLINK SE - REGR	36,200	13.190	477,478.00	
GRIFOLS SA	22,530	17.620	396,978.60	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,524	100.950	860,497.80	
HANNOVER RUECK SE	4,547	159.550	725,473.85	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,238	63.880	717,883.44	
HEINEKEN HOLDING NV	8,780	78.150	686,157.00	
HEINEKEN NV	19,600	92.860	1,820,056.00	
HELLOFRESH SE	12,431	94.160	1,170,502.96	
HENKEL AG & CO KGAA	7,949	70.500	560,404.50	
HENKEL KGAA-VORZUG	13,349	75.380	1,006,247.62	
HERMES INTERNATIONAL	2,389	1,675.500	4,002,769.50	
IBERDROLA SA	446,145	10.090	4,501,603.05	
INDITEX SA	82,190	30.470	2,504,329.30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	98,655	43.165	4,258,443.07	

INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	26,728	10.095	269,819.16	
ING GROEP NV-CVA	294,294	12.830	3,775,792.02	
INPOST SA	15,739	11.548	181,753.97	
INTESA SANPAOLO	1,243,386	2.384	2,964,232.22	
IPSEN	2,801	90.280	252,874.28	
JDE PEET'S BV	5,836	25.790	150,510.44	
JERONIMO MARTINS	18,624	19.310	359,629.44	
JUST EAT TAKEAWAY	13,597	63.850	868,168.45	
KBC GROEP NV	18,786	74.860	1,406,319.96	
KERING	5,660	716.900	4,057,654.00	
KERRY GROUP PLC-A	11,981	115.750	1,386,800.75	
KESKO OYJ-B SHS	20,316	28.560	580,224.96	
KINGSPAN GROUP PLC	11,636	100.600	1,170,581.60	
KION GROUP AG	5,428	101.300	549,856.40	
KNORR-BREMSE AG	5,528	92.380	510,676.64	
KONE OYJ	25,640	62.580	1,604,551.20	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	78,359	30.065	2,355,863.33	
KONINKLIJKE DSM NV	13,181	198.400	2,615,110.40	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	68,793	36.705	2,525,047.06	
L'OREAL SA	19,010	425.500	8,088,755.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	7,060	43.120	304,427.20	
LANXESS	6,228	55.280	344,283.84	
LEG IMMOBILIEN SE	5,496	129.450	711,457.20	
LEGRAND SA	20,166	97.880	1,973,848.08	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,952	733.500	15,368,292.00	
MEDIOBANCA SPA	46,575	10.560	491,832.00	
MERCK KGAA	9,734	221.000	2,151,214.00	
MICHELIN (C.G.D.E.)	12,757	137.400	1,752,811.80	
MONCLER SPA	15,479	67.800	1,049,476.20	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,028	180.850	728,463.80	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	10,558	247.200	2,609,937.60	
NATURGY ENERGY GROUP SA	22,065	22.920	505,729.80	
NEMETSCHEK SE	4,323	113.250	489,579.75	
NESTE OYJ	31,765	45.120	1,433,236.80	
NEXI SPA	33,129	14.430	478,051.47	
NN GROUP NV	20,209	46.710	943,962.39	
NOKIA OYJ	405,979	5.217	2,117,992.44	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	5,102	86.000	438,772.00	
OMV AG	10,919	49.150	536,668.85	
ORANGE S.A.	153,603	9.660	1,483,804.98	
ORION OYJ-CLASS B	7,967	36.600	291,592.20	
ORPEA	3,931	86.500	340,031.50	

PERNOD-RICARD	15,803	212.200	3,353,396.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	11,479	82.100	942,425.90	
POSTE ITALIANE SPA	41,070	12.065	495,509.55	
PROSUS	70,501	77.380	5,455,367.38	
PROXIMUS	12,120	16.385	198,586.20	
PRYSMIAN SPA	19,178	34.870	668,736.86	
PUBLICIS GROUPE	16,780	59.920	1,005,457.60	
PUMA AG	7,999	114.700	917,485.30	
QIAGEN NV	17,261	49.520	854,764.72	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	11,015	26.300	289,694.50	
RANDSTAD NV	9,001	61.620	554,641.62	
RATIONAL AG	384	867.200	333,004.80	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	7,844	56.520	443,342.88	
RED ELECTRICA DE ESPANA	32,653	18.080	590,366.24	
REMY COINTREAU	1,690	193.600	327,184.00	
RENAULT SA	14,465	32.930	476,332.45	
REPSOL SA	108,980	10.374	1,130,558.52	
ROYAL KPN NV	259,271	2.571	666,585.74	
RWE AG	48,397	32.750	1,585,001.75	
SAFRAN SA	25,809	112.960	2,915,384.64	
SAMPO OYJ	37,678	43.710	1,646,905.38	
SANOFI	85,635	88.900	7,612,951.50	
SAP SE	78,784	125.880	9,917,329.92	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,977	574.800	1,136,379.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,085	501.400	1,045,419.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,612	161.420	6,555,589.04	
SCOR REGROUPE	11,900	27.220	323,918.00	
SCOUT24 SE	6,562	64.620	424,036.44	
SEB SA	2,089	138.000	288,282.00	
SIEMENS AG	57,729	155.200	8,959,540.80	
SIEMENS ENERGY AG	30,142	24.300	732,450.60	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	18,004	21.910	394,467.64	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,224	66.380	1,408,849.12	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	18,496	46.260	855,624.96	
SNAM SPA	150,948	5.016	757,155.16	
SOCIETE GENERALE	60,748	28.840	1,751,972.32	
SODEXO	6,656	78.660	523,560.96	
SOFINA	1,144	401.000	458,744.00	
SOLVAY SA	5,589	104.350	583,212.15	
STMICROELECTRONICS NV	51,468	45.810	2,357,749.08	
STORA ENSO OYJ	43,540	14.970	651,793.80	
SUEZ	26,637	19.675	524,082.97	
SYMRISE AG	9,702	130.700	1,268,051.40	
TEAMVIEWER AG	12,164	13.055	158,801.02	
TELECOM ITALIA SPA	1,196,431	0.346	413,965.12	

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	83,265	2.397	199,586.20	
	TELEFONICA SA	390,874	3.967	1,550,597.15	
	TELEPERFORMANCE	4,432	365.000	1,617,680.00	
	TENARIS SA	34,419	9.492	326,705.14	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	106,251	6.714	713,369.21	
	THALES SA	7,997	78.240	625,685.28	
	TOTALENERGIES SE	188,489	41.895	7,896,746.65	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	6,999	45.560	318,874.44	
	UCB SA	9,537	102.450	977,065.65	
	UMICORE	14,827	44.540	660,394.58	
	UNICREDIT SPA	159,950	10.968	1,754,331.60	
	UNIPER SE	6,938	37.820	262,395.16	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,414	34.580	256,376.12	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	53,660	25.030	1,343,109.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	40,077	32.300	1,294,487.10	
	VALEO SA	17,350	28.400	492,740.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	41,578	29.020	1,206,593.56	
	VINCI SA	40,352	88.650	3,577,204.80	
	VIVENDI SA	53,660	11.050	592,943.00	
	VOESTALPINE AG	8,594	30.380	261,085.72	
	VOLKSWAGEN AG	2,477	277.400	687,119.80	
	VOLKSWAGEN AG	14,023	180.640	2,533,114.72	
	VONOVIA SE	41,426	55.720	2,308,256.72	
	VOPAK	5,281	33.550	177,177.55	
	WARTSILA OYJ	35,574	12.730	452,857.02	
	WENDEL	2,075	110.300	228,872.50	
	WOLTERS KLUWER NV	20,176	100.400	2,025,670.40	
	WORLDLINE SA	17,966	50.130	900,635.58	
	ZALANDO SE	16,723	85.580	1,431,154.34	
	ユーロ 小計	14,340,619		382,183,780.66 (49,175,587,058)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	913,675	84.600	77,296,905.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	282,539	24.450	6,908,078.55	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	131,100	20.750	2,720,325.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	150,600	17.040	2,566,224.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	152,409	45.800	6,980,332.20	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	204,409	52.100	10,649,708.90	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	52,000	46.500	2,418,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	124,643	76.000	9,472,868.00	
	ESR CAYMAN LTD	151,800	26.700	4,053,060.00	

GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,810	46.250	7,622,462.50	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	156,157	16.640	2,598,452.48	
HANG SENG BANK LTD	58,212	143.200	8,335,958.40	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,641	33.750	3,902,883.75	
HONG KONG & CHINA GAS	854,437	11.680	9,979,824.16	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	90,911	464.400	42,219,068.40	
MTR CORP	124,755	41.750	5,208,521.25	
NEW WORLD DEVELOPMENT	122,917	34.500	4,240,636.50	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	106,087	47.150	5,002,002.05	
SANDS CHINA LTD	187,780	19.480	3,657,954.40	
SINO LAND CO	260,000	9.970	2,592,200.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	106,000	25.950	2,750,700.00	
SJM HOLDINGS LTD	157,000	6.150	965,550.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	99,523	100.500	10,002,061.50	
SWIRE PACIFIC LTD	39,866	47.500	1,893,635.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	93,800	21.000	1,969,800.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	103,500	170.400	17,636,400.00	
WH GROUP LTD	723,500	5.210	3,769,435.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	128,733	42.200	5,432,532.60	
WYNN MACAU LTD	133,303	7.200	959,781.60	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	138,000	20.300	2,801,400.00	
香港・ドル 小計	6,128,107		266,606,761.24 (3,905,789,052)	
合計	82,482,243		487,369,676,341 (487,369,676,341)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	39,608.00	632,935.84	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,564.00	2,182,522.40	
		AMERICAN TOWER REIT INC	34,327.00	8,958,660.46	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	105,561.00	885,656.79	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,486.00	2,537,716.86	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,187.00	1,308,207.78	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,268.00	1,208,305.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,637.00	5,996,722.38	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,258.00	3,519,899.64	

	DUKE REALTY CORP	28,167.00	1,653,121.23	
	EQUINIX INC	6,762.00	5,332,039.86	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,987.00	1,101,037.86	
	EQUITY RESIDENTIAL	26,711.00	2,298,214.44	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,885.00	1,697,146.70	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,047.00	2,031,101.52	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,494.00	1,385,299.74	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	53,417.00	910,759.85	
	INVITATION HOMES INC	42,654.00	1,744,975.14	
	IRON MOUNTAIN INC	21,818.00	1,016,936.98	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	44,841.00	971,704.47	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,519.00	1,715,215.46	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	17,781.00	519,027.39	
	ORION OFFICE REIT INC	4,010.00	70,736.40	
	PROLOGIS INC	55,809.00	8,383,627.98	
	PUBLIC STORAGE	11,848.00	3,930,455.52	
	REALTY INCOME CORP	40,104.00	2,843,774.64	
	REGENCY CENTERS CORP	11,435.00	843,903.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,253.00	2,847,202.47	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,795.00	4,134,318.30	
	SUN COMMUNITIES INC	8,403.00	1,647,828.30	
	UDR INC	22,310.00	1,252,706.50	
	VENTAS INC	28,252.00	1,450,740.20	
	VICI PROPERTIES INC	40,656.00	1,157,069.76	
	VORNADO REALTY TRUST	12,357.00	546,673.68	
	WELLTOWER INC	31,495.00	2,651,564.05	
	WP CAREY INC	13,388.00	1,036,632.84	
アメリカ・ドル	小計	905,094.00	82,404,441.43 (9,402,346,767)	
イギリス・ボ ンド	BRITISH LAND CO PLC	66,349.00	350,853.51	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	53,272.00	396,130.59	
	SEGRO PLC	90,105.00	1,263,272.10	
イギリス・ボ ンド	小計	209,726.00	2,010,256.20 (308,292,891)	
オーストラ リア・ドル	DEXUS/AU	89,929.00	992,816.16	
	GOODMAN GROUP	129,849.00	3,181,300.50	
	GPT GROUP	158,118.00	817,470.06	
	MIRVAC GROUP	319,447.00	897,646.07	
	SCENTRE GROUP	408,557.00	1,282,868.98	
	STOCKLAND	189,962.00	832,033.56	
	VICINITY CENTRES	316,633.00	554,107.75	

オーストラリア・ドル 小計		1,612,495.00	8,558,243.08 (705,969,472)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,410.00	374,600.40	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	11,851.00	270,676.84	
カナダ・ドル 小計		18,261.00	645,277.24 (58,191,102)	
シンガポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	253,300.00	770,032.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	378,490.00	828,893.10	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	163,100.00	349,034.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	228,300.00	447,468.00	
シンガポール・ドル 小計		1,023,190.00	2,395,427.10 (200,569,111)	
ユーロ	COVIVIO	3,883.00	281,983.46	
	GECINA SA	3,411.00	409,320.00	
	KLEPIERRE	15,493.00	307,768.44	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	9,377.00	584,468.41	
ユーロ 小計		32,164.00	1,583,540.31 (203,754,132)	
香港・ドル	LINK REIT	157,471.00	11,251,302.95	
香港・ドル 小計		157,471.00	11,251,302.95 (164,831,588)	
投資証券 合計		3,958,401	11,043,955,063 (11,043,955,063)	
合計			11,043,955,063 (11,043,955,063)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

- 1．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
- 2．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 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 598銘柄	69.86	-	73.89
	投資証券 36銘柄	-	1.83	
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	4.06	-	4.25
	投資証券 3銘柄	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄	1.81	-	2.01
	投資証券 7銘柄	-	0.14	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.38	-	3.50
	投資証券 2銘柄	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.26	-	0.31
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.91	-	3.00
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	1.08	-	1.12
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.79	-	0.81
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.07	-	0.07
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.19	-	0.19
ユーロ	株式 230銘柄	9.57	-	9.91
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式 30銘柄	0.76	-	0.82
	投資証券 1銘柄	-	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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11月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	128,403,221
金銭信託	1,244,163
コール・ローン	188,080,120
国債証券	46,032,023,199
派生商品評価勘定	50,817
未収利息	213,297,401
前払費用	16,310,986
流動資産合計	46,579,409,907
資産合計	
46,579,409,907	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	320,028
未払金	77,090,399
未払解約金	99,622,048
その他未払費用	226
流動負債合計	177,032,701
負債合計	
177,032,701	
純資産の部	
元本等	
元本	30,507,939,274
剰余金	
剰余金又は欠損金()	15,894,437,932
元本等合計	46,402,377,206
純資産合計	46,402,377,206
負債純資産合計	46,579,409,907

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	22,593,334,379円
同期中追加設定元本額	12,260,352,422円
同期中一部解約元本額	4,345,747,527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)	2,986,163,468円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,056,378,960円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,880,695,095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)	794,936,383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)	2,894,140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)	9,637,810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)	8,084,024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	12,544,184,354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)	2,775,104,707円
DCニッセイ外国債券インデックス	1,797,970,791円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	129,096,191円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,394,471,048円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	145,528,684円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	316,245,375円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	70,634,260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)	124,824,289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)	13,130,579円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	36,185,694円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	84,716,044円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	59,442,181円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	127,218,574円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	150,396,623円
計	30,507,939,274円
2. 受益権の総数	30,507,939,274口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		389,831,691
合計		389,831,691

(注)「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年5月21日から2021年11月22日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年11月22日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	111,809,918	-	111,540,707	269,211
イギリス・ポンド	69,861,962	-	69,863,591	1,629
オーストラリア・ドル	4,462,520	-	4,444,245	18,275
カナダ・ドル	3,463,549	-	3,433,443	30,106
スウェーデン・クローナ	1,799,462	-	1,788,036	11,426
デンマーク・クローネ	380,206	-	380,149	57
ノルウェー・クローネ	352,087	-	352,024	63
ユーロ	515,001	-	510,784	4,217
ユーロ	30,975,131	-	30,768,435	206,696
合計	111,809,918	-	111,540,707	269,211

(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。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月22日現在	
1口当たり純資産額		1.5210円
(1万口当たり純資産額)		(15,210円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	153,374.40	
		US TREASURY BONDS	90,000.00	113,695.20	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	150,801.60	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	227,672.50	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	120,324.00	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,277,816.40	
		US TREASURY N/B	430,000.00	489,490.50	
		US TREASURY N/B	160,000.00	221,105.60	
		US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,257,149.50	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,805,607.10	
		US TREASURY N/B	580,000.00	673,525.00	
		US TREASURY N/B	410,000.00	532,134.90	
		US TREASURY N/B	3,690,000.00	3,820,995.00	
		US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,152,215.60	
		US TREASURY N/B	420,000.00	555,676.80	
		US TREASURY N/B	3,710,000.00	3,886,225.00	
		US TREASURY N/B	4,730,000.00	4,938,971.40	
		US TREASURY N/B	3,470,000.00	3,620,320.40	
		US TREASURY N/B	550,000.00	668,206.00	
		US TREASURY N/B	2,510,000.00	2,613,914.00	
		US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,762,195.10	
		US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,775,438.30	
		US TREASURY N/B	370,000.00	445,805.60	
		US TREASURY N/B	460,000.00	599,255.80	
		US TREASURY N/B	410,000.00	516,436.00	
		US TREASURY N/B	500,000.00	596,875.00	
		US TREASURY N/B	650,000.00	715,812.50	
		US TREASURY N/B	320,000.00	383,747.20	
		US TREASURY N/B	420,000.00	494,251.80	
		US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,613,895.00	
		US TREASURY N/B	3,270,000.00	3,419,929.50	
		US TREASURY N/B	240,000.00	288,796.80	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,500,825.90	
		US TREASURY N/B	3,060,000.00	3,123,464.40	
US TREASURY N/B	530,000.00	586,747.10			
US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,138,883.80			
US TREASURY N/B	3,040,000.00	3,102,107.20			
US TREASURY N/B	540,000.00	598,131.00			
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,746,591.20			
US TREASURY N/B	2,860,000.00	2,901,756.00			
US TREASURY N/B	640,000.00	678,195.20			

US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,880,414.00	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,433,792.40	
US TREASURY N/B	320,000.00	379,836.80	
US TREASURY N/B	2,740,000.00	2,835,790.40	
US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,544,925.90	
US TREASURY N/B	580,000.00	704,833.40	
US TREASURY N/B	3,110,000.00	3,215,802.20	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,318,224.50	
US TREASURY N/B	420,000.00	511,887.60	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,734,784.80	
US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,493,216.30	
US TREASURY N/B	620,000.00	723,750.80	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,597,626.80	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,242,570.50	
US TREASURY N/B	130,000.00	179,912.20	
US TREASURY N/B	630,000.00	736,136.10	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,500,912.00	
US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,393,695.20	
US TREASURY N/B	150,000.00	210,655.50	
US TREASURY N/B	730,000.00	893,848.50	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,815,941.60	
US TREASURY N/B	1,950,000.00	2,129,595.00	
US TREASURY N/B	770,000.00	965,325.90	
US TREASURY N/B	150,000.00	188,659.50	
US TREASURY N/B	230,000.00	315,978.60	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,646,022.50	
US TREASURY N/B	2,690,000.00	2,943,532.50	
US TREASURY N/B	850,000.00	1,042,941.50	
US TREASURY N/B	230,000.00	325,358.00	
US TREASURY N/B	1,980,000.00	2,126,084.40	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,268,694.60	
US TREASURY N/B	840,000.00	1,102,659.60	
US TREASURY N/B	250,000.00	348,777.50	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,420,881.20	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,253,971.60	
US TREASURY N/B	900,000.00	1,109,349.00	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,659,634.00	
US TREASURY N/B	940,000.00	1,001,278.60	
US TREASURY N/B	250,000.00	359,285.00	
US TREASURY N/B	880,000.00	1,062,283.20	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,259,532.50	
US TREASURY N/B	860,000.00	871,825.00	
US TREASURY N/B	850,000.00	911,157.50	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,592,526.00	
US TREASURY N/B	640,000.00	654,624.00	
US TREASURY N/B	240,000.00	316,490.40	
US TREASURY N/B	770,000.00	848,316.70	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,537,575.00	
US TREASURY N/B	480,000.00	493,084.80	

US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,113,030.30	
US TREASURY N/B	230,000.00	317,480.50	
US TREASURY N/B	980,000.00	997,796.80	
US TREASURY N/B	120,000.00	175,537.20	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,786,804.80	
US TREASURY N/B	420,000.00	406,593.60	
US TREASURY N/B	3,050,000.00	3,042,710.50	
US TREASURY N/B	780,000.00	681,642.00	
US TREASURY N/B	250,000.00	366,815.00	
US TREASURY N/B	790,000.00	756,298.60	
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,848,909.00	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,124,198.40	
US TREASURY N/B	990,000.00	862,884.00	
US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,696,303.60	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,117,353.80	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,943,892.00	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,186,002.20	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	963,762.60	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,724,026.80	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,636,316.10	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,033,220.00	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,376,364.10	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,295,511.40	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,054,902.30	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,051,180.80	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,153,280.90	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,537,034.20	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,358,218.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,486,275.00	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,386,409.20	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,145,000.00	
US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,500,311.40	
US TREASURY N/B	970,000.00	938,475.00	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,125,124.50	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,243,799.90	
US TREASURY N/B	1,870,000.00	1,833,179.70	
US TREASURY N/B	260,000.00	312,059.80	
US TREASURY N/B	270,000.00	324,791.10	
US TREASURY N/B	250,000.00	295,507.50	
US TREASURY N/B	290,000.00	329,976.50	
US TREASURY NOTES	130,000.00	179,927.80	
WI TREASURY SEC.	250,000.00	349,950.00	
WI TREASURY SEC.	1,140,000.00	970,550.40	
WI TREASURY SEC.	1,520,000.00	1,416,032.00	
WI TREASURY SEC.	230,000.00	323,777.90	
WI TREASURY SEC.	230,000.00	299,853.30	
アメリカ・ドル 小計	181,580,000.00 (20,718,278,000)	189,441,433.40 (21,615,267,551)	

イギリス・ボンド	UK TREASURY	220,000.00	312,048.00	
	UK TREASURY	350,000.00	575,260.00	
	TSY 4 1/4% 2036	310,000.00	442,562.20	
	TSY 4 1/4% 2046	310,000.00	524,048.80	
	UK TREASURY	230,000.00	279,208.50	
	UK TREASURY	330,000.00	440,675.40	
	UK TREASURY	230,000.00	348,916.90	
	UK TREASURY	270,000.00	417,244.50	
	UK TREASURY	310,000.00	601,933.20	
	UK TREASURY	300,000.00	403,287.00	
	UK TREASURY	230,000.00	456,927.20	
	UK TREASURY	270,000.00	426,135.60	
	UK TREASURY	300,000.00	343,842.00	
	UK TREASURY	180,000.00	245,925.00	
	UK TSY 0 1/4% 2031	520,000.00	489,876.40	
	UK TREASURY	270,000.00	233,647.20	
	UK TREASURY	640,000.00	638,284.80	
	UK TREASURY	590,000.00	585,457.00	
	UK TREASURY	310,000.00	304,795.10	
	UK TREASURY	240,000.00	232,356.00	
	UK TREASURY	290,000.00	286,296.70	
	UK TREASURY	270,000.00	259,888.50	
	UK TREASURY	290,000.00	291,539.90	
	UK TREASURY	190,000.00	171,364.80	
	UK TREASURY	240,000.00	250,528.80	
	UK TREASURY	340,000.00	372,677.40	
	UK TREASURY	240,000.00	248,716.80	
	UK TREASURY	430,000.00	440,758.60	
	UK TREASURY	270,000.00	287,558.10	
	UK TREASURY	250,000.00	292,472.50	
	UK TREASURY	200,000.00	267,508.00	
	UK TREASURY	280,000.00	283,799.60	
	UK TREASURY	200,000.00	233,264.00	
	UK TREASURY	340,000.00	420,263.80	
	UK TREASURY	290,000.00	299,311.90	
	UK TREASURY	210,000.00	223,141.80	
	UK TREASURY	260,000.00	274,588.60	
	UK TREASURY	250,000.00	252,492.50	
	UK TREASURY	280,000.00	561,635.20	
	UK TREASURY	380,000.00	541,112.40	
	UK TREASURY	230,000.00	395,089.40	
	UK TREASURY	360,000.00	537,339.60	
	UK TREASURY	230,000.00	409,763.40	
UK TREASURY	420,000.00	395,913.00		
UK TREASURY	190,000.00	180,640.60		
UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	443,245.60		
UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	416,784.00		
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	372,175.60		

	UNITED KINGDOM GILT	150,000.00	157,818.00	
	UNITED KINGDOM GILT	160,000.00	160,196.80	
	UNITED KINGDOM GILT	110,000.00	108,105.80	
	UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	188,983.50	
	UNITED KINGDOM GILT	30,000.00	29,713.50	
	UNITED KINGDOM GILT	110,000.00	125,160.20	
イギリス・ボンド	小計	15,120,000.00 (2,318,803,200)	18,482,279.70 (2,834,442,415)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	360,000.00	397,512.00	
	ISRAEL FIXED BOND	590,000.00	604,602.50	
	ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	677,300.00	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	487,586.00	
	ISRAEL FIXED BOND	860,000.00	906,999.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	371,823.50	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	412,699.00	
	ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	481,608.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	604,617.00	
	ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	630,936.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	318,714.00	
	ISRAEL FIXED BOND	80,000.00	80,112.00	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	151,200.00	
イスラエル・シュケル	小計	5,460,000.00 (201,334,224)	6,125,709.00 (225,881,844)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	378,396.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	283,281.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	419,552.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	428,047.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	160,000.00	173,636.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	353,545.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	277,658.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	190,000.00	215,553.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	323,339.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	364,398.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	273,270.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	240,000.00	258,345.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	448,874.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	377,807.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	530,600.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	263,137.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	448,224.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	368,160.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	540,000.00	505,024.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	460,247.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	326,865.80	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	244,910.80		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	490,933.70		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	374,049.00		

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	336,056.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	417,873.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	434,054.40	
オーストラリア・ドル 小計		9,420,000.00 (777,055,800)	9,775,842.30 (806,409,231)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	725,104.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	600,000.00	629,610.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,001,820.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,007,910.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	1,097,448.00	
オフショア・人民元 小計		4,420,000.00 (78,863,850)	4,461,892.80 (79,611,322)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	100,000.00	118,012.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	257,210.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	231,024.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	156,083.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	323,014.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	206,830.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	217,068.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	130,574.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	181,825.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	204,621.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	175,120.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	333,887.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	240,252.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	199,497.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	580,413.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	750,000.00	748,072.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	178,792.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	215,560.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	181,609.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	604,053.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	199,964.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	530,000.00	513,909.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	418,185.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	510,000.00	462,024.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	380,000.00	362,037.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	430,000.00	421,550.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	367,606.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	366,747.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	690,011.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	362,244.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	78,947.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	158,232.60	
CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	198,200.00		
CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	78,429.60		
カナダ・ドル 小計		9,950,000.00 (897,291,000)	10,161,613.60 (916,374,314)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	138,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	330,000.00	340,781.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	111,204.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	140,699.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	145,810.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	144,625.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	144,620.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	144,751.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	90,000.00	95,643.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	61,502.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	63,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	123,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	210,922.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	164,925.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	173,920.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	58,290.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	80,000.00	78,978.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	48,244.00	
シンガポール・ドル 小計		2,270,000.00 (190,067,100)	2,389,745.50 (200,093,391)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,910,000.00	1,975,455.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,460,000.00	1,592,509.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,510,000.00	1,584,427.90	
	SWEDISH GOVERNMENT	690,000.00	834,686.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,170,000.00	1,220,532.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,220,000.00	1,279,536.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	820,000.00	1,235,215.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	991,380.00	
スウェーデン・クローナ 小計		9,780,000.00 (124,499,400)	10,713,742.80 (136,385,946)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,010,000.00	1,054,611.70	
	KINGDOM OF DENMARK	1,040,000.00	1,135,076.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,390,000.00	1,462,863.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,740,000.00	1,841,494.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,390,000.00	1,402,718.50	
	KINGDOM OF DENMARK	820,000.00	825,854.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	1,006,970.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,190,000.00	3,972,506.70	
	KINGDOM OF DENMARK	730,000.00	743,081.60	
デンマーク・クローネ 小計		11,310,000.00 (195,663,000)	13,445,178.10 (232,601,581)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,590,000.00	1,610,685.90	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	1,297,587.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	980,000.00	990,623.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	850,000.00	850,977.50	

	NORWEGIAN GOVERNMENT	770,000.00	779,409.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	740,000.00	761,659.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	780,000.00	790,803.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	1,054,046.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	630,000.00	612,423.00	
ノルウェー・クローネ 小計		8,660,000.00 (110,588,200)	8,748,215.60 (111,714,713)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	420,000.00	428,820.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,050,000.00	1,057,518.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	840,000.00	819,848.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	675,248.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	651,575.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	460,000.00	458,983.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,080,000.00	1,069,318.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	850,951.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	205,653.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	186,934.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	540,000.00	500,175.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	630,000.00	534,095.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	400,000.00	384,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	380,000.00	329,513.20	
ポーランド・ズロチ 小計		8,420,000.00 (231,011,962)	8,153,133.50 (223,690,186)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	457,807.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	445,842.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	410,135.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	130,000.00	140,840.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	798,690.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	630,245.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	649,337.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	830,000.00	860,726.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	379,879.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	397,138.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	270,000.00	277,816.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	382,879.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	218,339.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	245,610.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	60,000.00	62,238.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	193,645.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	40,000.00	42,722.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	379,557.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	202,021.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	316,451.20	
MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	368,651.40		
MALAYSIA GOVERNMENT	330,000.00	318,621.60		
マレーシア・リングgit 小計		7,960,000.00 (216,859,056)	8,179,197.80 (222,830,793)	

メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,749,033.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,060,000.00	5,156,696.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,570,000.00	3,500,063.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,970,000.00	6,584,907.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,980,000.00	3,993,293.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,840,000.00	7,371,468.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,250,000.00	1,513,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,560,000.00	3,639,067.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,790,000.00	4,896,242.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,770,000.00	5,816,044.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,440,000.00	5,788,268.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,310,000.00	4,559,290.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,350,000.00	3,367,654.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	200,000.00	183,894.00	
メキシコ・ペソ	小計	56,810,000.00 (310,943,854)	58,119,124.70 (318,109,217)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	262,065.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	304,612.00	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	606,026.70	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	323,573.80	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	227,064.00	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	230,933.10	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	331,461.00	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	220,917.60	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	421,104.00	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	199,856.00	
	BELGIUM KINGDOM	360,000.00	386,010.00	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	256,638.90	
	BELGIUM KINGDOM	130,000.00	192,423.40	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	183,443.40	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	278,553.60	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	259,115.00	
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	173,792.40	
	BELGIUM KINGDOM	130,000.00	152,153.30	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	457,013.70	
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	366,526.80	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	227,738.00	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	348,620.80	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	263,671.80	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	245,647.20	
	BELGIUM KINGDOM	130,000.00	128,368.50	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	164,048.00	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	561,544.50	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	269,924.40	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	80,174.70	
	BONOS Y OBLIG DE	330,000.00	333,656.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	375,238.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	395,766.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	539,417.40		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	442,928.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	515,782.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	645,696.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	617,857.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	434,691.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	505,089.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	471,398.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	494,715.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	484,932.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	518,015.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	462,323.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	280,000.00	444,595.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	529,180.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	481,382.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	435,272.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	492,237.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	354,021.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	492,097.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	395,905.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	614,404.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	672,541.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	437,340.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	460,807.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	551,690.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	473,078.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	377,603.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	425,887.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	324,672.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	444,290.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	410,552.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	451,983.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	436,359.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	410,755.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	352,225.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	511,811.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	693,728.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	323,816.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	415,817.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	401,734.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	404,924.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	92,638.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	280,000.00	280,828.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	180,000.00	180,748.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	100,711.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,000.00	30,289.80	
BUNDESobligation	430,000.00	435,134.20	
BUNDESobligation	420,000.00	426,963.60	
BUNDESobligation	420,000.00	429,874.20	
BUNDESobligation	380,000.00	389,880.00	

BUNDESobligation	470,000.00	483,578.30	
BUNDESobligation	90,000.00	92,853.90	
BUNDESobligation	460,000.00	474,163.40	
BUNDESobligation	50,000.00	50,996.00	
BUNDESobligation	320,000.00	330,108.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	391,149.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	610,768.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	608,727.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	741,104.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000.00	814,867.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	946,080.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	504,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	552,286.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	554,195.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	610,020.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	460,000.00	764,625.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	588,644.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	607,120.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	596,164.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	634,396.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	761,369.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	772,418.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	544,950.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	569,683.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	539,105.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	519,055.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	555,461.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	370,000.00	639,130.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	530,099.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	455,589.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	430,000.00	442,345.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	592,446.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	864,437.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	130,000.00	135,853.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	559,742.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	340,000.00	348,194.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	110,000.00	112,382.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	460,000.00	475,419.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	330,000.00	342,236.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	145,133.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	120,000.00	120,248.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	313,380.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	872,440.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	260,000.00	262,243.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	310,000.00	313,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	443,914.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	558,069.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	548,345.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	590,510.70	

BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	731,479.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	433,130.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	649,404.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	412,024.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	750,000.00	793,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	605,463.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	506,293.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	528,850.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	411,336.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	703,976.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	756,151.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	401,798.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	739,128.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	662,720.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	331,122.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	549,988.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	810,000.00	827,406.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	211,536.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	417,499.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	644,037.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	895,942.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	427,713.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	760,621.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	349,045.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	770,000.00	849,787.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	435,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	752,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	465,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	356,465.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	368,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	498,325.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	317,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	674,489.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	508,281.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	561,633.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	669,270.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	349,452.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	280,173.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	704,241.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	213,084.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	437,370.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	378,132.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	453,750.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	486,081.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	295,041.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	440,853.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	574,001.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	623,212.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	475,433.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	297,909.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	856,927.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	258,900.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	421,645.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	256,516.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	130,000.00	135,094.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	90,000.00	88,871.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	311,621.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	352,884.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	171,013.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	229,008.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	40,000.00	41,441.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	162,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	140,000.00	139,862.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	49,643.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	587,573.50	
DEUTSCHLAND REP	270,000.00	376,220.70	
DEUTSCHLAND REP	270,000.00	381,485.70	
DEUTSCHLAND REP	220,000.00	300,084.40	
DEUTSCHLAND REP	340,000.00	531,001.80	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	182,008.50	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	138,873.80	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	163,738.30	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	86,787.20	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	93,002.40	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	137,763.60	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	136,399.90	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	111,620.30	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	137,432.10	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	102,344.40	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	88,951.10	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	127,410.00	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	69,731.20	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	105,574.50	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	70,299.60	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	111,722.60	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	65,432.50	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	91,874.70	
FINNISH GOVERNMENT	40,000.00	42,355.20	
FINNISH GOVERNMENT	40,000.00	40,844.40	
FINNISH GOVERNMENT	40,000.00	41,052.00	
FRANCE (GOVT OF)	950,000.00	1,131,915.50	
FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	886,297.50	
FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	1,027,996.20	
FRANCE (GOVT OF)	490,000.00	786,469.60	
FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	708,136.80	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	839,038.20	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	784,122.20	
FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	1,219,531.50	

FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	873,994.80	
FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	766,389.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,150,040.00	
FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	1,033,804.80	
FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	889,975.50	
FRANCE (GOVT OF)	270,000.00	361,897.20	
FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	900,307.70	
FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	778,005.00	
FRANCE (GOVT OF)	540,000.00	672,094.80	
FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	853,705.60	
FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	737,170.50	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	848,962.80	
FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	997,062.30	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	827,498.80	
FRANCE (GOVT OF)	920,000.00	988,595.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,310,000.00	1,332,518.90	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	806,855.00	
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	1,255,457.50	
FRANCE (GOVT OF)	620,000.00	752,996.20	
FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	929,931.20	
FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	929,701.50	
FRANCE (GOVT OF)	810,000.00	822,571.20	
FRANCE (GOVT OF)	570,000.00	574,047.00	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	818,944.00	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	856,432.20	
FRANCE (GOVT OF)	810,000.00	956,723.40	
FRANCE (GOVT OF)	320,000.00	664,547.20	
FRANCE (GOVT OF)	920,000.00	929,144.80	
FRANCE (GOVT OF)	390,000.00	394,410.90	
FRANCE (GOVT OF)	350,000.00	353,615.50	
FRANCE (GOVT OF)	160,000.00	134,790.40	
FRANCE (GOVT OF)	220,000.00	218,614.00	
FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	719,474.40	
FRANCE (GOVT OF)	260,000.00	266,000.80	
FRANCE (GOVT OF)	130,000.00	129,831.00	
FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	1,092,615.90	
FRANCE (GOVT OF)	380,000.00	749,755.20	
IRISH TREASURY	170,000.00	167,657.40	
IRISH TREASURY	150,000.00	152,701.50	
IRISH TREASURY	140,000.00	144,012.40	
IRISH TREASURY	100,000.00	101,299.00	
IRISH TREASURY	80,000.00	80,034.40	
IRISH TREASURY	240,000.00	256,003.20	
IRISH TREASURY	190,000.00	206,864.40	
IRISH TREASURY	100,000.00	112,306.00	
IRISH TREASURY	120,000.00	135,044.40	
IRISH TREASURY	130,000.00	154,078.60	
IRISH TREASURY	120,000.00	143,432.40	
IRISH TREASURY	180,000.00	235,198.80	

IRISH TREASURY	180,000.00	218,073.60	
IRISH TREASURY	150,000.00	160,923.00	
IRISH TREASURY	150,000.00	164,491.50	
IRISH TREASURY	130,000.00	137,924.80	
ITALIAN GOVT	200,000.00	271,028.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	655,129.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	375,982.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	417,424.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	322,368.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	393,030.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	378,856.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	311,112.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	295,095.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	179,122.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	324,204.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	549,973.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	240,672.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	218,526.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	276,542.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	614,589.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	297,972.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	190,000.00	182,409.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	203,780.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	120,000.00	119,325.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	316,118.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	110,000.00	112,897.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	207,072.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	174,136.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	212,434.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	395,981.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	187,488.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	304,398.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	300,171.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	318,654.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	233,082.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	191,139.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	242,038.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	69,819.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	189,747.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	208,072.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	214,050.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	451,474.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	232,434.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	186,049.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	222,945.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	119,340.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	65,984.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	68,991.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	121,308.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	201,632.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	10,213.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	110,488.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	20,380.60	
	IRISH TREASURY	210,000.00	251,926.50	
	ユーロ 小計	120,720,000.00 (15,533,042,400)	140,736,851.60 (18,108,610,695)	
国債証券 合計		41,904,301,046 (41,904,301,046)	46,032,023,199 (46,032,023,199)	
合計			46,032,023,199 (46,032,023,199)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
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 136銘柄	46.58	46.96
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	6.11	6.16
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.49	0.49
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.74	1.75
オフショア・人民元	国債証券 5銘柄	0.17	0.17
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	1.97	1.99
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.29	0.30
デンマーク・クローネ	国債証券 9銘柄	0.50	0.51
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.24	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.48	0.49
マレーシア・リングgit	国債証券 22銘柄	0.48	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.69	0.69
ユーロ	国債証券 332銘柄	39.03	39.34

(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。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	99,884,203
金銭信託	526,063
コール・ローン	79,524,910
投資証券	4,470,693,981
派生商品評価勘定	1,590
未収入金	177,379
未収配当金	4,320,984
流動資産合計	4,655,129,110
資産合計	
4,655,129,110	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,223
未払金	90,363,765
未払解約金	45,107,150
その他未払費用	79
流動負債合計	135,473,217
負債合計	
135,473,217	
純資産の部	
元本等	
元本	3,144,586,020
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,375,069,873
元本等合計	4,519,655,893
純資産合計	4,519,655,893
負債純資産合計	4,655,129,110

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,505,757,114円
同期中追加設定元本額	1,182,013,343円
同期中一部解約元本額	543,184,437円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,773,897,540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）	133,728,279円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	14,970,046円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	5,579,593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）	38,438,254円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	69,261,671円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	692,617円
DCニッセイ先進国リートインデックス	1,108,018,020円
計	3,144,586,020円
2. 受益権の総数	3,144,586,020口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資証券		851,192,172
合計		851,192,172

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年11月22日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
オーストラリア・ドル	8,276,108	-	8,275,475	633
香港・ドル	4,732,615	-	4,730,392	2,223
合計	3,543,493	-	3,545,083	1,590
合計	8,276,108	-	8,275,475	633

（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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4373円 (14,373円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	2,591.00	57,287.01	
		AGREE REALTY CORP	1,570.00	109,366.20	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,024.00	47,766.40	
		ALEXANDER'S INC	45.00	12,059.55	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,319.00	685,705.40	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	337.00	6,049.15	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,454.00	54,917.58	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3,324.00	177,302.16	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,038.00	16,915.40	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6,743.00	269,517.71	
AMERICOLD REALTY TRUST	5,759.00	185,094.26	
APARTMENT INCOME REIT CO	3,684.00	192,820.56	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2,995.00	23,361.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	4,844.00	75,808.60	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,833.00	26,945.10	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	629.00	7,831.05	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,413.00	825,980.13	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	418.00	6,215.66	
BOSTON PROPERTIES INC	3,420.00	399,934.80	
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1,295.00	6,410.25	
BRANDYWINE REALTY TRUST	5,036.00	71,259.40	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,816.00	192,039.12	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	4,093.00	106,049.63	
BRT APARTMENTS CORP	345.00	6,706.80	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,381.00	395,841.25	
CARETRUST REIT INC	2,352.00	48,662.88	
CEDAR REALTY TRUST INC	333.00	7,489.17	
CENTERSPACE	304.00	30,819.52	
CHATHAM LODGING TRUST	950.00	11,932.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	405.00	2,911.95	
CITY OFFICE REIT INC	1,032.00	18,596.64	
CLIPPER REALTY INC	93.00	845.37	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	2,599.00	49,796.84	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	490.00	21,952.00	
COREPOINT LODGING INC	1,013.00	15,711.63	
CORESITE REALTY CORP	1,027.00	176,027.80	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2,659.00	72,112.08	
COUSINS PROPERTIES INC	3,425.00	134,191.50	
CTO REALTY GROWTH INC	151.00	8,622.10	
CUBESMART	4,944.00	271,030.08	
CYRUSONE INC	3,016.00	269,539.92	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5,036.00	48,093.80	
DIGITAL REALTY TRUST INC	6,869.00	1,137,369.02	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	10,998.00	83,144.88	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5,848.00	18,596.64	
DOUGLAS EMMETT INC	4,648.00	164,957.52	
DUKE REALTY CORP	9,055.00	531,437.95	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,089.00	44,412.14	
EASTGROUP PROPERTIES	996.00	204,678.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	2,958.00	29,254.62	
EPR PROPERTIES	1,742.00	85,723.82	
EQUINIX INC	2,181.00	1,719,783.93	
EQUITY COMMONWEALTH	2,645.00	68,928.70	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,242.00	359,636.76	
EQUITY RESIDENTIAL	8,164.00	702,430.56	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	2,731.00	76,276.83	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,551.00	538,848.42	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,275.00	662,074.00	
FARMLAND PARTNERS INC	604.00	7,489.60	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,629.00	210,043.26	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3,171.00	194,065.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,581.00	72,887.44	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,666.00	9,712.78	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	5,506.00	255,533.46	
GEO GROUP INC/THE	2,701.00	23,876.84	
GETTY REALTY CORP	834.00	26,379.42	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	866.00	19,476.34	
GLADSTONE LAND CORP	430.00	12,108.80	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,212.00	36,431.64	
GLOBAL NET LEASE INC	2,765.00	41,336.75	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,256.00	106,178.16	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	5,591.00	192,330.40	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	13,480.00	461,150.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	962.00	9,898.98	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,424.00	110,316.24	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	17,223.00	293,652.15	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	3,443.00	92,306.83	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3,007.00	76,257.52	
INDUS REALTY TRUST INC	103.00	7,649.81	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	1,303.00	30,307.78	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	565.00	155,533.20	
INVITATION HOMES INC	14,199.00	580,881.09	
IRON MOUNTAIN INC	6,992.00	325,897.12	
JBG SMITH PROPERTIES	3,107.00	92,619.67	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	15,200.00	12,084.00	
KILROY REALTY CORP	2,401.00	167,157.62	
KIMCO REALTY CORP	15,098.00	360,389.26	
KITE REALTY GROUP TRUST	5,215.00	113,999.90	
LEXINGTON REALTY TRUST	7,103.00	108,178.69	
LIFE STORAGE INC	1,896.00	255,201.60	
LTC PROPERTIES INC	867.00	29,686.08	
MACERICH CO/THE	5,045.00	106,651.30	
MACK-CALI REALTY CORP	2,115.00	38,154.60	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	31,700.00	23,141.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	14,465.00	313,456.55	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,809.00	565,564.06	
MONMOUTH REIT -CL A	2,088.00	43,534.80	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,157.00	193,965.62	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,852.00	114,620.28	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,131.00	63,268.14	
NETSTREIT CORP	1,014.00	23,392.98	
NEXPOINT RESIDENTIAL	564.00	43,224.96	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,049.00	27,064.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,178.00	180,335.82	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	420.00	14,712.60	
ORION OFFICE REIT INC	1,316.00	23,214.24	
PARAMOUNT GROUP INC	4,143.00	37,411.29	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	5,522.00	104,365.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2,970.00	68,547.60	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,140.00	1,447.80	
PHYSICIANS REALTY TRUST	5,148.00	94,156.92	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2,737.00	51,318.75	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	601.00	17,849.70	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	399.00	7,062.30	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,266.00	17,888.58	
PRIME US REIT	11,300.00	9,492.00	
PROLOGIS INC	17,971.00	2,699,603.62	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	454.00	81,270.54	
PUBLIC STORAGE	3,678.00	1,220,139.72	
REALTY INCOME CORP	13,559.00	961,468.69	
REGENCY CENTERS CORP	3,794.00	279,997.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4,045.00	75,439.25	
RETAIL VALUE INC	359.00	2,164.77	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3,293.00	234,428.67	
RLJ LODGING TRUST	3,918.00	53,637.42	
RPT REALTY	2,088.00	28,522.08	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,447.00	128,175.26	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5,122.00	72,834.84	
SAFEHOLD INC	317.00	22,548.21	
SAUL CENTERS INC	390.00	20,529.60	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	956.00	14,349.56	
SERVICE PROPERTIES TRUST	3,908.00	39,236.32	
SIMON PROPERTY GROUP INC	8,062.00	1,344,257.88	
SITE CENTERS CORP	4,312.00	71,536.08	
SL GREEN REALTY CORP	1,564.00	114,484.80	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,165.00	148,185.30	
STAG INDUSTRIAL INC	4,055.00	173,432.35	
STORE CAPITAL CORP	6,268.00	211,043.56	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	2,601.00	24,501.42	
SUN COMMUNITIES INC	2,789.00	546,922.90	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	5,139.00	60,897.15	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2,154.00	45,212.46	
	TERRENO REALTY CORP	1,683.00	130,802.76	
	UDR INC	6,831.00	383,560.65	
	UMH PROPERTIES INC	914.00	21,387.60	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	291.00	16,939.11	
	URBAN EDGE PROPERTIES	2,663.00	48,999.20	
	URSTADT BIDDLE - CL A	1,030.00	20,651.50	
	VENTAS INC	9,569.00	491,368.15	
	VICI PROPERTIES INC	15,243.00	433,815.78	
	VORNADO REALTY TRUST	4,038.00	178,641.12	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,748.00	44,958.56	
	WELLTOWER INC	10,373.00	873,302.87	
	WHITESTONE REIT	765.00	7,305.75	
	WP CAREY INC	4,436.00	343,479.48	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	2,474.00	42,577.54	
アメリカ・ドル	小計	618,522.00	29,962,563.58 (3,418,728,503)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	3,378.00	3,749.58	
	ASSURA PLC	53,759.00	37,953.85	
	BIG YELLOW GROUP PLC	4,537.00	71,956.82	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	19,723.00	19,801.89	
	BRITISH LAND CO PLC	23,831.00	126,018.32	
	CAPITAL & COUNTIES PRO-W/I	27,207.00	45,680.55	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	14,406.00	13,397.58	
	CUSTODIAN REIT PLC	5,885.00	5,561.32	
	DERWENT LONDON PLC	2,972.00	101,909.88	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	16,612.00	13,804.57	
	GCP STUDENT LIVING PLC	10,898.00	22,885.80	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	5,644.00	42,188.90	
	HAMMERSON PLC	96,300.00	31,490.10	
	HOME REIT PLC	5,519.00	6,402.04	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	10,174.00	12,188.45	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	6,989.00	3,536.43	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,544.00	130,457.18	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	21,561.00	59,378.99	
	LXI REIT PLC	16,001.00	23,585.47	
	NEWRIVER REIT PLC	6,981.00	5,138.01	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	13,020.00	12,837.72	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	32,358.00	49,313.59	
	PRS REIT PLC/THE	10,611.00	10,717.11	
	REGIONAL REIT LTD	15,531.00	14,008.96	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	4,982.00	65,114.74	
	SEGRO PLC	29,447.00	412,846.94	
	SHAFTESBURY PLC	7,010.00	45,529.95	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	9,970.00	7,327.95	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	17,523.00	20,852.37	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	11,942.00	11,285.19	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	45,786.00	108,695.96	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	16,967.00	12,810.08	
	UNITE GROUP PLC	9,695.00	107,032.80	
	WORKSPACE GROUP PLC	2,940.00	25,092.90	
	イギリス・ポンド 小計	617,290.00	1,680,571.57 (257,732,456)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	3,643.00	77,741.62	
	イスラエル・シュケル 小計	3,643.00	77,741.62 (2,866,676)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	8,316.00	29,854.44	
	ARENA REIT	9,254.00	40,810.14	
	AVENTUS GROUP	10,542.00	35,842.80	
	BWP TRUST	9,674.00	39,856.88	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	16,068.00	53,024.40	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	11,859.00	44,234.07	
	CENTURIA OFFICE REIT	9,829.00	21,427.22	
	CHARTER HALL GROUP	11,042.00	210,681.36	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	15,672.00	75,695.76	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	17,184.00	71,657.28	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	6,214.00	22,867.52	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	40,078.00	34,066.30	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	4,964.00	16,480.48	
	DEXUS/AU	25,551.00	282,083.04	
	GDI PROPERTY GROUP	14,036.00	15,439.60	
	GOODMAN GROUP	41,054.00	1,005,823.00	
	GPT GROUP	45,710.00	236,320.70	

	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	6,212.00	25,531.32	
	HOME CONSORTIUM	4,697.00	35,932.05	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	10,752.00	15,375.36	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	5,048.00	17,617.52	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,306.00	70,888.62	
	IRONGATE GROUP	9,150.00	14,182.50	
	MIRVAC GROUP	100,922.00	283,590.82	
	NATIONAL STORAGE REIT	25,347.00	61,339.74	
	RURAL FUNDS GROUP	7,386.00	21,714.84	
	SCENTRE GROUP	129,014.00	405,103.96	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	33,260.00	94,458.40	
	STOCKLAND	61,697.00	270,232.86	
	VICINITY CENTRES	89,283.00	156,245.25	
	WAYPOINT REIT LTD	16,665.00	44,328.90	
	オーストラリア・ドル 小計	807,786.00	3,752,707.13 (309,560,811)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1,400.00	61,600.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,100.00	24,675.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	800.00	10,632.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	600.00	33,438.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,200.00	128,568.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	3,948.00	59,259.48	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,800.00	20,898.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	700.00	12,740.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,100.00	19,481.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2,200.00	36,960.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000.00	23,690.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	2,100.00	9,387.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2,800.00	51,996.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	700.00	70,070.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	3,600.00	59,148.00	

	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,800.00	26,852.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,600.00	27,600.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	900.00	20,781.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	200.00	4,518.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	200.00	3,770.00	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	800.00	10,104.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,200.00	30,008.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,200.00	95,928.00	
	SLATE GROCERY REIT	900.00	12,168.00	
	SLATE OFFICE REIT	2,200.00	10,934.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,800.00	57,276.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,800.00	41,220.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	900.00	6,606.00	
	カナダ・ドル 小計	47,548.00	970,307.48 (87,502,329)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	7,200.00	10,152.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	34,200.00	30,609.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	93,700.00	284,848.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	35,242.00	36,651.68	
	CAPITALAND CHINA TRUST	23,800.00	28,560.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	128,728.00	281,914.32	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	15,600.00	19,344.00	
	ESR REIT	66,900.00	32,112.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	26,300.00	16,437.50	
	FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	29,400.00	8,085.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	25,200.00	59,724.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	81,211.00	120,192.28	
	IREIT GLOBAL	12,600.00	8,127.00	
	KEPPEL DC REIT	31,900.00	74,646.00	
	KEPPEL REIT	47,300.00	54,395.00	

	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	20,400.00	18,258.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	49,600.00	106,144.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	44,400.00	118,548.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	67,100.00	131,516.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	44,400.00	45,288.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	52,000.00	22,880.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	10,200.00	50,796.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	3,400.00	3,009.00	
	SPH REIT	16,900.00	17,069.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	42,000.00	26,880.00	
	SUNTEC REIT	51,500.00	79,825.00	
	シンガポール・ドル 小計	1,061,181.00	1,686,010.78 (141,169,683)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	14,738.00	21,812.24	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	27,123.00	67,400.65	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	33,732.00	38,454.48	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	27,156.00	42,363.36	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	7,889.00	23,114.77	
	ニュージーランド・ドル 小計	110,638.00	193,145.50 (15,395,628)	
ユーロ	AEDIFICA	791.00	91,123.20	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,098.00	79,378.26	
	ALTAREA	65.00	11,193.00	
	ALTAREA-RTS	65.00	272.35	
	BEFIMMO S.C.A.	440.00	14,740.00	
	CARE PROPERTY INVEST	483.00	12,461.40	
	CARMILA	972.00	13,024.80	
	COFINIMMO	674.00	93,146.80	
	COVIVIO	1,173.00	85,183.26	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	801.00	14,948.26	
	GECINA SA	1,409.00	169,080.00	
	HAMBORNER REIT AG	3,916.00	38,224.07	
	HIBERNIA REIT PLC-W/I	12,137.00	15,292.62	
	ICADE	711.00	45,681.75	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	4,183.09	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	6,207.00	50,090.49	

	INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	314.00	8,572.20	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	6,593.00	10,416.94	
	KLEPIERRE	5,255.00	104,390.57	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1,218.00	6,333.60	
	MERCIALYS	1,089.00	9,621.31	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	7,475.00	73,673.60	
	MONTEA NV	231.00	28,967.40	
	NSI NV	299.00	10,360.35	
	RETAIL ESTATES	211.00	14,643.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,921.00	182,065.93	
	VASTNED RETAIL NV	513.00	12,132.45	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,406.00	141,008.40	
	WERELDHAVE NV	648.00	8,346.24	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	465.00	23,343.00	
	ユーロ 小計	65,706.00	1,371,898.74 (176,522,211)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	38,000.00	155,800.00	
	FORTUNE REIT	27,000.00	226,530.00	
	LINK REIT	49,900.00	3,565,355.00	
	PROSPERITY REIT	35,000.00	106,750.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	15,000.00	67,500.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,000.00	56,610.00	
	香港・ドル 小計	181,900.00	4,178,545.00 (61,215,684)	
投資証券 合計		3,514,214	4,470,693,981 (4,470,693,981)	
合計			4,470,693,981 (4,470,693,981)	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

- 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
- 合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資証券 157銘柄	75.64	76.47
イギリス・ポンド	投資証券 35銘柄	5.70	5.76
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	0.06	0.06
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	6.85	6.92
カナダ・ドル	投資証券 28銘柄	1.94	1.96
シンガポール・ドル	投資証券 26銘柄	3.12	3.16

ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	0.34	0.34
ユーロ	投資証券	30銘柄	3.91	3.95
香港・ドル	投資証券	6銘柄	1.35	1.37

(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。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	48,218,318
金銭信託	588,439
コール・ローン	88,954,238
株式	3,848,326,991
社債券	14,645
投資信託受益証券	251,293,805
投資証券	1,824,303
派生商品評価勘定	2,959,183
未収入金	26,233
未収配当金	2,078,131
未収利息	351
差入委託証拠金	244,494,952
流動資産合計	4,488,779,589
資産合計	4,488,779,589
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,277,227
未払解約金	19,800,994
その他未払費用	269
流動負債合計	21,078,490
負債合計	21,078,490
純資産の部	
元本等	
元本	3,649,078,821
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	818,622,278
元本等合計	4,467,701,099
純資産合計	4,467,701,099
負債純資産合計	4,488,779,589

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,262,953,958円
同期中追加設定元本額	2,422,897,522円
同期中一部解約元本額	1,036,772,659円
元本の内訳	
ファンド名	
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	2,452,405,336円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	13,411,635円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	17,648,965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）	6,580,974円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	45,330,698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）	262,414,439円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	803,471円
DCニッセイ新興国株式インデックス	850,483,303円
計	3,649,078,821円
2. 受益権の総数	3,649,078,821口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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つた場合、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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	130,061,315	
社債券	725	
投資信託受益証券	48,464,567	
投資証券	70,663	
合計	178,597,270	

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年11月22日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	65,084,243	-	65,021,040	63,203
	65,084,243	-	65,021,040	63,203
合計	65,084,243	-	65,021,040	63,203

(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11月22日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	358,240,340	-	359,985,500	1,745,160
合計	358,240,340	-	359,985,500	1,745,160

（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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

2021年11月22日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2243円 (12,243円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年11月22日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	360 DIGITECH INC	500	26.010	13,005.00	
	51JOB INC-ADR	100	50.330	5,033.00	
	AUTOHOME INC-ADR	234	35.780	8,372.52	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,391	151.770	211,112.07	
	BAOZUN INC-SPN ADR	100	16.840	1,684.00	
	BEIGENE LTD-ADR	239	364.540	87,125.06	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	717	67.120	48,125.04	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	6.800	3,624.40	
	CREDICORP LTD	337	120.350	40,557.95	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	200	66.330	13,266.00	
	DIDI GLOBAL INC	1,800	8.300	14,940.00	
	GAOTU TECHEDU INC- ADR	300	3.040	912.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	598	55.020	32,901.96	

GLOBANT SA	239	306.410	73,231.99	
HELLO GROUP INC-SPON ADR	466	13.100	6,104.60	
HUAZHU GROUP LIMITED ADR	717	48.210	34,566.57	
HUTCHMED CHINA LIMITED ADR	200	30.720	6,144.00	
HUYA INC-ADR	200	8.580	1,716.00	
I-MAB-SPONSORED ADR	200	68.570	13,714.00	
IQIYI INC-ADR	900	6.900	6,210.00	
JD.COM INC-ADR	4,125	91.550	377,643.75	
JOYY INC	134	56.520	7,573.68	
KE HOLDINGS INC	1,674	23.810	39,857.94	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS- ADR	200	21.080	4,216.00	
LI AUTO INC - ADR	2,750	30.600	84,150.00	
LUFAX HOLDING LTD	600	6.990	4,194.00	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	2,064	90.740	187,287.36	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,444	16.325	23,573.30	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS W/I	380	17.990	6,836.20	
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	1,682	8.500	14,297.00	
NETEASE.COM INC -ADR	2,021	115.550	233,526.55	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	5,330	2.190	11,672.70	
NIO INC - ADR	6,457	38.660	249,627.62	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	100	45.220	4,522.00	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	220.700	103,287.60	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	1,106	30.180	33,379.08	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	45.720	13,716.00	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	556	23.280	12,943.68	
PINDUODUO INC-ADR	2,152	81.870	176,184.24	
PJSC GAZPROM ADR	27,971	9.104	254,647.98	
PJSC MMC NORILSK NICKEL- ADR	2,732	29.930	81,768.76	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	460	107.700	49,542.00	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	3,200	4.500	14,400.00	
ROSNEFT OJSC-GDR	5,479	8.026	43,974.45	
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	12,460	17.695	220,479.70	
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1,314	22.740	29,880.36	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	2,280	0.906	2,065.68	
SOUTHERN COPPER CORP	234	59.680	13,965.12	
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	3,070	5.650	17,345.50	

	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,324	5.160	6,831.84	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	1,495	40.820	61,025.90	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	96.500	54,812.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,468	7.620	26,426.16	
	TRIP.COM GROUP LTD	2,304	29.030	66,885.12	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1,415	10.040	14,206.60	
	VNET GROUP INC-ADR	300	12.970	3,891.00	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	1.348	8,923.76	
	WEIBO CORP-SPON ADR	134	41.970	5,623.98	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	30.510	12,875.22	
	XPENG INC - ADR	1,913	46.890	89,700.57	
	YANDEX NV-A	1,315	81.050	106,580.75	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,022	53.490	108,156.78	
	ZAI LAB LTD-ADR	359	84.150	30,209.85	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC- ADR	2,152	32.610	70,176.72	
アメリカ・ドル	小計	128,525		3,605,230.66 (411,356,818)	
イギリス・ポ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	1,915	14.730	28,207.95	
イギリス・ポ ンド	小計	1,915		28,207.95 (4,325,971)	
インド・ル ピー	ACC LTD	285	2,440.500	695,542.50	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,515	1,688.750	2,558,456.25	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	1,211	1,345.750	1,629,703.25	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	1,512	726.050	1,097,787.60	
	ADANI TOTAL GAS LTD	1,367	1,657.100	2,265,255.70	
	ADANI TRANSMISSION LTD	1,340	1,913.300	2,563,822.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,593	400.850	1,039,404.05	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	304	5,588.600	1,698,934.40	
	ASIAN PAINTS LTD	1,875	3,226.850	6,050,343.75	
	AUROBINDO PHARMA LTD	802	639.550	512,919.10	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	839	5,080.900	4,262,875.10	
	AXIS BANK LTD	11,219	706.350	7,924,540.65	
	BAJAJ AUTO LTD	269	3,547.550	954,290.95	
	BAJAJ FINANCE LTD	1,236	7,484.950	9,251,398.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	142	17,921.250	2,544,817.50	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	331	2,311.150	764,990.65	
	BANDHAN BANK LTD	1,335	305.450	407,775.75	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	919	788.150	724,309.85	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	7,078	208.850	1,478,240.30	

BHARAT FORGE LTD	429	778.750	334,083.75	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,051	405.300	2,047,170.30	
BHARTI AIRTEL LTD	12,090	714.350	8,636,491.50	
BIOCON LTD	1,590	366.950	583,450.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	327	3,571.600	1,167,913.20	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	2,189	617.300	1,351,269.70	
CIPLA LIMITED	2,591	892.300	2,311,949.30	
COAL INDIA LTD	12,030	153.400	1,845,402.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	277	1,476.900	409,101.30	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	611	653.350	399,196.85	
DABUR INDIA LTD	3,788	608.750	2,305,945.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	495	4,785.600	2,368,872.00	
DLF LTD	2,165	415.900	900,423.50	
DR. REDDY'S LABORATORIES	621	4,671.450	2,900,970.45	
EICHER MOTORS LTD	350	2,603.300	911,155.00	
GAIL INDIA LTD	4,264	140.950	601,010.80	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	1,109	919.550	1,019,780.95	
GRASIM INDUSTRIES LTD	864	1,774.500	1,533,168.00	
HAVELLS INDIA LTD	799	1,372.950	1,096,987.05	
HCL TECHNOLOGIES LTD	5,255	1,120.200	5,886,651.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	153	2,601.400	398,014.20	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,893	704.500	2,742,618.50	
HERO MOTOCORP LTD	409	2,684.850	1,098,103.65	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	8,856	440.300	3,899,296.80	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	323.700	624,741.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	4,008	2,399.400	9,616,795.20	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	8,182	2,925.400	23,935,622.80	
ICICI BANK LTD	24,484	762.900	18,678,843.60	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	863	1,512.350	1,305,158.05	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	1,143	640.150	731,691.45	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	5,990	129.350	774,806.50	
INDRAPRASTHA GAS LTD	1,088	490.100	533,228.80	
INDUS TOWERS LTD	4,167	284.450	1,185,303.15	
INFO EDGE INDIA LTD	218	6,485.900	1,413,926.20	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	15,968	1,779.400	28,413,459.20	
INTERGLOBE AVIATION LTD	203	2,251.150	456,983.45	
IPCA LABORATORIES LTD	249	2,077.150	517,210.35	
ITC LTD	12,532	237.500	2,976,350.00	

JSW STEEL LTD	3,060	650.550	1,990,683.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	195	3,815.800	744,081.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	2,756	2,024.450	5,579,384.20	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	177	7,147.650	1,265,134.05	
LARSEN & TOUBRO LTD	3,595	1,897.000	6,819,715.00	
LUPIN LTD	907	898.700	815,120.90	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	4,409	923.700	4,072,593.30	
MARICO LTD	1,422	541.800	770,439.60	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	661	8,117.150	5,365,436.15	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	6,035	237.650	1,434,217.75	
MRF LTD	7	77,464.750	542,253.25	
MUTHOOT FINANCE LTD	448	1,603.000	718,144.00	
NESTLE INDIA LTD	178	19,405.500	3,454,179.00	
NTPC LTD	24,490	135.300	3,313,497.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	7,934	154.300	1,224,216.20	
PAGE INDUSTRIES LTD	14	40,595.000	568,330.00	
PETRONET LNG LTD	1,873	225.350	422,080.55	
PI INDUSTRIES LTD	332	2,870.750	953,089.00	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,240	2,439.600	3,025,104.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	268	2,551.850	683,895.80	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	16,661	192.500	3,207,242.50	
REC LTD	1,368	136.250	186,390.00	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	13,471	2,473.300	33,317,824.30	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	1,031	1,028.950	1,060,847.45	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,308	1,182.050	2,728,171.40	
SHREE CEMENT LTD	75	27,167.300	2,037,547.50	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	1,214	1,601.400	1,944,099.60	
STATE BANK OF INDIA	9,186	503.800	4,627,906.80	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	3,299	790.650	2,608,354.35	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	4,355	3,475.700	15,136,673.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	2,418	832.050	2,011,896.90	
TATA MOTORS LTD	9,165	509.700	4,671,400.50	
TATA STEEL LTD	3,673	1,186.600	4,358,381.80	
TECH MAHINDRA LTD	3,212	1,567.750	5,035,613.00	
TITAN CO LTD	1,900	2,478.200	4,708,580.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	257	2,791.300	717,364.10	
TRENT LTD	668	1,137.650	759,950.20	
ULTRATECH CEMENT LTD	401	7,767.700	3,114,847.70	

	UNITED SPIRITS LTD	1,082	920.050	995,494.10	
	UPL LTD	1,612	741.450	1,195,217.40	
	VEDANTA LTD	6,884	309.550	2,130,942.20	
	WIPRO LTD	6,705	651.450	4,367,972.25	
インド・ルピー	小計	338,349		331,022,863.90 (509,775,210)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY TBK PT	27,100	1,645.000	44,579,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	122,000	6,225.000	759,450,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	268,400	7,425.000	1,992,870,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	108,100	7,250.000	783,725,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	23,200	7,025.000	162,980,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	283,400	4,280.000	1,212,952,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	88,500	1,020.000	90,270,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	22,600	5,950.000	134,470,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	1,100	33,275.000	36,602,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	8,675.000	52,050,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	7,500	11,625.000	87,187,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	9,025.000	86,640,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	6,550.000	68,120,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	56,900	1,595.000	90,755,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	62,800	3,710.000	232,988,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	162,600	1,180.000	191,868,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	8,950.000	84,130,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	269,000	3,900.000	1,049,100,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	23,500	4,660.000	109,510,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	5,000	22,675.000	113,375,000.00	
インドネシア・ルピア	小計	1,567,100		7,383,623,000.00 (59,068,984)	
オフショア・人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	12.010	54,045.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	1,000	63.300	63,300.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	33,800	2.950	99,710.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	946	47.260	44,707.96	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	37.470	37,470.00	

AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	9,200	3.880	35,696.00	
BANK OF BEIJING CO LTD - A	8,600	4.440	38,184.00	
BANK OF CHINA LTD-A	4,500	3.060	13,770.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,700	4.650	17,205.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	1,700	38.760	65,892.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	7.250	32,625.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	5,700	6.530	37,221.00	
BBMG CORPORATION-A	14,100	2.710	38,211.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	19,700	4.610	90,817.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	11,000	4.930	54,230.00	
BYD CO LTD -A	700	296.820	207,774.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	284.010	28,401.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	5,700	22.880	130,416.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	4.830	32,844.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	9,700	3.360	32,592.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	10.770	74,313.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,000	29.510	29,510.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	6,900	52.330	361,077.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,700	17.300	46,710.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	11.510	21,869.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	3.920	83,104.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	11,300	5.690	64,297.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	6.510	69,006.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	1,600	47.490	75,984.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	1,500	28.320	42,480.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	8,400	4.180	35,112.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8,800	5.240	46,112.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	17,114	4.950	84,714.30	

CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	2,000	19.340	38,680.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	6.730	31,631.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	10,800	4.750	51,300.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	500	225.300	112,650.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	2,200	19.900	43,780.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	4,500	20.210	90,945.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	400	131.350	52,540.00	
CITIC SECURITIES CO-A	2,800	24.300	68,040.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	700	639.000	447,300.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	15.190	77,013.30	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,600	28.850	75,010.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	4,176	35.220	147,078.72	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	128.320	115,488.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	7.250	42,775.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	936	119.900	112,226.40	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	2,600	11.910	30,966.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	500	158.700	79,350.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	22.500	83,250.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	196	159.300	31,222.80	
GOERTEK INC -A	1,000	52.780	52,780.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	700	59.210	41,447.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	3,300	29.230	96,459.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	500	127.600	63,800.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	11.270	126,224.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	17.290	57,057.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,000	28.190	56,380.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,900	12.280	35,612.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	30.200	24,160.00	

HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	2,800	21.720	60,816.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD- A	2,900	5.210	15,109.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	2,100	15.690	32,949.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD- A	4,100	9.400	38,540.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	5.630	34,906.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	26.090	36,526.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	6,100	3.180	19,398.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	910	58.600	53,326.00	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	56.870	68,244.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	28,000	4.660	130,480.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	4,700	18.500	86,950.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	2.520	81,648.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	5.080	10,668.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	1,200	40.850	49,020.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	1,584	51.990	82,352.16	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	400	175.080	70,032.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,000	18.500	92,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	23.500	47,000.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	400	1,828.410	731,364.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	23.100	55,440.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,400	91.890	128,646.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,689	43.100	72,795.90	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	400	230.530	92,212.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.810	78,105.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD- A	1,190	57.570	68,508.30	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	2,160	40.120	86,659.20	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	395.510	79,102.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	38.740	34,866.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	15.370	27,666.00	
PETROCHINA CO LTD-A	6,900	4.830	33,327.00	

PICC HOLDING CO-A	14,900	4.820	71,818.00	
PING AN BANK CO LTD-A	4,400	18.150	79,860.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	3,700	49.960	184,852.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	15.020	40,554.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	5.220	63,684.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	6.680	66,800.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,000	16.120	48,360.00	
S F HOLDING CO LTD-A	1,000	67.420	67,420.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	2,100	20.680	43,428.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,200	35.710	42,852.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	21.900	65,700.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	8,000	12.230	97,840.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	20.120	9,255.20	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	4.910	30,933.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	700	54.150	37,905.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	21,000	4.720	99,120.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	14.450	73,695.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	6,700	8.650	57,955.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	6.490	36,344.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	280	311.700	87,276.00	
SHENAN CIRCUITS CO LTD-A	140	111.920	15,668.80	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	5.180	56,980.00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	100	114.320	11,432.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	66.100	99,150.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	112.720	33,816.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	378.100	189,050.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	1,900	10.700	20,330.00	

SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	500	151.520	75,760.00	
SUNING.COM CO LTD-A	4,400	4.070	17,908.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,000	6.360	25,440.00	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	1,500	46.420	69,630.00	
TIANMA MICROELECTRONICS- A	7,200	12.520	90,144.00	
TONGWEI CO LTD-A	1,500	48.930	73,395.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	300	208.700	62,610.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	26.960	26,420.80	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	900	100.240	90,216.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-A	3,400	16.100	54,740.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	17.150	30,870.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.830	75,951.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	100	269.000	26,900.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	114.470	22,894.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	6.510	33,201.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	1,200	212.600	255,120.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-A	672	130.300	87,561.60	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	6.030	15,678.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	31.120	52,592.80	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	90.020	45,010.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	259.000	77,700.00	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	300	447.580	134,274.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	500	119.200	59,600.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	840	30.310	25,460.40	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	12.190	24,380.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	7,100	10.430	74,053.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	6.890	64,766.00	
ZTE CORP-A	700	31.990	22,393.00	
オフショア・人民元 小計	669,933		10,420,466.64 (185,927,176)	

コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	764	30,000.000	22,920,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,664	30,100.000	50,086,400.00	
	ECOPETROL SA	18,083	2,645.000	47,829,535.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	662	21,440.000	14,193,280.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	21,900.000	32,017,800.00	
コロンビア・ペソ 小計		22,635		167,047,015.00 (4,864,743)	
タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE- FOR RG	3,800	196.000	744,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	25,500	66.500	1,695,750.00	
	ASSET WORLD CORP PCL- FOREIGN	88,100	4.680	412,308.00	
	B GRIMM POWER PCL- FOREIGN	3,100	42.250	130,975.00	
	BANGKOK COMMERCIAL- FOREIGN	9,000	20.700	186,300.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	59,700	24.100	1,438,770.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	23,600	8.850	208,860.00	
	BERLI JUCKER PUB CO- FORGN	6,000	36.250	217,500.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	20,200	9.550	192,910.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL- FOREIGN	1,300	152.500	198,250.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO- FOREI	7,200	57.000	410,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP- FOREIGN	6,700	35.750	239,525.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD- FORGN	26,800	25.000	670,000.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	29,300	65.000	1,904,500.00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO- FOR R	1,000	176.000	176,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL- FOREIGN	4,200	78.250	328,650.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	2,400	76.750	184,200.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM- FOREIGN	7,500	41.250	309,375.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- FOR	18,400	14.800	272,320.00	
	INDORAMA VENTURES- FOREIGN	5,100	40.750	207,825.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	76.000	478,800.00		

	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	11,400	11.800	134,520.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	5,400	58.750	317,250.00	
	LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	122,900	8.750	1,075,375.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	7,100	32.750	232,525.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	2,100	60.250	126,525.00	
	OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	34.500	110,400.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	4,800	119.000	571,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	7,200	60.750	437,400.00	
	PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	14,200	26.750	379,850.00	
	PTT PCL/FOREIGN	52,600	37.750	1,985,650.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	2,300	45.000	103,500.00	
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	7,300	64.000	467,200.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	4,200	395.000	1,659,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	2,800	128.000	358,400.00	
	SRISAWADCORP PCL - FOREIGN	2,400	66.250	159,000.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	2,400	52.000	124,800.00	
	THAI UNION GROUP PCL-F	9,800	20.000	196,000.00	
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	36,400	4.320	157,248.00	
	タイ・パーツ 小計	653,700		19,203,861.00 (66,637,398)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	571	723.000	412,833.00	
	KOMERCNI BANKA AS	654	893.500	584,349.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	94.850	106,611.40	
	チェコ・コルナ 小計	2,349		1,103,793.40 (5,589,499)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	178,957	76.000	13,600,732.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	169	28,990.000	4,899,310.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	553,318	37.590	20,799,223.62	
	CENCOSUD SA	4,383	1,170.000	5,128,110.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	7,418.000	2,025,114.00	
	COLBUN SA	13,714	52.000	713,128.00	
	EMPRESAS CMPC SA	3,736	1,400.000	5,230,400.00	
	EMPRESAS COPEC SA	1,242	6,243.000	7,753,806.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	33.360	3,018,612.96	
	ENERSIS SA	99,456	97.500	9,696,960.00	

	FALABELLA SA	2,406	2,770.000	6,664,620.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	784	52,700.000	41,316,800.00	
チリ・ペソ 小計		948,924		120,846,816.58 (16,612,449)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	25,852	7.230	186,909.96	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,100	18.740	39,354.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,552	66.750	170,346.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	21.240	172,787.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	223.000	35,011.00	
	KOC HOLDING AS	2,509	27.640	69,348.76	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	396	155.100	61,419.60	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	3,509	18.020	63,232.18	
	TURKIYE GARANTI BANKASI TURKIYE IS BANKASI-C	7,135 3,028	12.050 7.140	85,976.75 21,619.92	
トルコ・リラ 小計		55,373		906,005.57 (9,271,880)	
ハンガリー・ フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	968	2,436.000	2,358,048.00	
	OTP BANK RT	1,120	17,820.000	19,958,400.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	410	8,410.000	3,448,100.00	
ハンガリー・フォリント 小計		2,498		25,764,548.00 (9,025,218)	
フィリピン・ ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	50.800	320,548.00	
	AYALA CORPORATION	1,795	880.000	1,579,600.00	
	AYALA LAND INC	48,800	37.150	1,812,920.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	4,840	90.800	439,472.00	
	BDO UNIBANK INC	6,370	125.600	800,072.00	
	GLOBE TELECOM INC	65	3,630.000	235,950.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	190	591.500	112,385.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,800	189.000	529,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	9,608	57.000	547,656.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,380	249.000	343,620.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	300.000	411,000.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	28,100	4.000	112,400.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	5,537	50.100	277,403.70	
	PLDT INC	265	1,700.000	450,500.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,585	975.000	1,545,375.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	60,300	35.950	2,167,785.00		
UNIVERSAL ROBINA CORP	2,810	132.500	372,325.00		

フィリピン・ペソ 小計		182,125		12,058,211.70 (27,287,733)	
ブラジル・レアル	ALPARGATAS SA - PREF	1,100	43.050	47,355.00	
	AMBEV SA	23,000	17.390	399,970.00	
	AMERICANAS SA	2,314	33.570	77,680.98	
	ATACADAO SA	1,900	16.150	30,685.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	10,276	17.590	180,754.84	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	21,890	20.530	449,401.70	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	4,800	20.910	100,368.00	
	BANCO DO BRASIL SA	5,700	29.050	165,585.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	1,200	40.810	48,972.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	1,300	34.090	44,317.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	2,200	22.230	48,906.00	
	BM&FBOVESPA SA	26,900	12.470	335,443.00	
	BRADESPAR SA -PREF	564	45.980	25,932.72	
	BRF SA	1,600	22.670	36,272.00	
	CCR SA	3,800	12.030	45,714.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	700	32.530	22,771.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	700	33.040	23,128.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3,366	13.610	45,811.26	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,000	6.210	18,630.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	1,000	34.970	34,970.00	
	COSAN SA	5,600	21.060	117,936.00	
	CPFL ENERGIA SA	600	25.750	15,450.00	
	ENERGISA SA-UNITS	600	42.910	25,746.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	39.750	26,831.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	5,300	23.460	124,338.00	
	GERDAU SA-PREF	6,200	24.790	153,698.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	3,500	13.190	46,165.00	
	HYPERA S.A	1,100	28.930	31,823.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	23,950	22.280	533,606.00	
	ITAUSA SA	24,430	9.950	243,078.50	
	JBS SA	4,200	37.290	156,618.00	
KLABIN SA - UNIT	1,900	23.460	44,574.00		
LOCALIZA RENT A CAR	1,995	53.820	107,370.90		
LOJAS RENNEN S.A.	5,962	32.320	192,691.84		
MAGAZINE LUIZA SA	15,200	9.270	140,904.00		
NATURA &CO HOLDING SA	4,200	30.410	127,722.00		

	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	2,900	72.650	210,685.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	18,400	27.190	500,296.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	19,800	26.100	516,780.00	
	RAIA DROGASIL SA	4,000	23.350	93,400.00	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	1,400	55.700	77,980.00	
	RUMO SA	3,400	17.020	57,868.00	
	SUZANO S.A.	3,722	53.580	199,424.76	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	3,600	53.000	190,800.00	
	TIM SA	3,500	13.480	47,180.00	
	TOTVS SA	2,500	35.320	88,300.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	2,200	13.590	29,898.00	
	VALE SA	18,867	64.030	1,208,054.01	
	VIA SA	3,800	5.720	21,736.00	
	VIBRA ENERGIA SA	6,900	22.170	152,973.00	
	WEG SA	8,520	35.790	304,930.80	
	ブラジル・リアル 小計	326,231		7,971,525.56 (162,061,115)	
ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	1,606	45.400	72,912.40	
	BANK PEKAO SA	648	119.250	77,274.00	
	CD PROJEKT SA	218	189.000	41,202.00	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	35.200	35,974.40	
	DINO POLSKA SA	292	336.400	98,228.80	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	426	142.850	60,854.10	
	LPP SA	4	13,050.000	52,200.00	
	ORANGE POLSKA SA	1,329	8.265	10,984.18	
	PGE SA	1,780	9.300	16,554.00	
	PKO BANK POLSKI SA	5,021	43.750	219,668.75	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1,853	77.220	143,088.66	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	5,402	6.098	32,941.39	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	1,940	35.880	69,607.20	
SANTANDER BANK POLSKA S.A.	157	343.800	53,976.60		
	ポーランド・ズロチ 小計	21,698		985,466.48 (27,037,357)	
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	3.230	31,331.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	8,700	3.980	34,626.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	40,300	5.100	205,530.00	
	DIALOG GROUP BHD	14,900	2.830	42,167.00	
	DIGI.COM BHD	9,600	4.290	41,184.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	300	25.820	7,746.00	

GENTING BHD	6,700	5.010	33,567.00	
GENTING MALAYSIA BHD	11,300	3.060	34,578.00	
HAP SENG CONSOLIDATED	1,100	7.710	8,481.00	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,700	5.140	24,158.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	2,200	18.320	40,304.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	17.000	32,300.00	
IHH HEALTHCARE BHD	6,300	6.540	41,202.00	
IOI CORPORATION BHD	5,400	3.820	20,628.00	
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	3,800	1.960	7,448.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,100	20.600	22,660.00	
MALAYAN BANKING BHD	23,300	8.080	188,264.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	6.370	31,213.00	
MAXIS BHD	19,600	4.570	89,572.00	
MISC BHD	5,000	6.910	34,550.00	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	133.800	26,760.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	7,800	8.310	64,818.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	700	19.800	13,860.00	
PETRONAS GAS BHD	2,200	16.400	36,080.00	
PPB GROUP BERHAD	1,880	17.120	32,185.60	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	14,000	5.600	78,400.00	
PUBLIC BANK BHD	64,400	4.070	262,108.00	
QL RESOURCES BHD	3,000	4.900	14,700.00	
RHB BANK BHD	4,900	5.340	26,166.00	
SIME DARBY BERHAD	4,800	2.210	10,608.00	
SIME DARBY PLANTATION BHD	7,700	3.960	30,492.00	
SUPERMAX CORP BHD	4,702	1.730	8,134.46	
TELEKOM MALAYSIA BHD	2,200	5.600	12,320.00	
TENAGA NASIONAL BHD	12,900	9.550	123,195.00	
TOP GLOVE CORP BHD	14,400	2.310	33,264.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,800	4.230	7,614.00	
マレーシア・リンギット 小計	328,382		1,752,214.06 (47,736,619)	
メキシコ・ペソ				
AMERICA MOVIL SAB DE CV	156,300	18.230	2,849,349.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	129.060	232,308.00	
BECELE SAB DE CV	5,600	48.740	272,944.00	
CEMEX SAB-CPO	78,200	12.920	1,010,344.00	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	1,600	106.480	170,368.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	9,800	155.300	1,521,940.00	
GRUMA S.A.B.-B	515	249.860	128,677.90	

	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	645	411.380	265,340.10	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	1,200	262.700	315,240.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	5,300	58.160	308,248.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	67.360	60,624.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	12,800	137.530	1,760,384.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	7,500	20.950	157,125.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	16,900	88.080	1,488,552.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	14,000	41.670	583,380.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	360	251.920	90,691.20	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	4,900	31.330	153,517.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	800	57.350	45,880.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	3,300	51.360	169,488.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	430	150.730	64,813.90	
	WALMART DE MEXICO-SER V	25,100	72.460	1,818,746.00	
メキシコ・ペソ	小計	347,950		13,467,960.10 (73,715,533)	
ユーロ	FF GROUP	129	4.800	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,568	15.195	23,825.76	
	JUMBO SA	994	13.260	13,180.44	
	OPAP SA	1,819	12.980	23,610.62	
ユーロ	小計	4,510		61,236.02 (7,879,239)	
韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	82	70,000.000	5,740,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	105	178,000.000	18,690,000.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	60	46,850.000	2,811,000.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	151,500.000	2,272,500.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	422	87,900.000	37,093,800.00	
	CELLTRION INC	481	223,000.000	107,263,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	23,350.000	3,082,200.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	26	365,000.000	9,490,000.00	
	CJ CORP	53	88,600.000	4,695,800.00	
	CJ ENM CO LTD	28	180,400.000	5,051,200.00	
	CJ LOGISTICS	16	136,500.000	2,184,000.00	
	COWAY CO LTD	158	76,000.000	12,008,000.00	

DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	114	25,850.000	2,946,900.00	
DAUM COMMUNICATIONS CORP	1,495	127,000.000	189,865,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	161	56,400.000	9,080,400.00	
DOOSAN BOBCAT INC	272	38,800.000	10,553,600.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	95	78,900.000	7,495,500.00	
E-MART CO LTD	63	159,000.000	10,017,000.00	
ECOPRO BM CO LTD	69	546,500.000	37,708,500.00	
FILA HOLDINGS CORP	150	37,150.000	5,572,500.00	
GREEN CROSS CORP	38	230,500.000	8,759,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	188	40,100.000	7,538,800.00	
GS HOLDINGS CORP	407	39,950.000	16,259,650.00	
HANA FINANCIAL GROUP	1,656	42,500.000	70,380,000.00	
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	175	41,100.000	7,192,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	21	264,000.000	5,544,000.00	
HANON SYSTEMS	960	13,400.000	12,864,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	624	35,600.000	22,214,400.00	
HLB INC	340	41,750.000	14,195,000.00	
HMM CO LTD	1,215	25,600.000	31,104,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	99	79,000.000	7,821,000.00	
HYBE CO LTD	54	400,500.000	21,627,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	207	48,100.000	9,956,700.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	59	158,500.000	9,351,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	155	58,100.000	9,005,500.00	
HYUNDAI MOBIS	346	238,000.000	82,348,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	658	209,500.000	137,851,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	239	101,000.000	24,139,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	45	98,400.000	4,428,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	260	40,400.000	10,504,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	787	11,100.000	8,735,700.00	
KANGWON LAND INC	358	25,200.000	9,021,600.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	1,862	56,700.000	105,575,400.00	
KIA CORPORATION	1,214	83,800.000	101,733,200.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	320	30,650.000	9,808,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	790	22,300.000	17,617,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	139	84,800.000	11,787,200.00	
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	222	96,800.000	21,489,600.00	
KOREA ZINC CO LTD	26	490,500.000	12,753,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	675	29,650.000	20,013,750.00	

KT&G CORP	658	84,000.000	55,272,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	162,500.000	16,412,500.00	
LG CHEM LTD	232	758,000.000	175,856,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	15	369,500.000	5,542,500.00	
LG CORP	279	86,300.000	24,077,700.00	
LG DISPLAY CO LTD	707	22,600.000	15,978,200.00	
LG ELECTRONICS INC	515	133,500.000	68,752,500.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	48	1,172,000.000	56,256,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	4	642,000.000	2,568,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	42	288,000.000	12,096,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	13,000.000	17,420,000.00	
LG UPLUS CORP	815	13,850.000	11,287,750.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	47	209,500.000	9,846,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	22	98,800.000	2,173,600.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,040	5,150.000	5,356,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	9,050.000	11,873,600.00	
NAVER CORP	592	404,000.000	239,168,000.00	
NCSOFT CORPORATION	86	750,000.000	64,500,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	126,500.000	7,337,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	92	105,500.000	9,706,000.00	
PEARL ABYSS CORP	65	135,000.000	8,775,000.00	
POSCO	380	278,000.000	105,640,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	74	147,000.000	10,878,000.00	
S-1 CORPORATION	32	81,300.000	2,601,600.00	
S-OIL CORPORATION	136	88,600.000	12,049,600.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	85	892,000.000	75,820,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	457	112,500.000	51,412,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	336	174,000.000	58,464,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	22,518	71,200.000	1,603,281,600.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	3,832	66,200.000	253,678,400.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	349	22,250.000	7,765,250.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	177	218,000.000	38,586,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1,171	5,700.000	6,674,700.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	225	64,800.000	14,580,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	268	757,000.000	202,876,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	113	154,500.000	17,458,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	452	47,500.000	21,470,000.00	

	SEEGENE INC	110	54,900.000	6,039,000.00	
	SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	89	45,900.000	4,085,100.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	2,061	37,350.000	76,978,350.00	
	SHINSEGAE CO LTD	14	235,000.000	3,290,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	152	100,500.000	15,276,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	36	145,500.000	5,238,000.00	
	SK HYNIX INC	2,647	111,500.000	295,140,500.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	91	167,500.000	15,242,500.00	
	SK INC	134	246,000.000	32,964,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	208	216,500.000	45,032,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	68	309,500.000	21,046,000.00	
	SKC CO LTD	129	188,000.000	24,252,000.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	417	5,530.000	2,306,010.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	3,489	13,100.000	45,705,900.00	
	YUHAN CORP	152	59,800.000	9,089,600.00	
韓国・ウォン 小計		66,608		5,220,414,360.00 (501,681,820)	
香港・ドル	3SBIO INC	4,000	6.800	27,200.00	
	A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	1,500	20.700	31,050.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	34.450	120,575.00	
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	4,000	5.710	22,840.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	99,000	2.680	265,320.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	5.500	55,000.00	
	AKESO INC	2,000	50.850	101,700.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	71,600	139.300	9,973,880.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	16,000	8.980	143,680.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	40,000	0.890	35,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	4.070	97,680.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	6,000	37.700	226,200.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	103.350	72,345.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	6,000	135.500	813,000.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	5.580	22,320.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	380,000	2.790	1,060,200.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	62,000	4.880	302,560.00	

BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	4.980	19,920.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,500	28.000	42,000.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	2.900	46,400.00	
BOC AVIATION LTD	500	63.800	31,900.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	5.960	95,360.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	8,000	7.300	58,400.00	
BYD CO LTD	3,500	299.800	1,049,300.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,000	29.700	89,100.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	400	163.200	65,280.00	
CGN POWER CO LTD-H	34,000	2.100	71,400.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	4,000	2.390	9,560.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	1.270	35,560.00	
CHINA CITIC BANK	29,000	3.460	100,340.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	3.680	29,440.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	8,500	38.300	325,550.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK- H	458,000	5.210	2,386,180.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	7,150	11.460	81,939.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	2,000	7.650	15,300.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	2,000	13.520	27,040.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	2.800	33,600.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	5.340	80,100.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	4,000	8.640	34,560.00	
CHINA FEIHE LTD	17,000	12.020	204,340.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4.410	50,715.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	15,000	18.100	271,500.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	6,500	7.620	49,530.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	21,000	1.020	21,420.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	11,600	19.320	224,112.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	18,000	2.460	44,280.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	5,000	11.220	56,100.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- H	37,000	13.740	508,380.00	

CHINA LITERATURE LTD	1,400	58.000	81,200.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	12,000	15.700	188,400.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	8,000	13.060	104,480.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	2,000	38.550	77,100.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	17,000	46.500	790,500.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	18,500	64.600	1,195,100.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	4,000	12.000	48,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	22,900	3.190	73,051.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,000	4.720	28,320.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	12,000	9.050	108,600.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	4,000	6.570	26,280.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	19,500	18.520	361,140.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	8.080	40,400.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	14,800	24.600	364,080.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	112,000	3.730	417,760.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	44,880	8.300	372,504.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	10,000	3.480	34,800.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	9,000	3.790	34,110.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	8,000	65.000	520,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	18,000	6.060	109,080.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	4,000	39.850	159,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	16,000	35.050	560,800.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	2,200	40.700	89,540.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	4,000	3.600	14,400.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	6,000	18.420	110,520.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	18,500	16.360	302,660.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	4,000	4.720	18,880.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	4,000	8.010	32,040.00	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	11.460	75,636.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	134,000	1.020	136,680.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.750	22,500.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	8,900	19.480	173,372.00	
CHINA YOUZAN LTD	44,000	0.790	34,760.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	12,000	13.300	159,600.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	5,000	2.740	13,700.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	6,000	14.100	84,600.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	24,000	4.630	111,120.00	
CITIC LTD	19,000	7.330	139,270.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	7,000	18.940	132,580.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	6.120	36,720.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	48,000	7.300	350,400.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	7,000	53.700	375,900.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	4,500	4.050	18,225.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	8,000	7.320	58,560.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,700	141.900	525,030.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	6.930	48,510.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	3,000	37.900	113,700.00	
FOSUN INTERNATIONAL	7,500	9.140	68,550.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	44.850	143,520.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	1,000	146.100	146,100.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	30,000	26.000	780,000.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	8,000	37.350	298,800.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	13.500	64,800.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	20,000	0.700	14,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	15,000	33.950	509,250.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	6,000	7.450	44,700.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	16,000	10.340	165,440.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	9,600	8.080	77,568.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	3,200	4.270	13,664.00	

HAIDLIAO INTERNATIONAL HOLDI	5,000	19.720	98,600.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	11,400	30.500	347,700.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1,000	20.600	20,600.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	6.760	67,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	400	133.700	53,480.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	17.520	70,080.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	2,000	38.250	76,500.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	4,400	18.920	83,248.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1,000	47.150	47,150.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	5,000	21.350	106,750.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	3.330	46,620.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	11.420	61,668.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	250,000	4.260	1,065,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	5,500	80.300	441,650.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,150	74.850	86,077.50	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	7.690	15,380.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	2,000	13.420	26,840.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	4,000	12.240	48,960.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	3,000	18.720	56,160.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	7,000	1.010	7,070.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	2,000	37.850	75,700.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	13.240	33,100.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	14,000	26.600	372,400.00	
KINGSOFT CORP LTD	3,000	35.400	106,200.00	
KUAI SHOU TECHNOLOGY	1,200	96.300	115,560.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	10,000	7.030	70,300.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	7.140	28,560.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	3,000	5.630	16,890.00	
LEGEND GROUP LTD	40,000	7.930	317,200.00	
LI NING CO LTD	10,000	94.050	940,500.00	
LOGAN GROUP CO LTD	4,000	8.150	32,600.00	

LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	9,000	40.300	362,700.00	
MEITUAN-B	19,300	280.800	5,419,440.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	2,000	37.700	75,400.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	2,000	25.450	50,900.00	
MINTH GROUP LTD	2,000	36.800	73,600.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	2,200	21.850	48,070.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	9.610	28,830.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	1,600	48.900	78,240.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	2.390	54,970.00	
PETROCHINA CO LTD-H	122,000	3.540	431,880.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	600	159.600	95,760.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	23,000	7.010	161,230.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,600	33.100	52,960.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	30,500	57.350	1,749,175.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	600	54.700	32,820.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	26,000	5.460	141,960.00	
SEAZEN GROUP LTD	8,000	6.150	49,200.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	15.180	87,285.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	12.280	98,240.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	1,000	41.200	41,200.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	14.060	37,962.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,500	9.000	13,500.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	8,000	1.880	15,040.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	3,800	165.000	627,000.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	4,000	10.140	40,560.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	57,000	5.800	330,600.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	4,800	18.280	87,744.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	2,000	11.680	23,360.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	10,000	39.700	397,000.00	
SSY GROUP LTD	4,000	3.770	15,080.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	5,500	3.320	18,260.00	

SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	14,000	15.400	215,600.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	5,000	13.820	69,100.00	
SUNNY OPTICAL TECH	3,600	217.600	783,360.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	27,100	496.000	13,441,600.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	6,000	15.780	94,680.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	4,400	17.880	78,672.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	4,000	9.500	38,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3,000	13.480	40,440.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	67.100	134,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	7.620	22,860.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	1,500	40.750	61,125.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	15,000	6.130	91,950.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	6,000	14.460	86,760.00	
WEIMOB INC	6,000	10.520	63,120.00	
WHARF HOLDINGS LTD	4,000	28.500	114,000.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	1,840	158.300	291,272.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	17,500	110.600	1,935,500.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	68,800	21.150	1,455,120.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,400	17.980	43,152.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	26,000	14.800	384,800.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	4,000	13.660	54,640.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	4,000	11.680	46,720.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	2,000	47.700	95,400.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	3,200	7.240	23,168.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	3,500	7.510	26,285.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	6.990	13,980.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	7,000	4.450	31,150.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,100	27.350	84,785.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	69.200	138,400.00	
ZHUZHOU CRRc TIMES ELECTRIC-H	1,700	47.550	80,835.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	22,000	10.900	239,800.00	
ZTE CORP-H	2,800	22.750	63,700.00	

香港・ドル 小計		3,537,970		66,750,439.50 (977,893,939)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	2,000	292.000	584,000.00	
	ACER INC	13,000	27.650	359,450.00	
	ADVANTECH CO LTD	1,099	382.500	420,367.50	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	838.000	838,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	17,000	106.000	1,802,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	7,000	45.050	315,350.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	4,000	360.500	1,442,000.00	
	AU OPTRONICS CORP	26,000	21.850	568,100.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	161.000	322,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	32,000	61.800	1,977,600.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	5,543	251.000	1,391,293.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,755	17.250	340,773.75	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	34.300	445,900.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	74,000	16.850	1,246,900.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	11,354	30.750	349,135.50	
	CHINA STEEL CORP	60,000	32.600	1,956,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	14,000	113.000	1,582,000.00	
	COMPAL ELECTRONICS	13,000	23.550	306,150.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	87,000	24.250	2,109,750.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	10,000	261.000	2,610,000.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	45,241	27.650	1,250,913.65	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	633.000	633,000.00	
	EVERGREEN MARINE	12,150	117.000	1,421,550.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	10,000	29.400	294,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	4,000	64.100	256,400.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,320	215.500	284,460.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	40,904	23.750	971,470.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	18,000	80.800	1,454,400.00	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	4,000	98.800	395,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	19,000	103.500	1,966,500.00	

FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	2,000	66.700	133,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	35,700	74.800	2,670,360.00	
GIANT MANUFACTURING	1,000	312.500	312,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	810.000	810,000.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,091	286.000	312,026.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	60,200	106.500	6,411,300.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	658.000	658,000.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	24,824	20.950	520,062.80	
INNOLUX CORPORATION	28,000	18.950	530,600.00	
INVENTEC CO LTD	8,000	26.100	208,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	7,000	61.600	431,200.00	
MEDIA TEK INC	7,000	1,090.000	7,630,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	49,000	34.650	1,697,850.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	2,000	166.000	332,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	25,000	85.000	2,125,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	1,000	548.000	548,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	4,000	69.600	278,400.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	380.000	380,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	2,000	483.000	966,000.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	1,000	283.000	283,000.00	
PEGATRON CORP	6,000	68.100	408,600.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	414.500	414,500.00	
POU CHEN	7,000	34.700	242,900.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	2,000	98.600	197,200.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	293.500	587,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	11,000	86.900	955,900.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	547.000	1,094,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	2,520	67.100	169,092.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	31,244	11.250	351,495.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	34,480	15.100	520,648.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	4,000	56.800	227,200.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	30,495	18.950	577,880.25	
TAIWAN CEMENT	24,629	48.300	1,189,580.70	

	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	36,849	23.650	871,478.85	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	29.400	176,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	5,000	100.000	500,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	116,000	618.000	71,688,000.00	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	22,000	46.750	1,028,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	25,000	68.200	1,705,000.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	5,000	195.500	977,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	54,000	65.100	3,515,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	4,000	156.000	624,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	1,000	177.500	177,500.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	3,300	156.000	514,800.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	1,000	351.500	351,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	9,000	29.700	267,300.00	
	WISTRON CORP	9,146	29.200	267,063.20	
	WPG HOLDINGS LTD	5,760	50.500	290,880.00	
	YAGEO CORPORATION	2,000	463.000	926,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	7,000	107.500	752,500.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	45,200	25.050	1,132,260.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	2,000	100.000	200,000.00	
	台湾・ドル 小計	1,347,804		150,035,240.20 (616,014,689)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	4,723	135.250	638,785.75	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	654	204.550	133,775.70	
	ANGLO PLATINUM LTD	176	1,663.310	292,742.56	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	2,147	327.800	703,786.60	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,248	210.950	474,215.60	
	BID CORP LTD	1,933	307.070	593,566.31	
	BIDVEST GROUP LTD	883	182.120	160,811.96	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	435	1,834.070	797,820.45	
	CLICKS GROUP LTD	796	282.600	224,949.60	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	1,109	143.430	159,063.87	
	EXXARO RESOURCES LTD	783	149.920	117,387.36	
	FIRSTRAND LTD	26,541	58.020	1,539,908.82	
	GOLD FIELDS LTD	3,731	171.860	641,209.66	

HARMONY GOLD MINING CO LTD	1,461	66.240	96,776.64	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	4,521	208.000	940,368.00	
KUMBA IRON ORE LTD	214	412.130	88,195.82	
MR PRICE GROUP LTD	673	189.620	127,614.26	
MTN GROUP LTD	8,501	155.880	1,325,135.88	
MULTICHOICE GROUP LTD	1,332	121.290	161,558.28	
NASPERS LTD-N SHS	1,068	2,716.000	2,900,688.00	
NEDBANK GROUP LTD	1,436	160.660	230,707.76	
NEPI ROCKCASTLE PLC	1,207	103.060	124,393.42	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	1,216	223.640	271,946.24	
OLD MUTUAL LTD	15,106	14.300	216,015.80	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	1,888	42.650	80,523.20	
REINET INVESTMENTS SCA	328	267.520	87,746.56	
REMGRO LTD	1,616	132.790	214,588.64	
SANLAM LIMITED	9,720	58.470	568,328.40	
SASOL LTD	2,141	247.010	528,848.41	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	1,476	196.060	289,384.56	
SIBANYE STILLWATER LTD	12,418	52.410	650,827.38	
SPAR GROUP LIMITED/THE	596	176.600	105,253.60	
STANDARD BANK GROUP LTD	6,500	129.330	840,645.00	
TIGER BRANDS LTD	508	195.500	99,314.00	
VODACOM GROUP LTD	4,205	137.250	577,136.25	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	2,935	52.300	153,500.50	
南アフリカ・ランド 小計	127,225		17,157,520.84 (124,563,601)	
合計	10,681,804		3,848,326,991 (3,848,326,991)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	インド・ルピー	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	9,483.00	9,509.94	
	インド・ルピー	小計	9,483.00 (14,604)	9,509.94 (14,645)	
社債券 合計			14,603.82 (14,604)	14,645 (14,645)	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	6,935.00	251,116.35	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	14,403.00	304,623.45	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	30,012.00	1,290,816.12	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	21,408.00	355,843.77	
	アメリカ・ドル	小計	72,758.00	2,202,399.69 (251,293,805)	
投資信託受益証券 合計			72,758	251,293,805 (251,293,805)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8,900.00	177,199.00	
		メキシコ・ペソ	小計	8,900.00	177,199.00 (969,881)
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	9,053.00	117,689.00	
		南アフリカ・ランド	小計	9,053.00	117,689.00 (854,422)
投資証券 合計			17,953	1,824,303 (1,824,303)	
合計				253,132,753 (253,132,753)	

(注) 投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における () 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入債券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 64銘柄	9.21	-	-	-	16.16
	投資信託受益証 券 4銘柄	-	-	5.62	-	
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.10	-	-	-	0.11
インド・ルピー	株式 99銘柄	11.41	-	-	-	12.43
	社債券 1銘柄	-	0.00	-	-	
インドネシア・ルピア	株式 20銘柄	1.32	-	-	-	1.44
オフショア・人民元	株式 146銘柄	4.16	-	-	-	4.53
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.11	-	-	-	0.12
タイ・バーツ	株式 39銘柄	1.49	-	-	-	1.62
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.13	-	-	-	0.14
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.37	-	-	-	0.41
トルコ・リラ	株式 10銘柄	0.21	-	-	-	0.23
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.20	-	-	-	0.22
フィリピン・ペソ	株式 17銘柄	0.61	-	-	-	0.67
ブラジル・レアル	株式 51銘柄	3.63	-	-	-	3.95
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.61	-	-	-	0.66
マレーシア・リンギット	株式 36銘柄	1.07	-	-	-	1.16
メキシコ・ペソ	株式 21銘柄	1.65	-	-	-	1.82
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.02	
ユーロ	株式 4銘柄	0.18	-	-	-	0.19
韓国・ウォン	株式 102銘柄	11.23	-	-	-	12.23
香港・ドル	株式 201銘柄	21.89	-	-	-	23.84
台湾・ドル	株式 82銘柄	13.79	-	-	-	15.02
南アフリカ・ランド	株式 36銘柄	2.79	-	-	-	3.06
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.02	

（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。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年11月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	23,033,549
金銭信託	30,014
コール・ローン	4,537,290
国債証券	1,257,824,568
派生商品評価勘定	4,427
未収利息	13,123,079
前払費用	690,958
流動資産合計	1,299,243,885
資産合計	
1,299,243,885	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,803
未払解約金	217,098
その他未払費用	1
流動負債合計	218,902
負債合計	
218,902	
純資産の部	
元本等	
元本	1,030,988,108
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	268,036,875
元本等合計	1,299,024,983
純資産合計	1,299,024,983
負債純資産合計	1,299,243,885

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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11月22日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,019,988,559円
同期中追加設定元本額	22,446,740円
同期中一部解約元本額	11,447,191円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	985,985,076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）	44,205,838円
ニッセイ新興国債券インデックス（ラップ専用）	797,194円
計	1,030,988,108円
2. 受益権の総数	1,030,988,108口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月21日 至 2021年11月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月22日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		82,208,955
合計		82,208,955

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年11月22日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	4,009,354	-	4,011,978	2,624
	4,009,354	-	4,011,978	2,624
合計	4,009,354	-	4,011,978	2,624

(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。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2600円 (12,600円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月22日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	CROATIA	240,000.00	265,348.80	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	183,858.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	197,866.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	205,532.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	100,000.00	99,986.00	

FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	175,442.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	189,452.00	
HUNGARY	50,000.00	82,405.50	
HUNGARY	60,000.00	63,403.20	
HUNGARY	90,000.00	98,424.90	
HUNGARY	70,000.00	76,782.30	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	191,052.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	194,364.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	184,662.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	160,650.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	184,034.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	224,544.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	216,794.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	246,908.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	245,168.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	226,398.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	232,532.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	224,804.00	
REPUBLIC OF PANAMA	100,000.00	133,205.00	
REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	216,910.00	
REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	219,096.00	
REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	188,432.00	
REPUBLIC OF PERU	160,000.00	219,174.40	
REPUBLIC OF PERU	200,000.00	199,522.00	
REPUBLIC OF PERU	100,000.00	91,250.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	100,000.00	143,800.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	70,000.00	107,986.20	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	275,898.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	214,632.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	212,436.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	189,876.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	222,750.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	201,632.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	190,750.00	
ROMANIA	30,000.00	32,130.00	
ROMANIA	80,000.00	103,800.80	
ROMANIA	50,000.00	58,562.50	
ROMANIA	50,000.00	50,270.00	
ROMANIA	70,000.00	70,018.90	
RUSSIAN FEDERATION	58,500.00	67,295.47	
RUSSIAN FEDERATION	200,000.00	222,152.00	
RUSSIAN FEDERATION	200,000.00	219,878.00	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	506,732.00	
RUSSIAN FEDERATION	200,000.00	223,704.00	
RUSSIAN FEDERATION	200,000.00	237,216.00	
UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	214,430.00	
UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	221,752.00	
UNITED MEXICAN STATES	120,000.00	139,264.80	
UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	213,024.00	

	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	210,512.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	205,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	225,558.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	225,742.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	194,338.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	184,488.00	
	アメリカ・ドル 小計	10,198,500.00 (1,163,648,850)	11,023,878.77 (1,257,824,568)	
国債証券	合計	1,163,648,850 (1,163,648,850)	1,257,824,568 (1,257,824,568)	
合計			1,257,824,568 (1,257,824,568)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
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 60銘柄	96.83	100.00

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年11月30日現在

資産総額	435,811,097円
負債総額	313,972円
純資産総額（ - ）	435,497,125円
発行済数量	328,773,410口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3246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11月30日現在

資産総額	114,181,234,240円
負債総額	604,235,116円
純資産総額（ - ）	113,576,999,124円
発行済数量	52,504,554,686口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1632円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	79,580,998,695円
負債総額	1,975,068,989円
純資産総額（ - ）	77,605,929,706円
発行済数量	78,792,655,935口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9849円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	31,378,813,806円
負債総額	113,317,500円
純資産総額（ - ）	31,265,496,306円
発行済数量	16,539,551,286口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8903円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	512,877,641,964円
負債総額	7,503,629,792円
純資産総額（ - ）	505,374,012,172円
発行済数量	174,617,966,403口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8942円

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	46,898,277,343円
負債総額	391,364,151円
純資産総額(-)	46,506,913,192円
発行済数量	30,695,887,738口
1口当たり純資産額(/)	1.5151円

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	4,507,569,098円
負債総額	7,789,927円
純資産総額(-)	4,499,779,171円
発行済数量	3,166,033,814口
1口当たり純資産額(/)	1.4213円

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	4,348,043,365円
負債総額	32,571,823円
純資産総額(-)	4,315,471,542円
発行済数量	3,671,777,825口
1口当たり純資産額(/)	1.1753円

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	1,290,614,318円
負債総額	13,304,929円
純資産総額(-)	1,277,309,389円
発行済数量	1,031,982,954口
1口当たり純資産額(/)	1.2377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11月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間ににおける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年11月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	422	69,113
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	139	26,178
単位型公社債投資信託	0	0
合計	561	95,292

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．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．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。

また、第27期事業年度に係る中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

負債の部

流動負債

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

固定負債

退職給付引当金		1,950,746		2,155,971
役員退職慰労引当金		22,700		27,450
固定負債合計		1,973,446		2,183,421
負債合計		11,266,679		15,292,435

純資産の部

株主資本

資本金		10,000,000		10,000,000
資本剰余金				
資本準備金		8,281,840		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840		8,281,840
利益剰余金				
利益準備金		139,807		139,807
その他利益剰余金				
配当準備積立金		120,000		120,000
研究開発積立金		70,000		70,000
別途積立金		350,000		350,000
繰越利益剰余金		48,745,315		55,045,550
利益剰余金合計		49,425,122		55,725,357
株主資本合計		67,706,962		74,007,197

評価・換算差額等

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

純資産合計

純資産合計		68,155,196		75,152,647
-------	--	------------	--	------------

負債・純資産合計

負債・純資産合計		79,421,875		90,445,083
----------	--	------------	--	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

(単位：千円)

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

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

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

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

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

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

2. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 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
その他有価証券	22,039,919	22,039,919	-
資産計	77,880,937	77,886,489	5,551
その他未払金	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

その他未払金

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

デリバティブ取引

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

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

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

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

(注1) 投資信託受益証券等であります。

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

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

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度(2020年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

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

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

(2) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用

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

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

1 関連当事者との取引

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

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（1株当たり情報）

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

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第27期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,397,127
有価証券		3,450,000
前払費用		1,036,262
未収委託者報酬		5,905,517
未収運用受託報酬		4,241,456
未収投資助言報酬		223,450
その他		5,312
流動資産合計		46,259,127
固定資産		
有形固定資産	1	242,517
無形固定資産		1,880,946
投資その他の資産		
投資有価証券		32,410,243
関係会社株式		66,222
長期前払費用		56,143
差入保証金		378,030
繰延税金資産		870,069
その他		10,089
投資その他の資産合計		33,790,798
固定資産合計		35,914,262
資産合計		82,173,390

負債の部

流動負債

預り金		54,095
未払収益分配金		7,093
未払手数料		2,159,272
未払運用委託報酬		1,170,066
未払投資助言報酬		811,258
その他未払金		2,313,329
未払費用		190,552
未払法人税等		626,447
未払消費税等	2	366,077
前受投資助言報酬		42,288
賞与引当金		667,470
その他		10,955
流動負債合計		<u>8,418,909</u>

固定負債

退職給付引当金		2,288,326
役員退職慰労引当金		31,950
その他		20,039
固定負債合計		<u>2,340,315</u>

負債合計

	<u>10,759,224</u>
--	-------------------

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		51,534,686
利益剰余金合計		<u>52,214,493</u>

株主資本合計

<u>70,496,333</u>

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		1,028,471
繰延ヘッジ損益		110,639
評価・換算差額等合計		<u>917,831</u>

純資産合計

<u>71,414,165</u>

負債・純資産合計

<u>82,173,390</u>

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第27期中間会計期間	
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	14,604,756
運用受託報酬	8,499,817
投資助言報酬	479,991
営業収益計	23,584,565
営業費用	10,360,657
一般管理費	1 5,226,094
営業利益	7,997,813
営業外収益	2 85,167
営業外費用	3 17,578
経常利益	8,065,402
特別利益	4 462,465
特別損失	5 39,144
税引前中間純利益	8,488,723
法人税、住民税及び事業税	2,286,317
法人税等調整額	272,980
法人税等合計	2,559,297
中間純利益	5,929,426

(3)中間株主資本等変動計算書

第27期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備 金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,440,289	9,440,289	9,440,289
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	5,929,426	5,929,426	5,929,426
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,510,863	3,510,863	3,510,863
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	51,534,686	52,214,493	70,496,333

	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	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,440,289
中間純利益	-	-	-	5,929,426
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	214,183	13,435	227,618	227,618
当中間期変動額合計	214,183	13,435	227,618	3,738,481
当中間期末残高	1,028,471	110,639	917,831	71,414,165

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第27期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30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 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</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、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</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、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</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、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>

5．収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p>投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。</p> <p>投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 当該契約については、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。</p>
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
7．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るおります。</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 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るおります。</p>
8．連結納税制度	<p>日本生命保険相互会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日 企業会計基準委員会 実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。</p>

（会計方針の変更）

1．収益認識に関する会計基準等の適用

「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、当中間会計期間に係る中間財務諸表への影響はありません。また、利益剰余金の当中間会計期間の期首残高への影響もありません。

2．時価の算定に関する会計基準等の適用

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、中間財務諸表に与える影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

（中間貸借対照表関係）

第27期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1．有形固定資産の減価償却累計額	803,871千円
2．消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第27期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1．減価償却の実施額	
有形固定資産	32,767千円
無形固定資産	216,861千円
2．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	75,449千円
為替差益	3,471千円
3．営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	17,202千円
4．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	462,465千円
5．特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	39,113千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第27期中間会計期間
 (自 2021年4月1日
 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月30日 定時株主総会	普通株式	9,440,289	87,049	2021年3月31日	2021年6月30日

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。

なお、市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券			
満期保有目的の債券	3,450,000	3,450,000	-
その他有価証券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	13,068,571	13,071,011	2,439
その他有価証券	19,341,671	19,341,671	-
デリバティブ取引 ()			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	20,039	20,039	-

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

（注1）市場価格のない株式等

関係会社株式（中間貸借対照表計上額66,222千円）は、市場価格のない株式等と認められるため、上表に記載しておりません。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品
第27期中間会計期間末(2021年9月30日現在)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
デリバティブ取引() 為替予約	-	20,039	-	20,039
合計	-	20,039	-	20,039

()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。

なお、投資信託の時価は上記に含めておりません。投資信託の中間貸借対照表計上額は19,341,671千円であります。

(2) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品
第27期中間会計期間末(2021年9月30日現在)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
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	-	16,521,011	-	16,521,011
合計	-	16,521,011	-	16,521,011

(注) 時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明
有価証券及び投資有価証券

地方債は相場価格を用いて評価しております。当社が保有している地方債は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格と認められないため、その時価をレベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

第27期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	10,768,571	10,772,071	3,499
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	10,768,571	10,772,071	3,499
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	5,750,000	5,748,940	1,060
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	5,750,000	5,748,940	1,060
合計		16,518,571	16,521,011	2,439

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	11,941,000	13,348,744	1,407,744
小計		11,941,000	13,348,744	1,407,744
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	6,107,000	5,992,927	114,072
小計		6,107,000	5,992,927	114,072
合計		18,048,000	19,341,671	1,293,671

(注) 投資信託受益証券等であります。

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第27期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

第27期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	1,246,788	-	20,039
合計			1,246,788	-	20,039

（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。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

区分	第27期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	14,604,756千円
投資運用業務	8,499,817千円
投資助言業務	479,991千円
計	23,584,565千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	3,214,017

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

	第27期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
1株当たり純資産額	658,510円67銭
1株当たり中間純利益金額	54,675円29銭

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

2．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	5,929,426千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>5,929,426千円</u>
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第27期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	
エイチ・エス証券株式会社	3,000	
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
楽天証券株式会社	7,495	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	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。
PayPay銀行株式会社	37,250	

(3) 投資助言会社(参考情報)

a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

b. 資本金の額

2021年3月末現在、450百万円

c. 事業の内容

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

(3) 投資助言会社(参考情報)

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

3【資本関係】

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

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

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2021年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2021年12月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2020年11月21日から2021年11月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）の2021年11月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
2. 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。