【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月20日提出
【計算期間】	第5期（自　2021年2月23日　至　2022年2月21日）
【ファンド名】	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

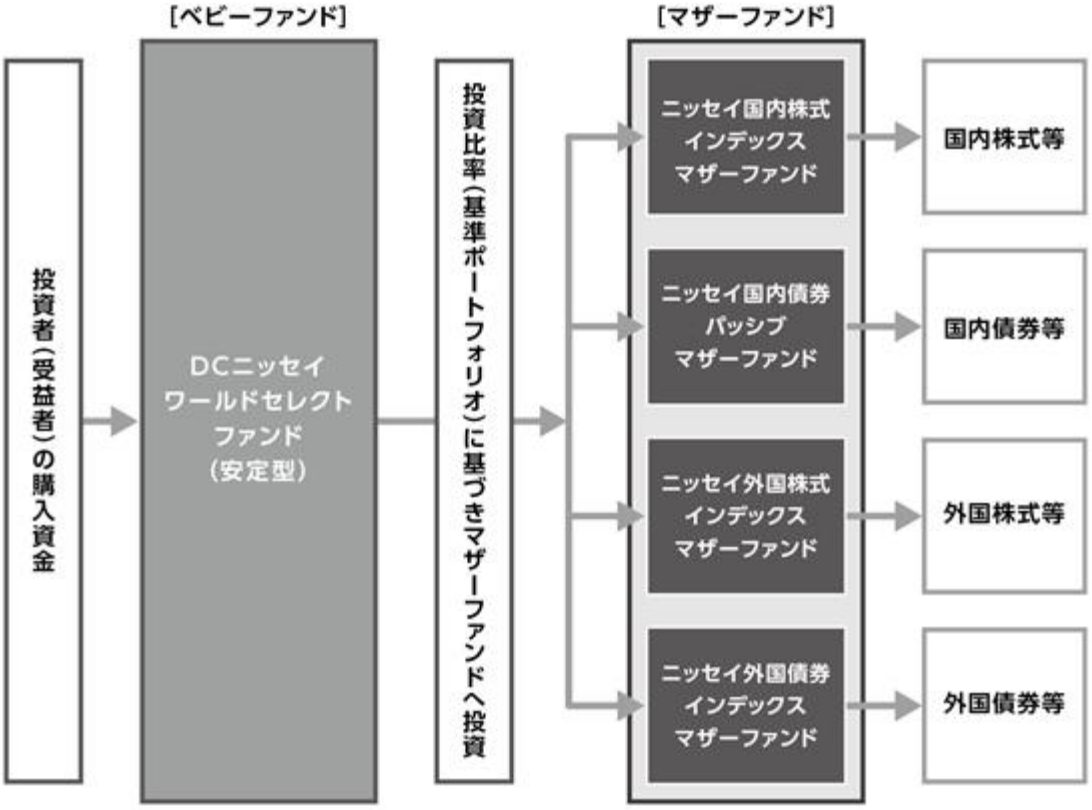
① 基本方針

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

② ファンドの特色

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

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



! 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。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。
TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

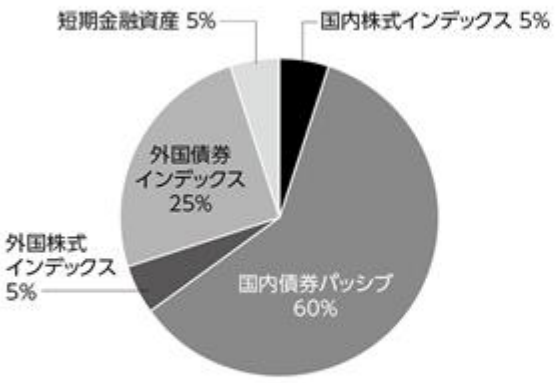
※2 NOMURA-BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

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

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

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

〈投資比率(基準ポートフォリオ)〉



〈各マザーファンドの運用プロセス〉

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

＜ＭＳＣＩ指数にかかる免責条項等＞

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

③　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。

④　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単　位　型 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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

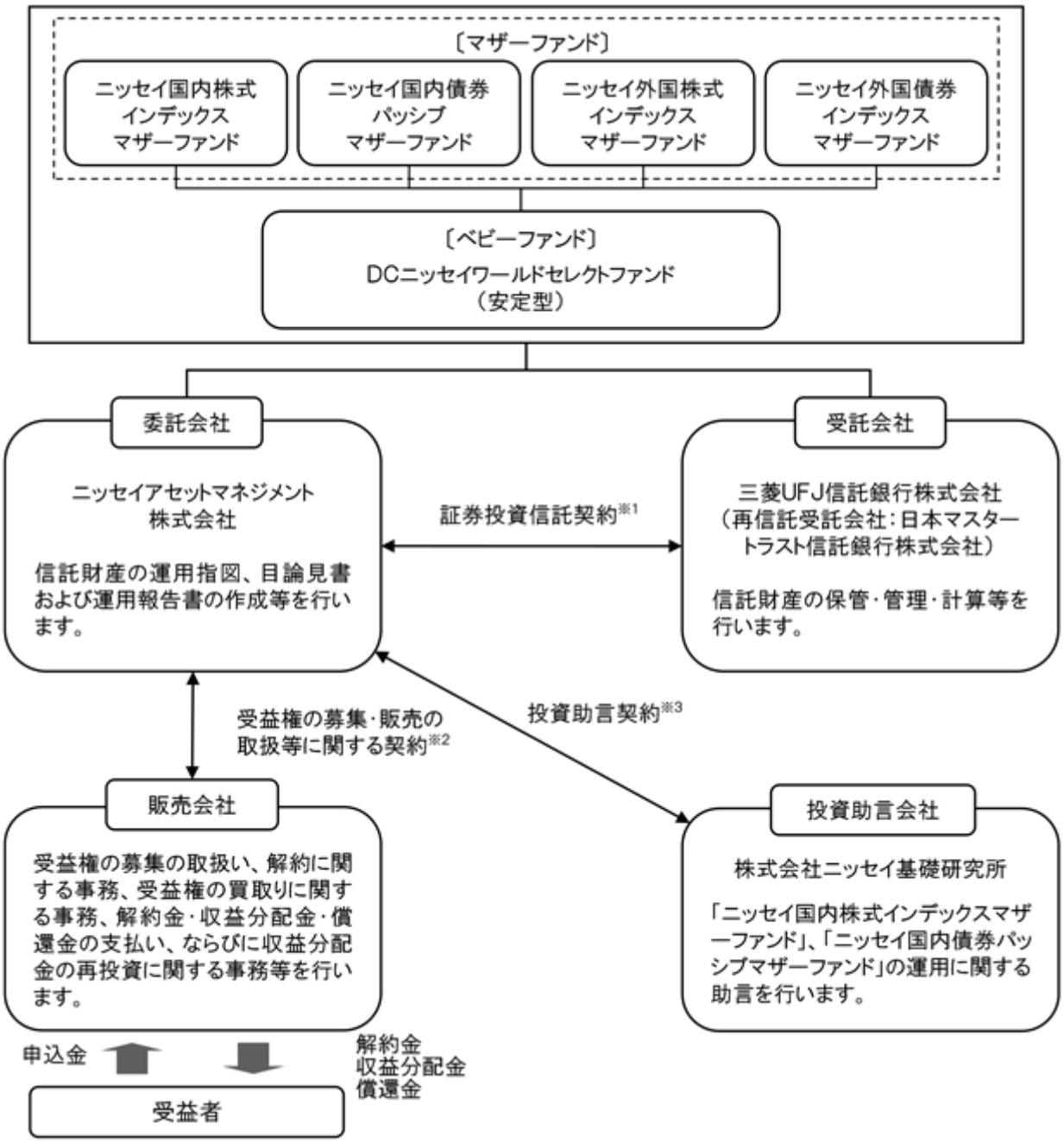
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式・債券） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

（２）【ファンドの沿革】

2017年7月14日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



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

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

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

委託会社の概況（2022年2月末現在）

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

1985年7月1日	ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
1995年4月4日	ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
1998年7月1日	ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
2000年5月8日	定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

・大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①　下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

②　各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

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

③　基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±５％未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にともなう資金フローの影響により、一時的に上記②の配分から乖離する場合があります。

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

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

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

ｂ　投資態度

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

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

③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

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

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

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

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

③　組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

（３）投資制限

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

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b　投資態度

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

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

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

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（３）投資制限

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

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

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

（２）【投資対象】

ａ　主な投資対象

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

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

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

ｂ　約款に定める投資対象

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ）
イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限　ｂ　約款に定めるその他の投資制限　③　先物取引等、④　スワップ取引　および⑤　金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権
２．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

②　有価証券

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

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

14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます）
16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

③　金融商品

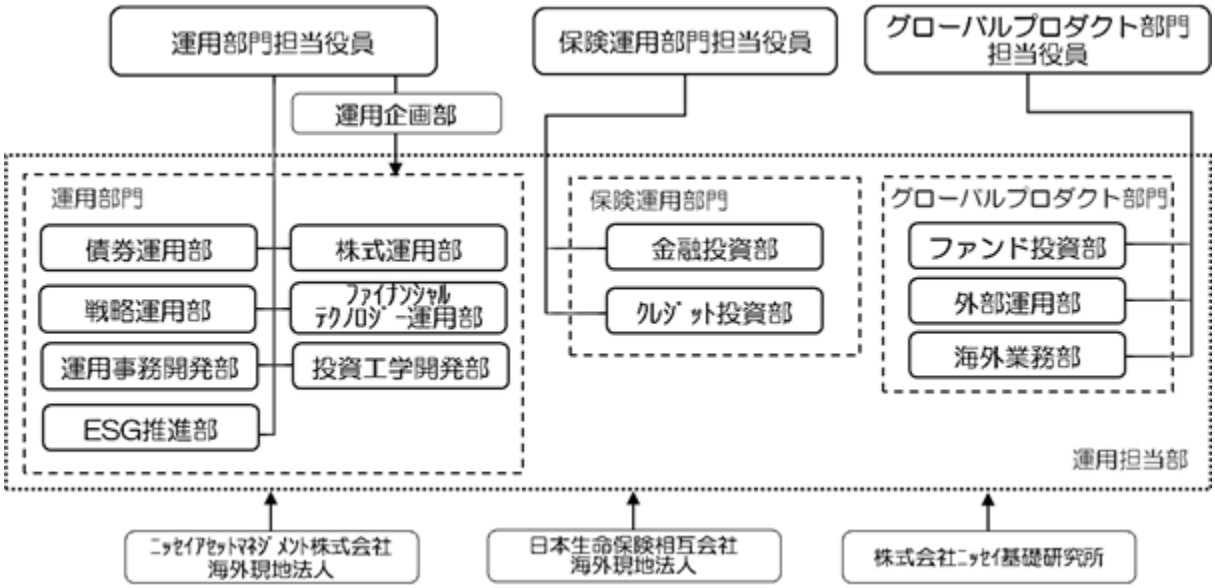
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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

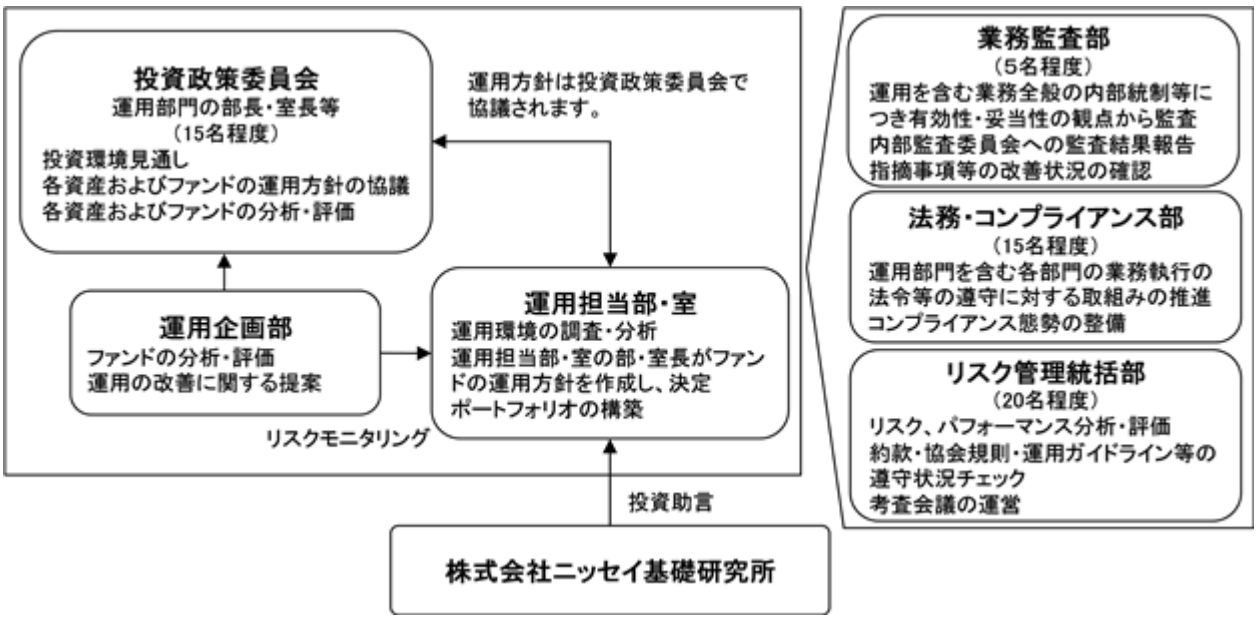
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

１．分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

２．分配対象額についての分配方針
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

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

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

③　支払方法
＜分配金受取コースの場合＞
税金を差引いた後※、原則として決算日から起算して５営業日目までにお支払いします。
＜分配金再投資コースの場合＞
税金を差引いた後※、自動的に無手数料で再投資されます。
※　確定拠出年金法に基づく運用として購入する加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

○　将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とします。
②　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。
③　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。

④　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。
⑤　投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥　同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑦　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑧　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。
⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
⑩　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

b　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

１．投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所※に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
※　金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。
２．前記１．にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、投資することができます。

②　信用取引の範囲

１．信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
２．前記１．の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

③　先物取引等

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

④　スワップ取引

１．異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
２．スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属すると

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

⑦　有価証券の空売り

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

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

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

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

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

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

⑩　資金の借入れ

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

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

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

4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

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

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

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

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

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

3【投資リスク】

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

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

・債券投資リスク
金利変動リスク
金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。
信用リスク
債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

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

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

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

・収益分配金に関する留意点
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

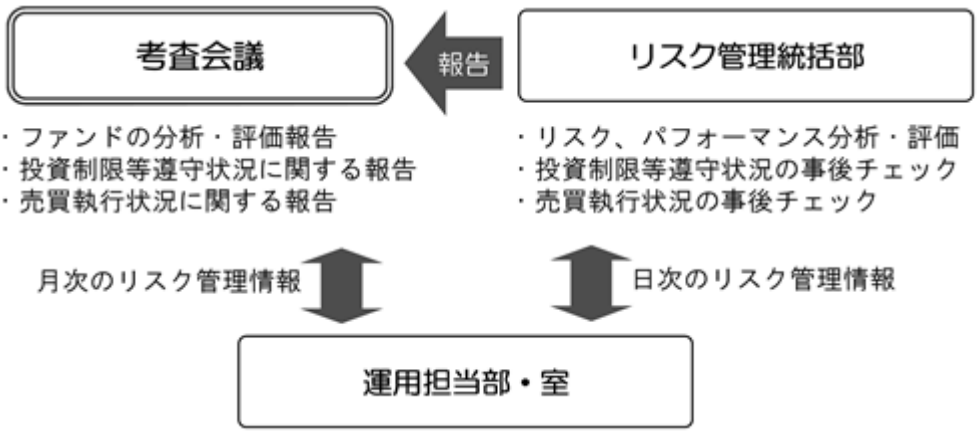
委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2022年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に6.0%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

・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、換金の申込みの受付けを中止する、また既に受付けた換金の申込みの受付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

（2）投資リスク管理体制



1．リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。

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

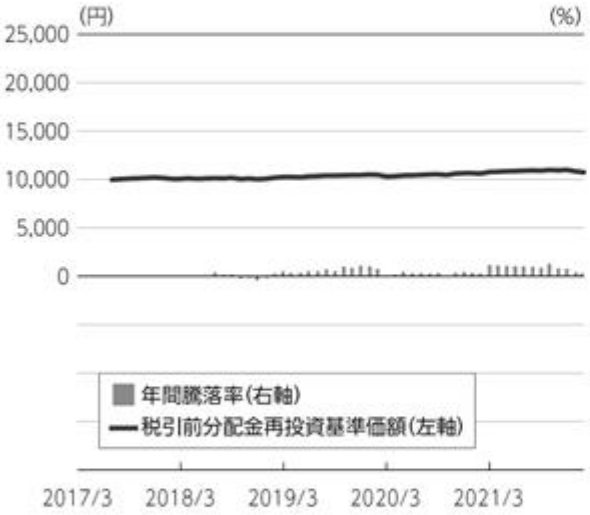
○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

＜流動性リスクに関する管理体制＞

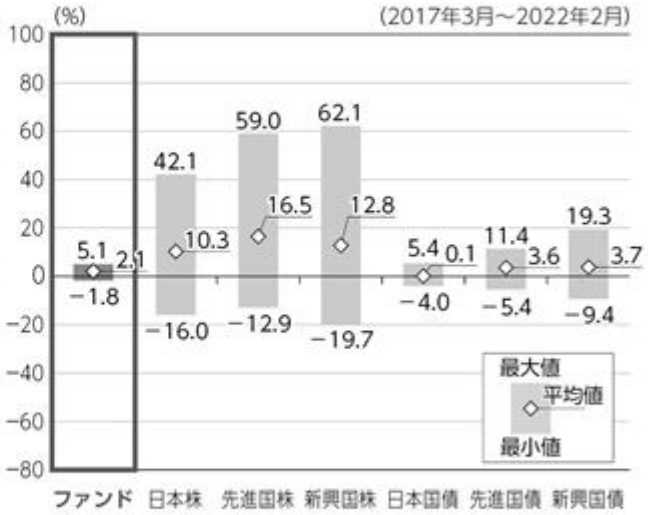
委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。

(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。

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

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

・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.154%（税抜0.14%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

（4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

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

＜ご参考＞

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

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

（５）【課税上の取扱い】

≪確定拠出年金としてファンドを取得した場合≫

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

≪確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合≫

課税対象

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

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

買取請求時：買取請求時の買取価額と取得価額※の差益に対して課税されます。

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

個人の課税の取扱い

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

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

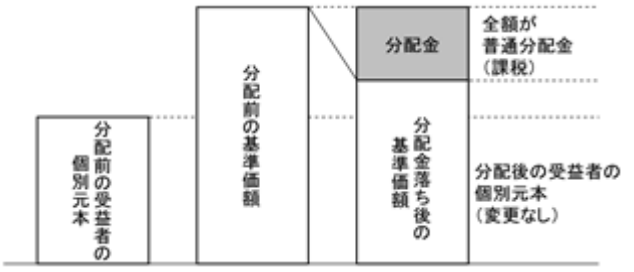
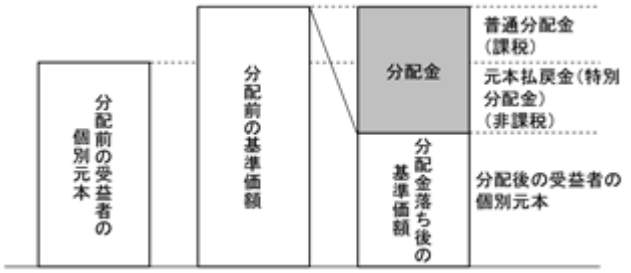
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

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】

2022年2月28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		8,501,523,099	94.92
	内　日本	8,501,523,099	94.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		454,644,393	5.08
純資産総額		8,956,167,492	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

2022年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		111,093,470,350	95.99
	内　日本	111,093,470,350	95.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,637,319,773	4.01
純資産総額		115,730,790,123	100.00

その他資産の投資状況

2022年2月28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）		4,595,130,000	3.97
	内　日本	4,595,130,000	3.97

（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

2022年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		61,625,085,150	78.86
	内　日本	61,625,085,150	78.86
地方債証券		4,691,438,410	6.00
	内　日本	4,691,438,410	6.00
特殊債券		6,065,727,559	7.76
	内　日本	6,065,727,559	7.76
社債券		5,080,549,700	6.50
	内　日本	4,477,892,300	5.73
	内　フランス	400,902,400	0.51
	内　スウェーデン	201,755,000	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		683,456,804	0.87
純資産総額		78,146,257,623	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

2022年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		477,701,543,155	93.75
	内　アメリカ	339,011,879,112	66.53
	内　イギリス	22,408,802,203	4.40
	内　カナダ	18,238,158,249	3.58
	内　スイス	16,696,407,925	3.28
	内　フランス	15,533,867,852	3.05
	内　ドイツ	12,311,993,853	2.42
	内　オーストラリア	9,214,899,969	1.81
	内　オランダ	8,640,928,744	1.70
	内　アイルランド	6,722,969,727	1.32
	内　スウェーデン	5,082,356,293	1.00
	内　デンマーク	3,709,268,358	0.73
	内　香港	3,685,131,738	0.72
	内　スペイン	3,386,209,285	0.66
	内　イタリア	3,071,265,495	0.60
	内　シンガポール	1,507,834,452	0.30
	内　フィンランド	1,411,626,625	0.28
	内　ベルギー	1,339,974,843	0.26
	内　ノルウェー	1,047,705,357	0.21
	内　ジャージィー	1,023,197,762	0.20
	内　イスラエル	866,479,995	0.17
	内　バミューダ	805,167,824	0.16
	内　オランダ領キュラソー	501,155,718	0.10
	内　ケイマン諸島	348,616,607	0.07
	内　オーストリア	319,235,522	0.06
	内　ニュージーランド	298,600,315	0.06
	内　ポルトガル	281,406,309	0.06
	内　ルクセンブルグ	236,403,023	0.05
投資証券		11,065,395,893	2.17
	内　アメリカ	9,417,402,455	1.85
	内　オーストラリア	694,930,768	0.14
	内　イギリス	310,571,388	0.06
	内　フランス	232,480,969	0.05
	内　シンガポール	194,380,608	0.04
	内　香港	155,122,822	0.03
	内　カナダ	60,506,883	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,792,328,432	4.08
純資産総額		509,559,267,480	100.00

その他資産の投資状況

2022年2月28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）		19,407,575,071	3.81
	内　アメリカ	14,500,022,850	2.85
	内　ドイツ	3,479,062,983	0.68
	内　イギリス	1,428,489,238	0.28

（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

2022年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		47,646,090,790	99.02
	内　アメリカ	22,911,054,069	47.62
	内　フランス	4,683,154,918	9.73
	内　イタリア	4,106,792,936	8.54
	内　ドイツ	3,433,537,149	7.14
	内　イギリス	2,733,056,904	5.68
	内　スペイン	2,724,411,242	5.66
	内　ベルギー	1,049,853,737	2.18
	内　カナダ	968,443,770	2.01
	内　オランダ	870,419,841	1.81
	内　オーストラリア	754,076,738	1.57
	内　オーストリア	666,070,267	1.38
	内　中国	404,563,033	0.84
	内　アイルランド	372,700,808	0.77
	内　メキシコ	348,936,936	0.73
	内　フィンランド	278,696,752	0.58
	内　マレーシア	246,467,011	0.51
	内　ポーランド	215,621,167	0.45
	内　シンガポール	214,211,542	0.45
	内　イスラエル	208,833,288	0.43
	内　デンマーク	205,211,039	0.43
	内　スウェーデン	132,485,259	0.28
	内　ノルウェー	117,492,384	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		470,179,360	0.98
純資産総額		48,116,270,150	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年2月28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	5,563,514,431	0.9688 5,389,945,687	0.9707 5,400,503,458	－ －	60.30
2	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,506,751,797	1.4784 2,227,715,348	1.4710 2,216,431,893	－ －	24.75
3	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	159,278,473	2.7697 441,158,870	2.7823 443,160,495	－ －	4.95
4	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	208,004,549	2.1481 446,818,906	2.1222 441,427,253	－ －	4.93

（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

2022年2月28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		94.92
	小計		94.92
合　計（対純資産総額比）			94.92

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年2月28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	2,180,500	2,173.00 4,738,226,500	2,138.50 4,662,999,250	－ －	4.03
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	269,700	11,890.00 3,206,733,000	11,810.00 3,185,157,000	－ －	2.75
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	39,000	52,500.00 2,047,500,000	53,780.00 2,097,420,000	－ －	1.81
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,662,700	739.10 1,968,001,570	712.80 1,897,972,560	－ －	1.64
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	317,300	4,643.00 1,473,223,900	4,819.00 1,529,068,700	－ －	1.32
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	27,300	55,140.00 1,505,322,000	55,770.00 1,522,521,000	－ －	1.32

7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	441,900	3,330.00 1,471,527,000	3,293.00 1,455,176,700	－ －	1.26
8	任天堂 日本	株式 その他製品	24,300	58,770.00 1,428,111,000	58,020.00 1,409,886,000	－ －	1.22
9	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	253,300	5,160.00 1,307,028,000	5,125.00 1,298,162,500	－ －	1.12
10	信越化学工業 日本	株式 化学	72,400	17,510.00 1,267,724,000	17,670.00 1,279,308,000	－ －	1.11
11	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	84,000	14,975.00 1,257,900,000	14,855.00 1,247,820,000	－ －	1.08
12	三菱商事 日本	株式 卸売業	317,700	4,061.00 1,290,179,700	3,871.00 1,229,816,700	－ －	1.06
13	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	293,900	4,277.00 1,257,010,300	4,121.00 1,211,161,900	－ －	1.05
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	338,900	3,662.00 1,241,051,800	3,525.00 1,194,622,500	－ －	1.03
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	338,300	3,494.00 1,182,020,200	3,501.00 1,184,388,300	－ －	1.02
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	207,000	6,009.00 1,243,863,000	5,650.00 1,169,550,000	－ －	1.01
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	54,800	21,450.00 1,175,460,000	21,205.00 1,162,034,000	－ －	1.00
18	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	308,000	3,793.00 1,168,244,000	3,756.00 1,156,848,000	－ －	1.00
19	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	296,500	3,834.00 1,136,781,000	3,743.00 1,109,799,500	－ －	0.96
20	日本電産 日本	株式 電気機器	111,600	9,956.00 1,111,089,600	9,883.00 1,102,942,800	－ －	0.95
21	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	48,600	21,155.00 1,028,133,000	21,130.00 1,026,918,000	－ －	0.89
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	126,500	7,938.00 1,004,157,000	7,787.00 985,055,500	－ －	0.85
23	第一三共 日本	株式 医薬品	338,300	2,549.50 862,495,850	2,793.50 945,041,050	－ －	0.82
24	三井物産 日本	株式 卸売業	329,300	3,075.00 1,012,597,500	2,865.50 943,609,150	－ －	0.82
25	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	639,800	1,472.00 941,785,600	1,450.50 928,029,900	－ －	0.80
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	165,900	5,726.00 949,943,400	5,591.00 927,546,900	－ －	0.80
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	139,800	7,033.00 983,213,400	6,574.00 919,045,200	－ －	0.79

28	ＳＭＣ 日本	株式 機械	12,600	67,490.00 850,374,000	68,050.00 857,430,000	－ －	0.74
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	543,000	1,592.00 864,456,000	1,525.00 828,075,000	－ －	0.72
30	ファナック 日本	株式 電気機器	37,800	21,525.00 813,645,000	21,155.00 799,659,000	－ －	0.69

（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

2022年2月28日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	16.93
		輸送用機器	8.16
		情報・通信業	7.76
		化学	6.35
		サービス業	5.49
		卸売業	5.48
		銀行業	5.21
		機械	5.03
		医薬品	4.84
		小売業	4.18
		食料品	3.29
		陸運業	2.95
		精密機器	2.54
		その他製品	2.30
		建設業	2.27
		保険業	2.10
		不動産業	1.91
		電気・ガス業	1.13
		その他金融業	1.10
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.79
		証券、商品先物取引業	0.75
		ガラス・土石製品	0.74
		ゴム製品	0.65
		海運業	0.62
		金属製品	0.58
		繊維製品	0.45
		石油・石炭製品	0.43
		空運業	0.41
		鉱業	0.27
		パルプ・紙	0.21
		倉庫・運輸関連業	0.17
		水産・農林業	0.09
	小計		95.99
合　計（対純資産総額比）			95.99

（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

2022年2月28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３５０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	744,000,000	100.83 750,175,200	100.42 747,139,680	0.1 2028/3/20	0.96
2	第３回　利付国債（４０年） 日本	国債証券	490,000,000	134.96 661,306,280	133.45 653,905,000	2.2 2050/3/20	0.84
3	第３６３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	643,000,000	100.65 647,182,760	99.54 640,048,630	0.1 2031/6/20	0.82
4	第３６１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	637,000,000	100.10 637,641,670	99.82 635,885,250	0.1 2030/12/20	0.81
5	第４３０回　利付国債（２年） 日本	国債証券	633,000,000	100.23 634,493,370	100.09 633,576,030	0.005 2023/11/1	0.81
6	第４３１回　利付国債（２年） 日本	国債証券	632,000,000	100.19 633,219,360	100.08 632,549,840	0.005 2023/12/1	0.81
7	第３６４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	608,000,000	100.27 609,682,480	99.38 604,279,040	0.1 2031/9/20	0.77
8	第４２９回　利付国債（２年） 日本	国債証券	600,000,000	100.22 601,346,000	100.09 600,570,000	0.005 2023/10/1	0.77
9	第４２８回　利付国債（２年） 日本	国債証券	599,000,000	100.23 600,417,490	100.09 599,539,100	0.005 2023/9/1	0.77
10	第３４０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	566,000,000	102.20 578,474,640	101.45 574,252,280	0.4 2025/9/20	0.73
11	第３４９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	570,000,000	100.86 574,902,000	100.43 572,473,800	0.1 2027/12/20	0.73
12	第３５１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	570,000,000	100.77 574,389,000	100.40 572,325,600	0.1 2028/6/20	0.73
13	第３４１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	552,000,000	101.79 561,924,960	101.18 558,513,600	0.3 2025/12/20	0.71
14	第３５２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	556,000,000	100.67 559,725,200	100.39 558,179,520	0.1 2028/9/20	0.71
15	第３５３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	543,000,000	100.62 546,372,030	100.40 545,210,010	0.1 2028/12/20	0.70

16	第３３９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	536,000,000	102.08 547,154,160	101.35 543,262,800	0.4 2025/6/20	0.70
17	第３４４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	533,000,000	100.83 537,429,230	100.45 535,425,150	0.1 2026/9/20	0.69
18	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	532,000,000	100.84 536,468,800	100.45 534,425,920	0.1 2026/12/20	0.68
19	第３６２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	534,000,000	100.20 535,087,300	99.68 532,328,580	0.1 2031/3/20	0.68
20	第３５８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	525,000,000	100.17 525,892,500	100.11 525,624,750	0.1 2030/3/20	0.67
21	第３４６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	523,000,000	100.81 527,262,450	100.45 525,374,420	0.1 2027/3/20	0.67
22	第３５４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	518,000,000	100.52 520,693,600	100.38 519,999,480	0.1 2029/3/20	0.67
23	第４２７回　利付国債（２年） 日本	国債証券	516,000,000	100.20 517,074,800	100.09 516,474,720	0.005 2023/8/1	0.66
24	第１４４回　利付国債（５年） 日本	国債証券	512,000,000	100.78 516,008,960	100.38 513,945,600	0.1 2025/6/20	0.66
25	第４２６回　利付国債（２年） 日本	国債証券	513,000,000	100.22 514,128,600	100.08 513,441,180	0.005 2023/7/1	0.66
26	第３４２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	510,000,000	100.83 514,238,100	100.42 512,167,500	0.1 2026/3/20	0.66
27	第４２３回　利付国債（２年） 日本	国債証券	510,000,000	100.12 510,612,000	100.07 510,382,500	0.005 2023/4/1	0.65
28	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	101.45 507,293,500	0.66 2024/5/31	0.65
29	第３３４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	496,000,000	102.31 507,457,600	101.45 503,201,920	0.6 2024/6/20	0.64
30	第３４８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	499,000,000	100.81 503,076,830	100.44 501,210,570	0.1 2027/9/20	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

2022年2月28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	78.86
		特殊債券	7.76
		地方債証券	6.00
		社債券	5.73
	小計		98.35
	外国	社債券	0.77
	小計		0.77
合　計（対純資産総額比）			99.13

（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

2022年2月28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	1,298,973	18,601.75 24,163,177,761	19,048.41 24,743,380,025	－ －	4.86
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	560,976	39,538.99 22,180,427,281	34,354.17 19,271,865,150	－ －	3.78
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	35,818	422,701.30 15,140,315,184	355,405.22 12,729,904,295	－ －	2.50
4	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	23,653	343,263.55 8,119,212,880	310,735.90 7,349,836,349	－ －	1.44
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	22,645	345,656.09 7,827,382,343	310,874.56 7,039,754,513	－ －	1.38
6	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	66,124	130,583.86 8,634,727,787	93,580.47 6,187,915,560	－ －	1.21
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	196,446	37,838.12 7,433,148,421	27,913.41 5,483,478,428	－ －	1.08
8	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	187,311	39,807.98 7,456,472,662	24,320.96 4,555,584,087	－ －	0.89
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	74,082	51,002.79 3,778,389,286	54,972.91 4,072,503,303	－ －	0.80
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	234,771	18,559.65 4,357,268,939	17,097.93 4,014,098,945	－ －	0.79

11	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	206,886	18,850.44 3,899,892,354	19,181.29 3,968,342,431	－ －	0.78
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	104,202	32,451.37 3,381,498,211	36,888.18 3,843,822,340	－ －	0.75
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	190,845	17,014.00 3,247,037,618	18,284.63 3,489,530,594	－ －	0.68
14	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	132,650	23,283.44 3,088,549,341	25,336.64 3,360,906,423	－ －	0.66
15	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	221,174	15,327.66 3,390,080,093	14,795.90 3,272,470,598	－ －	0.64
16	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	594,877	5,244.95 3,120,105,018	5,202.06 3,094,586,441	－ －	0.61
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	82,931	47,095.21 3,905,653,143	36,588.90 3,034,354,687	－ －	0.60
18	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	332,731	7,043.81 2,343,697,034	8,994.41 2,992,719,699	－ －	0.59
19	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	69,254	39,372.96 2,726,735,317	42,648.34 2,953,568,796	－ －	0.58
20	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	32,471	97,681.18 3,171,805,734	76,194.19 2,474,101,673	－ －	0.49
21	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	142,828	17,757.22 2,536,229,594	17,278.19 2,467,809,535	－ －	0.48
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	151,951	12,979.27 1,972,214,478	16,220.90 2,464,783,343	－ －	0.48
23	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	440,545	5,890.56 2,595,057,007	5,514.04 2,429,185,395	－ －	0.48

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	55,179	46,169.23 2,547,572,460	43,626.08 2,407,243,689	－ －	0.47
25	ABBVIE 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	138,904	13,501.15 1,875,363,795	17,279.34 2,400,170,415	－ －	0.47
26	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	322,806	6,387.44 2,061,907,035	7,262.31 2,344,319,662	－ －	0.46
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	32,258	65,865.08 2,124,676,007	67,944.55 2,191,755,471	－ －	0.43
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	331,046	6,172.51 2,043,387,379	6,475.42 2,143,662,551	－ －	0.42
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	108,674	18,957.92 2,060,233,332	19,456.30 2,114,394,924	－ －	0.41
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	34,717	61,650.44 2,140,318,431	59,795.96 2,075,936,673	－ －	0.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年2月28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	10.86
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.69
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.35
		銀行	6.17
		メディア・娯楽	6.14
		資本財	5.87
		小売	4.99
		半導体・半導体製造装置	4.81
		ヘルスケア機器・サービス	4.65
		各種金融	4.64
		素材	4.16
		エネルギー	4.07
		食品・飲料・タバコ	3.89
		保険	2.99
		公益事業	2.80
		自動車・自動車部品	2.14
		運輸	1.88
		消費者サービス	1.77
		耐久消費財・アパレル	1.71
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		電気通信サービス	1.50
		食品・生活必需品小売り	1.42
		商業・専門サービス	1.13
		不動産	0.44
	小計		93.75
投資証券	外国		2.17
	小計		2.17
合　計（対純資産総額比）			95.92

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。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

2022年2月28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	767,252,000	103.98 797,805,476	101.35 777,617,574	2.25 2024/11/15	1.62
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	523,441,500	104.38 546,394,375	101.81 532,926,259	2.5 2024/5/15	1.11
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	481,843,500	104.20 502,099,044	102.24 492,646,431	2.75 2024/2/15	1.02
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	472,599,500	104.37 493,255,696	102.04 482,268,885	2.75 2023/11/15	1.00
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	472,599,500	101.94 481,771,246	100.49 474,962,497	1.75 2023/5/15	0.99
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	444,867,500	104.31 464,070,754	101.60 452,025,418	2.375 2024/8/15	0.94
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	443,712,000	103.50 459,266,878	100.50 445,943,871	2 2025/8/15	0.93
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	437,934,500	103.54 453,473,779	101.54 444,704,967	2.5 2023/8/15	0.92
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	433,312,500	103.82 449,897,290	100.45 435,292,738	2 2026/11/15	0.90
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	429,846,000	99.36 427,107,880	97.97 421,145,916	0.125 2023/9/15	0.88
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	412,513,500	104.45 430,906,189	101.34 418,070,056	2.25 2025/11/15	0.87
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	411,358,000	98.95 407,064,795	97.49 401,057,595	0.125 2023/12/15	0.83
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	368,604,500	101.50 374,149,524	99.85 368,070,023	1.375 2023/9/30	0.76
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	362,827,000	99.75 361,935,300	98.58 357,682,113	0.25 2023/6/15	0.74
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	359,360,500	102.04 366,712,588	98.89 355,400,347	1.625 2026/5/15	0.74
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	332,784,000	109.22 363,484,497	105.46 350,967,317	2.875 2028/8/15	0.73
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	353,583,000	102.07 360,916,311	99.03 350,156,780	1.625 2026/2/15	0.73
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	338,561,500	103.83 351,560,724	100.93 341,733,821	2.125 2025/5/15	0.71
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	318,918,000	101.45 323,574,202	98.32 313,572,934	1.5 2026/8/15	0.65
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	298,119,000	104.68 312,071,847	101.40 302,298,628	2.25 2026/3/31	0.63
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	291,186,000	103.45 301,240,652	100.61 292,982,617	2 2025/2/15	0.61
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	287,719,500	105.19 302,667,131	101.67 292,527,292	2.25 2027/11/15	0.61
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	284,253,000	103.20 293,355,002	101.24 287,783,422	2.25 2023/12/31	0.60

24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	279,631,000	103.18 288,534,526	101.03 282,525,180	2.125 2024/3/31	0.59
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	263,454,000	106.17 279,732,822	102.81 270,862,326	2.625 2025/12/31	0.56
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	270,387,000	103.18 278,992,586	99.92 270,195,025	1.875 2026/6/30	0.56
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	255,365,500	108.31 276,591,480	104.50 266,874,823	2.75 2028/2/15	0.55
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	269,231,500	98.82 266,060,126	96.64 260,196,090	0.375 2024/9/15	0.54
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	257,676,500	101.05 260,384,171	96.99 249,935,897	1.625 2031/5/15	0.52
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	247,277,000	103.60 256,190,388	101.00 249,757,188	2.125 2024/9/30	0.52

（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

2022年2月28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	99.02
	小計		99.02
合　計（対純資産総額比）			99.02

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年2月28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　０４０３月	買建	243	4,638,467,700	4,595,130,000	3.97

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年2月28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 202203	買建	573	15,052,563,306	14,500,022,850	2.85
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202203	買建	679	3,689,703,909	3,479,062,983	0.68
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE 202203	買建	124	1,437,190,855	1,428,489,238	0.28

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2018年2月21日)	27,072,959	27,072,959	1.0066	1.0066
第2計算期間末(2019年2月21日)	459,363,791	459,363,791	1.0190	1.0190
第3計算期間末(2020年2月21日)	3,187,112,052	3,187,112,052	1.0590	1.0590
第4計算期間末(2021年2月22日)	5,944,766,656	5,944,766,656	1.0669	1.0669
第5計算期間末(2022年2月21日)	8,963,273,182	8,963,273,182	1.0748	1.0748
2021年2月末日	5,913,274,404	－	1.0612	－
3月末日	6,456,610,506	－	1.0780	－
4月末日	6,665,968,730	－	1.0800	－
5月末日	6,903,624,128	－	1.0852	－
6月末日	7,269,511,118	－	1.0872	－
7月末日	7,576,955,612	－	1.0917	－
8月末日	7,790,166,206	－	1.0940	－
9月末日	8,092,961,018	－	1.0909	－
10月末日	8,295,660,947	－	1.0990	－
11月末日	8,478,164,653	－	1.0952	－
12月末日	8,792,630,369	－	1.0994	－
2022年1月末日	8,850,460,633	－	1.0834	－
2月末日	8,956,167,492	－	1.0743	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	0.7
第2計算期間	1.2
第3計算期間	3.9
第4計算期間	0.7
第5計算期間	0.7

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	32,130,976	5,235,210	26,895,766
第2計算期間	452,842,888	28,932,225	450,806,429
第3計算期間	2,737,365,208	178,488,494	3,009,683,143
第4計算期間	3,158,136,127	595,621,118	5,572,198,152
第5計算期間	3,755,970,376	988,954,765	8,339,213,763

（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

2022年2月末現在

●基準価額・純資産の推移

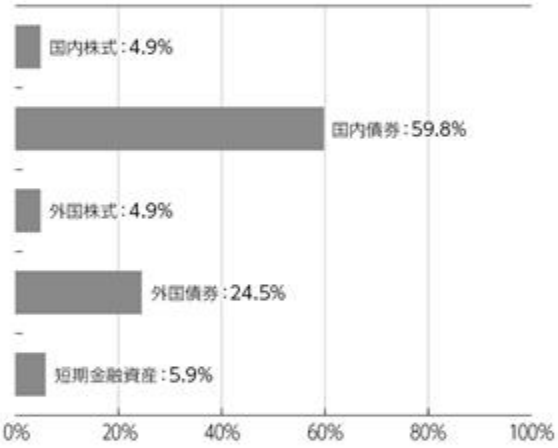
基準価額	10,743円
純資産総額	89億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年 2 月	0円
2019年 2 月	0円
2020年 2 月	0円
2021年 2 月	0円
2022年 2 月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

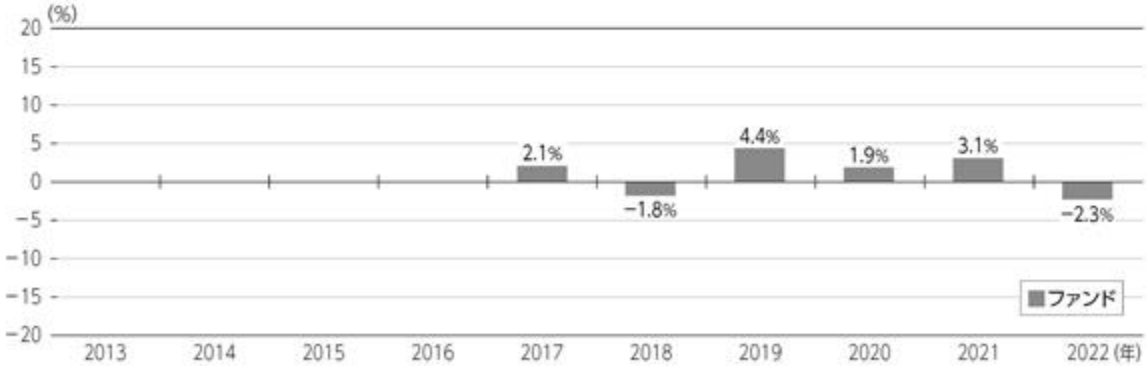
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2017年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

②　換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③　換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○　換金手数料はありません。

⑤　信託財産留保額

ありません。

⑥　支払開始日

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

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

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

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限です。

（4）【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

（5）【その他】

① 繰上償還

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

ｉ．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

ii．やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

５．前記２．から４．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記２．から４．までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

６．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。

７．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「②　約款の変更等　２．」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

８．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「②　約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。

９．償還金については、原則として償還日から起算して５営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して５営業日目）までにお支払いします。

②　約款の変更等

１．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「②　約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

２．委託会社は、前記１．の事項（前記１．の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

③　反対者の買取請求の不適用

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

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

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

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

⑥　信託事務処理の再信託

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

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2021年2月23日から2022年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2021年2月22日現在	第5期 2022年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,639,420	2,567,326
コール・ローン	288,331,485	459,240,138
親投資信託受益証券	5,655,922,357	8,508,481,129
未収入金	15,200,734	5,377,435
流動資産合計	5,965,093,996	8,975,666,028
資産合計	5,965,093,996	8,975,666,028
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,947,898	5,581,340
未払受託者報酬	594,057	929,588
未払委託者報酬	3,564,606	5,577,783
その他未払費用	220,779	304,135
流動負債合計	20,327,340	12,392,846
負債合計	20,327,340	12,392,846
純資産の部		
元本等		
元本	5,572,198,152	8,339,213,763
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	372,568,504	624,059,419
（分配準備積立金）	142,604,222	124,045,150
元本等合計	5,944,766,656	8,963,273,182
純資産合計	5,944,766,656	8,963,273,182
負債純資産合計	5,965,093,996	8,975,666,028

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　2020年2月22日 至　2021年2月22日	第5期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
営業収益		
受取利息	7,066	7,231
有価証券売買等損益	79,602,831	23,028,153
営業収益合計	79,609,897	23,035,384
営業費用		
支払利息	130,668	225,892
受託者報酬	1,012,576	1,689,591
委託者報酬	6,075,953	10,138,079
その他費用	391,248	574,640
営業費用合計	7,610,445	12,628,202
営業利益又は営業損失（△）	71,999,452	10,407,182
経常利益又は経常損失（△）	71,999,452	10,407,182
当期純利益又は当期純損失（△）	71,999,452	10,407,182
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（△）	△2,029	17,368,084
期首剰余金又は期首欠損金（△）	177,428,909	372,568,504
剰余金増加額又は欠損金減少額	155,229,124	329,175,553
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	155,229,124	329,175,553
剰余金減少額又は欠損金増加額	32,091,010	70,723,736
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	32,091,010	70,723,736
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（△）	372,568,504	624,059,419

（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5期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他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2月21日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2021年2月23日から2022年2月21日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4期 2021年2月22日現在	第5期 2022年2月21日現在
１．　期首元本額	3,009,683,143円	5,572,198,152円
期中追加設定元本額	3,158,136,127円	3,755,970,376円
期中一部解約元本額	595,621,118円	988,954,765円
２．　受益権の総数	5,572,198,152口	8,339,213,763口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第4期 自　2020年2月22日 至　2021年2月22日	第5期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（72,066,031円）、収益調整金（230,080,287円）及び分配準備積立金（70,538,191円）より分配対象収益は372,684,509円（1万口当たり668.83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（0円）、収益調整金（500,220,700円）及び分配準備積立金（124,045,150円）より分配対象収益は624,265,850円（1万口当たり748.59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4期 自　2020年2月22日 至　2021年2月22日	第5期 自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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4期 2021年2月22日現在	第5期 2022年2月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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4期 2021年2月22日現在	第5期 2022年2月21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	77,563,705	△15,536,697
合計	77,563,705	△15,536,697

（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4期 2021年2月22日現在	第5期 2022年2月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0669円 (10,669円)	1.0748円 (10,748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

2022年2月21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	208,072,492	446,981,327	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	1,507,249,210	2,228,467,956	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	159,332,621	441,319,493	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	5,565,351,314	5,391,712,353	
親投資信託受益証券　合計		7,440,005,637	8,508,481,129	
合計			8,508,481,129	

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

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

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年2月21日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	24,484,290
コール・ローン	4,379,719,491
株式	112,497,641,670
派生商品評価勘定	18,146,300
未収配当金	174,543,011
前払金	63,600,000
差入委託証拠金	182,055,000
流動資産合計	117,340,189,762
資産合計	117,340,189,762
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,482,250
未払解約金	176,705,800
その他未払費用	4,422
流動負債合計	279,192,472
負債合計	279,192,472
純資産の部	
元本等	
元本	54,493,461,224
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	62,567,536,066
元本等合計	117,060,997,290
純資産合計	117,060,997,290
負債純資産合計	117,340,189,762

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年2月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	79,813,755,893円
	同期中追加設定元本額	23,632,095,039円
	同期中一部解約元本額	48,952,389,708円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,837,157,491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）	3,537,763,643円
	ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,656,374円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,113,704,346円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,082,250,932円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	5,253,789,188円
	ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	4,978,524円
	ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	16,544,754円
	ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	16,615,142円
	ＤＣニッセイ国内株式インデックス	1,071,087,533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	21,344,932,487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）	2,132,535,408円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	201,061,345円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	208,072,492円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	241,020,671円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	473,144,628円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	49,277,264円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	98,857,796円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	7,457,971円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,013,941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）	4,293,106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）	6,605,585円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	26,854,982円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	136,468,048円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	100,987,893円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	224,574,567円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	205,595,072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）	4,063,776,492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）	19,506,730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）	80,115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）	166,146円
	ＦＷニッセイ国内株インデックス	485,273円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	145,285円
	計	54,493,461,224円
２．	受益権の総数	54,493,461,224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　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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	2022年2月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短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	2022年2月21日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△1,461,562,800
合計	△1,461,562,800

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年2月21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	4,462,690,000	－	4,378,480,000	△84,210,000
合計	4,462,690,000	－	4,378,480,000	△84,210,000

（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）

	2022年2月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1482円 (21,482円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年2月21日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	2,100	3,205.00	6,730,500	
日本水産	58,500	550.00	32,175,000	
マルハニチロ	9,100	2,579.00	23,468,900	
雪国まいたけ	4,300	1,221.00	5,250,300	
カネコ種苗	2,000	1,546.00	3,092,000	
サカタのタネ	7,000	3,400.00	23,800,000	
ホクト	4,900	1,959.00	9,599,100	
ヒノキヤグループ	1,300	2,384.00	3,099,200	
ショーボンドホールディングス	8,300	5,230.00	43,409,000	
ミライト・ホールディングス	18,800	1,935.00	36,378,000	
タマホーム	3,500	2,289.00	8,011,500	

ファーストコーポレーション	4,200	732.00	3,074,400	
スペースバリューホールディングス	6,100	1,145.00	6,984,500	
住石ホールディングス	11,900	137.00	1,630,300	
日鉄鉱業	1,300	6,370.00	8,281,000	
三井松島ホールディングス	2,400	1,638.00	3,931,200	
ＩＮＰＥＸ	234,500	1,127.00	264,281,500	
石油資源開発	6,900	2,680.00	18,492,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	2,700	1,584.00	4,276,800	
安藤・間	29,000	934.00	27,086,000	
東急建設	17,100	729.00	12,465,900	
コムシスホールディングス	18,800	2,800.00	52,640,000	
ビーアールホールディングス	8,800	345.00	3,036,000	
高松コンストラクショングループ	3,600	1,999.00	7,196,400	
東建コーポレーション	1,800	9,220.00	16,596,000	
ソネック	2,900	1,030.00	2,987,000	
ヤマウラ	3,100	994.00	3,081,400	
オリエンタル白石	19,600	242.00	4,743,200	
大成建設	39,000	3,805.00	148,395,000	
大林組	135,000	969.00	130,815,000	
清水建設	126,500	780.00	98,670,000	
飛島建設	3,600	1,128.00	4,060,800	
長谷工コーポレーション	40,200	1,512.00	60,782,400	
松井建設	5,300	741.00	3,927,300	
錢高組	800	4,085.00	3,268,000	
鹿島建設	98,900	1,565.00	154,778,500	
不動テトラ	2,900	1,550.00	4,495,000	
鉄建建設	2,900	1,924.00	5,579,600	
西松建設	8,200	3,875.00	31,775,000	
三井住友建設	30,400	448.00	13,619,200	
大豊建設	2,000	3,675.00	7,350,000	
佐田建設	6,400	474.00	3,033,600	
ナカノフドー建設	8,700	343.00	2,984,100	
奥村組	8,000	3,225.00	25,800,000	
東鉄工業	6,300	2,526.00	15,913,800	
淺沼組	1,500	5,320.00	7,980,000	
戸田建設	56,100	769.00	43,140,900	
熊谷組	6,900	2,877.00	19,851,300	
北野建設	1,400	2,149.00	3,008,600	
植木組	2,100	1,504.00	3,158,400	
矢作建設工業	6,000	783.00	4,698,000	
ピーエス三菱	4,900	611.00	2,993,900	
日本ハウスホールディングス	9,200	454.00	4,176,800	
大東建託	13,800	12,760.00	176,088,000	
新日本建設	5,700	743.00	4,235,100	
ＮＩＰＰＯ	11,200	4,000.00	44,800,000	
東亜道路工業	700	5,020.00	3,514,000	
日本道路	1,300	9,890.00	12,857,000	
東亜建設工業	3,300	2,673.00	8,820,900	
日本国土開発	13,100	532.00	6,969,200	
若築建設	2,300	1,898.00	4,365,400	

東洋建設	15,100	592.00	8,939,200	
五洋建設	53,500	621.00	33,223,500	
世紀東急工業	6,500	818.00	5,317,000	
福田組	1,400	4,220.00	5,908,000	
住友林業	34,500	2,270.00	78,315,000	
日本基礎技術	5,400	666.00	3,596,400	
巴コーポレーション	6,300	503.00	3,168,900	
大和ハウス工業	124,700	3,352.00	417,994,400	
ライト工業	8,500	1,942.00	16,507,000	
積水ハウス	146,400	2,373.50	347,480,400	
日特建設	4,600	736.00	3,385,600	
北陸電気工事	3,200	805.00	2,576,000	
ユアテック	7,700	713.00	5,490,100	
日本リーテック	2,800	1,438.00	4,026,400	
四電工	1,700	1,599.00	2,718,300	
中電工	6,200	2,152.00	13,342,400	
関電工	21,900	878.00	19,228,200	
きんでん	30,200	1,635.00	49,377,000	
東京エネシス	4,500	945.00	4,252,500	
トーエネック	1,400	3,330.00	4,662,000	
住友電設	3,300	2,241.00	7,395,300	
日本電設工業	7,400	1,537.00	11,373,800	
エクシオグループ	20,300	2,391.00	48,537,300	
新日本空調	3,600	2,036.00	7,329,600	
日本工営	2,400	2,996.00	7,190,400	
九電工	10,400	3,110.00	32,344,000	
三機工業	8,800	1,502.00	13,217,600	
日揮ホールディングス	41,600	1,093.00	45,468,800	
中外炉工業	1,900	1,581.00	3,003,900	
ヤマト	4,000	708.00	2,832,000	
太平電業	3,000	2,688.00	8,064,000	
高砂熱学工業	12,200	1,985.00	24,217,000	
三晃金属工業	1,200	2,527.00	3,032,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	14,000	1,758.00	24,612,000	
朝日工業社	700	3,045.00	2,131,500	
明星工業	8,700	724.00	6,298,800	
大氣社	6,600	3,065.00	20,229,000	
ダイダン	3,000	2,307.00	6,921,000	
日比谷総合設備	4,300	1,888.00	8,118,400	
ニップン	12,600	1,696.00	21,369,600	
日清製粉グループ本社	48,800	1,654.00	80,715,200	
昭和産業	4,100	2,700.00	11,070,000	
鳥越製粉	4,400	669.00	2,943,600	
中部飼料	4,900	1,042.00	5,105,800	
フィード・ワン	5,800	682.00	3,955,600	
日本甜菜製糖	2,300	1,701.00	3,912,300	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	3,900	1,999.00	7,796,100	
塩水港精糖	14,100	217.00	3,059,700	
日新製糖	2,000	1,795.00	3,590,000	
ＬＩＦＵＬＬ	12,600	239.00	3,011,400	

ミクシィ	9,400	2,240.00	21,056,000	
ジェイエイシーリクルートメント	3,300	1,787.00	5,897,100	
日本M&Aセンターホールディングス	67,500	1,686.00	113,805,000	
メンバーズ	1,200	2,877.00	3,452,400	
ＵＴグループ	5,900	3,415.00	20,148,500	
アイティメディア	1,900	1,571.00	2,984,900	
夢真ビーネックスグループ	10,900	1,550.00	16,895,000	
コシダカホールディングス	11,000	635.00	6,985,000	
アルトナー	3,500	875.00	3,062,500	
パソナグループ	4,500	2,457.00	11,056,500	
ＣＤＳ	1,800	1,609.00	2,896,200	
リンクアンドモチベーション	9,100	433.00	3,940,300	
エス・エム・エス	14,000	3,065.00	42,910,000	
サニーサイドアップグループ	4,000	731.00	2,924,000	
パーソルホールディングス	41,100	2,503.00	102,873,300	
クックパッド	12,900	254.00	3,276,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,900	590.00	2,891,000	
森永製菓	10,100	3,610.00	36,461,000	
中村屋	1,000	3,375.00	3,375,000	
江崎グリコ	11,900	3,875.00	46,112,500	
名糖産業	1,900	1,676.00	3,184,400	
井村屋グループ	2,400	2,256.00	5,414,400	
不二家	2,400	2,517.00	6,040,800	
山崎製パン	32,400	1,542.00	49,960,800	
モロゾフ	1,400	2,731.00	3,823,400	
亀田製菓	2,500	4,115.00	10,287,500	
寿スピリッツ	4,200	6,220.00	26,124,000	
カルビー	19,700	2,564.00	50,510,800	
森永乳業	8,000	5,610.00	44,880,000	
六甲バター	3,200	1,565.00	5,008,000	
ヤクルト本社	32,000	6,160.00	197,120,000	
明治ホールディングス	28,600	6,870.00	196,482,000	
雪印メグミルク	10,400	1,992.00	20,716,800	
プリマハム	5,400	2,428.00	13,111,200	
日本ハム	16,500	4,400.00	72,600,000	
林兼産業	5,900	502.00	2,961,800	
丸大食品	4,300	1,513.00	6,505,900	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	3,900	3,220.00	12,558,000	
柿安本店	1,500	2,567.00	3,850,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	27,800	689.00	19,154,200	
学情	2,800	1,036.00	2,900,800	
スタジオアリス	1,800	2,195.00	3,951,000	
シミックホールディングス	2,300	1,509.00	3,470,700	
システナ	60,300	386.00	23,275,800	
ＮＪＳ	1,500	2,009.00	3,013,500	
デジタルアーツ	2,300	6,000.00	13,800,000	
日鉄ソリューションズ	6,100	3,530.00	21,533,000	
綜合警備保障	16,400	4,235.00	69,454,000	
キューブシステム	900	907.00	816,300	
いちご	47,300	279.00	13,196,700	

日本駐車場開発	46,600	139.00	6,477,400	
コア	1,800	1,522.00	2,739,600	
カカクコム	30,200	2,553.00	77,100,600	
アイロムグループ	1,800	1,910.00	3,438,000	
セントケア・ホールディング	3,900	818.00	3,190,200	
ルネサンス	2,900	1,087.00	3,152,300	
ディップ	7,200	3,460.00	24,912,000	
ＳＢＳホールディングス	3,200	3,030.00	9,696,000	
デジタルホールディングス	2,900	1,552.00	4,500,800	
新日本科学	5,000	1,538.00	7,690,000	
ベネフィット・ワン	15,000	2,455.00	36,825,000	
エムスリー	72,600	4,001.00	290,472,600	
ツカダ・グローバルホールディング	10,100	327.00	3,302,700	
アウトソーシング	23,600	1,310.00	30,916,000	
ウェルネット	6,500	447.00	2,905,500	
ワールドホールディングス	1,600	2,077.00	3,323,200	
ディー・エヌ・エー	15,700	1,734.00	27,223,800	
博報堂ＤＹホールディングス	57,300	1,518.00	86,981,400	
ぐるなび	6,900	416.00	2,870,400	
ファンコミュニケーションズ	10,300	412.00	4,243,600	
ビジネス・ブレークスルー	7,000	432.00	3,024,000	
エスプール	11,600	985.00	11,426,000	
ＷＤＢホールディングス	1,900	2,668.00	5,069,200	
手間いらず	600	4,970.00	2,982,000	
アドウェイズ	6,100	642.00	3,916,200	
バリューコマース	3,200	3,325.00	10,640,000	
インフォマート	45,100	618.00	27,871,800	
サッポロホールディングス	14,700	2,408.00	35,397,600	
アサヒグループホールディングス	101,600	5,115.00	519,684,000	
キリンホールディングス	158,800	2,012.00	319,505,600	
宝ホールディングス	29,400	1,176.00	34,574,400	
オエノンホールディングス	12,300	346.00	4,255,800	
養命酒製造	1,700	1,775.00	3,017,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	30,300	1,517.00	45,965,100	
サントリー食品インターナショナル	28,900	4,685.00	135,396,500	
ダイドーグループホールディングス	2,200	5,200.00	11,440,000	
伊藤園	13,100	6,710.00	87,901,000	
キーコーヒー	4,200	2,071.00	8,698,200	
日清オイリオグループ	5,400	2,995.00	16,173,000	
不二製油グループ本社	9,400	2,236.00	21,018,400	
Ｊ－オイルミルズ	4,000	1,742.00	6,968,000	
ローソン	9,400	4,855.00	45,637,000	
サンエー	3,200	4,100.00	13,120,000	
カワチ薬品	3,300	2,406.00	7,939,800	
エービーシー・マート	6,600	5,220.00	34,452,000	
ハードオフコーポレーション	4,100	800.00	3,280,000	
アスクル	6,900	1,692.00	11,674,800	
ゲオホールディングス	5,700	1,512.00	8,618,400	
アダストリア	4,600	1,739.00	7,999,400	

オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,528.00	3,056,000	
伊藤忠食品	1,000	5,030.00	5,030,000	
くら寿司	4,400	3,795.00	16,698,000	
キャンドゥ	2,000	2,066.00	4,132,000	
エレマテック	3,400	1,067.00	3,627,800	
アイケイ	7,300	408.00	2,978,400	
パルグループホールディングス	3,700	1,598.00	5,912,600	
ＪＡＬＵＸ	1,200	2,558.00	3,069,600	
エディオン	19,500	1,194.00	23,283,000	
あらた	3,400	3,900.00	13,260,000	
サーラコーポレーション	8,600	643.00	5,529,800	
トーメンデバイス	600	6,180.00	3,708,000	
ハローズ	1,900	2,763.00	5,249,700	
ＪＰホールディングス	12,200	226.00	2,757,200	
フジオフードグループ本社	3,600	1,317.00	4,741,200	
あみやき亭	1,000	3,020.00	3,020,000	
東京エレクトロン　デバイス	1,300	5,360.00	6,968,000	
双日	46,800	1,958.00	91,634,400	
アルフレッサ　ホールディングス	47,100	1,752.00	82,519,200	
大黒天物産	1,400	4,690.00	6,566,000	
ハニーズホールディングス	3,400	1,025.00	3,485,000	
キッコーマン	31,100	8,990.00	279,589,000	
味の素	95,400	3,324.00	317,109,600	
ブルドックソース	1,800	2,005.00	3,609,000	
キユーピー	22,700	2,441.00	55,410,700	
ハウス食品グループ本社	16,200	3,015.00	48,843,000	
カゴメ	16,400	3,035.00	49,774,000	
アリアケジャパン	3,900	5,740.00	22,386,000	
ピエトロ	1,700	1,805.00	3,068,500	
ニチレイ	19,700	2,579.00	50,806,300	
横浜冷凍	11,900	867.00	10,317,300	
東洋水産	20,700	4,925.00	101,947,500	
イートアンドホールディングス	1,600	2,299.00	3,678,400	
大冷	1,400	1,888.00	2,643,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	511.00	2,503,900	
日清食品ホールディングス	17,000	9,200.00	156,400,000	
永谷園ホールディングス	1,900	2,015.00	3,828,500	
一正蒲鉾	3,800	797.00	3,028,600	
フジッコ	4,000	1,956.00	7,824,000	
ロック・フィールド	4,700	1,590.00	7,473,000	
日本たばこ産業	231,700	2,323.00	538,239,100	
ケンコーマヨネーズ	2,400	1,406.00	3,374,400	
わらべや日洋ホールディングス	2,800	1,833.00	5,132,400	
なとり	2,400	2,070.00	4,968,000	
ピックルスコーポレーション	2,100	1,512.00	3,175,200	
ファーマフーズ	4,100	1,565.00	6,416,500	
北の達人コーポレーション	15,100	221.00	3,337,100	
ユーグレナ	22,000	754.00	16,588,000	
紀文食品	3,100	1,192.00	3,695,200	
スター・マイカ・ホールディングス	2,300	1,239.00	2,849,700	

ＳＲＥホールディングス	1,000	3,590.00	3,590,000	
ＡＤワークスグループ	19,200	141.00	2,707,200	
片倉工業	4,700	2,289.00	10,758,300	
グンゼ	2,800	3,840.00	10,752,000	
ヒューリック	101,400	1,067.00	108,193,800	
ラサ商事	3,000	1,014.00	3,042,000	
アルペン	3,200	2,141.00	6,851,200	
ハブ	4,500	608.00	2,736,000	
ラクーンホールディングス	3,000	1,117.00	3,351,000	
クオールホールディングス	5,200	1,292.00	6,718,400	
アルコニックス	5,300	1,344.00	7,123,200	
神戸物産	32,900	3,770.00	124,033,000	
ジンズホールディングス	2,900	6,530.00	18,937,000	
ビックカメラ	25,100	1,011.00	25,376,100	
ＤＣＭホールディングス	26,200	1,107.00	29,003,400	
ハイパー	5,500	476.00	2,618,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	53,600	2,190.00	117,384,000	
東京一番フーズ	5,100	599.00	3,054,900	
あい　ホールディングス	6,100	1,782.00	10,870,200	
ディーブイエックス	2,800	1,048.00	2,934,400	
アークランドサービスホールディングス	3,100	2,254.00	6,987,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	50,600	1,030.00	52,118,000	
ドトール・日レスホールディングス	7,300	1,606.00	11,723,800	
マツキヨココカラ＆カンパニー	26,100	4,525.00	118,102,500	
ブロンコビリー	2,400	2,241.00	5,378,400	
ＺＯＺＯ	29,200	3,280.00	95,776,000	
トレジャー・ファクトリー	3,100	949.00	2,941,900	
物語コーポレーション	2,300	6,640.00	15,272,000	
三越伊勢丹ホールディングス	74,200	967.00	71,751,400	
東洋紡	16,700	1,251.00	20,891,700	
ユニチカ	11,600	309.00	3,584,400	
富士紡ホールディングス	1,900	3,620.00	6,878,000	
日清紡ホールディングス	26,300	1,041.00	27,378,300	
倉敷紡績	3,600	1,911.00	6,879,600	
ダイワボウホールディングス	20,600	1,770.00	36,462,000	
日東紡績	6,400	3,105.00	19,872,000	
トヨタ紡織	17,600	2,160.00	38,016,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	10,100	2,633.00	26,593,300	
Ｈａｍｅｅ	300	1,136.00	340,800	
ラクト・ジャパン	1,500	2,039.00	3,058,500	
ウエルシアホールディングス	22,400	3,090.00	69,216,000	
クリエイトＳＤホールディングス	6,300	3,130.00	19,719,000	
グリムス	1,900	2,126.00	4,039,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,400	808.00	5,979,200	
八洲電機	3,100	956.00	2,963,600	
メディアスホールディングス	3,100	911.00	2,824,100	
レスターホールディングス	4,000	1,977.00	7,908,000	
ジューテックホールディングス	2,700	1,230.00	3,321,000	

丸善ＣＨＩホールディングス	8,400	372.00	3,124,800	
ＯＣＨＩホールディングス	2,300	1,357.00	3,121,100	
ＴＯＫＡＩホールディングス	20,500	907.00	18,593,500	
ミサワ	4,200	647.00	2,717,400	
ティーライフ	2,200	1,346.00	2,961,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	4,000	745.00	2,980,000	
三洋貿易	4,300	1,016.00	4,368,800	
シュッピン	3,500	1,136.00	3,976,000	
オイシックス・ラ・大地	6,100	2,616.00	15,957,600	
ウイン・パートナーズ	3,100	1,044.00	3,236,400	
ネクステージ	8,600	2,578.00	22,170,800	
ジョイフル本田	12,400	1,556.00	19,294,400	
ホットランド	3,200	1,315.00	4,208,000	
すかいらーくホールディングス	54,700	1,495.00	81,776,500	
ＳＦＰホールディングス	2,100	1,415.00	2,971,500	
綿半ホールディングス	3,200	1,321.00	4,227,200	
日本毛織	12,700	893.00	11,341,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	12,300	1,057.00	13,001,100	
三栄建築設計	1,700	1,615.00	2,745,500	
野村不動産ホールディングス	22,000	2,842.00	62,524,000	
三重交通グループホールディングス	8,600	470.00	4,042,000	
サムティ	6,800	2,134.00	14,511,200	
ディア・ライフ	5,500	517.00	2,843,500	
コーセーアールイー	4,100	577.00	2,365,700	
地主	2,700	1,783.00	4,814,100	
プレサンスコーポレーション	5,500	1,868.00	10,274,000	
日本管理センター	2,900	1,022.00	2,963,800	
サンセイランディック	200	805.00	161,000	
エストラスト	4,500	576.00	2,592,000	
フージャースホールディングス	5,400	691.00	3,731,400	
オープンハウスグループ	13,500	5,000.00	67,500,000	
東急不動産ホールディングス	125,100	664.00	83,066,400	
飯田グループホールディングス	35,400	2,194.00	77,667,600	
イーグランド	1,900	1,371.00	2,604,900	
ムゲンエステート	6,100	480.00	2,928,000	
帝国繊維	4,800	1,908.00	9,158,400	
日本コークス工業	36,400	135.00	4,914,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,600	1,068.00	2,776,800	
ＢＥＥＮＯＳ	2,100	1,462.00	3,070,200	
あさひ	3,500	1,306.00	4,571,000	
日本調剤	2,600	1,381.00	3,590,600	
コスモス薬品	4,300	15,760.00	67,768,000	
シップヘルスケアホールディングス	13,600	2,301.00	31,293,600	
ソフトクリエイトホールディングス	1,800	4,075.00	7,335,000	
セブン&アイ・ホールディングス	165,900	5,726.00	949,943,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	22,600	735.00	16,611,000	
明治電機工業	2,400	1,044.00	2,505,600	
ツルハホールディングス	9,200	9,200.00	84,640,000	

サンマルクホールディングス	3,300	1,631.00	5,382,300	
フェリシモ	2,200	1,184.00	2,604,800	
トリドールホールディングス	10,500	2,575.00	27,037,500	
帝人	39,700	1,418.00	56,294,600	
東レ	305,300	660.00	201,498,000	
クラレ	61,700	1,084.00	66,882,800	
旭化成	279,400	1,090.00	304,546,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	4,900	442.00	2,165,800	
稲葉製作所	2,400	1,303.00	3,127,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,300	3,580.00	4,654,000	
トーカロ	11,000	1,326.00	14,586,000	
アルファ	2,700	1,092.00	2,948,400	
ＳＵＭＣＯ	65,600	1,958.00	128,444,800	
川田テクノロジーズ	900	3,825.00	3,442,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,400	5,250.00	7,350,000	
ファーストブラザーズ	3,300	817.00	2,696,100	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	3,200	910.00	2,912,000	
ケイアイスター不動産	1,900	5,000.00	9,500,000	
グッドコムアセット	2,700	1,136.00	3,067,200	
ジェイ・エス・ビー	700	3,210.00	2,247,000	
日本フエルト	6,800	450.00	3,060,000	
芦森工業	3,300	905.00	2,986,500	
アツギ	5,500	609.00	3,349,500	
ウイルプラスホールディングス	3,000	904.00	2,712,000	
ＪＭホールディングス	2,900	1,782.00	5,167,800	
コメダホールディングス	9,300	2,129.00	19,799,700	
アレンザホールディングス	3,200	1,057.00	3,382,400	
バロックジャパンリミテッド	3,500	850.00	2,975,000	
クスリのアオキホールディングス	4,200	6,960.00	29,232,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	24,800	3,755.00	93,124,000	
アセンテック	3,100	699.00	2,166,900	
セーレン	8,600	2,223.00	19,117,800	
ソトー	3,700	837.00	3,096,900	
東海染工	2,600	1,165.00	3,029,000	
小松マテーレ	6,900	1,292.00	8,914,800	
ワコールホールディングス	10,500	2,013.00	21,136,500	
ホギメディカル	5,700	3,300.00	18,810,000	
クラウディアホールディングス	12,700	238.00	3,022,600	
ＴＳＩホールディングス	14,100	320.00	4,512,000	
マツオカコーポレーション	2,400	1,163.00	2,791,200	
ワールド	5,500	1,234.00	6,787,000	
ＴＩＳ	40,300	2,584.00	104,135,200	
グリー	25,900	808.00	20,927,200	
コーエーテクモホールディングス	13,500	3,985.00	53,797,500	
三菱総合研究所	1,800	3,710.00	6,678,000	
ＡＧＳ	3,400	792.00	2,692,800	
ファインデックス	3,600	694.00	2,498,400	
ブレインパッド	3,300	1,060.00	3,498,000	
ＫＬａｂ	7,700	398.00	3,064,600	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,100	1,029.00	6,276,900	
ネクソン	95,300	2,508.00	239,012,400	
アイスタイル	12,900	189.00	2,438,100	
エムアップホールディングス	4,900	883.00	4,326,700	
エイチーム	3,400	709.00	2,410,600	
エニグモ	4,600	674.00	3,100,400	
テクノスジャパン	5,600	440.00	2,464,000	
コロプラ	13,900	630.00	8,757,000	
ブロードリーフ	20,900	328.00	6,855,200	
デジタルハーツホールディングス	1,900	1,471.00	2,794,900	
システム情報	3,500	1,008.00	3,528,000	
メディアドゥ	1,500	2,427.00	3,640,500	
じげん	11,900	298.00	3,546,200	
ブイキューブ	4,300	758.00	3,259,400	
サイバーリンクス	2,900	900.00	2,610,000	
フィックスターズ	4,500	678.00	3,051,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,700	2,353.00	4,000,100	
オプティム	2,900	875.00	2,537,500	
セレス	1,500	1,321.00	1,981,500	
ＳＨＩＦＴ	2,100	19,920.00	41,832,000	
特種東海製紙	2,600	4,105.00	10,673,000	
ティーガイア	3,700	1,724.00	6,378,800	
テクマトリックス	7,100	1,557.00	11,054,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11,500	2,838.00	32,637,000	
GMOペイメントゲートウェイ	8,200	10,190.00	83,558,000	
ザッパラス	5,300	492.00	2,607,600	
インターネットイニシアティブ	11,300	3,405.00	38,476,500	
さくらインターネット	5,500	513.00	2,821,500	
ヴィンクス	3,500	971.00	3,398,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	900	4,170.00	3,753,000	
ＳＲＡホールディングス	2,000	2,863.00	5,726,000	
朝日ネット	5,100	597.00	3,044,700	
ｅＢＡＳＥ	5,000	618.00	3,090,000	
アバント	4,500	1,044.00	4,698,000	
アドソル日進	1,700	1,601.00	2,721,700	
フリービット	2,900	894.00	2,592,600	
コムチュア	4,700	2,762.00	12,981,400	
サイバーコム	2,600	938.00	2,438,800	
アステリア	3,000	706.00	2,118,000	
アイル	2,300	1,295.00	2,978,500	
王子ホールディングス	176,200	606.00	106,777,200	
日本製紙	20,200	1,148.00	23,189,600	
三菱製紙	6,000	315.00	1,890,000	
北越コーポレーション	27,600	752.00	20,755,200	
大王製紙	20,300	1,777.00	36,073,100	
阿波製紙	9,100	330.00	3,003,000	
マークラインズ	2,100	2,625.00	5,512,500	

メディカル・データ・ビジョン	5,300	1,015.00	5,379,500	
ｇｕｍｉ	5,900	543.00	3,203,700	
テラスカイ	1,700	1,428.00	2,427,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,300	1,258.00	2,893,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,000	2,882.00	2,882,000	
ラクス	14,500	1,674.00	24,273,000	
ランドコンピュータ	3,500	855.00	2,992,500	
ダブルスタンダード	1,300	1,816.00	2,360,800	
オープンドア	2,500	1,944.00	4,860,000	
アカツキ	1,900	2,783.00	5,287,700	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,100	2,042.00	2,246,200	
カナミックネットワーク	6,400	444.00	2,841,600	
ノムラシステムコーポレーション	10,900	221.00	2,408,900	
レンゴー	39,800	861.00	34,267,800	
トーモク	2,600	1,729.00	4,495,400	
ザ・パック	3,200	2,700.00	8,640,000	
チェンジ	7,800	1,611.00	12,565,800	
シンクロ・フード	8,700	261.00	2,270,700	
オークネット	2,200	1,536.00	3,379,200	
キャピタル・アセット・プランニング	4,000	796.00	3,184,000	
マクロミル	8,600	1,178.00	10,130,800	
ビーグリー	1,800	1,238.00	2,228,400	
オロ	1,300	2,412.00	3,135,600	
ユーザーローカル	1,700	1,472.00	2,502,400	
マネーフォワード	6,400	4,485.00	28,704,000	
昭和電工	36,600	2,239.00	81,947,400	
住友化学	309,800	549.00	170,080,200	
住友精化	1,900	3,300.00	6,270,000	
日産化学	22,900	6,490.00	148,621,000	
ラサ工業	1,800	1,593.00	2,867,400	
クレハ	3,300	8,920.00	29,436,000	
多木化学	1,600	4,705.00	7,528,000	
テイカ	3,100	1,318.00	4,085,800	
石原産業	7,000	1,034.00	7,238,000	
片倉コープアグリ	2,600	1,177.00	3,060,200	
日本曹達	5,400	3,355.00	18,117,000	
東ソー	60,800	1,830.00	111,264,000	
トクヤマ	13,500	1,832.00	24,732,000	
セントラル硝子	6,900	2,062.00	14,227,800	
東亞合成	24,000	1,074.00	25,776,000	
大阪ソーダ	3,900	3,120.00	12,168,000	
関東電化工業	9,200	1,181.00	10,865,200	
デンカ	15,400	3,525.00	54,285,000	
イビデン	22,600	5,440.00	122,944,000	
信越化学工業	72,400	17,510.00	1,267,724,000	
日本カーバイド工業	2,200	1,444.00	3,176,800	
電算システムホールディングス	1,700	2,755.00	4,683,500	
堺化学工業	3,000	1,996.00	5,988,000	
第一稀元素化学工業	3,900	988.00	3,853,200	

エア・ウォーター	39,900	1,677.00	66,912,300	
日本酸素ホールディングス	40,500	2,272.00	92,016,000	
日本化学工業	1,300	2,460.00	3,198,000	
日本パーカライジング	21,300	997.00	21,236,100	
高圧ガス工業	6,700	689.00	4,616,300	
四国化成工業	5,500	1,437.00	7,903,500	
戸田工業	900	2,546.00	2,291,400	
ステラ　ケミファ	2,100	2,389.00	5,016,900	
保土谷化学工業	1,300	4,260.00	5,538,000	
日本触媒	7,100	5,680.00	40,328,000	
大日精化工業	3,500	2,201.00	7,703,500	
カネカ	10,900	3,755.00	40,929,500	
協和キリン	50,500	3,050.00	154,025,000	
三菱瓦斯化学	39,200	1,982.00	77,694,400	
三井化学	38,300	2,978.00	114,057,400	
ＪＳＲ	39,300	3,410.00	134,013,000	
東京応化工業	7,200	7,210.00	51,912,000	
大阪有機化学工業	3,600	2,985.00	10,746,000	
三菱ケミカルホールディングス	281,800	826.80	232,992,240	
ＫＨネオケム	7,000	2,792.00	19,544,000	
ダイセル	60,700	869.00	52,748,300	
住友ベークライト	6,600	4,880.00	32,208,000	
積水化学工業	88,200	1,950.00	171,990,000	
日本ゼオン	38,000	1,331.00	50,578,000	
アイカ工業	11,700	3,190.00	37,323,000	
宇部興産	19,900	2,177.00	43,322,300	
積水樹脂	6,400	1,922.00	12,300,800	
タキロンシーアイ	9,100	558.00	5,077,800	
旭有機材	2,400	2,044.00	4,905,600	
ニチバン	2,500	1,789.00	4,472,500	
リケンテクノス	10,300	464.00	4,779,200	
大倉工業	2,200	1,866.00	4,105,200	
積水化成品工業	6,200	452.00	2,802,400	
群栄化学工業	1,000	3,505.00	3,505,000	
ダイキョーニシカワ	8,900	574.00	5,108,600	
森六ホールディングス	2,300	1,856.00	4,268,800	
恵和	1,100	4,435.00	4,878,500	
日本化薬	33,200	1,127.00	37,416,400	
カーリットホールディングス	2,900	690.00	2,001,000	
ＣＬホールディングス	2,100	1,032.00	2,167,200	
プレステージ・インターナショナル	15,400	700.00	10,780,000	
プロトコーポレーション	4,500	1,229.00	5,530,500	
ハイマックス	2,700	1,219.00	3,291,300	
アミューズ	2,200	2,098.00	4,615,600	
野村総合研究所	81,600	3,785.00	308,856,000	
ドリームインキュベータ	1,900	2,532.00	4,810,800	
サイバネットシステム	4,200	627.00	2,633,400	
クイック	2,800	1,578.00	4,418,400	
ＴＡＣ	13,400	226.00	3,028,400	
ＣＥホールディングス	6,400	463.00	2,963,200	

電通グループ	42,400	4,805.00	203,732,000	
インテージホールディングス	5,300	1,759.00	9,322,700	
東邦システムサイエンス	2,900	924.00	2,679,600	
ぴあ	1,400	3,250.00	4,550,000	
イオンファンタジー	1,600	2,083.00	3,332,800	
ソースネクスト	18,200	155.00	2,821,000	
シーティーエス	4,600	808.00	3,716,800	
ネクシィーズグループ	4,300	572.00	2,459,600	
インフォコム	4,600	2,011.00	9,250,600	
メディカルシステムネットワーク	5,100	513.00	2,616,300	
日本精化	3,400	2,004.00	6,813,600	
扶桑化学工業	3,800	4,480.00	17,024,000	
トリケミカル研究所	4,300	2,776.00	11,936,800	
シンプレクス・ホールディングス	4,500	1,559.00	7,015,500	
ＨＥＲＯＺ	2,300	888.00	2,042,400	
ラクスル	4,600	3,060.00	14,076,000	
ＦＩＧ	8,500	281.00	2,388,500	
ＡＤＥＫＡ	19,400	2,599.00	50,420,600	
日油	14,400	5,030.00	72,432,000	
ミヨシ油脂	2,300	1,135.00	2,610,500	
新日本理化	11,600	238.00	2,760,800	
ハリマ化成グループ	3,600	818.00	2,944,800	
イーソル	4,900	482.00	2,361,800	
アルテリア・ネットワークス	5,300	1,312.00	6,953,600	
ウイングアーク１ｓｔ	2,400	1,212.00	2,908,800	
サーバーワークス	900	2,302.00	2,071,800	
トビラシステムズ	3,900	780.00	3,042,000	
Ｓａｎｓａｎ	15,000	982.00	14,730,000	
ギフティ	3,800	834.00	3,169,200	
花王	95,200	5,327.00	507,130,400	
第一工業製薬	1,600	2,706.00	4,329,600	
石原ケミカル	2,100	1,337.00	2,807,700	
日華化学	3,500	760.00	2,660,000	
三洋化成工業	2,500	5,080.00	12,700,000	
ベース	700	4,980.00	3,486,000	
ＪＭＤＣ	4,000	5,480.00	21,920,000	
武田薬品工業	338,300	3,494.00	1,182,020,200	
アステラス製薬	373,200	1,990.50	742,854,600	
大日本住友製薬	26,600	1,247.00	33,170,200	
塩野義製薬	54,100	7,585.00	410,348,500	
わかもと製薬	5,300	290.00	1,537,000	
日本新薬	11,300	7,570.00	85,541,000	
中外製薬	134,600	3,909.00	526,151,400	
科研製薬	6,800	4,140.00	28,152,000	
エーザイ	51,500	5,773.00	297,309,500	
理研ビタミン	4,500	1,780.00	8,010,000	
ロート製薬	22,100	3,755.00	82,985,500	
小野薬品工業	98,900	2,853.00	282,161,700	
久光製薬	11,400	3,645.00	41,553,000	
有機合成薬品工業	11,200	269.00	3,012,800	

持田製薬	5,400	3,885.00	20,979,000	
参天製薬	80,300	1,284.00	103,105,200	
扶桑薬品工業	1,500	2,315.00	3,472,500	
ツムラ	13,300	3,195.00	42,493,500	
日医工	13,400	836.00	11,202,400	
テルモ	121,800	3,636.00	442,864,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	10,700	3,040.00	32,528,000	
キッセイ薬品工業	7,600	2,407.00	18,293,200	
生化学工業	7,600	897.00	6,817,200	
栄研化学	7,600	1,739.00	13,216,400	
日水製薬	2,900	989.00	2,868,100	
鳥居薬品	2,300	2,959.00	6,805,700	
ＪＣＲファーマ	12,100	2,144.00	25,942,400	
東和薬品	6,200	3,005.00	18,631,000	
富士製薬工業	2,900	1,010.00	2,929,000	
ゼリア新薬工業	7,800	1,958.00	15,272,400	
第一三共	338,300	2,549.50	862,495,850	
キョーリン製薬ホールディングス	8,600	1,830.00	15,738,000	
大幸薬品	6,500	601.00	3,906,500	
ダイト	2,800	2,941.00	8,234,800	
大塚ホールディングス	89,500	4,030.00	360,685,000	
大正製薬ホールディングス	10,200	5,720.00	58,344,000	
ペプチドリーム	22,600	2,043.00	46,171,800	
大日本塗料	5,200	818.00	4,253,600	
日本ペイントホールディングス	158,400	1,060.00	167,904,000	
関西ペイント	43,700	2,399.00	104,836,300	
中国塗料	9,900	907.00	8,979,300	
日本特殊塗料	3,400	879.00	2,988,600	
藤倉化成	6,000	461.00	2,766,000	
太陽ホールディングス	6,200	3,020.00	18,724,000	
ＤＩＣ	17,800	2,657.00	47,294,600	
サカタインクス	8,400	935.00	7,854,000	
東洋インキＳＣホールディングス	8,900	1,890.00	16,821,000	
アルプス技研	3,600	1,955.00	7,038,000	
日本空調サービス	4,300	788.00	3,388,400	
オリエンタルランド	48,600	21,155.00	1,028,133,000	
フォーカスシステムズ	3,000	899.00	2,697,000	
ダスキン	9,500	2,774.00	26,353,000	
パーク２４	22,800	1,768.00	40,310,400	
明光ネットワークジャパン	5,300	569.00	3,015,700	
ファルコホールディングス	2,000	2,006.00	4,012,000	
クレスコ	3,100	1,774.00	5,499,400	
フジ・メディア・ホールディングス	40,700	1,255.00	51,078,500	
秀英予備校	7,200	428.00	3,081,600	
ラウンドワン	11,500	1,311.00	15,076,500	
リゾートトラスト	18,900	1,971.00	37,251,900	
オービック	13,300	17,660.00	234,878,000	
ジャストシステム	6,000	5,330.00	31,980,000	
ＴＤＣソフト	3,700	1,105.00	4,088,500	
Ｚホールディングス	614,000	557.80	342,489,200	

ビー・エム・エル	5,300	3,265.00	17,304,500	
トレンドマイクロ	22,600	5,890.00	133,114,000	
りらいあコミュニケーションズ	6,100	1,047.00	6,386,700	
ＩＤホールディングス	3,300	849.00	2,801,700	
リソー教育	18,800	390.00	7,332,000	
日本オラクル	8,600	8,130.00	69,918,000	
早稲田アカデミー	2,800	1,001.00	2,802,800	
アルファシステムズ	1,100	3,715.00	4,086,500	
フューチャー	8,900	1,328.00	11,819,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,500	1,297.00	3,242,500	
ＳＢテクノロジー	1,800	2,517.00	4,530,600	
トーセ	4,200	719.00	3,019,800	
ユー・エス・エス	46,100	1,959.00	90,309,900	
オービックビジネスコンサルタント	4,000	4,155.00	16,620,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	19,200	2,907.00	55,814,400	
アイティフォー	5,100	779.00	3,972,900	
東京個別指導学院	4,700	624.00	2,932,800	
東計電算	600	4,975.00	2,985,000	
サイバーエージェント	101,400	1,491.00	151,187,400	
楽天グループ	211,300	966.00	204,115,800	
クリーク・アンド・リバー社	2,200	1,672.00	3,678,400	
モーニングスター	7,200	578.00	4,161,600	
テー・オー・ダブリュー	9,400	297.00	2,791,800	
大塚商会	22,900	4,240.00	97,096,000	
サイボウズ	5,600	1,287.00	7,207,200	
山田コンサルティンググループ	2,600	1,154.00	3,000,400	
セントラルスポーツ	1,500	2,409.00	3,613,500	
電通国際情報サービス	6,100	3,715.00	22,661,500	
ＡＣＣＥＳＳ	4,800	581.00	2,788,800	
デジタルガレージ	7,000	3,905.00	27,335,000	
イーエムシステムズ	7,000	706.00	4,942,000	
ウェザーニューズ	1,300	7,600.00	9,880,000	
ＣＩＪ	3,400	808.00	2,747,200	
ビジネスエンジニアリング	800	3,590.00	2,872,000	
日本エンタープライズ	16,100	172.00	2,769,200	
WOWOW	2,000	1,748.00	3,496,000	
スカラ	4,400	670.00	2,948,000	
フルキャストホールディングス	3,500	2,273.00	7,955,500	
エン・ジャパン	6,600	2,914.00	19,232,400	
あすか製薬ホールディングス	4,900	1,068.00	5,233,200	
サワイグループホールディングス	9,400	4,425.00	41,595,000	
富士フイルムホールディングス	75,700	7,531.00	570,096,700	
コニカミノルタ	94,100	501.00	47,144,100	
資生堂	80,200	6,746.00	541,029,200	
ライオン	52,000	1,516.00	78,832,000	
高砂香料工業	3,000	2,711.00	8,133,000	
マンダム	9,000	1,392.00	12,528,000	
ミルボン	5,300	6,020.00	31,906,000	
ファンケル	17,400	3,255.00	56,637,000	
コーセー	8,100	13,360.00	108,216,000	

コタ	2,700	1,597.00	4,311,900	
シーボン	1,800	1,828.00	3,290,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	18,400	1,862.00	34,260,800	
ノエビアホールディングス	3,700	5,180.00	19,166,000	
アジュバンホールディングス	2,600	1,145.00	2,977,000	
エステー	2,800	1,561.00	4,370,800	
アグロ　カネショウ	2,300	1,186.00	2,727,800	
コニシ	7,100	1,557.00	11,054,700	
長谷川香料	7,400	2,345.00	17,353,000	
星光ＰＭＣ	4,200	602.00	2,528,400	
小林製薬	12,100	9,830.00	118,943,000	
荒川化学工業	3,600	1,127.00	4,057,200	
メック	3,200	2,859.00	9,148,800	
日本高純度化学	1,200	2,531.00	3,037,200	
タカラバイオ	11,300	2,425.00	27,402,500	
ＪＣＵ	4,800	4,595.00	22,056,000	
新田ゼラチン	5,000	652.00	3,260,000	
デクセリアルズ	11,200	2,960.00	33,152,000	
アース製薬	3,500	5,670.00	19,845,000	
北興化学工業	4,000	837.00	3,348,000	
大成ラミック	1,300	2,766.00	3,595,800	
クミアイ化学工業	16,000	793.00	12,688,000	
日本農薬	7,700	533.00	4,104,100	
ニチレキ	5,500	1,309.00	7,199,500	
ユシロ化学工業	2,700	1,048.00	2,829,600	
富士石油	11,800	268.00	3,162,400	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,600	1,142.00	2,969,200	
出光興産	47,800	3,015.00	144,117,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	647,600	454.30	294,204,680	
コスモエネルギーホールディングス	12,500	2,519.00	31,487,500	
テスホールディングス	2,500	1,253.00	3,132,500	
インフロニア・ホールディングス	57,600	1,060.00	61,056,000	
横浜ゴム	24,900	1,765.00	43,948,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	22,700	1,602.00	36,365,400	
ブリヂストン	124,000	5,134.00	636,616,000	
住友ゴム工業	38,700	1,174.00	45,433,800	
藤倉コンポジット	3,400	685.00	2,329,000	
オカモト	2,600	4,005.00	10,413,000	
アキレス	2,800	1,269.00	3,553,200	
フコク	1,600	974.00	1,558,400	
ニッタ	4,500	2,734.00	12,303,000	
住友理工	8,300	599.00	4,971,700	
三ツ星ベルト	5,200	2,111.00	10,977,200	
バンドー化学	6,900	852.00	5,878,800	
ＡＧＣ	39,500	5,600.00	221,200,000	
日本板硝子	20,700	509.00	10,536,300	
有沢製作所	6,300	993.00	6,255,900	
日本山村硝子	3,800	805.00	3,059,000	
日本電気硝子	17,300	2,824.00	48,855,200	
住友大阪セメント	8,000	3,545.00	28,360,000	

太平洋セメント	24,500	2,321.00	56,864,500	
日本ヒューム	4,300	700.00	3,010,000	
日本コンクリート工業	10,900	299.00	3,259,100	
三谷セキサン	2,000	6,260.00	12,520,000	
アジアパイルホールディングス	6,800	431.00	2,930,800	
東海カーボン	36,100	1,137.00	41,045,700	
日本カーボン	2,200	4,160.00	9,152,000	
東洋炭素	2,800	3,145.00	8,806,000	
ノリタケカンパニーリミテド	2,400	4,455.00	10,692,000	
ＴＯＴＯ	30,700	5,070.00	155,649,000	
日本碍子	46,600	1,857.00	86,536,200	
日本特殊陶業	32,700	2,122.00	69,389,400	
ＭＡＲＵＷＡ	1,500	14,290.00	21,435,000	
品川リフラクトリーズ	1,000	3,915.00	3,915,000	
黒崎播磨	700	4,375.00	3,062,500	
ヨータイ	2,700	1,262.00	3,407,400	
イソライト工業	2,400	1,266.00	3,038,400	
ニッカトー	4,300	572.00	2,459,600	
フジミインコーポレーテッド	3,500	6,490.00	22,715,000	
クニミネ工業	2,900	1,015.00	2,943,500	
ニチアス	10,000	2,623.00	26,230,000	
日本製鉄	190,500	2,074.00	395,097,000	
神戸製鋼所	79,500	614.00	48,813,000	
中山製鋼所	7,000	467.00	3,269,000	
合同製鐵	2,300	1,379.00	3,171,700	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	115,000	1,707.00	196,305,000	
東京製鐵	14,500	1,144.00	16,588,000	
共英製鋼	4,800	1,613.00	7,742,400	
大和工業	8,100	3,670.00	29,727,000	
東京鐵鋼	2,300	1,370.00	3,151,000	
淀川製鋼所	5,600	2,730.00	15,288,000	
丸一鋼管	15,100	2,969.00	44,831,900	
モリ工業	1,300	2,539.00	3,300,700	
大同特殊鋼	7,000	4,185.00	29,295,000	
日本高周波鋼業	9,200	344.00	3,164,800	
日本冶金工業	3,100	2,913.00	9,030,300	
山陽特殊製鋼	4,400	2,077.00	9,138,800	
愛知製鋼	2,400	2,630.00	6,312,000	
日立金属	45,900	2,074.00	95,196,600	
大平洋金属	2,600	3,355.00	8,723,000	
新日本電工	27,400	344.00	9,425,600	
栗本鐵工所	1,900	1,539.00	2,924,100	
日本製鋼所	12,900	3,675.00	47,407,500	
三菱製鋼	2,400	1,333.00	3,199,200	
日亜鋼業	11,100	279.00	3,096,900	
日本精線	700	4,415.00	3,090,500	
エンビプロ・ホールディングス	1,800	1,279.00	2,302,200	
大紀アルミニウム工業所	6,400	1,673.00	10,707,200	
日本軽金属ホールディングス	10,800	1,824.00	19,699,200	

三井金属鉱業	11,500	3,325.00	38,237,500	
東邦亜鉛	2,400	2,694.00	6,465,600	
三菱マテリアル	28,100	2,089.00	58,700,900	
住友金属鉱山	54,400	5,439.00	295,881,600	
ＤＯＷＡホールディングス	11,600	4,900.00	56,840,000	
古河機械金属	7,000	1,300.00	9,100,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,900	860.00	4,214,000	
東邦チタニウム	7,600	910.00	6,916,000	
ＵＡＣＪ	6,500	2,363.00	15,359,500	
ＣＫサンエツ	900	4,025.00	3,622,500	
古河電気工業	13,200	2,402.00	31,706,400	
住友電気工業	159,200	1,580.00	251,536,000	
フジクラ	47,500	655.00	31,112,500	
昭和電線ホールディングス	3,700	1,857.00	6,870,900	
東京特殊電線	1,000	2,851.00	2,851,000	
タツタ電線	7,500	451.00	3,382,500	
平河ヒューテック	2,500	1,172.00	2,930,000	
リョービ	5,200	1,111.00	5,777,200	
アーレスティ	5,500	379.00	2,084,500	
アサヒホールディングス	17,000	2,153.00	36,601,000	
東洋製罐グループホールディングス	27,100	1,588.00	43,034,800	
ホッカンホールディングス	2,300	1,398.00	3,215,400	
コロナ	3,300	901.00	2,973,300	
横河ブリッジホールディングス	7,400	2,062.00	15,258,800	
三和ホールディングス	40,100	1,281.00	51,368,100	
文化シヤッター	13,500	1,057.00	14,269,500	
三協立山	5,500	639.00	3,514,500	
アルインコ	3,100	912.00	2,827,200	
ＬＩＸＩＬ	67,100	2,600.00	174,460,000	
日本フイルコン	5,400	519.00	2,802,600	
ノーリツ	8,100	1,567.00	12,692,700	
長府製作所	4,300	1,982.00	8,522,600	
リンナイ	8,000	9,600.00	76,800,000	
ユニプレス	6,400	814.00	5,209,600	
ダイニチ工業	3,900	697.00	2,718,300	
日東精工	5,300	510.00	2,703,000	
三洋工業	1,700	1,844.00	3,134,800	
岡部	8,600	721.00	6,200,600	
ジーテクト	5,300	1,456.00	7,716,800	
東プレ	7,900	1,225.00	9,677,500	
高周波熱錬	7,600	597.00	4,537,200	
東京製綱	3,600	844.00	3,038,400	
サンコール	5,300	492.00	2,607,600	
モリテックスチール	8,400	311.00	2,612,400	
パイオラックス	6,100	1,767.00	10,778,700	
エイチワン	4,500	657.00	2,956,500	
日本発条	39,100	894.00	34,955,400	
三浦工業	18,400	3,155.00	58,052,000	
タクマ	14,400	1,446.00	20,822,400	
テクノプロ・ホールディングス	24,600	3,305.00	81,303,000	

インターワークス	7,500	372.00	2,790,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,900	3,680.00	6,992,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,600	2,182.00	5,673,200	
三機サービス	2,900	1,010.00	2,929,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	2,900	799.00	2,317,100	
イー・ガーディアン	1,700	2,535.00	4,309,500	
リブセンス	17,000	176.00	2,992,000	
ジャパンマテリアル	12,600	1,728.00	21,772,800	
ベクトル	5,800	1,098.00	6,368,400	
ウチヤマホールディングス	9,500	324.00	3,078,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,100	1,064.00	3,298,400	
キャリアリンク	2,300	1,418.00	3,261,400	
ＩＢＪ	3,400	793.00	2,696,200	
アサンテ	1,800	1,561.00	2,809,800	
バリューＨＲ	1,600	2,462.00	3,939,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	3,400	4,955.00	16,847,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,900	1,373.00	2,608,700	
アビスト	1,000	2,911.00	2,911,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,500	2,029.00	5,072,500	
ウィルグループ	3,000	1,206.00	3,618,000	
メドピア	3,200	2,835.00	9,072,000	
リクルートホールディングス	317,300	4,643.00	1,473,223,900	
エラン	5,700	939.00	5,352,300	
ツガミ	9,400	1,270.00	11,938,000	
オークマ	5,000	4,755.00	23,775,000	
芝浦機械	4,800	3,055.00	14,664,000	
アマダ	67,200	1,038.00	69,753,600	
アイダエンジニアリング	11,100	974.00	10,811,400	
滝澤鉄工所	2,600	1,204.00	3,130,400	
ＦＵＪＩ	19,600	2,323.00	45,530,800	
牧野フライス製作所	4,700	3,700.00	17,390,000	
オーエスジー	19,700	1,973.00	38,868,100	
ダイジェット工業	3,200	1,005.00	3,216,000	
旭ダイヤモンド工業	11,200	573.00	6,417,600	
DMG森精機	25,300	1,691.00	42,782,300	
ソディック	9,400	767.00	7,209,800	
ディスコ	6,300	33,950.00	213,885,000	
日東工器	2,300	1,604.00	3,689,200	
日進工具	3,300	1,416.00	4,672,800	
日本郵政	537,100	969.50	520,718,450	
ベルシステム２４ホールディングス	5,900	1,369.00	8,077,100	
鎌倉新書	4,900	492.00	2,410,800	
ＳＭＮ	4,600	594.00	2,732,400	
エアトリ	2,700	3,205.00	8,653,500	
アトラエ	2,900	1,975.00	5,727,500	
ストライク	1,600	4,345.00	6,952,000	
ソラスト	10,100	1,029.00	10,392,900	
インソース	4,000	1,914.00	7,656,000	

豊田自動織機	34,800	9,090.00	316,332,000	
豊和工業	3,800	824.00	3,131,200	
東洋機械金属	5,700	564.00	3,214,800	
エンシュウ	5,100	650.00	3,315,000	
島精機製作所	6,200	1,829.00	11,339,800	
オプトラン	5,300	1,905.00	10,096,500	
ＮＣホールディングス	500	1,855.00	927,500	
イワキ	2,700	1,022.00	2,759,400	
フリュー	3,800	1,013.00	3,849,400	
ヤマシンフィルタ	8,600	359.00	3,087,400	
日阪製作所	5,200	821.00	4,269,200	
やまびこ	8,300	1,313.00	10,897,900	
野村マイクロ・サイエンス	1,100	3,495.00	3,844,500	
平田機工	2,000	5,270.00	10,540,000	
ペガサスミシン製造	5,700	531.00	3,026,700	
マルマエ	1,700	2,396.00	4,073,200	
タツモ	2,000	1,575.00	3,150,000	
ナブテスコ	24,300	3,155.00	76,666,500	
三井海洋開発	4,500	1,176.00	5,292,000	
レオン自動機	4,600	1,014.00	4,664,400	
ＳＭＣ	12,600	67,490.00	850,374,000	
ホソカワミクロン	3,000	2,647.00	7,941,000	
ユニオンツール	1,600	3,590.00	5,744,000	
オイレス工業	6,000	1,556.00	9,336,000	
日精エー・エス・ビー機械	1,400	2,957.00	4,139,800	
サトーホールディングス	5,600	2,001.00	11,205,600	
技研製作所	3,800	3,675.00	13,965,000	
カワタ	3,000	1,009.00	3,027,000	
日精樹脂工業	3,000	1,002.00	3,006,000	
オカダアイヨン	1,900	1,423.00	2,703,700	
ワイエイシイホールディングス	2,900	1,069.00	3,100,100	
小松製作所	195,100	2,725.50	531,745,050	
住友重機械工業	24,600	2,747.00	67,576,200	
日立建機	17,300	2,921.00	50,533,300	
日工	5,800	623.00	3,613,400	
巴工業	1,700	2,310.00	3,927,000	
井関農機	4,000	1,218.00	4,872,000	
ＴＯＷＡ	3,700	2,314.00	8,561,800	
丸山製作所	1,900	1,509.00	2,867,100	
北川鉄工所	2,000	1,344.00	2,688,000	
シンニッタン	13,200	226.00	2,983,200	
ローツェ	2,100	10,410.00	21,861,000	
タカキタ	4,500	615.00	2,767,500	
クボタ	210,000	2,058.00	432,180,000	
荏原実業	2,000	2,157.00	4,314,000	
東洋エンジニアリング	5,700	566.00	3,226,200	
三菱化工機	1,400	2,008.00	2,811,200	
月島機械	7,900	1,042.00	8,231,800	
帝国電機製作所	3,000	1,397.00	4,191,000	
新東工業	9,500	700.00	6,650,000	

澁谷工業	3,800	2,438.00	9,264,400	
アイチコーポレーション	6,100	859.00	5,239,900	
小森コーポレーション	10,900	736.00	8,022,400	
鶴見製作所	3,300	1,785.00	5,890,500	
荏原製作所	17,900	5,650.00	101,135,000	
石井鐵工所	1,000	3,005.00	3,005,000	
酉島製作所	3,900	959.00	3,740,100	
北越工業	4,000	896.00	3,584,000	
ダイキン工業	54,800	21,450.00	1,175,460,000	
オルガノ	1,200	7,740.00	9,288,000	
トーヨーカネツ	1,600	2,403.00	3,844,800	
栗田工業	23,300	4,730.00	110,209,000	
椿本チエイン	5,600	3,285.00	18,396,000	
大同工業	3,000	925.00	2,775,000	
日機装	12,900	782.00	10,087,800	
木村化工機	3,600	819.00	2,948,400	
レイズネクスト	6,500	1,120.00	7,280,000	
アネスト岩田	6,700	816.00	5,467,200	
ダイフク	23,700	8,380.00	198,606,000	
サムコ	1,100	2,298.00	2,527,800	
加藤製作所	3,700	819.00	3,030,300	
タダノ	22,500	980.00	22,050,000	
フジテック	16,000	2,693.00	43,088,000	
ＣＫＤ	12,700	2,020.00	25,654,000	
キトー	3,700	1,676.00	6,201,200	
平和	12,000	1,945.00	23,340,000	
理想科学工業	3,600	2,171.00	7,815,600	
ＳＡＮＫＹＯ	9,300	3,225.00	29,992,500	
日本金銭機械	4,400	628.00	2,763,200	
マースグループホールディングス	2,700	1,635.00	4,414,500	
フクシマガリレイ	2,900	3,855.00	11,179,500	
ダイコク電機	2,500	1,243.00	3,107,500	
竹内製作所	6,500	2,602.00	16,913,000	
アマノ	11,300	2,255.00	25,481,500	
ＪＵＫＩ	6,000	676.00	4,056,000	
ジャノメ	4,300	719.00	3,091,700	
ブラザー工業	52,600	2,091.00	109,986,600	
マックス	5,700	1,711.00	9,752,700	
モリタホールディングス	6,900	1,247.00	8,604,300	
グローリー	11,100	2,087.00	23,165,700	
新晃工業	4,000	1,720.00	6,880,000	
大和冷機工業	6,200	1,127.00	6,987,400	
セガサミーホールディングス	42,700	2,145.00	91,591,500	
日本ピストンリング	2,300	1,370.00	3,151,000	
リケン	1,900	2,572.00	4,886,800	
ＴＰＲ	5,800	1,416.00	8,212,800	
ツバキ・ナカシマ	9,400	964.00	9,061,600	
ホシザキ	12,600	7,870.00	99,162,000	
大豊工業	3,700	718.00	2,656,600	
日本精工	81,000	738.00	59,778,000	

ＮＴＮ	92,500	226.00	20,905,000	
ジェイテクト	41,300	1,029.00	42,497,700	
不二越	3,700	4,190.00	15,503,000	
ミネベアミツミ	74,200	2,516.00	186,687,200	
日本トムソン	11,800	534.00	6,301,200	
ＴＨＫ	24,300	2,704.00	65,707,200	
ユーシン精機	4,000	684.00	2,736,000	
前澤給装工業	3,200	980.00	3,136,000	
イーグル工業	5,300	1,063.00	5,633,900	
日本ピラー工業	4,400	2,827.00	12,438,800	
キッツ	14,500	671.00	9,729,500	
日立製作所	207,000	6,009.00	1,243,863,000	
東芝	75,200	4,516.00	339,603,200	
三菱電機	430,500	1,425.00	613,462,500	
富士電機	25,900	6,060.00	156,954,000	
東洋電機製造	2,800	963.00	2,696,400	
安川電機	46,300	4,665.00	215,989,500	
シンフォニア　テクノロジー	5,200	1,280.00	6,656,000	
明電舎	7,300	2,367.00	17,279,100	
オリジン	2,400	1,233.00	2,959,200	
山洋電気	1,900	4,910.00	9,329,000	
デンヨー	3,700	1,715.00	6,345,500	
ＰＨＣホールディングス	4,900	1,551.00	7,599,900	
ベイカレント・コンサルティング	2,900	42,700.00	123,830,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	800	2,710.00	2,168,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,200	815.00	2,608,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,000	1,486.00	19,318,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	6,600	449.00	2,963,400	
ウェルビー	2,700	1,190.00	3,213,000	
ミダックホールディングス	1,800	2,323.00	4,181,400	
日総工産	3,400	848.00	2,883,200	
キュービーネットホールディングス	1,900	1,702.00	3,233,800	
ＲＰＡホールディングス	8,700	331.00	2,879,700	
三櫻工業	6,000	713.00	4,278,000	
マキタ	52,400	4,136.00	216,726,400	
東芝テック	4,600	4,910.00	22,586,000	
芝浦メカトロニクス	800	7,680.00	6,144,000	
マブチモーター	10,100	4,180.00	42,218,000	
日本電産	111,600	9,956.00	1,111,089,600	
トレックス・セミコンダクター	2,200	2,485.00	5,467,000	
東光高岳	2,400	1,435.00	3,444,000	
ダブル・スコープ	12,400	1,067.00	13,230,800	
ダイヘン	4,700	4,150.00	19,505,000	
ヤーマン	7,000	931.00	6,517,000	
ＪＶＣケンウッド	35,100	189.00	6,633,900	
ミマキエンジニアリング	3,900	726.00	2,831,400	
Ｉ－ＰＥＸ	2,000	1,466.00	2,932,000	
日新電機	10,100	1,414.00	14,281,400	

大崎電気工業	7,900	487.00	3,847,300	
オムロン	35,800	7,867.00	281,638,600	
日東工業	5,700	1,597.00	9,102,900	
ＩＤＥＣ	5,300	2,407.00	12,757,100	
不二電機工業	2,600	1,064.00	2,766,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	14,000	2,395.00	33,530,000	
サクサホールディングス	2,200	1,402.00	3,084,400	
メルコホールディングス	1,200	3,730.00	4,476,000	
日本電気	54,700	5,120.00	280,064,000	
富士通	38,700	16,150.00	625,005,000	
沖電気工業	17,500	887.00	15,522,500	
岩崎通信機	3,600	816.00	2,937,600	
電気興業	2,300	2,362.00	5,432,600	
サンケン電気	4,000	5,220.00	20,880,000	
アイホン	2,400	2,114.00	5,073,600	
ルネサスエレクトロニクス	233,400	1,392.00	324,892,800	
セイコーエプソン	53,400	1,838.00	98,149,200	
ワコム	33,400	850.00	28,390,000	
アルバック	7,900	5,800.00	45,820,000	
ＥＩＺＯ	3,300	3,665.00	12,094,500	
ジャパンディスプレイ	147,000	44.00	6,468,000	
日本信号	11,000	881.00	9,691,000	
京三製作所	9,200	422.00	3,882,400	
能美防災	5,700	2,021.00	11,519,700	
ホーチキ	3,100	1,213.00	3,760,300	
エレコム	9,900	1,548.00	15,325,200	
パナソニック	459,100	1,209.00	555,051,900	
シャープ	49,100	1,181.00	57,987,100	
アンリツ	27,700	1,624.00	44,984,800	
富士通ゼネラル	11,700	2,567.00	30,033,900	
ソニーグループ	269,700	11,890.00	3,206,733,000	
ＴＤＫ	62,400	4,760.00	297,024,000	
タムラ製作所	16,600	601.00	9,976,600	
アルプスアルパイン	38,100	1,209.00	46,062,900	
池上通信機	4,500	642.00	2,889,000	
日本電波工業	3,900	1,141.00	4,449,900	
メイコー	3,500	3,850.00	13,475,000	
日本トリム	900	2,700.00	2,430,000	
ローランド　ディー．ジー．	2,500	2,839.00	7,097,500	
フォスター電機	4,300	773.00	3,323,900	
ＳＭＫ	1,400	2,180.00	3,052,000	
ヨコオ	3,200	2,624.00	8,396,800	
ホシデン	10,400	1,206.00	12,542,400	
ヒロセ電機	6,600	16,980.00	112,068,000	
日本航空電子工業	9,900	1,847.00	18,285,300	
ＴＯＡ	4,600	767.00	3,528,200	
マクセル	8,600	1,212.00	10,423,200	
古野電気	5,100	1,052.00	5,365,200	
ユニデンホールディングス	900	3,435.00	3,091,500	
スミダコーポレーション	4,000	839.00	3,356,000	

アイコム	1,600	2,358.00	3,772,800	
リオン	1,600	2,079.00	3,326,400	
横河電機	43,100	1,815.00	78,226,500	
新電元工業	1,700	2,984.00	5,072,800	
アズビル	25,200	4,110.00	103,572,000	
東亜ディーケーケー	3,400	912.00	3,100,800	
日本光電工業	17,800	3,140.00	55,892,000	
共和電業	7,400	379.00	2,804,600	
日本電子材料	2,200	1,993.00	4,384,600	
堀場製作所	8,000	6,560.00	52,480,000	
アドバンテスト	32,000	9,380.00	300,160,000	
小野測器	6,100	483.00	2,946,300	
エスペック	3,500	2,035.00	7,122,500	
キーエンス	39,000	52,500.00	2,047,500,000	
日置電機	2,100	6,570.00	13,797,000	
シスメックス	36,400	8,330.00	303,212,000	
日本マイクロニクス	7,500	1,697.00	12,727,500	
メガチップス	4,000	3,805.00	15,220,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,000	3,140.00	6,280,000	
澤藤電機	1,900	1,534.00	2,914,600	
デンソー	94,800	8,431.00	799,258,800	
原田工業	3,000	991.00	2,973,000	
コーセル	5,300	819.00	4,340,700	
イリソ電子工業	3,600	4,100.00	14,760,000	
オプテックスグループ	7,100	1,606.00	11,402,600	
千代田インテグレ	1,800	1,917.00	3,450,600	
アイ・オー・データ機器	3,900	1,297.00	5,058,300	
レーザーテック	18,900	21,170.00	400,113,000	
スタンレー電気	30,100	2,841.00	85,514,100	
岩崎電気	1,600	2,281.00	3,649,600	
ウシオ電機	22,100	1,869.00	41,304,900	
岡谷電機産業	9,300	307.00	2,855,100	
日本セラミック	4,000	2,490.00	9,960,000	
遠藤照明	2,800	1,009.00	2,825,200	
古河電池	3,100	1,256.00	3,893,600	
山一電機	3,100	1,915.00	5,936,500	
図研	2,800	2,988.00	8,366,400	
日本電子	9,000	6,510.00	58,590,000	
カシオ計算機	31,200	1,296.00	40,435,200	
ファナック	37,800	21,525.00	813,645,000	
日本シイエムケイ	8,400	594.00	4,989,600	
エンプラス	1,100	2,619.00	2,880,900	
大真空	5,800	1,073.00	6,223,400	
ローム	19,300	9,210.00	177,753,000	
浜松ホトニクス	30,900	5,640.00	174,276,000	
三井ハイテック	4,200	8,160.00	34,272,000	
新光電気工業	12,600	4,755.00	59,913,000	
京セラ	60,600	6,854.00	415,352,400	
協栄産業	1,700	1,571.00	2,670,700	
太陽誘電	20,900	5,150.00	107,635,000	

村田製作所	126,500	7,938.00	1,004,157,000	
双葉電子工業	7,400	675.00	4,995,000	
日東電工	26,000	8,260.00	214,760,000	
北陸電気工業	100	1,296.00	129,600	
東海理化電機製作所	11,300	1,563.00	17,661,900	
ニチコン	13,600	1,226.00	16,673,600	
日本ケミコン	4,100	1,899.00	7,785,900	
ＫＯＡ	6,500	1,414.00	9,191,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	15,500	359.00	5,564,500	
日立造船	36,400	773.00	28,137,200	
三菱重工業	67,600	3,339.00	225,716,400	
川崎重工業	31,400	2,084.00	65,437,600	
ＩＨＩ	26,900	2,678.00	72,038,200	
マネジメントソリューションズ	2,000	3,075.00	6,150,000	
プロレド・パートナーズ	2,800	783.00	2,192,400	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	7,600	397.00	3,017,200	
カーブスホールディングス	11,300	699.00	7,898,700	
フォーラムエンジニアリング	3,700	854.00	3,159,800	
日本車輌製造	1,600	2,105.00	3,368,000	
三菱ロジスネクスト	5,700	937.00	5,340,900	
近畿車輌	3,000	1,066.00	3,198,000	
フルサト・マルカホールディングス	4,100	2,350.00	9,635,000	
ヤマエグループホールディングス	2,800	1,054.00	2,951,200	
ＦＰＧ	14,300	875.00	12,512,500	
島根銀行	5,500	555.00	3,052,500	
じもとホールディングス	4,700	682.00	3,205,400	
全国保証	10,100	4,830.00	48,783,000	
めぶきフィナンシャルグループ	220,600	281.00	61,988,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,300	1,147.00	3,785,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,300	2,074.00	10,992,200	
九州フィナンシャルグループ	86,700	414.00	35,893,800	
かんぽ生命保険	42,700	2,079.00	88,773,300	
ゆうちょ銀行	100,200	1,014.00	101,602,800	
富山第一銀行	10,200	320.00	3,264,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	242,500	490.00	118,825,000	
ジェイリース	1,500	1,740.00	2,610,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	27,700	843.00	23,351,100	
イントラスト	3,300	589.00	1,943,700	
アルヒ	6,300	1,022.00	6,438,600	
プレミアグループ	2,100	4,160.00	8,736,000	
日産自動車	507,700	598.10	303,655,370	
いすゞ自動車	135,100	1,638.00	221,293,800	
トヨタ自動車	2,180,500	2,173.00	4,738,226,500	
日野自動車	53,800	1,095.00	58,911,000	
三菱自動車工業	159,400	325.00	51,805,000	
エフテック	5,200	527.00	2,740,400	
武蔵精密工業	9,600	1,875.00	18,000,000	

日産車体	6,300	673.00	4,239,900	
新明和工業	12,200	935.00	11,407,000	
極東開発工業	8,000	1,476.00	11,808,000	
トピー工業	3,500	1,118.00	3,913,000	
ティラド	1,200	2,524.00	3,028,800	
曙ブレーキ工業	23,600	171.00	4,035,600	
タチエス	7,500	1,145.00	8,587,500	
ＮＯＫ	20,800	1,233.00	25,646,400	
フタバ産業	10,800	403.00	4,352,400	
ＫＹＢ	4,500	3,095.00	13,927,500	
市光工業	5,700	506.00	2,884,200	
大同メタル工業	8,300	636.00	5,278,800	
プレス工業	21,300	380.00	8,094,000	
ミクニ	9,500	407.00	3,866,500	
太平洋工業	9,000	1,016.00	9,144,000	
河西工業	10,400	288.00	2,995,200	
アイシン	31,500	4,375.00	137,812,500	
マツダ	135,100	931.00	125,778,100	
今仙電機製作所	5,100	592.00	3,019,200	
本田技研工業	338,900	3,662.00	1,241,051,800	
スズキ	98,500	4,864.00	479,104,000	
ＳＵＢＡＲＵ	123,400	1,975.50	243,776,700	
ヤマハ発動機	56,200	2,646.00	148,705,200	
小糸製作所	23,600	6,250.00	147,500,000	
エクセディ	6,500	1,721.00	11,186,500	
ミツバ	8,000	394.00	3,152,000	
豊田合成	13,900	2,257.00	31,372,300	
愛三工業	6,700	749.00	5,018,300	
ヨロズ	4,000	973.00	3,892,000	
エフ・シー・シー	7,000	1,459.00	10,213,000	
シマノ	17,300	26,620.00	460,526,000	
テイ・エス　テック	18,200	1,568.00	28,537,600	
三十三フィナンシャルグループ	3,900	1,522.00	5,935,800	
第四北越フィナンシャルグループ	6,900	2,703.00	18,650,700	
ひろぎんホールディングス	62,600	685.00	42,881,000	
おきなわフィナンシャルグループ	3,800	2,412.00	9,165,600	
ダイレクトマーケティングミックス	4,700	1,492.00	7,012,400	
ポピンズホールディングス	1,000	2,247.00	2,247,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	3,300	2,870.00	9,471,000	
十六フィナンシャルグループ	5,700	2,427.00	13,833,900	
北國フィナンシャルホールディングス	3,900	3,310.00	12,909,000	
ジャムコ	3,100	811.00	2,514,100	
小野建	4,100	1,622.00	6,650,200	
南陽	1,600	1,948.00	3,116,800	
ノジマ	6,900	2,550.00	17,595,000	
カッパ・クリエイト	5,900	1,376.00	8,118,400	
伯東	2,600	2,353.00	6,117,800	
コンドーテック	3,300	1,021.00	3,369,300	
中山福	8,700	405.00	3,523,500	
ライトオン	3,900	712.00	2,776,800	

ナガイレーベン	5,600	2,145.00	12,012,000	
三菱食品	4,100	3,150.00	12,915,000	
良品計画	48,800	1,764.00	86,083,200	
松田産業	3,100	2,274.00	7,049,400	
第一興商	8,000	3,610.00	28,880,000	
メディパルホールディングス	45,800	2,094.00	95,905,200	
アドヴァングループ	4,300	940.00	4,042,000	
ＳＰＫ	2,100	1,306.00	2,742,600	
萩原電気ホールディングス	1,600	2,087.00	3,339,200	
アルビス	1,400	2,215.00	3,101,000	
アズワン	6,100	6,660.00	40,626,000	
スズデン	1,600	2,168.00	3,468,800	
シモジマ	2,600	1,023.00	2,659,800	
ドウシシャ	4,000	1,547.00	6,188,000	
小津産業	1,500	2,005.00	3,007,500	
コナカ	9,000	353.00	3,177,000	
高速	2,500	1,521.00	3,802,500	
Ｇ－７ホールディングス	4,700	1,688.00	7,933,600	
イオン北海道	7,500	1,144.00	8,580,000	
コジマ	7,300	549.00	4,007,700	
ヒマラヤ	3,100	1,001.00	3,103,100	
コーナン商事	6,000	3,670.00	22,020,000	
ネットワンシステムズ	16,100	2,751.00	44,291,100	
エコス	1,600	1,954.00	3,126,400	
ワタミ	5,100	951.00	4,850,100	
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	84,800	1,876.00	159,084,800	
丸文	3,700	712.00	2,634,400	
西松屋チェーン	9,300	1,356.00	12,610,800	
ゼンショーホールディングス	20,700	2,709.00	56,076,300	
ハピネット	3,500	1,589.00	5,561,500	
幸楽苑ホールディングス	2,700	1,427.00	3,852,900	
橋本総業ホールディングス	1,500	2,008.00	3,012,000	
日本ライフライン	12,600	1,037.00	13,066,200	
サイゼリヤ	6,300	2,893.00	18,225,900	
ＶＴホールディングス	16,000	491.00	7,856,000	
アルゴグラフィックス	3,300	3,175.00	10,477,500	
ＩＤＯＭ	12,900	657.00	8,475,300	
日本エム・ディ・エム	2,500	1,564.00	3,910,000	
フジ・コーポレーション	2,600	1,177.00	3,060,200	
ユナイテッドアローズ	4,400	1,771.00	7,792,400	
進和	2,500	2,025.00	5,062,500	
ダイトロン	1,800	1,789.00	3,220,200	
ハイデイ日高	6,100	1,721.00	10,498,100	
シークス	6,100	1,130.00	6,893,000	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	14,800	201.00	2,974,800	
コロワイド	17,400	1,733.00	30,154,200	
ピーシーデポコーポレーション	9,700	282.00	2,735,400	
田中商事	4,700	643.00	3,022,100	

オーハシテクニカ	2,300	1,364.00	3,137,200	
壱番屋	3,000	4,615.00	13,845,000	
白銅	1,400	2,553.00	3,574,200	
スギホールディングス	8,500	6,410.00	54,485,000	
薬王堂ホールディングス	2,100	2,412.00	5,065,200	
島津製作所	55,400	4,020.00	222,708,000	
ＪＭＳ	5,000	609.00	3,045,000	
長野計器	3,100	1,281.00	3,971,100	
ブイ・テクノロジー	1,900	3,525.00	6,697,500	
スター精密	6,500	1,493.00	9,704,500	
東京計器	3,000	1,046.00	3,138,000	
愛知時計電機	1,800	1,892.00	3,405,600	
インターアクション	2,200	2,002.00	4,404,400	
オーバル	12,400	270.00	3,348,000	
東京精密	7,300	4,725.00	34,492,500	
マニー	17,100	1,579.00	27,000,900	
ニコン	65,700	1,250.00	82,125,000	
トプコン	20,300	1,490.00	30,247,000	
オリンパス	225,700	2,317.50	523,059,750	
理研計器	3,500	4,745.00	16,607,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	7,500	11,560.00	86,700,000	
キヤノン電子	3,900	1,612.00	6,286,800	
タムロン	3,300	2,310.00	7,623,000	
ＨＯＹＡ	84,000	14,975.00	1,257,900,000	
ノーリツ鋼機	3,900	1,790.00	6,981,000	
エー・アンド・デイ	3,900	912.00	3,556,800	
朝日インテック	47,200	2,289.00	108,040,800	
キヤノン	213,900	2,823.00	603,839,700	
リコー	119,500	1,048.00	125,236,000	
シチズン時計	50,400	506.00	25,502,400	
リズム	2,400	1,455.00	3,492,000	
メニコン	14,300	2,895.00	41,398,500	
スノーピーク	5,600	2,549.00	14,274,400	
パラマウントベッドホールディングス	8,300	1,990.00	16,517,000	
トランザクション	2,800	974.00	2,727,200	
粧美堂	200	418.00	83,600	
ニホンフラッシュ	3,700	1,028.00	3,803,600	
前田工繊	4,700	3,225.00	15,157,500	
永大産業	10,500	299.00	3,139,500	
アートネイチャー	4,100	725.00	2,972,500	
バンダイナムコホールディングス	38,600	7,790.00	300,694,000	
アイフィスジャパン	4,200	672.00	2,822,400	
共立印刷	21,500	163.00	3,504,500	
ＳＨＯＥＩ	4,000	4,590.00	18,360,000	
フランスベッドホールディングス	5,500	915.00	5,032,500	
マーベラス	6,700	734.00	4,917,800	
パイロットコーポレーション	7,300	4,645.00	33,908,500	
萩原工業	2,800	1,213.00	3,396,400	
エイベックス	7,300	1,364.00	9,957,200	
フジシールインターナショナル	10,500	1,743.00	18,301,500	

タカラトミー	18,000	1,267.00	22,806,000	
広済堂ホールディングス	3,800	870.00	3,306,000	
レック	5,600	943.00	5,280,800	
三光合成	7,700	353.00	2,718,100	
プロネクサス	3,300	1,081.00	3,567,300	
大建工業	2,500	2,231.00	5,577,500	
きもと	13,500	211.00	2,848,500	
凸版印刷	65,400	2,273.00	148,654,200	
大日本印刷	50,900	2,952.00	150,256,800	
共同印刷	1,200	2,834.00	3,400,800	
ＮＩＳＳＨＡ	8,800	1,356.00	11,932,800	
藤森工業	3,900	4,005.00	15,619,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	2,100	1,846.00	3,876,600	
前澤化成工業	2,700	1,271.00	3,431,700	
未来工業	1,900	1,520.00	2,888,000	
アシックス	38,100	2,252.00	85,801,200	
ツツミ	1,500	1,869.00	2,803,500	
ＪＳＰ	2,500	1,589.00	3,972,500	
ニチハ	6,000	2,585.00	15,510,000	
ローランド	3,000	4,080.00	12,240,000	
エフピコ	7,900	3,195.00	25,240,500	
小松ウオール工業	1,500	1,877.00	2,815,500	
ヤマハ	25,600	5,460.00	139,776,000	
河合楽器製作所	1,200	2,971.00	3,565,200	
ピジョン	26,000	2,311.00	60,086,000	
天馬	3,400	2,586.00	8,792,400	
キングジム	3,500	881.00	3,083,500	
象印マホービン	11,600	1,427.00	16,553,200	
リンテック	9,200	2,614.00	24,048,800	
信越ポリマー	7,700	1,087.00	8,369,900	
東リ	14,000	227.00	3,178,000	
イトーキ	7,900	359.00	2,836,100	
任天堂	24,300	58,770.00	1,428,111,000	
三菱鉛筆	7,100	1,250.00	8,875,000	
松風	1,800	1,784.00	3,211,200	
タカラスタンダード	8,900	1,346.00	11,979,400	
コクヨ	20,600	1,591.00	32,774,600	
ナカバヤシ	5,900	507.00	2,991,300	
ニフコ	14,400	3,495.00	50,328,000	
グローブライド	3,800	2,630.00	9,994,000	
オカムラ	14,800	1,173.00	17,360,400	
バルカー	3,500	2,545.00	8,907,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,800	2,043.00	3,677,400	
伊藤忠商事	296,500	3,834.00	1,136,781,000	
丸紅	418,200	1,236.50	517,104,300	
スクロール	6,500	935.00	6,077,500	
ヨンドシーホールディングス	3,900	1,725.00	6,727,500	
三陽商会	400	875.00	350,000	
長瀬産業	23,300	1,856.00	43,244,800	
蝶理	2,400	1,781.00	4,274,400	

豊田通商	42,600	5,040.00	214,704,000	
オンワードホールディングス	25,300	292.00	7,387,600	
三共生興	5,600	571.00	3,197,600	
兼松	15,800	1,407.00	22,230,600	
美津濃	4,300	2,272.00	9,769,600	
三井物産	329,300	3,075.00	1,012,597,500	
日本紙パルプ商事	2,200	4,160.00	9,152,000	
東京エレクトロン	27,300	55,140.00	1,505,322,000	
カメイ	5,000	1,042.00	5,210,000	
ＯＵＧホールディングス	1,100	2,721.00	2,993,100	
スターゼン	3,100	2,124.00	6,584,400	
セイコーホールディングス	6,100	2,344.00	14,298,400	
山善	17,800	1,020.00	18,156,000	
椿本興業	900	4,115.00	3,703,500	
住友商事	267,600	1,899.00	508,172,400	
日本ユニシス	13,200	3,035.00	40,062,000	
内田洋行	1,900	4,595.00	8,730,500	
三菱商事	317,700	4,061.00	1,290,179,700	
第一実業	1,900	4,310.00	8,189,000	
キヤノンマーケティングジャパン	10,500	2,466.00	25,893,000	
西華産業	2,200	1,603.00	3,526,600	
佐藤商事	3,500	1,225.00	4,287,500	
菱洋エレクトロ	2,500	2,136.00	5,340,000	
東京産業	3,900	698.00	2,722,200	
ユアサ商事	4,000	2,986.00	11,944,000	
神鋼商事	900	3,850.00	3,465,000	
阪和興業	8,500	3,275.00	27,837,500	
正栄食品工業	2,700	4,165.00	11,245,500	
カナデン	3,400	1,015.00	3,451,000	
菱電商事	3,400	1,761.00	5,987,400	
ニプロ	32,100	1,101.00	35,342,100	
岩谷産業	10,200	5,360.00	54,672,000	
ナイス	1,700	1,838.00	3,124,600	
極東貿易	1,200	2,244.00	2,692,800	
アステナホールディングス	6,200	416.00	2,579,200	
兼松エレクトロニクス	2,300	3,895.00	8,958,500	
三愛石油	10,400	933.00	9,703,200	
稲畑産業	9,300	2,490.00	23,157,000	
明和産業	3,900	1,114.00	4,344,600	
ゴールドウイン	7,600	5,990.00	45,524,000	
ユニ・チャーム	83,000	4,355.00	361,465,000	
デサント	8,200	2,880.00	23,616,000	
ワキタ	9,000	1,000.00	9,000,000	
ヤマトインターナショナル	10,300	292.00	3,007,600	
東邦ホールディングス	13,600	1,874.00	25,486,400	
サンゲツ	11,200	1,579.00	17,684,800	
ミツウロコグループホールディングス	6,200	1,043.00	6,466,600	
シナネンホールディングス	1,600	3,295.00	5,272,000	
伊藤忠エネクス	9,400	1,025.00	9,635,000	
サンリオ	13,100	2,427.00	31,793,700	

サンワ　テクノス	2,600	1,349.00	3,507,400	
リョーサン	4,700	2,317.00	10,889,900	
新光商事	6,400	917.00	5,868,800	
トーホー	2,500	1,061.00	2,652,500	
三信電気	2,000	1,695.00	3,390,000	
東陽テクニカ	4,200	1,071.00	4,498,200	
モスフードサービス	5,600	3,015.00	16,884,000	
加賀電子	3,800	3,145.00	11,951,000	
三益半導体工業	3,400	2,355.00	8,007,000	
都築電気	2,200	1,385.00	3,047,000	
ソーダニッカ	4,200	777.00	3,263,400	
立花エレテック	3,400	1,588.00	5,399,200	
木曽路	5,600	2,222.00	12,443,200	
ＳＲＳホールディングス	5,800	823.00	4,773,400	
千趣会	7,700	372.00	2,864,400	
リテールパートナーズ	5,100	1,176.00	5,997,600	
ケーヨー	7,800	879.00	6,856,200	
上新電機	4,900	2,088.00	10,231,200	
日本瓦斯	20,600	1,738.00	35,802,800	
ロイヤルホールディングス	7,300	1,951.00	14,242,300	
東天紅	3,100	951.00	2,948,100	
いなげや	5,300	1,394.00	7,388,200	
チヨダ	4,100	750.00	3,075,000	
ライフコーポレーション	4,000	2,958.00	11,832,000	
リンガーハット	5,200	2,222.00	11,554,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	5,300	604.00	3,201,200	
ＡＯＫＩホールディングス	8,200	610.00	5,002,000	
オークワ	6,700	958.00	6,418,600	
コメリ	6,500	2,776.00	18,044,000	
青山商事	8,800	738.00	6,494,400	
しまむら	4,900	10,080.00	49,392,000	
高島屋	30,900	1,161.00	35,874,900	
松屋	8,500	720.00	6,120,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	20,100	864.00	17,366,400	
近鉄百貨店	1,600	2,592.00	4,147,200	
丸井グループ	33,500	2,294.00	76,849,000	
クレディセゾン	27,300	1,357.00	37,046,100	
アクシアル　リテイリング	3,300	3,285.00	10,840,500	
イオン	163,100	2,614.00	426,343,400	
イズミ	7,700	3,200.00	24,640,000	
フォーバル	3,200	842.00	2,694,400	
平和堂	7,800	1,993.00	15,545,400	
フジ	5,100	2,099.00	10,704,900	
ヤオコー	4,800	6,570.00	31,536,000	
ゼビオホールディングス	5,800	948.00	5,498,400	
ケーズホールディングス	39,100	1,253.00	48,992,300	
ＰＡＬＴＡＣ	5,900	4,450.00	26,255,000	
三谷産業	9,400	315.00	2,961,000	
日産東京販売ホールディングス	13,100	235.00	3,078,500	
新生銀行	27,700	2,162.00	59,887,400	

あおぞら銀行	23,700	2,709.00	64,203,300	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	2,662,700	739.10	1,968,001,570	
りそなホールディングス	486,000	536.70	260,836,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	80,300	4,158.00	333,887,400	
三井住友フィナンシャルグループ	293,900	4,277.00	1,257,010,300	
千葉銀行	141,700	774.00	109,675,800	
群馬銀行	81,600	398.00	32,476,800	
武蔵野銀行	6,300	1,929.00	12,152,700	
千葉興業銀行	11,700	276.00	3,229,200	
七十七銀行	13,300	1,556.00	20,694,800	
青森銀行	3,300	1,930.00	6,369,000	
秋田銀行	2,700	1,736.00	4,687,200	
山形銀行	4,800	999.00	4,795,200	
岩手銀行	2,800	1,949.00	5,457,200	
東邦銀行	35,400	223.00	7,894,200	
みちのく銀行	3,700	895.00	3,311,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	35,800	2,383.00	85,311,400	
静岡銀行	103,400	900.00	93,060,000	
スルガ銀行	37,200	451.00	16,777,200	
八十二銀行	95,600	440.00	42,064,000	
山梨中央銀行	4,600	963.00	4,429,800	
大垣共立銀行	8,400	2,055.00	17,262,000	
福井銀行	3,600	1,476.00	5,313,600	
清水銀行	1,900	1,639.00	3,114,100	
富山銀行	1,700	2,274.00	3,865,800	
滋賀銀行	8,000	2,262.00	18,096,000	
南都銀行	6,600	2,129.00	14,051,400	
百五銀行	40,800	359.00	14,647,200	
京都銀行	15,200	5,580.00	84,816,000	
紀陽銀行	14,400	1,551.00	22,334,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	26,500	967.00	25,625,500	
山陰合同銀行	25,200	688.00	17,337,600	
中国銀行	33,900	909.00	30,815,100	
鳥取銀行	1,600	1,258.00	2,012,800	
伊予銀行	56,300	635.00	35,750,500	
百十四銀行	4,500	1,792.00	8,064,000	
四国銀行	6,500	810.00	5,265,000	
阿波銀行	6,500	2,315.00	15,047,500	
大分銀行	2,400	2,042.00	4,900,800	
宮崎銀行	2,700	2,246.00	6,064,200	
佐賀銀行	2,400	1,566.00	3,758,400	
琉球銀行	9,200	860.00	7,912,000	
セブン銀行	126,100	247.00	31,146,700	
みずほフィナンシャルグループ	543,000	1,592.00	864,456,000	
山口フィナンシャルグループ	49,500	736.00	36,432,000	
芙蓉総合リース	4,500	7,700.00	34,650,000	
みずほリース	6,500	3,220.00	20,930,000	
東京センチュリー	8,200	5,700.00	46,740,000	
ＳＢＩホールディングス	52,400	3,045.00	159,558,000	
日本証券金融	16,700	906.00	15,130,200	

アイフル	71,200	363.00	25,845,600	
長野銀行	2,500	1,270.00	3,175,000	
名古屋銀行	3,200	3,125.00	10,000,000	
北洋銀行	64,000	268.00	17,152,000	
愛知銀行	1,500	4,825.00	7,237,500	
中京銀行	1,800	1,635.00	2,943,000	
大光銀行	2,300	1,477.00	3,397,100	
愛媛銀行	5,900	981.00	5,787,900	
京葉銀行	18,100	520.00	9,412,000	
栃木銀行	20,500	233.00	4,776,500	
北日本銀行	1,900	1,742.00	3,309,800	
東和銀行	7,400	584.00	4,321,600	
リコーリース	3,800	3,795.00	14,421,000	
イオンフィナンシャルサービス	23,100	1,240.00	28,644,000	
アコム	83,800	323.00	27,067,400	
ジャックス	4,700	3,265.00	15,345,500	
オリエントコーポレーション	114,900	124.00	14,247,600	
オリックス	257,800	2,368.00	610,470,400	
三菱ＨＣキャピタル	156,800	614.00	96,275,200	
ジャフコ　グループ	16,200	1,708.00	27,669,600	
九州リースサービス	5,000	602.00	3,010,000	
トモニホールディングス	32,800	354.00	11,611,200	
大和証券グループ本社	318,000	691.40	219,865,200	
野村ホールディングス	648,200	538.30	348,926,060	
岡三証券グループ	33,400	391.00	13,059,400	
丸三証券	12,600	547.00	6,892,200	
東洋証券	15,700	155.00	2,433,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	48,800	420.00	20,496,000	
光世証券	6,100	476.00	2,903,600	
水戸証券	11,300	280.00	3,164,000	
いちよし証券	7,900	663.00	5,237,700	
松井証券	20,800	817.00	16,993,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	69,700	5,339.00	372,128,300	
日本取引所グループ	107,500	2,192.50	235,693,750	
マネックスグループ	34,600	512.00	17,715,200	
極東証券	5,700	772.00	4,400,400	
岩井コスモホールディングス	4,000	1,416.00	5,664,000	
アイザワ証券グループ	7,000	898.00	6,286,000	
フィデアホールディングス	3,900	1,412.00	5,506,800	
池田泉州ホールディングス	48,800	189.00	9,223,200	
アニコム　ホールディングス	13,000	770.00	10,010,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	95,200	3,982.00	379,086,400	
スパークス・グループ	19,600	261.00	5,115,600	
第一生命ホールディングス	209,000	2,638.50	551,446,500	
東京海上ホールディングス	139,800	7,033.00	983,213,400	
イー・ギャランティ	6,200	2,079.00	12,889,800	
アサックス	4,200	687.00	2,885,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	1,700	2,180.00	3,706,000	

Ｔ＆Ｄホールディングス	110,200	1,771.00	195,164,200	
アドバンスクリエイト	2,400	1,003.00	2,407,200	
三井不動産	193,600	2,592.50	501,908,000	
三菱地所	279,000	1,813.50	505,966,500	
平和不動産	7,300	3,985.00	29,090,500	
東京建物	41,900	1,816.00	76,090,400	
ダイビル	10,800	2,196.00	23,716,800	
京阪神ビルディング	6,600	1,506.00	9,939,600	
住友不動産	89,100	3,639.00	324,234,900	
テーオーシー	7,600	695.00	5,282,000	
東京楽天地	700	3,960.00	2,772,000	
レオパレス２１	44,000	215.00	9,460,000	
スターツコーポレーション	5,800	2,555.00	14,819,000	
フジ住宅	4,900	659.00	3,229,100	
空港施設	5,400	560.00	3,024,000	
ゴールドクレスト	3,300	1,857.00	6,128,100	
リログループ	22,500	1,712.00	38,520,000	
エスリード	1,800	1,774.00	3,193,200	
日神グループホールディングス	6,900	508.00	3,505,200	
日本エスコン	7,900	758.00	5,988,200	
タカラレーベン	17,800	320.00	5,696,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,400	837.00	2,845,800	
イオンモール	21,300	1,660.00	35,358,000	
ファースト住建	2,500	1,197.00	2,992,500	
カチタス	10,500	3,260.00	34,230,000	
東祥	3,100	1,708.00	5,294,800	
トーセイ	5,900	1,077.00	6,354,300	
穴吹興産	1,500	1,960.00	2,940,000	
サンフロンティア不動産	5,900	1,080.00	6,372,000	
ＦＪネクストホールディングス	4,200	997.00	4,187,400	
グランディハウス	6,100	572.00	3,489,200	
東武鉄道	42,100	2,923.00	123,058,300	
相鉄ホールディングス	13,800	2,237.00	30,870,600	
東急	108,600	1,583.00	171,913,800	
京浜急行電鉄	55,300	1,270.00	70,231,000	
小田急電鉄	64,000	2,127.00	136,128,000	
京王電鉄	22,300	5,280.00	117,744,000	
京成電鉄	30,000	3,400.00	102,000,000	
富士急行	5,100	4,070.00	20,757,000	
新京成電鉄	1,500	2,033.00	3,049,500	
東日本旅客鉄道	75,800	7,173.00	543,713,400	
西日本旅客鉄道	52,200	5,091.00	265,750,200	
東海旅客鉄道	35,800	15,930.00	570,294,000	
西武ホールディングス	56,200	1,233.00	69,294,600	
鴻池運輸	6,900	1,163.00	8,024,700	
西日本鉄道	11,900	2,656.00	31,606,400	
ハマキョウレックス	3,000	2,899.00	8,697,000	
サカイ引越センター	2,000	4,475.00	8,950,000	
近鉄グループホールディングス	40,800	3,580.00	146,064,000	
阪急阪神ホールディングス	51,000	3,510.00	179,010,000	

南海電気鉄道	18,200	2,384.00	43,388,800	
京阪ホールディングス	18,200	3,065.00	55,783,000	
神戸電鉄	1,000	3,410.00	3,410,000	
名古屋鉄道	33,500	2,130.00	71,355,000	
山陽電気鉄道	3,100	1,996.00	6,187,600	
アルプス物流	2,900	1,053.00	3,053,700	
トランコム	1,100	7,220.00	7,942,000	
ヤマトホールディングス	57,100	2,186.00	124,820,600	
山九	10,700	3,990.00	42,693,000	
日新	3,300	1,716.00	5,662,800	
丸全昭和運輸	3,300	3,190.00	10,527,000	
センコーグループホールディングス	20,400	940.00	19,176,000	
トナミホールディングス	1,000	3,810.00	3,810,000	
ニッコンホールディングス	13,700	2,179.00	29,852,300	
日本石油輸送	500	2,641.00	1,320,500	
福山通運	6,700	4,100.00	27,470,000	
セイノーホールディングス	27,800	1,217.00	33,832,600	
神奈川中央交通	1,000	3,570.00	3,570,000	
日立物流	7,900	5,950.00	47,005,000	
丸和運輸機関	8,600	1,051.00	9,038,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	4,100	1,246.00	5,108,600	
日本郵船	34,100	10,190.00	347,479,000	
商船三井	22,600	9,160.00	207,016,000	
川崎汽船	12,600	7,620.00	96,012,000	
ＮＳユナイテッド海運	2,200	4,145.00	9,119,000	
明治海運	4,900	919.00	4,503,100	
飯野海運	18,900	863.00	16,310,700	
九州旅客鉄道	31,500	2,576.00	81,144,000	
ＳＧホールディングス	77,000	2,517.00	193,809,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	14,100	7,330.00	103,353,000	
日本航空	93,500	2,365.00	221,127,500	
ＡＮＡホールディングス	103,600	2,612.50	270,655,000	
パスコ	700	1,310.00	917,000	
ＴＲＥホールディングス	5,600	1,529.00	8,562,400	
人・夢・技術グループ	1,600	1,889.00	3,022,400	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,000	2,815.00	2,815,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,900	3,730.00	7,087,000	
国際紙パルプ商事	9,300	363.00	3,375,900	
ナルミヤ・インターナショナル	3,100	1,023.00	3,171,300	
ブックオフグループホールディングス	2,900	1,030.00	2,987,000	
三菱倉庫	13,000	2,764.00	35,932,000	
三井倉庫ホールディングス	4,400	2,340.00	10,296,000	
住友倉庫	14,400	2,134.00	30,729,600	
澁澤倉庫	2,400	2,223.00	5,335,200	
ヤマタネ	2,000	1,625.00	3,250,000	
東陽倉庫	9,200	322.00	2,962,400	
乾汽船	2,800	2,616.00	7,324,800	
日本トランスシティ	9,000	617.00	5,553,000	

中央倉庫	3,000	980.00	2,940,000	
安田倉庫	3,300	981.00	3,237,300	
東洋埠頭	2,100	1,516.00	3,183,600	
上組	22,400	2,192.00	49,100,800	
近鉄エクスプレス	7,700	2,949.00	22,707,300	
東海運	9,700	308.00	2,987,600	
エーアイテイー	2,600	1,407.00	3,658,200	
内外トランスライン	1,600	1,885.00	3,016,000	
日本コンセプト	1,800	1,456.00	2,620,800	
ＴＢＳホールディングス	25,700	1,889.00	48,547,300	
日本テレビホールディングス	35,300	1,328.00	46,878,400	
朝日放送グループホールディングス	4,200	758.00	3,183,600	
テレビ朝日ホールディングス	10,200	1,567.00	15,983,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	35,800	444.00	15,895,200	
テレビ東京ホールディングス	3,000	2,120.00	6,360,000	
日本ＢＳ放送	2,600	1,065.00	2,769,000	
ビジョン	7,200	1,154.00	8,308,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,000	2,324.00	9,296,000	
コネクシオ	3,000	1,391.00	4,173,000	
日本通信	35,100	173.00	6,072,300	
日本電信電話	441,900	3,330.00	1,471,527,000	
ＫＤＤＩ	308,000	3,793.00	1,168,244,000	
ソフトバンク	639,800	1,472.00	941,785,600	
光通信	5,000	14,190.00	70,950,000	
エムティーアイ	4,800	474.00	2,275,200	
ＧＭＯインターネット	15,000	2,463.00	36,945,000	
ファイバーゲート	2,500	1,292.00	3,230,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	10,500	287.00	3,013,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	23,100	2,509.00	57,957,900	
学研ホールディングス	6,000	1,001.00	6,006,000	
ゼンリン	6,900	1,074.00	7,410,600	
インプレスホールディングス	13,500	202.00	2,727,000	
東京電力ホールディングス	322,200	367.00	118,247,400	
中部電力	131,700	1,136.00	149,611,200	
関西電力	163,100	1,160.00	189,196,000	
中国電力	67,300	905.00	60,906,500	
北陸電力	39,400	558.00	21,985,200	
東北電力	100,800	739.00	74,491,200	
四国電力	38,800	814.00	31,583,200	
九州電力	88,700	845.00	74,951,500	
北海道電力	37,400	506.00	18,924,400	
沖縄電力	9,100	1,417.00	12,894,700	
電源開発	36,700	1,852.00	67,968,400	
エフオン	2,600	536.00	1,393,600	
イーレックス	6,300	1,664.00	10,483,200	
レノバ	8,400	1,347.00	11,314,800	
東京瓦斯	82,500	2,323.00	191,647,500	
大阪瓦斯	78,000	2,111.00	164,658,000	

東邦瓦斯	19,800	2,992.00	59,241,600	
北海道瓦斯	2,100	1,511.00	3,173,100	
広島ガス	8,200	349.00	2,861,800	
西部ガスホールディングス	4,800	2,237.00	10,737,600	
静岡ガス	11,200	845.00	9,464,000	
メタウォーター	4,500	2,042.00	9,189,000	
アイネット	2,200	1,265.00	2,783,000	
松竹	2,800	11,680.00	32,704,000	
東宝	24,900	4,775.00	118,897,500	
エイチ・アイ・エス	9,100	2,034.00	18,509,400	
東映	1,400	17,120.00	23,968,000	
ラックランド	1,200	2,820.00	3,384,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	112,500	2,133.00	239,962,500	
共立メンテナンス	7,300	4,395.00	32,083,500	
イチネンホールディングス	4,200	1,301.00	5,464,200	
建設技術研究所	2,500	2,320.00	5,800,000	
スペース	3,200	945.00	3,024,000	
アインホールディングス	6,200	6,470.00	40,114,000	
ピー・シー・エー	2,500	1,420.00	3,550,000	
東京テアトル	2,400	1,237.00	2,968,800	
タナベ経営	4,400	642.00	2,824,800	
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	1,501.00	2,251,500	
ナガワ	1,300	9,680.00	12,584,000	
東京都競馬	3,100	4,050.00	12,555,000	
カナモト	7,200	2,308.00	16,617,600	
ＤＴＳ	8,100	2,726.00	22,080,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	19,700	5,540.00	109,138,000	
シーイーシー	4,500	1,090.00	4,905,000	
カプコン	39,800	2,819.00	112,196,200	
西尾レントオール	3,800	2,811.00	10,681,800	
アイ・エス・ビー	2,900	980.00	2,842,000	
日本空港ビルデング	16,200	5,550.00	89,910,000	
トランス・コスモス	5,200	3,155.00	16,406,000	
乃村工藝社	17,600	946.00	16,649,600	
ジャステック	2,900	1,047.00	3,036,300	
ＳＣＳＫ	29,200	1,913.00	55,859,600	
藤田観光	1,800	2,399.00	4,318,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	2,600	1,505.00	3,913,000	
日本管財	4,400	2,800.00	12,320,000	
トーカイ	3,600	1,870.00	6,732,000	
セコム	40,500	8,744.00	354,132,000	
日本システムウエア	1,600	2,088.00	3,340,800	
セントラル警備保障	2,000	2,360.00	4,720,000	
アイネス	3,800	1,526.00	5,798,800	
丹青社	8,400	727.00	6,106,800	
メイテック	5,000	6,950.00	34,750,000	
ＴＫＣ	7,100	3,040.00	21,584,000	
富士ソフト	4,500	5,530.00	24,885,000	
応用地質	4,600	2,066.00	9,503,600	

船井総研ホールディングス	8,400	2,182.00	18,328,800	
ＮＳＤ	13,600	2,137.00	29,063,200	
進学会ホールディングス	10,700	365.00	3,905,500	
丸紅建材リース	1,700	1,760.00	2,992,000	
コナミホールディングス	15,300	6,820.00	104,346,000	
学究社	1,900	1,644.00	3,123,600	
ベネッセホールディングス	13,700	2,358.00	32,304,600	
イオンディライト	5,100	3,040.00	15,504,000	
ナック	3,100	985.00	3,053,500	
福井コンピュータホールディングス	1,900	3,040.00	5,776,000	
ダイセキ	7,500	4,420.00	33,150,000	
ステップ	1,600	1,846.00	2,953,600	
日鉄物産	3,000	5,330.00	15,990,000	
泉州電業	1,200	6,260.00	7,512,000	
元気寿司	1,200	2,600.00	3,120,000	
トラスコ中山	8,800	2,533.00	22,290,400	
ヤマダホールディングス	155,000	406.00	62,930,000	
オートバックスセブン	14,300	1,429.00	20,434,700	
モリト	4,100	731.00	2,997,100	
アークランドサカモト	6,600	1,544.00	10,190,400	
ニトリホールディングス	16,800	16,525.00	277,620,000	
グルメ杵屋	3,400	1,044.00	3,549,600	
愛眼	17,000	185.00	3,145,000	
吉野家ホールディングス	14,800	2,395.00	35,446,000	
加藤産業	6,100	3,125.00	19,062,500	
イノテック	2,600	1,429.00	3,715,400	
イエローハット	7,400	1,628.00	12,047,200	
松屋フーズホールディングス	2,000	3,650.00	7,300,000	
ＪＢＣＣホールディングス	2,900	1,446.00	4,193,400	
ＪＫホールディングス	3,400	1,059.00	3,600,600	
サガミホールディングス	6,500	1,221.00	7,936,500	
日伝	3,500	2,235.00	7,822,500	
関西フードマーケット	3,200	1,108.00	3,545,600	
ミロク情報サービス	3,700	1,396.00	5,165,200	
北沢産業	12,500	231.00	2,887,500	
杉本商事	2,000	2,156.00	4,312,000	
因幡電機産業	11,300	2,621.00	29,617,300	
王将フードサービス	2,800	6,040.00	16,912,000	
プレナス	4,700	1,996.00	9,381,200	
ミニストップ	3,100	1,434.00	4,445,400	
アークス	8,100	2,192.00	17,755,200	
バローホールディングス	9,400	2,194.00	20,623,600	
東テク	1,400	2,435.00	3,409,000	
ミスミグループ本社	53,200	3,605.00	191,786,000	
ベルク	1,900	5,310.00	10,089,000	
タキヒヨー	1,900	1,275.00	2,422,500	
ファーストリテイリング	5,700	64,410.00	367,137,000	
ソフトバンクグループ	253,300	5,160.00	1,307,028,000	
蔵王産業	1,500	1,889.00	2,833,500	
スズケン	16,600	3,605.00	59,843,000	

サンドラッグ	15,900	3,200.00	50,880,000	
サックスバー　ホールディングス	5,700	511.00	2,912,700	
ジェコス	3,600	828.00	2,980,800	
ヤマザワ	1,800	1,660.00	2,988,000	
やまや	1,200	2,564.00	3,076,800	
ベルーナ	9,100	727.00	6,615,700	
合計	47,173,100		112,497,641,670	

（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）

	2022年2月21日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,141,742
コール・ローン	561,990,969
国債証券	61,405,113,290
地方債証券	4,685,070,490
特殊債券	6,056,314,832
社債券	5,076,314,700
未収利息	202,277,079
前払費用	3,358,299
流動資産合計	77,993,581,401
資産合計	77,993,581,401
負債の部	
流動負債	
未払解約金	12,396,819
その他未払費用	712
流動負債合計	12,397,531
負債合計	12,397,531
純資産の部	
元本等	
元本	80,494,945,652
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△2,513,761,782
元本等合計	77,981,183,870
純資産合計	77,981,183,870
負債純資産合計	77,993,581,401

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年2月23日 至　2022年2月21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		2022年2月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	82,138,960,938円
	同期中追加設定元本額	13,199,460,212円
	同期中一部解約元本額	14,843,475,498円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイ国内債券パッシブＤＢ（適格機関投資家限定）	65,561,525,380円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	3,402,449,343円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	109,268,705円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	5,565,351,314円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	219,660,795円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	1,160,818,295円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	2,035,474,158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）	219,175,430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）	23,937,060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）	68,750,509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）	59,895,313円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	52,766,641円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	72,166,453円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	271,146,711円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	1,671,436,209円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	1,075,363円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	47,973円
	計	80,494,945,652円
２．	受益権の総数	80,494,945,652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2,513,761,782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　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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	2022年2月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2022年2月21日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,182,861,230
地方債証券	△63,659,016
特殊債券	△75,231,349
社債券	△43,716,400
合計	△1,365,467,995

（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2022年2月21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）

	2022年2月21日現在
1口当たり純資産額	0.9688円
（1万口当たり純資産額）	(9,688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

2022年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第４２２回　利付国債（２年）	77,000,000	77,133,210	
	第４２３回　利付国債（２年）	510,000,000	510,392,700	
	第４２４回　利付国債（２年）	150,000,000	150,124,500	
	第４２５回　利付国債（２年）	272,000,000	272,223,040	
	第４２６回　利付国債（２年）	513,000,000	513,415,530	
	第４２７回　利付国債（２年）	516,000,000	516,407,640	
	第４２８回　利付国債（２年）	599,000,000	599,455,240	
	第４２９回　利付国債（２年）	600,000,000	600,480,000	
	第４３０回　利付国債（２年）	633,000,000	633,481,080	
	第４３１回　利付国債（２年）	632,000,000	632,442,400	
	第４３２回　利付国債（２年）	300,000,000	300,195,000	
	第１３５回　利付国債（５年）	104,000,000	104,183,040	
	第１３７回　利付国債（５年）	37,000,000	37,087,320	
	第１３８回　利付国債（５年）	81,000,000	81,199,260	
	第１３９回　利付国債（５年）	70,000,000	70,181,300	
	第１４０回　利付国債（５年）	259,000,000	259,691,530	
	第１４１回　利付国債（５年）	463,000,000	464,250,100	
	第１４２回　利付国債（５年）	165,000,000	165,465,300	
	第１４３回　利付国債（５年）	50,000,000	50,145,500	
	第１４４回　利付国債（５年）	512,000,000	513,525,760	
	第１４５回　利付国債（５年）	80,000,000	80,242,400	
	第１４６回　利付国債（５年）	80,000,000	80,244,000	
	第１５０回　利付国債（５年）	200,000,000	199,662,000	
	第１回　利付国債（４０年）	90,000,000	123,324,300	
	第２回　利付国債（４０年）	113,000,000	149,701,270	
	第３回　利付国債（４０年）	113,000,000	150,297,910	
	第４回　利付国債（４０年）	157,000,000	210,579,390	
	第５回　利付国債（４０年）	159,000,000	206,248,440	
	第６回　利付国債（４０年）	164,000,000	209,413,240	
	第７回　利付国債（４０年）	177,000,000	217,379,010	
	第８回　利付国債（４０年）	167,000,000	191,699,300	
	第９回　利付国債（４０年）	333,000,000	285,487,560	
	第１０回　利付国債（４０年）	291,000,000	292,166,910	
	第１１回　利付国債（４０年）	249,000,000	242,217,240	
	第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	92,794,520	
	第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	148,195,800	
	第１４回　利付国債（４０年）	136,000,000	126,854,000	
	第３２８回　利付国債（１０年）	345,000,000	347,456,400	
	第３２９回　利付国債（１０年）	184,000,000	186,093,920	

第３３０回　利付国債（１０年）	3,000,000	3,039,960	
第３３２回　利付国債（１０年）	138,000,000	139,587,000	
第３３３回　利付国債（１０年）	92,000,000	93,181,280	
第３３４回　利付国債（１０年）	496,000,000	503,087,840	
第３３５回　利付国債（１０年）	385,000,000	390,005,000	
第３３６回　利付国債（１０年）	185,000,000	187,612,200	
第３３７回　利付国債（１０年）	310,000,000	312,625,700	
第３３８回　利付国債（１０年）	585,000,000	592,090,200	
第３３９回　利付国債（１０年）	536,000,000	542,941,200	
第３４０回　利付国債（１０年）	566,000,000	573,782,500	
第３４１回　利付国債（１０年）	552,000,000	557,906,400	
第３４２回　利付国債（１０年）	510,000,000	511,657,500	
第３４３回　利付国債（１０年）	461,000,000	462,489,030	
第３４４回　利付国債（１０年）	533,000,000	534,577,680	
第３４５回　利付国債（１０年）	532,000,000	533,665,160	
第３４６回　利付国債（１０年）	523,000,000	524,453,940	
第３４７回　利付国債（１０年）	433,000,000	434,147,450	
第３４８回　利付国債（１０年）	499,000,000	500,382,230	
第３４９回　利付国債（１０年）	570,000,000	571,487,700	
第３５０回　利付国債（１０年）	744,000,000	745,793,040	
第３５１回　利付国債（１０年）	570,000,000	571,254,000	
第３５２回　利付国債（１０年）	556,000,000	557,089,760	
第３５３回　利付国債（１０年）	543,000,000	543,917,670	
第３５４回　利付国債（１０年）	518,000,000	518,725,200	
第３５５回　利付国債（１０年）	422,000,000	422,151,920	

第３５６回　利付国債（１０年）	418,000,000	418,000,000	
第３５７回　利付国債（１０年）	429,000,000	428,665,380	
第３５８回　利付国債（１０年）	525,000,000	524,160,000	
第３５９回　利付国債（１０年）	337,000,000	336,164,240	
第３６０回　利付国債（１０年）	297,000,000	295,993,170	
第３６１回　利付国債（１０年）	637,000,000	633,948,770	
第３６２回　利付国債（１０年）	354,000,000	351,783,960	
第３６３回　利付国債（１０年）	643,000,000	638,280,380	
第３６４回　利付国債（１０年）	608,000,000	602,570,560	
第１回　利付国債（３０年）	10,000,000	12,029,900	
第２回　利付国債（３０年）	82,000,000	96,919,080	
第３回　利付国債（３０年）	123,000,000	144,932,130	
第４回　利付国債（３０年）	79,000,000	97,873,100	
第５回　利付国債（３０年）	104,000,000	123,313,840	
第６回　利付国債（３０年）	78,000,000	94,578,900	
第７回　利付国債（３０年）	39,000,000	47,169,330	
第８回　利付国債（３０年）	21,000,000	24,432,450	
第９回　利付国債（３０年）	12,000,000	13,454,400	
第１０回　利付国債（３０年）	21,000,000	22,885,800	
第１１回　利付国債（３０年）	30,000,000	34,713,300	
第１２回　利付国債（３０年）	58,000,000	69,874,340	
第１３回　利付国債（３０年）	62,000,000	74,163,160	
第１４回　利付国債（３０年）	59,000,000	73,518,720	
第１５回　利付国債（３０年）	76,000,000	95,869,440	
第１６回　利付国債（３０年）	53,000,000	67,007,900	
第１７回　利付国債（３０年）	75,000,000	94,159,500	
第１８回　利付国債（３０年）	89,000,000	110,900,230	
第１９回　利付国債（３０年）	67,000,000	83,684,340	
第２０回　利付国債（３０年）	76,000,000	97,112,800	
第２１回　利付国債（３０年）	76,000,000	95,291,080	
第２２回　利付国債（３０年）	79,000,000	101,369,640	
第２３回　利付国債（３０年）	85,000,000	109,329,550	
第２４回　利付国債（３０年）	70,000,000	90,183,100	
第２５回　利付国債（３０年）	78,000,000	98,464,080	
第２６回　利付国債（３０年）	154,000,000	197,078,420	
第２７回　利付国債（３０年）	148,000,000	192,299,360	
第２８回　利付国債（３０年）	196,000,000	255,452,680	
第２９回　利付国債（３０年）	208,000,000	268,902,400	
第３０回　利付国債（３０年）	221,000,000	283,123,100	
第３１回　利付国債（３０年）	215,000,000	272,725,350	
第３２回　利付国債（３０年）	268,000,000	345,374,280	

第３３回　利付国債（３０年）	299,000,000	370,816,810	
第３４回　利付国債（３０年）	276,000,000	353,081,280	
第３５回　利付国債（３０年）	304,000,000	378,887,360	
第３６回　利付国債（３０年）	287,000,000	358,655,290	
第３７回　利付国債（３０年）	311,000,000	383,637,160	
第３８回　利付国債（３０年）	207,000,000	251,817,570	
第３９回　利付国債（３０年）	192,000,000	237,613,440	
第４０回　利付国債（３０年）	165,000,000	201,093,750	
第４１回　利付国債（３０年）	162,000,000	194,325,480	
第４２回　利付国債（３０年）	151,000,000	181,252,850	
第４３回　利付国債（３０年）	143,000,000	171,768,740	
第４４回　利付国債（３０年）	147,000,000	176,689,590	
第４５回　利付国債（３０年）	163,000,000	189,220,180	
第４６回　利付国債（３０年）	229,000,000	265,917,090	
第４７回　利付国債（３０年）	209,000,000	247,209,380	
第４８回　利付国債（３０年）	219,000,000	249,515,460	
第４９回　利付国債（３０年）	216,000,000	246,119,040	
第５０回　利付国債（３０年）	219,000,000	220,557,090	
第５１回　利付国債（３０年）	220,000,000	196,801,000	
第５２回　利付国債（３０年）	228,000,000	213,731,760	
第５３回　利付国債（３０年）	204,000,000	195,548,280	
第５４回　利付国債（３０年）	216,000,000	216,451,440	
第５５回　利付国債（３０年）	204,000,000	204,214,200	
第５６回　利付国債（３０年）	209,000,000	208,776,370	
第５７回　利付国債（３０年）	213,000,000	212,544,180	
第５８回　利付国債（３０年）	261,000,000	259,877,700	
第５９回　利付国債（３０年）	203,000,000	197,084,580	
第６０回　利付国債（３０年）	184,000,000	187,006,560	
第６１回　利付国債（３０年）	186,000,000	179,707,620	
第６２回　利付国債（３０年）	179,000,000	163,770,680	
第６３回　利付国債（３０年）	193,000,000	171,272,060	
第６４回　利付国債（３０年）	196,000,000	173,581,520	
第６５回　利付国債（３０年）	171,000,000	151,133,220	
第６６回　利付国債（３０年）	175,000,000	154,525,000	
第６７回　利付国債（３０年）	222,000,000	206,968,380	
第６８回　利付国債（３０年）	226,000,000	210,589,060	
第６９回　利付国債（３０年）	223,000,000	213,279,430	
第７０回　利付国債（３０年）	215,000,000	205,563,650	
第７１回　利付国債（３０年）	218,000,000	208,366,580	
第７２回　利付国債（３０年）	207,000,000	197,790,570	
第６１回　利付国債（２０年）	112,000,000	113,277,920	
第６２回　利付国債（２０年）	175,000,000	176,981,000	
第７０回　利付国債（２０年）	259,000,000	273,504,000	
第７１回　利付国債（２０年）	76,000,000	79,902,600	
第７２回　利付国債（２０年）	190,000,000	200,299,900	
第７３回　利付国債（２０年）	122,000,000	128,873,480	
第７４回　利付国債（２０年）	77,000,000	81,555,320	
第７５回　利付国債（２０年）	88,000,000	93,646,080	
第７６回　利付国債（２０年）	115,000,000	121,672,300	
第７７回　利付国債（２０年）	86,000,000	91,253,740	

第７８回　利付国債（２０年）	93,000,000	98,805,990	
第７９回　利付国債（２０年）	78,000,000	83,128,500	
第８０回　利付国債（２０年）	92,000,000	98,354,440	
第８１回　利付国債（２０年）	101,000,000	108,144,740	
第８２回　利付国債（２０年）	132,000,000	141,808,920	
第８３回　利付国債（２０年）	111,000,000	119,800,080	
第８４回　利付国債（２０年）	202,000,000	217,242,920	
第８５回　利付国債（２０年）	136,000,000	147,506,960	
第８６回　利付国債（２０年）	145,000,000	158,447,300	
第８７回　利付国債（２０年）	122,000,000	132,818,960	
第８８回　利付国債（２０年）	249,000,000	273,461,760	
第８９回　利付国債（２０年）	189,000,000	206,750,880	
第９０回　利付国債（２０年）	260,000,000	285,711,400	
第９１回　利付国債（２０年）	185,000,000	204,140,100	
第９２回　利付国債（２０年）	336,000,000	369,327,840	
第９３回　利付国債（２０年）	219,000,000	240,661,290	
第９４回　利付国債（２０年）	267,000,000	294,759,990	
第９５回　利付国債（２０年）	229,000,000	256,354,050	
第９６回　利付国債（２０年）	134,000,000	148,583,220	
第９７回　利付国債（２０年）	196,000,000	219,427,880	
第９８回　利付国債（２０年）	166,000,000	184,919,020	
第９９回　利付国債（２０年）	303,000,000	338,975,190	
第１００回　利付国債（２０年）	202,000,000	228,217,580	
第１０１回　利付国債（２０年）	125,000,000	142,736,250	
第１０２回　利付国債（２０年）	182,000,000	208,826,800	
第１０３回　利付国債（２０年）	131,000,000	149,484,100	
第１０４回　利付国債（２０年）	104,000,000	117,364,000	
第１０５回　利付国債（２０年）	88,000,000	99,724,240	
第１０６回　利付国債（２０年）	64,000,000	72,945,920	
第１０７回　利付国債（２０年）	85,000,000	96,719,800	
第１０８回　利付国債（２０年）	99,000,000	111,304,710	
第１０９回　利付国債（２０年）	79,000,000	89,140,440	
第１１０回　利付国債（２０年）	191,000,000	218,204,130	
第１１１回　利付国債（２０年）	137,000,000	158,029,500	
第１１２回　利付国債（２０年）	197,000,000	225,807,310	
第１１３回　利付国債（２０年）	333,000,000	383,216,400	

第１１４回　利付国債（２０年）	200,000,000	231,054,000	
第１１５回　利付国債（２０年）	138,000,000	160,499,520	
第１１６回　利付国債（２０年）	160,000,000	186,752,000	
第１１７回　利付国債（２０年）	238,000,000	275,889,600	
第１１８回　利付国債（２０年）	155,000,000	179,014,150	
第１１９回　利付国債（２０年）	140,000,000	159,381,600	
第１２０回　利付国債（２０年）	145,000,000	162,684,200	
第１２１回　利付国債（２０年）	221,000,000	254,174,310	
第１２２回　利付国債（２０年）	160,000,000	182,659,200	
第１２３回　利付国債（２０年）	257,000,000	300,777,380	
第１２４回　利付国債（２０年）	170,000,000	197,475,400	
第１２５回　利付国債（２０年）	193,000,000	228,305,490	
第１２６回　利付国債（２０年）	179,000,000	208,542,160	
第１２７回　利付国債（２０年）	189,000,000	218,501,010	
第１２８回　利付国債（２０年）	253,000,000	293,302,900	
第１２９回　利付国債（２０年）	169,000,000	194,370,280	
第１３０回　利付国債（２０年）	250,000,000	288,122,500	
第１３１回　利付国債（２０年）	164,000,000	187,463,480	
第１３２回　利付国債（２０年）	131,000,000	150,077,530	
第１３３回　利付国債（２０年）	156,000,000	180,222,120	
第１３４回　利付国債（２０年）	164,000,000	189,810,320	
第１３５回　利付国債（２０年）	114,000,000	130,816,140	
第１３６回　利付国債（２０年）	118,000,000	134,242,700	
第１３７回　利付国債（２０年）	35,000,000	40,228,650	
第１３８回　利付国債（２０年）	39,000,000	44,038,800	

第１３９回　利付国債（２０年）	42,000,000	47,850,180	
第１４０回　利付国債（２０年）	104,000,000	119,721,680	
第１４１回　利付国債（２０年）	163,000,000	188,007,460	
第１４２回　利付国債（２０年）	95,000,000	110,577,150	
第１４３回　利付国債（２０年）	160,000,000	183,072,000	
第１４４回　利付国債（２０年）	98,000,000	111,077,120	
第１４５回　利付国債（２０年）	255,000,000	295,063,050	
第１４６回　利付国債（２０年）	243,000,000	281,685,600	
第１４７回　利付国債（２０年）	266,000,000	305,836,160	
第１４８回　利付国債（２０年）	235,000,000	267,693,200	
第１４９回　利付国債（２０年）	254,000,000	289,704,780	
第１５０回　利付国債（２０年）	274,000,000	309,398,060	
第１５１回　利付国債（２０年）	267,000,000	295,035,000	
第１５２回　利付国債（２０年）	299,000,000	330,559,450	
第１５３回　利付国債（２０年）	307,000,000	343,468,530	
第１５４回　利付国債（２０年）	290,000,000	320,696,500	
第１５５回　利付国債（２０年）	291,000,000	314,076,300	
第１５６回　利付国債（２０年）	241,000,000	240,199,880	
第１５７回　利付国債（２０年）	247,000,000	238,851,470	
第１５８回　利付国債（２０年）	268,000,000	269,830,440	
第１５９回　利付国債（２０年）	245,000,000	249,757,900	
第１６０回　利付国債（２０年）	208,000,000	214,732,960	
第１６１回　利付国債（２０年）	222,000,000	225,640,800	
第１６２回　利付国債（２０年）	212,000,000	215,063,400	
第１６３回　利付国債（２０年）	275,000,000	278,621,750	

	第１６４回　利付国債（２０年）	334,000,000	332,513,700	
	第１６５回　利付国債（２０年）	274,000,000	272,353,260	
	第１６６回　利付国債（２０年）	265,000,000	271,243,400	
	第１６７回　利付国債（２０年）	281,000,000	278,192,810	
	第１６８回　利付国債（２０年）	245,000,000	238,149,800	
	第１６９回　利付国債（２０年）	273,000,000	260,351,910	
	第１７０回　利付国債（２０年）	245,000,000	233,127,300	
	第１７１回　利付国債（２０年）	257,000,000	243,993,230	
	第１７２回　利付国債（２０年）	243,000,000	234,310,320	
	第１７３回　利付国債（２０年）	309,000,000	297,322,890	
	第１７４回　利付国債（２０年）	308,000,000	295,726,200	
	第１７５回　利付国債（２０年）	287,000,000	280,246,890	
	第１７６回　利付国債（２０年）	292,000,000	284,565,680	
	第１７７回　利付国債（２０年）	276,000,000	263,475,120	
	第１７８回　利付国債（２０年）	273,000,000	265,197,660	
	第１７９回　利付国債（２０年）	97,000,000	94,195,730	
国債証券　合計		58,051,000,000	61,405,113,290	
地方債証券	第７３０回　東京都公募公債	300,000,000	303,439,500	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	101,638,800	
	平成２７年度第１回　北海道公募公債	300,000,000	302,775,900	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	109,014,400	
	第３７８回　大阪府公募公債（１０年）	144,000,000	145,521,936	
	第４４８回　大阪府公募公債（１０年）	38,000,000	37,291,756	
	第４５５回　大阪府公募公債（１０年）	180,000,000	177,868,080	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	112,092,300	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債（２０年）	100,000,000	101,009,900	

	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	113,022,200	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債	100,000,000	105,550,500	
	平成２５年度第４回　埼玉県公募公債	100,000,000	101,207,900	
	平成２５年度第１０回　埼玉県公募公債	119,000,000	120,347,318	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債	100,000,000	113,303,700	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債	100,000,000	113,689,500	
	第１０回　群馬県公募公債	300,000,000	303,021,000	
	第１２３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,231,300	
	第１３３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,764,700	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	97,766,900	
	第１回　名古屋市公募公債	100,000,000	126,291,000	
	第１回　京都市公募公債	300,000,000	317,067,000	
	平成２５年度第１１回　神戸市公募公債	100,000,000	101,159,700	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	114,516,100	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	115,346,700	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	115,548,800	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	125,795,100	
	平成２５年度第３回　北九州市公募公債	150,000,000	151,718,550	
	平成２６年度第２回　北九州市公募公債	150,000,000	151,394,550	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	199,941,800	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債（２０年）	100,000,000	100,733,600	
地方債証券　合計		4,481,000,000	4,685,070,490	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	319,177,200	
	第２２回　政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	308,774,400	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,115,600	
	第１１５回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,041,800	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,928,600	
	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	113,390,100	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	113,183,100	

第２１８回　政保道路機構債券	500,000,000	507,103,000	
第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	111,185,000	
第２４９回　政保道路機構債券	179,000,000	181,445,856	
第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	96,535,800	
第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,442,200	
第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	100,375,500	
第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	229,991,600	
第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	121,694,500	
第７２回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,836,400	
第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,686,468	
第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,681,700	
第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,087,400	
第１６回　公営企業債券	200,000,000	214,855,400	
第９７回　都市再生債券	100,000,000	105,649,300	
第４６回　福祉医療機構債券	200,000,000	199,270,200	
第５９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	228,755,200	
第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,307,700	
第３７回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,254,000	23,382,277	
第４２回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,080,000	58,749,408	
第４６回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,922,000	69,501,564	
第５４回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,468,000	59,054,234	
第５５回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,778,000	65,615,565	
第６０回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,528,000	74,882,662	
第６１回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,929,000	36,413,482	
第６２回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	301,176,000	313,313,392	
第６３回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	188,675,000	195,335,227	
第７３回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	123,240,000	128,637,912	
第７８回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	107,721,000	111,221,932	
第１０９回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	218,835,000	217,040,553	
い第８４５号　利付商工債券	200,000,000	199,721,200	

	い第８２２号　利付農林債券	100,000,000	99,991,500	
	第３４４回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,064,100	
	第３５３回　利付しんきん中金債券	100,000,000	99,938,900	
	第１１６回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,936,900	
特殊債券　合計		5,791,606,000	6,056,314,832	
社債券	第２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	300,000,000	300,761,400	
	第１３回　クレディ・アグリコル	100,000,000	99,976,500	
	第５回　スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	201,587,000	
	第２５回　首都高速道路債券	400,000,000	398,910,400	
	第５６回　中日本高速道路債券	200,000,000	202,389,200	
	第６０回　中日本高速道路債券	100,000,000	101,140,600	
	第２０回　西日本高速道路債券	100,000,000	101,071,700	
	第２５回　西日本高速道路債券	200,000,000	202,162,800	
	第２６回　西日本高速道路債券	200,000,000	202,876,000	
	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	101,367,800	
	第５回　電通グループ	400,000,000	400,190,000	
	第２４回　豊田自動織機	100,000,000	100,937,700	
	第１回　オリックス銀行	200,000,000	199,657,800	
	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	100,972,700	
	第２９回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	100,000,000	106,536,200	
	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	101,064,400	
	第８回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後特約付	100,000,000	105,122,400	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	100,141,400	
	第９６回　トヨタファイナンス	100,000,000	99,467,300	
	第６回　三井住友海上火災保険	100,000,000	99,866,400	
	第６６回　三井不動産	100,000,000	100,211,300	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	228,175,200	
	第７７回　東京急行電鉄	100,000,000	101,196,000	
	第２７回　ＫＤＤＩ	200,000,000	200,372,400	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	100,685,300	
	第３８１回　中国電力	200,000,000	203,548,200	
	第３０４回　北陸電力	100,000,000	101,456,800	
	第３０６回　北陸電力	100,000,000	101,650,900	
	第２５３回　四国電力	200,000,000	202,414,600	
	第４２９回　九州電力	200,000,000	203,925,400	
	第３３１回　北海道電力	100,000,000	100,375,000	
	第１３回　電源開発	100,000,000	106,103,900	
社債券　合計		5,000,000,000	5,076,314,700	

合計		77,222,813,312	

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）

	2022年2月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,567,086,628
金銭信託	56,888,141
コール・ローン	10,176,080,278
株式	475,911,780,813
投資証券	10,819,295,554
派生商品評価勘定	19,644,353
未収入金	67,863,124
未収配当金	453,547,367
差入委託証拠金	8,946,116,552
流動資産合計	508,018,302,810
資産合計	508,018,302,810
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	843,441,938
未払金	47,732,831
未払解約金	374,086,266
その他未払費用	6,132
流動負債合計	1,265,267,167
負債合計	1,265,267,167
純資産の部	
元本等	
元本	182,954,319,928
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	323,798,715,715
元本等合計	506,753,035,643
純資産合計	506,753,035,643
負債純資産合計	508,018,302,810

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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	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。 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	2022年2月21日現在
１．本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	149,298,469,961円
同期中追加設定元本額	57,188,006,214円
同期中一部解約元本額	23,532,156,247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）	809,266,590円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,612,511,529円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,013,122,499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）	1,851,513,778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）	1,905,443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）	8,445,170円
ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	9,613,823円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	11,612,088,704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	128,118,512,572円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	28,741,618,836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）	1,632,834,575円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	220,686,168円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	159,332,621円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	262,398,385円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	504,290,740円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	15,722,120円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	75,699,761円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	5,708,748円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	7,665,315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）	3,285,691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）	20,556,799円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	150,121,767円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	110,350,214円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	243,103,092円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	196,023,098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）	237,822,450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）	244,893,763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）	161,256,902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）	239,479,263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）	234,062,866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）	215,196,370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）	200,572,381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）	33,667,795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）	424,831円

ＦＷニッセイ先進国株インデックス	407,955円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	157,314円
計	182,954,319,928円
２．　受益権の総数	182,954,319,928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　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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	2022年2月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短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	2022年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△36,869,474,459
投資証券	△794,584,608
合計	△37,664,059,067

（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23日から2022年2月21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	2022年2月21日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	9,346,539,508	－	9,318,305,880	△28,233,628
アメリカ・ドル	6,432,413,060	－	6,413,515,200	△18,897,860
イギリス・ポンド	859,577,676	－	860,483,520	905,844
ユーロ	2,054,548,772	－	2,044,307,160	△10,241,612
合計	9,346,539,508	－	9,318,305,880	△28,233,628

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2022年2月21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	20,162,732,798	－	19,367,168,840	△795,563,958
合計	20,162,732,798	－	19,367,168,840	△795,563,958

（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）

	2022年2月21日現在
1口当たり純資産額	2.7698円
（1万口当たり純資産額）	(27,698円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年2月21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	6,054	81.560	493,764.24	
	3M CO	45,519	147.620	6,719,514.78	
	ABBOTT LABORATORIES	139,300	116.790	16,268,847.00	
	ABBVIE INC	138,904	144.030	20,006,343.12	
	ABIOMED INC	3,553	298.380	1,060,144.14	
	ACCENTURE PLC	49,807	321.180	15,997,012.26	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	61,075	81.050	4,950,128.75	
	ADOBE INC	37,416	442.560	16,558,824.96	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,935	218.800	1,079,778.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	128,815	113.830	14,663,011.45	
	AES CORP	52,535	21.260	1,116,894.10	
	AFFIRM HOLDINGS INC	6,857	37.330	255,971.81	
	AFLAC INC	49,956	63.170	3,155,720.52	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,802	132.050	3,143,054.10	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,406	241.970	4,211,729.82	
	AIRBNB INC-CLASS A	18,508	174.900	3,237,049.20	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12,776	100.330	1,281,816.08	
	ALBEMARLE CORP	9,171	190.760	1,749,459.96	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	5,892	498.650	2,938,045.80	
	ALLEGHANY CORP	1,082	687.800	744,199.60	
	ALLEGION PLC	7,171	114.130	818,426.23	
	ALLIANT ENERGY CORP	19,709	57.100	1,125,383.90	
	ALLSTATE CORP	23,130	125.890	2,911,835.70	
	ALLY FINANCIAL INC	28,237	49.760	1,405,073.12	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,349	147.500	1,378,977.50	
	ALPHABET INC-CL A	23,653	2,608.060	61,688,443.18	
	ALPHABET INC-CL C	22,645	2,609.350	59,088,730.75	
	ALTRIA GROUP INC	145,072	51.740	7,506,025.28	
	AMAZON.COM INC	35,818	3,052.030	109,317,610.54	
	AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	40,376	17.900	722,730.40	
	AMCOR PLC	121,883	11.880	1,447,970.04	
	AMERCO	813	587.430	477,580.59	
	AMEREN CORPORATION	20,211	84.670	1,711,265.37	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	39,373	85.710	3,374,659.83	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,104	194.880	10,348,907.52	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,583	134.650	751,750.95	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	67,094	61.730	4,141,712.62	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,274	148.260	2,116,263.24	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,889	300.560	2,671,677.84	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,360	141.500	1,748,940.00	
AMETEK INC	18,223	128.220	2,336,553.06	
AMGEN INC	44,640	220.770	9,855,172.80	
AMPHENOL CORP-CL A	47,093	76.230	3,589,899.39	
ANALOG DEVICES INC	42,282	160.360	6,780,341.52	
ANSYS INC	6,853	299.570	2,052,953.21	
ANTHEM INC	19,143	446.240	8,542,372.32	
AON PLC	17,734	283.800	5,032,909.20	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	25,916	64.170	1,663,029.72	
APPLE INC	1,298,973	167.300	217,318,182.90	
APPLIED MATERIALS INC	70,928	133.350	9,458,248.80	
APTIV PLC	21,268	141.150	3,001,978.20	
ARAMARK	18,176	37.770	686,507.52	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	30,939	47.100	1,457,226.90	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,859	76.390	3,350,389.01	
ARISTA NETWORKS INC	18,047	125.920	2,272,478.24	
ARROW ELECTRONICS INC	5,566	123.740	688,736.84	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,208	154.280	2,500,570.24	
ASANA INC - CL A	5,211	63.140	329,022.54	
ASSURANT INC	4,589	165.540	759,663.06	
AT&T INC	562,091	23.870	13,417,112.17	
ATMOS ENERGY CORP	10,355	106.040	1,098,044.20	
AUTODESK INC	17,291	216.840	3,749,380.44	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	33,249	200.450	6,664,762.05	
AUTOZONE INC	1,692	1,920.010	3,248,656.92	
AVALARA INC	6,775	93.400	632,785.00	
AVANTOR INC	41,408	34.000	1,407,872.00	
AVERY DENNISON CORP	6,517	180.870	1,178,729.79	
BAKER HUGHES COMPANY	65,234	29.110	1,898,961.74	
BALL CORP	25,746	90.610	2,332,845.06	
BANK OF AMERICA CORP	594,877	45.960	27,340,546.92	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	64,326	56.380	3,626,699.88	
BATH & BODY WORKS INC	20,747	52.280	1,084,653.16	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,328	82.350	3,238,660.80	
BECTON DICKINSON & CO	22,590	264.040	5,964,663.60	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,771	37.460	515,861.66	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	104,202	314.800	32,802,789.60	
BEST BUY CO INC	17,654	97.710	1,724,972.34	

BILL.COM HOLDINGS INC	5,858	224.230	1,313,539.34	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,733	583.760	1,011,656.08	
BIO-TECHNE CORP	3,062	401.010	1,227,892.62	
BIOGEN INC	11,707	209.790	2,456,011.53	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,415	84.860	1,223,256.90	
BLACK KNIGHT INC	12,364	55.860	690,653.04	
BLACKROCK INC	11,953	756.020	9,036,707.06	
BLACKSTONE INC	53,835	123.860	6,668,003.10	
BLOCK INC	31,235	97.720	3,052,284.20	
BOEING CO	43,868	209.030	9,169,728.04	
BOOKING HOLDINGS INC	3,227	2,616.410	8,443,155.07	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,674	73.030	779,522.22	
BORGWARNER INC	18,884	43.560	822,587.04	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	111,970	42.550	4,764,323.50	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	174,914	67.550	11,815,440.70	
BROADCOM INC	32,258	579.990	18,709,317.42	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	9,160	142.380	1,304,200.80	
BROWN & BROWN INC	18,683	66.140	1,235,693.62	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	24,430	66.520	1,625,083.60	
BUNGE LIMITED	11,034	99.300	1,095,676.20	
BURLINGTON STORES INC	5,258	221.060	1,162,333.48	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,796	91.980	993,016.08	
CABLE ONE INC	430	1,474.870	634,194.10	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	21,663	134.950	2,923,421.85	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	16,755	79.280	1,328,336.40	
CAMPBELL SOUP CO	15,499	44.950	696,680.05	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,543	72.360	1,486,491.48	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,022	153.960	5,391,987.12	
CARDINAL HEALTH INC	22,926	54.180	1,242,130.68	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,518	45.710	572,197.78	
CARMAX INC	12,805	105.640	1,352,720.20	
CARNIVAL CORP	65,122	22.170	1,443,754.74	
CARRIER GLOBAL CORP	64,893	44.080	2,860,483.44	
CARVANA CO	5,989	126.400	757,009.60	
CATALENT INC	13,406	99.040	1,327,730.24	
CATERPILLAR INC	43,053	191.950	8,264,023.35	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,362	118.810	993,489.22	
CBRE GROUP INC	26,385	99.690	2,630,320.65	
CDW CORP/DE	10,827	181.760	1,967,915.52	
CELANESE CORP-SERIES A	8,683	144.250	1,252,522.75	

CENTENE CORP	45,814	82.060	3,759,496.84	
CENTERPOINT ENERGY INC	46,786	26.610	1,244,975.46	
CENTURYLINK INC	74,486	9.940	740,390.84	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,583	66.850	707,473.55	
CERNER CORP	23,142	91.450	2,116,335.90	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,834	73.270	1,233,427.18	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,956	293.610	1,161,521.16	
CHARLES SCHWAB CORP	113,687	85.610	9,732,744.07	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	10,109	596.830	6,033,354.47	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,355	130.790	1,092,750.45	
CHENIERE ENERGY INC	18,943	116.020	2,197,766.86	
CHEVRON CORP	151,951	133.420	20,273,302.42	
CHEWY INC - CLASS A	6,981	44.170	308,350.77	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,206	1,523.320	3,360,443.92	
CHUBB LTD	34,423	204.710	7,046,732.33	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,317	98.780	1,908,133.26	
CIGNA CORP	26,728	228.650	6,111,357.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,982	125.580	1,504,699.56	
CINTAS CORP	7,278	371.570	2,704,286.46	
CISCO SYSTEMS INC	331,046	57.210	18,939,141.66	
CITIGROUP INC	159,250	64.140	10,214,295.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	33,334	53.250	1,775,035.50	
CITRIX SYSTEMS INC	9,776	101.880	995,978.88	
CLARIVATE PLC	27,811	16.000	444,976.00	
CLOROX CO	9,685	150.550	1,458,076.75	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	18,596	95.870	1,782,798.52	
CME GROUP INC	28,241	236.620	6,682,385.42	
CMS ENERGY CORP	22,957	62.510	1,435,042.07	
COCA-COLA CO	322,806	62.540	20,188,287.24	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	16,178	55.400	896,261.20	
COGNEX CORP	13,844	65.720	909,827.68	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	41,249	86.360	3,562,263.64	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	2,965	189.160	560,859.40	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,166	79.550	5,024,855.30	
COMCAST CORP	359,826	46.640	16,782,284.64	
CONAGRA BRANDS INC	37,706	36.020	1,358,170.12	
CONOCOPHILLIPS	104,983	89.630	9,409,626.29	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,763	84.610	2,349,027.43	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,245	215.850	2,858,933.25	

CONSTELLATION ENERGY	25,562	45.410	1,160,770.42	
COOPER COS INC/THE	3,853	388.980	1,498,739.94	
COPART INC	16,707	122.320	2,043,600.24	
CORNING INC	63,878	41.700	2,663,712.60	
CORTEVA INC	57,640	50.700	2,922,348.00	
COSTAR GROUP INC	31,074	64.950	2,018,256.30	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,717	512.670	17,798,364.39	
COTERRA ENERGY INC	60,412	22.590	1,364,707.08	
COUPA SOFTWARE INC	5,790	115.970	671,466.30	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,865	164.930	2,451,684.45	
CROWN HOLDINGS INC	10,410	120.720	1,256,695.20	
CSX CORP	179,071	34.660	6,206,600.86	
CUMMINS INC	11,284	218.050	2,460,476.20	
CVS HEALTH CORP	103,692	102.130	10,590,063.96	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,134	140.750	441,110.50	
DANAHER CORP	50,482	266.930	13,475,160.26	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,203	144.740	1,476,782.22	
DATADOG INC - CLASS A	15,051	159.020	2,393,410.02	
DAVITA INC	5,348	115.490	617,640.52	
DEERE & CO	23,160	369.100	8,548,356.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,729	58.900	1,279,838.10	
DELTA AIR LINES INC	12,737	42.840	545,653.08	
DENTSPLY SIRONA INC	17,164	55.090	945,564.76	
DEVON ENERGY CORPORATION	50,190	54.780	2,749,408.20	
DEXCOM INC	7,598	381.240	2,896,661.52	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,453	131.470	1,768,665.91	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,563	123.810	2,917,335.03	
DISCOVERY INC-A	13,198	29.860	394,092.28	
DISCOVERY INC-C	24,521	29.740	729,254.54	
DISH NETWORK CORP	19,336	28.960	559,970.56	
DOCUSIGN INC	15,304	110.280	1,687,725.12	
DOLLAR GENERAL CORP	18,346	199.970	3,668,649.62	
DOLLAR TREE INC	17,668	142.840	2,523,697.12	
DOMINION ENERGY INC	63,691	79.150	5,041,142.65	
DOMINO'S PIZZA INC	2,900	435.620	1,263,298.00	
DOORDASH INC - A	8,432	96.210	811,242.72	
DOVER CORP	11,301	159.030	1,797,198.03	
DOW INC	58,607	60.590	3,550,998.13	
DR HORTON INC	26,755	83.440	2,232,437.20	
DRAFTKINGS INC - CL A	25,333	17.290	438,007.57	
DROPBOX INC-CLASS A	24,768	23.020	570,159.36	
DTE ENERGY COMPANY	15,335	119.350	1,830,232.25	
DUKE ENERGY CORP	60,500	99.810	6,038,505.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	41,091	78.770	3,236,738.07	
DYNATRACE INC	14,451	41.640	601,739.64	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,687	121.280	1,296,119.36	

EATON CORP PLC	31,304	153.360	4,800,781.44	
EBAY INC	50,987	55.460	2,827,739.02	
ECOLAB INC	20,281	178.640	3,622,997.84	
EDISON INTERNATIONAL	29,961	59.940	1,795,862.34	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,947	105.620	5,169,782.14	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	33,551	25.510	855,886.01	
ELECTRONIC ARTS INC	22,325	129.330	2,887,292.25	
ELI LILLY & CO	63,896	240.310	15,354,847.76	
EMERSON ELECTRIC CO	47,026	92.770	4,362,602.02	
ENPHASE ENERGY INC	10,045	140.350	1,409,815.75	
ENTEGRIS INC	10,630	130.190	1,383,919.70	
ENTERGY CORP	15,856	104.620	1,658,854.72	
EOG RESOURCES INC	45,745	111.620	5,106,056.90	
EPAM SYSTEMS INC	4,427	443.230	1,962,179.21	
EQUIFAX INC	9,576	213.040	2,040,071.04	
EQUITABLE HOLDINGS INC	29,227	33.170	969,459.59	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,990	181.810	361,801.90	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,593	45.520	846,353.36	
ESTEE LAUDER COS INC	18,317	302.990	5,549,867.83	
ETSY INC	9,933	127.300	1,264,470.90	
EVEREST RE GROUP LTD	3,104	304.420	944,919.68	
EVERGY INC	18,092	60.970	1,103,069.24	
EVERSOURCE ENERGY	27,082	82.820	2,242,931.24	
EXACT SCIENCES CORP	13,574	74.130	1,006,240.62	
EXELON CORP	76,688	41.630	3,192,521.44	
EXPEDIA GROUP INC	11,407	209.170	2,386,002.19	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	13,799	106.220	1,465,729.78	
EXXON MOBIL CORP	332,731	77.360	25,740,070.16	
F5 INC	4,728	201.690	953,590.32	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,953	403.010	1,190,088.53	
FAIR ISAAC CORP	2,251	498.200	1,121,448.20	
FASTENAL CO	45,047	51.200	2,306,406.40	
FEDEX CORP	20,064	222.230	4,458,822.72	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	21,215	47.750	1,013,016.25	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	48,630	95.640	4,650,973.20	
FIFTH THIRD BANCORP	54,186	48.230	2,613,390.78	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,892	168.590	2,342,052.28	
FIRSTENERGY CORP	42,923	40.980	1,758,984.54	
FISERV INC	46,952	94.130	4,419,591.76	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	2,304	70.690	162,869.76	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,183	233.510	1,443,792.33	
FMC CORP	10,176	116.890	1,189,472.64	

FORD MOTOR CO	308,268	18.040	5,561,154.72	
FORTINET INC	10,883	304.850	3,317,682.55	
FORTIVE CORP	26,816	63.750	1,709,520.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,869	88.790	965,058.51	
FOX CORP - CLASS A	24,099	42.380	1,021,315.62	
FOX CORP- CLASS B	13,069	38.540	503,679.26	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,476	30.370	712,966.12	
FREEPORT-MCMORAN INC	115,102	43.020	4,951,688.04	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,035	42.780	172,617.30	
GARMIN LTD	12,081	114.520	1,383,516.12	
GARTNER INC	6,573	288.230	1,894,535.79	
GENERAC HOLDINGS INC	4,948	294.760	1,458,472.48	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,699	215.820	4,035,618.18	
GENERAL ELECTRIC CO	86,334	92.690	8,002,298.46	
GENERAL MILLS INC	47,502	68.150	3,237,261.30	
GENERAL MOTORS CO	102,657	48.600	4,989,130.20	
GENUINE PARTS CO	11,230	126.860	1,424,637.80	
GILEAD SCIENCES INC	98,515	61.050	6,014,340.75	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,146	136.620	3,162,206.52	
GLOBE LIFE INC	7,604	105.080	799,028.32	
GODADDY INC - CLASS A	13,363	83.620	1,117,414.06	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,471	346.040	9,160,024.84	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,226	87.810	546,705.06	
HALLIBURTON CO	69,970	32.260	2,257,232.20	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	27,131	70.530	1,913,549.43	
HASBRO INC	10,332	97.980	1,012,329.36	
HCA HEALTHCARE INC	20,112	244.100	4,909,339.20	
HEICO CORP	3,420	141.980	485,571.60	
HEICO CORP-CLASS A	5,700	117.410	669,237.00	
HENRY SCHEIN INC	10,918	83.470	911,325.46	
HERSHEY CO/THE	11,462	202.590	2,322,086.58	
HESS CORP	21,852	93.870	2,051,247.24	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	102,202	17.330	1,771,160.66	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,855	150.410	3,287,210.55	
HOLOGIC INC	19,872	70.050	1,392,033.60	
HOME DEPOT INC	82,931	346.870	28,766,275.97	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	54,311	182.130	9,891,662.43	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	93,600	5.580	522,288.00	
HORIZON PHARMA PLC	16,813	93.370	1,569,829.81	
HORMEL FOODS CORP	23,325	47.450	1,106,771.25	
HOWMET AEROSPACE INC	30,318	34.560	1,047,790.08	
HP INC	94,338	36.200	3,415,035.60	
HUBSPOT INC	3,504	497.590	1,743,555.36	

HUMANA INC	10,089	421.750	4,255,035.75	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	115,955	15.850	1,837,886.75	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,128	186.090	582,089.52	
IAC/INTERACTIVECORP	6,190	109.550	678,114.50	
IDEX CORP	5,994	189.340	1,134,903.96	
IDEXX LABORATORIES INC	6,675	489.450	3,267,078.75	
IHS MARKIT LTD	29,747	107.110	3,186,201.17	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	24,824	215.810	5,357,267.44	
ILLUMINA INC	11,533	311.970	3,597,950.01	
INCYTE CORP	14,765	68.530	1,011,845.45	
INGERSOLL-RAND INC	31,957	53.070	1,695,957.99	
INMODE LTD	3,861	41.580	160,540.38	
INSULET CORP	5,423	234.180	1,269,958.14	
INTEL CORP	318,813	45.040	14,359,337.52	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,263	122.870	5,438,594.81	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	70,514	124.350	8,768,415.90	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	19,623	134.790	2,644,984.17	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,182	46.740	1,363,966.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	30,795	36.110	1,112,007.45	
INTUIT INC	21,460	481.200	10,326,552.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,022	280.780	7,868,017.16	
INVESCO LTD	26,908	22.470	604,622.76	
IPG PHOTONICS CORP	2,943	136.810	402,631.83	
IQVIA HOLDINGS INC	15,079	228.270	3,442,083.33	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,805	172.460	1,001,130.30	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,247	119.650	1,226,053.55	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,100	60.120	1,028,052.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,795	137.890	661,182.55	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,918	188.290	1,302,590.22	
JM SMUCKER CO	8,412	138.990	1,169,183.88	
JOHNSON & JOHNSON	206,886	163.360	33,796,896.96	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	56,031	65.370	3,662,746.47	
JPMORGAN CHASE & CO	234,771	152.140	35,718,059.94	
JUNIPER NETWORKS INC	25,366	34.320	870,561.12	
KELLOGG CO	20,091	66.070	1,327,412.37	
KEURIG DR PEPPER INC	55,944	38.480	2,152,725.12	
KEYCORP	74,946	25.640	1,921,615.44	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	14,429	160.590	2,317,153.11	

KIMBERLY-CLARK CORP	26,564	133.150	3,536,996.60	
KINDER MORGAN INC	160,352	16.600	2,661,843.20	
KKR & CO INC -A	41,137	59.140	2,432,842.18	
KLA CORPORATION	12,002	358.300	4,300,316.60	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,226	53.870	712,484.62	
KORNIT DIGITAL LTD	3,635	87.840	319,298.40	
KRAFT HEINZ CO/THE	52,711	38.460	2,027,265.06	
KROGER CO	55,401	45.590	2,525,731.59	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,786	217.620	3,435,349.32	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,559	264.470	1,999,128.73	
LAM RESEARCH CORP	11,166	569.990	6,364,508.34	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,135	47.120	1,278,601.20	
LEAR CORP	4,708	171.770	808,693.16	
LEIDOS HOLDINGS INC	10,625	93.010	988,231.25	
LENNAR CORP-CL A	21,584	89.430	1,930,257.12	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,676	251.980	674,298.48	
LIBERTY BROADBAND-A	2,170	145.680	316,125.60	
LIBERTY BROADBAND-C	11,222	148.280	1,663,998.16	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,257	26.550	484,723.35	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,488	26.540	570,291.52	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	6,407	51.100	327,397.70	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13,402	51.160	685,646.32	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	15,266	63.030	962,215.98	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,880	69.650	966,742.00	
LINDE PLC	40,624	302.860	12,303,384.64	
LIVE NATION INC	12,934	117.440	1,518,968.96	
LKQ CORP	21,843	49.170	1,074,020.31	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,595	386.460	7,572,683.70	
LOEWS CORP	17,076	61.600	1,051,881.60	
LOWE'S COS INC	54,398	222.690	12,113,890.62	
LUCID GROUP INC	31,807	26.590	845,748.13	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,299	308.660	2,870,229.34	
LYFT INC-A	21,053	41.260	868,646.78	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,053	99.840	2,101,931.52	
M&T BANK CORP	10,088	182.350	1,839,546.80	
MARATHON PETROLEUM CORP	50,125	77.020	3,860,627.50	
MARKEL CORP	1,076	1,253.000	1,348,228.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,982	372.010	1,109,333.82	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	21,714	174.920	3,798,212.88	
MARSH & MCLENNAN COS INC	39,833	152.190	6,062,184.27	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,899	383.670	1,879,599.33	

MARVELL TECHNOLOGY INC	64,716	67.340	4,357,975.44	
MASCO CORP	19,546	57.560	1,125,067.76	
MASIMO CORPORATION	4,094	154.340	631,867.96	
MASTERCARD INC-CLASS A	69,254	369.950	25,620,517.30	
MATCH GROUP INC	20,662	107.560	2,222,404.72	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	19,709	97.790	1,927,343.11	
MCDONALD'S CORP	58,719	250.600	14,714,981.40	
MCKESSON CORP	12,199	270.810	3,303,611.19	
MEDTRONIC PLC	105,772	100.580	10,638,547.76	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	17,618	11.120	195,912.16	
MERCADOLIBRE INC	3,517	937.260	3,296,343.42	
MERCK & CO INC	198,927	76.370	15,192,054.99	
META PLATFORMS INC-A	187,311	206.160	38,616,035.76	
METLIFE INC	56,981	69.550	3,963,028.55	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,818	1,408.460	2,560,580.28	
MGM MIRAGE	30,070	43.560	1,309,849.20	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	43,198	71.780	3,100,752.44	
MICRON TECHNOLOGY INC	88,463	90.800	8,032,440.40	
MICROSOFT CORP	560,976	287.930	161,521,819.68	
MODERNA INC	26,945	145.740	3,926,964.30	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,606	148.260	682,885.56	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,567	314.870	1,438,011.29	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	14,958	49.000	732,942.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,860	66.000	7,250,760.00	
MONGODB INC	4,563	390.180	1,780,391.34	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,419	457.350	1,563,679.65	
MONSTER BEVERAGE CORP	31,144	81.270	2,531,072.88	
MOODY'S CORP	13,175	323.580	4,263,166.50	
MORGAN STANLEY	107,503	95.420	10,257,936.26	
MOSAIC CO/THE	28,855	45.000	1,298,475.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,322	217.810	2,901,664.82	
MSCI INC	6,474	527.000	3,411,798.00	
NASDAQ INC	9,145	171.540	1,568,733.30	
NETAPP INC	17,571	90.900	1,597,203.90	
NETFLIX INC	34,775	391.290	13,607,109.75	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	7,436	85.320	634,439.52	
NEWELL BRANDS INC	30,099	25.860	778,360.14	
NEWMONT CORP	62,574	67.670	4,234,382.58	
NEWS CORP - CLASS A	30,511	22.150	675,818.65	
NEXTERA ENERGY INC	154,195	74.150	11,433,559.25	
NIKE INC	100,470	142.950	14,362,186.50	

NISOURCE INC	31,283	28.450	890,001.35	
NORDSON CORP	4,108	229.510	942,827.08	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,680	270.220	5,317,929.60	
NORTHERN TRUST CORP	15,552	118.520	1,843,223.04	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,945	391.250	4,673,481.25	
NORTONLIFELOCK INC	45,698	27.970	1,278,173.06	
NOVAVAX INC	5,559	81.890	455,226.51	
NOVOCURE LTD	7,359	76.000	559,284.00	
NRG ENERGY INC	19,133	38.430	735,281.19	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,474	55.150	1,294,591.10	
NUCOR CORP	22,992	122.930	2,826,406.56	
NVIDIA CORP	196,446	236.420	46,443,763.32	
NVR INC	267	4,996.040	1,333,942.68	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,841	187.090	3,899,142.69	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,415	676.960	3,665,738.40	
OAK STREET HEALTH INC	7,658	15.750	120,613.50	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	73,381	39.560	2,902,952.36	
OKTA INC	9,831	164.670	1,618,870.77	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,953	287.960	2,290,145.88	
OMNICOM GROUP	16,887	84.120	1,420,534.44	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	33,825	60.200	2,036,265.00	
ONEOK INC	35,019	61.810	2,164,524.39	
ORACLE CORP	131,602	74.570	9,813,561.14	
OTIS WORLDWIDE CORP	32,003	76.350	2,443,429.05	
OWENS CORNING	8,089	98.070	793,288.23	
PACCAR INC	27,346	93.810	2,565,328.26	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,469	148.470	1,108,922.43	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	124,674	11.020	1,373,907.48	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,654	482.170	3,690,529.18	
PARAMOUNT GLOBAL	47,537	28.380	1,349,100.06	
PARKER HANNIFIN CORP	10,144	300.030	3,043,504.32	
PAYCHEX INC	25,433	115.840	2,946,158.72	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,009	318.570	1,277,147.13	
PAYPAL HOLDINGS INC	87,723	103.650	9,092,488.95	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	22,100	29.630	654,823.00	
PENTAIR PLC	12,945	57.810	748,350.45	
PEPSICO INC	108,674	167.710	18,225,716.54	
PERKINELMER INC	8,808	179.210	1,578,481.68	
PFIZER INC	440,545	48.530	21,379,648.85	
PG&E CORP	117,263	11.410	1,337,970.83	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,559	111.610	13,678,809.99	

PHILLIPS 66	34,422	85.070	2,928,279.54	
PINTEREST INC- CLASS A	43,643	23.860	1,041,321.98	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,151	233.380	4,236,080.38	
PLUG POWER INC	40,630	22.070	896,704.10	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,372	201.170	6,713,445.24	
POOL CORP	3,139	454.830	1,427,711.37	
PPG INDUSTRIES INC	18,681	149.640	2,795,424.84	
PPL CORPORATION	61,027	26.100	1,592,804.70	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,986	72.480	1,521,065.28	
PROCTER & GAMBLE CO	190,845	159.900	30,516,115.50	
PROGRESSIVE CORP	45,950	106.410	4,889,539.50	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,236	114.070	3,449,020.52	
PTC INC	8,775	108.860	955,246.50	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,824	64.680	2,575,816.32	
PULTE GROUP INC	20,371	48.130	980,456.23	
QORVO INC	8,731	133.200	1,162,969.20	
QUALCOMM INC	88,666	167.640	14,863,968.24	
QUEST DIAGNOSTICS	9,570	131.380	1,257,306.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,431	108.520	1,566,052.12	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	118,516	93.370	11,065,838.92	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,249	615.130	5,074,207.37	
REGIONS FINANCIAL CORP	74,402	23.700	1,763,327.40	
REPUBLIC SERVICES INC	17,539	117.540	2,061,534.06	
RESMED INC	11,426	231.730	2,647,746.98	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,094	146.880	895,086.72	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,895	66.370	922,211.15	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	8,696	120.380	1,046,824.48	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	14,296	11.810	168,835.76	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,129	264.590	2,415,442.11	
ROKU INC	9,152	112.460	1,029,233.92	
ROLLINS INC	17,404	31.130	541,786.52	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,302	440.330	3,655,619.66	
ROSS STORES INC	28,107	93.470	2,627,161.29	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,033	83.690	1,509,181.77	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,937	39.410	1,061,587.17	
RPM INTERNATIONAL INC	10,286	86.200	886,653.20	
S&P GLOBAL INC	18,937	378.670	7,170,873.79	
SALESFORCE.COM INC	76,933	196.840	15,143,491.72	
SCHLUMBERGER LTD	109,940	40.210	4,420,687.40	

SEA LTD-ADR	10,823	127.690	1,381,988.87	
SEAGATE TECHNOLOGY	16,067	108.640	1,745,518.88	
SEAGEN INC	10,724	120.260	1,289,668.24	
SEALED AIR CORP	11,815	69.310	818,897.65	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,255	59.070	546,692.85	
SEMPRA ENERGY	25,183	135.510	3,412,548.33	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,536	57.150	716,432.40	
SERVICENOW INC	15,557	556.010	8,649,847.57	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,672	268.070	5,273,473.04	
SIGNATURE BANK	4,750	335.250	1,592,437.50	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	80,637	6.030	486,241.11	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,966	136.580	1,770,896.28	
SMITH (A.O.) CORP	10,483	71.200	746,389.60	
SNAP INC - A	83,336	38.010	3,167,601.36	
SNAP-ON INC	4,224	215.470	910,145.28	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,545	273.770	4,529,524.65	
SOFI TECHNOLOGIES INC	40,637	11.390	462,855.43	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,107	257.910	1,059,236.37	
SOUTHERN CO	83,463	63.770	5,322,435.51	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,557	45.980	531,390.86	
SPLUNK INC	12,914	114.700	1,481,235.80	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	18,199	73.920	1,345,270.08	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,834	161.790	2,076,412.86	
STARBUCKS CORP	92,693	93.340	8,651,964.62	
STATE STREET CORP	28,610	93.390	2,671,887.90	
STEEL DYNAMICS INC	15,846	63.950	1,013,351.70	
STERIS PLC	7,822	226.030	1,768,006.66	
STRYKER CORP	26,691	248.140	6,623,104.74	
SUNRUN INC	13,765	21.560	296,773.40	
SVB FINANCIAL GROUP	4,597	613.130	2,818,558.61	
SYNCHRONY FINANCIAL	44,744	43.420	1,942,784.48	
SYNOPSYS INC	11,954	287.630	3,438,329.02	
SYSCO CORP	40,278	83.550	3,365,226.90	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,720	143.470	2,542,288.40	
T-MOBILE US INC	49,258	123.980	6,107,006.84	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,132	158.500	1,447,422.00	
TARGET CORP	38,315	204.390	7,831,202.85	
TE CONNECTIVITY LTD	25,752	143.480	3,694,896.96	
TELADOC HEALTH INC	11,267	65.000	732,355.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,666	419.920	1,539,426.72	
TELEFLEX INC	3,693	315.780	1,166,175.54	
TERADYNE INC	12,945	114.830	1,486,474.35	
TESLA, INC.	66,124	856.980	56,666,945.52	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	86,954	8.150	708,675.10	
TEXAS INSTRUMENTS INC	72,576	166.740	12,101,322.24	
TEXTRON INC	17,503	69.520	1,216,808.56	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,912	537.140	16,604,071.68	
TJX COS INC	94,601	66.150	6,257,856.15	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,958	214.180	1,918,624.44	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	34,109	78.050	2,662,207.45	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,226	80.670	663,591.42	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,734	152.330	2,853,750.22	
TRANSDIGM GROUP INC	4,124	648.960	2,676,311.04	
TRANSUNION	15,123	97.790	1,478,878.17	
TRAVELERS COS INC/THE	19,525	170.630	3,331,550.75	
TRIMBLE INC	19,775	68.350	1,351,621.25	
TRUIST FINANCIAL CORP	105,062	62.320	6,547,463.84	
TWILIO INC - A	13,117	158.330	2,076,814.61	
TWITTER INC	62,666	34.320	2,150,697.12	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,198	411.280	1,315,273.44	
TYSON FOODS INC-CL A	23,124	92.270	2,133,651.48	
UBER TECHNOLOGIES INC	96,810	34.680	3,357,370.80	
UGI CORP	16,506	38.040	627,888.24	
ULTA BEAUTY INC	4,051	375.830	1,522,487.33	
UNION PACIFIC CORP	51,606	251.190	12,962,911.14	
UNITED PARCEL SERVICE INC	57,431	209.360	12,023,754.16	
UNITED RENTALS INC	5,667	311.820	1,767,083.94	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,082	467.810	34,656,300.42	
UNITY SOFTWARE INC	4,430	99.090	438,968.70	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,936	134.790	800,113.44	
UPSTART HOLDINGS INC	1,523	130.050	198,066.15	
US BANCORP	110,649	57.100	6,318,057.90	
VAIL RESORTS INC	3,162	266.000	841,092.00	
VALERO ENERGY CORP	32,095	86.720	2,783,278.40	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,848	217.900	2,363,779.20	
VERISIGN INC	7,931	208.220	1,651,392.82	
VERISK ANALYTICS INC	12,070	189.300	2,284,851.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	326,192	53.830	17,558,915.36	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,385	229.610	4,680,599.85	
VF CORP	26,380	59.170	1,560,904.60	
VIATRIS INC	95,287	14.710	1,401,671.77	
VISA INC-CLASS A SHARES	132,650	222.690	29,539,828.50	
VISTRA CORP	34,300	21.450	735,735.00	

	VMWARE INC-CLASS A	16,461	122.670	2,019,270.87	
	VULCAN MATERIALS CO	10,433	185.310	1,933,339.23	
	WABTEC CORP	14,200	96.860	1,375,412.00	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	57,688	46.610	2,688,837.68	
	WALMART INC	121,065	137.990	16,705,759.35	
	WALT DISNEY CO	142,828	151.360	21,618,446.08	
	WASTE CONNECTIONS INC	20,518	121.000	2,482,678.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	33,159	142.330	4,719,520.47	
	WATERS CORP	4,817	316.180	1,523,039.06	
	WAYFAIR INC- CLASS A	5,779	128.090	740,232.11	
	WEC ENERGY GROUP INC	24,828	90.000	2,234,520.00	
	WELLS FARGO & CO	322,583	55.630	17,945,292.29	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,788	369.490	2,138,608.12	
	WESTERN DIGITAL CORP	24,246	55.530	1,346,380.38	
	WESTERN UNION CO	32,301	19.730	637,298.73	
	WESTROCK CO-WHEN ISSUED	20,929	46.650	976,337.85	
	WEYERHAEUSER CO	58,729	39.180	2,301,002.22	
	WHIRLPOOL CORP	4,927	204.540	1,007,768.58	
	WILLIAMS COS INC	95,445	29.620	2,827,080.90	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,123	225.610	2,283,850.03	
	WIX.COM LTD	4,427	86.120	381,253.24	
	WORKDAY INC-CLASS A	15,002	214.470	3,217,478.94	
	WR BERKLEY CORP	11,068	90.470	1,001,321.96	
	WW GRAINGER INC	3,480	473.930	1,649,276.40	
	WYNN RESORTS LTD	8,229	93.150	766,531.35	
	XCEL ENERGY INC	42,429	66.000	2,800,314.00	
	XYLEM INC	14,181	90.660	1,285,649.46	
	YUM! BRANDS INC	23,228	125.800	2,922,082.40	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,188	420.310	1,760,258.28	
	ZENDESK INC	9,480	115.060	1,090,768.80	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	13,191	60.810	802,144.71	
	ZILLOW GROUP INC - CL A	4,830	60.800	293,664.00	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,435	121.020	1,988,963.70	
	ZOETIS INC	37,278	191.320	7,132,026.96	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,020	126.960	2,160,859.20	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	17,634	52.540	926,490.36	
	ZSCALER INC	6,445	255.220	1,644,892.90	
アメリカ・ドル　小計		24,974,707		2,998,979,097.90 (345,062,535,003)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	75,647	13.130	993,245.11	
	ABRDN PLC	169,643	2.334	395,946.76	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,189	29.630	450,050.07	

ANGLO AMERICAN PLC	101,234	35.260	3,569,510.84	
ANTOFAGASTA PLC	30,698	14.040	430,999.92	
ASHTEAD GROUP PLC	35,092	47.780	1,676,695.76	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,143	19.075	536,827.72	
ASTRAZENECA PLC	121,764	88.010	10,716,449.64	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI	75,186	6.330	475,927.38	
AVEVA GROUP PLC	9,616	25.190	242,227.04	
AVIVA PLC	306,891	4.322	1,326,382.90	
BAE SYSTEMS PLC	252,418	5.974	1,507,945.13	
BARCLAYS PLC	1,322,473	1.911	2,527,245.90	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	80,108	6.030	483,051.24	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	8,908	39.490	351,776.92	
BHP GROUP LTD	162,080	25.550	4,141,144.00	
BP PLC	1,581,805	3.914	6,191,184.77	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	171,286	34.090	5,839,139.74	
BT GROUP PLC	705,841	1.973	1,392,624.29	
BUNZL PLC	26,573	27.360	727,037.28	
BURBERRY GROUP PLC	31,959	20.330	649,726.47	
COCA-COLA HBC AG-CDI	15,791	24.250	382,931.75	
COMPASS GROUP PLC	140,250	17.480	2,451,570.00	
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,942	70.600	772,505.20	
DCC PLC	7,781	61.840	481,177.04	
DIAGEO PLC	183,575	36.585	6,716,091.37	
ENTAIN PLC	45,865	16.500	756,772.50	
EXPERIAN PLC	72,501	28.280	2,050,328.28	
FERGUSON PLC	17,462	111.750	1,951,378.50	
GLAXOSMITHKLINE PLC	395,874	15.670	6,203,345.58	
GLENCORE PLC	782,673	4.220	3,302,880.06	
HALMA PLC	29,791	22.860	681,022.26	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,901	12.775	356,435.27	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,645	19.685	268,601.82	
HSBC HOLDINGS PLC	1,605,113	5.444	8,738,235.17	
IMPERIAL BRANDS PLC	74,267	17.790	1,321,209.93	
INFORMA PLC	119,148	6.010	716,079.48	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	14,535	49.740	722,970.90	
INTERTEK GROUP PLC	12,753	51.600	658,054.80	
JD SPORTS FASHION PLC	201,475	1.657	333,844.07	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,178	17.940	272,293.32	
KINGFISHER PLC	163,626	3.230	528,511.98	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	469,397	2.724	1,278,637.42	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,565,781	0.512	2,849,679.87	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,906	66.200	1,714,977.20	

	M&G PLC	207,343	2.134	442,469.96	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	345,193	1.544	532,977.99	
	MONDI PLC/WI	38,301	19.240	736,911.24	
	NATIONAL GRID PLC	284,988	10.896	3,105,229.24	
	NATWEST GROUP PLC	450,678	2.345	1,056,839.91	
	NEXT PLC	10,453	68.500	716,030.50	
	NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
	OCADO GROUP PLC	38,465	13.000	500,045.00	
	PEARSON PLC	59,226	6.210	367,793.46	
	PERSIMMON PLC	25,119	24.140	606,372.66	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	52,958	6.470	342,638.26	
	PRUDENTIAL PLC	205,734	11.595	2,385,485.73	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,246	62.730	3,528,311.58	
	RELX PLC	152,335	22.330	3,401,640.55	
	RENTOKIL INITIAL PLC	146,786	4.909	720,572.47	
	RIO TINTO PLC	87,959	56.570	4,975,840.63	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	658,210	1.170	770,105.70	
	SAGE GROUP PLC	82,992	6.686	554,884.51	
	SAINSBURY (J) PLC	134,370	2.779	373,414.23	
	SCHRODERS PLC	9,647	32.280	311,405.16	
	SEVERN TRENT PLC	19,906	28.510	567,520.06	
	SHELL PLC-NEW	599,929	19.570	11,740,610.53	
	SMITH & NEPHEW PLC	69,358	11.960	829,521.68	
	SMITHS GROUP PLC	31,428	15.145	475,977.06	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,801	116.900	678,136.90	
	SSE PLC	82,170	16.120	1,324,580.40	
	ST JAMES'S PLACE PLC	42,517	15.165	644,770.30	
	STANDARD CHARTERED PLC	205,910	5.792	1,192,630.72	
	TAYLOR WIMPEY PLC	289,371	1.484	429,426.56	
	TESCO PLC	604,995	2.942	1,779,895.29	
	UNILEVER PLC	204,140	38.575	7,874,700.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,982	10.615	573,018.93	
	VODAFONE GROUP PLC	2,195,737	1.375	3,019,138.37	
	WHITBREAD PLC	15,876	31.110	493,902.36	
	WPP PLC	94,086	11.840	1,113,978.24	
イギリス・ポンド　小計		22,890,751		148,301,454.08 (23,218,075,651)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	3,404	282.500	961,630.00	
	BANK HAPOALIM BM	88,957	33.800	3,006,746.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	113,246	34.530	3,910,384.38	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,126	563.000	1,196,938.00	
	ICL GROUP LTD	55,164	33.680	1,857,923.52	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	90,940	21.380	1,944,297.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,172	124.500	1,390,914.00	

	NICE LTD	4,962	738.600	3,664,933.20	
イスラエル・シュケル　小計		369,971		17,933,766.90 (643,807,885)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	20,928	31.250	654,000.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	48,837	39.840	1,945,666.08	
	ASX LTD	16,282	81.910	1,333,658.62	
	AURIZON HOLDINGS LTD	174,131	3.710	646,026.01	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	229,464	28.150	6,459,411.60	
	BHP GROUP LIMITED	233,882	47.960	11,216,980.72	
	BLOCK INC - CDI	6,389	143.600	917,460.40	
	BLUESCOPE STEEL LTD	42,638	19.080	813,533.04	
	BRAMBLES LTD	124,300	10.130	1,259,159.00	
	COCHLEAR LTD	5,586	191.080	1,067,372.88	
	COLES GROUP LTD	109,841	16.550	1,817,868.55	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	140,612	97.750	13,744,823.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	46,798	22.800	1,066,994.40	
	CROWN RESORTS LTD	33,102	12.310	407,485.62	
	CSL LIMITED	36,085	265.570	9,583,093.45	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,020	101.400	509,028.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	118,058	6.510	768,557.58	
	EVOLUTION MINING LTD	153,637	4.140	636,057.18	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,466	19.850	2,669,150.10	
	IDP EDUCATION LTD	17,016	27.490	467,769.84	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	208,925	4.760	994,483.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,297	46.170	1,675,832.49	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,243	191.110	5,397,519.73	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	12,936	21.700	280,711.20	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	236,869	3.240	767,455.56	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	265,390	30.580	8,115,626.20	
	NEWCREST MINING LIMITED	67,289	24.360	1,639,160.04	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	90,820	9.580	870,055.60	
	ORICA LTD	36,197	14.850	537,525.45	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,658	5.650	856,867.70	
	QANTAS AIRWAYS LTD	84,492	5.310	448,652.52	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	121,681	11.550	1,405,415.55	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	16,019	64.260	1,029,380.94	
	REA GROUP LTD	4,714	133.670	630,120.38	
	REECE LTD	24,432	20.280	495,480.96	

	RIO TINTO LTD	29,806	119.250	3,554,365.50	
	SANTOS LTD	264,411	7.000	1,850,877.00	
	SEEK LTD	28,726	27.200	781,347.20	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,734	37.600	1,418,798.40	
	SOUTH32 LTD	386,263	4.570	1,765,221.91	
	SUNCORP GROUP LTD	110,933	11.420	1,266,854.86	
	TABCORP HOLDINGS LTD	190,889	5.250	1,002,167.25	
	TELSTRA CORP LTD	363,659	3.910	1,421,906.69	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	59,576	11.950	711,933.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	18,223	25.570	465,962.11	
	WESFARMERS LIMITED	91,606	50.410	4,617,858.46	
	WESTPAC BANKING CORP	294,754	23.530	6,935,561.62	
	WISETECH GLOBAL LTD	11,958	45.390	542,773.62	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,074	27.440	2,197,230.56	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,466	34.010	3,484,868.66	
	XERO LTD	10,882	103.000	1,120,846.00	
オーストラリア・ドル　小計		5,164,994		116,266,956.43 (9,617,602,636)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	35,465	70.090	2,485,741.85	
	AIR CANADA	14,345	25.400	364,363.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	54,765	17.750	972,078.75	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	64,318	49.660	3,194,031.88	
	ALTAGAS LTD	22,640	27.620	625,316.80	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	18,852	12.260	231,125.52	
	BANK OF MONTREAL	50,893	146.480	7,454,806.64	
	BANK OF NOVA SCOTIA	95,676	91.870	8,789,754.12	
	BARRICK GOLD CORP	139,647	29.530	4,123,775.91	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	24,194	30.540	738,884.76	
	BCE INC	7,191	66.720	479,783.52	
	BLACKBERRY LTD	42,500	8.490	360,825.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	111,124	67.910	7,546,430.84	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	10,350	44.360	459,126.00	
	CAE INC	24,881	32.440	807,139.64	
	CAMECO CORP	31,125	25.830	803,958.75	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	35,432	160.610	5,690,733.52	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	56,084	159.130	8,924,646.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	93,035	66.190	6,157,986.65	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	53,709	92.330	4,958,951.97	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,521	192.390	869,795.19	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10,797	34.980	377,679.06	
CANOPY GROWTH CORP	19,274	9.800	188,885.20	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	12,078	62.890	759,585.42	
CENOVUS ENERGY INC	102,655	19.600	2,012,038.00	
CGI INC	17,275	105.520	1,822,858.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,584	2,058.830	3,261,186.72	
DOLLARAMA INC	23,057	64.290	1,482,334.53	
EMERA INC	20,912	58.800	1,229,625.60	
EMPIRE CO LTD 'A'	13,164	39.430	519,056.52	
ENBRIDGE INC	159,941	52.550	8,404,899.55	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,048	645.670	1,322,332.16	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	45,993	33.950	1,561,462.35	
FIRSTSERVICE CORP	3,160	175.970	556,065.20	
FORTIS INC	38,020	57.760	2,196,035.20	
FRANCO-NEVADA CORP	14,961	188.610	2,821,794.21	
GEORGE WESTON LTD	6,017	137.930	829,924.81	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,647	36.280	458,833.16	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,684	48.460	760,046.64	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,519	39.030	878,916.57	
HYDRO ONE LTD	27,057	31.270	846,072.39	
IA FINANCIAL CORP INC	8,447	79.170	668,748.99	
IGM FINANCIAL INC	6,689	44.710	299,065.19	
IMPERIAL OIL LTD	19,328	55.400	1,070,771.20	
INTACT FINANCIAL CORP	13,954	183.610	2,562,093.94	
IVANHOE MINES LTD-CL A	47,602	11.120	529,334.24	
KEYERA CORP	17,476	30.030	524,804.28	
KINROSS GOLD CORP	94,657	7.420	702,354.94	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,410	33.930	285,351.30	
LOBLAW COS LTD	13,146	98.170	1,290,542.82	
LUNDIN MINING CORP	51,656	11.660	602,308.96	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,554	98.780	2,227,884.12	
MANULIFE FINANCIAL CORP	153,092	26.900	4,118,174.80	
METRO INC	19,474	66.930	1,303,394.82	
NATIONAL BANK OF CANADA	26,633	101.640	2,706,978.12	
NORTHLAND POWER INC	18,104	36.930	668,580.72	
NUTRIEN LTD	44,877	96.690	4,339,157.13	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,452	67.650	301,177.80	
ONEX CORPORATION	5,982	87.370	522,647.34	
OPEN TEXT CORP	21,719	54.510	1,183,902.69	
PAN AMERICAN SILVER CORP	16,623	30.500	507,001.50	

	PARKLAND CORP	12,391	33.670	417,204.97	
	PEMBINA PIPELINE CORP	43,369	42.230	1,831,472.87	
	POWER CORP OF CANADA	44,278	40.290	1,783,960.62	
	QUEBECOR INC -CL B	13,666	30.100	411,346.60	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	22,696	72.780	1,651,814.88	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	8,780	65.430	574,475.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	28,487	66.330	1,889,542.71	
	ROYAL BANK OF CANADA	112,307	141.050	15,840,902.35	
	SAPUTO INC	20,047	30.970	620,855.59	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	36,018	37.300	1,343,471.40	
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,898	837.000	7,447,626.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	46,313	67.680	3,134,463.84	
	SUNCOR ENERGY INC	116,739	37.060	4,326,347.34	
	TC ENERGY CORP	77,234	66.810	5,160,003.54	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	36,904	45.300	1,671,751.20	
	TFI INTERNATIONAL INC	6,724	130.440	877,078.56	
	THOMSON REUTERS CORP	13,638	127.800	1,742,936.40	
	TMX GROUP LTD	4,618	124.830	576,464.94	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,650	107.930	717,734.50	
	TORONTO-DOMINION BANK	143,403	106.230	15,233,700.69	
	TOURMALINE OIL CORP	24,119	46.130	1,112,609.47	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,448	123.190	917,519.12	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	35,274	55.490	1,957,354.26	
	WSP GLOBAL INC	9,256	149.990	1,388,307.44	
カナダ・ドル　小計		3,053,722		197,372,108.11 (17,824,675,083)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	210,300	3.750	788,625.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	34,800	7.340	255,432.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	142,000	36.450	5,175,900.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	469,500	0.790	370,905.00	
	KEPPEL CORP LTD	117,200	6.050	709,060.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	265,800	13.270	3,527,166.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	107,200	5.420	581,024.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	63,000	9.620	606,060.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	125,600	3.860	484,816.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	660,200	2.550	1,683,510.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	92,800	32.570	3,022,496.00	
	UOL Group Limited	37,100	7.300	270,830.00	
	VENTURE CORP LTD	21,400	18.060	386,484.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	149,700	4.710	705,087.00	
シンガポール・ドル　小計		2,496,600		18,567,395.00	

				(1,588,440,642)	
スイス・フラン	ABB LTD	129,192	31.690	4,094,094.48	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,281	47.120	578,680.72	
	ALCON INC	39,234	70.440	2,763,642.96	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	477	500.000	238,500.00	
	BALOISE HOLDING AG	3,666	157.600	577,761.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	281	2,098.000	589,538.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	82	10,010.000	820,820.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	103,600.000	828,800.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	41,017	129.350	5,305,548.95	
	CLARIANT AG	17,426	16.560	288,574.56	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	208,549	8.286	1,728,037.01	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	549	921.000	505,629.00	
	GEBERIT AG-REG	2,827	600.800	1,698,461.60	
	GIVAUDAN-REG	726	3,650.000	2,649,900.00	
	HOLCIM LTD	41,162	50.060	2,060,569.72	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,364	58.300	1,012,321.20	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,329	248.700	1,076,622.30	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,552	68.240	924,788.48	
	LONZA GROUP AG	5,856	599.600	3,511,257.60	
	NESTLE SA	221,174	118.200	26,142,766.80	
	NOVARTIS AG	172,297	79.830	13,754,469.51	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,777	1,232.000	2,189,264.00	
	ROCHE HOLDING AG	55,179	342.550	18,901,566.45	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,518	372.000	936,696.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,718	206.400	354,595.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,105	209.300	649,876.50	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	475	2,587.000	1,228,825.00	
	SIKA AG-BEARER	11,146	293.400	3,270,236.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,287	324.300	1,390,274.10	
	STRAUMANN HOLDING AG	810	1,433.000	1,160,730.00	
	SWATCH GROUP AG	2,148	286.200	614,757.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,473	586.600	1,450,661.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,165	89.800	553,617.00	
	SWISS RE AG	23,713	97.800	2,319,131.40	
	SWISSCOM AG	2,084	549.000	1,144,116.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	5,297	97.740	517,728.78	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,769	55.200	263,248.80	
	UBS GROUP AG	276,142	18.650	5,150,048.30	

	VAT GROUP AG	2,095	338.800	709,786.00	
	VIFOR PHARMA AG	3,855	162.100	624,895.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,811	433.800	5,123,611.80	
スイス・フラン　小計		1,353,616		119,704,451.12 (14,959,465,256)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	24,718	293.900	7,264,620.20	
	ASSA ABLOY AB	79,409	268.700	21,337,198.30	
	ATLAS COPCO AB	30,789	435.300	13,402,451.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,733	494.000	26,050,102.00	
	BOLIDEN AB	21,119	403.500	8,521,516.50	
	ELECTROLUX AB	17,782	179.350	3,189,201.70	
	EMBRACER GROUP AB	37,337	81.410	3,039,605.17	
	EPIROC AB-A	51,145	190.100	9,722,664.50	
	EPIROC AB-B	31,414	163.600	5,139,330.40	
	EQT AB	23,158	321.800	7,452,244.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,075	263.800	12,682,185.00	
	EVOLUTION AB	13,461	991.900	13,351,965.90	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	8,266	588.400	4,863,714.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,703	351.000	6,213,753.00	
	HENNES & MAURITZ AB	57,740	173.900	10,040,986.00	
	HEXAGON AB-B SHS	154,752	122.150	18,902,956.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	32,491	115.150	3,741,338.65	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,146	280.600	2,846,967.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,824	276.100	3,540,706.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,441	259.800	2,972,371.80	
	INVESTOR AB	141,507	194.260	27,489,149.82	
	INVESTOR AB-A SHS	39,964	209.100	8,356,472.40	
	KINNEVIK AB - B	18,702	237.950	4,450,140.90	
	LIFCO AB-B SHS	18,181	202.700	3,685,288.70	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,949	462.000	2,748,438.00	
	LUNDIN ENERGY AB	15,696	322.300	5,058,820.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	111,863	77.200	8,635,823.60	
	NORDEA BANK ABP	254,168	109.320	27,785,645.76	
	SAGAX AB-B	12,443	254.000	3,160,522.00	
	SANDVIK AB	88,842	237.200	21,073,322.40	
	SECURITAS AB	24,851	114.850	2,854,137.35	
	SINCH AB	40,902	67.080	2,743,706.16	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	127,973	118.450	15,158,401.85	
	SKANSKA AB-B SHS	27,181	235.000	6,387,535.00	
	SKF AB	30,111	186.200	5,606,668.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB	47,767	163.650	7,817,069.55	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	115,152	95.260	10,969,379.52	
	SWEDBANK AB - A SHARES	70,887	166.200	11,781,419.40	
	SWEDISH MATCH AB	124,294	70.900	8,812,444.60	

	TELE2 AB	41,041	130.700	5,364,058.70	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	229,409	94.130	21,594,269.17	
	TELIA CO AB	219,266	37.205	8,157,791.53	
	VOLVO AB	111,678	205.450	22,944,245.10	
	VOLVO AB-A SHS	16,589	208.800	3,463,783.20	
スウェーデン・クローナ　小計		2,670,919		430,374,414.13 (5,267,782,829)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	456	22,940.000	10,460,640.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	258	21,940.000	5,660,520.00	
	AMBU A/S-B	13,161	106.050	1,395,724.05	
	CARLSBERG AS-B	7,886	1,058.000	8,343,388.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,367	460.200	3,850,493.40	
	COLOPLAST-B	9,323	909.400	8,478,336.20	
	DANSKE BANK A/S	54,202	125.400	6,796,930.80	
	DEMANT A/S	8,422	267.900	2,256,253.80	
	DSV A/S	16,266	1,212.500	19,722,525.00	
	GENMAB A/S	5,153	2,099.000	10,816,147.00	
	GN STORE NORD A/S	9,783	332.900	3,256,760.70	
	NOVO-NORDISK A/S	132,207	661.800	87,494,592.60	
	NOVOZYMES A/S	16,064	390.600	6,274,598.40	
	ORSTED A/S	14,862	671.800	9,984,291.60	
	PANDORA A/S	7,801	695.600	5,426,375.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	660	2,700.000	1,782,000.00	
	TRYGVESTA AS	28,613	151.800	4,343,453.40	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	79,321	164.350	13,036,406.35	
デンマーク・クローネ　小計		412,805		209,379,436.90 (3,670,421,529)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	106,192	7.120	756,087.04	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,427	28.810	1,308,751.87	
	MERCURY NZ LTD	55,369	5.920	327,784.48	
	MERIDIAN ENERGY LTD	101,467	5.055	512,915.68	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	34,225	9.400	321,715.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	157,003	4.535	712,008.60	
ニュージーランド・ドル　小計		499,683		3,939,262.67 (303,638,367)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	20,426	80.100	1,636,122.60	
	AKER BP ASA	9,853	256.800	2,530,250.40	
	DNB BANK ASA	73,513	209.000	15,364,217.00	
	EQUINOR ASA	76,753	268.300	20,592,829.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,200	213.700	3,461,940.00	
	MOWI ASA	34,626	228.600	7,915,503.60	
	NORSK HYDRO ASA	104,316	77.200	8,053,195.20	
	ORKLA ASA	59,427	83.960	4,989,490.92	

	SCHIBSTED ASA	5,582	230.500	1,286,651.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	7,798	204.200	1,592,351.60	
	TELENOR ASA	58,889	136.500	8,038,348.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,968	448.300	5,813,554.40	
ノルウェー・クローネ　小計		480,351		81,274,455.12 (1,042,751,259)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	32,958	12.668	417,511.94	
	ACCOR	13,419	32.890	441,350.91	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,746	22.320	440,730.72	
	ADIDAS AG	14,982	229.400	3,436,870.80	
	ADP	2,788	132.650	369,828.20	
	ADYEN NV	1,554	1,823.400	2,833,563.60	
	AEGON NV	138,599	4.758	659,454.04	
	AENA SME SA	6,359	149.550	950,988.45	
	AGEAS	13,471	42.750	575,885.25	
	AIR LIQUIDE	37,248	150.740	5,614,763.52	
	AIRBUS SE	46,355	115.000	5,330,825.00	
	AKZO NOBEL NV	14,746	91.360	1,347,194.56	
	ALLIANZ SE	32,363	214.100	6,928,918.30	
	ALSTOM RGPT	25,056	25.640	642,435.84	
	AMADEUS IT GROUP SA	35,435	61.340	2,173,582.90	
	AMPLIFON SPA	9,690	35.540	344,382.60	
	AMUNDI SA	4,828	66.600	321,544.80	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,027	55.820	3,350,707.14	
	ARCELORMITTAL	52,081	26.940	1,403,062.14	
	ARGENX SE	3,620	247.900	897,398.00	
	ARKEMA	4,756	126.500	601,634.00	
	AROUNDTOWN SA	80,684	5.468	441,180.11	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,651	286.000	1,044,186.00	
	ASML HOLDING NV	32,471	570.400	18,521,458.40	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	86,227	18.540	1,598,648.58	
	ATLANTIA SPA	40,483	16.540	669,588.82	
	AXA SA	151,565	26.920	4,080,129.80	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	520,965	5.712	2,975,752.08	
	BANCO SANTANDER SA	1,357,206	3.322	4,508,638.33	
	BASF SE	72,235	67.260	4,858,526.10	
	BAYER AG	77,332	54.000	4,175,928.00	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,002	95.380	2,480,070.76	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,434	80.100	355,163.40	
	BECHTLE AG	6,363	46.250	294,288.75	
	BEIERSDORF AG	7,937	91.120	723,219.44	
	BIOMERIEUX	3,229	99.880	322,512.52	
	BNP PARIBAS	88,099	61.920	5,455,090.08	

BOLLORE	69,675	4.786	333,464.55	
BOUYGUES	17,907	32.700	585,558.90	
BRENNTAG SE	12,054	78.500	946,239.00	
BUREAU VERITAS SA	23,327	24.470	570,811.69	
CAIXABANK	342,260	3.236	1,107,553.36	
CAPGEMINI SA	12,572	185.950	2,337,763.40	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,137	132.200	414,711.40	
CARREFOUR SA	48,971	18.180	890,292.78	
CELLNEX TELECOM SAU	40,320	38.320	1,545,062.40	
CIE DE SAINT-GOBAIN	39,770	61.850	2,459,774.50	
CNH INDUSTRIAL NV	80,309	13.885	1,115,090.46	
CNP ASSURANCES	13,325	21.800	290,485.00	
COLRUYT NV	4,046	35.920	145,332.32	
COMMERZBANK AG	78,221	9.210	720,415.41	
CONTINENTAL AG	8,630	87.510	755,211.30	
COVESTRO AG	15,046	52.800	794,428.80	
CREDIT AGRICOLE SA	96,929	13.056	1,265,505.02	
CRH PLC	61,110	43.280	2,644,840.80	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,564	31.275	1,049,714.10	
DANONE	51,380	55.880	2,871,114.40	
DASSAULT AVIATION SA	1,942	115.000	223,330.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	52,163	40.690	2,122,512.47	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	40,898	10.570	432,291.86	
DELIVERY HERO SE	12,773	47.070	601,225.11	
DEUTSCHE BANK AG	162,060	13.564	2,198,181.84	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,961	156.350	2,339,152.35	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	47,463	7.534	357,586.24	
DEUTSCHE POST AG	78,684	49.150	3,867,318.60	
DEUTSCHE TELEKOM AG	263,906	17.076	4,506,458.85	
DIASORIN SPA	1,941	117.300	227,679.30	
E.ON SE	176,719	12.126	2,142,894.59	
EDENRED	19,858	37.690	748,448.02	
EDF	37,093	8.140	301,937.02	
EDP RENOVAVEIS SA	22,399	18.400	412,141.60	
EIFFAGE	6,685	96.780	646,974.30	
ELIA GROUP SA/NV	2,509	118.000	296,062.00	
ELISA OYJ	11,417	51.140	583,865.38	
ENAGAS SA	19,344	18.310	354,188.64	
ENDESA SA	24,925	18.770	467,842.25	
ENEL SPA	639,292	6.435	4,113,844.02	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	218,488	3.962	865,649.45	
ENGIE	143,744	14.480	2,081,413.12	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	197,378	13.470	2,658,681.66	
ERSTE GROUP BANK AG	27,028	40.260	1,088,147.28	
ESSILORLUXOTTICA	22,577	166.980	3,769,907.46	
EURAZEO	3,115	69.950	217,894.25	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,487	85.500	896,638.50	

EURONEXT NV	6,720	80.800	542,976.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	16,329	29.000	473,541.00	
EXOR NV	8,492	72.220	613,292.24	
FAURECIA	9,216	39.640	365,322.24	
FERRARI NV	9,912	194.500	1,927,884.00	
FERROVIAL S.A.	38,798	24.590	954,042.82	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	159,514	16.692	2,662,607.68	
FINECOBANK SPA	47,533	15.985	759,815.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	13,007	126.350	1,643,434.45	
FORTUM OYJ	34,959	22.770	796,016.43	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	16,121	59.360	956,942.56	
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,856	37.075	1,218,136.20	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	5,369	37.660	202,196.54	
GALP ENERGIA SGPS SA	39,890	10.000	398,900.00	
GEA GROUP AG	11,914	41.180	490,618.52	
GETLINK SE - REGR	39,604	14.325	567,327.30	
GRIFOLS SA	23,524	14.600	343,450.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,921	93.500	834,113.50	
HANNOVER RUECK SE	4,723	173.100	817,551.30	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,763	65.700	772,829.10	
HEINEKEN HOLDING NV	9,160	78.700	720,892.00	
HEINEKEN NV	20,424	98.300	2,007,679.20	
HELLOFRESH SE	12,929	47.870	618,911.23	
HENKEL AG & CO KGAA	8,260	71.500	590,590.00	
HENKEL KGAA-VORZUG	13,952	73.740	1,028,820.48	
HERMES INTERNATIONAL	2,488	1,203.000	2,993,064.00	
IBERDROLA SA	449,621	9.290	4,176,979.09	
IMCD NV	4,430	139.650	618,649.50	
INDITEX SA	85,521	25.350	2,167,957.35	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	102,683	31.310	3,215,004.73	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	27,984	8.758	245,083.87	
ING GROEP NV-CVA	306,086	12.610	3,859,744.46	
INPOST SA	16,925	5.673	96,015.52	
INTESA SANPAOLO	1,296,125	2.722	3,528,052.25	
IPSEN	2,903	98.860	286,990.58	
JDE PEET'S BV	8,143	27.125	220,878.87	
JERONIMO MARTINS	21,739	19.990	434,562.61	
JUST EAT TAKEAWAY	14,251	35.995	512,964.74	
KBC GROEP NV	19,541	74.420	1,454,241.22	
KERING	5,895	666.600	3,929,607.00	
KERRY GROUP PLC-A	12,484	109.750	1,370,119.00	
KESKO OYJ-B SHS	21,070	26.170	551,401.90	
KINGSPAN GROUP PLC	12,055	88.380	1,065,420.90	
KION GROUP AG	5,651	79.600	449,819.60	

KNORR-BREMSE AG	5,778	91.780	530,304.84	
KONE OYJ	26,755	52.500	1,404,637.50	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	81,500	27.085	2,207,427.50	
KONINKLIJKE DSM NV	13,713	160.800	2,205,050.40	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,977	30.020	2,160,749.54	
L'OREAL SA	19,691	360.750	7,103,528.25	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	7,314	36.610	267,765.54	
LANXESS	6,489	51.060	331,328.34	
LEG IMMOBILIEN SE	5,745	112.850	648,323.25	
LEGRAND SA	21,043	86.020	1,810,118.86	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,817	686.300	14,973,007.10	
MEDIOBANCA SPA	48,605	10.205	496,014.02	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	67,128	75.590	5,074,205.52	
MERCK KGAA	10,125	177.300	1,795,162.50	
MICHELIN (C.G.D.E.)	13,285	135.450	1,799,453.25	
MONCLER SPA	16,097	55.080	886,622.76	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,195	208.000	872,560.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	10,976	261.600	2,871,321.60	
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,263	24.280	370,585.64	
NEMETSCHEK SE	4,468	74.900	334,653.20	
NESTE OYJ	33,023	35.270	1,164,721.21	
NEXI SPA	36,873	12.295	453,353.53	
NN GROUP NV	20,951	49.760	1,042,521.76	
NOKIA OYJ	422,456	5.025	2,122,841.40	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	5,282	94.000	496,508.00	
OMV AG	11,303	54.160	612,170.48	
ORANGE S.A.	159,876	11.012	1,760,554.51	
ORION OYJ-CLASS B	8,225	44.940	369,631.50	
ORPEA	4,129	36.710	151,575.59	
PERNOD-RICARD	16,450	197.100	3,242,295.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	11,875	84.220	1,000,112.50	
POSTE ITALIANE SPA	43,394	11.035	478,852.79	
PROSUS	73,390	64.550	4,737,324.50	
PROXIMUS	12,643	18.600	235,159.80	
PRYSMIAN SPA	19,942	28.840	575,127.28	
PUBLICIS GROUPE	17,812	62.580	1,114,674.96	
PUMA AG	8,322	90.300	751,476.60	
QIAGEN NV	17,970	43.140	775,225.80	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	11,253	24.880	279,974.64	
RANDSTAD NV	9,309	65.680	611,415.12	
RATIONAL AG	401	663.600	266,103.60	

RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,148	46.200	376,437.60	
RED ELECTRICA DE ESPANA	33,785	16.970	573,331.45	
REMY COINTREAU	1,767	177.000	312,759.00	
RENAULT SA	15,107	36.325	548,761.77	
REPSOL SA	113,216	11.734	1,328,476.54	
ROYAL KPN NV	270,360	3.096	837,034.56	
RWE AG	50,285	38.340	1,927,926.90	
SAFRAN SA	26,853	113.440	3,046,204.32	
SAMPO OYJ	39,092	43.360	1,695,029.12	
SANOFI	89,352	93.030	8,312,416.56	
SAP SE	82,022	102.260	8,387,569.72	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,054	399.100	819,751.40	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,167	331.000	717,277.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,445	144.840	6,147,733.80	
SCOUT24 SE	6,851	51.040	349,675.04	
SEB SA	2,183	135.100	294,923.30	
SIEMENS AG	60,108	136.340	8,195,124.72	
SIEMENS ENERGY AG	31,409	18.420	578,553.78	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	18,760	16.280	305,412.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	22,099	52.980	1,170,805.02	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,245	48.770	938,578.65	
SNAM SPA	157,185	4.812	756,374.22	
SOCIETE GENERALE	63,163	32.370	2,044,586.31	
SODEXO	6,912	79.980	552,821.76	
SOFINA	1,176	341.800	401,956.80	
SOLVAY SA	5,863	108.300	634,962.90	
STMICROELECTRONICS NV	53,587	38.250	2,049,702.75	
STORA ENSO OYJ	45,335	18.285	828,950.47	
SYMRISE AG	10,116	103.300	1,044,982.80	
TELECOM ITALIA SPA	787,704	0.406	319,807.82	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	86,572	2.638	228,376.93	
TELEFONICA SA	402,076	4.369	1,756,670.04	
TELEPERFORMANCE	4,614	330.400	1,524,465.60	
TENARIS SA	35,880	11.305	405,623.40	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	110,766	6.742	746,784.37	
THALES SA	8,329	84.440	703,300.76	
TOTALENERGIES SE	196,996	50.660	9,979,817.36	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,313	45.640	333,765.32	
UCB SA	9,918	87.120	864,056.16	
UMICORE	15,458	36.770	568,390.66	
UNICREDIT SPA	166,588	14.632	2,437,515.61	
UNIPER SE	7,270	38.410	279,240.70	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,771	34.190	265,690.49	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	57,083	19.764	1,128,188.41	

	UPM-KYMMENE OYJ	41,749	33.050	1,379,804.45	
	VALEO SA	18,067	26.080	471,187.36	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,529	32.560	1,677,784.24	
	VINCI SA	42,437	100.980	4,285,288.26	
	VIVENDI SA	59,789	11.450	684,584.05	
	VOESTALPINE AG	8,950	30.720	274,944.00	
	VOLKSWAGEN AG	2,590	242.200	627,298.00	
	VOLKSWAGEN AG	14,595	180.100	2,628,559.50	
	VONOVIA SE	58,131	46.610	2,709,485.91	
	WARTSILA OYJ	37,026	10.170	376,554.42	
	WENDEL	2,200	91.350	200,970.00	
	WOLTERS KLUWER NV	21,027	87.020	1,829,769.54	
	WORLDLINE SA	18,831	44.165	831,671.11	
	ZALANDO SE	17,476	59.480	1,039,472.48	
ユーロ　小計		14,457,074		372,558,725.20 (48,566,755,417)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	951,875	88.000	83,765,000.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	294,039	31.350	9,218,122.65	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	136,400	23.100	3,150,840.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	156,200	16.220	2,533,564.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	157,909	53.050	8,377,072.45	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,909	59.750	12,721,312.75	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	54,000	50.900	2,748,600.00	
	CLP HOLDINGS LTD	130,643	79.850	10,431,843.55	
	ESR CAYMAN LTD	158,000	25.700	4,060,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	171,810	48.650	8,358,556.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	162,157	16.320	2,646,402.24	
	HANG SENG BANK LTD	60,912	166.000	10,111,392.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	117,641	34.600	4,070,378.60	
	HONG KONG & CHINA GAS	893,437	12.120	10,828,456.44	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,611	434.200	41,080,096.20	
	MTR CORP	134,755	42.800	5,767,514.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	125,917	32.950	4,148,965.15	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	110,587	50.050	5,534,879.35	
	SANDS CHINA LTD	194,580	24.050	4,679,649.00	
	SINO LAND CO	266,000	10.400	2,766,400.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	114,000	32.800	3,739,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	103,523	98.600	10,207,367.80	

	SWIRE PACIFIC LTD	40,866	48.200	1,969,741.20	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,800	21.150	2,047,320.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	108,000	133.000	14,364,000.00	
	WH GROUP LTD	652,500	5.730	3,738,825.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	132,733	37.000	4,911,121.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	143,000	21.650	3,095,950.00	
香港・ドル　小計		5,975,804		281,073,169.88 (4,145,829,256)	
合計		84,800,997		475,911,780,813 (475,911,780,813)	

（２）株式以外の有価証券

2022年2月21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	41,186.00	553,539.84	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,362.00	2,108,900.82	
		AMERICAN TOWER REIT INC	35,774.00	8,172,212.56	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	113,327.00	805,754.97	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,919.00	2,566,947.71	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,667.00	1,414,040.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,790.00	1,261,201.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	33,987.00	5,517,449.58	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,200.00	3,001,440.00	
		DUKE REALTY CORP	29,529.00	1,562,674.68	
		EQUINIX INC	7,051.00	4,885,919.94	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,631.00	1,027,641.09	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,859.00	2,350,185.24	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,088.00	1,604,907.84	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,449.00	1,958,978.52	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	42,193.00	1,338,783.89	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,311.00	1,076,103.21	
		INVITATION HOMES INC	45,051.00	1,739,869.62	
		IRON MOUNTAIN INC	22,710.00	976,757.10	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	47,006.00	963,623.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,020.00	1,844,048.80	
		PROLOGIS INC	58,039.00	8,273,459.45	
		PUBLIC STORAGE	12,339.00	4,239,186.84	
		REALTY INCOME CORP	43,094.00	2,871,353.22	
		REGENCY CENTERS CORP	11,868.00	789,222.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,610.00	2,503,960.20	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	25,798.00	3,636,228.10	

		SUN COMMUNITIES INC	9,064.00	1,680,103.04	
		UDR INC	23,244.00	1,260,754.56	
		VENTAS INC	30,859.00	1,633,675.46	
		VICI PROPERTIES INC	48,315.00	1,348,954.80	
		VORNADO REALTY TRUST	12,857.00	572,007.93	
		WELLTOWER INC	33,190.00	2,750,123.40	
		WP CAREY INC	14,420.00	1,101,111.20	
	アメリカ・ドル　小計		935,807.00	79,391,120.01 (9,134,742,269)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,533.00	377,286.05	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	55,552.00	446,304.76	
		SEGRO PLC	93,583.00	1,184,292.86	
	イギリス・ポンド　小計		218,668.00	2,007,883.67 (314,354,267)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	94,398.00	1,007,226.66	
		GOODMAN GROUP	135,321.00	3,120,502.26	
		GPT GROUP	164,276.00	813,166.20	
		MIRVAC GROUP	337,075.00	869,653.50	
		SCENTRE GROUP	424,223.00	1,349,029.14	
		STOCKLAND	199,653.00	822,570.36	
		VICINITY CENTRES	331,475.00	628,145.12	
	オーストラリア・ドル　小計		1,686,421.00	8,610,293.24 (712,243,457)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,685.00	366,070.60	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	12,377.00	306,206.98	
	カナダ・ドル　小計		19,062.00	672,277.58 (60,713,388)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	265,200.00	750,516.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	385,490.00	824,948.60	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	168,000.00	310,800.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	238,300.00	419,408.00	
	シンガポール・ドル　小計		1,056,990.00	2,305,672.60 (197,250,291)	
	ユーロ	COVIVIO	4,043.00	303,063.28	
		GECINA SA	3,576.00	418,928.40	
		KLEPIERRE	15,875.00	415,925.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	9,794.00	697,920.44	
	ユーロ　小計		33,288.00	1,835,837.12 (239,319,727)	
	香港・ドル	LINK REIT	165,171.00	10,893,027.45	
	香港・ドル　小計		165,171.00	10,893,027.45 (160,672,155)	
投資証券　合計			4,115,407	10,819,295,554	

		(10,819,295,554)	
合計		10,819,295,554 (10,819,295,554)	

（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	607銘柄	68.09	－	72.77
	投資証券	34銘柄	－	1.80	
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.58	－	4.83
	投資証券	3銘柄	－	0.06	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.13	－	0.13
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄	1.90	－	2.12
	投資証券	7銘柄	－	0.14	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.52	－	3.67
	投資証券	2銘柄	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.31	－	0.37
	投資証券	4銘柄	－	0.04	
スイス・フラン	株式	41銘柄	2.95	－	3.07
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	1.04	－	1.08
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.72	－	0.75
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.06	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.21	－	0.21
ユーロ	株式	227銘柄	9.58	－	10.03
	投資証券	4銘柄	－	0.05	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.82	－	0.88
	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）

	2022年2月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	149,012,400
金銭信託	962,017
コール・ローン	172,084,482
国債証券	47,865,684,205
未収入金	465,444
未収利息	240,754,586
前払費用	23,218,963
流動資産合計	48,452,182,097
資産合計	48,452,182,097
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	339,009
未払金	44,055,591
未払解約金	83,967,186
その他未払費用	266
流動負債合計	128,362,052
負債合計	128,362,052
純資産の部	
元本等	
元本	32,684,205,869
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,639,614,176
元本等合計	48,323,820,045
純資産合計	48,323,820,045
負債純資産合計	48,452,182,097

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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		2022年2月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	24,370,479,823円
	同期中追加設定元本額	13,127,250,742円
	同期中一部解約元本額	4,813,524,696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）	3,061,937,241円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,125,464,973円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,899,921,672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）	811,061,820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）	3,604,538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）	7,985,469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）	6,492,392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	13,115,550,213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）	3,089,281,829円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	2,636,337,091円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	141,936,081円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,507,249,210円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	171,661,390円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	348,191,397円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	63,955,460円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	143,224,504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）	15,549,308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）	38,903,398円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	96,083,698円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	71,470,650円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	160,400,109円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	167,169,197円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	670,326円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	103,903円
	計	32,684,205,869円
２．	受益権の総数	32,684,205,869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　2021年2月23日 至　2022年2月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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	2022年2月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短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	2022年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,089,001,162
合計	△2,089,001,162

（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23日から2022年2月21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	2022年2月21日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	79,858,400	－	79,519,391	△339,009
アメリカ・ドル	58,833,779	－	58,656,734	△177,045
イギリス・ポンド	2,227,020	－	2,221,333	△5,687
カナダ・ドル	1,253,058	－	1,243,757	△9,301
ユーロ	17,544,543	－	17,397,567	△146,976
合計	79,858,400	－	79,519,391	△339,009

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（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）

	2022年2月21日現在
1口当たり純資産額	1.4785円
（1万口当たり純資産額）	(14,785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

2022年2月21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	147,763.20	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	145,419.60	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	219,033.10	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	116,257.00	
		US TREASURY N/B	430,000.00	458,147.80	
		US TREASURY N/B	160,000.00	209,443.20	
		US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,836,416.40	
		US TREASURY N/B	4,090,000.00	4,115,235.30	
		US TREASURY N/B	590,000.00	640,421.40	
		US TREASURY N/B	440,000.00	534,239.20	
		US TREASURY N/B	3,790,000.00	3,854,695.30	
		US TREASURY N/B	4,090,000.00	4,181,370.60	
		US TREASURY N/B	440,000.00	544,258.00	
		US TREASURY N/B	4,170,000.00	4,272,123.30	
		US TREASURY N/B	4,530,000.00	4,623,408.60	
		US TREASURY N/B	3,850,000.00	3,921,263.50	
		US TREASURY N/B	550,000.00	623,067.50	
		US TREASURY N/B	6,640,000.00	6,747,634.40	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,542,528.80	
		US TREASURY N/B	2,930,000.00	2,966,156.20	
		US TREASURY N/B	380,000.00	428,507.00	
		US TREASURY N/B	470,000.00	572,206.20	
		US TREASURY N/B	430,000.00	505,602.60	
		US TREASURY N/B	500,000.00	555,840.00	
		US TREASURY N/B	650,000.00	664,625.00	
		US TREASURY N/B	320,000.00	356,336.00	
		US TREASURY N/B	430,000.00	470,093.20	
		US TREASURY N/B	3,840,000.00	3,868,915.20	
		US TREASURY N/B	3,570,000.00	3,628,262.40	
		US TREASURY N/B	260,000.00	290,557.80	
		US TREASURY N/B	3,060,000.00	3,038,365.80	
		US TREASURY N/B	520,000.00	533,343.20	
		US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,766,318.40	
		US TREASURY N/B	3,110,000.00	3,085,431.00	
		US TREASURY N/B	540,000.00	553,942.80	
		US TREASURY N/B	1,980,000.00	1,981,465.20	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,721,387.60	
		US TREASURY N/B	640,000.00	626,995.20	
		US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,188,724.00	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,778,987.50	
		US TREASURY N/B	300,000.00	329,730.00	
		US TREASURY N/B	2,460,000.00	2,494,956.60	
		US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,519,740.40	
		US TREASURY N/B	590,000.00	663,750.00	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,449,572.40	
		US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,775,412.50	

		US TREASURY N/B	450,000.00	507,600.00	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	2,049,812.80	
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,163,311.60	
		US TREASURY N/B	640,000.00	692,448.00	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,166,985.40	
		US TREASURY N/B	2,490,000.00	2,539,600.80	
		US TREASURY N/B	130,000.00	170,071.20	
		US TREASURY N/B	650,000.00	703,417.00	
		US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,585,225.20	
		US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,316,610.40	
		US TREASURY N/B	150,000.00	199,071.00	
		US TREASURY N/B	740,000.00	840,418.00	
		US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,767,558.00	
		US TREASURY N/B	2,050,000.00	2,166,194.00	
		US TREASURY N/B	800,000.00	930,624.00	
		US TREASURY N/B	150,000.00	178,077.00	
		US TREASURY N/B	230,000.00	298,530.80	
		US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,424,629.20	
		US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,984,124.00	
		US TREASURY N/B	880,000.00	1,001,748.00	
		US TREASURY N/B	250,000.00	334,170.00	
		US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,261,606.50	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,333,967.20	
		US TREASURY N/B	890,000.00	1,084,162.40	
		US TREASURY N/B	260,000.00	342,620.20	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,350,520.40	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,234,704.80	
		US TREASURY N/B	940,000.00	1,075,228.40	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,622,931.20	
		US TREASURY N/B	970,000.00	1,000,419.20	
		US TREASURY N/B	270,000.00	366,503.40	
		US TREASURY N/B	910,000.00	1,019,263.70	
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,344,656.60	
		US TREASURY N/B	900,000.00	882,909.00	
		US TREASURY N/B	860,000.00	853,782.20	
		US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,972,109.90	
		US TREASURY N/B	670,000.00	662,931.50	
		US TREASURY N/B	260,000.00	322,956.40	
		US TREASURY N/B	800,000.00	816,120.00	
		US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,853,676.00	
		US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,105,754.40	
		US TREASURY N/B	260,000.00	338,070.20	
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	959,871.00	
		US TREASURY N/B	130,000.00	179,994.10	
		US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,455,771.00	
		US TREASURY N/B	470,000.00	442,458.00	
		US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,097,924.00	
		US TREASURY N/B	790,000.00	649,435.30	
		US TREASURY N/B	270,000.00	373,253.40	

	US TREASURY N/B	850,000.00	791,426.50	
	US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,842,499.00	
	US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,075,012.40	
	US TREASURY N/B	980,000.00	802,375.00	
	US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,648,204.00	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,279,550.60	
	US TREASURY N/B	2,140,000.00	1,960,347.00	
	US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,126,600.00	
	US TREASURY N/B	1,080,000.00	922,471.20	
	US TREASURY N/B	3,560,000.00	3,475,450.00	
	US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,497,235.60	
	US TREASURY N/B	2,080,000.00	1,943,011.20	
	US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,324,589.50	
	US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,217,776.00	
	US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,023,647.60	
	US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,020,038.00	
	US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,172,421.40	
	US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,504,045.20	
	US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,384,862.40	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,441,335.00	
	US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,252,778.80	
	US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,154,729.70	
	US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,383,858.00	
	US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,352,175.00	
	US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,257,001.10	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,296,406.40	
	US TREASURY N/B	1,870,000.00	1,778,164.30	
	US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,947,500.00	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,245,243.20	
	US TREASURY N/B	270,000.00	304,392.60	
	US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,052,069.10	
	US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,066,255.60	
	US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,381,603.20	
	US TREASURY N/B	280,000.00	316,388.80	
	US TREASURY N/B	270,000.00	299,573.10	
	US TREASURY N/B	310,000.00	330,512.70	
	US TREASURY NOTES	150,000.00	199,675.50	
	WI TREASURY SEC.	250,000.00	330,427.50	
	WI TREASURY SEC.	1,170,000.00	916,437.60	
	WI TREASURY SEC.	1,580,000.00	1,425,207.40	
	WI TREASURY SEC.	250,000.00	331,250.00	
	WI TREASURY SEC.	230,000.00	282,189.30	
アメリカ・ドル　小計		197,920,000.00 (22,772,675,200)	198,928,513.70 (22,888,714,790)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	500,414.40	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	345,157.80	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	511,183.00	
	UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	414,296.40	

		UNITED KINGDOM GILT	220,000.00	228,091.60	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	509,497.40	
		UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	357,535.00	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	266,783.40	
		UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	404,112.10	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	263,125.20	
		UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	348,351.50	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	390,434.80	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	371,609.80	
		UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	498,320.00	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	303,451.20	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	260,374.40	
		UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	417,606.00	
		UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	559,769.60	
		UNITED KINGDOM GILT	220,000.00	225,530.80	
		UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	274,483.20	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	298,536.00	
		UNITED KINGDOM GILT	210,000.00	221,520.60	
		UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	322,202.40	
		UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	340,857.60	
		UNITED KINGDOM GILT	210,000.00	274,795.50	
		UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	411,382.40	
		UNITED KINGDOM GILT	250,000.00	261,127.50	
		UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	426,991.20	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	252,408.00	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	255,021.00	
		UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	403,967.20	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	403,704.00	
		UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	534,544.50	
		UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	417,058.40	
		UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	554,982.40	
		UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	249,228.90	
		UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	209,095.60	
		UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	229,884.00	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	243,477.00	
		UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	144,522.00	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	337,903.60	
		UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	606,453.00	
		UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	450,080.00	
		UNITED KINGDOM GILT	220,000.00	190,682.80	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	325,985.20	
		UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	169,450.20	
		UNITED KINGDOM GILT	160,000.00	149,836.80	
		UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	179,911.00	
		UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	169,293.60	
		UNITED KINGDOM GILT	150,000.00	145,540.50	
		UNITED KINGDOM GILT	100,000.00	101,505.00	
		UNITED KINGDOM GILT	40,000.00	38,416.00	
		UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	389,383.20	

	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	344,422.40	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	444,692.50	
イギリス・ポンド　小計		15,680,000.00 (2,454,860,800)	17,948,989.60 (2,810,093,812)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	360,000.00	387,360.00	
	ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	663,065.00	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	484,374.00	
	ISRAEL FIXED BOND	860,000.00	893,970.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	365,588.50	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	404,377.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	486,000.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	554,796.50	
	ISRAEL FIXED BOND	530,000.00	654,894.50	
	ISRAEL FIXED BOND	350,000.00	321,632.50	
	ISRAEL FIXED BOND	40,000.00	39,768.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	368,742.00	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	148,800.00	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	148,882.50	
イスラエル・シュケル　小計		5,440,000.00 (195,291,648)	5,922,250.50 (212,604,055)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	365,588.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	289,234.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	427,031.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	394,876.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	170,000.00	176,733.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	367,269.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	240,000.00	277,668.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	190,000.00	206,165.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	293,262.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	332,883.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	260,000.00	268,751.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	240,000.00	249,964.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	344,018.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	491,683.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	260,000.00	261,154.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	432,239.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	381,843.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	379,444.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	483,190.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	302,368.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	244,329.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	560,000.00	499,738.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	375,600.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	370,874.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	411,586.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	443,773.20	
オーストラリア・ドル　小計		9,020,000.00	9,071,272.00	

		(746,134,400)	(750,375,620)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	730,972.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,224,756.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,336,255.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,005,160.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,014,240.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,433,660.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,627,720.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,027,150.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,340,000.00	2,358,603.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,350,000.00	1,396,629.00	
オフショア・人民元　小計		21,870,000.00 (397,974,951)	22,155,146.00 (403,163,838)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	110,000.00	125,673.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	249,026.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	234,838.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	150,911.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	350,840.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	204,300.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	224,455.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	148,957.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	177,961.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	202,524.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	172,714.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	351,806.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	233,886.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	205,860.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	575,454.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	772,800.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	144,713.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	294,315.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	179,697.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	640,000.00	612,998.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	148,392.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	560,000.00	538,137.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	560,000.00	499,525.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	330,648.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	430,000.00	418,854.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	356,763.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	345,758.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	750,000.00	726,075.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	358,496.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	283,941.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	280,000.00	251,930.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	285,571.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	385,312.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	175,572.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000.00	9,858.30	

カナダ・ドル　小計		10,700,000.00 (966,317,000)	10,728,572.30 (968,897,364)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	135,780.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	330,000.00	337,464.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	143,070.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	138,359.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	144,144.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	144,040.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	142,730.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	151,900.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	114,785.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	80,000.00	81,222.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	61,980.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	121,940.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	208,060.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	162,270.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	171,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	90,000.00	86,697.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	80,000.00	77,549.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	47,237.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	40,000.00	39,102.80	
シンガポール・ドル　小計		2,420,000.00 (207,031,000)	2,509,532.10 (214,690,471)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,051,780.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,520,000.00	1,627,509.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,580,000.00	1,619,310.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	770,000.00	897,758.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,230,000.00	1,246,777.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,260,000.00	1,277,350.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	860,000.00	1,240,868.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,040,000.00	997,339.20	
スウェーデン・クローナ　小計		10,260,000.00 (125,582,400)	10,958,693.20 (134,134,405)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,020,000.00	1,053,578.40	
	KINGDOM OF DENMARK	970,000.00	1,032,555.30	
	KINGDOM OF DENMARK	1,470,000.00	1,493,564.10	
	KINGDOM OF DENMARK	1,670,000.00	1,691,576.40	
	KINGDOM OF DENMARK	940,000.00	843,556.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,220,000.00	1,162,684.40	
	KINGDOM OF DENMARK	2,260,000.00	3,755,103.00	
	KINGDOM OF DENMARK	790,000.00	792,662.30	
デンマーク・クローネ　小計		10,340,000.00 (181,260,200)	11,825,279.90 (207,297,157)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,630,000.00	1,642,844.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,360,000.00	1,395,251.20	

	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,045,621.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	920,000.00	904,571.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	820,000.00	810,758.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	770,000.00	769,461.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	840,000.00	822,276.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,040,864.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	695,925.00	
ノルウェー・クローネ　小計		9,240,000.00 (118,549,200)	9,127,573.30 (117,106,765)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	520,000.00	523,874.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	830,000.00	817,301.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	840,000.00	796,908.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	650,000.00	606,021.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	630,570.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,080,000.00	1,056,672.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	950,000.00	878,845.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	340,000.00	328,933.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	179,272.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	690,000.00	631,143.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	660,000.00	537,675.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	470,000.00	451,787.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	520,000.00	442,052.00	
ポーランド・ズロチ　小計		8,380,000.00 (241,133,662)	7,881,054.60 (226,776,558)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	453,460.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	443,058.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	408,290.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	172,315.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	793,900.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	623,645.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	650,060.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	830,000.00	856,261.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	376,228.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	393,714.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	326,633.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	379,712.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	216,291.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	260,000.00	282,011.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	120,000.00	123,640.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	110,000.00	112,657.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	194,376.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	120,000.00	127,714.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	374,917.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	253,248.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	352,958.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	461,300.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	330,022.00	

	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	146,724.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	100,000.00	100,340.00	
マレーシア・リンギット　小計		8,790,000.00 (241,477,122)	8,953,485.80 (245,968,371)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,705,156.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,560,000.00	5,542,096.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,870,000.00	3,744,844.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,070,000.00	7,514,057.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,220,000.00	4,183,032.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,040,000.00	6,377,032.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,250,000.00	1,478,700.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,060,000.00	6,094,723.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,790,000.00	4,810,309.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,020,000.00	5,957,512.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,740,000.00	5,982,515.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,710,000.00	4,930,192.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,450,000.00	2,433,438.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,080,000.00	978,717.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000.00	462,675.00	
メキシコ・ペソ　小計		62,080,000.00 (352,502,656)	62,195,003.80 (353,155,671)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	259,200.00	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	320,505.00	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	594,484.80	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	293,190.90	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	227,257.70	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	227,538.00	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	364,199.50	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	225,805.50	
	BELGIUM KINGDOM	410,000.00	422,705.90	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	195,216.10	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	395,982.80	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	228,853.80	
	BELGIUM KINGDOM	130,000.00	164,353.80	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	192,128.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	289,758.00	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	255,262.50	
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	151,603.20	
	BELGIUM KINGDOM	140,000.00	150,605.00	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	437,969.40	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	393,490.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	213,384.00	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	343,077.90	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	255,033.20	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	242,547.50	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	143,192.00	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	158,296.00	
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	528,921.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	263,468.80	

		BELGIUM KINGDOM	110,000.00	79,754.40	
		BELGIUM KINGDOM	100,000.00	96,455.00	
		BONOS Y OBLIG DE	430,000.00	405,206.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	369,593.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	388,681.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	499,422.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	434,640.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	516,048.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	611,257.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	592,991.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	412,566.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	484,984.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	492,367.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	498,060.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	566,861.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	490,373.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	444,970.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	390,516.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	541,424.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	461,727.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	425,353.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	502,406.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	491,074.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	370,834.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	587,852.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	655,312.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	474,817.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	522,095.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	512,510.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	454,522.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	393,065.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	441,999.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	318,211.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	502,925.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	436,198.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	437,482.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	419,214.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	424,447.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	308,864.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	491,040.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	640,974.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	325,972.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	434,029.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	394,443.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	440,497.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	75,910.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	355,459.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	230,000.00	208,644.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	89,126.00	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	140,000.00	136,183.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	190,000.00	180,832.50	
		BUNDESOBLIGATION	390,000.00	392,979.60	
		BUNDESOBLIGATION	420,000.00	424,263.00	
		BUNDESOBLIGATION	440,000.00	444,386.80	
		BUNDESOBLIGATION	390,000.00	393,673.80	
		BUNDESOBLIGATION	480,000.00	484,161.60	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	101,087.00	
		BUNDESOBLIGATION	490,000.00	493,743.60	
		BUNDESOBLIGATION	210,000.00	212,144.10	
		BUNDESOBLIGATION	470,000.00	472,942.20	
		BUNDESOBLIGATION	30,000.00	30,098.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	388,227.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	605,635.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	602,927.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	679,770.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	605,537.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	902,868.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	496,920.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	553,867.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	574,123.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	626,872.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	749,294.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	584,118.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	610,656.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	618,336.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	360,000.00	601,873.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	410,000.00	736,999.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	713,982.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	567,341.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	599,906.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	538,771.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	538,342.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	502,073.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	616,640.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	497,330.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	451,165.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	431,734.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	634,643.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	851,801.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	180,000.00	179,213.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	494,145.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	418,330.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	120,000.00	106,718.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	570,905.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	489,813.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	160,000.00	157,865.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	180,000.00	155,714.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	78,406.40	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	298,774.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	823,704.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	310,000.00	312,210.30	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	320,000.00	322,867.20	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	320,000.00	323,049.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	549,842.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	515,073.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	571,134.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	687,197.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	424,323.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	591,948.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	372,982.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	720,000.00	741,744.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	599,305.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	475,540.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	498,916.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	455,952.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	681,661.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	700,556.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	361,348.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	712,328.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	658,996.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	328,384.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	497,619.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	830,000.00	839,719.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	192,762.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	392,514.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	508,492.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	828,680.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	385,008.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	588,235.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	323,178.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	732,984.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	428,404.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	730,460.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	460,521.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	335,373.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	333,777.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	500,193.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	294,694.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	635,220.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	453,063.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	544,785.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	627,470.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	309,398.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	270,280.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	657,687.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	218,944.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	428,280.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	359,943.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	436,582.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	449,212.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	269,178.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	441,661.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	603,930.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	428,177.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	262,371.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	588,843.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	239,990.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	459,484.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	231,022.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	227,982.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	85,012.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	294,791.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	379,840.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000.00	79,580.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	277,550.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	268,886.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	278,297.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	412,706.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	251,316.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	188,440.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	105,334.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	301,948.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	557,761.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	168,573.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	110,140.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	110,000.00	117,352.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	140,000.00	130,062.80	
		DEUTSCHLAND REP	280,000.00	374,735.20	
		DEUTSCHLAND REP	270,000.00	366,346.80	
		DEUTSCHLAND REP	220,000.00	287,837.00	
		DEUTSCHLAND REP	340,000.00	504,842.20	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	174,486.00	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	126,338.40	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	149,486.70	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	92,191.50	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	102,402.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	145,058.20	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	132,879.50	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	110,932.80	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	132,848.30	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	95,184.90	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	91,074.40	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	121,459.20	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	73,439.20	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	102,799.80	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	72,436.00	

		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	105,668.20	
		FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	56,594.30	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	105,805.70	
		FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	50,746.00	
		FINNISH GOVERNMENT	60,000.00	60,486.00	
		FINNISH GOVERNMENT	60,000.00	59,855.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,215,215.80	
		FRANCE (GOVT OF)	570,000.00	855,068.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,091,142.80	
		FRANCE (GOVT OF)	540,000.00	782,011.80	
		FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	686,772.80	
		FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	793,927.50	
		FRANCE (GOVT OF)	760,000.00	802,088.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	1,261,116.00	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	898,145.60	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	799,960.70	
		FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,138,903.50	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	998,238.50	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	897,124.80	
		FRANCE (GOVT OF)	280,000.00	319,118.80	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	861,852.80	
		FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	795,451.00	
		FRANCE (GOVT OF)	610,000.00	697,339.80	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	804,111.00	
		FRANCE (GOVT OF)	570,000.00	683,663.70	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	885,975.20	
		FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	1,009,743.00	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	811,241.20	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	1,018,799.10	
		FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	1,118,180.70	
		FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	773,297.20	
		FRANCE (GOVT OF)	760,000.00	1,231,230.40	
		FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	699,920.00	
		FRANCE (GOVT OF)	960,000.00	969,024.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	1,034,490.80	
		FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	812,229.60	
		FRANCE (GOVT OF)	610,000.00	536,409.60	
		FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	849,685.50	
		FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	842,189.40	
		FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	962,967.60	
		FRANCE (GOVT OF)	330,000.00	602,527.20	
		FRANCE (GOVT OF)	950,000.00	905,967.50	
		FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	404,734.00	
		FRANCE (GOVT OF)	330,000.00	332,055.90	
		FRANCE (GOVT OF)	170,000.00	115,919.60	
		FRANCE (GOVT OF)	220,000.00	195,624.00	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	846,045.00	
		FRANCE (GOVT OF)	460,000.00	456,485.60	
		FRANCE (GOVT OF)	370,000.00	372,845.30	

		FRANCE (GOVT OF)	230,000.00	199,669.90	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	93,196.00	
		FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	1,071,112.00	
		FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	701,772.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	146,609.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	172,398.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	226,670.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	208,362.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	239,455.30	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	130,000.00	143,986.70	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	176,905.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	105,345.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	130,000.00	139,283.30	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	209,560.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	149,405.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	103,064.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	269,226.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	140,232.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	155,228.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	177,536.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	73,128.80	
		IRISH GOVERNMENT BOND	50,000.00	47,694.00	
		ITALIAN GOVT	200,000.00	258,608.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	607,492.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	378,696.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	361,641.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	359,437.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	395,740.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	379,094.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	342,609.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	302,706.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	311,994.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	525,605.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	240,000.00	240,696.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	210,000.00	209,367.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	273,506.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	596,025.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	309,522.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	166,460.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	260,000.00	251,477.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	160,000.00	146,446.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	303,489.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	160,000.00	157,566.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	110,000.00	110,212.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	205,293.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	151,625.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	207,152.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	360,000.00	378,918.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	238,491.60	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	272,539.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	340,939.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	191,354.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	182,366.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	265,616.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	55,790.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	160,950.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	227,157.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	216,747.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	448,089.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	232,633.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	180,540.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	212,359.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	113,738.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	85,123.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	51,288.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	120,770.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	228,835.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	56,972.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	100,430.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	101,263.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	60,481.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	58,741.20	
	ユーロ　小計		127,820,000.00 (16,662,615,200)	140,631,369.50 (18,332,705,328)	
国債証券　合計			45,663,405,439 (45,663,405,439)	47,865,684,205 (47,865,684,205)	
合計				47,865,684,205 (47,865,684,205)	

（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	137銘柄	47.37	47.82
イギリス・ポンド	国債証券	55銘柄	5.82	5.87
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	0.44	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	1.55	1.57
オフショア・人民元	国債証券	10銘柄	0.83	0.84
カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	2.01	2.02
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.28	0.28
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.43	0.43
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	13銘柄	0.47	0.47
マレーシア・リンギット	国債証券	25銘柄	0.51	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.73	0.74
ユーロ	国債証券	345銘柄	37.94	38.30

（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】

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	8,967,311,334円
Ⅱ　負債総額	11,143,842円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	8,956,167,492円
Ⅳ　発行済数量	8,336,723,326口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0743円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	116,211,098,702円
Ⅱ　負債総額	480,308,579円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	115,730,790,123円
Ⅳ　発行済数量	54,533,059,104口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1222円

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	79,679,325,289円
Ⅱ　負債総額	1,533,067,666円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	78,146,257,623円
Ⅳ　発行済数量	80,501,791,075口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9707円

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	511,535,631,580円
Ⅱ　負債総額	1,976,364,100円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	509,559,267,480円
Ⅳ　発行済数量	183,143,317,470口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7823円

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	48,250,831,346円
Ⅱ　負債総額	134,561,196円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,116,270,150円
Ⅳ　発行済数量	32,709,471,082口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4710円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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

2022年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後1年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年2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	431	66,731
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	141	25,376
単位型公社債投資信託	0	0
合計	572	92,108

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

３【委託会社等の経理状況】

１．財務諸表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		68,155,196		75,152,647
負債・純資産合計		79,421,875		90,445,083

（2）【損益計算書】

（単位：千円）

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2019年4月１日　至2020年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自2020年4月１日　至2021年3月31日)

(単位：千円)

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （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	①　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。 ②　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。 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。 ③　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。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 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。 ②　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。
４．引当金の計上基準	①　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。 ②　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。 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。 ③　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。
５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

６．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②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。 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 ③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。 ④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。
７．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
８．連結納税	日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日　企業会計基準委員会　実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

(未適用の会計基準等)

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

（１） 概要

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

（２） 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（３） 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

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

（１）　概要

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

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

（２）　適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（３）　当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

（貸借対照表関係）

※１．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 （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）
建物付属設備	4,181千円	－千円
器具備品	4,240	870
計	8,422	870

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自2019年4月1日　至2020年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項

①配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2020年4月1日　至2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項

①配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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

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

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日） **（単位：千円）**

	貸借対照表計上額	時価	差額
①現金・預金	28,674,230	28,674,230	―
②有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	△259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	―
資産計	68,610,058	68,615,802	5,744
①その他未払金	3,591,122	3,591,122	―
負債計	3,591,122	3,591,122	―
①デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	10,218	10,218	―
デリバティブ取引計	10,218	10,218	―

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

当事業年度（2021年3月31日）　　（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
①現金・預金	40,822,894	40,822,894	－
②有価証券			
満期保有目的の債券	－	－	－
③投資有価証券			
満期保有目的の債券	15,018,123	15,023,675	5,551
その他有価証券	22,039,919	22,039,919	－
資産計	77,880,937	77,886,489	5,551
①その他未払金	4,839,326	4,839,326	－
負債計	4,839,326	4,839,326	－
①デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△65,238	△65,238	－
デリバティブ取引計	△65,238	△65,238	－

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

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

資　産

①現金・預金

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

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

負　債

①その他未払金

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

デリバティブ取引

①デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

（注３）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

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

（注）投資信託受益証券であります。

当事業年度(2021年3月31日)

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

（注）投資信託受益証券であります。

（有価証券関係）

１．満期保有目的の債券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

（注１）投資信託受益証券等であります。

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自2019年4月1日　至2020年3月31日）

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

当事業年度（自2020年4月1日　至2021年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2021年3月31日）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

前事業年度（2020年3月31日）

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

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

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

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

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

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

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

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

（２）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

（３）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

（４）退職給付費用

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

（５）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

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

３．確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2019年4月1日　至2020年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2020年4月1日　至2021年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1　関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自2019年4月１日　至2020年3月31日）

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

当事業年度（自2020年4月１日　至2021年3月31日）

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

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2　親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（１株当たり情報）

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

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

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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		8,418,909
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		2,340,315
負債合計		10,759,224
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		8,281,840
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		52,214,493
株主資本合計		70,496,333
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		917,831
純資産合計		71,414,165
負債・純資産合計		82,173,390

(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									
	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	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	①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。 ②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。 ③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。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①有形固定資産 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。 ②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。
４．引当金の計上基準	①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。 ②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。 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。 ③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。

５．収益及び費用の計上基準	**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。** **①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。** **②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。** **③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。**
６．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、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。**
７．ヘッジ会計の方法	**①ヘッジ会計の方法** **繰延ヘッジ処理によっております。** **②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。** **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** **③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。** **④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。**
８．連結納税制度	**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。**

（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
①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	－	－	－
②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	－
③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△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	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③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	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③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	5,929,426千円
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。

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

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

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

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

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

5【その他】

① 定款の変更等

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。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2021年3月末現在、324,279百万円

ｃ．事業の内容

銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

（参考）再信託受託会社の概況

ａ．名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2021年3月末現在、10,000百万円

ｃ．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

(資本金の額：2021年3月末現在)

ａ．名称	ｂ．資本金の額（単位：百万円）	ｃ．事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	
楽天証券株式会社	7,495	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
日本生命保険相互会社	1,400,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

2021年3月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

３【資本関係】

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

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

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

第３【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2021年5月21日	**有価証券報告書**
	有価証券届出書
2021年11月19日	**半期報告書**
	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

２０２１年5月３１日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　樋　口　誠　之　㊞

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　牧　野　あや子　㊞

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2022年3月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政　印

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2021年2月23日から2022年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2022年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２１年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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。