

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2022年9月20日提出

【発行者名】 ニッセイアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 大関 洋

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

【事務連絡者氏名】 投資信託企画部 茶木 健

【電話番号】 03 - 5533 - 4608

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

【届出の対象とした募集（売  
出）内国投資信託受益証券  
に係るファンドの名称】 当初設定額 DCニッセイターゲットデートファンド20  
65は、1百万円とします。  
継続募集額 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年12月24日をもって提出した有価証券届出書（2022年3月18日をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み、以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、半期報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

## 【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

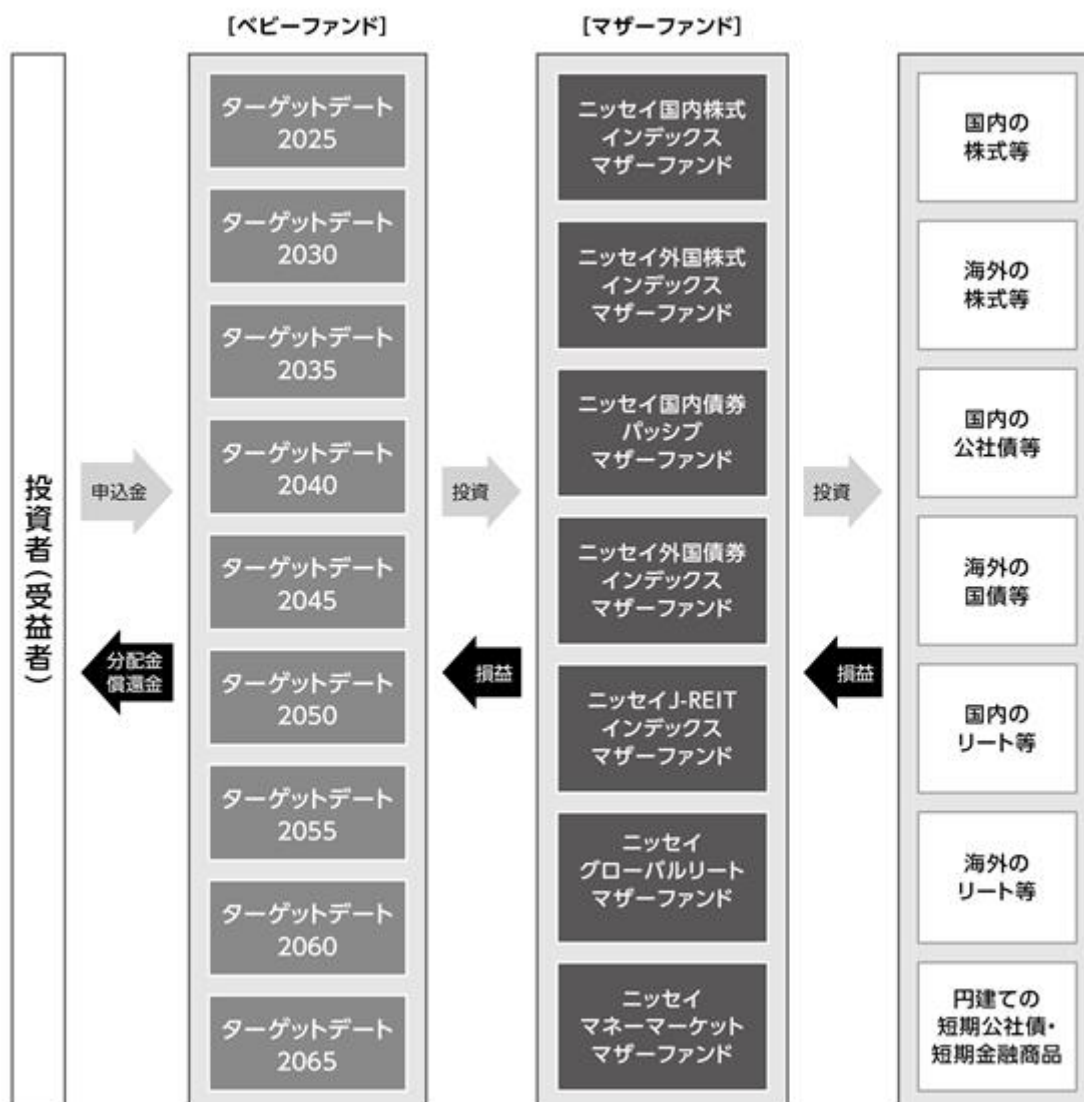
<訂正前>

##### 基本方針

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

##### 運用の形態

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



■ マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等によっても、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。将来の市場構造の変化等によっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

##### ファンドの特色

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

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

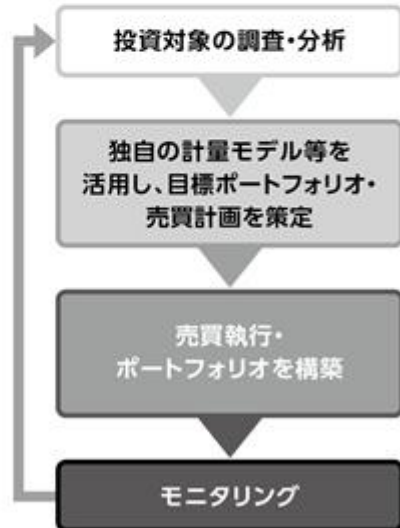
\*為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

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

- マザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債に実質的な投資を行います。

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

〈マザーファンドの運用プロセス〉



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

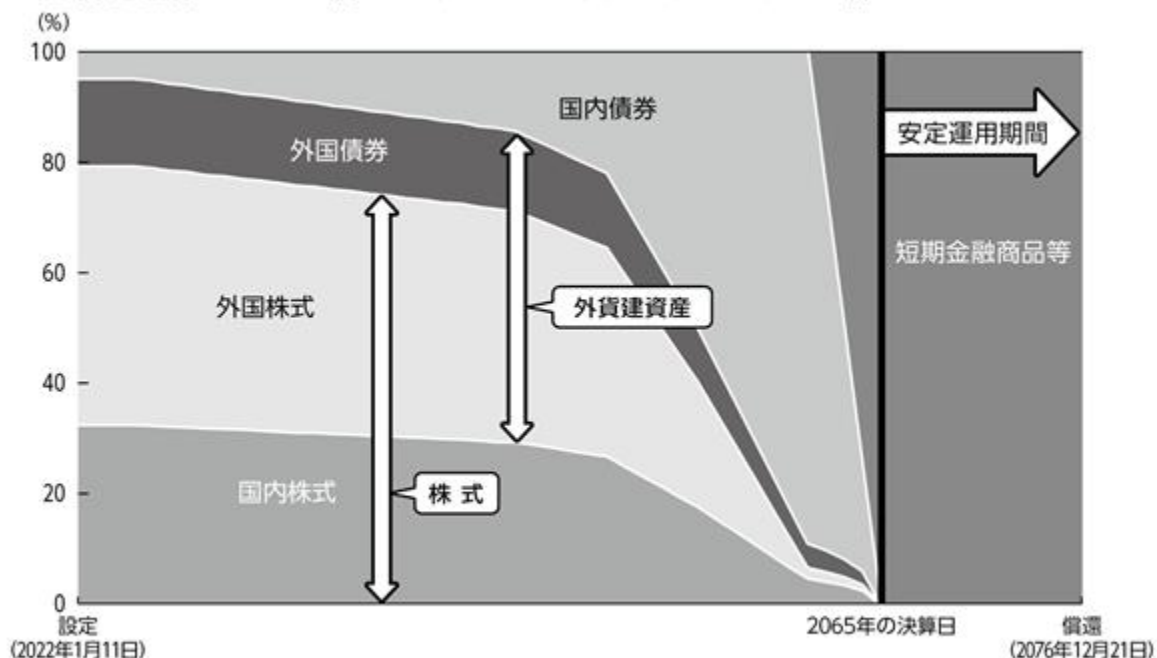
### ③安定運用開始時期(ターゲットデート)の異なる複数のファンドから選択いただけます。各ファンドは、安定運用開始時期に近づくにしたいがい、リスクを低減させていく運用を行います。

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

#### 〈各ファンドの安定運用開始時期(ターゲットデート)〉

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

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



・上記は2021年12月末現在で計画している基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。将来の基本資産配分比率は、市況動向等により変更となる場合があります。

## 〈2021年12月末現在の基本資産配分〉

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
DCニッセイターゲットデートファンド2025	4.8%	2.0%	88.9%	4.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2030	15.5%	19.3%	56.5%	8.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25.0%	34.8%	27.5%	12.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2040	29.0%	41.0%	15.7%	14.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2045	30.1%	42.8%	12.3%	14.8%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2050	30.9%	44.1%	9.9%	15.1%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2055	31.6%	45.3%	7.7%	15.4%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2060	32.3%	46.4%	5.6%	15.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2065	—	—	—	—	—

・DCニッセイターゲットデートファンド2065は、2022年1月11日設定のため、2021年12月末現在の基本資産配分は記載しておりません。

・実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。なお、2021年12月末現在においては、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、および円建ての短期金融商品等を主要投資対象とするニッセイマネーマーケットマザーファンドは組入れを行っていません。

## 〈当初設定時の基本資産配分〉

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

・各ファンドの設定日は以下の通りです。

DCニッセイターゲットデートファンド2055：2016年7月29日

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

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

DCニッセイターゲットデートファンド2065：2022年1月11日

## 〈各インデックスについて〉

### ●TOPIX(東証株価指数)

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

○ 東京証券取引所の第一部、第二部などの市場は、2022年4月に新しい市場区分への再編が予定されています。これに併せ、TOPIXの算出方法についても変更が予定されています。

### ●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

### ●NOMURA-BPI総合

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

### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

### ●東証REIT指数

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

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

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

### <MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

#### 信託金の上限

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

#### ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。



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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)		
債券 一般	年1回	日 本		
公債	年2回	北 米	ファミリー ファンド	あ り ( )
社債	年4回	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	ア ジ ア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式・債券・不動 産投信・短期金 融資産)資産配 分変更型))	日 々	中 南 米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 ( )	ア フ リ カ		
		中近東 (中東)		
		エマ- ジ ン グ		

商品分類表

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

属性区分表

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

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

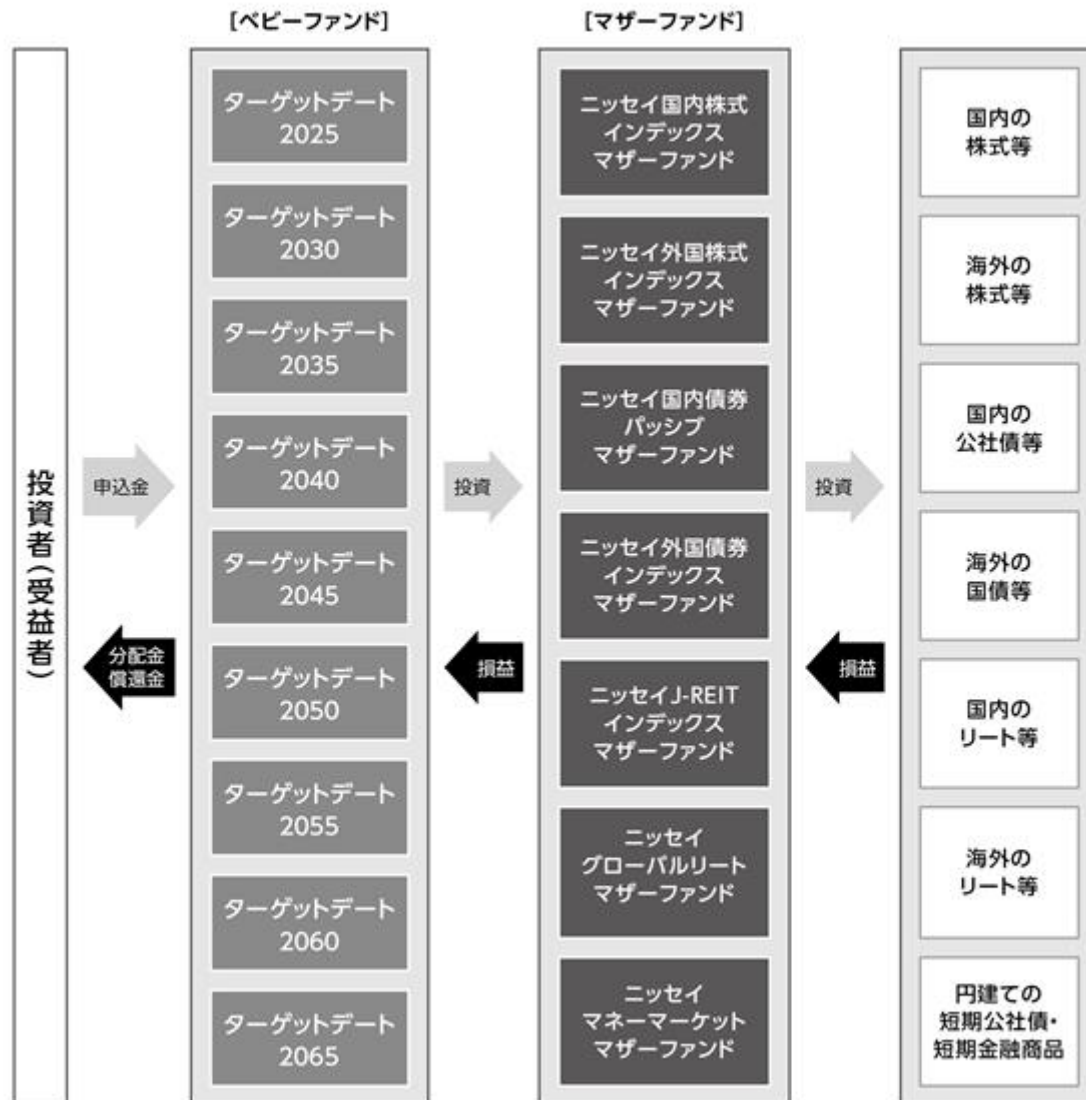
< 訂正後 >

#### 基本方針

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

#### 運用の形態

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



■ マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にとまもない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。将来の市場構造の変化等によっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

## ファンドの特色

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

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

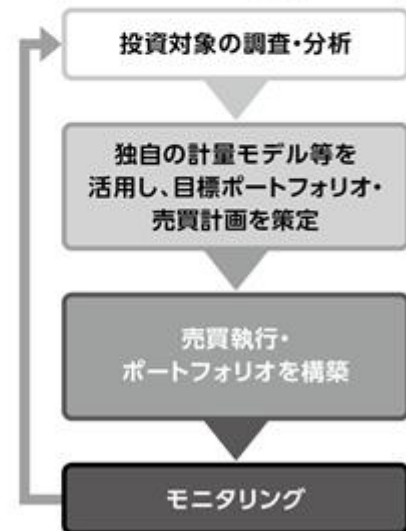
\*為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

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

- マザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債に実質的な投資を行います。

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

〈マザーファンドの運用プロセス〉



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

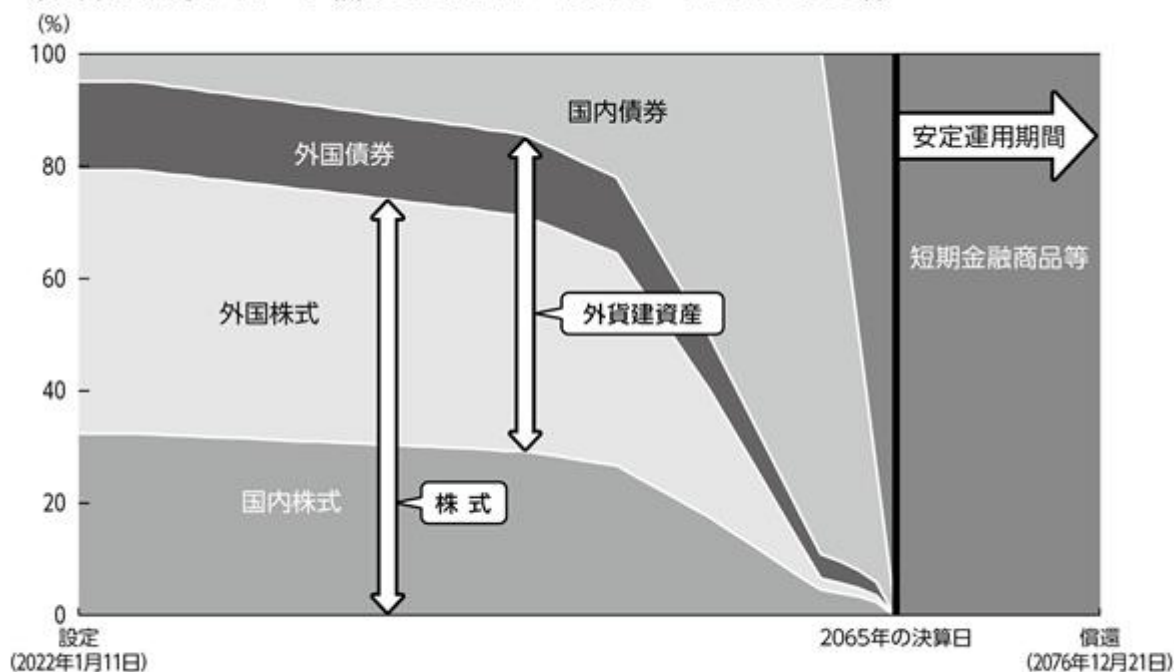
### ③安定運用開始時期(ターゲットデート)の異なる複数のファンドから選択いただけます。各ファンドは、安定運用開始時期に近づくにしたがい、リスクを低減させていく運用を行います。

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

#### 〈各ファンドの安定運用開始時期(ターゲットデート)〉

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

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



・上記は2022年6月末現在で計画している基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。将来の基本資産配分比率は、市況動向等により変更となる場合があります。

## 〈2022年6月末現在の基本資産配分〉

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
DCニッセイターゲットデートファンド2025	4.8%	2.0%	88.9%	4.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2030	15.5%	19.3%	56.5%	8.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25.0%	34.8%	27.5%	12.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2040	29.0%	41.0%	15.7%	14.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2045	30.1%	42.8%	12.3%	14.8%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2050	30.9%	44.1%	9.9%	15.1%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2055	31.6%	45.3%	7.7%	15.4%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2060	32.3%	46.4%	5.6%	15.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2065	32.6%	46.9%	4.7%	15.8%	0.0%

・実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。なお、2022年6月末現在においては、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、および円建ての短期金融商品等を主要投資対象とするニッセイマネーマーケットマザーファンドは組入れを行っていません。

## 〈当初設定時の基本資産配分〉

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

・各ファンドの設定日は以下の通りです。

DCニッセイターゲットデートファンド2055：2016年7月29日

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

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

DCニッセイターゲットデートファンド2065：2022年1月11日

## 〈各インデックスについて〉

### ●TOPIX(東証株価指数)

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。

### ●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

### ●NOMURA-BPI総合

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

### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

### ●東証REIT指数

東証REIT指数とは、東証市場に上場する不動産投資信託(Real Estate Investment Trust)全銘柄を対象とした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。

東証REIT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。

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

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

### <MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

#### 信託金の上限

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

#### ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。



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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)		
債券 一般	年1回	日 本		
公債	年2回	北 米	ファミリー ファンド	あ り ( )
社債	年4回	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	ア ジ ア		
不動産投信		オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式・債券・不動 産投信・短期金 融資産)資産配 分変更型))	年12回 (毎月)	中 南 米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
	日 々	ア フ リ カ		
	その他 ( )	中 近 東 (中 東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマ ージ ング		

商品分類表

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

属性区分表

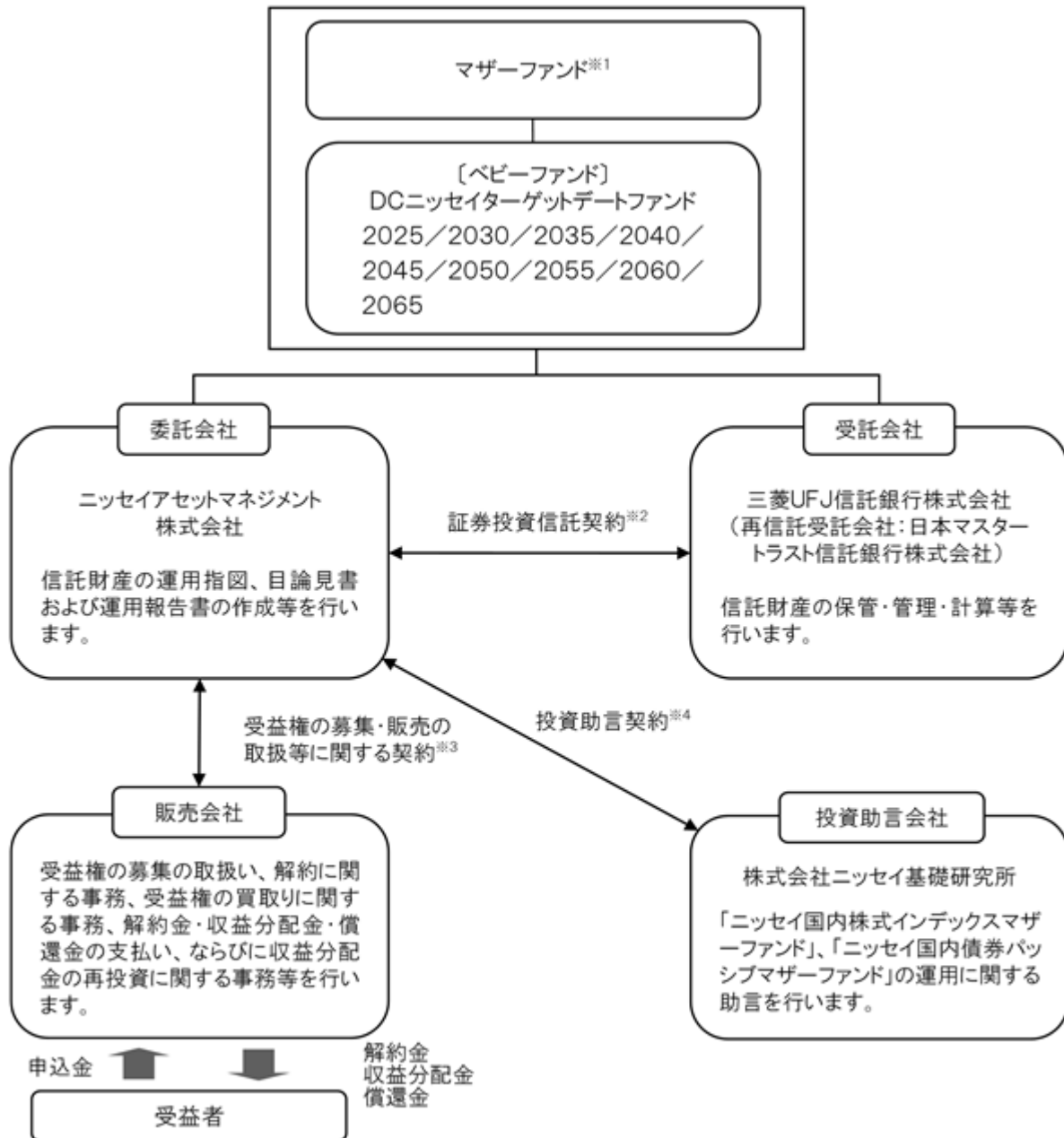
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券・ 不動産投信・短期 金融資産)資産配 分変更型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、短期金融資産に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款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

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

### (3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >



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

#### 委託会社の概況（2021年12月末現在）

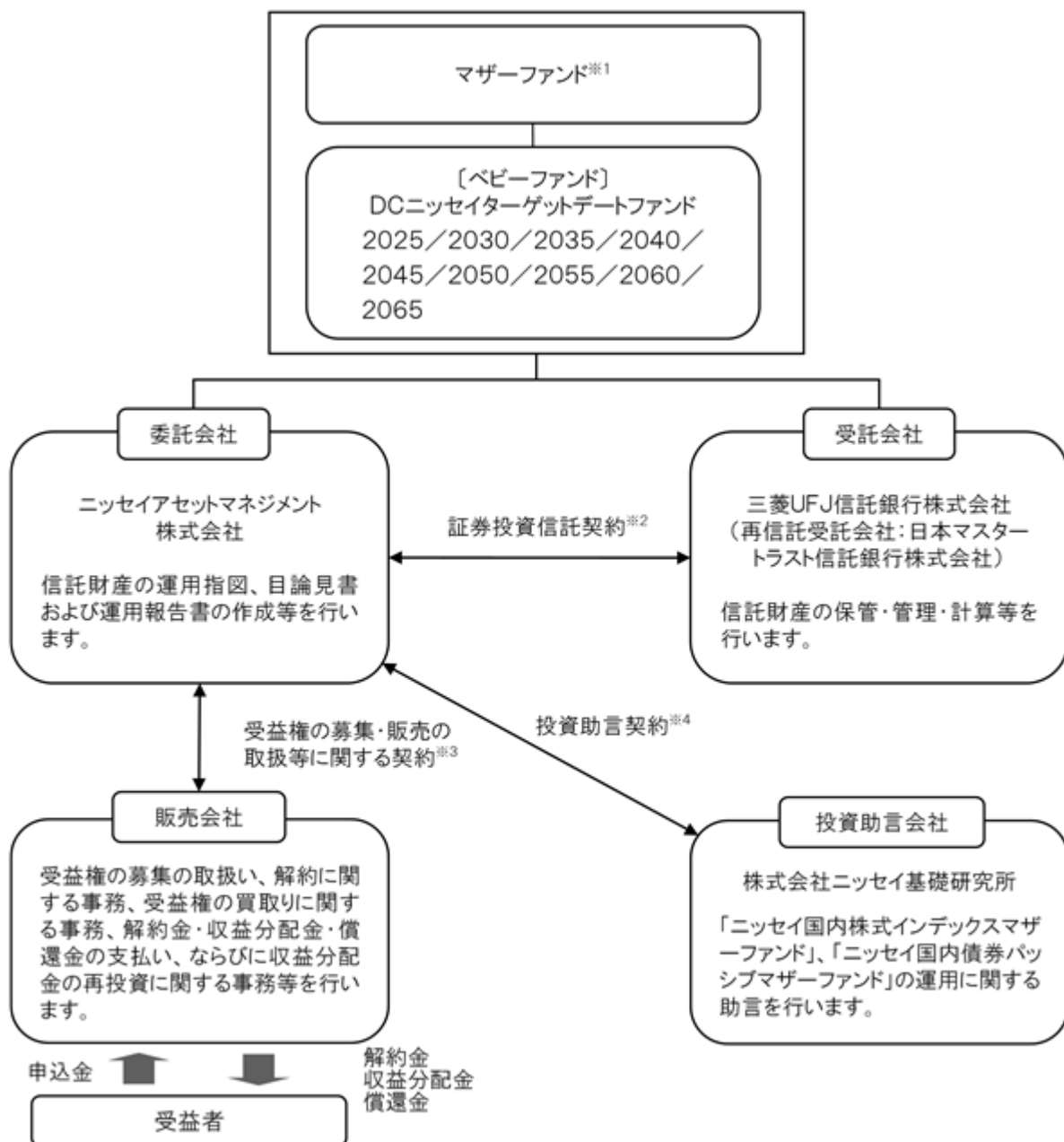
- ・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
- ・設立年月日：1995年4月4日
- ・資本金の額：100億円
- ・沿革

- 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%

<訂正後>



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

#### 委託会社の概況（2022年6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

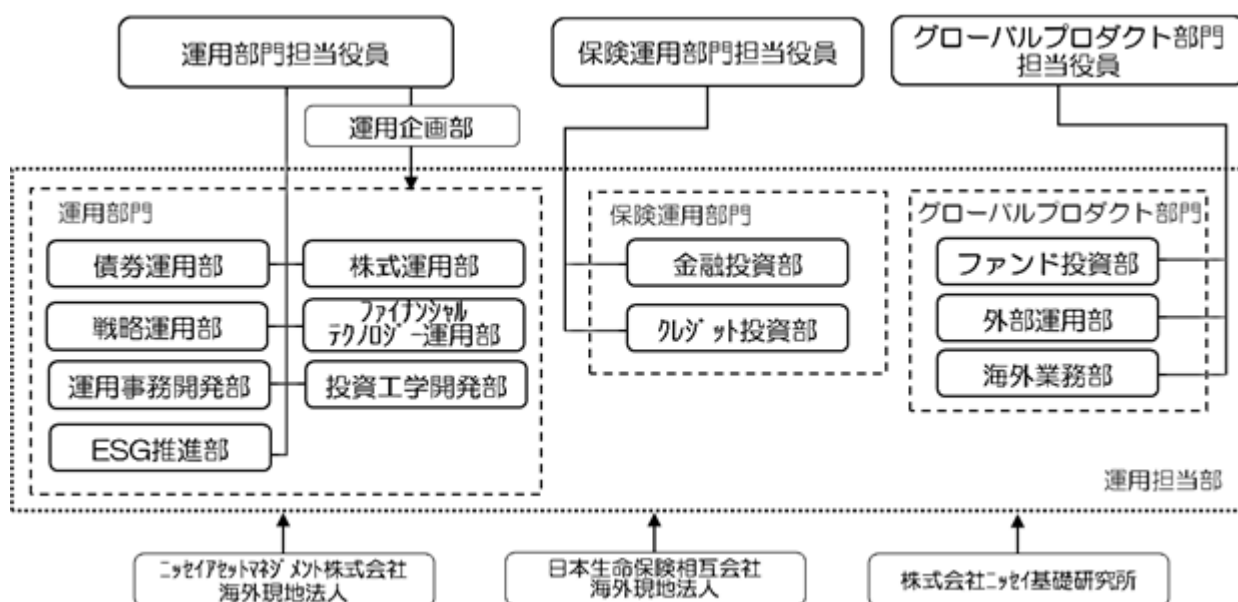
名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	108,448株	100%

## 2【投資方針】

### （3）【運用体制】

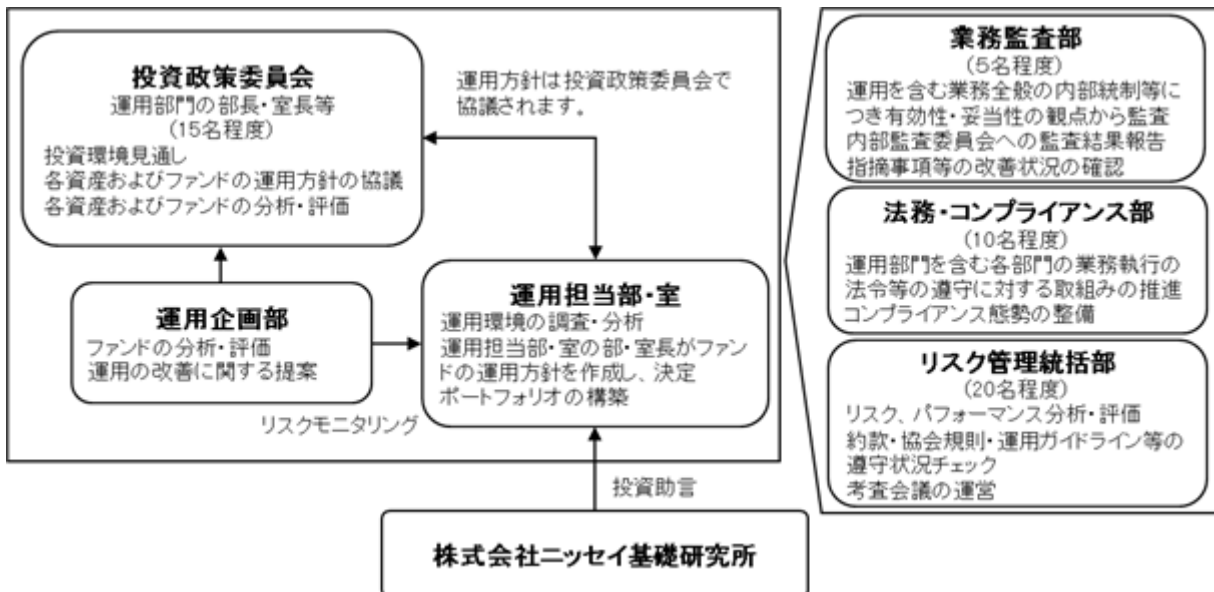
<訂正前>

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



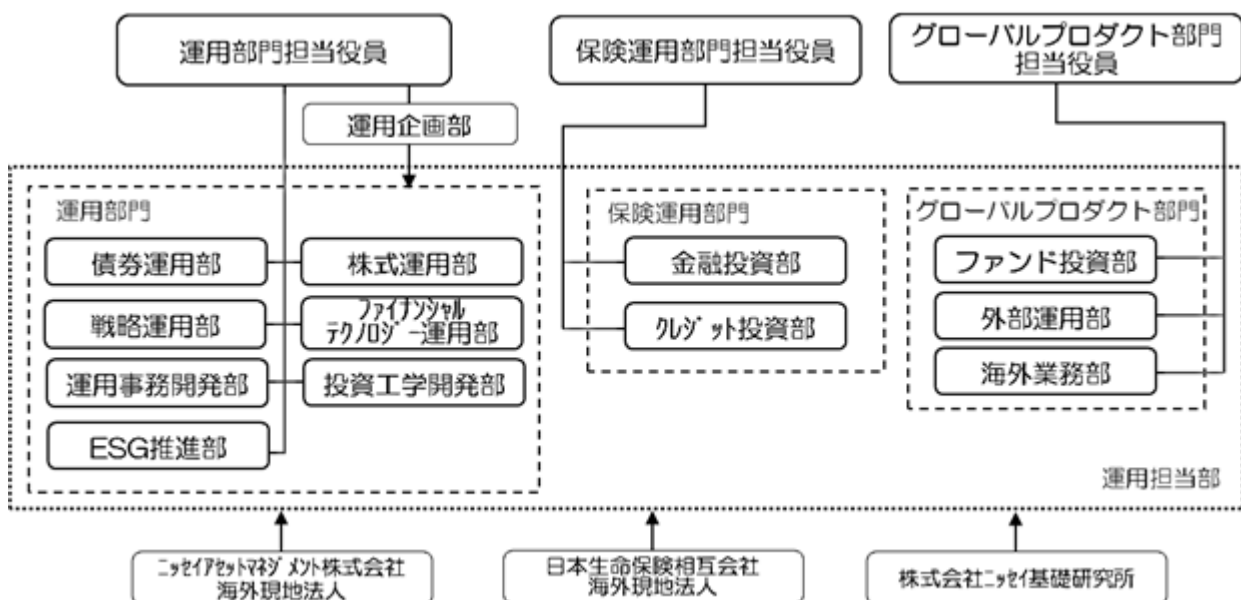
#### < 受託会社に対する管理体制等 >

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。

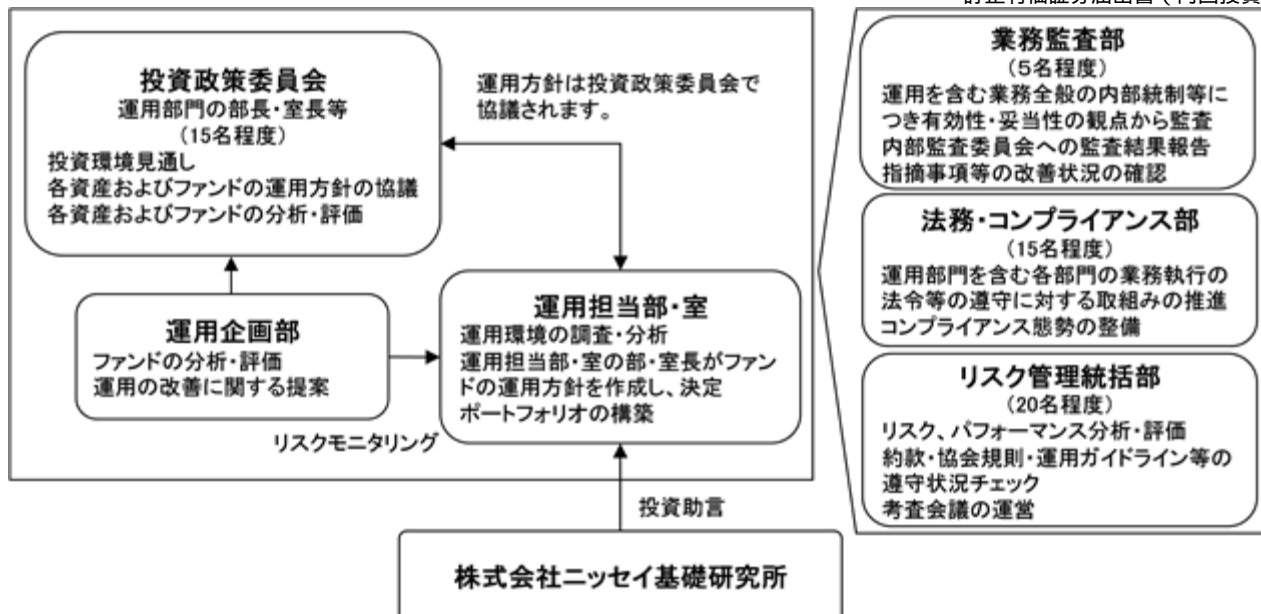
#### < 訂正後 >

#### 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。

### 3【投資リスク】

#### < 訂正前 >

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、それにもとない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

###### 信用リスク

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

##### ・不動産投資信託（リート）投資リスク

###### 保有不動産に関するリスク

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

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

#### 金利変動リスク

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

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

#### 信用リスク

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

#### J - R E I T の税制に関するリスク

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

#### リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

#### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

#### ・為替変動リスク

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

#### ・カントリーリスク

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

#### ・流動性リスク

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

#### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

#### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

#### ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

「ターゲットデート2065」の設定日における信託財産（1百万円（受益権口数1百万口））は、委託会社の資金によるものです。また、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2021年11月末現在、各ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に6.2%保有しています。

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

#### ・流動性に関する留意点

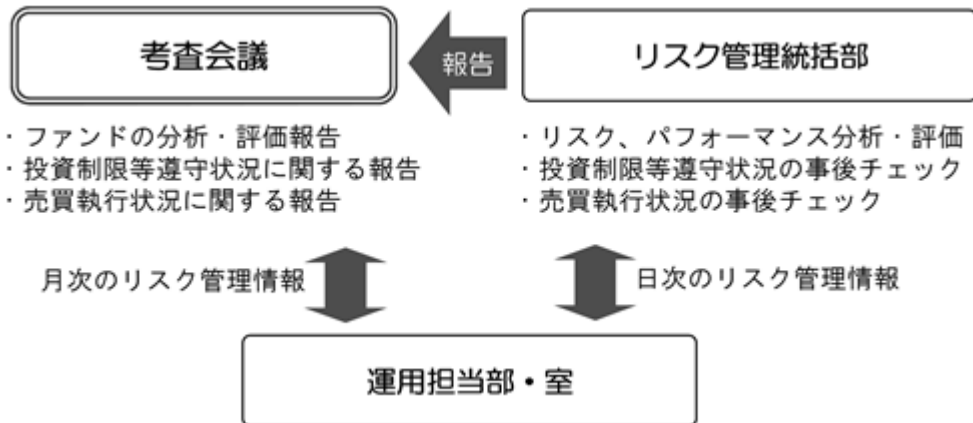
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の



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を中止する、また既に受付けた換金の申込みの受付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、月次の審査会議で報告します。
  - ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

### <流動性リスクに関する管理体制>

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

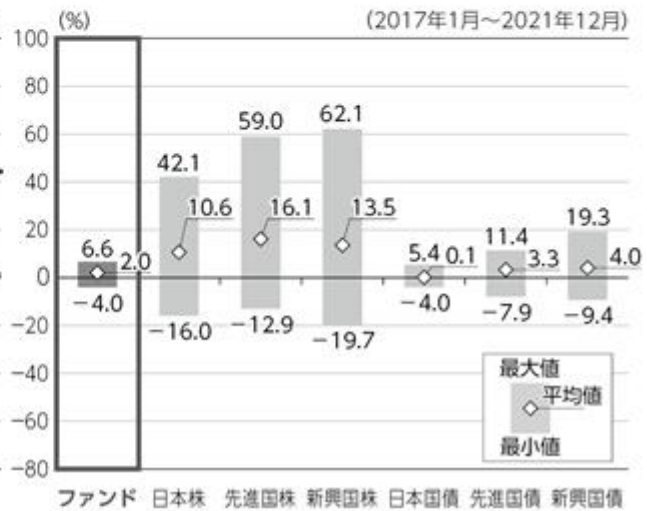
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●DCニッセイターゲットデートファンド2025

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

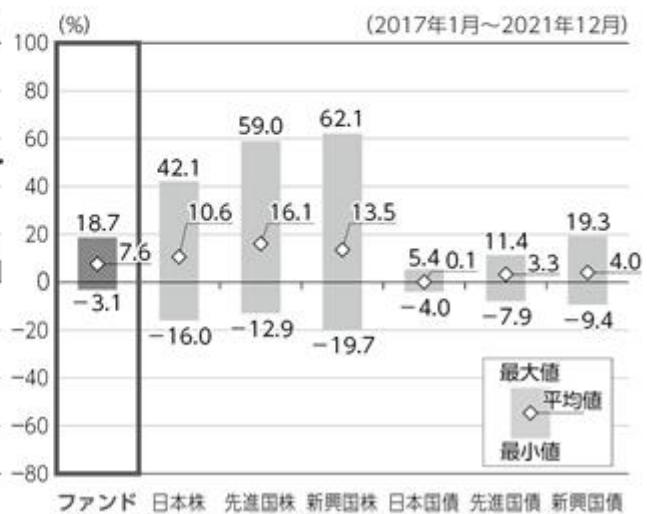


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2030

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

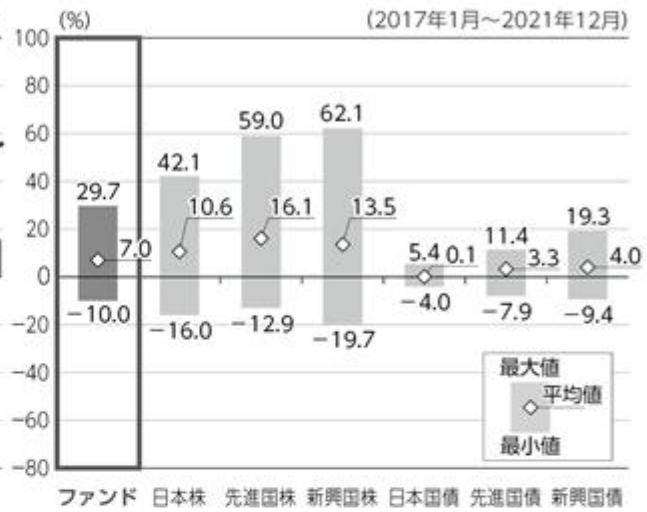


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2035

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

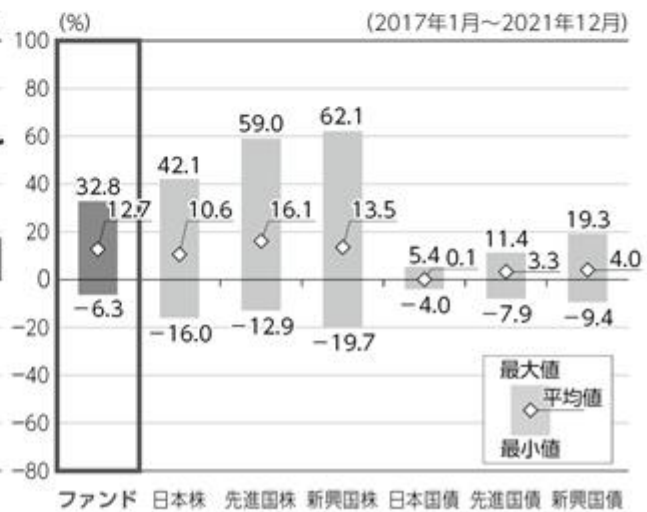


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2040

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

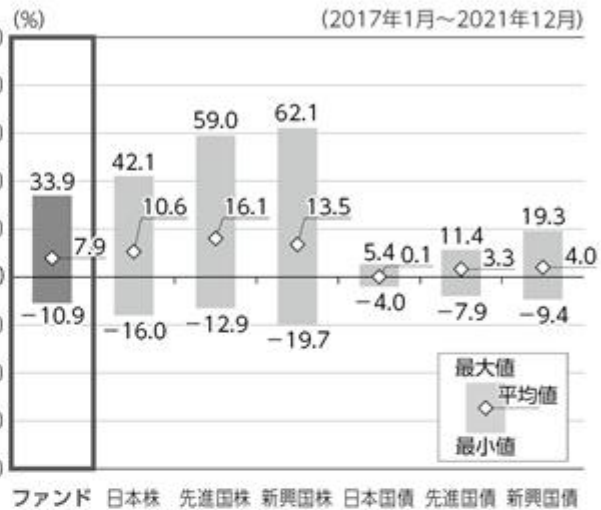


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2045

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

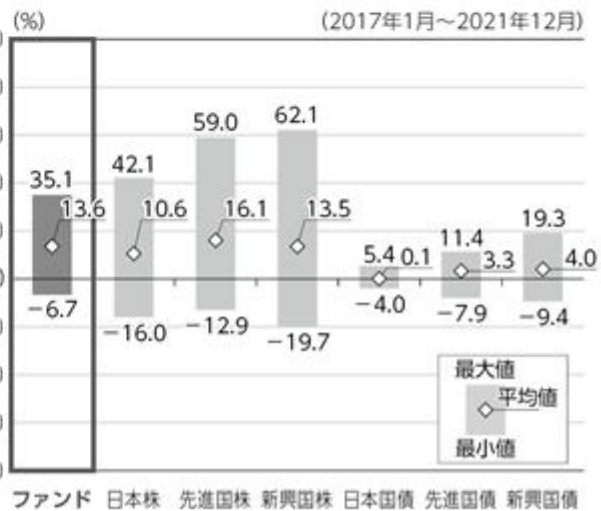


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2050

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

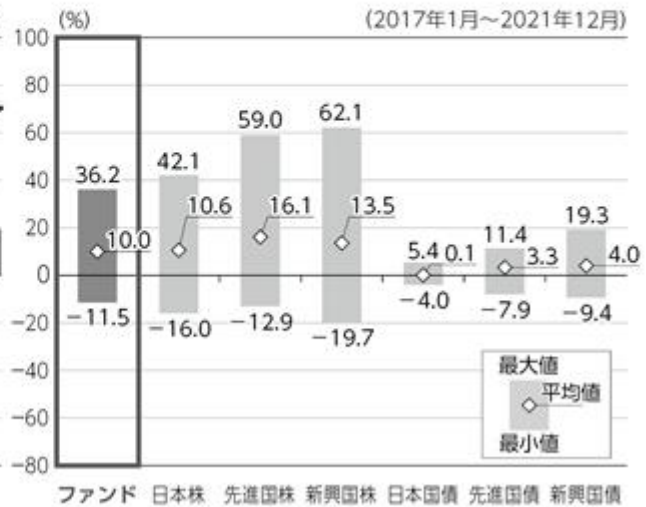


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2055

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

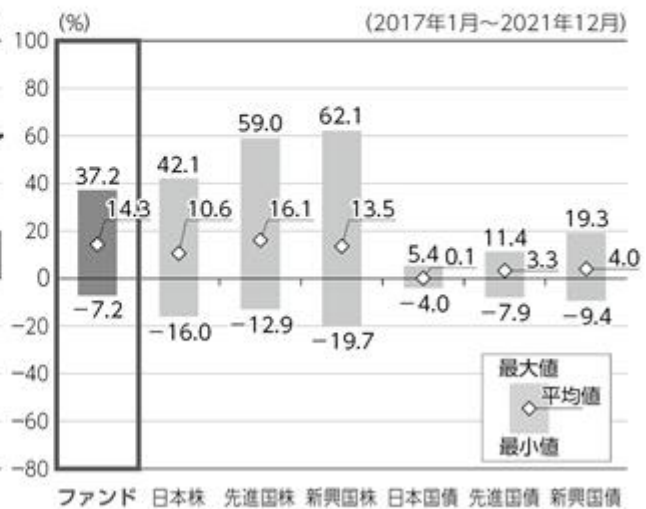


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2060

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

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

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

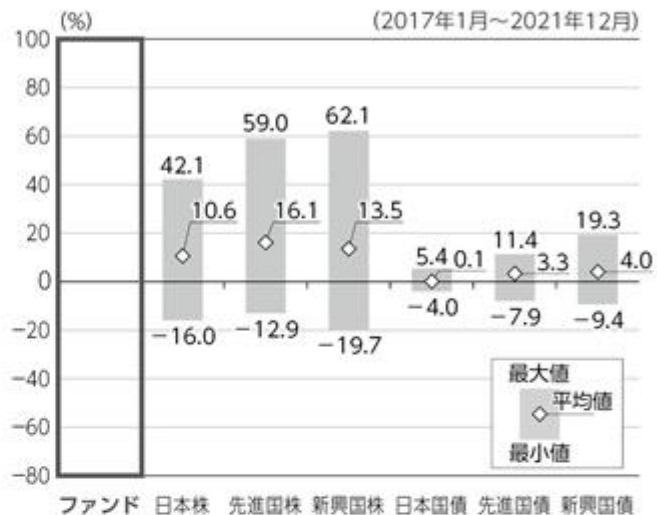
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●DCニッセイターゲットデートファンド2065

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移

該当事項はありません。

②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

<訂正後>

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

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

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

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

#### （１）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・不動産投資信託（リート）投資リスク

###### 保有不動産に関するリスク

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

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

###### 金利変動リスク

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

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

###### 信用リスク

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

###### J - R E I T の税制に関するリスク

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

###### リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

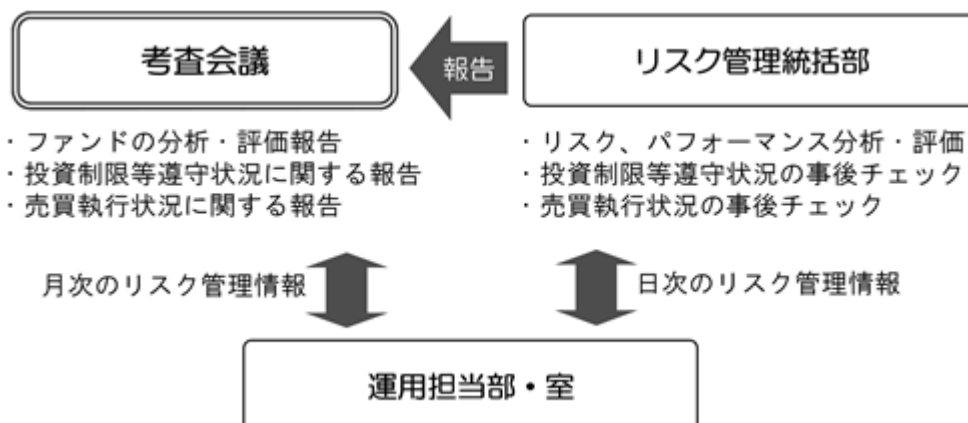
##### ・カントリーリスク



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

- ・流動性リスク  
市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。
- ・収益分配金に関する留意点  
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。  
収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。  
受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点  
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点  
「ターゲットデート2065」の設定日における信託財産（1百万円（受益権口数1百万口））は、委託会社の資金によるものです。また、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2021年11月末現在、各ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に6.2%保有しています。  
当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点  
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

## （２）投資リスク管理体制



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

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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

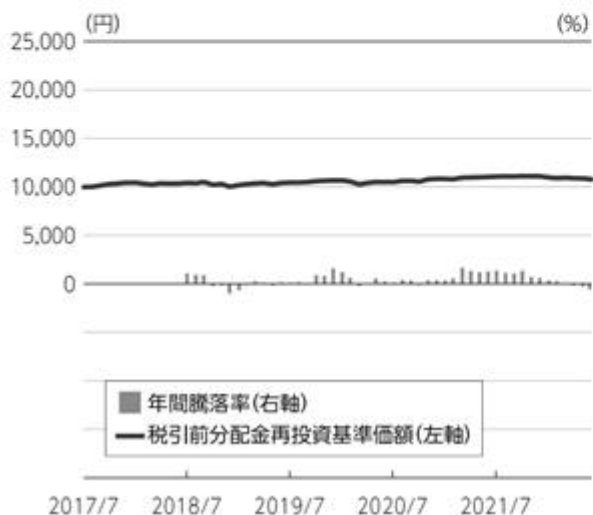
#### <流動性リスクに関する管理体制>

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

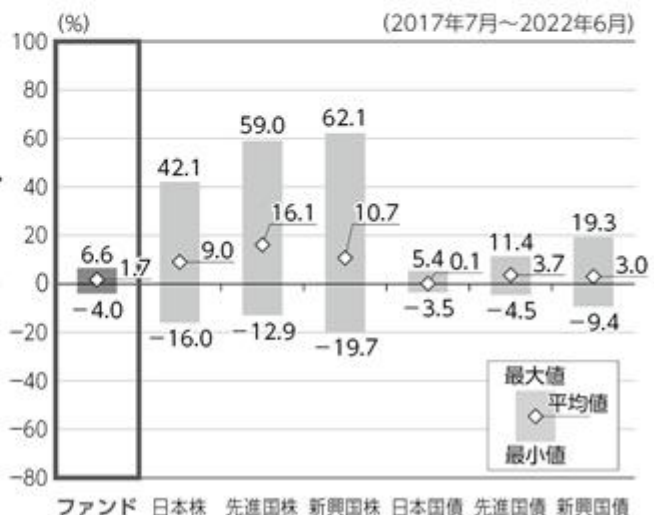
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ●DCニッセイターゲットデートファンド2025

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

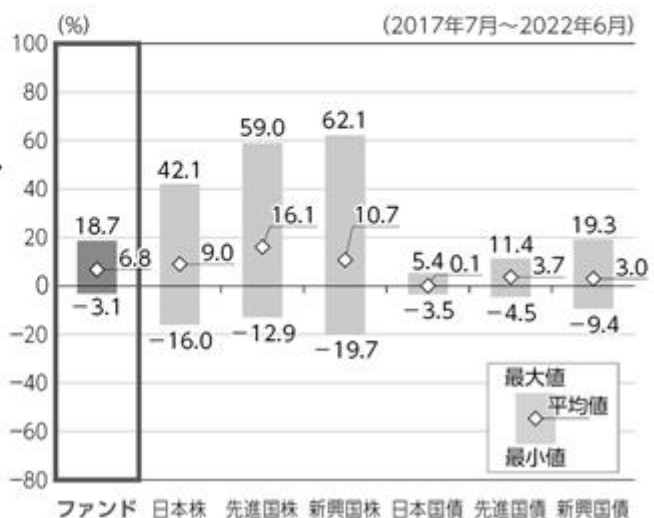


### ●DCニッセイターゲットデートファンド2030

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

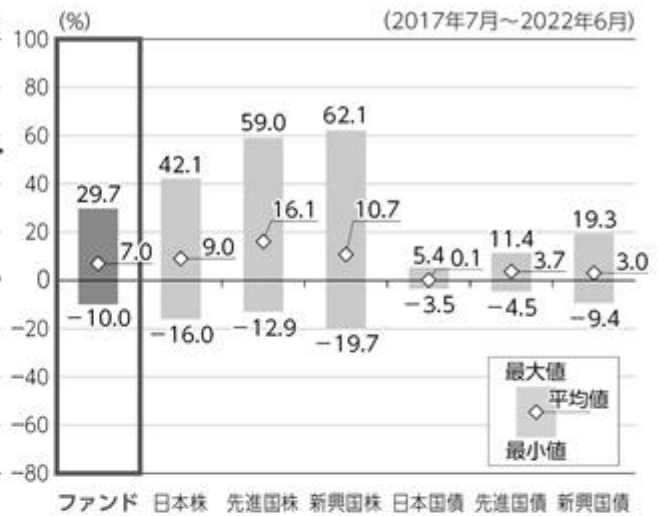


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2035

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

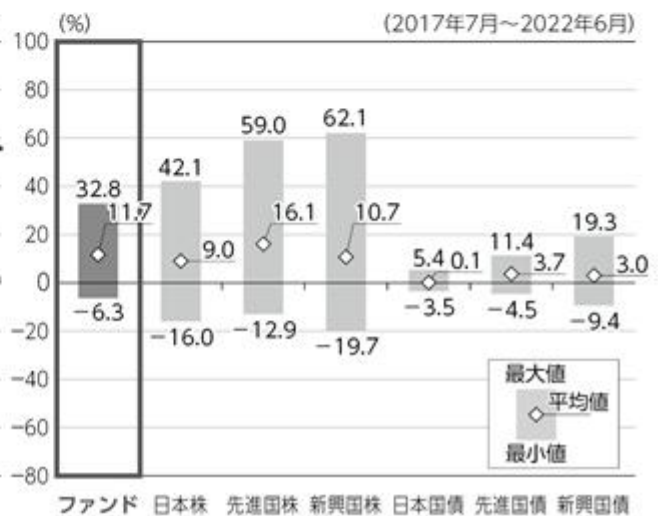


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2040

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

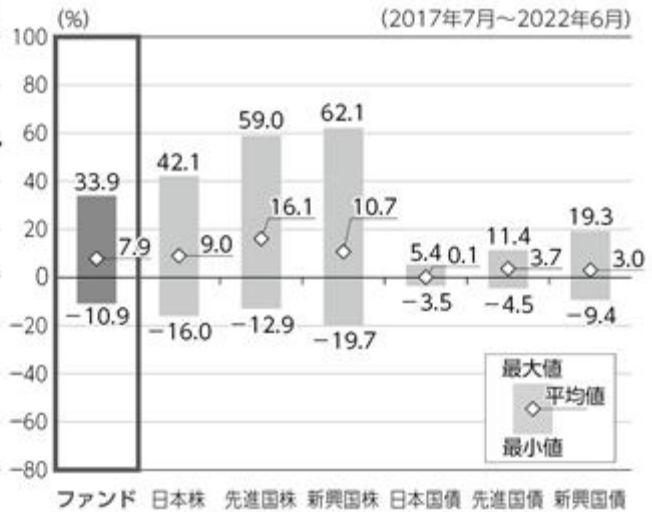


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2045

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

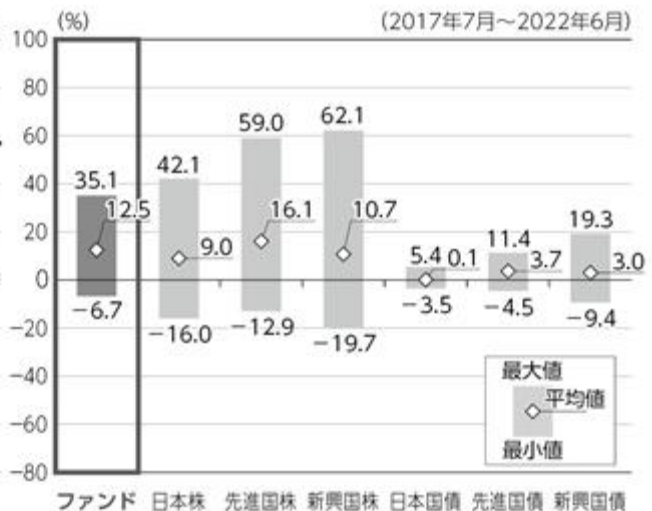


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2050

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

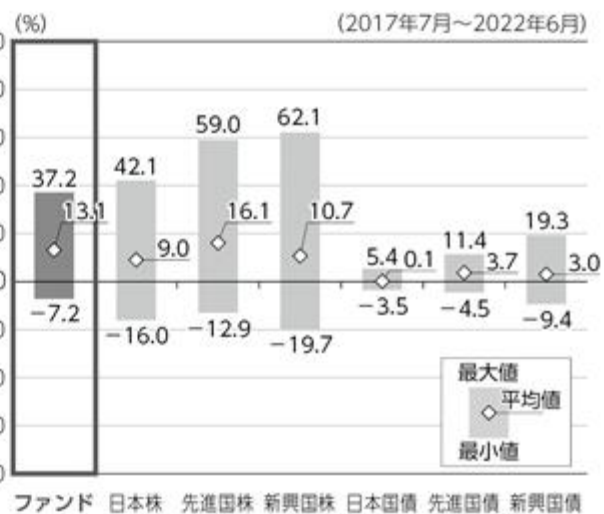


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2060

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数) (配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIEマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (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。
- ・MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

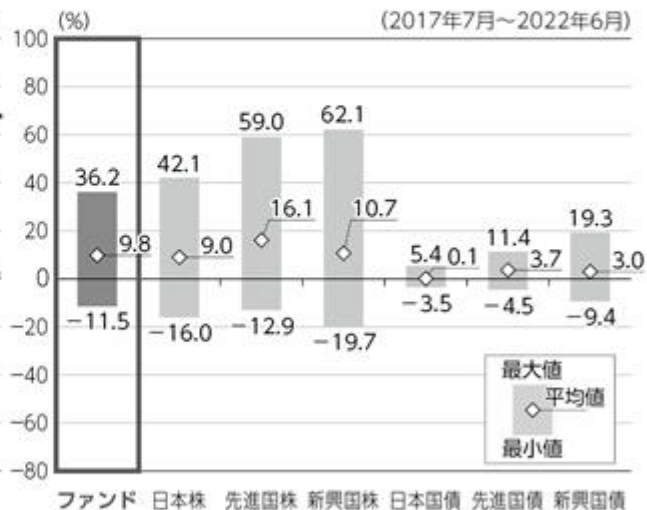
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●DCニッセイターゲットデートファンド2055

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

### <代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数) (配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)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・ディバースィファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

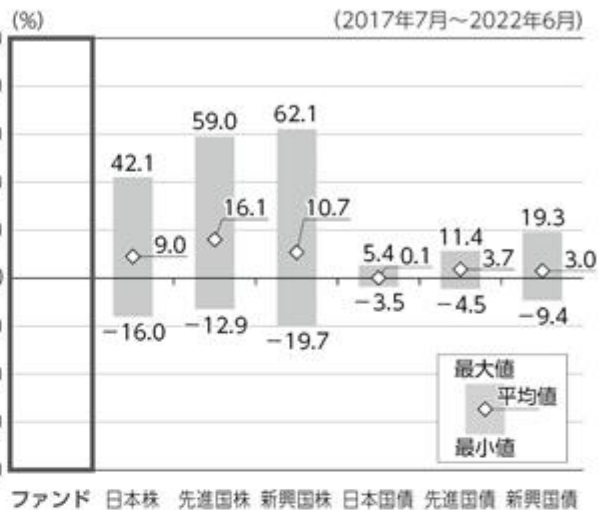
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●DCニッセイターゲットデートファンド2065

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### 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月末データが1年に満たないため、騰落率を記載していません。

・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年間に於けるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数) (配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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】

## (3)【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

各ファンドにおいて、信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

## [ターゲットデート2025]

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.31%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2030]

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

## [ターゲットデート2035]

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。



## 【ターゲットデート2040】

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

## 【ターゲットデート2045】

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## 【ターゲットデート2050】

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

## 【ターゲットデート2055】

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2060]

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

## [ターゲットデート2065]

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

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

## &lt;訂正後&gt;

各ファンドにおいて、信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

## 【ターゲットデート2025】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2017年決算日まで	<b>0.3456%</b> (税抜0.32%)	0.145%	0.145%	0.030%
2017年決算日翌日から 2022年決算日まで	<b>0.2420%</b> (税抜0.22%)*	0.100%	0.100%	0.020%
2022年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.1540%</b> (税抜0.14%)	0.060%	0.060%	0.020%

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.31%から税抜0.27%に、そして2022年9月21日に税抜0.27%から当該料率に変更いたしました。

## 【ターゲットデート2030】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2027年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2027年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

\*信託報酬率を2022年9月21日に税抜0.28%から当該料率に変更いたしました。

## 【ターゲットデート2035】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2032年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2032年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から税抜0.29%に、そして2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

## [ターゲットデート2040]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2037年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2037年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

※信託報酬率を2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

## [ターゲットデート2045]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2042年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2042年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

※信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から税抜0.29%に、そして2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

## [ターゲットデート2050]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2047年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2047年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

※信託報酬率を2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

## [ターゲットデート2055]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2052年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2052年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

※信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から税抜0.29%に、そして2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

## [ターゲットデート2060]

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2057年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2057年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

※信託報酬率を2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

## 【ターゲットデート2065】

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2062年決算日まで	<b>0.242%</b> (税抜0.22%)*	0.10%	0.10%	0.02%
2062年決算日翌日から 償還日まで	<b>0.154%</b> (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

※信託報酬率を2022年9月21日に税抜0.29%から当該料率に変更いたしました。

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

## 5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

DCニッセイターゲットデットファンド2025

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,344,351,116	100.00
内 日本	2,344,351,116	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	19,430	0.00
純資産総額	2,344,331,686	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイターゲットデットファンド2030

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,035,961,578	100.00
内 日本	3,035,961,578	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	26,158	0.00
純資産総額	3,035,935,420	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイターゲットデットファンド2035

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,540,220,920	100.00
内 日本	4,540,220,920	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	40,291	0.00
純資産総額	4,540,180,629	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイターゲットデットファンド2040

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,903,758,209	100.00
内 日本	1,903,758,209	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,971	0.00
純資産総額	1,903,741,238	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイターゲットデットファンド2045

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,952,044,023	100.00
内 日本	1,952,044,023	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,344	0.00
純資産総額	1,952,026,679	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	818,916,346	100.00
内 日本	818,916,346	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,302	0.00
純資産総額	818,909,044	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,609,093,724	100.00
内 日本	1,609,093,724	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,294	0.00
純資産総額	1,609,079,430	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,123,422,743	100.00
内 日本	1,123,422,743	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,006	0.00
純資産総額	1,123,412,737	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2065

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	39,487,757	100.00
内 日本	39,487,757	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	645	0.00
純資産総額	39,488,402	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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	188,943,581,290	97.99
内 日本	188,943,581,290	97.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,883,468,818	2.01
純資産総額	192,827,050,108	100.00

## その他資産の投資状況

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	3,797,115,000	1.97
内 日本	3,797,115,000	1.97

（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。



## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	509,748,937,077	93.75
内 アメリカ	361,483,321,286	66.48
内 イギリス	23,981,609,215	4.41
内 カナダ	20,413,396,529	3.75
内 スイス	18,002,791,572	3.31
内 フランス	16,087,893,107	2.96
内 ドイツ	11,865,674,050	2.18
内 オーストラリア	11,265,730,714	2.07
内 オランダ	8,535,220,687	1.57
内 アイルランド	6,827,987,567	1.26
内 スウェーデン	5,242,095,349	0.96
内 香港	4,390,235,820	0.81
内 デンマーク	4,238,913,501	0.78
内 スペイン	3,818,510,374	0.70
内 イタリア	2,970,718,721	0.55
内 シンガポール	1,701,921,197	0.31
内 フィンランド	1,547,581,618	0.28
内 ベルギー	1,491,738,960	0.27
内 ノルウェー	1,242,666,860	0.23
内 ジャージー	1,027,479,198	0.19
内 イスラエル	1,000,158,324	0.18
内 オランダ領キュラソー	573,664,173	0.11
内 パミュータ	462,781,622	0.09
内 ケイマン諸島	422,049,473	0.08
内 ポルトガル	359,527,608	0.07
内 ニュージーランド	286,541,018	0.05
内 オーストリア	281,774,510	0.05
内 ルクセンブルグ	226,954,024	0.04
投資証券	12,676,511,212	2.33
内 アメリカ	10,916,120,466	2.01
内 オーストラリア	721,942,849	0.13
内 イギリス	286,349,698	0.05
内 シンガポール	249,484,761	0.05
内 香港	197,705,236	0.04
内 フランス	194,944,988	0.04
内 カナダ	58,674,331	0.01
内 ベルギー	51,288,883	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	21,320,375,673	3.92
純資産総額	543,745,823,962	100.00

## その他資産の投資状況

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	20,103,892,205	3.70
内 アメリカ	14,859,106,402	2.73
内 ドイツ	3,729,041,405	0.69
内 イギリス	1,515,744,398	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。

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	50,694,724,310	74.74
内 日本	50,694,724,310	74.74
地方債証券	4,887,140,321	7.20
内 日本	4,887,140,321	7.20
特殊債券	5,976,732,278	8.81
内 日本	5,976,732,278	8.81
社債券	5,755,380,200	8.49
内 日本	5,354,987,200	7.89
内 スウェーデン	201,063,200	0.30
内 フランス	199,329,800	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	516,041,118	0.76
純資産総額	67,830,018,227	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	53,274,476,154	99.10
内 アメリカ	27,146,873,125	50.50
内 フランス	4,673,255,543	8.69
内 イタリア	4,381,969,048	8.15
内 ドイツ	3,504,047,411	6.52
内 スペイン	2,801,945,653	5.21
内 イギリス	2,659,107,777	4.95
内 カナダ	1,094,355,730	2.04
内 ベルギー	1,080,529,164	2.01
内 中国	1,055,890,187	1.96
内 オランダ	918,874,471	1.71
内 オーストラリア	809,591,715	1.51
内 オーストリア	689,901,857	1.28
内 メキシコ	415,903,632	0.77
内 アイルランド	362,209,831	0.67
内 フィンランド	281,745,919	0.52
内 マレーシア	271,970,155	0.51
内 シンガポール	235,365,976	0.44
内 ポーランド	222,537,380	0.41
内 イスラエル	213,893,869	0.40
内 デンマーク	202,493,539	0.38
内 スウェーデン	142,418,283	0.26
内 ノルウェー	109,595,889	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	483,925,470	0.90
純資産総額	53,758,401,624	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

DCニッセイターゲットデットファンド2025

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,182,178,238	0.9832 2,145,614,962	0.9553 2,084,634,870	- -	88.92
2	ニッセイ国内株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	51,672,127	2.1692 112,087,379	2.1317 110,149,473	- -	4.70
3	ニッセイ外国債券インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	67,119,749	1.5153 101,711,941	1.5497 104,015,475	- -	4.44
4	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	15,884,816	2.8649 45,508,717	2.8676 45,551,298	- -	1.94

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイターゲットデットファンド2030

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,806,644,148	0.9829 1,775,872,283	0.9553 1,725,887,154	- -	56.85
2	ニッセイ外国株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	199,677,658	2.8673 572,540,985	2.8676 572,595,652	- -	18.86
3	ニッセイ国内株式インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	217,355,261	2.1724 472,190,036	2.1317 463,336,209	- -	15.26
4	ニッセイ外国債券インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	176,900,409	1.5168 268,330,969	1.5497 274,142,563	- -	9.03

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2035

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	541,389,089	2.8730 1,555,459,573	2.8676 1,552,487,351	- -	34.19
2	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,321,943,575	0.9810 1,296,953,983	0.9553 1,262,852,697	- -	27.82
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	527,011,257	2.1749 1,146,228,893	2.1317 1,123,429,896	- -	24.74
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	388,108,006	1.5165 588,598,986	1.5497 601,450,976	- -	13.25

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	268,075,572	2.8764 771,100,662	2.8676 768,733,510	- -	40.38
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	256,895,077	2.1766 559,182,582	2.1317 547,623,235	- -	28.77
3	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	317,086,064	0.9807 310,976,930	0.9553 302,912,316	- -	15.91
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	183,576,917	1.5166 278,421,597	1.5497 284,489,148	- -	14.94

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	287,069,782	2.8736 824,936,312	2.8676 823,201,306	- -	42.17
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	273,562,716	2.1756 595,181,723	2.1317 583,153,641	- -	29.87
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	194,978,466	1.5162 295,630,334	1.5497 302,158,128	- -	15.48
4	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	254,926,147	0.9804 249,939,888	0.9553 243,530,948	- -	12.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2022年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	124,125,458	2.8766 357,070,968	2.8676 355,942,163	- -	43.47
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	117,874,673	2.1770 256,616,231	2.1317 251,273,440	- -	30.68
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	83,506,329	1.5156 126,567,842	1.5497 129,409,758	- -	15.80
4	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	86,141,511	0.9796 84,387,415	0.9553 82,290,985	- -	10.05

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	250,774,553	2.8754 721,086,848	2.8676 719,121,108	- -	44.69
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	236,920,221	2.1745 515,183,185	2.1317 505,042,835	- -	31.39
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	167,277,744	1.5156 253,542,375	1.5497 259,230,319	- -	16.11
4	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	131,581,139	0.9791 128,834,316	0.9553 125,699,462	- -	7.81

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	179,470,878	2.8772 516,387,403	2.8676 514,650,689	- -	45.81
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	169,156,563	2.1700 367,075,658	2.1317 360,591,045	- -	32.10
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	118,969,680	1.5150 180,247,378	1.5497 184,367,313	- -	16.41
4	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	66,799,640	0.9767 65,247,201	0.9553 63,813,696	- -	5.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 種類別及び業種別投資比率

2022年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DCニッセイターゲットデットファンド2065

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,374,566	2.9356 18,713,714	2.8676 18,279,705	- -	46.29
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,004,552	2.1533 12,929,771	2.1317 12,799,903	- -	32.41
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,212,653	1.5187 6,398,025	1.5497 6,528,348	- -	16.53
4	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,967,760	0.9628 1,894,755	0.9553 1,879,801	- -	4.76

(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6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(参考)

## ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	3,580,500	2,148.42 7,692,432,695	2,100.00 7,519,050,000	- -	3.90
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	492,000	11,647.02 5,730,338,297	11,095.00 5,458,740,000	- -	2.83
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	863,800	3,609.57 3,117,954,656	3,896.00 3,365,364,800	- -	1.75
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,534,200	741.05 3,360,075,050	729.40 3,307,245,480	- -	1.72
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	71,200	50,535.02 3,598,093,698	46,380.00 3,302,256,000	- -	1.71
6	任天堂 日本	株式 その他製品	44,300	58,415.97 2,587,827,718	58,680.00 2,599,524,000	- -	1.35
7	日立製作所 日本	株式 電気機器	377,700	6,249.22 2,360,333,411	6,438.00 2,431,632,600	- -	1.26
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	462,100	5,138.44 2,374,475,993	5,235.00 2,419,093,500	- -	1.25
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	561,900	4,087.90 2,296,992,073	4,289.00 2,409,989,100	- -	1.25
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	617,300	3,584.39 2,212,648,429	3,818.00 2,356,851,400	- -	1.22
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	49,800	53,726.04 2,675,557,160	44,300.00 2,206,140,000	- -	1.14
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	537,600	4,465.21 2,400,501,042	3,995.00 2,147,712,000	- -	1.11
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	507,200	4,163.81 2,111,887,234	4,037.00 2,047,566,400	- -	1.06
14	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	502,700	4,161.32 2,091,899,309	4,032.00 2,026,886,400	- -	1.05
15	第一三共 日本	株式 医薬品	569,700	2,829.90 1,612,199,105	3,437.00 1,958,058,900	- -	1.02
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	574,200	3,508.47 2,014,569,052	3,293.00 1,890,840,600	- -	0.98
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	85,800	20,828.72 1,787,104,481	21,750.00 1,866,150,000	- -	0.97
18	信越化学工業 日本	株式 化学	121,900	17,211.82 2,098,121,425	15,300.00 1,865,070,000	- -	0.97

19	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	1,167,300	1,480.12 1,727,748,682	1,506.50 1,758,537,450	- -	0.91
20	HOYA 日本	株式 精密機器	151,600	13,971.76 2,118,120,162	11,585.00 1,756,286,000	- -	0.91
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	215,600	7,167.51 1,545,316,230	7,903.00 1,703,886,800	- -	0.88
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	463,800	3,778.73 1,752,576,767	3,667.00 1,700,754,600	- -	0.88
23	三井物産 日本	株式 卸売業	560,700	3,097.84 1,736,961,838	2,994.50 1,679,016,150	- -	0.87
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	214,200	7,934.56 1,699,583,419	7,396.00 1,584,223,200	- -	0.82
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス 業	79,800	20,137.06 1,606,937,666	18,920.00 1,509,816,000	- -	0.78
26	ファナック 日本	株式 電気機器	68,900	21,130.70 1,455,905,498	21,240.00 1,463,436,000	- -	0.76
27	日本電産 日本	株式 電気機器	174,500	9,229.43 1,610,536,032	8,380.00 1,462,310,000	- -	0.76
28	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	928,800	1,569.19 1,457,467,716	1,543.00 1,433,138,400	- -	0.74
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	671,500	2,012.71 1,351,539,106	2,115.00 1,420,222,500	- -	0.74
30	S M C 日本	株式 機械	23,000	65,366.19 1,503,422,445	60,470.00 1,390,810,000	- -	0.72

(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6月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	16.99
		情報・通信業	8.94
		輸送用機器	7.91
		化学	6.15
		卸売業	5.40
		医薬品	5.36
		銀行業	5.28
		機械	5.20
		サービス業	5.10
		小売業	4.23
		食料品	3.38
		陸運業	3.01
		精密機器	2.57
		その他製品	2.47
		保険業	2.30
		建設業	2.20
		不動産業	2.01
		電気・ガス業	1.34
		その他金融業	1.13
		鉄鋼	0.76
		証券、商品先物取引業	0.72
		非鉄金属	0.71
		ガラス・土石製品	0.71
		ゴム製品	0.69
		海運業	0.61
		金属製品	0.59
		石油・石炭製品	0.53
		繊維製品	0.46
		空運業	0.43
	鉱業	0.32	
パルプ・紙	0.19		
倉庫・運輸関連業	0.18		
水産・農林業	0.10		
	小計		97.99
合 計（対純資産総額比）			97.99

（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。

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	1,339,268	18,785.21 25,158,439,134	19,029.95 25,486,211,647	- -	4.69
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	584,462	34,627.15 20,238,254,318	35,572.33 20,790,679,110	- -	3.82
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	751,640	14,697.01 11,046,860,912	14,887.18 11,189,804,184	- -	2.06
4	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア ・エンターテインメント	24,679	301,840.53 7,449,122,557	305,347.22 7,535,664,052	- -	1.39
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア ・エンターテインメント	23,313	302,783.24 7,058,785,853	306,864.36 7,153,929,020	- -	1.32
6	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部品	72,089	97,236.96 7,009,715,648	93,690.03 6,754,021,264	- -	1.24
7	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア 機器・ サービス	77,209	65,438.24 5,052,421,316	70,487.24 5,442,249,529	- -	1.00
8	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	215,843	23,783.19 5,133,435,941	24,190.99 5,221,456,545	- -	0.96
9	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	205,151	23,433.76 4,807,459,622	21,242.80 4,357,982,811	- -	0.80
10	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア ・エンターテインメント	189,454	26,145.51 4,953,372,815	22,407.31 4,245,156,251	- -	0.78
11	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	347,395	12,465.36 4,330,405,456	12,044.24 4,184,109,310	- -	0.77
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	106,021	41,577.09 4,408,045,375	37,380.61 3,963,129,992	- -	0.73

13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	196,784	19,370.67 3,811,838,673	19,435.89 3,824,673,358	- -	0.70
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	242,262	16,191.68 3,922,629,441	15,759.20 3,817,856,279	- -	0.70
15	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	231,021	16,242.67 3,752,400,128	16,095.67 3,718,440,089	- -	0.68
16	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	136,105	26,989.19 3,673,364,808	27,267.65 3,711,264,864	- -	0.68
17	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	461,462	6,927.75 3,196,897,230	6,962.47 3,212,919,576	- -	0.59
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	159,821	22,830.61 3,648,811,975	20,089.22 3,210,680,252	- -	0.59
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	85,704	39,357.94 3,373,133,046	37,432.55 3,208,119,402	- -	0.59
20	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	71,624	45,435.68 3,254,285,767	44,091.60 3,158,016,844	- -	0.58
21	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	145,215	20,728.94 3,010,153,503	21,067.85 3,059,368,592	- -	0.56
22	ELI LILLY & CO 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	66,438	39,159.36 2,601,669,778	44,147.63 2,933,080,906	- -	0.54
23	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	338,238	8,208.41 2,776,399,148	8,573.93 2,900,031,100	- -	0.53

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	57,614	45,406.20 2,616,032,868	45,773.87 2,637,216,322	- -	0.49
25	MERCK & CO 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	207,496	12,586.75 2,611,700,528	12,644.26 2,623,634,783	- -	0.48
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	595,689	4,708.62 2,804,876,713	4,354.62 2,594,002,092	- -	0.48
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	113,621	22,045.01 2,504,776,254	22,788.65 2,589,269,928	- -	0.48
28	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信 サービス	345,153	6,718.62 2,318,954,169	6,962.47 2,403,120,583	- -	0.44
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	32,111	75,291.24 2,417,677,097	73,249.54 2,352,116,158	- -	0.43
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生 活必需品 小売り	36,371	57,903.05 2,105,991,878	64,217.73 2,335,663,101	- -	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2022年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	10.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.06
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.06
		銀行	5.67
		資本財	5.65
		メディア・娯楽	5.59
		エネルギー	5.08
		ヘルスケア機器・サービス	4.74
		小売	4.46
		各種金融	4.43
		食品・飲料・タバコ	4.30
		素材	4.14
		半導体・半導体製造装置	4.11
		公益事業	3.17
		保険	3.11
		自動車・自動車部品	2.01
		運輸	1.86
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		消費者サービス	1.66
		電気通信サービス	1.65
耐久消費財・アパレル	1.54		
食品・生活必需品小売り	1.49		
商業・専門サービス	1.14		
不動産	0.41		
	小計		93.75
投資証券	外国		2.33
	小計		2.33
合 計（対純資産総額比）			96.08

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



## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	637,000,000	100.39 639,484,300	100.05 637,356,720	0.1 2028/3/20	0.94
2	第432回 利付国債(2 年) 日本	国債証 券	600,000,000	100.10 600,636,000	100.13 600,810,000	0.005 2024/1/1	0.89
3	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	564,000,000	100.40 566,256,000	99.97 563,830,800	0.1 2028/6/20	0.83
4	第218回 政保道路機構 債券 日本	特殊債 券	500,000,000	101.44 507,214,500	101.29 506,473,000	0.66 2024/5/31	0.75
5	第433回 利付国債(2 年) 日本	国債証 券	500,000,000	100.13 500,651,000	100.12 500,635,000	0.005 2024/2/1	0.74
6	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	494,000,000	100.40 495,976,000	100.16 494,805,220	0.1 2027/12/20	0.73
7	第334回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	483,000,000	101.43 489,906,900	101.32 489,380,430	0.6 2024/6/20	0.72
8	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	470,000,000	101.44 476,768,000	101.45 476,824,400	0.4 2025/9/20	0.70
9	第345回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	472,000,000	100.38 473,804,400	100.44 474,109,840	0.1 2026/12/20	0.70
10	第365回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	474,000,000	99.08 469,647,780	98.70 467,852,220	0.1 2031/12/20	0.69
11	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	458,000,000	101.17 463,358,600	101.18 463,408,980	0.3 2025/12/20	0.68
12	第361回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	467,000,000	99.78 465,976,200	98.79 461,377,320	0.1 2030/12/20	0.68
13	第362回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	466,000,000	99.61 464,206,160	98.72 460,035,200	0.1 2031/3/20	0.68
14	第363回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	466,000,000	99.49 463,623,400	98.64 459,662,400	0.1 2031/6/20	0.68
15	第364回 利付国債(1 0年) 日本	国債証 券	465,000,000	99.34 461,931,000	98.64 458,708,550	0.1 2031/9/20	0.68

16	第149回 利付国債（5年） 日本	国債証券	456,000,000	99.95 455,772,000	100.08 456,383,040	0.005 2026/9/20	0.67
17	第434回 利付国債（2年） 日本	国債証券	450,000,000	100.08 450,382,500	100.13 450,598,500	0.005 2024/3/1	0.66
18	第144回 利付国債（5年） 日本	国債証券	445,000,000	100.37 446,646,500	100.47 447,118,200	0.1 2025/6/20	0.66
19	第342回 利付国債（10年） 日本	国債証券	423,000,000	100.42 424,776,600	100.48 425,043,090	0.1 2026/3/20	0.63
20	第5回 電通グループ 日本	社債券	400,000,000	100.19 400,778,800	100.07 400,296,400	0.32 2027/7/8	0.59
21	第25回 首都高速道路債券 日本	社債券	400,000,000	99.78 399,141,600	99.82 399,298,400	0.03 2024/9/20	0.59
22	第357回 利付国債（10年） 日本	国債証券	384,000,000	100.19 384,729,600	99.15 380,751,360	0.1 2029/12/20	0.56
23	第358回 利付国債（10年） 日本	国債証券	384,000,000	100.11 384,422,400	99.05 380,355,840	0.1 2030/3/20	0.56
24	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	380,000,000	100.26 380,988,000	99.39 377,697,200	0.1 2029/9/20	0.56
25	第352回 利付国債（10年） 日本	国債証券	370,000,000	100.39 371,443,000	99.87 369,541,200	0.1 2028/9/20	0.54
26	第92回 利付国債（20年） 日本	国債証券	336,000,000	109.98 369,536,160	109.38 367,547,040	2.1 2026/12/20	0.54
27	第353回 利付国債（10年） 日本	国債証券	353,000,000	100.37 354,306,100	99.77 352,205,750	0.1 2028/12/20	0.52
28	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	347,000,000	101.36 351,719,200	101.36 351,746,960	0.4 2025/6/20	0.52
29	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	341,000,000	100.44 342,500,400	100.49 342,691,360	0.1 2026/6/20	0.51
30	第37回 利付国債（30年） 日本	国債証券	289,000,000	123.53 357,001,700	118.32 341,950,580	1.9 2042/9/20	0.50

（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6月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	国内	国債証券	74.74
		特殊債券	8.81
		社債券	7.89
		地方債証券	7.20
	小計		98.65
	外国	社債券	0.59
	小計		0.59
合 計 (対純資産総額比)			99.24

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	892,520,400	98.78 881,676,277	98.05 875,151,953	2.25 2024/11/15	1.63
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	651,963,600	99.74 650,318,027	98.93 645,033,226	2.5 2024/5/15	1.20
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	625,994,400	98.19 614,664,065	97.25 608,823,373	2.125 2025/5/15	1.13
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	602,758,800	100.44 605,442,984	99.62 600,498,454	2.75 2023/11/15	1.12
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	600,025,200	100.32 601,980,598	99.53 597,211,081	2.75 2024/2/15	1.11
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	557,654,400	100.19 558,769,059	99.42 554,470,193	2.5 2023/8/15	1.03
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	560,388,000	98.41 551,500,246	96.70 541,951,234	2.625 2029/2/15	1.01
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	538,519,200	99.21 534,271,031	98.50 530,457,567	2.375 2024/8/15	0.99
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	515,283,600	97.45 502,195,396	96.56 497,568,149	2 2025/8/15	0.93
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	508,449,600	96.35 489,916,612	95.15 483,820,301	2 2026/11/15	0.90
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	496,148,400	97.96 486,036,866	97.16 482,097,477	2 2025/2/15	0.90
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	471,546,000	95.66 451,099,765	94.67 446,417,313	1.625 2026/2/15	0.83
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	452,410,800	97.04 439,062,959	95.94 434,047,445	2.25 2027/2/15	0.81
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	446,943,600	97.62 436,319,559	96.29 430,375,400	2.375 2027/5/15	0.80
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	436,009,200	98.64 430,096,915	97.98 427,236,694	1.375 2023/9/30	0.79
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	437,376,000	98.06 428,899,653	97.04 424,442,791	2.25 2025/11/15	0.79
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	438,742,800	96.40 422,991,933	95.87 420,657,821	0.125 2023/12/15	0.78

18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	426,441,600	95.90 409,000,138	95.35 406,633,387	0.25 2024/3/15	0.76
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	425,074,800	95.38 405,478,851	94.35 401,096,330	1.625 2026/5/15	0.75
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	405,939,600	99.87 405,416,429	98.15 398,454,073	2.875 2028/8/15	0.74
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	362,202,000	99.62 360,854,608	98.83 357,982,346	2.25 2023/12/31	0.67
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	377,236,800	94.56 356,752,841	93.48 352,656,050	1.5 2026/8/15	0.66
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	352,634,400	97.81 344,946,970	96.76 341,226,677	2.25 2026/3/31	0.63
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	344,433,600	98.69 339,938,741	97.88 337,166,051	2.25 2024/12/31	0.63
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	337,599,600	99.56 336,134,417	98.69 333,180,421	2.625 2025/3/31	0.62
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	334,866,000	99.31 332,562,121	97.69 327,147,338	2.75 2028/2/15	0.61
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	330,765,600	99.07 327,706,974	98.44 325,608,964	1.375 2023/6/30	0.61
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	330,765,600	99.20 328,129,398	98.39 325,453,504	2.125 2024/3/31	0.61
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	328,032,000	99.30 325,748,897	98.22 322,199,591	2.625 2025/12/31	0.60
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	332,132,400	96.78 321,454,343	95.32 316,615,174	2.25 2027/11/15	0.59

（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6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	外国	国債証券	99.10
	小計		99.10
合計(対純資産総額比)			99.10

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

DCニッセイターゲットデットファンド2025

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2030

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2035

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2040  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2045  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2050  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2055  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2060  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2065  
該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

DCニッセイターゲットデットファンド2025  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2030  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2035  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2040  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2045  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2050  
該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2055

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2060

該当事項はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2065

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6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物 409月	買建	203	3,867,756,650	3,797,115,000	1.97

（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。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P 500 EMINI FUTURE 202209	買建	569	14,643,350,188	14,859,106,402	2.73
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 202209	買建	747	3,739,814,274	3,729,041,405	0.69
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202209	買建	126	1,500,670,257	1,515,744,398	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。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

DCニッセイターゲットデットファンド2025

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年12月20日)	1,042,745	1,042,745	1.0427	1.0427
第2計算期間末 (2018年12月20日)	75,725,362	75,725,362	1.0070	1.0070
第3計算期間末 (2019年12月20日)	457,912,286	457,912,286	1.0627	1.0627
第4計算期間末 (2020年12月21日)	1,301,134,378	1,301,134,378	1.0837	1.0837
第5計算期間末 (2021年12月20日)	2,216,280,204	2,216,280,204	1.1106	1.1106
2021年6月末日	1,672,238,678	-	1.1031	-
7月末日	1,724,866,471	-	1.1069	-
8月末日	1,744,390,733	-	1.1096	-
9月末日	1,839,817,492	-	1.1078	-
10月末日	1,948,391,159	-	1.1111	-
11月末日	2,140,723,668	-	1.1094	-
12月末日	2,248,347,495	-	1.1096	-
2022年1月末日	2,225,105,164	-	1.0974	-
2月末日	2,218,176,315	-	1.0909	-
3月末日	2,294,965,788	-	1.0942	-
4月末日	2,297,795,099	-	1.0894	-
5月末日	2,326,588,475	-	1.0879	-
6月末日	2,344,331,686	-	1.0781	-

## DCニッセイターゲットデットファンド2030

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2019年12月20日)	73,587,808	73,587,808	1.1045	1.1045
第2計算期間末 (2020年12月21日)	1,170,122,248	1,170,122,248	1.1535	1.1535
第3計算期間末 (2021年12月20日)	2,832,119,430	2,832,119,430	1.2486	1.2486
2021年6月末日	1,641,279,049	-	1.2236	-
7月末日	1,692,514,031	-	1.2262	-
8月末日	1,736,634,017	-	1.2390	-
9月末日	1,908,806,530	-	1.2390	-
10月末日	2,026,265,387	-	1.2579	-
11月末日	2,613,455,290	-	1.2487	-
12月末日	2,911,850,742	-	1.2635	-
2022年1月末日	2,842,700,735	-	1.2298	-
2月末日	2,855,490,915	-	1.2213	-
3月末日	2,966,347,893	-	1.2566	-
4月末日	2,918,116,556	-	1.2398	-
5月末日	2,983,998,480	-	1.2390	-
6月末日	3,035,935,420	-	1.2253	-



## DCニッセイターゲットデートファンド2035

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年12月20日)	1,082,306	1,082,306	1.0823	1.0823
第2計算期間末 (2018年12月20日)	70,055,216	70,055,216	0.9897	0.9897
第3計算期間末 (2019年12月20日)	564,969,332	564,969,332	1.1252	1.1252
第4計算期間末 (2020年12月21日)	1,687,473,196	1,687,473,196	1.1936	1.1936
第5計算期間末 (2021年12月20日)	3,957,865,139	3,957,865,139	1.3568	1.3568
2021年6月末日	2,451,414,364	-	1.3147	-
7月末日	2,544,315,292	-	1.3163	-
8月末日	2,663,664,740	-	1.3390	-
9月末日	3,001,252,057	-	1.3405	-
10月末日	3,198,729,470	-	1.3753	-
11月末日	3,694,572,165	-	1.3582	-
12月末日	4,115,283,361	-	1.3886	-
2022年1月末日	4,011,459,627	-	1.3321	-
2月末日	4,056,806,941	-	1.3218	-
3月末日	4,405,943,002	-	1.3897	-
4月末日	4,342,672,085	-	1.3597	-
5月末日	4,425,357,586	-	1.3594	-
6月末日	4,540,180,629	-	1.3418	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年12月20日)	46,572,387	46,572,387	1.1461	1.1461
第2計算期間末 (2020年12月21日)	520,318,560	520,318,560	1.2197	1.2197
第3計算期間末 (2021年12月20日)	1,600,494,859	1,600,494,859	1.4045	1.4045
2021年6月末日	795,685,174	-	1.3570	-
7月末日	843,814,036	-	1.3582	-
8月末日	913,517,547	-	1.3841	-
9月末日	1,059,770,696	-	1.3862	-
10月末日	1,161,899,171	-	1.4260	-
11月末日	1,446,947,714	-	1.4062	-
12月末日	1,679,842,749	-	1.4440	-
2022年1月末日	1,641,606,142	-	1.3769	-
2月末日	1,656,789,655	-	1.3660	-
3月末日	1,814,451,342	-	1.4484	-
4月末日	1,785,505,316	-	1.4122	-
5月末日	1,810,353,042	-	1.4121	-
6月末日	1,903,741,238	-	1.3927	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2017年12月20日)	1,088,135	1,088,135	1.0881	1.0881
第2計算期間末 (2018年12月20日)	43,412,324	43,412,324	0.9867	0.9867
第3計算期間末 (2019年12月20日)	264,521,692	264,521,692	1.1346	1.1346
第4計算期間末 (2020年12月21日)	682,760,159	682,760,159	1.2107	1.2107
第5計算期間末 (2021年12月20日)	1,665,050,649	1,665,050,649	1.3997	1.3997
2021年6月末日	988,940,581	-	1.3512	-
7月末日	1,045,156,296	-	1.3522	-
8月末日	1,116,201,188	-	1.3789	-
9月末日	1,261,569,749	-	1.3810	-
10月末日	1,358,769,585	-	1.4220	-
11月末日	1,537,489,961	-	1.4016	-
12月末日	1,745,054,180	-	1.4410	-
2022年1月末日	1,695,211,303	-	1.3717	-
2月末日	1,713,921,296	-	1.3607	-
3月末日	1,868,516,022	-	1.4463	-
4月末日	1,832,871,302	-	1.4089	-
5月末日	1,871,992,171	-	1.4089	-
6月末日	1,952,026,679	-	1.3892	-

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2019年12月20日）	25,150,378	25,150,378	1.1540	1.1540
第2計算期間末 （2020年12月21日）	146,693,410	146,693,410	1.2328	1.2328
第3計算期間末 （2021年12月20日）	680,452,088	680,452,088	1.4312	1.4312
2021年6月末日	269,612,220	-	1.3804	-
7月末日	294,651,059	-	1.3813	-
8月末日	338,842,543	-	1.4093	-
9月末日	449,069,531	-	1.4116	-
10月末日	505,974,332	-	1.4547	-
11月末日	622,414,107	-	1.4333	-
12月末日	717,512,372	-	1.4748	-
2022年1月末日	694,295,545	-	1.4022	-
2月末日	696,578,388	-	1.3909	-
3月末日	778,794,543	-	1.4809	-
4月末日	764,392,747	-	1.4416	-
5月末日	783,602,496	-	1.4416	-
6月末日	818,909,044	-	1.4212	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2016年12月20日)	1,141,342	1,141,342	1.1413	1.1413
第2計算期間末 (2017年12月20日)	2,854,940	2,854,940	1.3107	1.3107
第3計算期間末 (2018年12月20日)	71,901,230	71,901,230	1.1820	1.1820
第4計算期間末 (2019年12月20日)	359,193,901	359,193,901	1.3682	1.3682
第5計算期間末 (2020年12月21日)	653,687,309	653,687,309	1.4629	1.4629
第6計算期間末 (2021年12月20日)	1,303,595,387	1,303,595,387	1.7047	1.7047
2021年6月末日	940,102,965	-	1.6430	-
7月末日	971,652,562	-	1.6439	-
8月末日	1,049,890,792	-	1.6781	-
9月末日	1,142,101,025	-	1.6811	-
10月末日	1,230,139,370	-	1.7335	-
11月末日	1,270,073,904	-	1.7072	-
12月末日	1,370,096,889	-	1.7582	-
2022年1月末日	1,335,844,529	-	1.6696	-
2月末日	1,361,510,929	-	1.6561	-
3月末日	1,497,799,982	-	1.7662	-
4月末日	1,485,814,578	-	1.7182	-
5月末日	1,536,973,377	-	1.7183	-
6月末日	1,609,079,430	-	1.6937	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年12月20日)	32,944,282	32,944,282	1.1609	1.1609
第2計算期間末 (2020年12月21日)	175,309,722	175,309,722	1.2428	1.2428
第3計算期間末 (2021年12月20日)	855,240,032	855,240,032	1.4537	1.4537
2021年6月末日	439,599,986	-	1.3997	-
7月末日	478,883,858	-	1.4004	-
8月末日	534,904,796	-	1.4303	-
9月末日	675,023,075	-	1.4329	-
10月末日	753,414,381	-	1.4791	-
11月末日	818,388,853	-	1.4560	-
12月末日	914,251,955	-	1.5005	-
2022年1月末日	894,802,579	-	1.4235	-
2月末日	899,177,883	-	1.4119	-
3月末日	994,401,591	-	1.5079	-
4月末日	989,548,406	-	1.4661	-
5月末日	1,039,910,457	-	1.4662	-
6月末日	1,123,412,737	-	1.4450	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2065

直近日（2022年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
2022年1月末日	953,066	-	0.9531	-
2月末日	945,334	-	0.9453	-
3月末日	1,010,255	-	1.0095	-
4月末日	31,533,755	-	0.9814	-
5月末日	39,213,270	-	0.9813	-
6月末日	39,488,402	-	0.9673	-

## 【分配の推移】

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2021年12月21日～2022年6月20日	-

## 【収益率の推移】

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

	収益率（％）
第1計算期間	4.3
第2計算期間	3.4
第3計算期間	5.5
第4計算期間	2.0
第5計算期間	2.5
2021年12月21日～2022年6月20日	3.3

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

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

	収益率（％）
第1計算期間	10.5
第2計算期間	4.4
第3計算期間	8.2
2021年12月21日～2022年6月20日	3.3

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



## DCニッセイターゲットデートファンド2035

	収益率（％）
第1計算期間	8.2
第2計算期間	8.6
第3計算期間	13.7
第4計算期間	6.1
第5計算期間	13.7
2021年12月21日～2022年6月20日	3.6

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

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

	収益率（％）
第1計算期間	14.6
第2計算期間	6.4
第3計算期間	15.2
2021年12月21日～2022年6月20日	3.7

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

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

	収益率（％）
第1計算期間	8.8
第2計算期間	9.3
第3計算期間	15.0
第4計算期間	6.7
第5計算期間	15.6
2021年12月21日～2022年6月20日	3.7

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

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

	収益率（％）
第1計算期間	15.4
第2計算期間	6.8
第3計算期間	16.1
2021年12月21日～2022年6月20日	3.8

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

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

	収益率（％）
第1計算期間	14.1
第2計算期間	14.8
第3計算期間	9.8
第4計算期間	15.8
第5計算期間	6.9
第6計算期間	16.5
2021年12月21日～2022年6月20日	3.8

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

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

	収益率（％）
第1計算期間	16.1
第2計算期間	7.1
第3計算期間	17.0
2021年12月21日～2022年6月20日	3.8

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## DCニッセイターゲットデットファンド2025

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	86,246,774	12,050,899	75,195,875
第3計算期間	387,560,915	31,880,755	430,876,035
第4計算期間	922,348,817	152,580,214	1,200,644,638
第5計算期間	1,051,584,639	256,647,601	1,995,581,676
2021年12月21日～ 2022年6月20日	311,283,729	163,265,386	2,143,600,019

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデットファンド2030

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	73,774,281	7,147,035	66,627,246
第2計算期間	973,321,960	25,560,840	1,014,388,366
第3計算期間	1,471,484,708	217,636,186	2,268,236,888
2021年12月21日～ 2022年6月20日	290,204,674	111,567,942	2,446,873,620

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	75,898,281	6,116,182	70,782,099
第3計算期間	472,272,256	40,931,452	502,122,903
第4計算期間	1,069,111,112	157,447,877	1,413,786,138
第5計算期間	1,722,619,889	219,279,074	2,917,126,953
2021年12月21日～ 2022年6月20日	519,894,498	110,409,714	3,326,611,737

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	43,349,876	2,715,954	40,633,922
第2計算期間	409,608,219	23,643,836	426,598,305
第3計算期間	793,296,990	80,312,773	1,139,582,522
2021年12月21日～ 2022年6月20日	259,885,787	58,992,025	1,340,476,284

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	45,814,915	2,817,018	43,997,897
第3計算期間	215,465,288	26,325,617	233,137,568
第4計算期間	414,415,117	83,597,702	563,954,983
第5計算期間	735,655,901	110,059,244	1,189,551,640
2021年12月21日～ 2022年6月20日	278,247,965	89,666,379	1,378,133,226

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	25,368,600	3,574,381	21,794,219
第2計算期間	113,562,838	16,369,433	118,987,624
第3計算期間	418,895,243	62,456,116	475,426,751
2021年12月21日～ 2022年6月20日	144,305,716	55,411,479	564,320,988

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	2,178,145	1,000,000	2,178,145
第3計算期間	67,199,823	8,549,894	60,828,074
第4計算期間	228,564,856	26,865,852	262,527,078
第5計算期間	290,087,575	105,775,306	446,839,347
第6計算期間	495,378,300	177,500,475	764,717,172
2021年12月21日～ 2022年6月20日	256,311,001	95,968,468	925,059,705

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	37,713,552	9,335,463	28,378,089
第2計算期間	179,902,566	67,216,411	141,064,244
第3計算期間	605,255,833	158,007,296	588,312,781
2021年12月21日～ 2022年6月20日	322,923,173	175,848,674	735,387,280

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt; 参考情報 &gt;

## 3.運用実績

2022年6月末現在

### DCニッセイターゲットデートファンド2025

#### ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

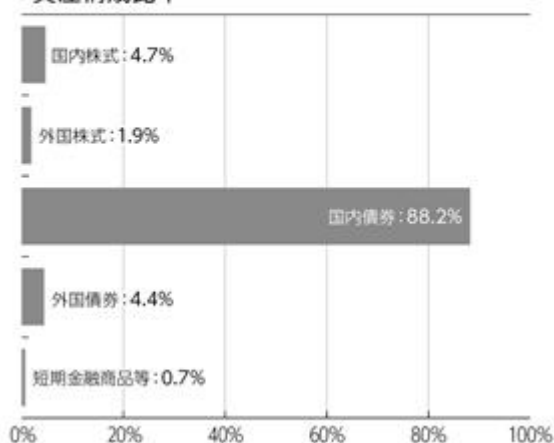
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	10,781円
純資産総額	23億円

#### ●分配の推移 1万円当り(税引前)

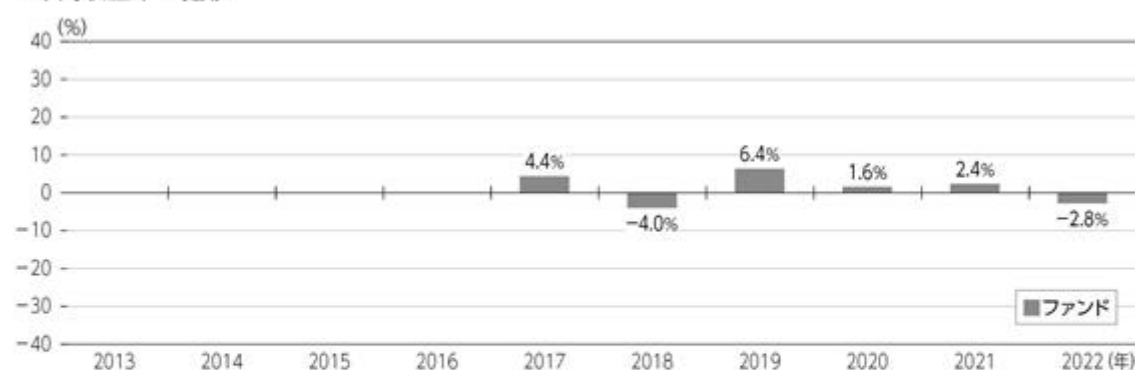
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

#### ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

#### ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・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。

## 3.運用実績

2022年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,253円
純資産総額	30億円

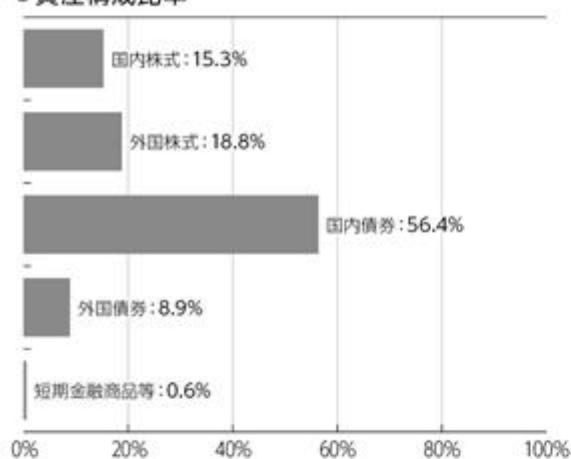
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

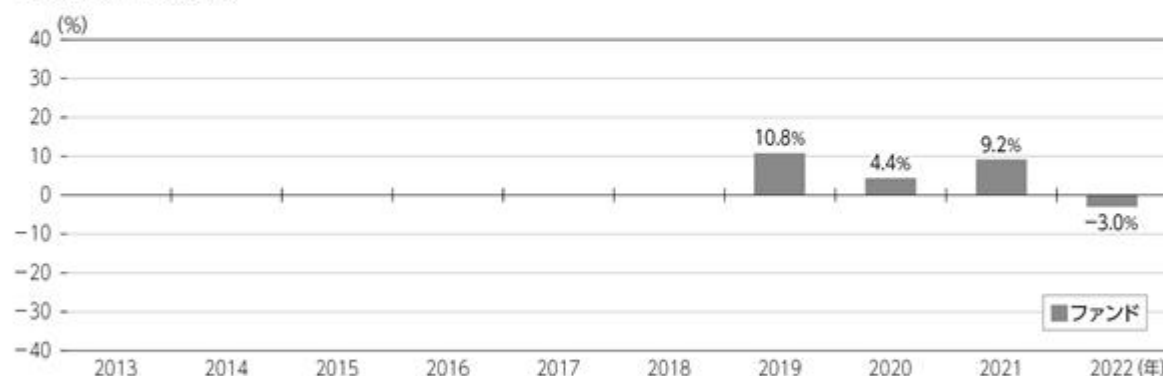
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

・2019年はファンド設定時から年末まで、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。

2022年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

## ●基準価額・純資産の推移



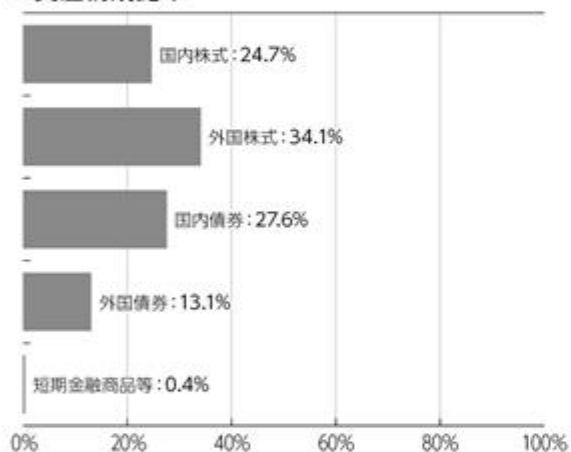
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

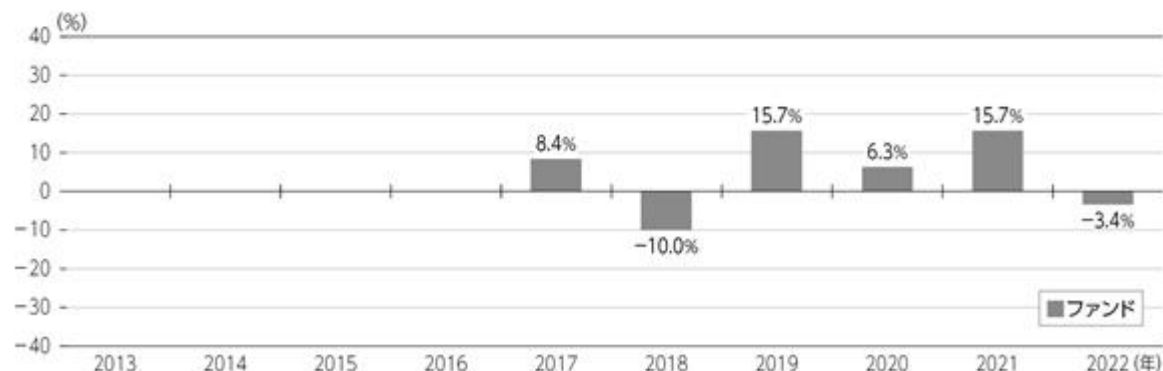
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・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。

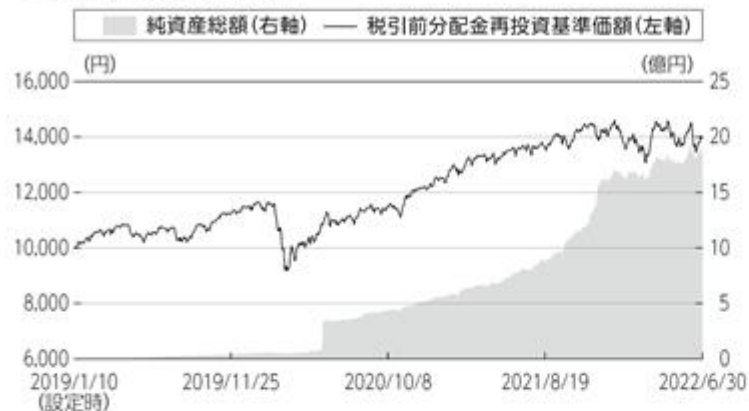
■ ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。  
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 3.運用実績

2022年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	13,927円
純資産総額	19億円

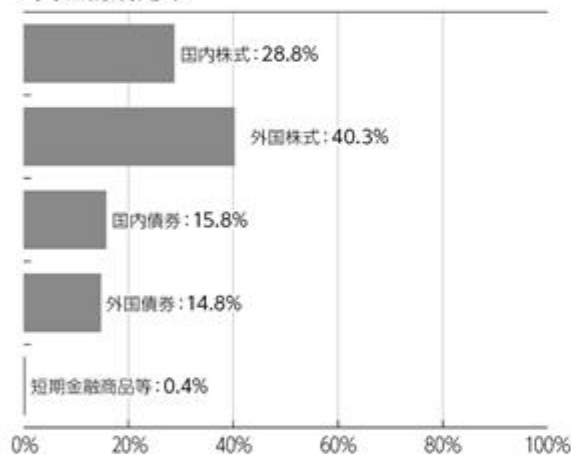
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

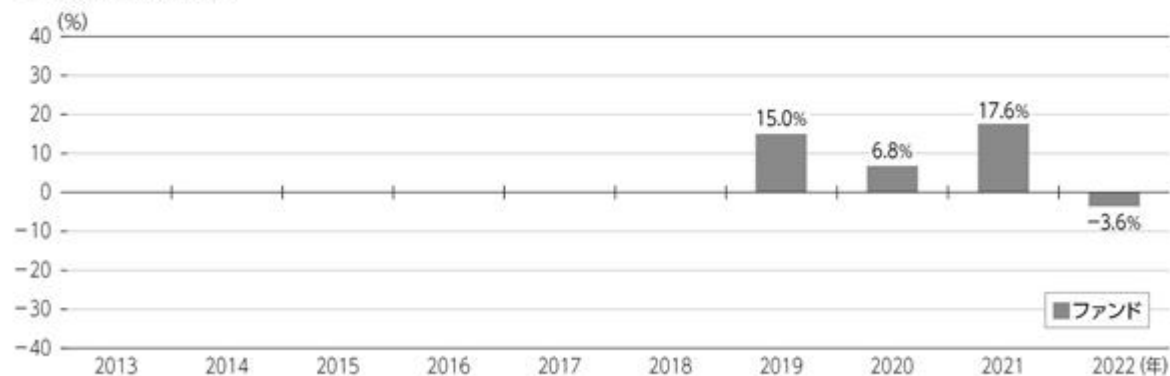
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

・2019年はファンド設定時から年末まで、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。



2022年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

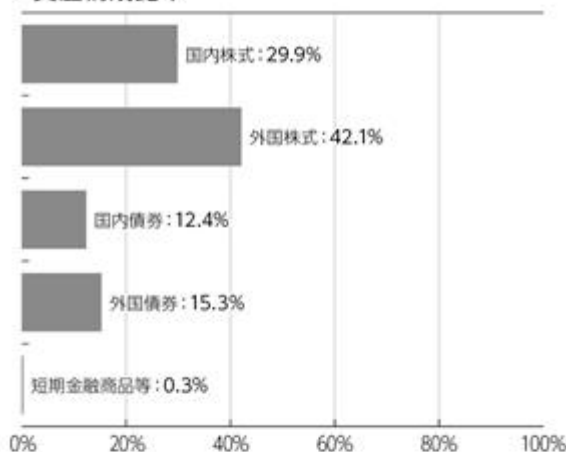
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

基準価額	13,892円
純資産総額	19億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

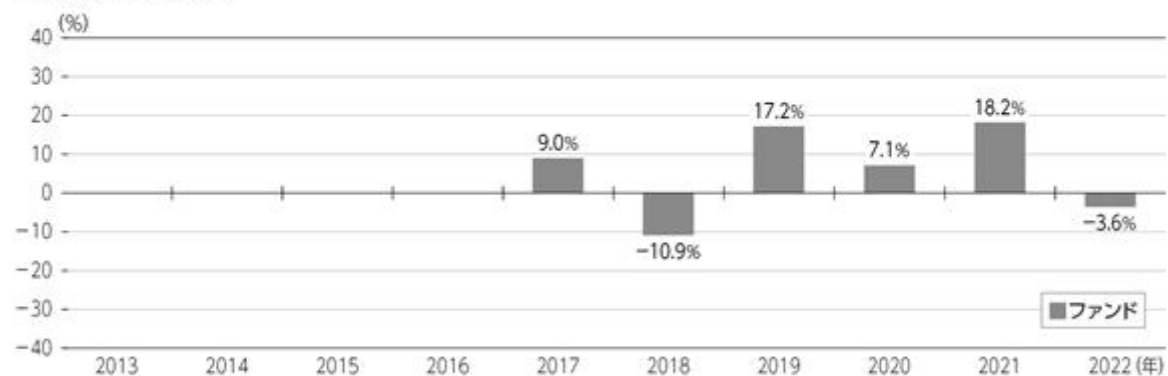
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したも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。

## 3.運用実績

2022年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

## ●基準価額・純資産の推移



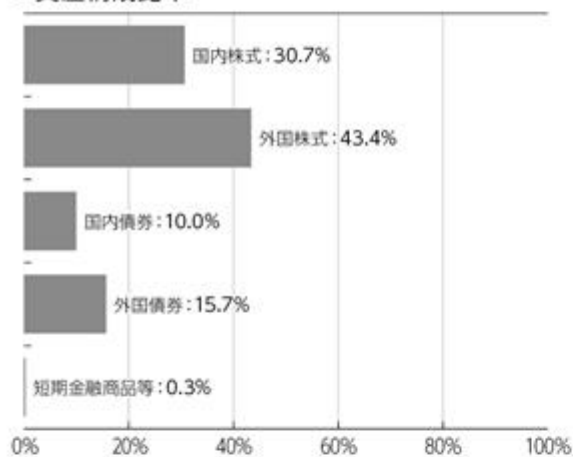
基準価額	14,212円
純資産総額	818百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

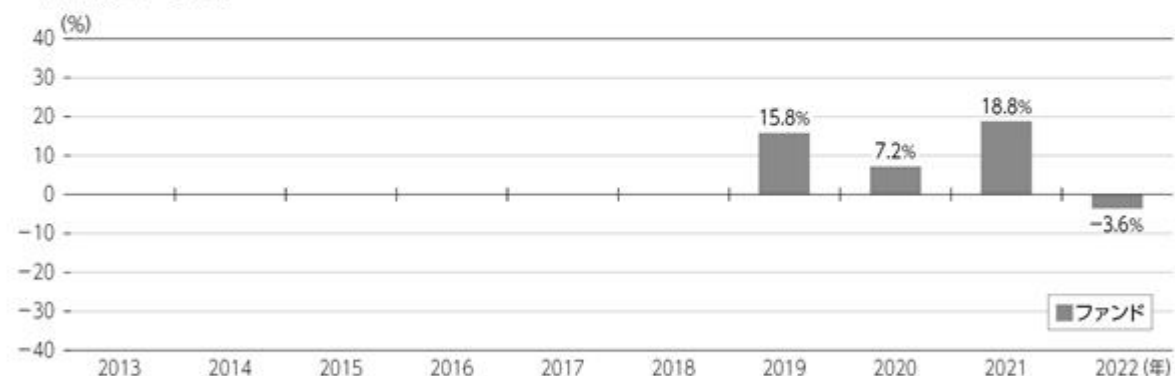
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2019年はファンド設定時から年末まで、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。

2022年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

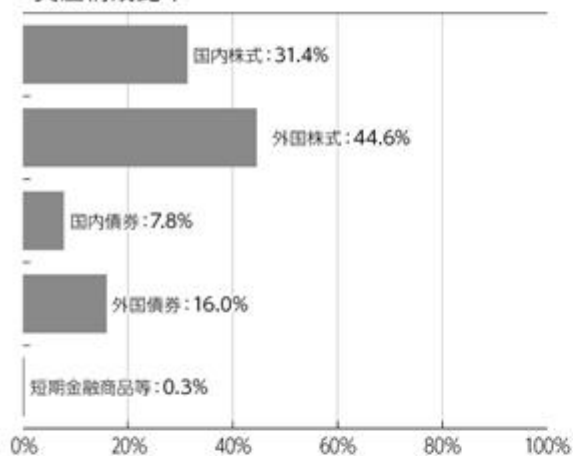
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	16.937円
純資産総額	16億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

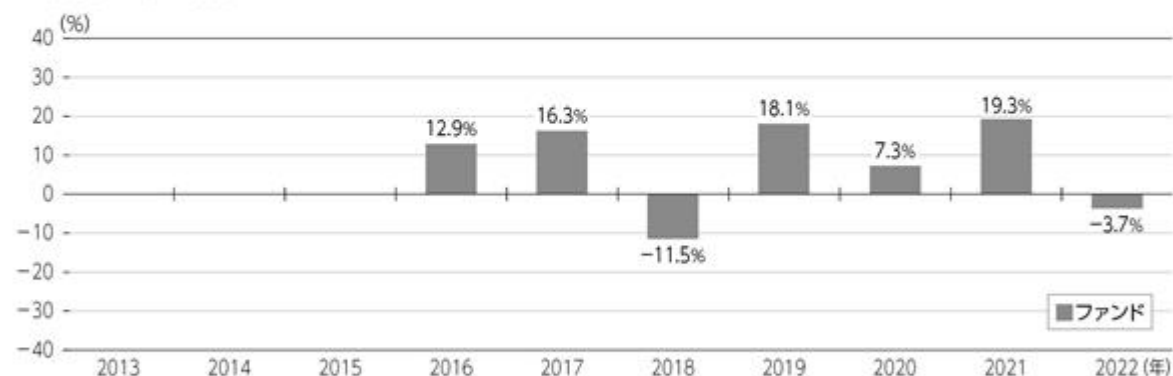
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2016年はファンド設定時から年末まで、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。

## 3.運用実績

2022年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	14,450円
純資産総額	11億円

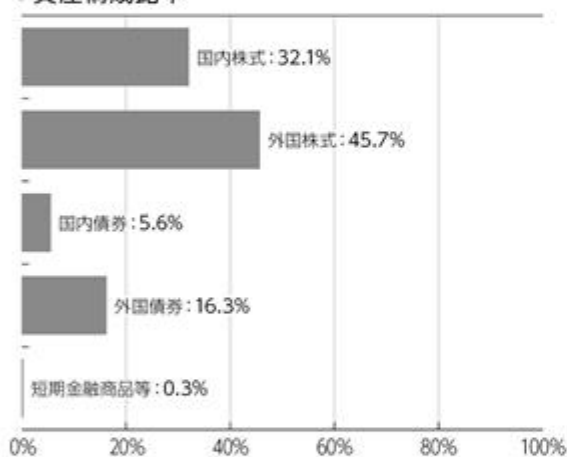
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

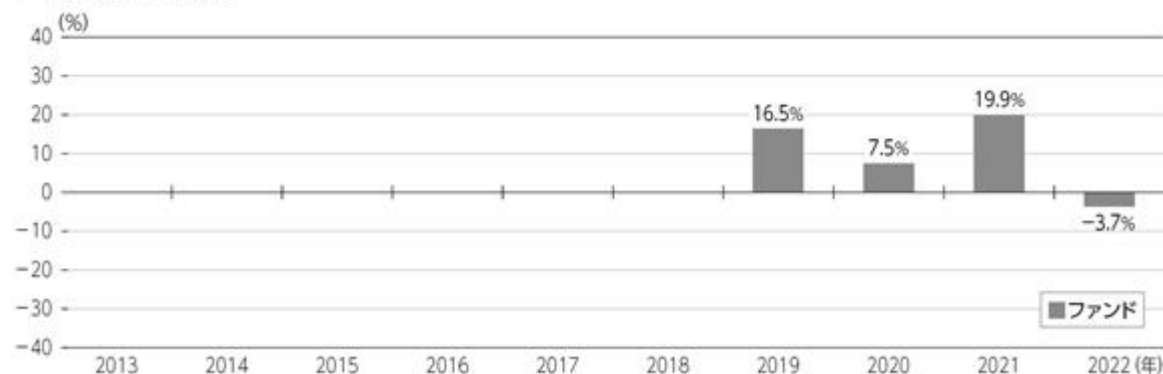
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2019年はファンド設定時から年末まで、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。

2022年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2065

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

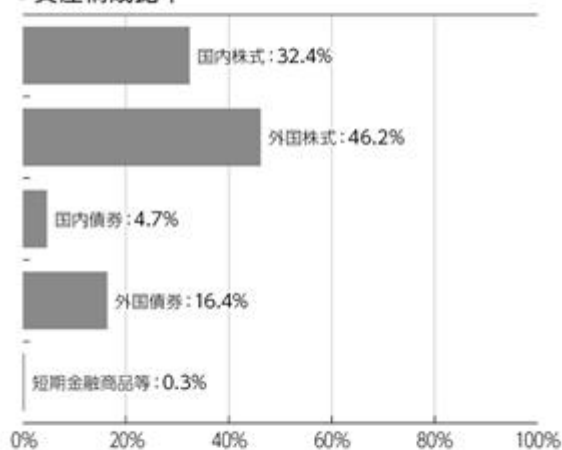
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	9.673円
純資産総額	39百万円

## ●分配の推移

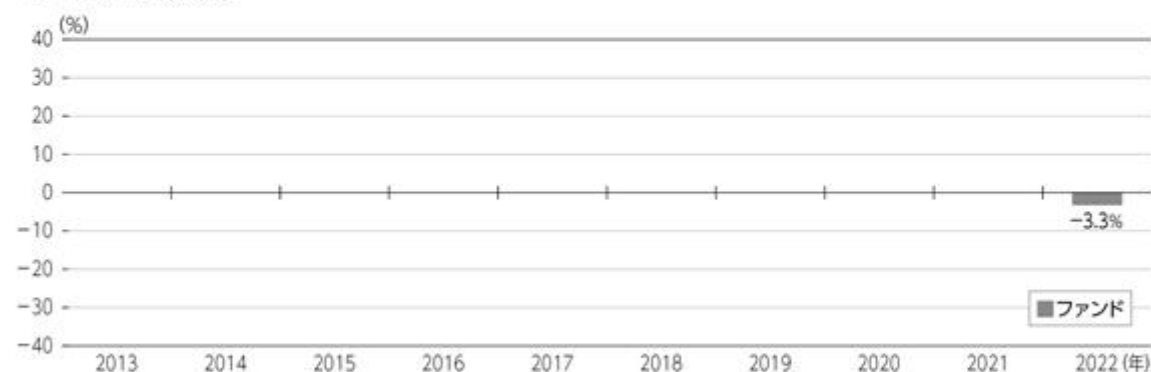
第1期決算日は2022年12月20日であり、該当事項はありません。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2022年はファンド設定時から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

## 3.運用実績

2022年6月末現在

## ●マザーファンドの状況

## 1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.0%
2	ソニーグループ	2.9%
3	日本電信電話	1.8%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.8%
5	キーエンス	1.7%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.3%
2	情報・通信業	9.1%
3	輸送用機器	8.1%
4	化学	6.3%
5	卸売業	5.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	4.9%
2	マイクロソフト	情報技術	4.0%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.1%
4	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.4%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.4%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	73.1%
2	イギリス	4.7%
3	カナダ	3.8%
4	フランス	3.3%
5	スイス	3.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 3. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	0.9%
2	第432回 利付国債(2年)	2024/01/01	0.005%	0.9%
3	第351回 利付国債(10年)	2028/06/20	0.100%	0.8%
4	第218回 政保道路機構債券	2024/05/31	0.660%	0.8%
5	第433回 利付国債(2年)	2024/02/01	0.005%	0.7%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入債券種別

	種別	比率
	日本国債	75.3%
	その他	24.7%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 4. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	2024/11/15	2.250%	1.6%
2	アメリカ国債	2024/05/15	2.500%	1.2%
3	アメリカ国債	2025/05/15	2.125%	1.1%
4	アメリカ国債	2023/11/15	2.750%	1.1%
5	アメリカ国債	2024/02/15	2.750%	1.1%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	51.0%
2	フランス	8.8%
3	イタリア	8.2%
4	ドイツ	6.6%
5	スペイン	5.3%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

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

最新の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3【ファンドの経理状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」につきまして、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### DCニッセイターゲットデートファンド2065

当ファンドは2022年1月11日から運用を開始しており、2021年12月20日時点では初回の決算が未到来となっております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2025

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2030

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2035

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2040

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2020年12月22日から2021年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。



## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2025】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	10,937	29,352
コール・ローン	1,606,303	2,698,432
親投資信託受益証券	1,301,167,147	2,216,336,145
未収入金	3,478,451	28,357,966
流動資産合計	1,306,262,838	2,247,421,895
資産合計	1,306,262,838	2,247,421,895
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,445,781	28,301,578
未払受託者報酬	180,499	305,780
未払委託者報酬	1,444,368	2,446,605
その他未払費用	57,812	87,728
流動負債合計	5,128,460	31,141,691
負債合計	5,128,460	31,141,691
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,200,644,638	1,995,581,676
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	100,489,740	220,698,528
(分配準備積立金)	38,363,673	66,232,197
元本等合計	1,301,134,378	2,216,280,204
純資産合計	1,301,134,378	2,216,280,204
負債純資産合計	1,306,262,838	2,247,421,895

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第5期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
営業収益		
受取利息	8	12
有価証券売買等損益	32,097,667	42,575,073
営業収益合計	32,097,675	42,575,085
営業費用		
支払利息	192	551
受託者報酬	268,890	541,656
委託者報酬	2,151,781	4,333,880
その他費用	87,205	159,137
営業費用合計	2,508,068	5,035,224
営業利益又は営業損失（ ）	29,589,607	37,539,861
経常利益又は経常損失（ ）	29,589,607	37,539,861
当期純利益又は当期純損失（ ）	29,589,607	37,539,861
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,265,428	3,703,217
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,036,251	100,489,740
剰余金増加額又は欠損金減少額	51,624,133	108,869,314
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	51,624,133	108,869,314
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,025,679	22,497,170
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,025,679	22,497,170
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（ ）	100,489,740	220,698,528

## ( 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 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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	第5期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	430,876,035円	1,200,644,638円
期中追加設定元本額	922,348,817円	1,051,584,639円
期中一部解約元本額	152,580,214円	256,647,601円
2. 受益権の総数	1,200,644,638口	1,995,581,676口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第4期	第5期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(30,855,186円)、収益調整金(70,485,387円)及び分配準備積立金(7,508,487円)より分配対象収益は108,849,060円(1万口当たり906.59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。	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(33,836,995円)、収益調整金(154,466,853円)及び分配準備積立金(32,395,202円)より分配対象収益は220,699,050円(1万口当たり1,105.94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	第5期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20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	32,338,375	30,613,934
合計	32,338,375	30,613,934

(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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0837円 (10,837円)	1.1106円 (11,106円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	68,483,716	149,253,410	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	76,082,880	115,440,553	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	42,951,531	123,253,713	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	1,853,785,329	1,828,388,469	
親投資信託受益証券 合計		2,041,303,456	2,216,336,145	
合計			2,216,336,145	

(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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2030】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	9,944	31,745
コール・ローン	1,460,463	2,918,490
親投資信託受益証券	1,170,152,818	2,832,193,593
未収入金	609,648	548,719
流動資産合計	1,172,232,873	2,835,692,547
資産合計	1,172,232,873	2,835,692,547
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	579,176	474,687
未払受託者報酬	158,467	322,130
未払委託者報酬	1,320,920	2,684,767
その他未払費用	52,062	91,533
流動負債合計	2,110,625	3,573,117
負債合計	2,110,625	3,573,117
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,014,388,366	2,268,236,888
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	155,733,882	563,882,542
(分配準備積立金)	74,280,991	159,580,466
元本等合計	1,170,122,248	2,832,119,430
純資産合計	1,170,122,248	2,832,119,430
負債純資産合計	1,172,232,873	2,835,692,547

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第3期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
営業収益		
受取利息	4	13
有価証券売買等損益	73,768,231	112,517,710
営業収益合計	73,768,235	112,517,723
営業費用		
支払利息	137	625
受託者報酬	184,734	540,334
委託者報酬	1,540,114	4,503,477
その他費用	60,745	158,829
営業費用合計	1,785,730	5,203,265
営業利益又は営業損失( )	71,982,505	107,314,458
経常利益又は経常損失( )	71,982,505	107,314,458
当期純利益又は当期純損失( )	71,982,505	107,314,458
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( )	303,060	10,925,307
期首剰余金又は期首欠損金( )	6,960,562	155,733,882
剰余金増加額又は欠損金減少額	79,301,832	349,147,326
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	79,301,832	349,147,326
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,207,957	37,387,817
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,207,957	37,387,817
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( )	155,733,882	563,882,542



## ( 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3期	
	自 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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2期	第3期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	66,627,246円	1,014,388,366円
期中追加設定元本額	973,321,960円	1,471,484,708円
期中一部解約元本額	25,560,840円	217,636,186円
2. 受益権の総数	1,014,388,366口	2,268,236,888口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(71,679,576円)、収益調整金(81,453,024円)及び分配準備積立金(2,601,415円)より分配対象収益は155,734,015円(1万口当たり1,535.25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(96,389,626円)、収益調整金(404,302,673円)及び分配準備積立金(63,190,840円)より分配対象収益は563,883,139円(1万口当たり2,486.00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2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20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	69,701,876	82,264,702
合計	69,701,876	82,264,702

(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1535円 (11,535円)	1.2486円 (12,486円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	227,554,556	495,932,399	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	179,323,768	272,087,953	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	226,294,211	649,373,867	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	1,434,451,358	1,414,799,374	
親投資信託受益証券 合計		2,067,623,893	2,832,193,593	
合計			2,832,193,593	

(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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2035】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	15,259	49,768
コール・ローン	2,241,162	4,575,458
親投資信託受益証券	1,687,518,709	3,957,972,731
未収入金	499,437	529,186
流動資産合計	1,690,274,567	3,963,127,143
資産合計	1,690,274,567	3,963,127,143
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	454,150	422,071
未払受託者報酬	235,397	487,196
未払委託者報酬	2,040,557	4,222,676
その他未払費用	71,267	130,061
流動負債合計	2,801,371	5,262,004
負債合計	2,801,371	5,262,004
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,413,786,138	2,917,126,953
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	273,687,058	1,040,738,186
(分配準備積立金)	165,541,189	390,484,392
元本等合計	1,687,473,196	3,957,865,139
純資産合計	1,687,473,196	3,957,865,139
負債純資産合計	1,690,274,567	3,963,127,143

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第5期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	14	21
有価証券売買等損益	136,890,863	270,698,509
営業収益合計	136,890,877	270,698,530
<b>営業費用</b>		
支払利息	326	1,046
受託者報酬	344,273	811,434
委託者報酬	2,984,507	7,033,118
その他費用	107,115	222,094
営業費用合計	3,436,221	8,067,692
営業利益又は営業損失（ ）	133,454,656	262,630,838
経常利益又は経常損失（ ）	133,454,656	262,630,838
当期純利益又は当期純損失（ ）	133,454,656	262,630,838
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（ ）	2,850,535	18,632,082
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	62,846,429	273,687,058
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,895,601	570,799,354
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	90,895,601	570,799,354
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,360,163	47,746,982
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,360,163	47,746,982
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（ ）	273,687,058	1,040,738,186

## ( 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 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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	第5期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	502,122,903円	1,413,786,138円
期中追加設定元本額	1,069,111,112円	1,722,619,889円
期中一部解約元本額	157,447,877円	219,279,074円
2. 受益権の総数	1,413,786,138口	2,917,126,953口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第4期	第5期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(136,305,463円)、収益調整金(187,336,636円)及び分配準備積立金(29,235,726円)より分配対象収益は352,877,825円(1万口当たり2,495.98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(243,999,482円)、収益調整金(650,254,810円)及び分配準備積立金(146,484,910円)より分配対象収益は1,040,739,202円(1万口当たり3,567.69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	第5期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20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	142,698,625	211,232,626
合計	142,698,625	211,232,626

(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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,193,360円 (11,936円)	1,356,800円 (13,568円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	482,868,615	1,052,363,859	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	352,112,240	534,259,901	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	526,220,581	1,510,042,579	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	873,270,194	861,306,392	
親投資信託受益証券 合計		2,234,471,630	3,957,972,731	
合計			3,957,972,731	

(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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2040】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,474	17,766
コール・ローン	657,083	1,633,318
親投資信託受益証券	520,332,609	1,600,538,602
未収入金	86,955	427,072
流動資産合計	521,081,121	1,602,616,758
資産合計	521,081,121	1,602,616,758
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	73,074	383,381
未払受託者報酬	68,925	174,046
未払委託者報酬	597,665	1,508,656
その他未払費用	22,897	55,816
流動負債合計	762,561	2,121,899
負債合計	762,561	2,121,899
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	426,598,305	1,139,582,522
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	93,720,255	460,912,337
(分配準備積立金)	52,375,768	131,666,074
元本等合計	520,318,560	1,600,494,859
純資産合計	520,318,560	1,600,494,859
負債純資産合計	521,081,121	1,602,616,758

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第3期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
営業収益		
受取利息	1	4
有価証券売買等損益	50,813,688	96,323,652
営業収益合計	50,813,689	96,323,656
営業費用		
支払利息	29	268
受託者報酬	83,584	277,741
委託者報酬	725,067	2,407,650
その他費用	27,711	90,295
営業費用合計	836,391	2,775,954
営業利益又は営業損失( )	49,977,298	93,547,702
経常利益又は経常損失( )	49,977,298	93,547,702
当期純利益又は当期純損失( )	49,977,298	93,547,702
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( )	222,433	7,622,904
期首剰余金又は期首欠損金( )	5,938,465	93,720,255
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,450,156	301,792,519
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	40,450,156	301,792,519
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,423,231	20,525,235
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,423,231	20,525,235
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( )	93,720,255	460,912,337

## ( 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3期	
	自 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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2期	第3期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	40,633,922円	426,598,305円
期中追加設定元本額	409,608,219円	793,296,990円
期中一部解約元本額	23,643,836円	80,312,773円
2. 受益権の総数	426,598,305口	1,139,582,522口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(49,754,892円)、収益調整金(41,344,515円)及び分配準備積立金(2,620,876円)より分配対象収益は93,720,283円(1万口当たり2,196.92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(85,925,033円)、収益調整金(329,246,526円)及び分配準備積立金(45,741,041円)より分配対象収益は460,912,600円(1万口当たり4,044.57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2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20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	49,585,571	74,996,946
合計	49,585,571	74,996,946

(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2197円 (12,197円)	1,4045円 (14,045円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	214,096,854	466,602,683	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	152,887,960	231,976,901	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	235,281,457	675,163,669	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	229,945,604	226,795,349	
親投資信託受益証券 合計		832,211,875	1,600,538,602	
合計			1,600,538,602	

(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。



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2045】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	6,067	20,879
コール・ローン	891,074	1,919,524
親投資信託受益証券	682,778,651	1,665,096,096
未収入金	852,988	376,716
流動資産合計	684,528,780	1,667,413,215
資産合計	684,528,780	1,667,413,215
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	834,585	331,440
未払受託者報酬	93,371	203,469
未払委託者報酬	809,620	1,763,832
その他未払費用	31,045	63,825
流動負債合計	1,768,621	2,362,566
負債合計	1,768,621	2,362,566
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	563,954,983	1,189,551,640
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	118,805,176	475,499,009
(分配準備積立金)	71,407,883	174,756,797
元本等合計	682,760,159	1,665,050,649
純資産合計	682,760,159	1,665,050,649
負債純資産合計	684,528,780	1,667,413,215

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第5期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	4	7
有価証券売買等損益	58,308,470	127,444,367
営業収益合計	58,308,474	127,444,374
<b>営業費用</b>		
支払利息	64	351
受託者報酬	143,592	337,635
委託者報酬	1,245,205	2,926,917
その他費用	47,719	108,478
営業費用合計	1,436,580	3,373,381
営業利益又は営業損失( )	56,871,894	124,070,993
経常利益又は経常損失( )	56,871,894	124,070,993
当期純利益又は当期純損失( )	56,871,894	124,070,993
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( )	255,075	10,719,630
期首剰余金又は期首欠損金( )	31,384,124	118,805,176
剰余金増加額又は欠損金減少額	39,933,179	269,869,961
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	39,933,179	269,869,961
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,639,096	26,527,491
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,639,096	26,527,491
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( )	118,805,176	475,499,009

## ( 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 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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	第5期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	233,137,568円	563,954,983円
期中追加設定元本額	414,415,117円	735,655,901円
期中一部解約元本額	83,597,702円	110,059,244円
2. 受益権の総数	563,954,983口	1,189,551,640口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第4期	第5期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(57,127,022円)、収益調整金(78,970,919円)及び分配準備積立金(14,280,861円)より分配対象収益は150,378,802円(1万口当たり2,666.50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(113,351,646円)、収益調整金(300,742,554円)及び分配準備積立金(61,405,151円)より分配対象収益は475,499,351円(1万口当たり3,997.30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	第5期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20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	61,295,524	99,261,734
合計	61,295,524	99,261,734

(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 2020年12月21日現在	第5期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2107円 (12,107円)	1,3997円 (13,997円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	228,757,318	498,553,698	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	163,448,457	248,000,343	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	252,344,238	724,127,025	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	197,115,513	194,415,030	
親投資信託受益証券 合計		841,665,526	1,665,096,096	
合計			1,665,096,096	

(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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2050】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,165	7,122
コール・ローン	171,059	654,771
親投資信託受益証券	146,697,349	680,470,781
未収入金	8,713	1,274,846
流動資産合計	146,878,286	682,407,520
資産合計	146,878,286	682,407,520
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,817	1,256,147
未払受託者報酬	17,976	69,909
未払委託者報酬	156,158	606,152
その他未払費用	5,925	23,224
流動負債合計	184,876	1,955,432
負債合計	184,876	1,955,432
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	118,987,624	475,426,751
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	27,705,786	205,025,337
(分配準備積立金)	14,363,632	37,162,625
元本等合計	146,693,410	680,452,088
純資産合計	146,693,410	680,452,088
負債純資産合計	146,878,286	682,407,520

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期		第3期	
	自	2019年12月21日 至 2020年12月21日	自	2020年12月22日 至 2021年12月20日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		13,466,036		33,040,109
営業収益合計		13,466,036		33,040,110
営業費用				
支払利息		-		62
受託者報酬		24,205		101,823
委託者報酬		210,466		883,186
その他費用		7,935		33,786
営業費用合計		242,606		1,018,857
営業利益又は営業損失( )		13,223,430		32,021,253
経常利益又は経常損失( )		13,223,430		32,021,253
当期純利益又は当期純損失( )		13,223,430		32,021,253
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( )		113,563		5,789,782
期首剰余金又は期首欠損金( )		3,356,159		27,705,786
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,270,375		170,198,754
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		13,270,375		170,198,754
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,030,615		19,110,674
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,030,615		19,110,674
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		27,705,786		205,025,337



## ( 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3期	
	自 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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2期	第3期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	21,794,219円	118,987,624円
期中追加設定元本額	113,562,838円	418,895,243円
期中一部解約元本額	16,369,433円	62,456,116円
2. 受益権の総数	118,987,624口	475,426,751口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(13,109,867円)、収益調整金(13,342,154円)及び分配準備積立金(1,253,765円)より分配対象収益は27,705,786円(1万口当たり2,328.46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(26,231,531円)、収益調整金(167,862,772円)及び分配準備積立金(10,931,094円)より分配対象収益は205,025,397円(1万口当たり4,312.45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2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20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	13,424,059	23,286,973
合計	13,424,059	23,286,973

(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2328円 (12,328円)	1,4312円 (14,312円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	95,631,363	208,418,992	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	67,696,561	102,715,992	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	105,987,158	304,140,748	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	66,100,628	65,195,049	
親投資信託受益証券 合計		335,415,710	680,470,781	
合計			680,470,781	

(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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2055】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2020年12月21日現在	第6期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,775	18,845
コール・ローン	848,215	1,732,475
親投資信託受益証券	653,705,000	1,303,631,192
未収入金	73,466	4,733,601
流動資産合計	654,632,456	1,310,116,113
資産合計	654,632,456	1,310,116,113
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	55,884	4,697,956
未払受託者報酬	88,894	182,449
未払委託者報酬	770,810	1,581,609
その他未払費用	29,559	58,712
流動負債合計	945,147	6,520,726
負債合計	945,147	6,520,726
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	446,839,347	764,717,172
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	206,847,962	538,878,215
（分配準備積立金）	71,766,100	155,898,556
元本等合計	653,687,309	1,303,595,387
純資産合計	653,687,309	1,303,595,387
負債純資産合計	654,632,456	1,310,116,113

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第6期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
営業収益		
受取利息	5	6
有価証券売買等損益	51,349,902	128,342,343
営業収益合計	51,349,907	128,342,349
営業費用		
支払利息	82	314
受託者報酬	151,322	309,539
委託者報酬	1,312,201	2,683,366
その他費用	50,295	100,999
営業費用合計	1,513,900	3,094,218
営業利益又は営業損失( )	49,836,007	125,248,131
経常利益又は経常損失( )	49,836,007	125,248,131
当期純利益又は当期純損失( )	49,836,007	125,248,131
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( )	2,688,981	21,603,665
期首剰余金又は期首欠損金( )	96,666,823	206,847,962
剰余金増加額又は欠損金減少額	94,659,487	317,960,390
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	94,659,487	317,960,390
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,003,336	89,574,603
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,003,336	89,574,603
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( )	206,847,962	538,878,215

## ( 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6期	
	自 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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5期	第6期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	262,527,078円	446,839,347円
期中追加設定元本額	290,087,575円	495,378,300円
期中一部解約元本額	105,775,306円	177,500,475円
2. 受益権の総数	446,839,347口	764,717,172口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第5期	第6期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(52,525,054円)、収益調整金(135,081,939円)及び分配準備積立金(19,241,046円)より分配対象収益は206,848,039円(1万口当たり4,629.14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(103,644,696円)、収益調整金(382,979,958円)及び分配準備積立金(52,253,860円)より分配対象収益は538,878,514円(1万口当たり7,046.77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5期	第6期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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5期 2020年12月21日現在	第6期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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5期 2020年12月21日現在	第6期 2021年12月20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	58,788,290	91,419,352
合計	58,788,290	91,419,352

(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5期 2020年12月21日現在	第6期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,462,900円 (14,629円)	1,704,700円 (17,047円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	187,929,337	409,573,197	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	132,235,489	200,640,907	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	208,101,828	597,169,005	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	97,584,998	96,248,083	
親投資信託受益証券 合計		625,851,652	1,303,631,192	
合計			1,303,631,192	

(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。

【DCニッセイターゲットデートファンド2060】  
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,422	10,599
コール・ローン	208,922	974,433
親投資信託受益証券	175,314,432	855,263,528
未収入金	805,628	598,580
流動資産合計	176,330,404	856,847,140
資産合計	176,330,404	856,847,140
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	800,960	575,169
未払受託者報酬	21,949	103,170
未払委託者報酬	190,527	894,459
その他未払費用	7,246	34,310
流動負債合計	1,020,682	1,607,108
負債合計	1,020,682	1,607,108
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	141,064,244	588,312,781
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	34,245,478	266,927,251
（分配準備積立金）	16,053,870	48,073,943
元本等合計	175,309,722	855,240,032
純資産合計	175,309,722	855,240,032
負債純資産合計	176,330,404	856,847,140

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2019年12月21日 至 2020年12月21日	自	2020年12月22日 至 2021年12月20日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		16,753,739		52,648,472
営業収益合計		16,753,739		52,648,474
営業費用				
支払利息		-		125
受託者報酬		29,092		149,610
委託者報酬		252,812		1,297,252
その他費用		9,554		49,707
営業費用合計		291,458		1,496,694
営業利益又は営業損失（ ）		16,462,281		51,151,780
経常利益又は経常損失（ ）		16,462,281		51,151,780
当期純利益又は当期純損失（ ）		16,462,281		51,151,780
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,064,507		12,671,626
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,566,193		34,245,478
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,431,260		245,043,701
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		22,431,260		245,043,701
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,149,749		50,842,082
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,149,749		50,842,082
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,245,478		266,927,251

## ( 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3期	
	自 2020年12月22日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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12月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2020年12月22日から2021年12月20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2期	第3期
	2020年12月21日現在	2021年12月20日現在
1. 期首元本額	28,378,089円	141,064,244円
期中追加設定元本額	179,902,566円	605,255,833円
期中一部解約元本額	67,216,411円	158,007,296円
2. 受益権の総数	141,064,244口	588,312,781口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(15,397,774円)、収益調整金(18,191,608円)及び分配準備積立金(656,096円)より分配対象収益は34,245,478円(1万口当たり2,427.65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(38,480,274円)、収益調整金(218,853,428円)及び分配準備積立金(9,593,669円)より分配対象収益は266,927,371円(1万口当たり4,537.17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2期	第3期
	自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20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	15,682,758	34,892,951
合計	15,682,758	34,892,951

(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2期 2020年12月21日現在	第3期 2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2428円 (12,428円)	1,4537円 (14,537円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	125,999,127	274,602,497	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	89,023,235	135,074,954	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	140,407,515	402,913,405	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	43,265,409	42,672,672	
親投資信託受益証券 合計		398,695,286	855,263,528	
合計			855,263,528	

(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）

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

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

#### ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

2021年12月20日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	38,558,847
コール・ローン	3,544,910,488
株式	112,816,857,230
未収配当金	13,185,346
差入委託証拠金	125,580,000
流動資産合計	116,539,091,911
<b>資産合計</b>	
116,539,091,911	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	65,378,550
前受金	4,745,000
未払解約金	378,044,200
その他未払費用	3,174
流動負債合計	448,170,924
<b>負債合計</b>	
448,170,924	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	53,267,646,540
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,823,274,447
元本等合計	116,090,920,987
純資産合計	116,090,920,987
負債純資産合計	116,539,091,911

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,506,962,631円
同期中追加設定元本額	23,152,033,097円
同期中一部解約元本額	50,391,349,188円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,821,600,937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)	3,599,820,017円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,649,165円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,067,192,244円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,963,600,436円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,153,866,326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)	4,978,066円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	19,658,587円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	18,672,342円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,046,285,848円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	20,626,814,931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)	1,973,181,039円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	187,929,337円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	196,905,990円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	228,757,318円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	482,868,615円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	68,483,716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)	89,079,282円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,300,771円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	9,722,067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)	3,947,349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)	6,319,655円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	25,479,584円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	125,999,127円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	95,631,363円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	214,096,854円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	227,554,556円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	3,979,573,586円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	18,025,102円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	63,185円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	132,003円
FWニッセイ国内株インデックス	457,142円
計	53,267,646,540円
2. 受益権の総数	53,267,646,540口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	381,627,976	
合計	381,627,976	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年2月23日から2021年12月20日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2021年12月20日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	3,187,885,000	-		3,122,595,000	65,290,000
合計	3,187,885,000	-		3,122,595,000	65,290,000

## （注）株価指数先物取引

## 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

2021年12月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1794円 (21,794円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2021年12月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	2,000	3,020.00	6,040,000	
日本水産	57,600	532.00	30,643,200	
マルハニチロ	9,000	2,365.00	21,285,000	
雪国まいたけ	4,200	1,160.00	4,872,000	
カネコ種苗	2,100	1,445.00	3,034,500	
サカタのタネ	6,900	3,270.00	22,563,000	
ホクト	4,800	1,887.00	9,057,600	
ヒノキヤグループ	1,300	2,204.00	2,865,200	
ショーボンドホールディングス	8,200	5,130.00	42,066,000	

ミライト・ホールディングス	18,500	1,894.00	35,039,000
タマホーム	3,500	2,208.00	7,728,000
ファーストコーポレーション	4,200	697.00	2,927,400
スペースバリューホールディングス	6,100	1,148.00	7,002,800
住石ホールディングス	10,300	129.00	1,328,700
日鉄鉱業	1,300	6,100.00	7,930,000
三井松島ホールディングス	2,400	1,468.00	3,523,200
I N P E X	231,100	971.00	224,398,100
石油資源開発	6,800	2,491.00	16,938,800
K & O エナジーグループ	2,800	1,450.00	4,060,000
安藤・間	31,700	870.00	27,579,000
東急建設	16,900	638.00	10,782,200
コムシスホールディングス	18,600	2,539.00	47,225,400
ビーアールホールディングス	8,100	335.00	2,713,500
高松コンストラクショングループ	3,600	1,954.00	7,034,400
東建コーポレーション	1,800	9,090.00	16,362,000
ソネック	2,900	999.00	2,897,100
ヤマウラ	3,000	952.00	2,856,000
オリエンタル白石	19,300	227.00	4,381,100
大成建設	38,400	3,470.00	133,248,000
大林組	133,000	882.00	117,306,000
清水建設	124,600	709.00	88,341,400
飛鳥建設	3,600	995.00	3,582,000
長谷工コーポレーション	39,600	1,386.00	54,885,600
松井建設	5,200	740.00	3,848,000
銭高組	700	3,830.00	2,681,000
鹿島建設	97,500	1,313.00	128,017,500
不動テトラ	2,800	1,665.00	4,662,000
鉄建建設	2,900	1,799.00	5,217,100
西松建設	8,100	3,585.00	29,038,500
三井住友建設	30,000	419.00	12,570,000
大豊建設	1,900	3,710.00	7,049,000
佐田建設	5,800	469.00	2,720,200
ナカノフドー建設	8,500	322.00	2,737,000
奥村組	7,800	3,220.00	25,116,000
東鉄工業	6,200	2,432.00	15,078,400
浅沼組	1,500	5,260.00	7,890,000
戸田建設	55,200	718.00	39,633,600
熊谷組	6,800	2,851.00	19,386,800
北野建設	1,400	2,074.00	2,903,600
植木組	2,000	1,474.00	2,948,000
矢作建設工業	5,900	734.00	4,330,600
ピーエス三菱	4,700	588.00	2,763,600
日本ハウスホールディングス	9,100	454.00	4,131,400
大東建託	13,600	13,050.00	177,480,000
新日本建設	5,700	819.00	4,668,300
N I P P O	11,000	3,985.00	43,835,000
東亜道路工業	700	4,625.00	3,237,500
日本道路	1,300	8,100.00	10,530,000
東亜建設工業	3,300	2,392.00	7,893,600

日本国土開発	12,900	554.00	7,146,600
若築建設	2,200	1,856.00	4,083,200
東洋建設	14,900	566.00	8,433,400
五洋建設	52,700	658.00	34,676,600
世紀東急工業	6,400	818.00	5,235,200
福田組	1,400	4,190.00	5,866,000
住友林業	34,000	2,233.00	75,922,000
日本基礎技術	4,900	572.00	2,802,800
巴コーポレーション	6,400	450.00	2,880,000
大和ハウス工業	122,800	3,238.00	397,626,400
ライト工業	8,400	1,971.00	16,556,400
積水ハウス	144,200	2,336.50	336,923,300
日特建設	4,300	651.00	2,799,300
北陸電気工事	2,300	1,065.00	2,449,500
ユアテック	7,600	644.00	4,894,400
日本リーテック	2,800	1,510.00	4,228,000
四電工	1,700	1,674.00	2,845,800
中電工	6,100	2,086.00	12,724,600
関電工	21,600	839.00	18,122,400
きんでん	29,700	1,733.00	51,470,100
東京エネシス	4,400	1,076.00	4,734,400
トーエネック	1,300	3,225.00	4,192,500
住友電設	3,300	2,000.00	6,600,000
日本電設工業	7,300	1,626.00	11,869,800
エクシオグループ	20,200	2,430.00	49,086,000
新日本空調	3,500	2,287.00	8,004,500
日本工営	2,400	3,115.00	7,476,000
九電工	10,300	3,430.00	35,329,000
三機工業	8,600	1,408.00	12,108,800
日揮ホールディングス	41,000	944.00	38,704,000
中外炉工業	1,800	1,549.00	2,788,200
ヤマト	3,900	735.00	2,866,500
太平電業	2,900	2,803.00	8,128,700
高砂熱学工業	12,000	1,887.00	22,644,000
三晃金属工業	1,200	2,298.00	2,757,600
NEC ネットエスアイ	13,800	1,720.00	23,736,000
朝日工業社	1,000	3,120.00	3,120,000
明星工業	8,600	725.00	6,235,000
大気社	6,500	3,070.00	19,955,000
ダイダン	3,000	2,195.00	6,585,000
日比谷総合設備	4,300	1,995.00	8,578,500
ニッポン	12,500	1,639.00	20,487,500
日清製粉グループ本社	48,100	1,694.00	81,481,400
昭和産業	4,000	2,613.00	10,452,000
鳥越製粉	4,000	690.00	2,760,000
中部飼料	4,800	940.00	4,512,000
フィード・ワン	5,700	684.00	3,898,800
日本甜菜製糖	2,200	1,632.00	3,590,400
DM三井製糖ホールディングス	3,900	1,905.00	7,429,500
塩水港精糖	13,300	209.00	2,779,700

日新製糖	2,000	1,684.00	3,368,000	
L I F U L L	12,400	230.00	2,852,000	
ミクシィ	9,300	1,995.00	18,553,500	
ジェイエシーリクルートメント	3,300	2,151.00	7,098,300	
日本M&Aセンターホールディングス	66,500	3,025.00	201,162,500	
メンバーズ	1,200	2,293.00	2,751,600	
UTグループ	5,800	4,035.00	23,403,000	
アイティメディア	1,900	1,774.00	3,370,600	
夢真ビーネックスグループ	10,800	1,590.00	17,172,000	
コシダカホールディングス	10,800	578.00	6,242,400	
アルトナー	3,400	822.00	2,794,800	
パソナグループ	4,400	3,185.00	14,014,000	
C D S	1,700	1,614.00	2,743,800	
リンクアンドモチベーション	8,900	531.00	4,725,900	
エス・エム・エス	13,800	4,215.00	58,167,000	
サニーサイドアップグループ	3,800	720.00	2,736,000	
パーソルホールディングス	40,500	3,200.00	129,600,000	
クックパッド	12,700	240.00	3,048,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,600	591.00	2,718,600	
森永製菓	10,000	3,770.00	37,700,000	
中村屋	1,000	3,625.00	3,625,000	
江崎グリコ	11,700	3,710.00	43,407,000	
名糖産業	1,900	1,695.00	3,220,500	
井村屋グループ	2,400	2,196.00	5,270,400	
不二家	2,400	2,302.00	5,524,800	
山崎製パン	31,900	1,569.00	50,051,100	
モロゾフ	700	5,690.00	3,983,000	
亀田製菓	2,400	4,365.00	10,476,000	
寿スピリッツ	4,100	5,570.00	22,837,000	
カルビー	19,400	2,719.00	52,748,600	
森永乳業	7,900	5,430.00	42,897,000	
六甲バター	3,100	1,630.00	5,053,000	
ヤクルト本社	31,500	6,130.00	193,095,000	
明治ホールディングス	28,100	7,040.00	197,824,000	
雪印メグミルク	10,200	2,072.00	21,134,400	
プリマハム	5,300	2,403.00	12,735,900	
日本ハム	16,300	4,060.00	66,178,000	
林兼産業	5,400	502.00	2,710,800	
丸大食品	4,200	1,506.00	6,325,200	
S F o o d s	3,800	3,350.00	12,730,000	
柿安本店	1,500	2,737.00	4,105,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	27,400	649.00	17,782,600	
学情	2,600	1,061.00	2,758,600	
スタジオアリス	1,800	2,034.00	3,661,200	
シミックホールディングス	2,200	1,484.00	3,264,800	
システナ	59,400	432.00	25,660,800	
N J S	1,500	1,873.00	2,809,500	
デジタルアーツ	2,200	8,650.00	19,030,000	
日鉄ソリューションズ	6,000	3,480.00	20,880,000	
総合警備保障	16,100	4,595.00	73,979,500	



キューブシステム	3,200	929.00	2,972,800	
いちご	46,600	278.00	12,954,800	
日本駐車場開発	45,900	135.00	6,196,500	
コア	1,800	1,546.00	2,782,800	
カカクコム	29,700	3,075.00	91,327,500	
アイロムグループ	1,700	1,581.00	2,687,700	
セントケア・ホールディング	3,800	731.00	2,777,800	
ルネサンス	2,800	1,080.00	3,024,000	
ディップ	7,100	3,705.00	26,305,500	
SBSホールディングス	3,100	3,210.00	9,951,000	
デジタルホールディングス	2,800	1,354.00	3,791,200	
新日本科学	4,900	1,475.00	7,227,500	
ベネフィット・ワン	14,700	4,765.00	70,045,500	
エムスリー	71,500	5,573.00	398,469,500	
ツカダ・グローバルホールディング	10,100	287.00	2,898,700	
アウトソーシング	23,200	1,602.00	37,166,400	
ウェルネット	6,300	447.00	2,816,100	
ワールドホールディングス	1,600	2,499.00	3,998,400	
ディー・エヌ・エー	15,400	1,699.00	26,164,600	
博報堂DYホールディングス	56,400	1,848.00	104,227,200	
ぐるなび	6,700	423.00	2,834,100	
ファンコミュニケーションズ	10,100	415.00	4,191,500	
ビジネス・ブレークスルー	7,100	421.00	2,989,100	
エスプール	11,400	1,163.00	13,258,200	
WDBホールディングス	1,800	3,005.00	5,409,000	
手間いらず	600	4,975.00	2,985,000	
アドウェイズ	6,000	852.00	5,112,000	
バリューコマース	3,200	4,215.00	13,488,000	
インフォマート	44,400	914.00	40,581,600	
サッポロホールディングス	14,500	2,240.00	32,480,000	
アサヒグループホールディングス	100,100	4,500.00	450,450,000	
キリンホールディングス	156,500	1,885.50	295,080,750	
宝ホールディングス	28,900	1,197.00	34,593,300	
オエノンホールディングス	12,100	360.00	4,356,000	
養命酒製造	1,600	1,768.00	2,828,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	29,900	1,337.00	39,976,300	
サントリー食品インターナショナル	28,500	4,230.00	120,555,000	
ダイドーグループホールディングス	2,200	4,750.00	10,450,000	
伊藤園	12,900	6,110.00	78,819,000	
キーコーヒー	4,200	2,000.00	8,400,000	
日清オイリオグループ	5,300	2,849.00	15,099,700	
不二製油グループ本社	9,200	2,294.00	21,104,800	
J・オイルミルズ	4,000	1,630.00	6,520,000	
ローソン	9,200	5,800.00	53,360,000	
サンエー	3,200	4,240.00	13,568,000	
カワチ薬品	3,200	2,181.00	6,979,200	
エービーシー・マート	6,500	4,915.00	31,947,500	
ハードオフコーポレーション	4,000	703.00	2,812,000	
アスクル	6,700	1,492.00	9,996,400	

ゲオホールディングス	5,600	1,214.00	6,798,400
アダストリア	4,500	1,669.00	7,510,500
オルパヘルスケアホールディングス	1,900	1,511.00	2,870,900
伊藤忠食品	1,000	4,780.00	4,780,000
くら寿司	4,400	3,485.00	15,334,000
キャンドウ	2,000	2,320.00	4,640,000
エレマテック	3,300	1,018.00	3,359,400
アイケイ	6,900	400.00	2,760,000
パルグループホールディングス	3,700	1,595.00	5,901,500
JALUX	1,200	2,547.00	3,056,400
エディオン	19,200	1,044.00	20,044,800
あらた	3,300	4,160.00	13,728,000
サーラコーポレーション	8,500	620.00	5,270,000
トーマンデバイス	700	6,360.00	4,452,000
ハローズ	1,900	2,712.00	5,152,800
J Pホールディングス	11,500	238.00	2,737,000
フジオフードグループ本社	3,500	1,390.00	4,865,000
あみやき亭	1,000	2,900.00	2,900,000
東京エレクトロン デバイス	1,300	6,350.00	8,255,000
双日	46,100	1,653.00	76,203,300
アルフレッサ ホールディングス	46,400	1,550.00	71,920,000
大黒天物産	1,300	5,460.00	7,098,000
ハニーズホールディングス	3,300	992.00	3,273,600
キッコーマン	30,700	9,170.00	281,519,000
味の素	94,000	3,457.00	324,958,000
ブルドックソース	1,800	2,094.00	3,769,200
キューピー	22,400	2,487.00	55,708,800
ハウス食品グループ本社	15,900	2,948.00	46,873,200
カゴメ	16,200	3,000.00	48,600,000
アリアケジャパン	3,900	6,430.00	25,077,000
ピエトロ	1,600	1,787.00	2,859,200
ニチレイ	20,300	2,705.00	54,911,500
横浜冷凍	11,700	822.00	9,617,400
東洋水産	20,400	4,860.00	99,144,000
イートアンドホールディングス	1,600	2,117.00	3,387,200
大冷	1,500	1,932.00	2,898,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,600	619.00	2,847,400
日清食品ホールディングス	16,700	8,770.00	146,459,000
永谷園ホールディングス	1,900	1,940.00	3,686,000
一正蒲鉾	3,400	805.00	2,737,000
フジッコ	4,600	1,872.00	8,611,200
ロック・フィールド	4,600	1,477.00	6,794,200
日本たばこ産業	228,200	2,378.00	542,659,600
ケンコーマヨネーズ	2,400	1,320.00	3,168,000
わらべや日洋ホールディングス	2,800	1,975.00	5,530,000
なとり	2,400	2,000.00	4,800,000
ピクルスコーポレーション	2,000	1,840.00	3,680,000
ファーマフーズ	4,100	2,117.00	8,679,700
北の達人コーポレーション	14,900	336.00	5,006,400
ユーグレナ	21,700	705.00	15,298,500

紀文食品	3,000	945.00	2,835,000
スター・マイカ・ホールディングス	2,300	1,288.00	2,962,400
S R Eホールディングス	1,000	7,390.00	7,390,000
A Dワークスグループ	18,000	154.00	2,772,000
片倉工業	4,600	2,360.00	10,856,000
ゲンゼ	2,800	3,980.00	11,144,000
ヒューリック	99,900	1,083.00	108,191,700
ラサ商事	3,200	968.00	3,097,600
アルペン	3,200	2,115.00	6,768,000
ハブ	4,300	650.00	2,795,000
ラクーンホールディングス	2,900	1,413.00	4,097,700
クオールホールディングス	5,100	1,348.00	6,874,800
アルコニックス	4,400	1,254.00	5,517,600
神戸物産	32,400	4,060.00	131,544,000
ソリトンシステムズ	2,400	1,221.00	2,930,400
ジーンズホールディングス	2,800	6,650.00	18,620,000
ビックカメラ	24,800	935.00	23,188,000
D C Mホールディングス	25,800	1,074.00	27,709,200
ハイパー	5,200	557.00	2,896,400
M o n o t a R O	52,800	2,037.00	107,553,600
東京一番フーズ	4,800	581.00	2,788,800
あい ホールディングス	6,000	1,883.00	11,298,000
ディーブイエックス	2,600	1,097.00	2,852,200
アークランドサービスホールディングス	3,100	2,281.00	7,071,100
J . フロント リテイリング	49,900	949.00	47,355,100
ドトール・日レスホールディングス	7,200	1,553.00	11,181,600
マツキヨココカラ&カンパニー	25,700	4,380.00	112,566,000
ブロンコビリー	2,400	2,382.00	5,716,800
Z O Z O	28,700	3,425.00	98,297,500
トレジャー・ファクトリー	3,300	912.00	3,009,600
物語コーポレーション	2,200	6,410.00	14,102,000
三越伊勢丹ホールディングス	73,100	790.00	57,749,000
東洋紡	16,400	1,228.00	20,139,200
ユニチカ	11,400	286.00	3,260,400
富士紡ホールディングス	1,900	3,900.00	7,410,000
日清紡ホールディングス	25,900	865.00	22,403,500
倉敷紡績	3,600	1,956.00	7,041,600
ダイワボウホールディングス	20,300	1,779.00	36,113,700
日東紡績	6,300	2,829.00	17,822,700
トヨタ紡織	17,300	2,144.00	37,091,200
マクニカ・富士エレホールディングス	10,000	2,530.00	25,300,000
H a m e e	2,700	1,272.00	3,434,400
ラクト・ジャパン	1,400	2,347.00	3,285,800
ウエルシアホールディングス	22,100	3,855.00	85,195,500
クリエイトSDホールディングス	6,200	3,260.00	20,212,000
グリムス	1,900	2,319.00	4,406,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,300	796.00	5,810,800
八洲電機	3,100	936.00	2,901,600

メディアスホールディングス	3,100	925.00	2,867,500	
レスターホールディングス	4,000	1,893.00	7,572,000	
ジューテックホールディングス	2,700	1,055.00	2,848,500	
丸善CHIホールディングス	7,800	355.00	2,769,000	
OCHIホールディングス	2,300	1,275.00	2,932,500	
TOKAIホールディングス	20,200	844.00	17,048,800	
ミサワ	4,400	675.00	2,970,000	
ティーライフ	2,100	1,317.00	2,765,700	
Cominix	3,900	722.00	2,815,800	
三洋貿易	4,200	971.00	4,078,200	
シュッピン	3,500	1,008.00	3,528,000	
オイシックス・ラ・大地	6,000	2,917.00	17,502,000	
ウイン・パートナーズ	3,000	967.00	2,901,000	
ネクステージ	8,400	2,251.00	18,908,400	
ジョイフル本田	12,200	1,431.00	17,458,200	
ホットランド	3,100	1,308.00	4,054,800	
すかいらくホールディングス	53,900	1,507.00	81,227,300	
SFPホールディングス	2,200	1,327.00	2,919,400	
綿半ホールディングス	3,100	1,243.00	3,853,300	
日本毛織	12,500	912.00	11,400,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	12,100	1,047.00	12,668,700	
三栄建築設計	1,700	1,650.00	2,805,000	
野村不動産ホールディングス	21,600	2,488.00	53,740,800	
三重交通グループホールディングス	8,500	468.00	3,978,000	
サムティ	6,700	2,153.00	14,425,100	
ディア・ライフ	5,400	510.00	2,754,000	
コーセーアールイー	1,000	683.00	683,000	
日本商業開発	2,600	1,784.00	4,638,400	
プレサンスコーポレーション	5,400	1,916.00	10,346,400	
日本管理センター	2,700	994.00	2,683,800	
サンセイラディック	3,600	810.00	2,916,000	
エストラスト	4,600	625.00	2,875,000	
フージャースホールディングス	5,300	637.00	3,376,100	
オープンハウス	13,300	5,870.00	78,071,000	
東急不動産ホールディングス	123,200	596.00	73,427,200	
飯田グループホールディングス	34,900	2,478.00	86,482,200	
イーグランド	1,800	1,452.00	2,613,600	
ムゲンエステート	5,700	480.00	2,736,000	
帝国繊維	4,700	2,031.00	9,545,700	
日本コークス工業	35,800	122.00	4,367,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,700	1,109.00	2,994,300	
BEENOS	2,100	2,366.00	4,968,600	
あさひ	3,500	1,337.00	4,679,500	
日本調剤	2,500	1,296.00	3,240,000	
コスモス薬品	4,200	17,540.00	73,668,000	
シップヘルスケアホールディングス	13,400	2,606.00	34,920,400	
ソフトクリエイティブホールディングス	1,800	4,235.00	7,623,000	
セブン&アイ・ホールディングス	163,400	4,883.00	797,882,200	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	22,200	687.00	15,251,400	
明治電機工業	2,300	1,234.00	2,838,200	
ツルハホールディングス	9,100	11,960.00	108,836,000	
サンマルクホールディングス	3,300	1,420.00	4,686,000	
フェリシモ	2,100	1,362.00	2,860,200	
トリドールホールディングス	10,400	2,386.00	24,814,400	
帝人	39,100	1,374.00	53,723,400	
東レ	300,700	666.80	200,506,760	
クラレ	60,700	990.00	60,093,000	
旭化成	275,300	1,063.50	292,781,550	
TOKYO BASE	4,400	577.00	2,538,800	
稲葉製作所	2,400	1,323.00	3,175,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,300	3,185.00	4,140,500	
トーカロ	10,800	1,425.00	15,390,000	
アルファ	2,500	1,101.00	2,752,500	
SUMCO	64,600	2,225.00	143,735,000	
川田テクノロジーズ	900	4,005.00	3,604,500	
RS Technologies	1,400	5,910.00	8,274,000	
ファーストブラザーズ	3,100	888.00	2,752,800	
ハウズドゥ	3,000	892.00	2,676,000	
ケイアイスター不動産	1,900	8,040.00	15,276,000	
グッドコムアセット	2,300	1,022.00	2,350,600	
ジェイ・エス・ビー	1,000	2,862.00	2,862,000	
日本フェルト	2,700	441.00	1,190,700	
芦森工業	3,200	903.00	2,889,600	
アツギ	4,400	563.00	2,477,200	
ウイルプラスホールディングス	3,200	897.00	2,870,400	
JMホールディングス	2,800	1,629.00	4,561,200	
コメダホールディングス	9,100	1,996.00	18,163,600	
アレンザホールディングス	3,200	1,010.00	3,232,000	
バロックジャパンリミテッド	3,400	825.00	2,805,000	
クスリのアオキホールディングス	4,200	7,380.00	30,996,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	24,500	4,090.00	100,205,000	
アセンテック	2,500	949.00	2,372,500	
セーレン	8,500	2,335.00	19,847,500	
ソトー	3,400	809.00	2,750,600	
東海染工	2,500	1,131.00	2,827,500	
小松マテーレ	6,800	1,224.00	8,323,200	
ワコールホールディングス	10,400	2,124.00	22,089,600	
ホギメディカル	5,600	3,225.00	18,060,000	
クラウドシアホールディングス	12,000	228.00	2,736,000	
TSIホールディングス	13,900	325.00	4,517,500	
マツオカコーポレーション	2,400	1,188.00	2,851,200	
ワールド	5,400	1,111.00	5,999,400	
TIS	39,700	3,435.00	136,369,500	
グリー	25,500	740.00	18,870,000	
コーエーテクモホールディングス	13,300	4,670.00	62,111,000	
三菱総合研究所	1,800	3,910.00	7,038,000	

A G S	3,400	866.00	2,944,400
ファインデックス	3,500	985.00	3,447,500
ブレインパッド	1,100	4,465.00	4,911,500
K L a b	7,600	485.00	3,686,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,000	942.00	5,652,000
ネクソン	93,800	2,226.00	208,798,800
アイスタイル	12,700	256.00	3,251,200
エムアップホールディングス	1,200	3,930.00	4,716,000
エイチーム	2,900	864.00	2,505,600
エニグモ	4,500	760.00	3,420,000
テクノスジャパン	5,500	480.00	2,640,000
コロブラ	13,700	651.00	8,918,700
ブロードリーフ	20,600	450.00	9,270,000
デジタルハーツホールディングス	1,900	2,262.00	4,297,800
システム情報	3,300	806.00	2,659,800
メディアドゥ	1,500	4,100.00	6,150,000
じげん	11,800	285.00	3,363,000
ブイキューブ	4,200	1,024.00	4,300,800
サイバーリンクス	2,800	996.00	2,788,800
フィックスターズ	4,400	761.00	3,348,400
C A R T A H O L D I N G S	1,700	1,942.00	3,301,400
オブティム	2,900	1,271.00	3,685,900
セレス	1,500	2,384.00	3,576,000
S H I F T	2,100	23,070.00	48,447,000
特種東海製紙	2,600	4,010.00	10,426,000
ティーガイア	3,700	1,588.00	5,875,600
テクマトリックス	7,000	1,911.00	13,377,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11,300	2,627.00	29,685,100
G M O ペイメントゲートウェイ	8,100	13,510.00	109,431,000
ザッパラス	5,100	565.00	2,881,500
インターネットイニシアティブ	11,100	4,565.00	50,671,500
さくらインターネット	5,300	544.00	2,883,200
ヴィンクス	3,300	787.00	2,597,100
G M O グローバルサイン・ホールディングス	900	4,080.00	3,672,000
S R A ホールディングス	2,000	2,785.00	5,570,000
朝日ネット	4,800	587.00	2,817,600
e B A S E	5,000	608.00	3,040,000
アバント	4,500	1,155.00	5,197,500
アドソル日進	1,600	1,646.00	2,633,600
フリービット	2,500	1,031.00	2,577,500
コムチュア	4,700	3,240.00	15,228,000
サイバーコム	2,500	1,132.00	2,830,000
アステリア	3,600	750.00	2,700,000
アイル	2,300	1,376.00	3,164,800
王子ホールディングス	173,600	550.00	95,480,000
日本製紙	19,900	1,081.00	21,511,900
三菱製紙	9,000	311.00	2,799,000

北越コーポレーション	27,200	693.00	18,849,600
大王製紙	20,000	1,835.00	36,700,000
阿波製紙	5,600	333.00	1,864,800
マークライNZ	2,100	2,609.00	5,478,900
メディカル・データ・ビジョン	5,300	1,099.00	5,824,700
g u m i	5,800	667.00	3,868,600
テラスカイ	1,500	1,799.00	2,698,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	2,000	1,258.00	2,516,000
P R T I M E S	900	2,937.00	2,643,300
ラクス	14,300	3,025.00	43,257,500
ランドコンピュータ	3,500	819.00	2,866,500
ダブルスタンダード	1,300	2,920.00	3,796,000
オープンドア	2,500	1,857.00	4,642,500
アカツキ	1,900	2,545.00	4,835,500
U b i c o mホールディングス	1,100	2,511.00	2,762,100
カナミックネットワーク	5,700	474.00	2,701,800
ノムラシステムコーポレーション	11,600	255.00	2,958,000
レンゴー	39,300	850.00	33,405,000
トーモク	2,500	1,708.00	4,270,000
ザ・バック	3,100	2,714.00	8,413,400
チェンジ	7,700	1,736.00	13,367,200
シンクロ・フード	8,200	325.00	2,665,000
オークネット	2,200	1,523.00	3,350,600
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	758.00	2,956,200
マクロミル	8,500	997.00	8,474,500
ビーグリー	1,600	1,788.00	2,860,800
オロ	1,300	3,065.00	3,984,500
ユーザーローカル	1,800	1,566.00	2,818,800
マネーフォワード	6,300	6,170.00	38,871,000
昭和電工	36,000	2,397.00	86,292,000
住友化学	305,200	517.00	157,788,400
住友精化	1,800	3,020.00	5,436,000
日産化学	22,600	6,470.00	146,222,000
ラサ工業	1,700	1,601.00	2,721,700
クレハ	3,300	8,020.00	26,466,000
多木化学	1,600	5,510.00	8,816,000
テイカ	3,000	1,238.00	3,714,000
石原産業	6,900	1,104.00	7,617,600
片倉コープアグリ	2,400	1,151.00	2,762,400
日本曹達	5,300	3,205.00	16,986,500
東ソー	59,900	1,666.00	99,793,400
トクヤマ	13,300	1,778.00	23,647,400
セントラル硝子	6,800	2,024.00	13,763,200
東亜合成	23,700	1,163.00	27,563,100
大阪ソーダ	3,900	2,845.00	11,095,500
関東電化工業	9,100	1,013.00	9,218,300
デンカ	15,200	3,570.00	54,264,000
イビデン	22,300	6,530.00	145,619,000
信越化学工業	71,300	19,225.00	1,370,742,500

日本カーバイド工業	2,200	1,267.00	2,787,400
電算システムホールディングス	1,700	2,685.00	4,564,500
堺化学工業	2,900	2,214.00	6,420,600
第一稀元素化学工業	3,900	1,216.00	4,742,400
エア・ウォーター	39,300	1,770.00	69,561,000
日本酸素ホールディングス	39,900	2,523.00	100,667,700
日本化学工業	1,300	2,562.00	3,330,600
日本パーカライズン	21,000	1,085.00	22,785,000
高压ガス工業	6,600	756.00	4,989,600
四国化成工業	5,400	1,346.00	7,268,400
戸田工業	900	3,715.00	3,343,500
ステラ ケミファ	2,100	2,462.00	5,170,200
保土谷化学工業	1,300	5,390.00	7,007,000
日本触媒	7,000	5,250.00	36,750,000
大日精化工業	3,400	2,206.00	7,500,400
カネカ	10,700	3,645.00	39,001,500
協和キリン	49,800	3,160.00	157,368,000
三菱瓦斯化学	38,600	1,874.00	72,336,400
三井化学	37,700	3,045.00	114,796,500
J S R	38,700	4,255.00	164,668,500
東京応化工業	7,100	6,770.00	48,067,000
大阪有機化学工業	3,500	3,320.00	11,620,000
三菱ケミカルホールディングス	277,700	828.10	229,963,370
K Hネオケム	6,800	2,979.00	20,257,200
ダイセル	59,800	776.00	46,404,800
住友ベークライト	6,500	5,470.00	35,555,000
積水化学工業	86,900	1,891.00	164,327,900
日本ゼオン	37,500	1,240.00	46,500,000
アイカ工業	11,600	3,435.00	39,846,000
宇部興産	19,600	1,943.00	38,082,800
積水樹脂	6,300	2,023.00	12,744,900
タキロンシーアイ	9,000	533.00	4,797,000
旭有機材	2,300	1,614.00	3,712,200
ニチバン	2,500	1,795.00	4,487,500
リケンテクノス	10,100	491.00	4,959,100
大倉工業	2,100	2,141.00	4,496,100
積水化成成品工業	5,800	474.00	2,749,200
群栄化学工業	900	3,440.00	3,096,000
ダイキョーニシカワ	8,800	546.00	4,804,800
森六ホールディングス	2,200	1,781.00	3,918,200
恵和	1,000	5,110.00	5,110,000
日本化薬	32,700	1,178.00	38,520,600
カーリットホールディングス	4,400	653.00	2,873,200
レグス	2,000	1,356.00	2,712,000
プレステージ・インターナショナル	15,200	663.00	10,077,600
プロトコーポレーション	4,400	1,311.00	5,768,400
ハイマックス	2,600	1,060.00	2,756,000
アミューズ	2,200	2,001.00	4,402,200
野村総合研究所	80,400	4,835.00	388,734,000
ドリームインキュベータ	2,000	1,321.00	2,642,000



サイバネットシステム	4,200	696.00	2,923,200	
クイック	2,800	1,438.00	4,026,400	
T A C	12,800	221.00	2,828,800	
C Eホールディングス	6,100	474.00	2,891,400	
電通グループ	41,800	3,950.00	165,110,000	
インテージホールディングス	5,200	1,643.00	8,543,600	
東邦システムサイエンス	2,800	1,016.00	2,844,800	
ぴあ	1,400	3,310.00	4,634,000	
イオンファンタジー	1,600	1,751.00	2,801,600	
ソースネクスト	17,900	181.00	3,239,900	
シーティーエス	4,600	756.00	3,477,600	
ネクシィーズグループ	3,900	687.00	2,679,300	
インフォコム	4,600	1,976.00	9,089,600	
メディカルシステムネットワーク	4,600	562.00	2,585,200	
日本精化	3,300	2,154.00	7,108,200	
扶桑化学工業	3,700	4,575.00	16,927,500	
トリケミカル研究所	4,300	3,495.00	15,028,500	
シンプレクス・ホールディングス	4,400	2,596.00	11,422,400	
H E R O Z	2,000	1,269.00	2,538,000	
ラクスル	4,600	4,985.00	22,931,000	
F I G	9,000	316.00	2,844,000	
A D E K A	19,100	2,463.00	47,043,300	
日油	14,200	5,610.00	79,662,000	
ミヨシ油脂	2,200	1,311.00	2,884,200	
新日本理化	11,600	246.00	2,853,600	
ハリマ化成グループ	3,500	792.00	2,772,000	
イーソル	4,400	602.00	2,648,800	
アルテリア・ネットワークス	5,300	1,550.00	8,215,000	
E D U L A B	2,300	1,087.00	2,500,100	
ウイングアーク1 s t	2,400	2,056.00	4,934,400	
サーバーワークス	800	3,245.00	2,596,000	
トピラシステムズ	3,100	765.00	2,371,500	
S a n s a n	14,800	2,336.00	34,572,800	
ギフティ	3,600	2,097.00	7,549,200	
花王	93,800	6,062.00	568,615,600	
第一工業製薬	1,500	2,987.00	4,480,500	
石原ケミカル	2,200	1,300.00	2,860,000	
日華化学	3,500	819.00	2,866,500	
三洋化成工業	2,500	5,110.00	12,775,000	
ベース	700	3,820.00	2,674,000	
武田薬品工業	333,300	3,126.00	1,041,895,800	
アステラス製薬	367,700	1,837.50	675,648,750	
大日本住友製薬	26,200	1,335.00	34,977,000	
塩野義製薬	53,300	7,712.00	411,049,600	
わかもと製薬	10,200	290.00	2,958,000	
日本新薬	11,100	7,960.00	88,356,000	
中外製薬	132,600	3,617.00	479,614,200	
科研製薬	6,700	4,225.00	28,307,500	
エーザイ	50,800	6,876.00	349,300,800	
理研ビタミン	4,400	1,666.00	7,330,400	

ロート製薬	21,800	3,400.00	74,120,000
小野薬品工業	97,400	2,821.00	274,765,400
久光製薬	11,200	3,940.00	44,128,000
有機合成薬品工業	10,800	264.00	2,851,200
持田製薬	5,300	3,385.00	17,940,500
参天製薬	79,100	1,391.00	110,028,100
扶桑薬品工業	1,500	2,529.00	3,793,500
ツムラ	13,100	3,260.00	42,706,000
日医工	13,200	688.00	9,081,600
テルモ	120,000	4,721.00	566,520,000
H.U.グループホールディングス	10,600	2,792.00	29,595,200
キッセイ薬品工業	7,500	2,200.00	16,500,000
生化学工業	7,500	925.00	6,937,500
栄研化学	7,500	1,905.00	14,287,500
日水製薬	2,900	1,073.00	3,111,700
鳥居薬品	2,300	2,867.00	6,594,100
JCRファーマ	12,000	2,198.00	26,376,000
東和薬品	6,100	2,680.00	16,348,000
富士製薬工業	900	981.00	882,900
ゼリア新薬工業	7,700	1,948.00	14,999,600
第一三共	333,300	2,771.00	923,574,300
キョーリン製薬ホールディングス	8,500	1,774.00	15,079,000
大幸薬品	6,400	705.00	4,512,000
ダイト	2,700	2,927.00	7,902,900
大塚ホールディングス	88,100	4,204.00	370,372,400
大正製薬ホールディングス	10,100	5,340.00	53,934,000
ペプチドリーム	22,300	2,727.00	60,812,100
大日本塗料	5,100	820.00	4,182,000
日本ペイントホールディングス	156,100	1,207.00	188,412,700
関西ペイント	43,100	2,538.00	109,387,800
中国塗料	9,800	903.00	8,849,400
日本特殊塗料	3,400	821.00	2,791,400
藤倉化成	5,600	472.00	2,643,200
太陽ホールディングス	6,100	3,215.00	19,611,500
D I C	17,500	2,875.00	50,312,500
サカタインクス	8,200	990.00	8,118,000
東洋インキ S C ホールディングス	8,800	1,935.00	17,028,000
T & K T O K A	3,700	790.00	2,923,000
アルプス技研	3,600	1,875.00	6,750,000
日本空調サービス	4,200	782.00	3,284,400
オリエンタルランド	47,900	19,260.00	922,554,000
フォーカスシステムズ	2,900	937.00	2,717,300
ダスキン	9,400	2,760.00	25,944,000
パーク 2 4	22,500	1,456.00	32,760,000
明光ネットワークジャパン	5,300	551.00	2,920,300
ファルコホールディングス	1,900	1,997.00	3,794,300
クレスコ	3,000	1,949.00	5,847,000
フジ・メディア・ホールディングス	40,100	1,109.00	44,470,900
秀英予備校	6,900	405.00	2,794,500
ラウンドワン	11,300	1,256.00	14,192,800

リゾートトラスト	18,600	1,807.00	33,610,200
オービック	13,100	21,130.00	276,803,000
ジャストシステム	5,900	5,400.00	31,860,000
TDCソフト	3,600	1,049.00	3,776,400
Zホールディングス	604,900	642.20	388,466,780
ビー・エム・エル	5,200	3,455.00	17,966,000
トレンドマイクロ	22,200	6,710.00	148,962,000
りらいあコミュニケーションズ	6,200	953.00	5,908,600
IDホールディングス	3,400	846.00	2,876,400
リソー教育	18,500	379.00	7,011,500
日本オラクル	8,400	10,190.00	85,596,000
早稲田アカデミー	2,800	1,038.00	2,906,400
アルファシステムズ	1,100	3,850.00	4,235,000
フューチャー	4,400	3,365.00	14,806,000
CAC Holdings	2,400	1,464.00	3,513,600
SBテクノロジー	1,800	2,439.00	4,390,200
トーセ	4,000	716.00	2,864,000
ユー・エス・エス	45,400	1,763.00	80,040,200
オービックビジネスコンサルタント	4,000	4,920.00	19,680,000
伊藤忠テクノソリューションズ	19,000	3,710.00	70,490,000
アイティフォー	5,000	778.00	3,890,000
東京個別指導学院	4,600	613.00	2,819,800
東計電算	600	5,080.00	3,048,000
サイバーエージェント	99,900	1,852.00	185,014,800
楽天グループ	208,100	1,111.00	231,199,100
クリーク・アンド・リバー社	2,100	1,966.00	4,128,600
モーニングスター	7,100	615.00	4,366,500
テー・オー・ダブリュー	9,200	305.00	2,806,000
大塚商会	22,500	5,480.00	123,300,000
サイボウズ	5,600	1,824.00	10,214,400
山田コンサルティンググループ	2,400	1,136.00	2,726,400
セントラルスポーツ	1,500	2,359.00	3,538,500
電通国際情報サービス	6,000	3,730.00	22,380,000
ACCESS	4,700	695.00	3,266,500
デジタルガレージ	6,900	4,715.00	32,533,500
イーエムシステムズ	6,900	761.00	5,250,900
ウェザーニューズ	1,200	8,980.00	10,776,000
CIJ	3,400	847.00	2,879,800
ビジネスエンジニアリング	800	3,640.00	2,912,000
日本エンタープライズ	16,000	170.00	2,720,000
WOWOW	2,000	1,828.00	3,656,000
スカラ	4,500	650.00	2,925,000
フルキャストホールディングス	3,500	2,417.00	8,459,500
エン・ジャパン	6,500	3,280.00	21,320,000
あすか製薬ホールディングス	4,800	931.00	4,468,800
サワイグループホールディングス	9,300	4,440.00	41,292,000
富士フイルムホールディングス	74,500	8,405.00	626,172,500
コニカミノルタ	92,700	496.00	45,979,200
資生堂	79,000	6,508.00	514,132,000
ライオン	51,200	1,605.00	82,176,000

高砂香料工業	2,900	2,764.00	8,015,600	
マンダム	8,900	1,363.00	12,130,700	
ミルボン	5,200	5,720.00	29,744,000	
ファンケル	17,200	3,475.00	59,770,000	
コーセー	8,000	13,270.00	106,160,000	
コタ	2,700	1,564.00	4,222,800	
シーボン	1,700	1,690.00	2,873,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	18,100	1,994.00	36,091,400	
ノエビアホールディングス	3,600	5,370.00	19,332,000	
アジュバンホールディングス	2,600	1,115.00	2,899,000	
エステー	2,700	1,511.00	4,079,700	
アグロ カネショウ	2,300	1,265.00	2,909,500	
コニシ	7,000	1,662.00	11,634,000	
長谷川香料	7,300	2,708.00	19,768,400	
星光P M C	4,100	687.00	2,816,700	
小林製薬	11,900	9,170.00	109,123,000	
荒川化学工業	3,500	1,162.00	4,067,000	
メック	3,200	3,825.00	12,240,000	
日本高純度化学	1,200	2,501.00	3,001,200	
タカラバイオ	11,100	2,633.00	29,226,300	
J C U	4,800	4,940.00	23,712,000	
新田ゼラチン	4,700	595.00	2,796,500	
デクセリアルズ	11,000	3,775.00	41,525,000	
アース製薬	3,500	6,210.00	21,735,000	
北興化学工業	3,900	860.00	3,354,000	
大成ラミック	1,300	2,790.00	3,627,000	
クミアイ化学工業	15,800	771.00	12,181,800	
日本農薬	7,600	470.00	3,572,000	
ニチレキ	5,500	1,393.00	7,661,500	
ユシロ化学工業	2,700	1,067.00	2,880,900	
富士石油	11,400	244.00	2,781,600	
M O R E S C O	2,600	1,118.00	2,906,800	
出光興産	47,100	2,881.00	135,695,100	
E N E O Sホールディングス	638,000	424.40	270,767,200	
コスモエネルギーホールディングス	12,300	2,240.00	27,552,000	
テスホールディングス	2,400	2,269.00	5,445,600	
インフロニア・ホールディングス	56,700	1,000.00	56,700,000	
横浜ゴム	24,600	1,762.00	43,345,200	
T O Y O T I R E	22,300	1,729.00	38,556,700	
ブリヂストン	122,200	4,748.00	580,205,600	
住友ゴム工業	38,100	1,137.00	43,319,700	
藤倉コンポジット	1,600	789.00	1,262,400	
オカモト	2,500	4,025.00	10,062,500	
アキレス	2,700	1,235.00	3,334,500	
フコク	3,100	942.00	2,920,200	
ニッタ	4,400	2,843.00	12,509,200	
住友理工	8,200	585.00	4,797,000	
三ツ星ベルト	5,200	2,079.00	10,810,800	
バンドー化学	6,800	866.00	5,888,800	
A G C	38,900	5,400.00	210,060,000	

日本板硝子	20,400	489.00	9,975,600
有沢製作所	6,200	937.00	5,809,400
日本山村硝子	3,600	776.00	2,793,600
日本電気硝子	17,000	2,933.00	49,861,000
住友大阪セメント	7,800	3,535.00	27,573,000
太平洋セメント	24,100	2,261.00	54,490,100
日本ヒューム	4,300	678.00	2,915,400
日本コンクリート工業	10,700	262.00	2,803,400
三谷セキサン	2,000	7,560.00	15,120,000
アジアパイルホールディングス	6,600	436.00	2,877,600
東海カーボン	35,500	1,187.00	42,138,500
日本カーボン	2,200	4,220.00	9,284,000
東洋炭素	2,800	3,250.00	9,100,000
ノリタケカンパニーリミテド	2,300	4,715.00	10,844,500
TOTO	30,300	5,170.00	156,651,000
日本碍子	45,900	1,878.00	86,200,200
日本特殊陶業	32,300	1,947.00	62,888,100
MARUWA	1,500	14,860.00	22,290,000
品川リフラクトリーズ	1,000	3,620.00	3,620,000
黒崎播磨	700	4,010.00	2,807,000
ヨータイ	2,700	1,220.00	3,294,000
イソライト工業	3,200	845.00	2,704,000
ニッカトー	4,000	677.00	2,708,000
フジインコーポレーテッド	3,400	7,270.00	24,718,000
クニミネ工業	2,800	1,012.00	2,833,600
ニチアス	9,800	2,655.00	26,019,000
日本製鉄	187,700	1,848.50	346,963,450
神戸製鋼所	78,300	560.00	43,848,000
中山製鋼所	6,700	420.00	2,814,000
合同製鐵	2,300	1,360.00	3,128,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	113,300	1,449.00	164,171,700
東京製鐵	14,300	1,345.00	19,233,500
共英製鋼	4,700	1,324.00	6,222,800
大和工業	8,000	3,580.00	28,640,000
東京鐵鋼	2,300	1,311.00	3,015,300
淀川製鋼所	5,500	2,448.00	13,464,000
丸一鋼管	14,900	2,538.00	37,816,200
モリ工業	1,200	2,639.00	3,166,800
大同特殊鋼	6,900	4,035.00	27,841,500
日本高周波鋼業	8,100	332.00	2,689,200
日本冶金工業	3,100	2,160.00	6,696,000
山陽特殊製鋼	4,300	1,955.00	8,406,500
愛知製鋼	2,400	2,470.00	5,928,000
日立金属	45,200	2,115.00	95,598,000
大平洋金属	2,600	2,033.00	5,285,800
新日本電工	27,100	288.00	7,804,800
栗本鐵工所	1,900	1,498.00	2,846,200
日本製鋼所	12,700	3,520.00	44,704,000
三菱製鋼	2,900	990.00	2,871,000

日亜鋼業	10,300	268.00	2,760,400	
日本精線	700	4,780.00	3,346,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,800	1,710.00	3,078,000	
大紀アルミニウム工業所	6,300	1,398.00	8,807,400	
日本軽金属ホールディングス	10,600	1,656.00	17,553,600	
三井金属鉱業	11,300	3,010.00	34,013,000	
東邦亜鉛	2,300	2,143.00	4,928,900	
三菱マテリアル	27,700	1,944.00	53,848,800	
住友金属鉱山	53,600	4,304.00	230,694,400	
DOWAホールディングス	11,400	4,515.00	51,471,000	
古河機械金属	6,900	1,225.00	8,452,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,800	760.00	3,648,000	
東邦チタニウム	7,500	884.00	6,630,000	
UACJ	6,400	2,436.00	15,590,400	
CKサンエツ	900	3,990.00	3,591,000	
古河電気工業	13,000	2,212.00	28,756,000	
住友電気工業	156,800	1,461.00	229,084,800	
フジクラ	46,700	539.00	25,171,300	
昭和電線ホールディングス	3,700	1,679.00	6,212,300	
東京特殊電線	1,000	2,928.00	2,928,000	
タツタ電線	7,400	458.00	3,389,200	
平河ヒューテック	1,900	1,182.00	2,245,800	
リョービ	5,200	1,064.00	5,532,800	
アーレスティ	7,800	357.00	2,784,600	
アサヒホールディングス	16,800	1,987.00	33,381,600	
東洋製罐グループホールディングス	26,700	1,402.00	37,433,400	
ホッカンホールディングス	2,300	1,426.00	3,279,800	
コロナ	3,200	898.00	2,873,600	
横河ブリッジホールディングス	7,200	2,160.00	15,552,000	
三和ホールディングス	39,500	1,179.00	46,570,500	
文化シャッター	13,300	1,031.00	13,712,300	
三協立山	5,400	709.00	3,828,600	
アルインコ	3,000	945.00	2,835,000	
LIXIL	66,000	2,972.00	196,152,000	
日本フィルコン	5,400	519.00	2,802,600	
ノーリツ	8,000	1,688.00	13,504,000	
長府製作所	4,300	2,033.00	8,741,900	
リンナイ	7,900	10,340.00	81,686,000	
ユニプレス	6,300	723.00	4,554,900	
ダイニチ工業	3,700	755.00	2,793,500	
日東精工	5,300	592.00	3,137,600	
三洋工業	1,500	1,818.00	2,727,000	
岡部	8,500	725.00	6,162,500	
ジーテクト	5,200	1,376.00	7,155,200	
東プレ	7,800	1,096.00	8,548,800	
高周波熱錬	7,500	567.00	4,252,500	
東京製綱	3,100	867.00	2,687,700	
サンコール	6,100	452.00	2,757,200	
モリテックスチール	7,900	361.00	2,851,900	
パイオラックス	6,200	1,682.00	10,428,400	

エイチワン	4,400	647.00	2,846,800
日本発条	38,600	979.00	37,789,400
三浦工業	18,100	3,935.00	71,223,500
タクマ	14,200	1,412.00	20,050,400
テクノプロ・ホールディングス	24,300	3,320.00	80,676,000
インターワークス	6,700	399.00	2,673,300
アイ・アールジャパンホールディングス	1,900	6,480.00	12,312,000
Keeper 技研	2,600	2,237.00	5,816,200
三機サービス	2,800	1,003.00	2,808,400
Gunosy	4,300	757.00	3,255,100
イー・ガーディアン	1,600	3,275.00	5,240,000
リブセンス	15,200	182.00	2,766,400
ジャパンマテリアル	12,500	1,783.00	22,287,500
ベクトル	5,700	1,109.00	6,321,300
ウチヤマホールディングス	9,200	296.00	2,723,200
チャーム・ケア・コーポレーション	3,000	1,382.00	4,146,000
キャリアリンク	2,300	1,249.00	2,872,700
IBJ	3,300	885.00	2,920,500
アサンテ	1,800	1,714.00	3,085,200
バリューHR	1,600	2,601.00	4,161,600
M&Aキャピタルパートナーズ	3,300	5,380.00	17,754,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,600	1,577.00	2,523,200
アピスト	1,000	2,810.00	2,810,000
シグマクシス・ホールディングス	2,400	2,522.00	6,052,800
ウィルグループ	3,000	1,254.00	3,762,000
メドピア	3,100	3,060.00	9,486,000
リクルートホールディングス	312,600	6,480.00	2,025,648,000
エラン	5,600	1,108.00	6,204,800
ツガミ	9,200	1,582.00	14,554,400
オークマ	4,900	4,890.00	23,961,000
芝浦機械	4,700	3,580.00	16,826,000
アマダ	66,200	1,078.00	71,363,600
アイダエンジニアリング	11,000	952.00	10,472,000
滝澤鉄工所	2,500	1,142.00	2,855,000
FUJI	19,300	2,572.00	49,639,600
牧野フライス製作所	4,600	3,830.00	17,618,000
オーエスジー	19,400	1,708.00	33,135,200
ダイジェット工業	2,800	972.00	2,721,600
旭ダイヤモンド工業	11,000	609.00	6,699,000
DMG森精機	24,900	1,860.00	46,314,000
ソディック	9,300	771.00	7,170,300
ディスコ	6,200	32,900.00	203,980,000
日東工器	2,300	1,751.00	4,027,300
日進工具	3,300	1,548.00	5,108,400
日本郵政	529,200	882.60	467,071,920
ベルシステム24ホールディングス	5,800	1,206.00	6,994,800
鎌倉新書	4,600	620.00	2,852,000
SMN	4,600	606.00	2,787,600

エアトリ	2,600	3,265.00	8,489,000
アトラエ	2,800	2,438.00	6,826,400
ストライク	1,500	5,160.00	7,740,000
ソラスト	10,000	1,158.00	11,580,000
インソース	3,900	2,724.00	10,623,600
豊田自動織機	34,300	9,030.00	309,729,000
豊和工業	3,600	786.00	2,829,600
東洋機械金属	5,600	488.00	2,732,800
エンシュウ	4,400	631.00	2,776,400
島精機製作所	6,100	1,967.00	11,998,700
オプトラン	5,300	2,337.00	12,386,100
NCホールディングス	2,000	1,450.00	2,900,000
イワキ	2,600	1,012.00	2,631,200
フリー	3,700	1,223.00	4,525,100
ヤマシンフィルタ	8,500	479.00	4,071,500
日阪製作所	5,200	804.00	4,180,800
やまびこ	8,100	1,243.00	10,068,300
野村マイクロ・サイエンス	1,100	4,955.00	5,450,500
平田機工	2,000	5,860.00	11,720,000
ペガサスミシン製造	6,600	491.00	3,240,600
マルマエ	1,700	2,743.00	4,663,100
タツモ	2,000	1,480.00	2,960,000
ナプテスコ	23,900	3,155.00	75,404,500
三井海洋開発	4,500	1,358.00	6,111,000
レオン自動機	4,500	1,327.00	5,971,500
S M C	12,400	75,120.00	931,488,000
ホソカワミクロン	2,900	3,070.00	8,903,000
ユニオンツール	1,600	3,705.00	5,928,000
オイレス工業	5,900	1,743.00	10,283,700
日精エー・エス・ビー機械	1,400	2,949.00	4,128,600
サトーホールディングス	5,500	2,098.00	11,539,000
技研製作所	3,700	4,175.00	15,447,500
カワタ	3,300	887.00	2,927,100
日精樹脂工業	2,900	1,001.00	2,902,900
オカダアイヨン	2,000	1,482.00	2,964,000
ワイエイシーホールディングス	3,100	857.00	2,656,700
小松製作所	192,200	2,597.00	499,143,400
住友重機械工業	24,300	2,587.00	62,864,100
日立建機	17,000	3,175.00	53,975,000
日工	5,800	607.00	3,520,600
巴工業	1,700	2,250.00	3,825,000
井関農機	3,900	1,357.00	5,292,300
T O W A	3,600	3,080.00	11,088,000
丸山製作所	1,900	1,566.00	2,975,400
北川鉄工所	2,000	1,457.00	2,914,000
シンニッタン	10,400	219.00	2,277,600
ローツェ	2,100	11,370.00	23,877,000
タカキタ	4,700	620.00	2,914,000
クボタ	206,900	2,480.00	513,112,000
荏原実業	1,900	2,487.00	4,725,300



東洋エンジニアリング	5,600	684.00	3,830,400
三菱化工機	1,400	2,129.00	2,980,600
月島機械	7,800	1,084.00	8,455,200
帝国電機製作所	3,000	1,470.00	4,410,000
新東工業	9,300	686.00	6,379,800
澁谷工業	3,700	2,900.00	10,730,000
アイチコーポレーション	6,200	793.00	4,916,600
小森コーポレーション	10,700	706.00	7,554,200
鶴見製作所	3,300	1,593.00	5,256,900
荏原製作所	17,600	6,090.00	107,184,000
石井鐵工所	700	2,982.00	2,087,400
西島製作所	3,800	898.00	3,412,400
北越工業	4,000	974.00	3,896,000
ダイキン工業	54,000	25,035.00	1,351,890,000
オルガノ	1,200	7,570.00	9,084,000
トーヨーカネツ	1,600	2,471.00	3,953,600
栗田工業	23,000	5,140.00	118,220,000
椿本チエイン	5,500	2,947.00	16,208,500
大同工業	3,300	934.00	3,082,200
日機装	12,700	823.00	10,452,100
木村化工機	3,500	828.00	2,898,000
レイズネクスト	6,400	1,163.00	7,443,200
アネスト岩田	6,600	880.00	5,808,000
ダイフク	23,300	9,540.00	222,282,000
サムコ	1,100	2,627.00	2,889,700
加藤製作所	3,500	783.00	2,740,500
タダノ	22,200	1,026.00	22,777,200
フジテック	15,700	2,350.00	36,895,000
C K D	12,500	2,206.00	27,575,000
キトー	3,600	1,826.00	6,573,600
平和	11,800	1,861.00	21,959,800
理想科学工業	3,600	2,066.00	7,437,600
S A N K Y O	9,200	3,010.00	27,692,000
日本金銭機械	4,300	659.00	2,833,700
マースグループホールディングス	2,700	1,618.00	4,368,600
フクシマガリレイ	2,900	4,510.00	13,079,000
ダイコク電機	2,400	1,195.00	2,868,000
竹内製作所	6,500	2,608.00	16,952,000
アマノ	11,100	2,512.00	27,883,200
J U K I	5,900	867.00	5,115,300
ジャノメ	4,500	650.00	2,925,000
ブラザー工業	51,800	2,089.00	108,210,200
マックス	5,600	1,807.00	10,119,200
モリタホールディングス	6,800	1,293.00	8,792,400
グローリー	10,900	2,162.00	23,565,800
新晃工業	3,900	1,892.00	7,378,800
大和冷機工業	6,100	1,188.00	7,246,800
セガサミーホールディングス	42,100	1,815.00	76,411,500
日本ピストンリング	2,300	1,231.00	2,831,300
リケン	1,800	2,475.00	4,455,000

T P R	5,700	1,341.00	7,643,700
ツバキ・ナカシマ	9,300	1,407.00	13,085,100
ホシザキ	12,400	8,480.00	105,152,000
大豊工業	3,700	767.00	2,837,900
日本精工	79,800	725.00	57,855,000
N T N	91,100	223.00	20,315,300
ジェイテクト	40,700	986.00	40,130,200
不二越	3,600	3,930.00	14,148,000
ミネベアミツミ	73,100	3,085.00	225,513,500
日本トムソン	11,600	620.00	7,192,000
T H K	24,700	2,577.00	63,651,900
ユーシン精機	3,900	728.00	2,839,200
前澤給装工業	3,200	1,015.00	3,248,000
イーグル工業	5,200	1,051.00	5,465,200
日本ピラー工業	4,300	3,170.00	13,631,000
キット	14,300	684.00	9,781,200
日立製作所	204,000	6,165.00	1,257,660,000
東芝	74,100	4,545.00	336,784,500
三菱電機	424,100	1,451.00	615,369,100
富士電機	25,600	5,900.00	151,040,000
東洋電機製造	2,800	1,014.00	2,839,200
安川電機	45,700	5,560.00	254,092,000
シンフォニア テクノロジー	5,100	1,243.00	6,339,300
明電舎	7,200	2,558.00	18,417,600
オリジン	2,200	1,235.00	2,717,000
山洋電気	1,900	5,610.00	10,659,000
デンヨー	3,600	1,731.00	6,231,600
P H Cホールディングス	4,900	1,943.00	9,520,700
ベイカレント・コンサルティング	2,900	44,000.00	127,600,000
Orchestra Holdings	800	3,395.00	2,716,000
MS - Japan	3,100	936.00	2,901,600
グレイステクノロジー	6,800	357.00	2,427,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	12,900	1,902.00	24,535,800
G A M E W I T H	5,700	444.00	2,530,800
ウェルビー	2,700	1,271.00	3,431,700
ミダックホールディングス	1,800	3,740.00	6,732,000
日総工産	3,500	838.00	2,933,000
キュービーネットホールディングス	1,900	1,627.00	3,091,300
R P Aホールディングス	7,600	344.00	2,614,400
三櫻工業	5,900	893.00	5,268,700
マキタ	51,600	4,894.00	252,530,400
東芝テック	4,600	4,495.00	20,677,000
芝浦メカトロニクス	800	8,310.00	6,648,000
マブチモーター	9,900	3,720.00	36,828,000
日本電産	109,900	13,275.00	1,458,922,500
トレックス・セミコンダクター	2,100	3,115.00	6,541,500
東光高岳	2,400	1,343.00	3,223,200
ダブル・スコープ	12,200	752.00	9,174,400

ダイヘン	4,600	4,440.00	20,424,000
ヤーマン	6,900	926.00	6,389,400
JVCケンウッド	34,500	165.00	5,692,500
ミマキエンジニアリング	3,800	857.00	3,256,600
I - P E X	2,000	1,895.00	3,790,000
日新電機	9,900	1,479.00	14,642,100
大崎電気工業	7,800	446.00	3,478,800
オムロン	35,300	11,440.00	403,832,000
日東工業	5,700	1,568.00	8,937,600
I D E C	5,200	2,561.00	13,317,200
不二電機工業	2,200	1,159.00	2,549,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	14,200	2,376.00	33,739,200
サクサホールディングス	2,000	1,329.00	2,658,000
メルコホールディングス	1,200	3,980.00	4,776,000
日本電気	53,900	5,150.00	277,585,000
富士通	38,200	19,130.00	730,766,000
沖電気工業	17,200	882.00	15,170,400
岩崎通信機	3,300	836.00	2,758,800
電気興業	2,200	2,419.00	5,321,800
サンケン電気	4,000	5,890.00	23,560,000
アイホン	2,400	2,073.00	4,975,200
ルネサスエレクトロニクス	229,800	1,354.00	311,149,200
セイコーエプソン	52,600	1,974.00	103,832,400
ワコム	32,900	910.00	29,939,000
アルバック	7,800	6,920.00	53,976,000
E I Z O	3,300	3,980.00	13,134,000
ジャパンディスプレイ	144,800	36.00	5,212,800
日本信号	10,800	900.00	9,720,000
京三製作所	9,100	449.00	4,085,900
能美防災	5,600	2,183.00	12,224,800
ホーチキ	3,100	1,300.00	4,030,000
エレコム	9,700	1,451.00	14,074,700
パナソニック	452,300	1,222.00	552,710,600
シャープ	48,300	1,228.00	59,312,400
アンリツ	27,300	1,740.00	47,502,000
富士通ゼネラル	11,500	2,678.00	30,797,000
ソニーグループ	265,700	13,440.00	3,571,008,000
T D K	61,400	4,415.00	271,081,000
タムラ製作所	16,300	624.00	10,171,200
アルプスアルパイン	37,500	1,078.00	40,425,000
池上通信機	4,100	682.00	2,796,200
日本電波工業	3,800	1,523.00	5,787,400
メイコー	3,400	4,170.00	14,178,000
日本トリム	500	3,230.00	1,615,000
ローランド ディー・ジー	2,500	2,909.00	7,272,500
フォスター電機	4,300	721.00	3,100,300
S M K	1,300	2,183.00	2,837,900
ヨコオ	3,100	2,744.00	8,506,400
ホシデン	10,200	1,156.00	11,791,200
ヒロセ電機	6,500	19,070.00	123,955,000

日本航空電子工業	9,700	1,920.00	18,624,000
TOA	4,500	782.00	3,519,000
マクセル	8,400	1,414.00	11,877,600
古野電気	5,000	1,162.00	5,810,000
ユニデンホールディングス	900	3,425.00	3,082,500
スミダコーポレーション	4,000	1,170.00	4,680,000
アイコム	1,600	2,358.00	3,772,800
リオン	1,600	2,268.00	3,628,800
横河電機	42,400	2,033.00	86,199,200
新電元工業	1,600	3,430.00	5,488,000
アズビル	24,900	4,935.00	122,881,500
東亜ディーケーケー	3,300	860.00	2,838,000
日本光電工業	17,500	3,210.00	56,175,000
共和電業	7,300	390.00	2,847,000
日本電子材料	2,100	2,470.00	5,187,000
堀場製作所	7,800	6,570.00	51,246,000
アドバンテスト	31,500	10,200.00	321,300,000
小野測器	5,700	486.00	2,770,200
エスベック	3,400	2,104.00	7,153,600
キーエンス	38,400	71,580.00	2,748,672,000
日置電機	2,000	8,620.00	17,240,000
シスメックス	35,900	14,775.00	530,422,500
日本マイクロニクス	7,400	1,719.00	12,720,600
メガチップス	3,900	4,860.00	18,954,000
OBARA GROUP	1,900	3,360.00	6,384,000
澤藤電機	1,600	1,650.00	2,640,000
デンソー	93,400	9,031.00	843,495,400
原田工業	2,900	983.00	2,850,700
コーセル	5,200	833.00	4,331,600
イリソ電子工業	3,600	4,280.00	15,408,000
オブテックスグループ	7,000	1,560.00	10,920,000
千代田インテグレ	1,800	2,012.00	3,621,600
アイ・オー・データ機器	3,600	751.00	2,703,600
レーザーテック	18,600	30,230.00	562,278,000
スタンレー電気	29,700	2,852.00	84,704,400
岩崎電気	1,500	2,297.00	3,445,500
ウシオ電機	21,700	1,892.00	41,056,400
岡谷電機産業	8,800	318.00	2,798,400
日本セラミック	3,900	2,737.00	10,674,300
遠藤照明	2,700	1,019.00	2,751,300
古河電池	3,000	1,358.00	4,074,000
山一電機	3,100	2,173.00	6,736,300
図研	2,800	3,560.00	9,968,000
日本電子	8,800	8,600.00	75,680,000
カシオ計算機	30,700	1,459.00	44,791,300
ファナック	37,200	23,535.00	875,502,000
日本シイエムケイ	8,300	638.00	5,295,400
エンプラス	1,100	2,518.00	2,769,800
大真空	5,700	1,393.00	7,940,100
ローム	19,000	10,300.00	195,700,000

浜松ホトニクス	30,400	7,140.00	217,056,000	
三井ハイテック	4,200	10,310.00	43,302,000	
新光電気工業	12,500	5,150.00	64,375,000	
京セラ	59,700	7,105.00	424,168,500	
協栄産業	1,900	1,464.00	2,781,600	
太陽誘電	20,600	6,300.00	129,780,000	
村田製作所	124,600	9,102.00	1,134,109,200	
双葉電子工業	7,300	681.00	4,971,300	
日東電工	25,600	8,530.00	218,368,000	
北陸電気工業	2,200	1,340.00	2,948,000	
東海理化電機製作所	11,200	1,500.00	16,800,000	
ニチコン	13,400	1,211.00	16,227,400	
日本ケミコン	4,000	1,694.00	6,776,000	
K O A	6,400	1,529.00	9,785,600	
三井E & Sホールディングス	15,300	365.00	5,584,500	
日立造船	35,900	741.00	26,601,900	
三菱重工業	66,600	2,587.00	172,294,200	
川崎重工業	31,000	1,991.00	61,721,000	
I H I	26,500	2,171.00	57,531,500	
マネジメントソリューションズ	2,000	2,901.00	5,802,000	
プロレド・パートナーズ	2,500	982.00	2,455,000	
and factory	6,700	370.00	2,479,000	
カーブスホールディングス	11,100	763.00	8,469,300	
フォーラムエンジニアリング	3,400	806.00	2,740,400	
日本車輛製造	1,500	2,018.00	3,027,000	
三菱ロジスネクスト	5,600	1,140.00	6,384,000	
近畿車輛	2,800	990.00	2,772,000	
フルサト・マルカホールディングス	4,000	2,155.00	8,620,000	
ヤマエグループホールディングス	2,800	1,016.00	2,844,800	
F P G	14,100	556.00	7,839,600	
島根銀行	5,200	545.00	2,834,000	
じもとホールディングス	4,800	633.00	3,038,400	
全国保証	10,000	4,880.00	48,800,000	
めぶきフィナンシャルグループ	217,300	230.00	49,979,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3,200	1,242.00	3,974,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,200	1,466.00	7,623,200	
九州フィナンシャルグループ	85,400	407.00	34,757,800	
かんぽ生命保険	42,100	1,784.00	75,106,400	
ゆうちょ銀行	98,700	1,007.00	99,390,900	
富山第一銀行	10,400	282.00	2,932,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	238,900	415.00	99,143,500	
ジェイリース	1,400	1,857.00	2,599,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	27,300	720.00	19,656,000	
イントラスト	4,100	690.00	2,829,000	
アルヒ	6,200	1,006.00	6,237,200	
プレミアグループ	2,100	3,490.00	7,329,000	
日産自動車	500,200	548.10	274,159,620	

いすゞ自動車	133,100	1,432.00	190,599,200
トヨタ自動車	2,148,200	2,051.00	4,405,958,200
日野自動車	53,000	923.00	48,919,000
三菱自動車工業	157,000	315.00	49,455,000
エフテック	5,600	495.00	2,772,000
武蔵精密工業	9,500	1,704.00	16,188,000
日産車体	6,200	684.00	4,240,800
新明和工業	12,000	857.00	10,284,000
極東開発工業	7,900	1,518.00	11,992,200
トピー工業	3,500	1,068.00	3,738,000
ティラド	1,200	2,557.00	3,068,400
曙ブレーキ工業	23,300	178.00	4,147,400
タチエス	7,400	1,146.00	8,480,400
N O K	20,500	1,185.00	24,292,500
フタバ産業	10,600	405.00	4,293,000
K Y B	4,400	2,940.00	12,936,000
市光工業	5,500	492.00	2,706,000
大同メタル工業	8,100	582.00	4,714,200
プレス工業	21,000	379.00	7,959,000
ミクニ	9,800	334.00	3,273,200
太平洋工業	8,900	1,120.00	9,968,000
河西工業	10,400	275.00	2,860,000
アイシン	31,100	4,275.00	132,952,500
マツダ	133,100	877.00	116,728,700
今仙電機製作所	5,100	575.00	2,932,500
本田技研工業	333,900	3,086.00	1,030,415,400
スズキ	97,000	4,319.00	418,943,000
S U B A R U	121,500	2,010.50	244,275,750
ヤマハ発動機	55,300	2,700.00	149,310,000
小糸製作所	23,300	5,940.00	138,402,000
エクセディ	6,400	1,658.00	10,611,200
ミツバ	7,800	429.00	3,346,200
豊田合成	13,700	2,341.00	32,071,700
愛三工業	6,600	752.00	4,963,200
ヨロズ	4,000	1,088.00	4,352,000
エフ・シー・シー	6,900	1,439.00	9,929,100
シマノ	17,100	32,030.00	547,713,000
テイ・エス テック	17,900	1,333.00	23,860,700
三十三フィナンシャルグループ	3,900	1,452.00	5,662,800
第四北越フィナンシャルグループ	6,800	2,448.00	16,646,400
ひろぎんホールディングス	61,700	659.00	40,660,300
おきなわフィナンシャルグループ	3,800	2,181.00	8,287,800
ダイレクトマーケティングミックス	2,200	3,245.00	7,139,000
ポピンズホールディングス	900	2,800.00	2,520,000
L I T A L I C O	3,300	3,865.00	12,754,500
十六フィナンシャルグループ	5,600	2,116.00	11,849,600
北國フィナンシャルホールディングス	3,900	2,436.00	9,500,400
ジャムコ	3,600	852.00	3,067,200
小野建	4,000	1,630.00	6,520,000
南陽	1,500	1,880.00	2,820,000

ノジマ	6,800	2,311.00	15,714,800
カップ・クリエイト	5,900	1,326.00	7,823,400
伯東	2,500	2,346.00	5,865,000
コンドーテック	3,200	934.00	2,988,800
中山福	8,000	352.00	2,816,000
ライトオン	1,300	721.00	937,300
ナガイレーベン	5,500	2,224.00	12,232,000
三菱食品	4,000	2,730.00	10,920,000
良品計画	48,100	1,750.00	84,175,000
松田産業	3,000	2,360.00	7,080,000
第一興商	7,900	3,450.00	27,255,000
メディカルホールディングス	45,100	2,119.00	95,566,900
アドヴァングループ	4,300	953.00	4,097,900
S P K	2,100	1,368.00	2,872,800
萩原電気ホールディングス	1,500	2,005.00	3,007,500
アルビス	1,300	2,150.00	2,795,000
アズワン	3,000	14,370.00	43,110,000
スズデン	1,700	1,735.00	2,949,500
シモジマ	2,600	1,136.00	2,953,600
ドウシシャ	3,900	1,542.00	6,013,800
小津産業	1,500	1,919.00	2,878,500
コナカ	8,800	318.00	2,798,400
高速	2,500	1,562.00	3,905,000
G - 7ホールディングス	4,600	1,585.00	7,291,000
イオン北海道	7,300	1,310.00	9,563,000
コジマ	7,200	528.00	3,801,600
ヒマラヤ	3,100	945.00	2,929,500
コーナン商事	5,900	3,275.00	19,322,500
ネットワークシステムズ	15,900	3,205.00	50,959,500
エコス	1,600	1,841.00	2,945,600
ワタミ	5,100	871.00	4,442,100
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	83,500	1,606.00	134,101,000
丸文	3,700	775.00	2,867,500
西松屋チェーン	9,200	1,335.00	12,282,000
ゼンショーホールディングス	20,400	2,647.00	53,998,800
ハビネット	3,500	1,459.00	5,106,500
幸楽苑ホールディングス	2,700	1,410.00	3,807,000
橋本総業ホールディングス	1,500	2,010.00	3,015,000
日本ライフライン	12,400	1,043.00	12,933,200
サイゼリヤ	6,200	2,958.00	18,339,600
V Tホールディングス	15,700	446.00	7,002,200
アルゴグラフィックス	3,200	3,030.00	9,696,000
I D O M	12,700	681.00	8,648,700
日本エム・ディ・エム	2,400	1,804.00	4,329,600
フジ・コーポレーション	2,400	1,125.00	2,700,000
ユナイテッドアローズ	4,400	1,795.00	7,898,000
進和	2,500	2,037.00	5,092,500
ダイトロン	1,800	2,049.00	3,688,200
ハイデイ日高	6,000	1,610.00	9,660,000

シークス	6,000	1,341.00	8,046,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	13,500	206.00	2,781,000
コロワイド	17,200	1,572.00	27,038,400
ピーシーデポコーポレーション	8,600	291.00	2,502,600
田中商事	4,500	621.00	2,794,500
オーハシテクニカ	2,300	1,340.00	3,082,000
壱番屋	2,900	4,505.00	13,064,500
白銅	1,300	2,767.00	3,597,100
スギホールディングス	8,300	6,830.00	56,689,000
薬王堂ホールディングス	2,100	2,170.00	4,557,000
島津製作所	54,600	4,815.00	262,899,000
JMS	4,700	593.00	2,787,100
長野計器	3,100	1,498.00	4,643,800
ブイ・テクノロジー	1,900	3,335.00	6,336,500
スター精密	6,500	1,568.00	10,192,000
東京計器	2,900	970.00	2,813,000
愛知時計電機	600	4,570.00	2,742,000
インターアクション	2,100	2,341.00	4,916,100
オーバル	9,100	237.00	2,156,700
東京精密	7,200	4,720.00	33,984,000
マニー	16,900	1,545.00	26,110,500
ニコン	64,800	1,174.00	76,075,200
トプコン	19,900	1,602.00	31,879,800
オリンパス	222,400	2,449.00	544,657,600
理研計器	3,400	5,470.00	18,598,000
SCREENホールディングス	7,400	11,420.00	84,508,000
キヤノン電子	3,900	1,580.00	6,162,000
タムロン	3,300	2,740.00	9,042,000
HOYA	82,800	16,550.00	1,370,340,000
ノーリツ鋼機	3,800	2,498.00	9,492,400
エー・アンド・デイ	3,900	1,120.00	4,368,000
朝日インテック	46,500	2,501.00	116,296,500
キヤノン	210,700	2,785.00	586,799,500
リコー	117,700	1,026.00	120,760,200
シチズン時計	49,700	485.00	24,104,500
リズム	2,400	1,173.00	2,815,200
メニコン	14,100	3,470.00	48,927,000
スノーピーク	5,500	3,500.00	19,250,000
パラマウントベッドホールディングス	8,100	1,895.00	15,349,500
トランザクション	2,900	982.00	2,847,800
粧美堂	7,400	393.00	2,908,200
ニホンフラッシュ	3,600	1,013.00	3,646,800
前田工織	4,700	3,695.00	17,366,500
永大産業	10,300	279.00	2,873,700
アートネイチャー	4,100	700.00	2,870,000
バンダイナムコホールディングス	38,000	8,936.00	339,568,000
アイフィスジャパン	2,900	670.00	1,943,000
共立印刷	20,100	136.00	2,733,600
SHOEI	4,000	4,540.00	18,160,000



フランスベッドホールディングス	5,500	914.00	5,027,000	
マーベラス	6,600	707.00	4,666,200	
パイロットコーポレーション	7,200	4,150.00	29,880,000	
萩原工業	2,700	1,237.00	3,339,900	
エイベックス	7,200	1,550.00	11,160,000	
トッパン・フォームズ	6,100	1,547.00	9,436,700	
フジシールインターナショナル	10,300	2,043.00	21,042,900	
タカラトミー	17,800	1,076.00	19,152,800	
広済堂ホールディングス	3,500	757.00	2,649,500	
レック	5,500	818.00	4,499,000	
三光合成	7,500	364.00	2,730,000	
プロネクサス	3,300	1,057.00	3,488,100	
大建工業	2,500	2,132.00	5,330,000	
きもと	7,300	213.00	1,554,900	
凸版印刷	64,500	2,001.00	129,064,500	
大日本印刷	50,100	2,728.00	136,672,800	
共同印刷	1,300	3,125.00	4,062,500	
N I S S H A	8,700	1,612.00	14,024,400	
藤森工業	3,800	3,810.00	14,478,000	
TAKARA & COMPANY	2,100	1,755.00	3,685,500	
前澤化成工業	2,700	1,285.00	3,469,500	
未来工業	1,800	1,583.00	2,849,400	
アシックス	37,500	2,452.00	91,950,000	
ツツミ	1,300	1,905.00	2,476,500	
J S P	2,500	1,583.00	3,957,500	
ニチハ	5,900	2,912.00	17,180,800	
ローランド	2,900	3,870.00	11,223,000	
エフピコ	7,800	3,865.00	30,147,000	
小松ウオール工業	1,500	1,900.00	2,850,000	
ヤマハ	25,200	5,650.00	142,380,000	
河合楽器製作所	1,200	3,420.00	4,104,000	
ビジョン	25,600	2,345.00	60,032,000	
天馬	3,300	2,561.00	8,451,300	
キングジム	3,400	880.00	2,992,000	
象印マホービン	11,500	1,577.00	18,135,500	
リンテック	9,100	2,610.00	23,751,000	
信越ポリマー	7,600	1,084.00	8,238,400	
東リ	12,800	220.00	2,816,000	
イトーキ	8,300	357.00	2,963,100	
任天堂	23,900	53,510.00	1,278,889,000	
三菱鉛筆	7,000	1,208.00	8,456,000	
松風	1,800	1,981.00	3,565,800	
タカラスタANDARD	8,800	1,410.00	12,408,000	
コクヨ	20,300	1,698.00	34,469,400	
ナカバヤシ	5,700	489.00	2,787,300	
ニフコ	14,200	3,380.00	47,996,000	
グローブライト	3,800	3,245.00	12,331,000	
オカムラ	14,600	1,280.00	18,688,000	
バルカー	3,400	2,479.00	8,428,600	
MUTOHホールディングス	1,700	1,660.00	2,822,000	

伊藤忠商事	292,200	3,417.00	998,447,400	
丸紅	412,000	1,053.50	434,042,000	
スクロール	6,400	756.00	4,838,400	
ヨンドシーホールディングス	3,800	1,670.00	6,346,000	
三陽商会	3,400	886.00	3,012,400	
長瀬産業	22,900	1,796.00	41,128,400	
蝶理	2,300	1,713.00	3,939,900	
豊田通商	42,000	5,050.00	212,100,000	
オンワードホールディングス	25,000	282.00	7,050,000	
三共生興	5,500	551.00	3,030,500	
兼松	15,600	1,251.00	19,515,600	
美津濃	4,200	2,173.00	9,126,600	
三井物産	324,400	2,599.00	843,115,600	
日本紙パルプ商事	2,200	3,855.00	8,481,000	
東京エレクトロン	26,900	59,600.00	1,603,240,000	
カメイ	4,900	996.00	4,880,400	
OUGホールディングス	1,100	2,653.00	2,918,300	
スターゼン	3,100	1,924.00	5,964,400	
セイコーホールディングス	6,000	2,212.00	13,272,000	
山善	17,600	1,027.00	18,075,200	
椿本興業	900	4,260.00	3,834,000	
住友商事	263,600	1,628.50	429,272,600	
日本ユニシス	13,000	3,220.00	41,860,000	
内田洋行	1,800	5,150.00	9,270,000	
三菱商事	313,000	3,594.00	1,124,922,000	
第一実業	1,900	4,830.00	9,177,000	
キャノンマーケティングジャパン	10,400	2,264.00	23,545,600	
西華産業	2,200	1,615.00	3,553,000	
佐藤商事	3,400	1,111.00	3,777,400	
菱洋エレクトロ	2,500	2,300.00	5,750,000	
東京産業	3,800	746.00	2,834,800	
ユアサ商事	4,000	2,850.00	11,400,000	
神鋼商事	900	3,250.00	2,925,000	
阪和興業	8,400	3,045.00	25,578,000	
正栄食品工業	2,700	3,810.00	10,287,000	
カナデン	3,400	1,017.00	3,457,800	
菱電商事	3,300	1,756.00	5,794,800	
ニプロ	31,600	1,079.00	34,096,400	
岩谷産業	10,000	5,730.00	57,300,000	
ナイス	1,700	1,647.00	2,799,900	
極東貿易	1,200	2,414.00	2,896,800	
アステナホールディングス	6,000	474.00	2,844,000	
兼松エレクトロニクス	2,300	3,855.00	8,866,500	
三愛石油	10,300	1,267.00	13,050,100	
稲畑産業	9,200	1,611.00	14,821,200	
明和産業	3,900	845.00	3,295,500	
ゴールドウイン	7,500	6,370.00	47,775,000	
ユニ・チャーム	81,700	4,870.00	397,879,000	
デサント	8,100	3,925.00	31,792,500	
ワキタ	8,900	1,031.00	9,175,900	

ヤマトインターナショナル	9,300	290.00	2,697,000
東邦ホールディングス	13,400	1,747.00	23,409,800
サンゲツ	11,000	1,564.00	17,204,000
ミツウロコグループホールディングス	6,200	1,192.00	7,390,400
シナネンホールディングス	1,500	3,460.00	5,190,000
伊藤忠エネクス	9,200	967.00	8,896,400
サンリオ	12,900	2,387.00	30,792,300
サンワテクノス	2,500	1,560.00	3,900,000
リョーサン	4,600	2,083.00	9,581,800
新光商事	6,300	898.00	5,657,400
トーホー	2,000	1,258.00	2,516,000
三信電気	2,000	1,401.00	2,802,000
東陽テクニカ	4,100	1,075.00	4,407,500
モスフードサービス	5,500	3,040.00	16,720,000
加賀電子	3,800	2,999.00	11,396,200
三益半導体工業	3,300	2,382.00	7,860,600
都築電気	2,100	1,707.00	3,584,700
ソーダニッカ	4,300	750.00	3,225,000
立花エレテック	3,300	1,562.00	5,154,600
木曽路	5,500	2,160.00	11,880,000
S R S ホールディングス	5,700	768.00	4,377,600
千趣会	7,500	401.00	3,007,500
リテールパートナーズ	5,100	1,326.00	6,762,600
ケーヨー	7,700	820.00	6,314,000
上新電機	4,800	2,095.00	10,056,000
日本瓦斯	20,300	1,516.00	30,774,800
ロイヤルホールディングス	7,200	1,858.00	13,377,600
東天紅	2,800	985.00	2,758,000
いなげや	5,200	1,360.00	7,072,000
チヨダ	4,100	742.00	3,042,200
ライフコーポレーション	3,900	3,425.00	13,357,500
リンガーハット	5,100	2,177.00	11,102,700
MrMaxHD	5,300	561.00	2,973,300
AOKIホールディングス	8,100	598.00	4,843,800
オークワ	6,600	964.00	6,362,400
コメリ	6,400	2,523.00	16,147,200
青山商事	8,600	642.00	5,521,200
しまむら	4,900	9,570.00	46,893,000
はせがわ	12,100	249.00	3,012,900
高島屋	30,400	1,021.00	31,038,400
松屋	8,400	800.00	6,720,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	19,800	796.00	15,760,800
近鉄百貨店	1,600	2,505.00	4,008,000
丸井グループ	35,300	2,105.00	74,306,500
クレディセゾン	26,900	1,133.00	30,477,700
アクシアル リテイリング	3,200	3,290.00	10,528,000
イオン	160,700	2,694.00	432,925,800
イズミ	7,500	3,230.00	24,225,000
フォーバル	2,700	1,027.00	2,772,900
平和堂	7,700	1,929.00	14,853,300

フジ	5,000	1,902.00	9,510,000	
ヤオコー	4,700	6,940.00	32,618,000	
ゼビオホールディングス	5,700	881.00	5,021,700	
ケーズホールディングス	38,500	1,097.00	42,234,500	
PALTA C	5,900	4,610.00	27,199,000	
三谷産業	9,400	304.00	2,857,600	
日産東京販売ホールディングス	12,400	224.00	2,777,600	
新生銀行	27,300	1,831.00	49,986,300	
あおぞら銀行	23,400	2,516.00	58,874,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,682,500	617.40	1,656,175,500	
りそなホールディングス	478,800	436.50	208,996,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	79,100	3,803.00	300,817,300	
三井住友フィナンシャルグループ	289,600	3,812.00	1,103,955,200	
千葉銀行	139,600	661.00	92,275,600	
群馬銀行	80,400	341.00	27,416,400	
武蔵野銀行	6,200	1,676.00	10,391,200	
千葉興業銀行	11,400	251.00	2,861,400	
七十七銀行	13,100	1,270.00	16,637,000	
青森銀行	3,200	1,715.00	5,488,000	
秋田銀行	2,700	1,580.00	4,266,000	
山形銀行	4,700	846.00	3,976,200	
岩手銀行	2,800	1,782.00	4,989,600	
東邦銀行	34,900	208.00	7,259,200	
みちのく銀行	3,600	790.00	2,844,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	35,200	1,902.00	66,950,400	
静岡銀行	101,900	826.00	84,169,400	
スルガ銀行	36,700	494.00	18,129,800	
八十二銀行	94,200	372.00	35,042,400	
山梨中央銀行	4,500	833.00	3,748,500	
大垣共立銀行	8,300	1,874.00	15,554,200	
福井銀行	3,600	1,367.00	4,921,200	
清水銀行	1,800	1,547.00	2,784,600	
富山銀行	1,700	1,773.00	3,014,100	
滋賀銀行	7,900	1,971.00	15,570,900	
南都銀行	6,500	1,881.00	12,226,500	
百五銀行	40,200	339.00	13,627,800	
京都銀行	15,000	4,875.00	73,125,000	
紀陽銀行	14,800	1,405.00	20,794,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	26,100	794.00	20,723,400	
山陰合同銀行	24,800	624.00	15,475,200	
中国銀行	33,400	884.00	29,525,600	
伊予銀行	55,400	565.00	31,301,000	
百十四銀行	4,400	1,441.00	6,340,400	
四国銀行	6,400	742.00	4,748,800	
阿波銀行	6,400	2,123.00	13,587,200	
大分銀行	2,400	1,743.00	4,183,200	
宮崎銀行	2,600	2,037.00	5,296,200	
佐賀銀行	2,400	1,432.00	3,436,800	
琉球銀行	9,100	752.00	6,843,200	
セブン銀行	124,200	235.00	29,187,000	

みずほフィナンシャルグループ	535,000	1,442.00	771,470,000
山口フィナンシャルグループ	48,700	633.00	30,827,100
芙蓉総合リース	4,400	7,770.00	34,188,000
みずほリース	6,500	3,055.00	19,857,500
東京センチュリー	8,100	5,360.00	43,416,000
SBIホールディングス	51,600	2,897.00	149,485,200
日本証券金融	16,400	828.00	13,579,200
アイフル	70,200	339.00	23,797,800
長野銀行	2,500	1,185.00	2,962,500
名古屋銀行	3,100	2,670.00	8,277,000
北洋銀行	63,100	245.00	15,459,500
愛知銀行	1,600	3,705.00	5,928,000
中京銀行	2,300	1,492.00	3,431,600
大光銀行	2,200	1,276.00	2,807,200
愛媛銀行	5,800	784.00	4,547,200
京葉銀行	17,800	442.00	7,867,600
栃木銀行	20,200	184.00	3,716,800
北日本銀行	2,000	1,523.00	3,046,000
東和銀行	7,300	516.00	3,766,800
リコーリース	3,700	3,730.00	13,801,000
イオンフィナンシャルサービス	22,800	1,214.00	27,679,200
アコム	82,500	327.00	26,977,500
ジャックス	4,600	2,840.00	13,064,000
オリエントコーポレーション	113,200	119.00	13,470,800
オリックス	253,900	2,239.50	568,609,050
三菱HCキャピタル	154,500	552.00	85,284,000
ジャフコグループ	5,300	6,350.00	33,655,000
九州リースサービス	4,900	571.00	2,797,900
トモニホールディングス	32,300	300.00	9,690,000
大和証券グループ本社	313,300	636.00	199,258,800
野村ホールディングス	638,600	488.30	311,828,380
岡三証券グループ	32,900	376.00	12,370,400
丸三証券	12,400	499.00	6,187,600
東洋証券	18,600	143.00	2,659,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	48,000	389.00	18,672,000
光世証券	5,500	493.00	2,711,500
水戸証券	11,200	266.00	2,979,200
いちよし証券	7,800	634.00	4,945,200
松井証券	20,500	777.00	15,928,500
SOMPOホールディングス	73,700	4,937.00	363,856,900
日本取引所グループ	105,900	2,415.00	255,748,500
マネックスグループ	34,100	689.00	23,494,900
極東証券	5,600	727.00	4,071,200
岩井コスモホールディングス	4,000	1,310.00	5,240,000
アイザワ証券グループ	6,900	1,036.00	7,148,400
フィデアホールディングス	3,800	1,245.00	4,731,000
池田泉州ホールディングス	48,100	159.00	7,647,900
アニコムホールディングス	12,800	761.00	9,740,800

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	93,800	3,500.00	328,300,000	
スパークス・グループ	19,300	302.00	5,828,600	
第一生命ホールディングス	205,900	2,337.00	481,188,300	
東京海上ホールディングス	137,800	6,242.00	860,147,600	
イー・ギャランティ	6,100	2,342.00	14,286,200	
アサックス	3,300	701.00	2,313,300	
NECキャピタルソリューション	1,700	1,966.00	3,342,200	
T & Dホールディングス	108,600	1,425.00	154,755,000	
アドバンスクリエイト	1,900	1,075.00	2,042,500	
三井不動産	190,700	2,211.50	421,733,050	
三菱地所	274,800	1,563.00	429,512,400	
平和不動産	7,200	3,630.00	26,136,000	
東京建物	41,300	1,611.00	66,534,300	
ダイビル	10,600	2,218.00	23,510,800	
京阪神ビルディング	6,500	1,494.00	9,711,000	
住友不動産	87,800	3,283.00	288,247,400	
テーオーシー	7,500	639.00	4,792,500	
東京楽天地	700	3,995.00	2,796,500	
レオパレス21	43,400	181.00	7,855,400	
スターツコーポレーション	5,700	2,393.00	13,640,100	
フジ住宅	4,900	657.00	3,219,300	
空港施設	5,400	538.00	2,905,200	
ゴールドクレスト	3,300	1,558.00	5,141,400	
リログループ	22,200	2,054.00	45,598,800	
エスリード	1,700	1,630.00	2,771,000	
日神グループホールディングス	6,800	477.00	3,243,600	
日本エスコン	7,800	785.00	6,123,000	
タカラレーベン	17,500	277.00	4,847,500	
A V A N T I A	3,400	851.00	2,893,400	
イオンモール	21,000	1,591.00	33,411,000	
ファースト住建	2,400	1,221.00	2,930,400	
カチタス	10,400	4,080.00	42,432,000	
東祥	3,000	1,589.00	4,767,000	
トーセイ	5,800	977.00	5,666,600	
穴吹興産	1,500	1,866.00	2,799,000	
サンフロンティア不動産	5,800	945.00	5,481,000	
FJネクストホールディングス	4,100	992.00	4,067,200	
グランディハウス	6,100	470.00	2,867,000	
東武鉄道	41,400	2,633.00	109,006,200	
相鉄ホールディングス	13,600	2,062.00	28,043,200	
東急	107,000	1,545.00	165,315,000	
京浜急行電鉄	54,500	1,143.00	62,293,500	
小田急電鉄	63,100	2,190.00	138,189,000	
京王電鉄	22,000	5,080.00	111,760,000	
京成電鉄	29,500	3,025.00	89,237,500	
富士急行	5,100	4,130.00	21,063,000	
新京成電鉄	100	2,015.00	201,500	
東日本旅客鉄道	74,600	7,022.00	523,841,200	
西日本旅客鉄道	51,400	4,848.00	249,187,200	

東海旅客鉄道	35,300	15,545.00	548,738,500
西武ホールディングス	55,400	1,069.00	59,222,600
鴻池運輸	6,700	1,159.00	7,765,300
西日本鉄道	11,800	2,574.00	30,373,200
ハマキョウレックス	3,000	2,857.00	8,571,000
サカイ引越センター	2,000	4,260.00	8,520,000
近鉄グループホールディングス	40,200	3,245.00	130,449,000
阪急阪神ホールディングス	50,200	3,340.00	167,668,000
南海電気鉄道	17,900	2,116.00	37,876,400
京阪ホールディングス	17,900	2,557.00	45,770,300
神戸電鉄	1,000	3,140.00	3,140,000
名古屋鉄道	33,000	1,706.00	56,298,000
山陽電気鉄道	3,100	1,993.00	6,178,300
アルプス物流	2,900	1,058.00	3,068,200
トランコム	1,100	8,590.00	9,449,000
日本通運	13,900	6,730.00	93,547,000
ヤマトホールディングス	56,300	2,654.00	149,420,200
山九	11,200	4,750.00	53,200,000
日新	3,200	1,599.00	5,116,800
丸全昭和運輸	3,300	3,185.00	10,510,500
センコーグループホールディングス	20,100	932.00	18,733,200
トナミホールディングス	1,000	3,670.00	3,670,000
ニッコンホールディングス	13,500	2,090.00	28,215,000
日本石油輸送	1,100	2,618.00	2,879,800
福山通運	6,600	3,930.00	25,938,000
セイノーホールディングス	27,300	1,167.00	31,859,100
神奈川中央交通	1,000	3,370.00	3,370,000
日立物流	7,800	5,240.00	40,872,000
丸和運輸機関	8,500	1,402.00	11,917,000
C & F ロジホールディングス	4,100	1,533.00	6,285,300
日本郵船	33,600	8,350.00	280,560,000
商船三井	22,300	7,910.00	176,393,000
川崎汽船	12,400	6,800.00	84,320,000
N S ユナイテッド海運	2,200	3,345.00	7,359,000
明治海運	4,700	686.00	3,224,200
飯野海運	18,600	519.00	9,653,400
九州旅客鉄道	31,100	2,377.00	73,924,700
S G ホールディングス	75,900	2,616.00	198,554,400
日本航空	92,100	2,058.00	189,541,800
A N A ホールディングス	102,000	2,302.00	234,804,000
パスコ	800	1,300.00	1,040,000
T R E ホールディングス	5,500	1,687.00	9,278,500
人・夢・技術グループ	1,600	1,759.00	2,814,400
西本W i s m e t t a c ホールディングス	900	3,100.00	2,790,000
Genky DrugStores	1,800	5,220.00	9,396,000
国際紙パルプ商事	9,500	287.00	2,726,500
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	911.00	2,641,900
ブックオフグループホールディングス	2,900	985.00	2,856,500
三菱倉庫	12,800	2,827.00	36,185,600

三井倉庫ホールディングス	4,300	2,342.00	10,070,600	
住友倉庫	14,200	1,922.00	27,292,400	
澁澤倉庫	2,500	2,239.00	5,597,500	
ヤマタネ	1,900	1,588.00	3,017,200	
東陽倉庫	9,000	318.00	2,862,000	
乾汽船	2,700	2,163.00	5,840,100	
日本トランスシティ	8,800	643.00	5,658,400	
中央倉庫	3,000	955.00	2,865,000	
安田倉庫	3,300	961.00	3,171,300	
東洋埠頭	2,000	1,429.00	2,858,000	
宇徳	3,900	723.00	2,819,700	
上組	22,100	2,168.00	47,912,800	
近鉄エクスプレス	7,600	3,025.00	22,990,000	
東海運	9,200	303.00	2,787,600	
エーアイティー	2,500	1,288.00	3,220,000	
内外トランスライン	1,500	2,079.00	3,118,500	
日本コンセプト	1,700	1,766.00	3,002,200	
TBSホールディングス	25,300	1,662.00	42,048,600	
日本テレビホールディングス	34,700	1,154.00	40,043,800	
朝日放送グループホールディングス	4,100	691.00	2,833,100	
テレビ朝日ホールディングス	10,000	1,432.00	14,320,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	35,200	412.00	14,502,400	
テレビ東京ホールディングス	3,000	1,992.00	5,976,000	
日本BS放送	2,500	1,092.00	2,730,000	
ビジョン	7,100	1,189.00	8,441,900	
USEN-NEXT HOLDINGS	4,000	2,991.00	11,964,000	
コネクシオ	2,900	1,425.00	4,132,500	
日本通信	34,600	200.00	6,920,000	
日本電信電話	486,800	3,183.00	1,549,484,400	
KDDI	303,400	3,363.00	1,020,334,200	
ソフトバンク	630,300	1,450.50	914,250,150	
光通信	4,900	17,600.00	86,240,000	
エムティーアイ	4,700	582.00	2,735,400	
GMOインターネット	14,700	2,663.00	39,146,100	
ファイバーゲート	2,700	1,167.00	3,150,900	
アйдママーケティングコミュニケーション	9,500	293.00	2,783,500	
KADOKAWA	12,100	5,610.00	67,881,000	
学研ホールディングス	5,900	978.00	5,770,200	
ゼンリン	6,800	959.00	6,521,200	
インプレスホールディングス	13,200	213.00	2,811,600	
東京電力ホールディングス	317,400	300.00	95,220,000	
中部電力	129,700	1,204.00	156,158,800	
関西電力	160,700	1,064.00	170,984,800	
中国電力	66,300	944.00	62,587,200	
北陸電力	38,800	593.00	23,008,400	
東北電力	99,300	815.00	80,929,500	
四国電力	38,200	806.00	30,789,200	
九州電力	87,400	861.00	75,251,400	



北海道電力	36,900	509.00	18,782,100
沖縄電力	9,000	1,461.00	13,149,000
電源開発	36,200	1,547.00	56,001,400
エフオン	2,100	586.00	1,230,600
イーレックス	6,200	2,196.00	13,615,200
レノバ	8,300	4,645.00	38,553,500
東京瓦斯	81,300	2,090.00	169,917,000
大阪瓦斯	76,800	1,918.00	147,302,400
東邦瓦斯	19,500	3,135.00	61,132,500
北海道瓦斯	2,100	1,504.00	3,158,400
広島ガス	8,100	361.00	2,924,100
西部ガスホールディングス	4,800	2,266.00	10,876,800
静岡ガス	11,000	985.00	10,835,000
メタウォーター	4,800	1,945.00	9,336,000
アイネット	2,200	1,335.00	2,937,000
松竹	2,800	11,540.00	32,312,000
東宝	24,600	4,970.00	122,262,000
エイチ・アイ・エス	9,000	1,821.00	16,389,000
東映	1,400	17,550.00	24,570,000
ラックランド	1,200	3,030.00	3,636,000
エヌ・ティ・ティ・データ	110,800	2,338.00	259,050,400
共立メンテナンス	7,200	3,850.00	27,720,000
イチネンホールディングス	4,200	1,306.00	5,485,200
建設技術研究所	2,400	2,278.00	5,467,200
スペース	3,200	963.00	3,081,600
アインホールディングス	6,100	5,710.00	34,831,000
ピー・シー・エー	2,400	1,597.00	3,832,800
東京テアトル	2,300	1,225.00	2,817,500
タナベ経営	3,800	687.00	2,610,600
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,894.00	189,400
ナガワ	1,300	11,330.00	14,729,000
東京都競馬	3,000	4,130.00	12,390,000
カナモト	7,100	2,302.00	16,344,200
D T S	8,000	2,497.00	19,976,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	19,400	6,090.00	118,146,000
シーイーシー	4,500	1,049.00	4,720,500
カブコン	39,200	2,699.00	105,800,800
西尾レントオール	3,700	2,658.00	9,834,600
アイ・エス・ビー	2,800	969.00	2,713,200
日本空港ビルデング	15,900	4,600.00	73,140,000
トランス・コスモス	5,100	3,090.00	15,759,000
乃村工藝社	17,400	939.00	16,338,600
ジャステック	2,700	1,021.00	2,756,700
S C S K	28,800	2,228.00	64,166,400
藤田観光	1,800	2,321.00	4,177,800
K N T - C Tホールディングス	2,500	1,348.00	3,370,000
日本管財	4,300	2,709.00	11,648,700
トーカイ	3,600	1,967.00	7,081,200
セコム	39,900	7,932.00	316,486,800

日本システムウエア	1,600	2,171.00	3,473,600	
セントラル警備保障	2,000	2,282.00	4,564,000	
アイネス	3,800	1,430.00	5,434,000	
丹青社	8,300	781.00	6,482,300	
メイテック	4,900	6,530.00	31,997,000	
T K C	7,000	3,330.00	23,310,000	
富士ソフト	4,400	5,410.00	23,804,000	
応用地質	4,600	1,991.00	9,158,600	
船井総研ホールディングス	8,300	2,504.00	20,783,200	
N S D	13,400	2,084.00	27,925,600	
進学会ホールディングス	9,000	268.00	2,412,000	
丸紅建材リース	1,600	1,732.00	2,771,200	
コナミホールディングス	15,100	5,580.00	84,258,000	
学究社	1,900	1,487.00	2,825,300	
ベネッセホールディングス	13,500	2,227.00	30,064,500	
イオンディライト	5,000	3,305.00	16,525,000	
ナック	3,000	951.00	2,853,000	
福井コンピュータホールディングス	1,900	3,295.00	6,260,500	
ダイセキ	7,500	4,865.00	36,487,500	
ステップ	1,600	1,818.00	2,908,800	
日鉄物産	3,000	4,750.00	14,250,000	
泉州電業	1,200	5,550.00	6,660,000	
元気寿司	1,200	2,443.00	2,931,600	
トラスコ中山	8,700	2,670.00	23,229,000	
ヤマダホールディングス	152,700	380.00	58,026,000	
オートバックスセブン	14,000	1,368.00	19,152,000	
モリト	4,300	690.00	2,967,000	
アークランドサカモト	6,500	1,605.00	10,432,500	
ニトリホールディングス	16,600	18,255.00	303,033,000	
グルメ杵屋	3,300	981.00	3,237,300	
愛眼	15,500	178.00	2,759,000	
吉野家ホールディングス	14,600	2,297.00	33,536,200	
加藤産業	6,000	3,230.00	19,380,000	
イノテック	2,500	1,387.00	3,467,500	
イエローハット	7,200	1,588.00	11,433,600	
松屋フーズホールディングス	2,000	3,530.00	7,060,000	
J B C Cホールディングス	2,800	1,789.00	5,009,200	
J Kホールディングス	3,400	1,076.00	3,658,400	
サガミホールディングス	6,400	1,021.00	6,534,400	
日伝	3,500	2,246.00	7,861,000	
関西スーパーマーケット	3,200	1,034.00	3,308,800	
ミロク情報サービス	3,700	1,357.00	5,020,900	
北沢産業	11,500	244.00	2,806,000	
杉本商事	2,000	2,162.00	4,324,000	
因幡電機産業	11,100	2,642.00	29,326,200	
王将フードサービス	2,800	6,000.00	16,800,000	
プレナス	4,700	1,937.00	9,103,900	
ミニストップ	3,100	1,394.00	4,321,400	
アークス	8,000	2,135.00	17,080,000	
パローホールディングス	9,200	2,138.00	19,669,600	

東テク	1,400	2,432.00	3,404,800	
ミスミグループ本社	52,400	4,615.00	241,826,000	
ベルク	1,900	5,440.00	10,336,000	
タキヒヨー	1,700	1,650.00	2,805,000	
ファーストリテイリング	5,600	66,560.00	372,736,000	
ソフトバンクグループ	249,500	5,344.00	1,333,328,000	
蔵王産業	1,500	1,973.00	2,959,500	
スズケン	16,300	3,290.00	53,627,000	
サンドラッグ	15,700	3,090.00	48,513,000	
サックスパー ホールディングス	5,500	516.00	2,838,000	
ジェコス	3,600	778.00	2,800,800	
ヤマザワ	1,700	1,659.00	2,820,300	
やまや	1,200	2,400.00	2,880,000	
ベルーナ	9,000	704.00	6,336,000	
合計	46,562,300		112,816,857,230	

## (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。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2021年12月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,556,544,125
金銭信託	100,170,021
コール・ローン	9,209,138,430
株式	484,454,379,913
投資証券	11,534,472,777
派生商品評価勘定	16,460,856
未収入金	11,640,499
未収配当金	335,979,257
差入委託証拠金	8,995,800,330
流動資産合計	517,214,586,208
資産合計	
517,214,586,208	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	147,808,737
未払金	7,656,245,138
未払解約金	507,991,872
その他未払費用	4,934
流動負債合計	8,312,050,681
負債合計	
8,312,050,681	
純資産の部	
元本等	
元本	177,341,691,085
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	331,560,844,442
元本等合計	508,902,535,527
純資産合計	508,902,535,527
負債純資産合計	517,214,586,208

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	145,971,623,211円
同期中追加設定元本額	55,915,499,537円
同期中一部解約元本額	24,545,431,663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）	801,557,958円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,592,317,342円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,991,231,280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）	1,823,756,550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）	1,931,857円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	10,164,446円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	10,931,439円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	10,874,677,097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	124,410,958,442円
DCニッセイ外国株式インデックス	27,740,173,260円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	1,530,243,738円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	208,101,828円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	152,689,017円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	252,344,238円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	526,220,581円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	42,951,531円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	69,075,269円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,663,921円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	7,542,562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)	3,061,613円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	19,764,951円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	140,407,515円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	105,987,158円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	235,281,457円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	226,294,211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)	237,904,081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)	244,977,621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)	150,980,594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)	239,561,456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)	234,143,414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)	215,276,503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)	200,650,758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)	34,180,507円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	337,815円
FWニッセイ先進国株インデックス	349,075円
計	177,341,691,085円
2. 受益権の総数	177,341,691,085口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	11,691,982,071	
投資証券	302,185,704	
合計	11,389,796,367	

（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2021年12月20日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2021年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	7,295,988,672	-	7,298,983,734	2,995,062
イギリス・ポンド	5,397,150,999	-	5,399,146,155	1,995,156
ユーロ	536,055,198	-	536,557,035	501,837
ユーロ	1,362,782,475	-	1,363,280,544	498,069
買建	15,709,538,973	-	15,705,945,442	3,593,531
アメリカ・ドル	10,772,323,093	-	10,773,373,002	1,049,909
イギリス・ポンド	1,250,475,333	-	1,252,029,943	1,554,610
オーストラリア・ドル	153,763,665	-	153,794,812	31,147
カナダ・ドル	261,734,887	-	261,921,693	186,806
シンガポール・ドル	23,711,520	-	23,731,062	19,542
スイス・フラン	235,825,180	-	235,935,628	110,448
スウェーデン・クローナ	87,459,073	-	87,535,129	76,056
デンマーク・クローネ	62,190,942	-	62,213,091	22,149
ニュージーランド・ドル	4,842,884	-	4,845,138	2,254
ノルウェー・クローネ	14,902,018	-	14,916,242	14,224
ユーロ	2,782,102,539	-	2,775,428,131	6,674,408
香港・ドル	60,207,839	-	60,221,571	13,732
合計	23,005,527,645	-	23,004,929,176	6,588,593

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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



## 株式関連

種類	2021年12月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	12,597,666,240	-	12,472,906,952	124,759,288
合計	12,597,666,240	-	12,472,906,952	124,759,288

## (注) 株価指数先物取引

## 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	2.8696円
(1万口当たり純資産額)	(28,696円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2021年12月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	10X GENOMICS INC-CLASS A	5,938	143.450	851,806.10	
	3M CO	44,643	174.750	7,801,364.25	
	ABBOTT LABORATORIES	136,620	137.110	18,731,968.20	
	ABBVIE INC	136,232	129.530	17,646,130.96	
	ABIOMED INC	3,485	315.550	1,099,691.75	
	ACCENTURE PLC	48,849	396.240	19,355,927.76	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	59,900	61.360	3,675,464.00	
	ADOBE INC	36,696	556.640	20,426,461.44	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,840	232.820	1,126,848.80	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	93,481	137.750	12,877,007.75	
	AES CORP	51,524	24.090	1,241,213.16	
	AFFIRM HOLDINGS INC	6,725	98.770	664,228.25	
	AFLAC INC	48,995	56.840	2,784,875.80	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,344	151.420	3,534,748.48	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,071	298.330	5,092,791.43	
	AIRBNB INC-CLASS A	18,152	157.910	2,866,382.32	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12,530	115.350	1,445,335.50	
	ALBEMARLE CORP	8,995	229.870	2,067,680.65	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	5,779	609.060	3,519,757.74	
	ALLEGHANY CORP	1,061	657.830	697,957.63	
	ALLEGION PLC	7,033	127.890	899,450.37	
	ALLIANT ENERGY CORP	19,330	59.770	1,155,354.10	
	ALLSTATE CORP	22,685	114.140	2,589,265.90	
	ALLY FINANCIAL INC	27,694	46.240	1,280,570.56	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,169	194.570	1,784,012.33	
	ALPHABET INC-CL A	23,198	2,834.500	65,754,731.00	
	ALPHABET INC-CL C	22,209	2,856.060	63,430,236.54	
	ALTRIA GROUP INC	142,281	48.250	6,865,058.25	
	AMAZON.COM INC	35,129	3,400.350	119,450,895.15	
	AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	39,599	29.120	1,153,122.88	
	AMCOR PLC	119,538	11.790	1,409,353.02	
	AMERCO	797	715.300	570,094.10	
	AMEREN CORPORATION	19,822	86.410	1,712,819.02	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	38,616	86.540	3,341,828.64	
	AMERICAN EXPRESS CO	52,082	160.010	8,333,640.82	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,476	135.680	742,983.68	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	65,803	54.110	3,560,600.33	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,999	183.110	2,563,356.89	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,718	294.630	2,568,584.34	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,122	125.180	1,517,431.96	
AMETEK INC	17,872	139.830	2,499,041.76	
AMGEN INC	43,781	222.500	9,741,272.50	
AMPHENOL CORP-CL A	46,187	82.480	3,809,503.76	
ANALOG DEVICES INC	41,469	170.110	7,054,291.59	
ANSYS INC	6,721	396.860	2,667,296.06	
ANTHEM INC	18,775	445.100	8,356,752.50	
AON PLC	17,393	292.380	5,085,365.34	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	13,625	70.340	958,382.50	
APPLE INC	1,273,986	171.140	218,029,964.04	
APPLIED MATERIALS INC	69,564	146.150	10,166,778.60	
APTIV PLC	20,859	158.420	3,304,482.78	
ARAMARK	17,826	33.950	605,192.70	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	30,344	43.220	1,311,467.68	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,015	65.270	2,807,589.05	
ARISTA NETWORKS INC	17,700	135.030	2,390,031.00	
ARROW ELECTRONICS INC	5,459	125.220	683,575.98	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,896	164.400	2,613,302.40	
ASANA INC - CL A	5,111	74.750	382,047.25	
ASSURANT INC	4,501	150.580	677,760.58	
AT&T INC	551,278	23.780	13,109,390.84	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,263	80.600	827,197.80	
ATMOS ENERGY CORP	10,156	98.830	1,003,717.48	
AUTODESK INC	16,958	277.650	4,708,388.70	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	32,609	229.410	7,480,830.69	
AUTOZONE INC	1,659	1,996.370	3,311,977.83	
AVALARA INC	6,645	138.640	921,262.80	
AVANTOR INC	40,611	39.900	1,620,378.90	
AVERY DENNISON CORP	6,392	206.890	1,322,440.88	
BAKER HUGHES COMPANY	63,979	23.680	1,515,022.72	
BALL CORP	25,251	92.790	2,343,040.29	
BANK OF AMERICA CORP	583,434	43.880	25,601,083.92	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	63,089	57.500	3,627,617.50	
BATH & BODY WORKS INC	20,348	69.850	1,421,307.80	
BAXTER INTERNATIONAL INC	38,571	83.630	3,225,692.73	
BECTON DICKINSON & CO	22,155	256.900	5,691,619.50	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,506	49.320	666,115.92	

BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	102,198	293.660	30,011,464.68	
BEST BUY CO INC	17,314	100.030	1,731,919.42	
BILL.COM HOLDINGS INC	5,745	244.740	1,406,031.30	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,700	731.460	1,243,482.00	
BIO-TECHNE CORP	3,003	470.560	1,413,091.68	
BIOGEN INC	11,482	237.430	2,726,171.26	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,138	86.480	1,222,654.24	
BLACK KNIGHT INC	12,126	82.710	1,002,941.46	
BLACKROCK INC	11,723	913.570	10,709,781.11	
BLACKSTONE INC	52,799	123.270	6,508,532.73	
BLOCK INC	30,634	167.060	5,117,716.04	
BOEING CO	43,024	192.630	8,287,713.12	
BOOKING HOLDINGS INC	3,165	2,210.460	6,996,105.90	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,469	81.940	857,829.86	
BORGWARNER INC	18,521	43.630	808,071.23	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	109,816	40.860	4,487,081.76	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	171,549	61.560	10,560,556.44	
BROADCOM INC	31,637	634.960	20,088,229.52	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,984	175.790	1,579,297.36	
BROWN & BROWN INC	18,324	65.870	1,207,001.88	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	23,960	71.900	1,722,724.00	
BUNGE LIMITED	10,822	88.080	953,201.76	
BURLINGTON STORES INC	5,157	277.240	1,429,726.68	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,588	101.370	1,073,305.56	
CABLE ONE INC	422	1,677.950	708,094.90	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	21,246	179.150	3,806,220.90	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	16,433	87.910	1,444,625.03	
CAMPBELL SOUP CO	15,201	43.120	655,467.12	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,543	72.350	1,486,286.05	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,348	144.080	4,948,859.84	
CARDINAL HEALTH INC	22,485	49.650	1,116,380.25	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,277	52.000	638,404.00	
CARMAX INC	12,559	137.540	1,727,364.86	
CARNIVAL CORP	63,869	18.280	1,167,525.32	
CARRIER GLOBAL CORP	63,645	52.260	3,326,087.70	
CARVANA CO	5,874	223.590	1,313,367.66	
CATALENT INC	13,148	125.370	1,648,364.76	
CATERPILLAR INC	42,225	201.370	8,502,848.25	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,201	128.250	1,051,778.25	

CBRE GROUP INC	25,877	101.750	2,632,984.75	
CDW CORP/DE	10,619	190.070	2,018,353.33	
CELANESE CORP-SERIES A	8,516	159.230	1,356,002.68	
CENTENE CORP	44,933	83.020	3,730,337.66	
CENTERPOINT ENERGY INC	45,886	26.980	1,238,004.28	
CENTURYLINK INC	73,053	12.590	919,737.27	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,379	101.850	1,057,101.15	
CERNER CORP	22,697	89.770	2,037,509.69	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,510	64.810	1,070,013.10	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,880	362.950	1,408,246.00	
CHARLES SCHWAB CORP	111,500	82.950	9,248,925.00	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	9,915	650.000	6,444,750.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,194	114.240	936,082.56	
CHENIERE ENERGY INC	18,579	100.410	1,865,517.39	
CHEVRON CORP	149,028	113.600	16,929,580.80	
CHEWY INC - CLASS A	6,847	54.760	374,941.72	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,683.840	3,643,829.76	
CHUBB LTD	33,761	189.770	6,406,824.97	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,945	98.090	1,858,315.05	
CIGNA CORP	26,214	219.620	5,757,118.68	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,752	113.000	1,327,976.00	
CINTAS CORP	7,138	438.510	3,130,084.38	
CISCO SYSTEMS INC	324,678	60.460	19,630,031.88	
CITIGROUP INC	156,187	59.540	9,299,373.98	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,693	45.460	1,486,223.78	
CITRIX SYSTEMS INC	9,588	83.520	800,789.76	
CLARIVATE PLC	27,276	23.700	646,441.20	
CLOROX CO	9,499	174.160	1,654,345.84	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	18,238	134.590	2,454,652.42	
CME GROUP INC	27,698	224.780	6,225,956.44	
CMS ENERGY CORP	22,515	64.180	1,445,012.70	
COCA-COLA CO	316,596	57.730	18,277,087.08	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	15,867	53.550	849,677.85	
COGNEX CORP	13,578	75.910	1,030,705.98	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	40,456	84.820	3,431,477.92	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	2,908	243.350	707,661.80	
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,951	82.480	5,109,718.48	
COMCAST CORP	352,904	48.750	17,204,070.00	
CONAGRA BRANDS INC	36,981	34.580	1,278,802.98	
CONOCOPHILLIPS	102,964	68.610	7,064,360.04	

CONSOLIDATED EDISON INC	27,229	83.820	2,282,334.78	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,990	242.250	3,146,827.50	
COOPER COS INC/THE	3,779	393.470	1,486,923.13	
COPART INC	16,386	143.120	2,345,164.32	
CORNING INC	62,649	36.690	2,298,591.81	
CORTEVA INC	56,531	46.080	2,604,948.48	
COSTAR GROUP INC	30,476	78.700	2,398,461.20	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,049	547.610	18,645,572.89	
COTERRA ENERGY INC	59,250	19.660	1,164,855.00	
COUPA SOFTWARE INC	5,679	158.070	897,679.53	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,579	205.100	2,990,152.90	
CROWN HOLDINGS INC	10,210	106.930	1,091,755.30	
CSX CORP	175,626	35.720	6,273,360.72	
CUMMINS INC	11,067	211.030	2,335,469.01	
CVS HEALTH CORP	101,697	100.360	10,206,310.92	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,074	164.320	505,119.68	
DANAHER CORP	49,511	313.410	15,517,242.51	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,007	139.830	1,399,278.81	
DATADOG INC - CLASS A	14,761	170.160	2,511,731.76	
DAVITA INC	5,245	104.870	550,043.15	
DEERE & CO	22,714	347.030	7,882,439.42	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,311	54.650	1,164,646.15	
DELTA AIR LINES INC	12,492	36.560	456,707.52	
DENTSPLY SIRONA INC	16,834	53.410	899,103.94	
DEVON ENERGY CORPORATION	49,225	39.200	1,929,620.00	
DEXCOM INC	7,452	555.340	4,138,393.68	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,194	102.430	1,351,461.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,110	114.110	2,637,082.10	
DISCOVERY INC-A	12,944	23.280	301,336.32	
DISCOVERY INC-C	24,049	22.420	539,178.58	
DISH NETWORK CORP	18,964	33.250	630,553.00	
DOCUSIGN INC	15,010	155.370	2,332,103.70	
DOLLAR GENERAL CORP	17,993	222.500	4,003,442.50	
DOLLAR TREE INC	17,328	136.320	2,362,152.96	
DOMINION ENERGY INC	62,466	76.630	4,786,769.58	
DOMINO'S PIZZA INC	2,844	528.380	1,502,712.72	
DOORDASH INC - A	8,270	148.810	1,230,658.70	
DOVER CORP	11,084	170.290	1,887,494.36	
DOW INC	57,480	54.100	3,109,668.00	
DR HORTON INC	26,240	103.020	2,703,244.80	
DRAFTKINGS INC - CL A	24,846	28.670	712,334.82	
DROPBOX INC-CLASS A	24,292	24.340	591,267.28	
DTE ENERGY COMPANY	15,040	116.600	1,753,664.00	
DUKE ENERGY CORP	59,336	103.040	6,113,981.44	
DUPONT DE NEMOURS INC	40,301	76.510	3,083,429.51	

DYNATRACE INC	14,173	57.580	816,081.34	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,481	118.680	1,243,885.08	
EATON CORP PLC	30,702	165.070	5,067,979.14	
EBAY INC	50,006	64.030	3,201,884.18	
ECOLAB INC	19,891	225.450	4,484,425.95	
EDISON INTERNATIONAL	29,385	66.700	1,959,979.50	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,005	122.120	5,862,370.60	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	32,906	28.270	930,252.62	
ELECTRONIC ARTS INC	21,896	127.520	2,792,177.92	
ELI LILLY & CO	62,667	267.420	16,758,409.14	
EMERSON ELECTRIC CO	46,121	90.690	4,182,713.49	
ENPHASE ENERGY INC	9,852	189.110	1,863,111.72	
ENTEGRIS INC	10,426	132.960	1,386,240.96	
ENTERGY CORP	15,551	109.520	1,703,145.52	
EOG RESOURCES INC	44,865	84.000	3,768,660.00	
EPAM SYSTEMS INC	4,342	636.330	2,762,944.86	
EQUIFAX INC	9,392	276.640	2,598,202.88	
EQUITABLE HOLDINGS INC	28,665	31.850	912,980.25	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	1,952	187.520	366,039.04	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,235	51.530	939,649.55	
ESTEE LAUDER COS INC	17,965	345.960	6,215,171.40	
ETSY INC	9,742	221.600	2,158,827.20	
EVEREST RE GROUP LTD	3,044	266.930	812,534.92	
EVERGY INC	17,744	66.890	1,186,896.16	
EVERSOURCE ENERGY	26,561	89.400	2,374,553.40	
EXACT SCIENCES CORP	13,313	80.270	1,068,634.51	
EXELON CORP	75,213	53.520	4,025,399.76	
EXPEDIA GROUP INC	11,188	159.310	1,782,360.28	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	13,534	129.930	1,758,472.62	
EXXON MOBIL CORP	326,330	60.030	19,589,589.90	
F5 INC	4,637	233.000	1,080,421.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,896	473.120	1,370,155.52	
FAIR ISAAC CORP	2,208	412.250	910,248.00	
FASTENAL CO	44,180	62.050	2,741,369.00	
FEDEX CORP	19,678	250.320	4,925,796.96	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	20,807	50.350	1,047,632.45	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	47,695	107.980	5,150,106.10	
FIFTH THIRD BANCORP	53,144	42.260	2,245,865.44	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,625	199.340	2,716,007.50	
FIRSTENERGY CORP	42,097	40.080	1,687,247.76	
FISERV INC	46,049	103.650	4,772,978.85	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	2,260	117.700	266,002.00	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,064	214.260	1,299,272.64	
FMC CORP	9,980	103.980	1,037,720.40	
FORD MOTOR CO	302,338	19.770	5,977,222.26	
FORTINET INC	10,674	333.830	3,563,301.42	
FORTIVE CORP	26,300	72.890	1,917,007.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,660	100.740	1,073,888.40	
FOX CORP - CLASS A	23,635	36.960	873,549.60	
FOX CORP- CLASS B	12,818	34.220	438,631.96	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,024	33.220	764,857.28	
FREEPORT-MCMORAN INC	112,888	38.000	4,289,744.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,957	39.080	154,639.56	
GARMIN LTD	11,849	132.230	1,566,793.27	
GARTNER INC	6,447	320.070	2,063,491.29	
GENERAC HOLDINGS INC	4,853	357.430	1,734,607.79	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,339	202.200	3,708,145.80	
GENERAL ELECTRIC CO	84,673	91.450	7,743,345.85	
GENERAL MILLS INC	46,588	67.650	3,151,678.20	
GENERAL MOTORS CO	100,682	55.160	5,553,619.12	
GENUINE PARTS CO	11,014	133.250	1,467,615.50	
GILEAD SCIENCES INC	96,620	72.210	6,976,930.20	
GLOBAL PAYMENTS INC	22,701	128.070	2,907,317.07	
GLOBE LIFE INC	7,458	89.680	668,833.44	
GODADDY INC - CLASS A	13,106	71.740	940,224.44	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,962	381.800	9,912,291.60	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,106	112.240	685,337.44	
HALLIBURTON CO	68,624	22.110	1,517,276.64	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	26,609	67.700	1,801,429.30	
HASBRO INC	10,133	98.850	1,001,647.05	
HCA HEALTHCARE INC	19,725	253.790	5,006,007.75	
HEICO CORP	3,354	135.870	455,707.98	
HEICO CORP-CLASS A	5,590	121.390	678,570.10	
HENRY SCHEIN INC	10,708	73.750	789,715.00	
HERSHEY CO/THE	11,242	187.620	2,109,224.04	
HESS CORP	21,432	71.620	1,534,959.84	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	100,236	15.080	1,511,558.88	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,435	140.940	3,021,048.90	
HOLOGIC INC	19,490	77.710	1,514,567.90	
HOME DEPOT INC	81,336	387.980	31,556,741.28	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	53,266	205.170	10,928,585.22	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	91,800	5.200	477,360.00	
HORIZON PHARMA PLC	16,490	103.840	1,712,321.60	
HORMEL FOODS CORP	22,876	48.170	1,101,936.92	



HOWMET AEROSPACE INC	29,735	29.960	890,860.60	
HP INC	92,523	36.570	3,383,566.11	
HUBSPOT INC	3,437	668.500	2,297,634.50	
HUMANA INC	9,895	453.330	4,485,700.35	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	113,724	14.880	1,692,213.12	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,068	184.110	564,849.48	
IAC/INTERACTIVECORP	6,071	125.430	761,485.53	
IDEX CORP	5,879	228.730	1,344,703.67	
IDEXX LABORATORIES INC	6,547	616.880	4,038,713.36	
IHS MARKIT LTD	29,175	131.220	3,828,343.50	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	24,346	238.180	5,798,730.28	
ILLUMINA INC	11,311	384.920	4,353,830.12	
INCYTE CORP	14,481	72.890	1,055,520.09	
INGERSOLL-RAND INC	31,342	58.220	1,824,731.24	
INMODE LTD	3,787	67.770	256,644.99	
INSULET CORP	5,319	262.700	1,397,301.30	
INTEL CORP	312,680	50.620	15,827,861.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,412	133.380	5,790,292.56	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	69,158	127.400	8,810,729.20	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	19,246	144.430	2,779,699.78	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,621	45.840	1,311,986.64	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	30,203	36.710	1,108,752.13	
INTUIT INC	21,047	620.270	13,054,822.69	
INTUITIVE SURGICAL INC	27,483	337.400	9,272,764.20	
INVESCO LTD	26,390	22.610	596,677.90	
IPG PHOTONICS CORP	2,886	165.770	478,412.22	
IQVIA HOLDINGS INC	14,789	267.430	3,955,022.27	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,693	164.240	935,018.32	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,050	135.530	1,362,076.50	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,800	55.330	929,544.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,703	125.290	589,238.87	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,785	192.100	1,303,398.50	
JM SMUCKER CO	8,250	136.410	1,125,382.50	
JOHNSON & JOHNSON	202,906	168.230	34,134,876.38	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	54,953	77.050	4,234,128.65	
JPMORGAN CHASE & CO	230,255	156.760	36,094,773.80	
JUNIPER NETWORKS INC	24,878	33.640	836,895.92	
KELLOGG CO	19,705	64.450	1,269,987.25	

KEURIG DR PEPPER INC	54,868	35.680	1,957,690.24	
KEYCORP	73,504	22.510	1,654,575.04	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	14,151	197.200	2,790,577.20	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,053	139.370	3,631,006.61	
KINDER MORGAN INC	157,267	15.600	2,453,365.20	
KKR & CO INC -A	40,346	71.580	2,887,966.68	
KLA CORPORATION	11,771	391.550	4,608,935.05	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,972	58.980	765,088.56	
KORNIT DIGITAL LTD	3,565	130.520	465,303.80	
KRAFT HEINZ CO/THE	51,697	35.510	1,835,760.47	
KROGER CO	54,335	44.790	2,433,664.65	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,482	207.930	3,219,172.26	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,414	307.920	2,282,918.88	
LAM RESEARCH CORP	10,951	669.170	7,328,080.67	
LAS VEGAS SANDS CORP	26,613	35.440	943,164.72	
LEAR CORP	4,617	174.400	805,204.80	
LEIDOS HOLDINGS INC	10,421	86.730	903,813.33	
LENNAR CORP-CL A	21,169	105.840	2,240,526.96	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,625	312.480	820,260.00	
LIBERTY BROADBAND-A	2,128	153.930	327,563.04	
LIBERTY BROADBAND-C	11,006	155.510	1,711,543.06	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,906	27.130	485,789.78	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	21,075	27.420	577,876.50	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	6,284	48.450	304,459.80	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	13,144	48.310	634,986.64	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	14,972	59.420	889,636.24	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,613	65.760	895,190.88	
LINDE PLC	39,843	333.830	13,300,788.69	
LIVE NATION INC	12,685	105.140	1,333,700.90	
LKQ CORP	21,423	55.730	1,193,903.79	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,218	344.140	6,613,682.52	
LOEWS CORP	16,748	56.780	950,951.44	
LOWE'S COS INC	53,352	248.090	13,236,097.68	
LUCID GROUP INC	31,195	40.010	1,248,111.95	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,120	384.660	3,508,099.20	
LYFT INC-A	20,648	38.070	786,069.36	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,648	87.760	1,812,068.48	
M&T BANK CORP	9,894	147.150	1,455,902.10	
MARATHON PETROLEUM CORP	49,161	62.450	3,070,104.45	
MARKEL CORP	1,055	1,220.250	1,287,363.75	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,925	410.420	1,200,478.50	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	21,296	150.190	3,198,446.24	

MARSH & MCLENNAN COS INC	39,067	168.300	6,574,976.10	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,805	436.350	2,096,661.75	
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,471	84.030	5,333,468.13	
MASCO CORP	19,170	66.470	1,274,229.90	
MASIMO CORPORATION	4,015	280.080	1,124,521.20	
MASTERCARD INC-CLASS A	67,922	349.310	23,725,833.82	
MATCH GROUP INC	20,265	126.650	2,566,562.25	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	19,330	94.120	1,819,339.60	
MCDONALD'S CORP	57,589	261.700	15,071,041.30	
MCKESSON CORP	11,964	233.090	2,788,688.76	
MEDTRONIC PLC	103,737	100.630	10,439,054.31	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED- ADR	17,279	9.340	161,385.86	
MERCADOLIBRE INC	3,449	1,187.550	4,095,859.95	
MERCK & CO INC	195,100	75.690	14,767,119.00	
META PLATFORMS INC-A	183,708	333.790	61,319,893.32	
METLIFE INC	55,885	60.250	3,367,071.25	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,783	1,579.340	2,815,963.22	
MGM MIRAGE	29,492	42.280	1,246,921.76	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42,367	84.360	3,574,080.12	
MICRON TECHNOLOGY INC	86,761	83.000	7,201,163.00	
MICROSOFT CORP	550,185	323.800	178,149,903.00	
MODERNA INC	26,427	294.800	7,790,679.60	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,517	170.640	770,780.88	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,479	302.920	1,356,778.68	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	14,670	44.740	656,335.80	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	107,747	64.960	6,999,245.12	
MONGODB INC	4,475	497.850	2,227,878.75	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,353	482.990	1,619,465.47	
MONSTER BEVERAGE CORP	30,545	91.620	2,798,532.90	
MOODY'S CORP	12,922	393.640	5,086,616.08	
MORGAN STANLEY	105,435	97.130	10,240,901.55	
MOSAIC CO/THE	28,300	36.460	1,031,818.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,066	259.120	3,385,661.92	
MSCI INC	6,349	590.220	3,747,306.78	
NASDAQ INC	8,969	201.070	1,803,396.83	
NETAPP INC	17,233	88.060	1,517,537.98	
NETFLIX INC	34,106	586.730	20,011,013.38	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	7,293	86.630	631,792.59	
NEWELL BRANDS INC	29,520	21.750	642,060.00	
NEWMONT CORP	61,370	59.240	3,635,558.80	

NEWS CORP - CLASS A	29,924	21.280	636,782.72	
NEXTERA ENERGY INC	151,229	90.940	13,752,765.26	
NIKE INC	98,537	161.360	15,899,930.32	
NISOURCE INC	30,681	26.880	824,705.28	
NORDSON CORP	4,029	248.430	1,000,924.47	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,301	284.790	5,496,731.79	
NORTHERN TRUST CORP	15,253	117.230	1,788,109.19	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,715	377.460	4,421,943.90	
NORTONLIFELOCK INC	44,819	25.720	1,152,744.68	
NOVAVAX INC	5,452	217.320	1,184,828.64	
NOVOCURE LTD	7,217	84.030	606,444.51	
NRG ENERGY INC	18,765	40.490	759,794.85	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,022	54.920	1,264,368.24	
NUCOR CORP	22,550	118.000	2,660,900.00	
NVIDIA CORP	192,667	278.010	53,563,352.67	
NVR INC	262	5,636.780	1,476,836.36	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,440	218.710	4,470,432.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,311	676.070	3,590,607.77	
OAK STREET HEALTH INC	7,511	33.970	255,148.67	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	71,969	28.040	2,018,010.76	
OKTA INC	9,642	217.910	2,101,088.22	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,800	340.620	2,656,836.00	
OMNICOM GROUP	16,562	73.030	1,209,522.86	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	33,174	61.990	2,056,456.26	
ONEOK INC	34,345	57.850	1,986,858.25	
ORACLE CORP	129,070	96.620	12,470,743.40	
OTIS WORLDWIDE CORP	31,387	84.160	2,641,529.92	
OWENS CORNING	7,933	87.020	690,329.66	
PACCAR INC	26,820	83.500	2,239,470.00	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,325	130.030	952,469.75	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	122,276	19.060	2,330,580.56	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,507	530.140	3,979,760.98	
PARKER HANNIFIN CORP	9,949	302.610	3,010,666.89	
PAYCHEX INC	24,944	123.890	3,090,312.16	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,932	406.820	1,599,616.24	
PAYPAL HOLDINGS INC	86,036	186.200	16,019,903.20	
PELOTON INTERACTIVE INC- A	21,675	42.450	920,103.75	
PENTAIR PLC	12,696	70.120	890,243.52	
PEPSICO INC	106,584	168.300	17,938,087.20	
PERKINELMER INC	8,639	187.590	1,620,590.01	
PFIZER INC	432,071	59.480	25,699,583.08	
PG&E CORP	115,007	12.020	1,382,384.14	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	120,201	93.450	11,232,783.45	
PHILLIPS 66	33,760	71.800	2,423,968.00	
PINTEREST INC- CLASS A	42,803	36.510	1,562,737.53	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,802	173.690	3,092,029.38	
PLUG POWER INC	39,848	29.750	1,185,478.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,730	197.240	6,455,665.20	
POOL CORP	3,079	540.640	1,664,630.56	
PPG INDUSTRIES INC	18,322	164.590	3,015,617.98	
PPL CORPORATION	59,853	29.560	1,769,254.68	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,582	71.640	1,474,494.48	
PROCTER & GAMBLE CO	187,174	157.460	29,472,418.04	
PROGRESSIVE CORP	45,066	100.970	4,550,314.02	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,654	105.380	3,124,938.52	
PTC INC	8,606	120.750	1,039,174.50	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,058	64.090	2,503,227.22	
PULTE GROUP INC	19,979	52.980	1,058,487.42	
QORVO INC	8,563	147.680	1,264,583.84	
QUALCOMM INC	86,960	176.800	15,374,528.00	
QUEST DIAGNOSTICS	9,386	171.200	1,606,883.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,153	97.380	1,378,219.14	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	116,236	82.280	9,563,898.08	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,090	619.280	5,009,975.20	
REGIONS FINANCIAL CORP	72,971	21.270	1,552,093.17	
REPUBLIC SERVICES INC	17,202	134.980	2,321,925.96	
RESMED INC	11,206	252.980	2,834,893.88	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,977	185.210	1,107,000.17	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,628	97.700	1,331,455.60	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	8,529	106.510	908,423.79	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	14,021	19.100	267,801.10	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,953	341.760	3,059,777.28	
ROKU INC	8,976	236.460	2,122,464.96	
ROLLINS INC	17,069	32.770	559,351.13	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,142	475.520	3,871,683.84	
ROSS STORES INC	27,566	108.070	2,979,057.62	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,686	72.410	1,280,643.26	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,419	38.540	1,018,188.26	
RPM INTERNATIONAL INC	10,088	96.800	976,518.40	
S&P GLOBAL INC	18,573	467.640	8,685,477.72	

SALESFORCE.COM INC	75,453	252.930	19,084,327.29	
SCHLUMBERGER LTD	107,825	28.970	3,123,690.25	
SEA LTD-ADR	10,615	212.800	2,258,872.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	15,758	104.510	1,646,868.58	
SEAGEN INC	10,518	150.150	1,579,277.70	
SEALED AIR CORP	11,588	64.630	748,932.44	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,077	60.320	547,524.64	
SEMPRA ENERGY	24,699	126.870	3,133,562.13	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,295	57.190	703,151.05	
SERVICENOW INC	15,258	615.630	9,393,282.54	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,294	340.440	6,568,449.36	
SIGNATURE BANK	4,659	303.470	1,413,866.73	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	79,086	6.380	504,568.68	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,717	151.700	1,929,168.90	
SMITH (A.O.) CORP	10,281	80.910	831,835.71	
SNAP INC - A	81,733	45.290	3,701,687.57	
SNAP-ON INC	4,143	209.350	867,337.05	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,227	332.330	5,392,718.91	
SOFI TECHNOLOGIES INC	39,855	14.650	583,875.75	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,028	288.850	1,163,487.80	
SOUTHERN CO	81,857	66.840	5,471,321.88	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,335	39.660	449,546.10	
SPLUNK INC	12,666	111.340	1,410,232.44	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,849	79.960	1,427,206.04	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,587	183.700	2,312,231.90	
STARBUCKS CORP	90,910	108.630	9,875,553.30	
STATE STREET CORP	28,060	91.830	2,576,749.80	
STEEL DYNAMICS INC	15,541	62.340	968,825.94	
STERIS PLC	7,672	232.540	1,784,046.88	
STRYKER CORP	26,178	251.220	6,576,437.16	
SUNRUN INC	13,500	34.230	462,105.00	
SVB FINANCIAL GROUP	4,509	654.010	2,948,931.09	
SYNCHRONY FINANCIAL	43,883	46.650	2,047,141.95	
SYNOPSIS INC	11,724	348.040	4,080,420.96	
SYSCO CORP	39,503	72.110	2,848,561.33	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,379	193.360	3,360,403.44	
T-MOBILE US INC	48,310	119.810	5,788,021.10	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,956	175.740	1,573,927.44	
TARGET CORP	37,578	223.310	8,391,543.18	
TE CONNECTIVITY LTD	25,257	156.410	3,950,447.37	
TELADOC HEALTH INC	11,050	97.770	1,080,358.50	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,595	417.370	1,500,445.15	
TELEFLEX INC	3,622	321.500	1,164,473.00	

TERADYNE INC	12,696	156.260	1,983,876.96	
TESLA, INC.	64,852	932.570	60,479,029.64	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	85,281	8.200	699,304.20	
TEXAS INSTRUMENTS INC	71,180	186.300	13,260,834.00	
TEXTRON INC	17,166	74.080	1,271,657.28	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,317	651.070	19,738,489.19	
TJX COS INC	92,781	74.020	6,867,649.62	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,786	226.650	1,991,346.90	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	33,453	89.990	3,010,435.47	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,068	94.940	765,975.92	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,374	194.340	3,570,803.16	
TRANSDIGM GROUP INC	4,045	583.880	2,361,794.60	
TRANSUNION	14,832	110.760	1,642,792.32	
TRAVELERS COS INC/THE	19,149	158.190	3,029,180.31	
TRIMBLE INC	19,395	85.430	1,656,914.85	
TRUIST FINANCIAL CORP	103,041	57.110	5,884,671.51	
TWILIO INC - A	12,865	273.630	3,520,249.95	
TWITTER INC	61,461	43.070	2,647,125.27	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,136	501.670	1,573,237.12	
TYSON FOODS INC-CL A	22,679	85.430	1,937,466.97	
UBER TECHNOLOGIES INC	94,948	39.680	3,767,536.64	
UGI CORP	16,188	44.890	726,679.32	
ULTA BEAUTY INC	3,973	380.940	1,513,474.62	
UNION PACIFIC CORP	50,613	242.690	12,283,268.97	
UNITED PARCEL SERVICE INC	56,326	206.590	11,636,388.34	
UNITED RENTALS INC	5,558	332.330	1,847,090.14	
UNITEDHEALTH GROUP INC	72,657	487.120	35,392,677.84	
UNITY SOFTWARE INC	4,345	138.410	601,391.45	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,822	127.800	744,051.60	
UPSTART HOLDINGS INC	1,494	139.180	207,934.92	
US BANCORP	108,521	55.730	6,047,875.33	
VAIL RESORTS INC	3,101	322.210	999,173.21	
VALERO ENERGY CORP	31,478	68.690	2,162,223.82	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,639	256.930	2,733,478.27	
VERISIGN INC	7,778	242.110	1,883,131.58	
VERISK ANALYTICS INC	11,838	222.140	2,629,693.32	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	319,917	53.170	17,009,986.89	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,993	214.540	4,289,298.22	
VF CORP	25,873	70.980	1,836,465.54	
VIACOMCBS INC	46,623	29.520	1,376,310.96	

VIATRIS INC	93,454	13.030	1,217,705.62	
VISA INC-CLASS A SHARES	130,098	211.880	27,565,164.24	
VISTRA CORP	33,640	21.230	714,177.20	
VMWARE INC-CLASS A	16,144	114.790	1,853,169.76	
VULCAN MATERIALS CO	10,232	204.740	2,094,899.68	
WABTEC CORP	13,927	88.960	1,238,945.92	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	56,578	48.850	2,763,835.30	
WALMART INC	118,736	138.750	16,474,620.00	
WALT DISNEY CO	140,081	148.760	20,838,449.56	
WASTE CONNECTIONS INC	20,123	130.250	2,621,020.75	
WASTE MANAGEMENT INC	32,521	161.310	5,245,962.51	
WATERS CORP	4,724	348.350	1,645,605.40	
WAYFAIR INC- CLASS A	5,668	201.780	1,143,689.04	
WEC ENERGY GROUP INC	24,350	96.290	2,344,661.50	
WELLS FARGO & CO	316,378	47.950	15,170,325.10	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,677	449.810	2,553,571.37	
WESTERN DIGITAL CORP	23,780	56.850	1,351,893.00	
WESTERN UNION CO	31,680	17.380	550,598.40	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	20,526	43.940	901,912.44	
WEYERHAEUSER CO	57,599	39.640	2,283,224.36	
WHIRLPOOL CORP	4,832	230.360	1,113,099.52	
WILLIAMS COS INC	93,609	25.790	2,414,176.11	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,928	232.880	2,312,032.64	
WIX.COM LTD	4,342	145.280	630,805.76	
WORKDAY INC-CLASS A	14,713	273.880	4,029,596.44	
WR BERKLEY CORP	10,855	80.400	872,742.00	
WW GRAINGER INC	3,413	492.890	1,682,233.57	
WYNN RESORTS LTD	8,071	82.270	664,001.17	
XCEL ENERGY INC	41,613	67.000	2,788,071.00	
XILINX INC	19,065	200.140	3,815,669.10	
XYLEM INC	13,908	115.810	1,610,685.48	
YUM! BRANDS INC	22,781	131.930	3,005,497.33	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	4,107	588.520	2,417,051.64	
ZENDESK INC	9,298	102.320	951,371.36	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	12,937	62.460	808,045.02	
ZILLOW GROUP INC - CL A	4,737	61.060	289,241.22	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,119	120.850	1,947,981.15	
ZOETIS INC	36,561	234.310	8,566,607.91	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,693	199.740	3,334,259.82	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	17,295	62.730	1,084,915.35	
ZSCALER INC	6,321	304.870	1,927,083.27	
アメリカ・ドル 小計	24,454,323		3,143,790,247.06 (357,197,447,866)	



イギリス・ボンド	3I GROUP PLC	74,192	14.240	1,056,494.08	
	ABRDN PLC	166,380	2.369	394,154.22	
	ADMIRAL GROUP PLC	14,897	31.090	463,147.73	
	ANGLO AMERICAN PLC	99,287	29.430	2,922,016.41	
	ANTOFAGASTA PLC	30,107	13.695	412,315.36	
	ASHTAD GROUP PLC	34,417	60.320	2,076,033.44	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,602	19.525	538,929.05	
	ASTRAZENECA PLC	119,422	85.130	10,166,394.86	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	73,740	7.186	529,895.64	
	AVEVA GROUP PLC	9,431	32.570	307,167.67	
	AVIVA PLC	300,988	4.029	1,212,680.65	
	BAE SYSTEMS PLC	247,562	5.326	1,318,515.21	
	BARCLAYS PLC	1,297,034	1.808	2,345,037.47	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	78,567	7.206	566,153.80	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	8,737	47.250	412,823.25	
	BHP GROUP PLC	162,080	21.795	3,532,533.60	
	BP PLC	1,551,377	3.337	5,176,945.04	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,991	27.625	4,640,751.37	
	BT GROUP PLC	692,263	1.674	1,158,848.26	
	BUNZL PLC	26,062	28.670	747,197.54	
	BURBERRY GROUP PLC	31,344	17.450	546,952.80	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	15,487	25.200	390,272.40	
	COMPASS GROUP PLC	137,552	15.565	2,140,996.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,732	99.220	1,064,829.04	
	DCC PLC	7,631	60.780	463,812.18	
	DIAGEO PLC	180,044	39.770	7,160,349.88	
	ENTAIN PLC	44,983	16.010	720,177.83	
	EVRAZ PLC	38,252	6.000	229,512.00	
	EXPERIAN PLC	71,106	35.130	2,497,953.78	
	FERGUSON PLC	17,126	128.050	2,192,984.30	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	388,259	16.134	6,264,170.70	
	GLENCORE PLC	767,617	3.683	2,827,133.41	
	HALMA PLC	29,218	30.680	896,408.24	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,364	13.490	369,140.36	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,383	22.200	297,102.60	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,574,237	4.454	7,011,651.59	
	IMPERIAL BRANDS PLC	72,838	15.880	1,156,667.44	
	INFORMA PLC	116,856	5.020	586,617.12	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	14,255	44.750	637,911.25	
	INTERTEK GROUP PLC	12,508	55.460	693,693.68	
JD SPORTS FASHION PLC	197,599	1.983	391,838.81		
JOHNSON MATTHEY PLC	14,886	19.625	292,137.75		
KINGFISHER PLC	160,478	3.374	541,452.77		

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	460,368	2.873	1,322,637.26	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,458,716	0.461	2,516,468.07	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,408	68.080	1,729,776.64	
M&G PLC	203,354	1.941	394,710.11	
MELROSE INDUSTRIES PLC	338,553	1.468	496,995.80	
MONDI PLC/WI	37,564	18.165	682,350.06	
NATIONAL GRID PLC	279,506	10.738	3,001,335.42	
NATWEST GROUP PLC	442,009	2.194	969,767.74	
NEXT PLC	10,252	77.720	796,785.44	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	37,725	17.220	649,624.50	
PEARSON PLC	58,087	6.040	350,845.48	
PERSIMMON PLC	24,636	27.470	676,750.92	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,939	6.414	333,136.74	
PRUDENTIAL PLC	201,776	12.750	2,572,644.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	55,164	62.300	3,436,717.20	
RELX PLC	149,405	23.400	3,496,077.00	
RENTOKIL INITIAL PLC	143,962	5.350	770,196.70	
RIO TINTO PLC	86,267	48.760	4,206,378.92	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	645,548	1.143	737,861.36	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	316,654	15.930	5,044,298.22	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	283,275	15.958	4,520,502.45	
SAGE GROUP PLC	81,396	8.134	662,075.06	
SAINSBURY (J) PLC	131,785	2.712	357,400.92	
SCHRODERS PLC	9,461	34.390	325,363.79	
SEVERN TRENT PLC	19,523	29.290	571,828.67	
SMITH & NEPHEW PLC	68,024	12.400	843,497.60	
SMITHS GROUP PLC	30,823	15.485	477,294.15	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,689	153.800	874,968.20	
SSE PLC	80,589	16.090	1,296,677.01	
ST JAMES'S PLACE PLC	41,699	16.150	673,438.85	
STANDARD CHARTERED PLC	201,949	4.319	872,217.73	
TAYLOR WIMPEY PLC	283,805	1.673	474,805.76	
TESCO PLC	593,357	2.844	1,687,507.30	
UNILEVER PLC	200,213	39.820	7,972,481.66	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	52,944	11.020	583,442.88	
VODAFONE GROUP PLC	2,153,499	1.142	2,459,295.85	
WHITBREAD PLC	15,571	27.690	431,160.99	
WPP PLC	92,276	10.910	1,006,731.16	
イギリス・ポンド 小計	22,503,420		139,627,853.82 (21,000,029,215)	

イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	3,287	291.500	958,160.50	
	BANK HAPOALIM BM	85,897	30.800	2,645,627.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	109,351	31.000	3,389,881.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,053	540.000	1,108,620.00	
	ICL GROUP LTD	53,267	29.870	1,591,085.29	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	87,812	19.870	1,744,824.44	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,788	113.800	1,227,674.40	
	NICE LTD	4,792	904.000	4,331,968.00	
イスラエル・シュケル 小計		357,247		16,997,841.23 (616,341,723)	
オーストラリ ア・ドル	AFTERPAY LTD	17,039	82.670	1,408,614.13	
	AMPOL LTD	20,525	28.270	580,241.75	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	47,898	42.580	2,039,496.84	
	ASX LTD	15,969	91.690	1,464,197.61	
	AURIZON HOLDINGS LTD	170,781	3.410	582,363.21	
	AUSNET SERVICES	165,747	2.530	419,339.91	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	225,050	27.630	6,218,131.50	
	BHP GROUP LIMITED	229,383	41.400	9,496,456.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	41,818	21.050	880,268.90	
	BRAMBLES LTD	121,909	10.710	1,305,645.39	
	COCHLEAR LTD	5,479	207.620	1,137,549.98	
	COLES GROUP LTD	107,728	17.480	1,883,085.44	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,907	99.120	13,669,341.84	
	COMPUTERSHARE LIMITED	45,898	19.640	901,436.72	
	CROWN RESORTS LTD	32,465	11.100	360,361.50	
	CSL LIMITED	35,391	272.100	9,629,891.10	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	4,923	116.140	571,757.22	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	115,787	6.920	801,246.04	
	EVOLUTION MINING LTD	150,682	3.940	593,687.08	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	131,879	18.980	2,503,063.42	
	IDP EDUCATION LTD	16,689	34.490	575,603.61	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	204,906	4.290	879,046.74	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	35,599	54.440	1,938,009.56	
	MACQUARIE GROUP LTD	27,700	205.370	5,688,749.00	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	12,491	29.360	366,735.76		
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,313	3.380	785,217.94		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	260,285	28.830	7,504,016.55		
NEWCREST MINING LIMITED	65,995	23.650	1,560,781.75		

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	89,073	9.450	841,739.85	
	ORICA LTD	35,501	13.690	486,008.69	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	148,741	5.100	758,579.10	
	QANTAS AIRWAYS LTD	82,867	4.780	396,104.26	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	119,340	11.320	1,350,928.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	15,711	66.990	1,052,479.89	
	REA GROUP LTD	4,623	157.720	729,139.56	
	REECE LTD	23,962	24.650	590,663.30	
	RIO TINTO LTD	29,233	98.000	2,864,834.00	
	SANTOS LTD	259,325	6.420	1,664,866.50	
	SEEK LTD	28,173	32.660	920,130.18	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,008	43.150	1,596,895.20	
	SOUTH32 LTD	378,833	3.900	1,477,448.70	
	SUNCORP GROUP LTD	108,799	10.830	1,178,293.17	
	TABCORP HOLDINGS LTD	187,217	4.880	913,618.96	
	TELSTRA CORP LTD	356,664	4.090	1,458,755.76	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,430	12.120	708,171.60	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,872	31.500	562,968.00	
	WESFARMERS LIMITED	89,844	58.710	5,274,741.24	
	WESTPAC BANKING CORP	289,084	21.030	6,079,436.52	
	WISETECH GLOBAL LTD	11,728	58.520	686,322.56	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	78,534	21.900	1,719,894.60	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	100,495	37.660	3,784,641.70	
	XERO LTD	10,673	134.270	1,433,063.71	
	オーストラリア・ドル 小計	5,241,966		114,274,062.54 (9,248,199,881)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	18,622	65.010	1,210,616.22	
	AIR CANADA	14,069	20.120	283,068.28	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	53,712	17.950	964,130.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,081	47.850	3,018,425.85	
	ALTAGAS LTD	22,204	26.920	597,731.68	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	18,489	16.670	308,211.63	
	BANK OF MONTREAL	49,914	134.110	6,693,966.54	
	BANK OF NOVA SCOTIA	93,836	87.290	8,190,944.44	
	BARRICK GOLD CORP	136,961	23.720	3,248,714.92	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	23,729	32.000	759,328.00	
	BCE INC	7,053	65.690	463,311.57	
	BLACKBERRY LTD	41,682	11.780	491,013.96	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	108,986	73.830	8,046,436.38	

BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	10,151	46.900	476,081.90	
CAE INC	24,402	31.040	757,438.08	
CAMECO CORP	30,526	27.250	831,833.50	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	34,750	145.000	5,038,750.00	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	55,005	164.120	9,027,420.60	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	91,245	49.900	4,553,125.50	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	52,676	93.400	4,919,938.40	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,434	178.300	790,582.20	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10,589	36.510	386,604.39	
CANOPY GROWTH CORP	18,903	12.380	234,019.14	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	11,846	67.420	798,657.32	
CENOVUS ENERGY INC	100,680	14.520	1,461,873.60	
CGI INC	16,943	109.500	1,855,258.50	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,554	2,230.690	3,466,492.26	
DOLLARAMA INC	22,613	62.070	1,403,588.91	
EMERA INC	20,510	62.810	1,288,233.10	
EMPIRE CO LTD 'A'	12,911	39.860	514,632.46	
ENBRIDGE INC	156,864	47.650	7,474,569.60	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,009	583.530	1,172,311.77	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	45,108	27.130	1,223,780.04	
FIRSTSERVICE CORP	3,099	244.090	756,434.91	
FORTIS INC	37,289	60.510	2,256,357.39	
FRANCO-NEVADA CORP	14,673	172.200	2,526,690.60	
GEORGE WESTON LTD	5,901	147.820	872,285.82	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	12,404	45.640	566,118.56	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,382	51.810	796,941.42	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,086	37.390	825,795.54	
HYDRO ONE LTD	26,537	32.270	856,348.99	
IA FINANCIAL CORP INC	8,285	71.110	589,146.35	
IGM FINANCIAL INC	6,560	46.420	304,515.20	
IMPERIAL OIL LTD	18,956	42.410	803,923.96	
INTACT FINANCIAL CORP	13,686	162.880	2,229,175.68	
IVANHOE MINES LTD-CL A	46,686	9.560	446,318.16	
KEYERA CORP	17,140	28.040	480,605.60	
KINROSS GOLD CORP	92,836	7.160	664,705.76	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	20,368	51.350	1,045,896.80	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,248	52.060	429,390.88	
LOBLAW COS LTD	12,893	103.540	1,334,941.22	
LUNDIN MINING CORP	50,662	10.670	540,563.54	

MAGNA INTERNATIONAL INC	22,120	99.680	2,204,921.60		
MANULIFE FINANCIAL CORP	150,147	23.430	3,517,944.21		
METRO INC	19,099	67.640	1,291,856.36		
NATIONAL BANK OF CANADA	26,121	96.800	2,528,512.80		
NORTHLAND POWER INC	17,756	37.640	668,335.84		
NUTRIEN LTD	44,014	91.260	4,016,717.64		
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,366	70.490	307,759.34		
ONEX CORPORATION	5,867	95.220	558,655.74		
OPEN TEXT CORP	21,301	59.530	1,268,048.53		
PAN AMERICAN SILVER CORP	16,303	31.450	512,729.35		
PARKLAND CORP	12,153	33.790	410,649.87		
PEMBINA PIPELINE CORP	42,535	38.040	1,618,031.40		
POWER CORP OF CANADA	43,426	42.790	1,858,198.54		
QUEBECOR INC -CL B	13,403	28.090	376,490.27		
RESTAURANT BRANDS INTERN	22,259	74.160	1,650,727.44		
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	8,611	80.720	695,079.92		
ROGERS COMMUNICATIONS INC	27,939	58.970	1,647,562.83		
ROYAL BANK OF CANADA	110,147	130.980	14,427,054.06		
SAPUTO INC	19,661	28.340	557,192.74		
SHAW COMMUNICATIONS INC- B	35,325	37.450	1,322,921.25		
SHOPIFY INC - CLASS A	8,727	1,705.370	14,882,763.99		
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,422	69.140	3,140,477.08		
SUNCOR ENERGY INC	114,493	29.900	3,423,340.70		
TC ENERGY CORP	75,748	58.710	4,447,165.08		
TECK RESOURCES LTD-CL B	36,194	34.750	1,257,741.50		
TFI INTERNATIONAL INC	6,595	136.480	900,085.60		
THOMSON REUTERS CORP	13,376	148.090	1,980,851.84		
TMX GROUP LTD	4,529	124.770	565,083.33		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,522	111.070	724,398.54		
TORONTO-DOMINION BANK	140,644	94.120	13,237,413.28		
TOURMALINE OIL CORP	23,655	39.470	933,662.85		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,305	112.430	821,301.15		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,595	53.100	1,836,994.50		
WSP GLOBAL INC	9,078	178.350	1,619,061.30		
カナダ・ドル 小計	2,999,184		191,486,977.99 (16,885,321,719)		
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	206,300	3.370	695,231.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	34,100	6.780	231,198.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	139,300	32.440	4,518,892.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	460,500	0.770	354,585.00	
	KEPPEL CORP LTD	114,900	5.130	589,437.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	260,700	11.370	2,964,159.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	105,100	4.870	511,837.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	61,800	9.220	569,796.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	123,200	3.720	458,304.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	647,500	2.370	1,534,575.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	91,000	26.950	2,452,450.00	
	UOL Group Limited	36,400	7.020	255,528.00	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.450	387,450.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,800	4.080	598,944.00	
	シンガポール・ドル 小計	2,448,600		16,122,386.00 (1,340,737,620)	
スイス・フラン	ABB LTD	126,707	34.140	4,325,776.98	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,045	44.540	536,484.30	
	ALCON INC	38,479	78.060	3,003,670.74	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	468	630.000	294,840.00	
	BALOISE HOLDING AG	3,595	143.900	517,320.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	276	2,176.000	600,576.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	80	11,970.000	957,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	8	119,200.000	953,600.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	40,228	131.300	5,281,936.40	
	CLARIANT AG	17,091	18.830	321,823.53	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	204,537	8.692	1,777,835.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	538	1,009.000	542,842.00	
	GEBERIT AG-REG	2,773	717.000	1,988,241.00	
	GIVAUDAN-REG	712	4,770.000	3,396,240.00	
	HOLCIM LTD	40,370	44.990	1,816,246.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,030	58.740	1,000,342.20	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	4,246	277.700	1,179,114.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	13,291	76.600	1,018,090.60	
	LONZA GROUP AG	5,743	748.000	4,295,764.00	
	NESTLE SA	216,919	127.340	27,622,465.46	
	NOVARTIS AG	168,983	79.800	13,484,843.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,743	1,466.000	2,555,238.00	
	ROCHE HOLDING AG	54,118	378.900	20,505,310.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,470	403.400	996,398.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,685	238.800	402,378.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,045	241.400	735,063.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	466	2,968.000	1,383,088.00	
	SIKA AG-BEARER	10,932	369.500	4,039,374.00	

	SONOVA HOLDING AG-REG	4,205	339.500	1,427,597.50	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	1,821.000	1,445,874.00	
	SWATCH GROUP AG	2,107	270.600	570,154.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,425	554.800	1,345,390.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,046	88.750	536,582.50	
	SWISS RE AG	23,257	89.660	2,085,222.62	
	SWISSCOM AG	2,044	518.000	1,058,792.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	5,195	127.950	664,700.25	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,677	51.800	242,268.60	
	UBS GROUP AG	270,830	16.145	4,372,550.35	
	VAT GROUP AG	2,055	431.600	886,938.00	
	VIFOR PHARMA AG	3,781	159.700	603,825.70	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,584	391.800	4,538,611.20	
スイス・フラン	小計	1,327,578		125,311,009.33 (15,415,760,368)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	24,243	341.800	8,286,257.40	
	ASSA ABLOY AB	77,881	266.000	20,716,346.00	
	ATLAS COPCO AB	30,197	501.000	15,128,697.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	51,719	592.200	30,627,991.80	
	BOLIDEN AB	20,713	343.700	7,119,058.10	
	ELECTROLUX AB	17,440	212.300	3,702,512.00	
	EMBRACER GROUP AB	36,619	86.000	3,149,234.00	
	EPIROC AB-A	50,161	218.900	10,980,242.90	
	EPIROC AB-B	30,810	185.150	5,704,471.50	
	EQT AB	22,713	501.800	11,397,383.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	47,150	290.000	13,673,500.00	
	EVOLUTION AB	13,202	1,171.000	15,459,542.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	8,107	647.200	5,246,850.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,362	374.300	6,498,596.60	
	HENNES & MAURITZ AB	56,629	168.200	9,524,997.80	
	HEXAGON AB-B SHS	151,775	134.050	20,345,438.75	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,866	139.250	4,437,340.50	
	ICA GRUPPEN AB	7,477	534.000	3,992,718.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	9,951	275.800	2,744,485.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,577	267.800	3,368,120.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,221	336.300	3,773,622.30	
	INVESTOR AB	138,785	216.700	30,074,709.50	
	INVESTOR AB-A SHS	39,195	224.400	8,795,358.00	
	KINNEVIK AB - B	18,342	302.000	5,539,284.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,831	243.500	4,341,848.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,835	480.800	2,805,468.00	
	LUNDIN ENERGY AB	15,394	364.000	5,603,416.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,711	124.300	13,637,077.30	
	NORDEA BANK ABP	249,279	105.260	26,239,107.54	



	SAGAX AB-B	12,204	304.000	3,710,016.00	
	SANDVIK AB	87,133	236.100	20,572,101.30	
	SECURITAS AB	24,373	120.750	2,943,039.75	
	SINCH AB	40,115	102.350	4,105,770.25	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	125,511	123.100	15,450,404.10	
	SKANSKA AB-B SHS	26,658	222.200	5,923,407.60	
	SKF AB	29,532	208.300	6,151,515.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB	46,848	156.050	7,310,630.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	112,937	93.560	10,566,385.72	
	SWEDBANK AB - A SHARES	69,523	177.000	12,305,571.00	
	SWEDISH MATCH AB	121,903	69.000	8,411,307.00	
	TELE2 AB	40,252	122.800	4,942,945.60	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	224,996	96.960	21,815,612.16	
	TELIA CO AB	215,048	35.070	7,541,733.36	
	VOLVO AB	109,530	198.200	21,708,846.00	
	VOLVO AB-A SHS	16,270	198.700	3,232,849.00	
スウェーデン・クローナ 小計		2,627,018		459,605,810.53 (5,712,900,225)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	447	21,890.000	9,784,830.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	253	20,240.000	5,120,720.00	
	AMBU A/S-B	12,908	162.500	2,097,550.00	
	CARLSBERG AS-B	7,734	1,089.000	8,422,326.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,206	508.400	4,171,930.40	
	COLOPLAST-B	9,144	1,097.500	10,035,540.00	
	DANSKE BANK A/S	53,159	108.300	5,757,119.70	
	DEMANT A/S	8,260	312.000	2,577,120.00	
	DSV A/S	15,953	1,429.000	22,796,837.00	
	GENMAB A/S	5,054	2,470.000	12,483,380.00	
	GN STORE NORD A/S	9,595	400.200	3,839,919.00	
	NOVO-NORDISK A/S	129,664	764.900	99,179,993.60	
	NOVOZYMES A/S	15,755	522.800	8,236,714.00	
	ORSTED A/S	14,576	830.000	12,098,080.00	
	PANDORA A/S	7,651	768.600	5,880,558.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	647	2,775.000	1,795,425.00	
	TRYGVESTA AS	28,063	160.050	4,491,483.15	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	77,795	194.200	15,107,789.00		
デンマーク・クローネ 小計		404,864		233,877,315.45 (4,020,351,053)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	104,149	7.470	777,993.03	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	44,553	31.270	1,393,172.31	
	MERCURY NZ LTD	54,304	6.100	331,254.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	99,515	4.845	482,150.17	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	33,567	12.490	419,251.83	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	153,983	4.490	691,383.67	

ニュージーランド・ドル 小計		490,071		4,095,205.41 (313,406,070)	
ノルウェー・ク ローネ	ADEVINTA ASA-B	20,033	116.650	2,336,849.45	
	AKER BP ASA	9,663	295.200	2,852,517.60	
	DNB BANK ASA	72,099	193.900	13,979,996.10	
	EQUINOR ASA	75,277	236.100	17,772,899.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	15,888	212.000	3,368,256.00	
	MOWI ASA	33,960	206.000	6,995,760.00	
	NORSK HYDRO ASA	102,309	65.860	6,738,070.74	
	ORKLA ASA	58,284	85.720	4,996,104.48	
	SCHIBSTED ASA	5,475	340.400	1,863,690.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	7,648	296.200	2,265,337.60	
	TELENOR ASA	57,756	137.400	7,935,674.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,719	448.700	5,707,015.30	
ノルウェー・クローネ 小計		471,111		76,812,171.37 (964,760,872)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	32,324	12.428	401,722.67	
	ACCOR	13,161	26.420	347,713.62	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,366	21.750	421,210.50	
	ADIDAS AG	14,694	252.700	3,713,173.80	
	ADP	2,734	108.050	295,408.70	
	ADYEN NV	1,524	2,175.000	3,314,700.00	
	AEGON NV	135,933	4.138	562,490.75	
	AENA SME SA	6,237	132.850	828,585.45	
	AGEAS	13,212	44.000	581,328.00	
	AIR LIQUIDE	36,531	152.800	5,581,936.80	
	AIRBUS SE	45,463	104.140	4,734,516.82	
	AKZO NOBEL NV	14,462	94.200	1,362,320.40	
	ALLIANZ SE	31,740	204.700	6,497,178.00	
	ALSTOM RGPT	24,574	29.090	714,857.66	
	AMADEUS IT GROUP SA	34,753	55.660	1,934,351.98	
	AMPLIFON SPA	9,504	44.080	418,936.32	
	AMUNDI SA	4,735	70.250	332,633.75	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	58,872	53.160	3,129,635.52	
	ARCELORMITTAL	51,079	28.690	1,465,456.51	
	ARGENX SE	3,550	276.700	982,285.00	
	ARKEMA	4,665	120.200	560,733.00	
	AROUNDTOWN SA	79,132	5.318	420,823.97	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,581	361.500	1,294,531.50	
	ASML HOLDING NV	31,846	662.000	21,082,052.00	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	84,568	18.495	1,564,085.16	
	ATLANTIA SPA	39,704	17.360	689,261.44	
	AXA SA	148,649	25.380	3,772,711.62	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	510,944	4.997	2,553,187.16	
BANCO SANTANDER SA	1,331,098	2.775	3,693,796.95	
BASF SE	70,845	60.190	4,264,160.55	
BAYER AG	75,844	46.525	3,528,642.10	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,502	86.920	2,216,633.84	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,349	70.900	308,344.10	
BECHTLE AG	6,241	62.000	386,942.00	
BEIERSDORF AG	7,784	89.700	698,224.80	
BIOMERIEUX	3,167	122.100	386,690.70	
BNP PARIBAS	86,404	56.170	4,853,312.68	
BOLLORE	68,335	4.402	300,810.67	
BOUYGUES	17,563	30.720	539,535.36	
BRENTAG SE	11,822	75.920	897,526.24	
BUREAU VERITAS SA	22,878	28.130	643,558.14	
CAIXABANK	335,676	2.283	766,348.30	
CAPGEMINI SA	12,330	204.800	2,525,184.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,077	184.350	567,244.95	
CARREFOUR SA	48,029	15.590	748,772.11	
CELLNEX TELECOM SAU	39,544	48.800	1,929,747.20	
CIE DE SAINT-GOBAIN	39,005	58.560	2,284,132.80	
CNH INDUSTRIAL NV	78,764	15.885	1,251,166.14	
CNP ASSURANCES	13,069	21.660	283,074.54	
COLRUYT NV	3,968	38.180	151,498.24	
COMMERZBANK AG	76,716	6.368	488,527.48	
CONTINENTAL AG	8,464	91.310	772,847.84	
COVESTRO AG	14,757	51.960	766,773.72	
CREDIT AGRICOLE SA	95,064	12.006	1,141,338.38	
CRH PLC	59,934	44.760	2,682,645.84	
DAIMLER AG	65,837	68.750	4,526,293.75	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	32,918	31.400	1,033,625.20	
DANONE	50,392	54.620	2,752,411.04	
DASSAULT AVIATION SA	1,905	91.650	174,593.25	
DASSAULT SYSTEMES SA	51,160	51.730	2,646,506.80	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	40,111	12.650	507,404.15	
DELIVERY HERO SE	12,527	91.600	1,147,473.20	
DEUTSCHE BANK AG	158,943	10.930	1,737,246.99	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,673	142.550	2,091,636.15	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	46,550	5.965	277,670.75	
DEUTSCHE POST AG	77,170	53.700	4,144,029.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG	258,829	16.050	4,154,205.45	
DIASORIN SPA	1,904	158.850	302,450.40	
E.ON SE	173,320	11.776	2,041,016.32	
EDENRED	19,476	39.600	771,249.60	
EDF	36,379	9.926	361,097.95	
EDP RENOVAVEIS SA	21,968	21.600	474,508.80	

EIFFAGE	6,556	85.280	559,095.68	
ELIA GROUP SA/NV	2,461	117.000	287,937.00	
ELISA OYJ	11,197	53.660	600,831.02	
ENAGAS SA	18,972	19.880	377,163.36	
ENDESA SA	24,446	19.665	480,730.59	
ENEL SPA	626,994	6.746	4,229,701.52	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	214,285	4.740	1,015,710.90	
ENGIE	140,979	12.958	1,826,805.88	
ENI -ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	193,581	12.052	2,333,038.21	
ERSTE GROUP BANK AG	26,508	39.230	1,039,908.84	
ESSILORLUXOTTICA	22,143	180.360	3,993,711.48	
EURAZEO	3,055	73.350	224,084.25	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,285	106.480	1,095,146.80	
EURONEXT NV	6,591	88.250	581,655.75	
EVONIK INDUSTRIES AG	16,015	28.010	448,580.15	
EXOR NV	8,329	77.100	642,165.90	
FAURECIA	9,039	39.150	353,876.85	
FERRARI NV	9,721	227.300	2,209,583.30	
FERROVIAL S.A.	38,052	25.690	977,555.88	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	156,446	16.414	2,567,904.64	
FINECOBANK SPA	46,619	15.180	707,676.42	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	12,757	131.500	1,677,545.50	
FORTUM OYJ	34,287	26.840	920,263.08	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	15,811	54.340	859,169.74	
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,224	34.545	1,113,178.08	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	5,266	39.140	206,111.24	
GALP ENERGIA SGPS SA	39,123	8.416	329,259.16	
GEA GROUP AG	11,685	46.150	539,262.75	
GETLINK SE - REGR	38,842	13.575	527,280.15	
GRIFOLS SA	23,071	16.500	380,671.50	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,749	95.500	835,529.50	
HANNOVER RUECK SE	4,632	165.600	767,059.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,537	58.960	680,221.52	
HEINEKEN HOLDING NV	8,984	80.000	718,720.00	
HEINEKEN NV	20,031	97.440	1,951,820.64	
HELLOFRESH SE	12,680	68.600	869,848.00	
HENKEL AG & CO KGAA	8,101	67.750	548,842.75	
HENKEL KGAA-VORZUG	13,684	70.640	966,637.76	
HERMES INTERNATIONAL	2,440	1,525.000	3,721,000.00	
IBERDROLA SA	440,972	9.748	4,298,595.05	
IMCD NV	4,345	188.250	817,946.25	
INDITEX SA	83,876	27.810	2,332,591.56	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	100,708	38.905	3,918,044.74	

INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	27,446	10.445	286,673.47	
ING GROEP NV-CVA	300,198	11.924	3,579,560.95	
INPOST SA	16,599	9.705	161,093.29	
INTESA SANPAOLO	1,271,192	2.205	2,802,978.36	
IPSEN	2,847	85.860	244,443.42	
JDE PEET'S BV	7,986	26.210	209,313.06	
JERONIMO MARTINS	21,321	20.160	429,831.36	
JUST EAT TAKEAWAY	13,977	47.850	668,799.45	
KBC GROEP NV	19,165	72.940	1,397,895.10	
KERING	5,782	689.800	3,988,423.60	
KERRY GROUP PLC-A	12,244	114.000	1,395,816.00	
KESKO OYJ-B SHS	20,665	29.560	610,857.40	
KINGSPAN GROUP PLC	11,823	98.160	1,160,545.68	
KION GROUP AG	5,542	94.480	523,608.16	
KNORR-BREMSE AG	5,667	87.340	494,955.78	
KONE OYJ	26,240	61.880	1,623,731.20	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	79,932	30.010	2,398,759.32	
KONINKLIJKE DSM NV	13,449	193.000	2,595,657.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	70,592	31.355	2,213,412.16	
L'OREAL SA	19,312	413.050	7,976,821.60	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	7,173	37.300	267,552.90	
LANXESS	6,364	52.780	335,891.92	
LEG IMMOBILIEN SE	5,634	123.150	693,827.10	
LEGRAND SA	20,638	100.450	2,073,087.10	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,397	699.000	14,956,503.00	
MEDIOBANCA SPA	47,670	10.035	478,368.45	
MERCK KGAA	9,930	219.800	2,182,614.00	
MICHELIN (C.G.D.E.)	13,029	138.400	1,803,213.60	
MONCLER SPA	15,787	63.220	998,054.14	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,114	169.400	696,911.60	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	10,765	258.000	2,777,370.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,969	26.850	401,917.65	
NEMETSCHEK SE	4,382	107.850	472,598.70	
NESTE OYJ	32,388	43.400	1,405,639.20	
NEXI SPA	36,164	13.955	504,668.62	
NN GROUP NV	20,548	46.120	947,673.76	
NOKIA OYJ	414,330	5.397	2,236,139.01	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	5,180	97.400	504,532.00	
OMV AG	11,086	49.450	548,202.70	
ORANGE S.A.	156,801	9.305	1,459,033.30	
ORION OYJ-CLASS B	8,067	35.680	287,830.56	
ORPEA	4,050	86.640	350,892.00	

PERNOD-RICARD	16,134	209.500	3,380,073.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	11,647	84.020	978,580.94	
POSTE ITALIANE SPA	42,559	11.225	477,724.77	
PROSUS	71,978	69.420	4,996,712.76	
PROXIMUS	12,400	17.715	219,666.00	
PRYSMIAN SPA	19,558	31.570	617,446.06	
PUBLICIS GROUPE	17,469	56.860	993,287.34	
PUMA AG	8,162	103.050	841,094.10	
QIAGEN NV	17,624	48.710	858,465.04	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	11,037	25.500	281,443.50	
RANDSTAD NV	9,130	57.020	520,592.60	
RATIONAL AG	393	869.000	341,517.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	7,991	55.520	443,660.32	
RED ELECTRICA DE ESPANA	33,135	18.750	621,281.25	
REMY COINTREAU	1,733	209.600	363,236.80	
RENAULT SA	14,816	29.120	431,441.92	
REPSOL SA	111,038	9.943	1,104,050.83	
ROYAL KPN NV	265,159	2.691	713,542.86	
RWE AG	49,318	34.940	1,723,170.92	
SAFRAN SA	26,336	101.240	2,666,256.64	
SAMPO OYJ	38,340	43.560	1,670,090.40	
SANOFI	87,633	86.890	7,614,431.37	
SAP SE	80,444	123.520	9,936,442.88	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,014	566.000	1,139,924.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,125	456.000	969,000.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,629	165.680	6,897,092.72	
SCOUT24 SE	6,719	60.780	408,380.82	
SEB SA	2,141	137.600	294,601.60	
SIEMENS AG	58,952	147.900	8,719,000.80	
SIEMENS ENERGY AG	30,805	22.430	690,956.15	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	18,399	20.750	381,779.25	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,674	63.960	1,386,269.04	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	18,875	46.840	884,105.00	
SNAM SPA	154,161	5.166	796,395.72	
SOCIETE GENERALE	61,948	28.670	1,776,049.16	
SODEXO	6,779	74.280	503,544.12	
SOFINA	1,153	429.800	495,559.40	
SOLVAY SA	5,750	98.920	568,790.00	
STMICROELECTRONICS NV	52,556	41.370	2,174,241.72	
STORA ENSO OYJ	44,463	15.540	690,955.02	
SUEZ	27,266	19.805	540,003.13	
SYMRISE AG	9,921	128.900	1,278,816.90	
TELECOM ITALIA SPA	772,551	0.439	339,149.88	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	84,907	2.460	208,871.22	

	TELEFONICA SA	394,342	3.855	1,520,188.41	
	TELEFONICA SA-RTS	388,247	0.147	57,072.30	
	TELEPERFORMANCE	4,525	373.600	1,690,540.00	
	TENARIS SA	35,190	9.028	317,695.32	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	108,635	7.016	762,183.16	
	THALES SA	8,169	72.540	592,579.26	
	TOTALENERGIES SE	193,207	43.660	8,435,417.62	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	7,172	42.230	302,873.56	
	UCB SA	9,727	97.720	950,522.44	
	UMICORE	15,161	35.500	538,215.50	
	UNICREDIT SPA	163,383	13.122	2,143,911.72	
	UNIPER SE	7,130	40.910	291,688.30	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,622	35.200	268,294.40	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	55,985	24.805	1,388,707.92	
	UPM-KYMMENE OYJ	40,946	32.150	1,316,413.90	
	VALEO SA	17,719	26.000	460,694.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,538	31.540	1,593,968.52	
	VINCI SA	41,621	86.620	3,605,211.02	
	VIVENDI SA	58,639	11.285	661,741.11	
	VOESTALPINE AG	8,778	31.700	278,262.60	
	VOLKSWAGEN AG	2,540	265.000	673,100.00	
	VOLKSWAGEN AG	14,314	176.020	2,519,550.28	
	VONOVIA SE	57,013	48.900	2,787,935.70	
	WARTSILA OYJ	36,314	11.595	421,060.83	
	WENDEL	2,158	100.600	217,094.80	
	WOLTERS KLUWER NV	20,623	100.950	2,081,891.85	
	WORLDLINE SA	18,469	49.120	907,197.28	
	ZALANDO SE	17,140	69.800	1,196,372.00	
	ユーロ 小計	14,594,481		375,374,965.58 (47,972,920,601)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	933,475	79.650	74,351,283.75	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	288,539	24.900	7,184,621.10	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	133,800	21.350	2,856,630.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	153,200	13.740	2,104,968.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	154,909	47.250	7,319,450.25	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,909	49.850	10,414,113.65	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	53,000	47.250	2,504,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	128,143	77.000	9,867,011.00	
	ESR CAYMAN LTD	155,000	27.350	4,239,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	168,810	39.100	6,600,471.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	159,157	15.540	2,473,299.78	

HANG SENG BANK LTD	59,712	143.800	8,586,585.60	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,641	32.550	3,764,114.55	
HONG KONG & CHINA GAS	876,437	11.900	10,429,600.30	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	92,811	453.000	42,043,383.00	
MTR CORP	132,255	40.800	5,396,004.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	123,917	30.100	3,729,901.70	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	108,587	48.400	5,255,610.80	
SANDS CHINA LTD	190,980	16.560	3,162,628.80	
SINO LAND CO	260,000	9.410	2,446,600.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	112,000	30.050	3,365,600.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	101,523	93.600	9,502,552.80	
SWIRE PACIFIC LTD	39,866	43.450	1,732,177.70	
SWIRE PROPERTIES LTD	95,000	19.160	1,820,200.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	106,000	156.400	16,578,400.00	
WH GROUP LTD	640,000	4.880	3,123,200.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	129,733	39.850	5,169,860.05	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	140,000	18.900	2,646,000.00	
香港・ドル 小計	5,861,404		258,667,767.83 (3,766,202,700)	
合計	83,781,267		484,454,379,913 (484,454,379,913)	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2021年12月20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	40,394.00	605,506.06	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,143.00	2,399,867.91	
		AMERICAN TOWER REIT INC	35,086.00	9,784,081.96	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	111,147.00	881,395.71	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,709.00	2,618,671.77	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,443.00	1,306,790.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,640.00	1,311,100.40	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	33,333.00	6,711,266.22	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,773.00	3,734,940.42	
		DUKE REALTY CORP	28,961.00	1,798,188.49	
		EQUINIX INC	6,915.00	5,685,927.90	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,369.00	1,121,659.10	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,323.00	2,394,860.95	



	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,990.00	1,705,382.40	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,248.00	2,204,857.20	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41,381.00	1,445,024.52	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	55,228.00	867,631.88	
	INVITATION HOMES INC	44,184.00	1,895,493.60	
	IRON MOUNTAIN INC	22,273.00	1,141,491.25	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	46,102.00	1,026,691.54	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,846.00	1,947,358.44	
	PROLOGIS INC	56,923.00	9,174,849.14	
	PUBLIC STORAGE	12,102.00	4,377,777.48	
	REALTY INCOME CORP	42,265.00	2,864,721.70	
	REGENCY CENTERS CORP	11,640.00	832,842.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,444.00	3,173,930.72	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,302.00	3,813,770.46	
	SUN COMMUNITIES INC	8,890.00	1,760,931.20	
	UDR INC	22,797.00	1,321,314.12	
	VENTAS INC	30,265.00	1,498,117.50	
	VICI PROPERTIES INC	47,386.00	1,308,801.32	
	VORNADO REALTY TRUST	12,610.00	514,109.70	
	WELLTOWER INC	32,552.00	2,708,326.40	
	WP CAREY INC	14,143.00	1,132,571.44	
アメリカ・ドル	小計	917,807.00	87,070,251.50 (9,892,921,977)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	68,195.00	353,932.05	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	54,483.00	409,276.29	
	SEGRO PLC	91,783.00	1,270,735.63	
イギリス・ポンド	小計	214,461.00	2,033,943.97 (305,905,173)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	92,582.00	1,033,215.12	
	GOODMAN GROUP	132,718.00	3,485,174.68	
	GPT GROUP	161,116.00	852,303.64	
	MIRVAC GROUP	330,591.00	965,325.72	
	SCENTRE GROUP	416,063.00	1,277,313.41	
	STOCKLAND	195,812.00	869,405.28	
	VICINITY CENTRES	325,099.00	557,544.78	
オーストラリア・ドル	小計	1,653,981.00	9,040,282.63 (731,630,073)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,556.00	383,853.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	12,139.00	273,248.89	
カナダ・ドル	小計	18,695.00	657,102.69 (57,943,315)	

シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	260,100.00	759,492.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	378,090.00	748,618.20	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	164,800.00	331,248.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	233,700.00	434,682.00	
シンガポール・ドル 小計		1,036,690.00	2,274,040.20 (189,109,183)	
ユーロ	COVIVIO	3,965.00	276,994.90	
	GECINA SA	3,507.00	422,768.85	
	KLEPIERRE	15,570.00	305,639.10	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	9,606.00	555,995.28	
ユーロ 小計		32,648.00	1,561,398.13 (199,546,681)	
香港・ドル	LINK REIT	161,971.00	10,811,564.25	
香港・ドル 小計		161,971.00	10,811,564.25 (157,416,375)	
投資証券 合計		4,036,253	11,534,472,777 (11,534,472,777)	
合計			11,534,472,777 (11,534,472,777)	

(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 608銘柄	70.19	-	74.01
	投資証券 34銘柄	-	1.94	
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	4.13	-	4.30
	投資証券 3銘柄	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	1.82	-	2.01
	投資証券 7銘柄	-	0.14	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.32	-	3.42
	投資証券 2銘柄	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.26	-	0.31
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
スイス・フラン	株式 41銘柄	3.03	-	3.11
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.12	-	1.15
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.79	-	0.81
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.06	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.19	-	0.19
ユーロ	株式 229銘柄	9.43	-	9.71
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式 28銘柄	0.74	-	0.79
	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。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2021年12月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	5,193,132
コール・ローン	477,430,937
国債証券	59,796,045,320
地方債証券	4,892,053,639
特殊債券	7,571,118,444
社債券	5,099,330,200
未収利息	109,738,809
前払費用	1,751,866
流動資産合計	77,952,662,347
資産合計	77,952,662,347
負債の部	
流動負債	
未払解約金	27,970,215
その他未払費用	554
流動負債合計	27,970,769
負債合計	27,970,769
純資産の部	
元本等	
元本	79,006,185,912
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,081,494,334
元本等合計	77,924,691,578
純資産合計	77,924,691,578
負債純資産合計	77,952,662,347

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	81,342,544,413円
同期中追加設定元本額	12,367,271,158円
同期中一部解約元本額	14,703,629,659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）	65,293,984,652円
DCニッセイ日本債券インデックス	3,298,892,665円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	97,584,998円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	5,274,423,229円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	197,115,513円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	873,270,194円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,853,785,329円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）	197,628,800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）	22,027,372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）	65,820,055円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	56,873,220円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	43,265,409円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	66,100,628円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	229,945,604円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	1,434,451,358円
FWニッセイ国内債インデックス	1,016,886円
計	79,006,185,912円
2. 受益権の総数	79,006,185,912口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,081,494,334円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		188,651,650
地方債証券		9,363,567
特殊債券		14,545,267
社債券		20,700,900
合計		144,041,916

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年3月11日から2021年12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2021年12月20日現在	
1口当たり純資産額	0.9863円
（1万口当たり純資産額）	（9,863円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第420回 利付国債（2年）	181,000,000	181,409,060	
	第421回 利付国債（2年）	184,000,000	184,450,800	
	第422回 利付国債（2年）	77,000,000	77,201,740	
	第424回 利付国債（2年）	150,000,000	150,255,000	
	第425回 利付国債（2年）	272,000,000	272,470,560	
	第426回 利付国債（2年）	413,000,000	413,788,830	
	第427回 利付国債（2年）	416,000,000	416,836,160	
	第428回 利付国債（2年）	599,000,000	600,269,880	
	第429回 利付国債（2年）	600,000,000	601,332,000	
	第430回 利付国債（2年）	500,000,000	501,165,000	
	第135回 利付国債（5年）	104,000,000	104,277,680	
	第137回 利付国債（5年）	37,000,000	37,142,450	
	第138回 利付国債（5年）	81,000,000	81,364,500	
	第139回 利付国債（5年）	70,000,000	70,354,200	
	第140回 利付国債（5年）	259,000,000	260,424,500	
	第141回 利付国債（5年）	377,000,000	379,284,620	
	第142回 利付国債（5年）	160,000,000	161,081,600	

第143回 利付国債(5年)	50,000,000	50,366,000	
第144回 利付国債(5年)	512,000,000	516,131,840	
第145回 利付国債(5年)	30,000,000	30,248,400	
第146回 利付国債(5年)	30,000,000	30,258,900	
第1回 利付国債(40年)	90,000,000	129,671,100	
第2回 利付国債(40年)	113,000,000	157,924,280	
第3回 利付国債(40年)	113,000,000	158,968,400	
第4回 利付国債(40年)	153,000,000	216,323,640	
第5回 利付国債(40年)	158,000,000	216,004,960	
第6回 利付国債(40年)	164,000,000	221,258,960	
第7回 利付国債(40年)	176,000,000	228,923,200	
第8回 利付国債(40年)	167,000,000	203,462,780	
第9回 利付国債(40年)	330,000,000	303,072,000	
第10回 利付国債(40年)	292,000,000	313,380,240	
第11回 利付国債(40年)	247,000,000	257,112,180	
第12回 利付国債(40年)	2,000,000	1,884,600	
第13回 利付国債(40年)	170,000,000	159,742,200	
第14回 利付国債(40年)	105,000,000	105,161,700	
第328回 利付国債(10年)	345,000,000	348,070,500	
第329回 利付国債(10年)	184,000,000	186,522,640	
第330回 利付国債(10年)	3,000,000	3,048,060	
第332回 利付国債(10年)	138,000,000	139,988,580	
第333回 利付国債(10年)	92,000,000	93,489,480	
第334回 利付国債(10年)	496,000,000	504,937,920	
第335回 利付国債(10年)	385,000,000	391,579,650	
第336回 利付国債(10年)	185,000,000	188,478,000	
第337回 利付国債(10年)	310,000,000	313,961,800	
第338回 利付国債(10年)	585,000,000	594,997,650	
第339回 利付国債(10年)	536,000,000	545,878,480	
第340回 利付国債(10年)	566,000,000	577,184,160	
第341回 利付国債(10年)	552,000,000	561,306,720	
第342回 利付国債(10年)	510,000,000	514,783,800	
第343回 利付国債(10年)	461,000,000	465,476,310	
第344回 利付国債(10年)	533,000,000	538,340,660	



第345回 利付国債(10年)	532,000,000	537,745,600	
第346回 利付国債(10年)	523,000,000	528,789,610	
第347回 利付国債(10年)	433,000,000	438,027,130	
第348回 利付国債(10年)	499,000,000	505,207,560	
第349回 利付国債(10年)	570,000,000	577,398,600	
第350回 利付国債(10年)	744,000,000	753,820,800	
第351回 利付国債(10年)	570,000,000	577,826,100	
第352回 利付国債(10年)	556,000,000	563,934,120	
第353回 利付国債(10年)	543,000,000	551,036,400	
第354回 利付国債(10年)	518,000,000	526,132,600	
第355回 利付国債(10年)	422,000,000	428,532,560	
第356回 利付国債(10年)	418,000,000	424,361,960	
第357回 利付国債(10年)	429,000,000	435,387,810	
第358回 利付国債(10年)	525,000,000	532,397,250	
第359回 利付国債(10年)	337,000,000	341,458,510	
第360回 利付国債(10年)	293,000,000	296,600,970	
第361回 利付国債(10年)	457,000,000	461,940,170	
第362回 利付国債(10年)	354,000,000	357,270,960	
第363回 利付国債(10年)	643,000,000	647,873,940	
第364回 利付国債(10年)	136,000,000	136,858,160	
第1回 利付国債(30年)	10,000,000	12,245,300	
第2回 利付国債(30年)	82,000,000	98,677,160	
第3回 利付国債(30年)	123,000,000	147,538,500	
第4回 利付国債(30年)	79,000,000	99,645,860	
第5回 利付国債(30年)	104,000,000	125,413,600	
第6回 利付国債(30年)	78,000,000	96,179,460	
第7回 利付国債(30年)	39,000,000	48,013,680	
第8回 利付国債(30年)	21,000,000	24,896,760	
第9回 利付国債(30年)	12,000,000	13,711,800	
第10回 利付国債(30年)	21,000,000	23,321,970	
第11回 利付国債(30年)	30,000,000	35,415,000	

第12回	利付国債(30年)	32,000,000	39,339,840	
第13回	利付国債(30年)	39,000,000	47,615,100	
第14回	利付国債(30年)	59,000,000	75,095,790	
第15回	利付国債(30年)	76,000,000	97,967,040	
第16回	利付国債(30年)	53,000,000	68,579,350	
第17回	利付国債(30年)	75,000,000	96,390,000	
第18回	利付国債(30年)	88,000,000	112,277,440	
第19回	利付国債(30年)	67,000,000	85,771,390	
第20回	利付国債(30年)	75,000,000	98,343,750	
第21回	利付国債(30年)	66,000,000	84,987,540	
第22回	利付国債(30年)	79,000,000	104,163,870	
第23回	利付国債(30年)	85,000,000	112,460,950	
第24回	利付国債(30年)	70,000,000	92,864,100	
第25回	利付国債(30年)	78,000,000	101,480,340	
第26回	利付国債(30年)	154,000,000	203,065,940	
第27回	利付国債(30年)	148,000,000	198,303,720	
第28回	利付国債(30年)	194,000,000	261,118,180	
第29回	利付国債(30年)	208,000,000	277,875,520	
第30回	利付国債(30年)	219,000,000	290,334,870	
第31回	利付国債(30年)	215,000,000	282,406,800	
第32回	利付国債(30年)	268,000,000	357,924,720	
第33回	利付国債(30年)	299,000,000	384,780,110	
第34回	利付国債(30年)	276,000,000	366,078,120	
第35回	利付国債(30年)	304,000,000	393,379,040	
第36回	利付国債(30年)	287,000,000	372,646,540	
第37回	利付国債(30年)	311,000,000	399,224,480	
第38回	利付国債(30年)	207,000,000	262,457,370	
第39回	利付国債(30年)	192,000,000	247,779,840	
第40回	利付国債(30年)	165,000,000	209,955,900	
第41回	利付国債(30年)	147,000,000	184,146,900	
第42回	利付国債(30年)	151,000,000	189,355,510	
第43回	利付国債(30年)	143,000,000	179,513,620	
第44回	利付国債(30年)	146,000,000	183,469,440	
第45回	利付国債(30年)	191,000,000	232,068,820	
第46回	利付国債(30年)	226,000,000	274,777,580	
第47回	利付国債(30年)	206,000,000	255,252,540	
第48回	利付国債(30年)	216,000,000	258,361,920	
第49回	利付国債(30年)	231,000,000	276,433,080	
第50回	利付国債(30年)	217,000,000	230,080,760	
第51回	利付国債(30年)	220,000,000	207,902,200	
第52回	利付国債(30年)	228,000,000	225,514,800	
第53回	利付国債(30年)	207,000,000	209,272,860	
第54回	利付国債(30年)	216,000,000	228,221,280	
第55回	利付国債(30年)	204,000,000	215,403,600	
第56回	利付国債(30年)	208,000,000	219,232,000	
第57回	利付国債(30年)	211,000,000	222,237,860	
第58回	利付国債(30年)	261,000,000	274,389,300	
第59回	利付国債(30年)	203,000,000	208,355,140	
第60回	利付国債(30年)	184,000,000	197,404,400	
第61回	利付国債(30年)	182,000,000	186,011,280	

第62回 利付国債(30年)	179,000,000	173,588,830	
第63回 利付国債(30年)	192,000,000	181,013,760	
第64回 利付国債(30年)	196,000,000	184,479,120	
第65回 利付国債(30年)	170,000,000	159,743,900	
第66回 利付国債(30年)	175,000,000	164,559,500	
第67回 利付国債(30年)	222,000,000	219,593,520	
第68回 利付国債(30年)	225,000,000	222,813,000	
第69回 利付国債(30年)	219,000,000	222,484,290	
第70回 利付国債(30年)	213,000,000	215,881,890	
第71回 利付国債(30年)	217,000,000	219,955,540	
第72回 利付国債(30年)	150,000,000	151,869,000	
第61回 利付国債(20年)	112,000,000	113,554,560	
第62回 利付国債(20年)	175,000,000	177,399,250	
第70回 利付国債(20年)	259,000,000	275,304,050	
第71回 利付国債(20年)	52,000,000	55,012,880	
第72回 利付国債(20年)	149,000,000	158,096,450	
第73回 利付国債(20年)	102,000,000	108,504,540	
第74回 利付国債(20年)	66,000,000	70,406,820	
第75回 利付国債(20年)	83,000,000	89,000,070	
第76回 利付国債(20年)	115,000,000	122,564,700	
第77回 利付国債(20年)	86,000,000	91,936,580	
第78回 利付国債(20年)	93,000,000	99,594,630	
第79回 利付国債(20年)	78,000,000	83,804,760	
第80回 利付国債(20年)	92,000,000	99,169,560	
第81回 利付国債(20年)	101,000,000	109,040,610	
第82回 利付国債(20年)	132,000,000	143,004,840	
第83回 利付国債(20年)	111,000,000	120,872,340	
第84回 利付国債(20年)	202,000,000	219,155,860	
第85回 利付国債(20年)	136,000,000	148,846,560	
第86回 利付国債(20年)	145,000,000	159,933,550	
第87回 利付国債(20年)	122,000,000	134,043,840	
第88回 利付国債(20年)	249,000,000	276,111,120	
第89回 利付国債(20年)	189,000,000	208,725,930	
第90回 利付国債(20年)	260,000,000	288,665,000	
第91回 利付国債(20年)	185,000,000	206,278,700	
第92回 利付国債(20年)	336,000,000	373,309,440	
第93回 利付国債(20年)	219,000,000	243,370,320	
第94回 利付国債(20年)	267,000,000	298,121,520	
第95回 利付国債(20年)	229,000,000	259,514,250	
第96回 利付国債(20年)	134,000,000	150,373,460	
第97回 利付国債(20年)	196,000,000	222,189,520	
第98回 利付国債(20年)	166,000,000	187,219,780	
第99回 利付国債(20年)	303,000,000	343,423,230	
第100回 利付国債(20年)	252,000,000	288,507,240	
第101回 利付国債(20年)	175,000,000	202,552,000	
第102回 利付国債(20年)	182,000,000	211,817,060	

第103回 利付国債(20年)	131,000,000	151,604,990	
第104回 利付国債(20年)	104,000,000	118,997,840	
第105回 利付国債(20年)	88,000,000	101,186,800	
第106回 利付国債(20年)	64,000,000	74,025,600	
第107回 利付国債(20年)	85,000,000	98,211,550	
第108回 利付国債(20年)	99,000,000	112,991,670	
第109回 利付国債(20年)	79,000,000	90,594,830	
第110回 利付国債(20年)	191,000,000	221,821,670	
第111回 利付国債(20年)	137,000,000	160,796,900	
第112回 利付国債(20年)	197,000,000	229,731,550	
第113回 利付国債(20年)	333,000,000	389,899,710	
第114回 利付国債(20年)	200,000,000	235,186,000	
第115回 利付国債(20年)	138,000,000	163,389,240	
第116回 利付国債(20年)	160,000,000	190,115,200	
第117回 利付国債(20年)	238,000,000	280,820,960	
第118回 利付国債(20年)	155,000,000	182,188,550	
第119回 利付国債(20年)	140,000,000	162,166,200	
第120回 利付国債(20年)	145,000,000	165,482,700	
第121回 利付国債(20年)	221,000,000	258,636,300	
第122回 利付国債(20年)	160,000,000	185,843,200	
第123回 利付国債(20年)	257,000,000	306,107,560	
第124回 利付国債(20年)	170,000,000	200,951,900	
第125回 利付国債(20年)	193,000,000	232,248,480	
第126回 利付国債(20年)	179,000,000	212,091,730	
第127回 利付国債(20年)	189,000,000	222,194,070	

第128回 利付国債(20年)	253,000,000	298,221,220	
第129回 利付国債(20年)	169,000,000	197,604,940	
第130回 利付国債(20年)	250,000,000	293,007,500	
第131回 利付国債(20年)	164,000,000	190,618,840	
第132回 利付国債(20年)	95,000,000	110,647,450	
第133回 利付国債(20年)	156,000,000	183,246,960	
第134回 利付国債(20年)	164,000,000	193,052,600	
第135回 利付国債(20年)	114,000,000	133,034,580	
第136回 利付国債(20年)	118,000,000	136,501,220	
第137回 利付国債(20年)	35,000,000	40,944,050	
第138回 利付国債(20年)	39,000,000	44,810,610	
第139回 利付国債(20年)	42,000,000	48,695,220	
第140回 利付国債(20年)	104,000,000	121,953,520	
第141回 利付国債(20年)	163,000,000	191,577,160	
第142回 利付国債(20年)	95,000,000	112,689,950	
第143回 利付国債(20年)	160,000,000	186,684,800	
第144回 利付国債(20年)	98,000,000	113,254,680	
第145回 利付国債(20年)	255,000,000	301,027,500	
第146回 利付国債(20年)	243,000,000	287,476,290	
第147回 利付国債(20年)	266,000,000	312,190,900	
第148回 利付国債(20年)	235,000,000	273,469,500	
第149回 利付国債(20年)	254,000,000	296,059,860	
第150回 利付国債(20年)	274,000,000	316,445,340	
第151回 利付国債(20年)	267,000,000	301,968,990	
第152回 利付国債(20年)	299,000,000	338,450,060	

第153回 利付国債(20年)	302,000,000	346,336,620	
第154回 利付国債(20年)	280,000,000	317,674,000	
第155回 利付国債(20年)	291,000,000	322,477,470	
第156回 利付国債(20年)	241,000,000	246,820,150	
第157回 利付国債(20年)	247,000,000	245,787,230	
第158回 利付国債(20年)	268,000,000	277,924,040	
第159回 利付国債(20年)	245,000,000	257,394,550	
第160回 利付国債(20年)	208,000,000	221,418,080	
第161回 利付国債(20年)	222,000,000	232,722,600	
第162回 利付国債(20年)	212,000,000	222,063,640	
第163回 利付国債(20年)	275,000,000	287,812,250	
第164回 利付国債(20年)	334,000,000	343,812,920	
第165回 利付国債(20年)	274,000,000	281,726,800	
第166回 利付国債(20年)	262,000,000	277,604,720	
第167回 利付国債(20年)	281,000,000	288,221,700	
第168回 利付国債(20年)	245,000,000	246,991,850	
第169回 利付国債(20年)	273,000,000	270,081,630	
第170回 利付国債(20年)	245,000,000	241,939,950	
第171回 利付国債(20年)	257,000,000	253,322,330	
第172回 利付国債(20年)	243,000,000	243,413,100	
第173回 利付国債(20年)	309,000,000	309,000,000	
第174回 利付国債(20年)	308,000,000	307,461,000	
第175回 利付国債(20年)	287,000,000	291,038,090	
第176回 利付国債(20年)	292,000,000	295,632,480	
第177回 利付国債(20年)	270,000,000	268,299,000	

	第178回 利付国債(20年)	180,000,000	181,962,000	
国債証券 合計		55,078,000,000	59,796,045,320	
地方債証券	第730回 東京都公募公債	300,000,000	304,367,100	
	第34回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,981,200	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	304,189,800	
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,783,600	
	第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	145,896,336	
	第448回 大阪府公募公債(10年)	38,000,000	37,865,252	
	第455回 大阪府公募公債(10年)	180,000,000	180,747,180	
	第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	114,784,300	
	平成29年度第5回 京都府公募公債(20年)	100,000,000	104,386,500	
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	115,550,600	
	平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	107,265,900	
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,451,400	
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	120,708,721	
	平成20年度第1回 福岡県公募公債	100,000,000	114,937,300	
	平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	115,552,800	
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	303,773,700	
	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,905,400	
	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,754,400	
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	151,757,250	
	第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	100,567,000	
	第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	129,399,900	
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	319,154,400	
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	101,455,700	
	第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,379,200	
	第26回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,430,200	
	第9回 川崎市公募公債(20年)	100,000,000	117,652,100	

	第4回 川崎市公募公債(30年)	100,000,000	130,639,500	
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	152,152,800	
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	151,991,100	
	平成30年度第5回 広島市公募公債	200,000,000	202,458,400	
	平成29年度第1回 仙台市公募公債(20年)	100,000,000	104,114,600	
地方債証券	合計	4,631,000,000	4,892,053,639	
特殊債券	第9回 新関西国際空港	300,000,000	323,473,200	
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	310,044,300	
	第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,725,400	
	第115回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,274,200	
	第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,962,000	
	第205回 政保道路機構債券	100,000,000	115,864,100	
	第212回 政保道路機構債券	100,000,000	115,678,500	
	第218回 政保道路機構債券	500,000,000	508,462,000	
	第233回 政府道路機構債券	100,000,000	113,854,100	
	第249回 政保道路機構債券	179,000,000	182,247,418	
	第278回 政保道路機構債券	100,000,000	99,292,900	
	第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,279,200	
	第316回 政保道路機構債券	100,000,000	103,682,900	
	第17回 地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	233,793,400	
	第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	404,604,400	
	第1回 地方公共団体金融機構債券(30年)	100,000,000	127,214,600	
	第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,650,600	
	第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	103,171,495	
	第120回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,105,900	
	第136回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,230,200	
	第16回 公営企業債券	200,000,000	216,709,600	
	第97回 都市再生債券	100,000,000	107,407,900	
	第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	200,610,200	
	第59回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,766,000	
	第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,011,611,000	



第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,710,500	
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,693,000	23,970,615	
第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,294,000	60,450,899	
第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,704,000	71,739,158	
第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	58,938,000	62,055,820	
第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,790,000	70,396,660	
第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,140,000	77,206,584	
第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,674,000	37,500,508	
第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	307,352,000	322,535,188	
第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	192,265,000	200,782,339	
第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	124,860,000	131,427,636	
第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	109,542,000	113,989,405	
第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	221,379,000	222,441,619	
い第845号 利付商工債券	200,000,000	200,715,600	
い第822号 利付農林債券	100,000,000	100,141,700	
第344回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,158,300	
第353回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,131,400	
第116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,049,000	
特殊債券 合計	7,219,631,000	7,571,118,444	
社債券			
第26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	300,000,000	301,215,900	
第13回 クレディ・アグリコル	100,000,000	100,141,800	
第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	202,094,800	
第25回 首都高速道路債券	400,000,000	400,043,600	
第56回 中日本高速道路債券	200,000,000	202,971,000	
第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	101,537,600	
第20回 西日本高速道路債券	100,000,000	101,303,900	
第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,955,200	
第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,931,800	
第14回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,806,900	
第5回 電通グループ	400,000,000	403,206,800	

第24回 豊田自動織機	100,000,000	101,101,900	
第1回 オリックス銀行	200,000,000	200,808,400	
第1回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	101,336,300	
第29回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	107,419,200	
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	101,436,500	
第8回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	100,000,000	105,886,800	
第18回 NTTファイナンス	100,000,000	101,425,900	
第96回 トヨタファイナンス	100,000,000	99,911,300	
第6回 三井住友海上火災保険	100,000,000	100,130,200	
第66回 三井不動産	100,000,000	100,723,800	
第7回 野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	230,784,800	
第77回 東京急行電鉄	100,000,000	101,390,100	
第27回 KDDI	200,000,000	201,323,400	
第510回 関西電力	100,000,000	101,629,300	
第381回 中国電力	200,000,000	204,087,000	
第304回 北陸電力	100,000,000	101,698,500	
第306回 北陸電力	100,000,000	101,923,800	
第253回 四国電力	200,000,000	202,821,000	
第429回 九州電力	200,000,000	204,528,000	
第331回 北海道電力	100,000,000	101,009,700	
第13回 電源開発	100,000,000	106,745,000	
社債券 合計	5,000,000,000	5,099,330,200	
合計		77,358,547,603	

## 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。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2021年12月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	110,605,234
金銭信託	1,127,532
コール・ローン	103,659,727
国債証券	46,726,608,527
派生商品評価勘定	26,137
未収利息	236,789,974
前払費用	18,156,127
流動資産合計	47,196,973,258
資産合計	
47,196,973,258	
負債の部	
流動負債	
未払金	58,408,269
未払解約金	51,306,441
その他未払費用	185
流動負債合計	109,714,895
負債合計	
109,714,895	
純資産の部	
元本等	
元本	31,033,769,786
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,053,488,577
元本等合計	47,087,258,363
純資産合計	
47,087,258,363	
負債純資産合計	
47,196,973,258	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,241,498,035円
同期中追加設定元本額	12,239,972,651円
同期中一部解約元本額	4,447,700,900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)	3,003,582,947円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,047,338,574円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,867,684,369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)	799,734,260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)	3,610,896円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	9,520,597円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	7,323,399円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	12,762,033,190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)	2,867,294,740円
DCニッセイ外国債券インデックス	1,840,804,724円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	132,235,489円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,430,554,799円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	163,448,457円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	352,112,240円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	76,082,880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)	129,447,324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)	14,341,291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)	37,029,103円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	89,023,235円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	67,696,561円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	152,887,960円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	179,323,768円
FWニッセイ外国債券インデックス	658,983円
計	31,033,769,786円
2. 受益権の総数	31,033,769,786口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		145,548,517
合計		145,548,517

（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2021年12月20日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2021年12月20日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	34,753,952	-	34,780,089	26,137	
	34,753,952	-	34,780,089	26,137	
合計	34,753,952	-	34,780,089	26,137	

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5173円 (15,173円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2021年12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	153,416.40	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	151,321.20	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	229,518.70	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	119,976.00	
		US TREASURY N/B	430,000.00	496,465.10	
		US TREASURY N/B	160,000.00	223,761.60	
		US TREASURY N/B	3,580,000.00	3,646,122.60	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,796,132.90	
		US TREASURY N/B	580,000.00	683,037.00	
		US TREASURY N/B	410,000.00	539,002.40	
		US TREASURY N/B	3,790,000.00	3,910,067.20	
		US TREASURY N/B	4,090,000.00	4,252,618.40	
		US TREASURY N/B	420,000.00	563,026.80	
		US TREASURY N/B	3,710,000.00	3,871,125.30	
		US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,588,957.80	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,900,262.50	
		US TREASURY N/B	550,000.00	677,380.00	
		US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,164,264.70	
		US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,754,265.20	
		US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,819,851.20	
		US TREASURY N/B	370,000.00	451,758.90	
		US TREASURY N/B	450,000.00	593,680.50	
		US TREASURY N/B	410,000.00	523,196.90	
		US TREASURY N/B	480,000.00	580,852.80	
		US TREASURY N/B	660,000.00	736,956.00	
		US TREASURY N/B	320,000.00	388,649.60	
		US TREASURY N/B	420,000.00	500,913.00	
		US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,606,949.90	
		US TREASURY N/B	3,270,000.00	3,413,422.20	
		US TREASURY N/B	250,000.00	304,980.00	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,496,695.20	
		US TREASURY N/B	3,060,000.00	3,119,976.00	
		US TREASURY N/B	520,000.00	583,840.40	
		US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,131,498.70	
		US TREASURY N/B	3,110,000.00	3,171,702.40	
		US TREASURY N/B	530,000.00	595,460.30	
		US TREASURY N/B	1,980,000.00	2,005,660.80	
		US TREASURY N/B	2,860,000.00	2,902,556.80	
		US TREASURY N/B	640,000.00	688,044.80	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,189,268.00	
US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,534,354.80			
US TREASURY N/B	300,000.00	361,029.00			
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,125,096.00			
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,988,922.60			
US TREASURY N/B	580,000.00	714,281.60			
US TREASURY N/B	3,110,000.00	3,205,850.20			



US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,321,991.30	
US TREASURY N/B	430,000.00	531,032.80	
US TREASURY N/B	1,830,000.00	1,884,241.20	
US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,498,762.10	
US TREASURY N/B	620,000.00	734,476.80	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,592,868.20	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,280,571.20	
US TREASURY N/B	130,000.00	182,106.60	
US TREASURY N/B	650,000.00	770,783.00	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,496,923.20	
US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,402,336.30	
US TREASURY N/B	140,000.00	199,024.00	
US TREASURY N/B	730,000.00	907,222.10	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,810,695.60	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	2,247,620.00	
US TREASURY N/B	770,000.00	979,825.00	
US TREASURY N/B	150,000.00	191,121.00	
US TREASURY N/B	220,000.00	306,039.80	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,376,934.00	
US TREASURY N/B	2,690,000.00	2,958,354.40	
US TREASURY N/B	850,000.00	1,059,074.50	
US TREASURY N/B	230,000.00	329,465.80	
US TREASURY N/B	1,980,000.00	2,121,292.80	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,276,081.80	
US TREASURY N/B	860,000.00	1,145,778.00	
US TREASURY N/B	260,000.00	367,655.60	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,417,598.00	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,241,083.80	
US TREASURY N/B	900,000.00	1,126,962.00	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,657,652.80	
US TREASURY N/B	940,000.00	1,009,287.40	
US TREASURY N/B	260,000.00	378,775.80	
US TREASURY N/B	880,000.00	1,079,883.20	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,414,201.40	
US TREASURY N/B	870,000.00	889,200.90	
US TREASURY N/B	840,000.00	916,742.40	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,745,191.80	
US TREASURY N/B	640,000.00	660,595.20	
US TREASURY N/B	260,000.00	347,698.00	
US TREASURY N/B	780,000.00	874,356.60	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,367,401.50	
US TREASURY N/B	440,000.00	452,082.40	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,123,830.60	
US TREASURY N/B	230,000.00	322,062.10	
US TREASURY N/B	970,000.00	1,005,463.20	
US TREASURY N/B	120,000.00	177,496.80	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,499,476.80	
US TREASURY N/B	470,000.00	456,153.80	
US TREASURY N/B	3,050,000.00	3,038,196.50	

US TREASURY N/B	770,000.00	683,790.80	
US TREASURY N/B	270,000.00	402,289.20	
US TREASURY N/B	790,000.00	759,071.50	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,890,183.90	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,162,941.00	
US TREASURY N/B	980,000.00	866,075.00	
US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,689,905.20	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,264,790.10	
US TREASURY N/B	2,090,000.00	2,005,083.30	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,216,947.20	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	977,182.20	
US TREASURY N/B	1,830,000.00	1,810,473.90	
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,548,739.50	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,056,929.00	
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,433,362.20	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,311,781.60	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,060,337.90	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,056,894.20	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,208,600.00	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,588,661.10	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,475,486.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,494,255.00	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,369,605.90	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,212,000.00	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,508,449.50	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,283,380.80	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,121,512.50	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,333,806.40	
US TREASURY N/B	1,870,000.00	1,845,951.80	
US TREASURY N/B	650,000.00	648,375.00	
US TREASURY N/B	470,000.00	476,166.40	
US TREASURY N/B	260,000.00	316,477.20	
US TREASURY N/B	430,000.00	440,074.90	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,443,816.00	
US TREASURY N/B	270,000.00	329,313.60	
US TREASURY N/B	250,000.00	299,745.00	
US TREASURY N/B	290,000.00	334,778.90	
US TREASURY NOTES	100,000.00	139,140.00	
WI TREASURY SEC.	250,000.00	355,205.00	
WI TREASURY SEC.	1,140,000.00	988,722.00	
WI TREASURY SEC.	1,540,000.00	1,451,142.00	
WI TREASURY SEC.	250,000.00	356,640.00	
WI TREASURY SEC.	230,000.00	304,147.40	
アメリカ・ドル 小計	187,490,000.00 (21,302,613,800)	196,152,070.60 (22,286,798,261)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY	230,000.00	330,505.40
	UK TREASURY	340,000.00	566,127.20
	UK TREASURY	300,000.00	433,077.00

UK TREASURY	310,000.00	530,989.70	
UK TREASURY	230,000.00	279,134.90	
UK TREASURY	330,000.00	444,546.30	
UK TREASURY	220,000.00	337,695.60	
UK TREASURY	270,000.00	422,312.40	
UK TREASURY	300,000.00	591,456.00	
UK TREASURY	310,000.00	419,203.70	
UK TREASURY	230,000.00	465,993.80	
UK TREASURY	270,000.00	431,217.00	
UK TREASURY	300,000.00	342,549.00	
UK TREASURY	180,000.00	246,063.60	
UK TREASURY	520,000.00	495,180.40	
UK TREASURY	270,000.00	242,133.30	
UK TREASURY	610,000.00	608,725.10	
UK TREASURY	590,000.00	585,167.90	
UK TREASURY	310,000.00	304,931.50	
UK TREASURY	250,000.00	243,162.50	
UK TREASURY	290,000.00	286,569.30	
UK TREASURY	270,000.00	262,431.90	
UK TREASURY	280,000.00	281,397.20	
UK TREASURY	180,000.00	165,650.40	
UK TREASURY	240,000.00	250,480.80	
UK TREASURY	340,000.00	378,256.80	
UK TREASURY	240,000.00	249,124.80	
UK TREASURY	430,000.00	448,275.00	
UK TREASURY	250,000.00	267,332.50	
UK TREASURY	250,000.00	299,200.00	
UK TREASURY	230,000.00	318,688.00	
UK TREASURY	280,000.00	283,670.80	
UK TREASURY	200,000.00	236,740.00	
UK TREASURY	340,000.00	428,933.80	
UK TREASURY	280,000.00	288,713.60	
UK TREASURY	210,000.00	222,713.40	
UK TREASURY	260,000.00	274,019.20	
UK TREASURY	250,000.00	254,377.50	
UK TREASURY	280,000.00	576,212.00	
UK TREASURY	380,000.00	548,184.20	
UK TREASURY	230,000.00	400,443.80	
UK TREASURY	370,000.00	559,243.90	
UK TREASURY	230,000.00	414,384.10	
UK TREASURY	400,000.00	382,740.00	
UK TREASURY	220,000.00	213,188.80	
UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	456,548.40	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	411,240.20	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	372,305.10	
UNITED KINGDOM GILT	150,000.00	160,587.00	
UNITED KINGDOM GILT	170,000.00	173,298.00	
UNITED KINGDOM GILT	130,000.00	128,572.60	
UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	180,901.80	

	UNITED KINGDOM GILT	90,000.00	89,133.30	
	UNITED KINGDOM GILT	110,000.00	127,226.00	
イギリス・ポンド 小計		15,150,000.00 (2,278,560,000)	18,710,956.50 (2,814,127,858)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	360,000.00	400,320.00	
	ISRAEL FIXED BOND	220,000.00	222,739.00	
	ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	668,882.50	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	488,158.00	
	ISRAEL FIXED BOND	860,000.00	908,977.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	373,186.50	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	414,352.00	
	ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	484,848.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	612,905.00	
	ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	642,528.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	323,383.50	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	370,906.50	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	151,635.00	
	ISRAEL FIXED BOND	100,000.00	100,645.00	
イスラエル・シュケル 小計		5,480,000.00 (198,704,800)	6,163,466.00 (223,487,277)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	381,449.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	240,000.00	251,496.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	440,993.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	404,517.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	160,000.00	178,489.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	373,996.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	285,802.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	190,000.00	222,908.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	304,082.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	365,333.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	284,765.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	240,000.00	259,996.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	360,165.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	516,172.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	272,917.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	456,821.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	396,105.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	485,571.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	460,289.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	307,446.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	257,586.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	520,602.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	355,422.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	344,148.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	416,410.80		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	433,795.40		
オーストラリア・ドル 小計		8,870,000.00	9,337,285.10	

		(717,849,100)	(755,666,483)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	725,932.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,216,236.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	600,000.00	630,984.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,001,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,010,560.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	1,100,088.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,195,974.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,302,002.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	600,000.00	601,818.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	650,000.00	666,971.50	
オフショア・人民元 小計		10,370,000.00 (184,503,040)	10,452,266.30 (185,966,722)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	110,000.00	142,744.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	272,746.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	246,988.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	161,422.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	323,139.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	207,104.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	218,316.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	131,940.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	185,143.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	207,918.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	178,243.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	333,910.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	246,372.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	222,812.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	580,755.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	760,000.00	817,805.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	150,423.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	215,785.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	182,212.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	620,086.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	150,699.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	530,000.00	518,212.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	540,000.00	503,841.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	346,654.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	430,000.00	422,793.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	368,027.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	367,247.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	710,668.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	366,614.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	138,782.00	
CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	202,082.00		
CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	287,743.80		
CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	171,847.90		
CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	80,077.60		
カナダ・ドル 小計		9,840,000.00	10,281,164.00	

		(867,691,200)	(906,593,042)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	140,220.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	330,000.00	340,164.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	114,203.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	142,285.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	146,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	149,240.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	145,390.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	147,417.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	90,000.00	96,480.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	61,476.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	64,620.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	126,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	211,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	166,020.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	176,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	58,578.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	80,000.00	80,422.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	49,547.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	59,872.80	
シンガポール・ドル 小計		2,330,000.00 (193,762,800)	2,476,375.90 (205,935,420)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,910,000.00	1,973,030.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,460,000.00	1,591,998.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,540,000.00	1,617,893.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	710,000.00	864,403.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,190,000.00	1,245,239.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,220,000.00	1,287,075.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	820,000.00	1,251,713.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	997,720.00	
スウェーデン・クローナ 小計		9,850,000.00 (122,435,500)	10,829,074.50 (134,605,396)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	980,000.00	1,020,209.40	
	KINGDOM OF DENMARK	930,000.00	1,012,267.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,390,000.00	1,461,418.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,710,000.00	1,813,472.10	
	KINGDOM OF DENMARK	890,000.00	920,384.60	
	KINGDOM OF DENMARK	1,070,000.00	1,082,797.20	
	KINGDOM OF DENMARK	2,190,000.00	3,996,684.30	
	KINGDOM OF DENMARK	730,000.00	742,176.40	
デンマーク・クローネ 小計		9,890,000.00 (170,009,100)	12,049,410.00 (207,129,358)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,620,000.00	1,641,205.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	1,297,737.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,032,342.00	

	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	893,017.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	770,000.00	781,757.90	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	740,000.00	764,005.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	810,000.00	825,851.70	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	1,060,573.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	630,000.00	616,833.00	
ノルウェー・クローネ 小計		8,800,000.00 (110,528,000)	8,913,323.90 (111,951,348)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	420,000.00	428,589.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	870,000.00	872,688.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	840,000.00	812,943.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	701,734.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	651,039.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	460,000.00	458,785.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,080,000.00	1,069,956.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	850,740.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	205,800.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	186,776.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	690,000.00	639,733.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	630,000.00	540,199.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	430,000.00	413,982.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	430,000.00	374,530.00	
ポーランド・ズロチ 小計		8,500,000.00 (234,587,250)	8,207,497.70 (226,514,625)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	457,605.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	446,682.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	416,539.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	130,000.00	142,168.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	795,279.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	628,403.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	649,491.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	830,000.00	857,165.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	378,266.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	396,412.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	332,438.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	382,180.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	222,051.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	249,356.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	60,000.00	61,774.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	196,738.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	40,000.00	42,985.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	378,476.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	228,024.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	318,038.40	
MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	371,837.70		
MALAYSIA GOVERNMENT	330,000.00	321,565.20		
マレーシア・リングgit 小計		8,030,000.00	8,273,481.00	

		(215,732,374)	(222,273,686)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,768,762.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,060,000.00	5,202,540.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,570,000.00	3,541,368.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,970,000.00	6,609,511.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,980,000.00	4,035,600.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,490,000.00	6,974,348.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,250,000.00	1,529,762.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,660,000.00	4,752,780.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,790,000.00	4,870,424.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,020,000.00	6,092,541.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,740,000.00	6,144,268.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,310,000.00	4,612,303.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,350,000.00	3,357,470.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	680,000.00	629,136.00	
メキシコ・ペソ 小計		58,590,000.00 (319,872,105)	60,120,818.00 (328,229,606)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	261,137.50	
	BELGIUM KINGDOM	290,000.00	314,006.20	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	624,359.00	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	325,213.50	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	227,696.00	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	231,290.10	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	365,042.70	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	232,200.90	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	419,864.00	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	201,012.80	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	374,458.00	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	258,499.50	
	BELGIUM KINGDOM	130,000.00	194,842.70	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	182,901.60	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	278,231.20	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	248,028.00	
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	176,124.00	
	BELGIUM KINGDOM	130,000.00	152,686.30	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	455,799.30	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	377,328.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	228,988.00	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	348,768.00	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	266,070.00	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	246,045.60	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	158,752.00	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	164,043.20	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	563,362.80	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	270,785.70	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	90,660.00	
	BONOS Y OBLIG DE	360,000.00	365,428.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	373,604.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	394,009.20	



BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	544,156.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	441,392.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	514,584.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	644,841.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	622,203.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	434,339.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	502,530.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	481,189.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	507,210.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	505,618.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	483,639.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	497,651.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	280,000.00	453,552.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	560,502.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	480,708.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	449,335.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	491,805.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	503,088.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	416,694.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	637,243.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	673,732.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	456,912.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	482,741.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	518,927.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	487,821.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	377,492.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	447,582.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	323,205.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	473,966.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	411,928.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	449,992.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	415,924.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	410,654.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	359,162.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	524,126.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	699,414.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	337,990.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	415,252.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	423,292.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	364,208.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	95,410.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	340,000.00	341,343.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	180,000.00	182,289.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	90,000.00	91,869.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	100,925.00	
BUNDESobligation	390,000.00	393,861.00	
BUNDESobligation	420,000.00	425,943.00	
BUNDESobligation	440,000.00	449,455.60	
BUNDESobligation	380,000.00	389,044.00	

BUNDES OblIGATION	480,000.00	492,662.40	
BUNDES OblIGATION	90,000.00	92,546.10	
BUNDES OblIGATION	480,000.00	493,569.60	
BUNDES OblIGATION	70,000.00	71,241.80	
BUNDES OblIGATION	390,000.00	401,629.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	389,880.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	608,844.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	606,697.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	738,367.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000.00	812,226.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	967,010.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	502,488.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	540,540.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	552,468.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	608,391.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	781,332.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	587,373.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	606,076.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	595,229.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	634,595.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	762,138.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	775,559.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	565,854.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	569,608.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	539,192.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	540,430.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	559,306.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	370,000.00	640,532.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	520,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	430,000.00	445,032.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	430,000.00	442,732.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	603,229.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	865,176.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	130,000.00	135,916.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	571,235.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	390,351.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	110,000.00	113,100.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	528,819.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	414,956.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	145,545.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	141,377.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	312,264.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	892,369.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	260,000.00	261,794.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	310,000.00	312,703.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	240,000.00	243,045.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	555,890.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	547,774.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	602,624.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	729,136.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	431,004.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	614,277.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	411,373.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	750,000.00	790,245.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	602,352.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	504,300.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	526,394.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	409,360.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	700,882.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	751,796.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	401,134.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	735,602.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	661,667.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	329,909.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	515,940.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	830,000.00	846,027.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	213,521.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	415,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,535.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	892,848.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	427,068.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	757,033.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	360,490.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	770,000.00	846,191.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	433,732.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	762,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	475,345.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	354,424.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	368,782.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	496,255.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	317,067.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	673,268.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	505,862.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	558,369.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	668,169.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	359,671.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	279,015.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	700,651.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	223,210.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	436,101.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	376,571.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	450,946.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	483,754.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	294,641.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	439,446.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	352,205.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	620,693.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	473,130.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	287,500.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	620,000.00	623,775.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	267,615.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	419,628.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	256,435.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	165,614.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,919.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	310,731.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	351,274.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	260,962.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	228,104.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	40,000.00	41,264.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	192,394.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	149,281.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	118,789.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	32,704.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	202,597.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	584,051.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000.00	69,496.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000.00	69,779.50	
DEUTSCHLAND REP	270,000.00	374,765.40	
DEUTSCHLAND REP	270,000.00	379,498.50	
DEUTSCHLAND REP	220,000.00	299,195.60	
DEUTSCHLAND REP	340,000.00	529,985.20	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	181,606.50	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	138,387.60	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	165,519.20	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	86,999.20	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	92,669.40	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	137,369.70	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	136,142.50	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	111,322.20	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	137,254.00	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	102,544.20	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	103,538.40	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	127,514.40	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	70,086.80	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	105,090.30	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	71,003.10	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	111,915.10	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	66,850.70	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	92,211.30	
FINNISH GOVERNMENT	40,000.00	42,358.40	
FINNISH GOVERNMENT	40,000.00	40,767.60	
FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	51,230.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,200,597.10	
FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	887,804.50	
FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	1,024,313.40	
FRANCE (GOVT OF)	490,000.00	790,051.50	

FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	704,205.60	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	835,637.40	
FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	802,545.00	
FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	1,218,056.40	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	871,038.00	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	774,435.10	
FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,162,671.60	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	1,045,586.30	
FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	887,859.00	
FRANCE (GOVT OF)	270,000.00	367,224.30	
FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	904,060.20	
FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	776,737.50	
FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	739,305.40	
FRANCE (GOVT OF)	760,000.00	819,698.00	
FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	745,107.00	
FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	857,191.00	
FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	1,007,322.80	
FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	841,091.40	
FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	999,117.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,270,000.00	1,288,859.50	
FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	825,843.00	
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	1,259,291.50	
FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	774,666.90	
FRANCE (GOVT OF)	890,000.00	940,863.50	
FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	927,053.40	
FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	833,620.20	
FRANCE (GOVT OF)	580,000.00	592,852.80	
FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	806,945.50	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	851,635.20	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	988,226.40	
FRANCE (GOVT OF)	320,000.00	672,985.60	
FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	939,830.10	
FRANCE (GOVT OF)	390,000.00	397,066.80	
FRANCE (GOVT OF)	330,000.00	332,663.10	
FRANCE (GOVT OF)	160,000.00	137,902.40	
FRANCE (GOVT OF)	220,000.00	221,183.60	
FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	871,940.10	
FRANCE (GOVT OF)	330,000.00	337,019.10	
FRANCE (GOVT OF)	130,000.00	131,839.50	
FRANCE (GOVT OF)	170,000.00	172,237.20	
FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	1,093,058.10	
FRANCE (GOVT OF)	380,000.00	757,598.40	
IRISH TREASURY	170,000.00	169,535.90	
IRISH TREASURY	170,000.00	174,051.10	
IRISH TREASURY	140,000.00	144,193.00	
IRISH TREASURY	100,000.00	101,648.00	
IRISH TREASURY	80,000.00	81,223.20	
IRISH TREASURY	230,000.00	245,048.90	
IRISH TREASURY	190,000.00	208,139.30	

IRISH TREASURY	100,000.00	113,090.00	
IRISH TREASURY	120,000.00	136,005.60	
IRISH TREASURY	140,000.00	170,087.40	
IRISH TREASURY	120,000.00	144,684.00	
IRISH TREASURY	180,000.00	239,830.20	
IRISH TREASURY	180,000.00	218,804.40	
IRISH TREASURY	160,000.00	172,238.40	
IRISH TREASURY	150,000.00	163,758.00	
IRISH TREASURY	130,000.00	137,429.50	
ITALIAN GOVT	200,000.00	269,076.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	661,003.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	390,759.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	415,904.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	320,895.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	391,726.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	378,352.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	310,975.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	294,199.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	178,290.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	324,462.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	552,554.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	241,120.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	220,752.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	277,384.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	636,400.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	318,463.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	190,000.00	185,117.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	240,000.00	245,572.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	150,000.00	150,693.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	315,405.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	120,000.00	123,279.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	207,752.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	175,688.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	214,117.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	394,926.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	271,931.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	299,457.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	318,309.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	192,126.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	205,977.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	262,912.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	70,876.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	191,277.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	207,400.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	224,897.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	452,961.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	232,570.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	185,086.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	223,559.60	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	120,609.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	66,696.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	70,159.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	121,084.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	202,128.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	61,124.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	111,016.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	20,344.00	
	TREASURY 5.4% 2025	210,000.00	250,800.90	
	ユーロ 小計	121,600,000.00 (15,540,480,000)	141,763,141.20 (18,117,329,445)	
国債証券 合計		42,457,329,069 (42,457,329,069)	46,726,608,527 (46,726,608,527)	
合計			46,726,608,527 (46,726,608,527)	

(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 138銘柄	47.33	47.70
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	5.98	6.02
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.47	0.48
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.60	1.62
オフショア・人民元	国債証券 10銘柄	0.39	0.40
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	1.93	1.94
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.44	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.29	0.29
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.44	0.44
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.24	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.48	0.48
マレーシア・リンギット	国債証券 22銘柄	0.47	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.70	0.70
ユーロ	国債証券 335銘柄	38.48	38.77

(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。



## 中間財務諸表

## DCニッセイターゲットデートファンド2065

当ファンドは2022年1月11日から運用を開始しており、本書作成時点では2022年1月11日から2022年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査中となっております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年12月21日から2022年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2050

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年12月21日から2022年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2055

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年12月21日から2022年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2060

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年12月21日から2022年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2025】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2021年12月20日現在	第6期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	29,352	16,922
コール・ローン	2,698,432	3,330,978
親投資信託受益証券	2,216,336,145	2,301,806,915
未収入金	28,357,966	11,151,579
流動資産合計	2,247,421,895	2,316,306,394
資産合計	2,247,421,895	2,316,306,394
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	28,301,578	11,093,516
未払受託者報酬	305,780	373,348
未払委託者報酬	2,446,605	2,987,104
その他未払費用	87,728	103,482
流動負債合計	31,141,691	14,557,450
負債合計	31,141,691	14,557,450
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,995,581,676	2,143,600,019
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	220,698,528	158,148,925
(分配準備積立金)	66,232,197	61,209,568
元本等合計	2,216,280,204	2,301,748,944
純資産合計	2,216,280,204	2,301,748,944
負債純資産合計	2,247,421,895	2,316,306,394

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第6期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	8
有価証券売買等損益	23,599,659	73,289,947
営業収益合計	23,599,661	73,289,939
<b>営業費用</b>		
支払利息	121	276
受託者報酬	235,876	373,348
委託者報酬	1,887,275	2,987,104
その他費用	71,409	103,482
営業費用合計	2,194,681	3,464,210
営業利益又は営業損失（ ）	21,404,980	76,754,149
経常利益又は経常損失（ ）	21,404,980	76,754,149
中間純利益又は中間純損失（ ）	21,404,980	76,754,149
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	939,177	2,850,340
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	100,489,740	220,698,528
剰余金増加額又は欠損金減少額	38,148,081	29,266,968
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	38,148,081	29,266,968
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,696,412	17,912,762
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,696,412	17,912,762
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	149,407,212	158,148,925

## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	1,200,644,638円	1,995,581,676円
期中追加設定元本額	1,051,584,639円	311,283,729円
期中一部解約元本額	256,647,601円	163,265,386円
2. 受益権の総数	1,995,581,676口	2,143,600,019口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2021年12月20日現在	第6期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.1106円	1.0738円
(1万口当たり純資産額)	(11,106円)	(10,738円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2030】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	31,745	22,422
コール・ローン	2,918,490	4,413,679
親投資信託受益証券	2,832,193,593	2,953,237,469
未収入金	548,719	724,874
流動資産合計	2,835,692,547	2,958,398,444
資産合計	2,835,692,547	2,958,398,444
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	474,687	647,469
未払受託者報酬	322,130	478,066
未払委託者報酬	2,684,767	3,984,251
その他未払費用	91,533	127,937
流動負債合計	3,573,117	5,237,723
負債合計	3,573,117	5,237,723
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,268,236,888	2,446,873,620
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	563,882,542	506,287,101
(分配準備積立金)	159,580,466	152,182,184
元本等合計	2,832,119,430	2,953,160,721
純資産合計	2,832,119,430	2,953,160,721
負債純資産合計	2,835,692,547	2,958,398,444

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第4期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	10
有価証券売買等損益	63,493,728	96,422,847
営業収益合計	63,493,729	96,422,837
<b>営業費用</b>		
支払利息	107	385
受託者報酬	218,204	478,066
委託者報酬	1,818,710	3,984,251
その他費用	67,294	127,945
営業費用合計	2,104,315	4,590,647
営業利益又は営業損失( )	61,389,414	101,013,484
経常利益又は経常損失( )	61,389,414	101,013,484
中間純利益又は中間純損失( )	61,389,414	101,013,484
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	3,402,123	1,470,813
期首剰余金又は期首欠損金( )	155,733,882	563,882,542
剰余金増加額又は欠損金減少額	78,857,341	69,650,093
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	78,857,341	69,650,093
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,696,753	27,702,863
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,696,753	27,702,863
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	277,881,761	506,287,101



## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	1,014,388,366円	2,268,236,888円
期中追加設定元本額	1,471,484,708円	290,204,674円
期中一部解約元本額	217,636,186円	111,567,942円
2. 受益権の総数	2,268,236,888口	2,446,873,620口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1,2486円	1,2069円
(1万口当たり純資産額)	(12,486円)	(12,069円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2035】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	49,768	33,575
コール・ローン	4,575,458	6,609,205
親投資信託受益証券	3,957,972,731	4,352,397,683
未収入金	529,186	3,155,276
流動資産合計	3,963,127,143	4,362,195,739
資産合計	3,963,127,143	4,362,195,739
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	422,071	3,037,097
未払受託者報酬	487,196	693,012
未払委託者報酬	4,222,676	6,006,459
その他未払費用	130,061	178,082
流動負債合計	5,262,004	9,914,650
負債合計	5,262,004	9,914,650
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,917,126,953	3,326,611,737
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,040,738,186	1,025,669,352
（分配準備積立金）	390,484,392	376,977,425
元本等合計	3,957,865,139	4,352,281,089
純資産合計	3,957,865,139	4,352,281,089
負債純資産合計	3,963,127,143	4,362,195,739

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第6期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	16
有価証券売買等損益	149,743,895	155,634,230
営業収益合計	149,743,897	155,634,214
<b>営業費用</b>		
支払利息	191	611
受託者報酬	324,238	693,012
委託者報酬	2,810,442	6,006,459
その他費用	92,026	178,100
営業費用合計	3,226,897	6,878,182
営業利益又は営業損失（ ）	146,517,000	162,512,396
経常利益又は経常損失（ ）	146,517,000	162,512,396
中間純利益又は中間純損失（ ）	146,517,000	162,512,396
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	7,090,497	1,221,626
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	273,687,058	1,040,738,186
剰余金増加額又は欠損金減少額	136,943,305	185,606,593
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	136,943,305	185,606,593
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,229,655	39,384,657
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	23,229,655	39,384,657
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	526,827,211	1,025,669,352

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	1,413,786,138円	2,917,126,953円
期中追加設定元本額	1,722,619,889円	519,894,498円
期中一部解約元本額	219,279,074円	110,409,714円
2. 受益権の総数	2,917,126,953口	3,326,611,737口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2021年12月20日現在	第6期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.3568円	1.3083円
(1万口当たり純資産額)	(13,568円)	(13,083円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2040】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	17,766	13,830
コール・ローン	1,633,318	2,722,334
親投資信託受益証券	1,600,538,602	1,812,835,992
未収入金	427,072	199,528
流動資産合計	1,602,616,758	1,815,771,684
資産合計	1,602,616,758	1,815,771,684
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	383,381	150,194
未払受託者報酬	174,046	284,592
未払委託者報酬	1,508,656	2,466,767
その他未払費用	55,816	82,789
流動負債合計	2,121,899	2,984,342
負債合計	2,121,899	2,984,342
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,139,582,522	1,340,476,284
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	460,912,337	472,311,058
(分配準備積立金)	131,666,074	125,490,501
元本等合計	1,600,494,859	1,812,787,342
純資産合計	1,600,494,859	1,812,787,342
負債純資産合計	1,602,616,758	1,815,771,684

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第4期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	5
有価証券売買等損益	52,608,132	69,188,467
営業収益合計	52,608,132	69,188,462
<b>営業費用</b>		
支払利息	23	201
受託者報酬	103,695	284,592
委託者報酬	898,994	2,466,767
その他費用	34,479	82,789
営業費用合計	1,037,191	2,834,349
営業利益又は営業損失（ ）	51,570,941	72,022,811
経常利益又は経常損失（ ）	51,570,941	72,022,811
中間純利益又は中間純損失（ ）	51,570,941	72,022,811
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,594,306	393,919
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	93,720,255	460,912,337
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,539,447	106,926,518
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,539,447	106,926,518
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,567,203	23,898,905
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,567,203	23,898,905
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	189,669,134	472,311,058



## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	426,598,305円	1,139,582,522円
期中追加設定元本額	793,296,990円	259,885,787円
期中一部解約元本額	80,312,773円	58,992,025円
2. 受益権の総数	1,139,582,522口	1,340,476,284口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.4045円	1.3523円
(1万口当たり純資産額)	(14,045円)	(13,523円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2045】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2021年12月20日現在	第6期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	20,879	14,258
コール・ローン	1,919,524	2,806,616
親投資信託受益証券	1,665,096,096	1,856,788,501
未収入金	376,716	12,928,818
流動資産合計	1,667,413,215	1,872,538,193
資産合計	1,667,413,215	1,872,538,193
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	331,440	12,878,117
未払受託者報酬	203,469	293,410
未払委託者報酬	1,763,832	2,543,353
その他未払費用	63,825	84,845
流動負債合計	2,362,566	15,799,725
負債合計	2,362,566	15,799,725
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,189,551,640	1,378,133,226
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	475,499,009	478,605,242
(分配準備積立金)	174,756,797	162,939,359
元本等合計	1,665,050,649	1,856,738,468
純資産合計	1,665,050,649	1,856,738,468
負債純資産合計	1,667,413,215	1,872,538,193

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第6期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	5
有価証券売買等損益	69,918,279	71,340,570
営業収益合計	69,918,279	71,340,565
<b>営業費用</b>		
支払利息	38	213
受託者報酬	134,166	293,410
委託者報酬	1,163,085	2,543,353
その他費用	44,652	84,845
営業費用合計	1,341,941	2,921,821
営業利益又は営業損失（ ）	68,576,338	74,262,386
経常利益又は経常損失（ ）	68,576,338	74,262,386
中間純利益又は中間純損失（ ）	68,576,338	74,262,386
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,899,758	1,410,100
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	118,805,176	475,499,009
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,783,316	111,824,540
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	59,783,316	111,824,540
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,623,062	35,866,021
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,623,062	35,866,021
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	230,642,010	478,605,242

## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	563,954,983円	1,189,551,640円
期中追加設定元本額	735,655,901円	278,247,965円
期中一部解約元本額	110,059,244円	89,666,379円
2. 受益権の総数	1,189,551,640口	1,378,133,226口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2021年12月20日現在	第6期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.3997円	1.3473円
(1万口当たり純資産額)	(13,997円)	(13,473円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2050】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	7,122	5,941
コール・ローン	654,771	1,169,489
親投資信託受益証券	680,470,781	777,202,129
未収入金	1,274,846	12,553,798
流動資産合計	682,407,520	790,931,357
資産合計	682,407,520	790,931,357
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,256,147	12,532,383
未払受託者報酬	69,909	121,740
未払委託者報酬	606,152	1,055,483
その他未払費用	23,224	40,511
流動負債合計	1,955,432	13,750,117
負債合計	1,955,432	13,750,117
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	475,426,751	564,320,988
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	205,025,337	212,860,252
（分配準備積立金）	37,162,625	33,433,236
元本等合計	680,452,088	777,181,240
純資産合計	680,452,088	777,181,240
負債純資産合計	682,407,520	790,931,357

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第4期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	16,351,674	31,058,884
営業収益合計	16,351,674	31,058,882
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	49
受託者報酬	31,914	121,740
委託者報酬	277,034	1,055,483
その他費用	10,562	40,511
営業費用合計	319,510	1,217,783
営業利益又は営業損失（ ）	16,032,164	32,276,665
経常利益又は経常損失（ ）	16,032,164	32,276,665
中間純利益又は中間純損失（ ）	16,032,164	32,276,665
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,048,444	1,084,707
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,705,786	205,025,337
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,538,053	62,968,021
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,538,053	62,968,021
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,571,516	23,941,148
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,571,516	23,941,148
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	66,656,043	212,860,252



## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	118,987,624円	475,426,751円
期中追加設定元本額	418,895,243円	144,305,716円
期中一部解約元本額	62,456,116円	55,411,479円
2. 受益権の総数	475,426,751口	564,320,988口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.4312円	1.3772円
(1万口当たり純資産額)	(14,312円)	(13,772円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2055】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 2021年12月20日現在	第7期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	18,845	11,422
コール・ローン	1,732,475	2,248,406
親投資信託受益証券	1,303,631,192	1,517,058,928
未収入金	4,733,601	2,381,037
流動資産合計	1,310,116,113	1,521,699,793
資産合計	1,310,116,113	1,521,699,793
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,697,956	2,339,870
未払受託者報酬	182,449	234,849
未払委託者報酬	1,581,609	2,035,638
その他未払費用	58,712	71,170
流動負債合計	6,520,726	4,681,527
負債合計	6,520,726	4,681,527
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	764,717,172	925,059,705
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	538,878,215	591,958,561
(分配準備積立金)	155,898,556	138,926,476
元本等合計	1,303,595,387	1,517,018,266
純資産合計	1,303,595,387	1,517,018,266
負債純資産合計	1,310,116,113	1,521,699,793

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第7期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	4
有価証券売買等損益	70,168,321	59,188,815
営業収益合計	70,168,321	59,188,811
<b>営業費用</b>		
支払利息	38	152
受託者報酬	127,090	234,849
委託者報酬	1,101,757	2,035,638
その他費用	42,287	71,170
営業費用合計	1,271,172	2,341,809
営業利益又は営業損失( )	68,897,149	61,530,620
経常利益又は経常損失( )	68,897,149	61,530,620
中間純利益又は中間純損失( )	68,897,149	61,530,620
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	8,242,695	896,134
期首剰余金又は期首欠損金( )	206,847,962	538,878,215
剰余金増加額又は欠損金減少額	112,650,513	181,399,350
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	112,650,513	181,399,350
剰余金減少額又は欠損金増加額	44,473,535	67,684,518
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	44,473,535	67,684,518
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	335,679,394	591,958,561

## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第7期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	446,839,347円	764,717,172円
期中追加設定元本額	495,378,300円	256,311,001円
期中一部解約元本額	177,500,475円	95,968,468円
2. 受益権の総数	764,717,172口	925,059,705口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	第7期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第6期 2021年12月20日現在	第7期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.7047円	1.6399円
(1万口当たり純資産額)	(17,047円)	(16,399円)

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2060】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	10,599	7,659
コール・ローン	974,433	1,507,657
親投資信託受益証券	855,263,528	1,028,172,344
未収入金	598,580	5,894,933
流動資産合計	856,847,140	1,035,582,593
資産合計	856,847,140	1,035,582,593
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	575,169	5,866,882
未払受託者報酬	103,170	157,085
未払委託者報酬	894,459	1,361,766
その他未払費用	34,310	52,161
流動負債合計	1,607,108	7,437,894
負債合計	1,607,108	7,437,894
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	588,312,781	735,387,280
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	266,927,251	292,757,419
（分配準備積立金）	48,073,943	36,679,258
元本等合計	855,240,032	1,028,144,699
純資産合計	855,240,032	1,028,144,699
負債純資産合計	856,847,140	1,035,582,593

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年6月21日	第4期中間計算期間 自 2021年12月21日 至 2022年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	23,180,357	40,756,588
営業収益合計	23,180,357	40,756,586
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	76
受託者報酬	46,440	157,085
委託者報酬	402,793	1,361,766
その他費用	15,397	52,161
営業費用合計	464,630	1,571,088
営業利益又は営業損失（ ）	22,715,727	42,327,674
経常利益又は経常損失（ ）	22,715,727	42,327,674
中間純利益又は中間純損失（ ）	22,715,727	42,327,674
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,988,727	1,063,832
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	34,245,478	266,927,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	77,154,973	146,932,054
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,154,973	146,932,054
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,762,054	79,838,044
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,762,054	79,838,044
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	113,365,397	292,757,419



## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2021年12月21日	至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 期首元本額	141,064,244円	588,312,781円
期中追加設定元本額	605,255,833円	322,923,173円
期中一部解約元本額	158,007,296円	175,848,674円
2. 受益権の総数	588,312,781口	735,387,280口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2021年12月20日現在	2022年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもありませぬ。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2021年12月20日現在	第4期中間計算期間 2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.4537円	1.3981円
(1万口当たり純資産額)	(14,537円)	(13,981円)

（参考）

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

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2022年6月20日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	13,515,432
コール・ローン	2,660,477,929
株式	161,988,487,690
未収配当金	940,428,992
前払金	162,680,000
差入委託証拠金	142,305,000
流動資産合計	165,907,895,043
資産合計	
165,907,895,043	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	166,358,450
未払解約金	182,146,285
その他未払費用	19,704
流動負債合計	348,524,439
負債合計	
348,524,439	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	79,979,023,495
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,580,347,109
元本等合計	165,559,370,604
純資産合計	
165,559,370,604	
負債純資産合計	
165,907,895,043	

## 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12月21日 至 2022年6月20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6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,267,646,540円
同期中追加設定元本額	33,281,976,599円
同期中一部解約元本額	6,570,599,644円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,765,514,519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)	3,453,787,875円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,582,484円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,164,654,488円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,297,204,529円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,524,105,160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)	3,923,931円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	15,900,485円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	15,620,491円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,189,422,589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	22,150,882,626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)	2,445,553,446円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	230,724,793円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	222,964,349円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	268,332,110円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	518,168,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	50,940,615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)	110,634,306円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	8,151,671円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,887,610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)	4,731,787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)	7,345,272円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	28,140,907円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	160,016,319円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	115,463,412円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	251,945,170円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	214,662,878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)	27,714,585,727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)	22,720,844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)	77,995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)	164,299円
FWニッセイ国内株インデックス	2,483,459円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	5,729,169円
計	79,979,023,495円
2. 受益権の総数	79,979,023,495口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2022年6月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	3,423,165,000	-	3,256,905,000	166,260,000
合計	3,423,165,000	-	3,256,905,000	166,260,000

## （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ぬ。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2022年6月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0700円 (20,700円)

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2022年6月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,629,656,023
金銭信託	41,327,732
コール・ローン	8,135,257,475
株式	487,523,455,784
投資証券	11,984,312,608
派生商品評価勘定	20,188,019
未収入金	637,739,269
未収配当金	605,205,572
差入委託証拠金	7,921,655,192
流動資産合計	518,498,797,674
資産合計	518,498,797,674
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	404,736,716
未払金	437,986,601
未払解約金	653,029,578
その他未払費用	11,108
流動負債合計	1,495,764,003
負債合計	1,495,764,003
純資産の部	
元本等	
元本	188,639,244,513
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	328,363,789,158
元本等合計	517,003,033,671
純資産合計	517,003,033,671
負債純資産合計	518,498,797,674

## 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12月21日 至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	177,341,691,085円
同期中追加設定元本額	27,243,061,602円
同期中一部解約元本額	15,945,508,174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）	798,480,926円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,577,684,916円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,044,784,994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）	1,950,830,269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）	1,447,356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）	7,811,380円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	8,684,337円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,882,174,321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	135,173,025,246円
DCニッセイ外国株式インデックス	30,982,434,599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)	1,804,469,224円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	244,102,138円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	164,480,960円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	281,480,610円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	532,136,864円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	15,655,521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)	81,630,246円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,013,883円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	8,032,620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)	3,490,983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)	20,761,741円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	169,627,748円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	121,535,681円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	262,820,371円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	197,158,349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)	197,792,463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)	181,089,197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)	199,189,508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)	195,249,886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)	195,123,859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)	190,775,137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)	30,385,177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)	100,748,261円
FWニッセイ先進国株インデックス	2,052,077円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	6,083,665円
計	188,639,244,513円
2. 受益権の総数	188,639,244,513口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2022年6月20日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建	12,561,519	-	12,686,132	124,613	
イギリス・ポンド	12,229,440	-	12,355,246	125,806	
カナダ・ドル	332,079	-	330,886	1,193	
買建	7,388,958,659	-	7,408,824,338	19,865,679	
アメリカ・ドル	4,966,994,297	-	4,969,672,928	2,678,631	
イギリス・ポンド	619,754,739	-	629,132,530	9,377,791	
ユーロ	1,802,209,623	-	1,810,018,880	7,809,257	
合計	7,401,520,178	-	7,421,510,470	19,741,066	

## (注) 為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## 株式関連

種類	2022年6月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	16,851,585,216	-	16,447,295,454	404,289,762
合計	16,851,585,216	-	16,447,295,454	404,289,762

## （注）株価指数先物取引

## 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## （1口当たり情報に関する注記）

	2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	2.7407円
（1万口当たり純資産額）	（27,407円）

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2022年6月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	24,207,064
コール・ローン	4,765,098,186
国債証券	54,323,464,010
地方債証券	4,343,617,513
特殊債券	5,631,737,791
社債券	4,659,239,000
未収入金	4,036,269,620
未収利息	103,124,694
前払費用	1,515,907
流動資産合計	77,888,273,785
資産合計	
77,888,273,785	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,222,750,787
その他未払費用	1,268
流動負債合計	4,222,752,055
負債合計	
4,222,752,055	
純資産の部	
元本等	
元本	77,211,645,804
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,546,124,074
元本等合計	73,665,521,730
純資産合計	73,665,521,730
負債純資産合計	77,888,273,785

## 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12月21日 至 2022年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2022年6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	79,006,185,912円
同期中追加設定元本額	5,312,543,867円
同期中一部解約元本額	7,107,083,975円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	61,004,315,545円
DCニッセイ日本債券インデックス	3,612,447,517円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	128,179,070円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	6,097,898,497円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	250,106,261円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	1,299,955,201円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	2,151,458,403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）	250,709,693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）	26,966,686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）	78,163,228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）	64,157,461円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	63,261,127円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	84,397,246円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	311,066,894円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	1,784,441,329円
FWニッセイ国内債インデックス	2,242,320円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	1,879,326円
計	77,211,645,804円
2. 受益権の総数	77,211,645,804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3,546,124,074円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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)は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	0.9541円
(1万口当たり純資産額)	(9,541円)

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2022年6月20日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	73,965,972
金銭信託	959,544
コール・ローン	188,883,689
国債証券	51,997,752,247
派生商品評価勘定	807,568
未収入金	1,417,695
未収利息	299,311,951
前払費用	23,975,490
流動資産合計	52,587,074,156
資産合計	
52,587,074,156	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,770
未払金	100,708,548
未払解約金	61,867,186
その他未払費用	364
流動負債合計	162,581,868
負債合計	
162,581,868	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	34,447,438,768
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	17,977,053,520
元本等合計	52,424,492,288
純資産合計	
52,424,492,288	
負債純資産合計	
52,587,074,156	

## 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12月21日 至 2022年6月20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6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	31,033,769,786円
同期中追加設定元本額	6,587,651,974円
同期中一部解約元本額	3,173,982,992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)	3,139,800,063円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,275,885,047円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,995,582,214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)	822,497,774円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	2,845,716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)	7,695,604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)	6,098,467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	13,606,954,870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)	3,546,794,720円
DCニッセイ外国債券インデックス	2,850,317,083円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	163,054,227円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,617,092,418円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	191,379,686円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	381,808,786円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	66,197,710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)	160,448,564円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	17,157,351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)	40,821,066円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	112,807,908円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	81,855,980円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	180,175,293円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	174,780,179円
FWニッセイ外国債インデックス	1,360,514円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	4,027,528円
計	34,447,438,768円
2. 受益権の総数	34,447,438,768口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2022年6月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	137,817,078	-	138,618,876	801,798
アメリカ・ドル	91,292,081	-	91,826,450	534,369
イギリス・ポンド	5,316,867	-	5,356,007	39,140
カナダ・ドル	2,015,894	-	2,012,384	3,510
スウェーデン・クローナ	666,470	-	669,996	3,526
メキシコ・ペソ	1,215,835	-	1,221,148	5,313
ユーロ	37,309,931	-	37,532,891	222,960
合計	137,817,078	-	138,618,876	801,798

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年6月20日現在
1口当たり純資産額	1.5219円
(1万口当たり純資産額)	(15,219円)

## 2【ファンドの現況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「2 ファンドの現況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## 【純資産額計算書】

DCニッセイターゲットデートファンド2025

2022年6月30日現在

資産総額	2,344,923,442円
負債総額	591,756円
純資産総額（ - ）	2,344,331,686円
発行済数量	2,174,416,349口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0781円

DCニッセイターゲットデートファンド2030

2022年6月30日現在

資産総額	3,036,528,575円
負債総額	593,155円
純資産総額（ - ）	3,035,935,420円
発行済数量	2,477,700,583口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2253円

DCニッセイターゲットデートファンド2035

2022年6月30日現在

資産総額	4,542,529,756円
負債総額	2,349,127円
純資産総額（ - ）	4,540,180,629円
発行済数量	3,383,721,546口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3418円

DCニッセイターゲットデートファンド2040

2022年6月30日現在

資産総額	1,903,942,934円
負債総額	201,696円
純資産総額（ - ）	1,903,741,238円
発行済数量	1,366,930,308口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3927円

DCニッセイターゲットデートファンド2045

2022年6月30日現在

資産総額	1,959,134,013円
負債総額	7,107,334円
純資産総額（ - ）	1,952,026,679円
発行済数量	1,405,174,277口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3892円

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

2022年6月30日現在

資産総額	819,244,549円
負債総額	335,505円
純資産総額( - )	818,909,044円
発行済数量	576,195,535口
1口当たり純資産額( / )	1.4212円

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

2022年6月30日現在

資産総額	1,616,978,688円
負債総額	7,899,258円
純資産総額( - )	1,609,079,430円
発行済数量	950,036,656口
1口当たり純資産額( / )	1.6937円

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

2022年6月30日現在

資産総額	1,124,128,595円
負債総額	715,858円
純資産総額( - )	1,123,412,737円
発行済数量	777,428,555口
1口当たり純資産額( / )	1.4450円

## DCニッセイターゲットデートファンド2065

2022年6月30日現在

資産総額	39,685,048円
負債総額	196,646円
純資産総額( - )	39,488,402円
発行済数量	40,821,441口
1口当たり純資産額( / )	0.9673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6月30日現在

資産総額	195,583,097,638円
負債総額	2,756,047,530円
純資産総額( - )	192,827,050,108円
発行済数量	90,455,420,379口
1口当たり純資産額( / )	2.1317円

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	544,169,680,970円
負債総額	423,857,008円
純資産総額( - )	543,745,823,962円
発行済数量	189,616,255,327口
1口当たり純資産額( / )	2.8676円

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	71,130,348,198円
負債総額	3,300,329,971円
純資産総額( - )	67,830,018,227円
発行済数量	71,007,042,182口
1口当たり純資産額( / )	0.9553円

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	54,123,469,819円
負債総額	365,068,195円
純資産総額( - )	53,758,401,624円
発行済数量	34,690,041,845口
1口当たり純資産額( / )	1.5497円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

##### (1) 資本金の額

2021年12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

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

<訂正後>

##### (1) 資本金の額

2022年6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

###### 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。

###### 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】

<訂正前>

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

2021年12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	430	70,297
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	140	26,199
単位型公社債投資信託	0	0
合計	570	96,497

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

<訂正後>

「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6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	425	68,547
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	142	24,209
単位型公社債投資信託	0	0
合計	567	92,757

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

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### 1．財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。



## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		40,822,894		38,492,350
有価証券		-		6,249,635
前払費用		718,688		763,755
未収委託者報酬		5,412,597		6,157,565
未収運用受託報酬		2,425,363		3,219,400
未収投資助言報酬		216,401		265,131
その他		38,899		8,403
流動資産合計		49,634,844		55,156,243
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	130,411	1	150,311
車両	1	1,454	1	968
器具備品	1	125,816	1	103,050
有形固定資産合計		257,681		254,330
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		1,225,315		1,840,943
ソフトウェア仮勘定		359,445		577,731
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,592,774		2,426,688
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		37,058,043		30,679,401
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		237,055		10,629
差入保証金		382,751		374,819
繰延税金資産		1,200,554		1,413,142
その他		15,154		10,305
投資その他の資産合計		38,959,781		32,554,521
固定資産合計		40,810,238		35,235,540
資産合計		90,445,083		90,391,783

## 負債の部

## 流動負債

預り金		47,039		51,241
未払収益分配金		5,643		8,706
未払手数料	2	1,911,775	2	2,315,345
未払運用委託報酬	2	1,871,193	2	1,728,950
未払投資助言報酬	2	1,147,828	2	828,040
その他未払金	2	4,839,326	2	4,619,477
未払費用	2	132,085	2	134,086
未払法人税等		1,042,946		611,046
未払消費税等		904,947		349,108
賞与引当金		1,123,336		1,227,440
その他		82,891		93,579
流動負債合計		13,109,013		11,967,023

## 固定負債

退職給付引当金		2,155,971		2,423,289
役員退職慰労引当金		27,450		16,750
固定負債合計		2,183,421		2,440,039

## 負債合計

負債合計		15,292,435		14,407,063
------	--	------------	--	------------

## 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		55,045,550		56,866,270
利益剰余金合計		55,725,357		57,546,077
株主資本合計		74,007,197		75,827,917

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		1,242,655		348,871
繰延ヘッジ損益		97,204		192,067
評価・換算差額等合計		1,145,450		156,803

## 純資産合計

純資産合計		75,152,647		75,984,720
-------	--	------------	--	------------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計		90,445,083		90,391,783
----------	--	------------	--	------------

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,838,624	29,144,394
運用受託報酬	18,630,497	17,750,312
投資助言報酬	878,199	1,032,738
営業収益計	46,347,320	47,927,445
営業費用		
支払手数料	10,412,572	11,524,989
広告宣伝費	17,988	62,919
公告費	-	125
調査費	8,251,721	8,730,925
支払運用委託報酬	2,916,886	3,825,413
支払投資助言報酬	3,866,188	3,083,142
委託調査費	129,355	125,430
調査費	1,339,290	1,696,938
委託計算費	256,942	277,534
営業雑経費	760,920	846,156
通信費	64,179	59,759
印刷費	176,812	173,841
協会費	40,454	38,262
その他営業雑経費	479,472	574,292
営業費用計	19,700,144	21,442,649
一般管理費		
役員報酬	126,093	150,830
給料・手当	4,103,410	4,699,931
賞与引当金繰入額	1,120,241	1,184,037
賞与	280,494	369,403
福利厚生費	797,392	925,165
退職給付費用	359,252	431,379
役員退職慰労引当金繰入額	7,150	8,950
その他人件費	166,126	162,879
不動産賃借料	716,925	766,098
その他不動産経費	32,816	36,278
交際費	6,766	12,883
旅費交通費	8,778	17,654
固定資産減価償却費	477,830	552,239
租税公課	395,649	385,352
業務委託費	315,850	349,177
器具備品費	357,066	484,762
保険料	45,818	46,907
寄付金	30,000	5,126
諸経費	226,790	247,185
一般管理費計	9,574,455	10,836,244
営業利益	17,072,720	15,648,550
営業外収益		
受取利息	289	2,029
有価証券利息	4,705	3,452
受取配当金	1 74,260	1 83,809
金融派生商品収益	40,753	-

為替差益	-			27,680
団体定期保険配当金	8,833			13,992
その他営業外収益	5,810			5,963
営業外収益計	134,653			136,927
営業外費用				
為替差損	32,651			-
金融派生商品費用	24,611			-
控除対象外消費税	3,018			20,188
その他営業外費用	4,203			404
営業外費用計	64,485			20,592
経常利益	17,142,888			15,764,885
特別利益				
投資有価証券売却益	3,376			18,927
投資有価証券償還益	20,904			510,138
特別利益計	24,280			529,065
特別損失				
投資有価証券売却損	49,202			7,280
投資有価証券償還損	105,236			50,697
固定資産除却損	2	870	2	132
事故損失賠償金	3	12,614	3	9,883
特別損失計	167,924			67,993
税引前当期純利益	16,999,244			16,225,956
法人税、住民税及び事業税	5,395,622			4,940,051
法人税等調整額	196,661			24,895
法人税等合計	5,198,960			4,964,946
当期純利益	11,800,283			11,261,009

## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自2021年4月1日 至2022年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,440,289	9,440,289	9,440,289
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	11,261,009	11,261,009	11,261,009
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,820,719	1,820,719	1,820,719
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,440,289
当期純利益	-	-	-	11,261,009
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	893,783	94,862	988,646	988,646
当期変動額合計	893,783	94,862	988,646	832,073
当期末残高	348,871	192,067	156,803	75,984,720

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>

5．収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p><b>投資信託委託業務</b>  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。  委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p><b>投資運用業務</b>  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。  運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、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。また、成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。</p> <p><b>投資助言業務</b>  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。  投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、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おります。</p>
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、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。</p>
7．ヘッジ会計の方法	<p><b>ヘッジ会計の方法</b>  繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p><b>ヘッジ手段とヘッジ対象</b>  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</p> <p><b>ヘッジ方針</b>  ヘッジ指定は、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について、原則として個々取引毎に行います。</p> <p><b>ヘッジ有効性評価の方法</b>  ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
8．消費税等の会計処理	<p>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。</p>



9. 連結納税	<p>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。</p>
---------	--

## (会計方針の変更)

### 1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当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、当会計期間に係る財務諸表への影響はありません。また、利益剰余金の当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、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。

## (未適用の会計基準等)

- ・「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 2021年6月17日 企業会計基準委員会）

### (1) 概要

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第31号）の2021年6月17日の改正は、2019年7月4日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、「時価の算定に関する会計基準」公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

### (2) 適用予定日

2023年3月期の期首から適用します。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の運用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

- ・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会）

### (1) 概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取り扱いを明らかにすることを目的として企業会計基準委員会から公表されたものです。

### (2) 適用年月日

2023年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の運用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

## (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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物附属設備	318,792千円	329,011千円
車両	5,275	5,760
器具備品	447,285	494,576
計	771,352	829,348

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、その金額は前事業年度および当事業年度においてそれぞれ4,960,571千円、5,317,615千円であります。

## (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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
受取配当金	9,823千円	42,069千円

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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
器具備品	870	132
計	870	132

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2020年4月1日 至2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2021年6月30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	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

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

2022年6月30日開催の定時株主総会において、以下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	9,008,883千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	83,071円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022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、以下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金融商品または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。

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
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
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。

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,319,017	17,308,937	10,080
その他有価証券	19,610,019	19,610,019	-
資産計	75,421,387	75,411,306	10,080
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	73,870	73,870	-
デリバティブ取引計	73,870	73,870	-

( ) 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) 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 (2021年3月31日)
関係会社株式	66,222

市場価格のない株式等

(単位:千円)

区分	当事業年度 (2022年3月31日)
関係会社株式	66,222

### 3. 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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

当事業年度（2022年3月31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	-	73,870	-	73,870
合計	-	73,870	-	73,870

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

なお、投資信託の時価は上記に含めておりません。投資信託の貸借対照表計上額は19,610,019千円であります。

#### (2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

当事業年度（2022年3月31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	-	17,308,937	-	17,308,937
合計	-	17,308,937	-	17,308,937

#### (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。



4. 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(2021年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2022年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	38,492,350	-	-	-
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	6,250,000	11,070,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	6,108,860	12,060,309	1,121,260	101,009
合計	50,851,210	23,130,309	1,121,260	101,009

(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(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

当事業年度(2022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	4,899,207	4,900,290	1,082
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	4,899,207	4,900,290	1,082
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	12,419,810	12,408,647	11,163
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,419,810	12,408,647	11,163
合計		17,319,017	17,308,937	10,080

## 2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式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。

当事業年度（2022年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	10,012,022	9,238,000	774,022
	小計	10,012,022	9,238,000	774,022
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	9,597,996	10,017,000	419,003
	小計	9,597,996	10,017,000	419,003
	合計	19,610,019	19,255,000	355,019

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には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

当事業年度（自2021年4月1日 至2022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	72,646	18,927	7,280
合計	72,646	18,927	7,280

## (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（2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2022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（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。

当事業年度（2022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	1,264,288	-	73,870
合計			1,264,288	-	73,870

(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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,833,391 千円	2,049,929 千円
勤務費用	247,178	296,556
利息費用	5,766	5,724
数理計算上の差異の発生額	28,155	26,217
退職給付の支払額	65,497	58,809
その他	936	4,869
退職給付債務の期末残高	2,049,929	2,324,488

## (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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	117,355 千円	134,197 千円
退職給付費用	19,053	19,557
退職給付の支払額	1,275	1,342
その他	936	4,869
退職給付引当金の期末残高	134,197	147,543

## (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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,184,126 千円	2,472,031 千円
未認識数理計算上の差異	28,155	48,741
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,155,971	2,423,289
退職給付引当金	2,155,971	2,423,289
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,155,971	2,423,289

## (4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	19,053 千円	19,557 千円
勤務費用	247,178	296,556
利息費用	5,766	5,724
数理計算上の差異の当期費用処理額	-	5,631
確定給付制度に係る退職給付費用	271,997	327,469

## (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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
割引率	0.28 %	0.35 %

## 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64,693千円、当事業年度において68,995千円であり、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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	343,965 千円	375,842 千円
未払事業税	216,469	134,561
退職給付引当金	660,158	742,011
税務上の繰延資産償却超過額	2,848	1,565
役員退職慰労引当金	8,405	5,128
投資有価証券評価差額	156,971	140,574
減価償却超過額	-	38,704
その他	96,541	128,909
小計	1,485,360	1,567,297
評価性引当額	10	1,808
繰延税金資産合計	1,485,350	1,565,488
繰延税金負債		
特別分配金否認	4,093	6,396
投資有価証券評価差額	280,701	145,949
繰延税金負債合計	284,795	152,345
繰延税金資産(は負債)の純額	1,200,554	1,413,142

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。

当事業年度（自2021年4月1日 至2022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

（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	6,500,632

## [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。

## (収益認識関係)

## 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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。

(単位：千円)

区分	第27期事業年度 (自 2021年4月 1日 至2022年3月31日)
営業収益	
投資信託委託業務	29,144,394
投資運用業務(注)	17,750,312
投資助言業務	1,032,738
計	47,927,445

(注) 成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

## 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の「5. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りでございます。

## ( 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

当事業年度（自2021年4月1日 至2022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	6,521,634	未収運用受託報酬	1,657,146
								投資助言報酬の受取	120,504	未収投資助言報酬	11,837
								連結納税	3,919,311	その他未払金	3,919,311

(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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	692,983円25銭	700,655円80銭
1株当たり当期純利益金額	108,810円52銭	103,837円87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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	11,800,283千円	11,261,009千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	11,800,283千円	11,261,009千円
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。

## 5【その他】

### <訂正前>

#### 定款の変更等

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

#### <変更前>

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

#### <変更後>

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

#### 訴訟その他の重要事項

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

### <訂正後>

#### 定款の変更等

該当事項はありません。

#### 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】

<訂正前>

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2021年3月末現在、324,279百万円

##### c. 事業の内容

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

#### (参考) 再信託受託会社の概況

##### a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2021年3月末現在、10,000百万円

##### c. 事業の内容

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

#### (2) 販売会社

(資本金の額：2021年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,400,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

2021年3月末現在、450百万円

##### c. 事業の内容

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

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

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

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

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

### 3【資本関係】

- (1) 日本生命保険相互会社（販売会社）は、委託会社の株式を108,448株（持株比率100%）保有しています。
- (2) 委託会社は、株式会社ニッセイ基礎研究所（投資助言会社）の株式を1,350株（持株比率15.0%）保有しています（参考情報）。  
委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

<訂正後>

#### 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

2022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

2022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：2022年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,450,000	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

2022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。

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2025の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2025の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2030の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2030の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2035の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2035の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2040の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2040の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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



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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26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ニッセイターゲットデートファンド2045の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2045の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2050の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2050の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2055の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2055の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2060の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2060の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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



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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2025の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2025の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2030の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2030の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2035の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2035の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2040の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2040の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2045の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2045の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2050の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2050の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2055の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2055の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月15日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2060の2021年12月21日から2022年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイターゲットデートファンド2060の2022年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年12月21日から2022年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2022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 大竹 新

## 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2022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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

## 利害関係

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

以上

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