【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年2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
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	＜購入・換金手数料なし＞ ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額　上限１兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

① 契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

② 委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。
申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。
なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2023年2月21日から2023年8月18日まで
○ 継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター ０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ https://www.nam.co.jp/

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

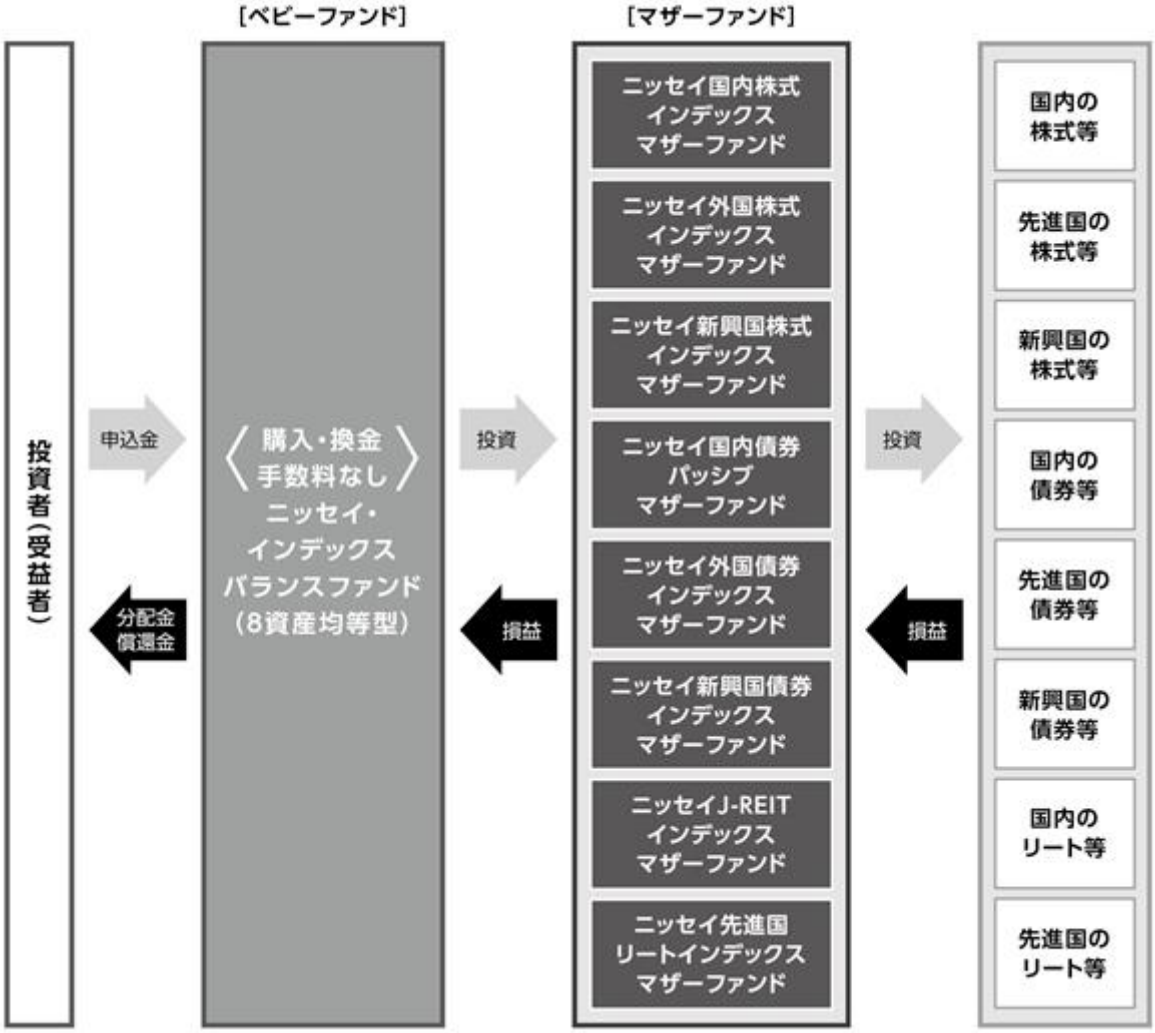
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



③　ファンドの特色

1国内外の株式・債券・リート（不動産投資信託証券）に分散投資を行います。

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

【投資対象とするマザーファンド】

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

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

●組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ※を行いません。

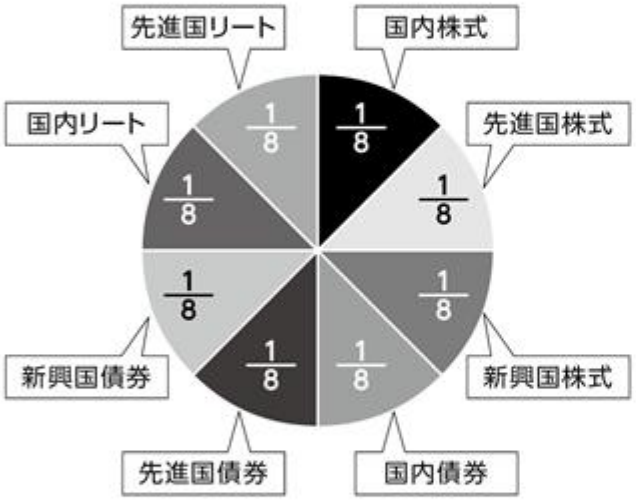
※為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

2 8つの資産への投資割合は均等を基本とします。

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

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

<基本投資割合>



<各マザーファンドの運用プロセス>

〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

3 購入時および換金時の手数料は無料です。

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

・保有期間中に運用管理費用（信託報酬）等をファンドからご負担いただきます。

〈各指数について〉

●TOPIX（東証株価指数）

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。

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●NOMURA−BPI総合

日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

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

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）はJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（以下「EMBI+」といいます）から格付がB格以下の債券等を除いたものです。
EMBI+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付債券等やローンを対象としています。
JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複写、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・転載を禁じます。
なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

●東証REIT指数

東証REIT指数とは、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先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）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SPDJI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、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

＜ＭＳＣＩ指数にかかる免責条項等＞

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

④　信託金の上限

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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）	補足分類
単　位　型 追　加　型	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特　殊　型

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

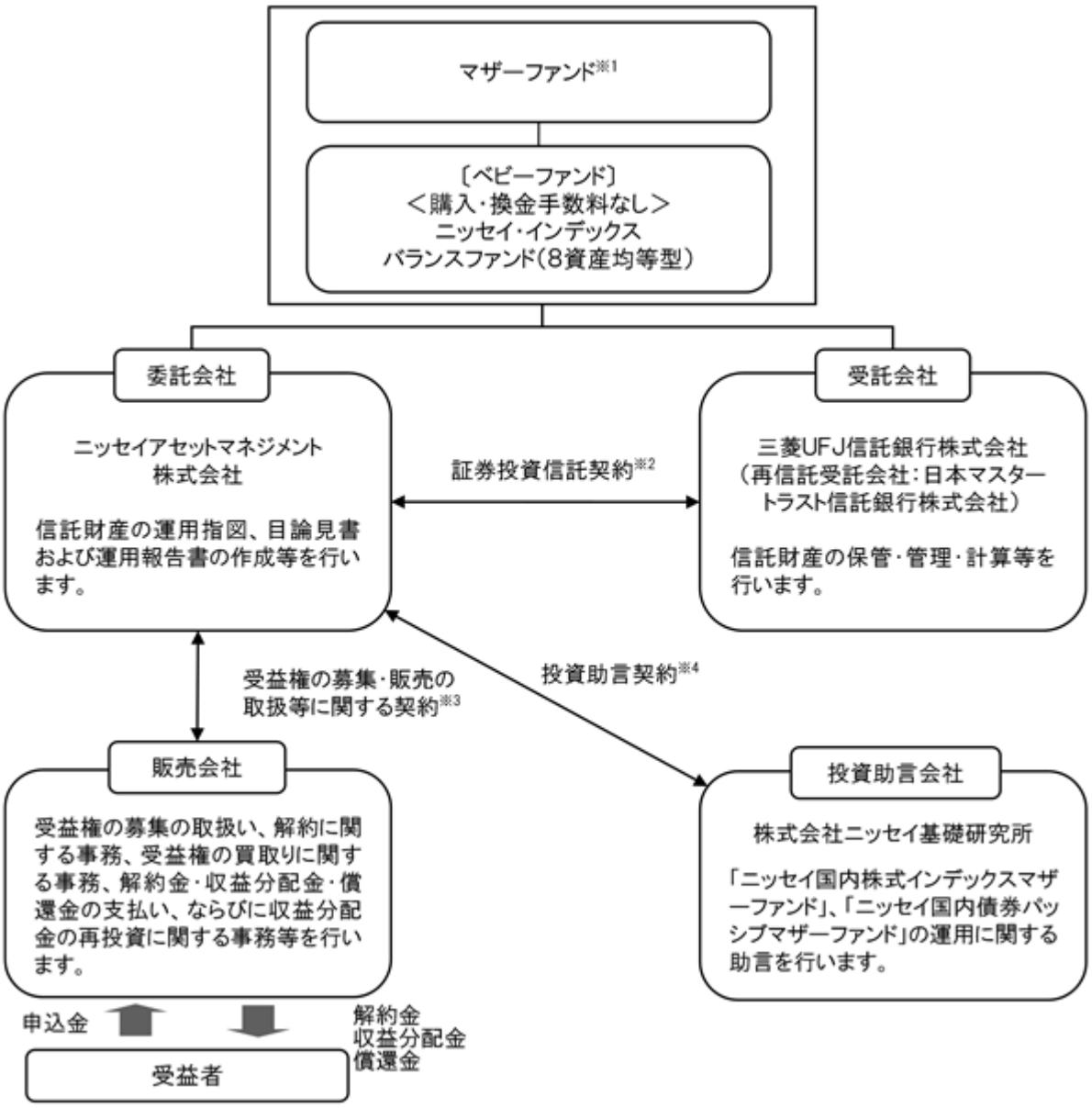
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式・債券・ 不動産投信） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）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

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

（２）【ファンドの沿革】

2018年2月13日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



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

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

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

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

委託会社の概況（2022年11月末現在）

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

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

・大株主の状況

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

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

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

② 各マザーファンドへの基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の８分の１とします。
③ 各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。
④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

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

ｂ　投資態度

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

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

③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

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

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

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

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

③　組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

（3）投資制限

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

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

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

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

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

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

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

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。

②　不動産投資信託証券への投資にあたっては、東証ＲＥＩＴ指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証ＲＥＩＴ指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜不動産投資信託証券の追加・見直しを行います。

③　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

（3）投資制限

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　デリバティブの直接利用は行いません。

⑥　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b　投資態度

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

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b　投資態度

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

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

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

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

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

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

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

ｂ　投資態度

①　主として、世界各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国の不動産投資信託証券に投資することにより、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

②　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

②　株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。

③　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます）を主要投資対象とします。

b　投資態度

①　主として新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます）に投資することにより、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。

④　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑥　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑦　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑧　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

b　投資態度

①　主として新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くＢ格以下）（円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

②　公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

④　投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

（２）【投資対象】

ａ　主な投資対象

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

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

ｂ　約款に定める投資対象

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限　ｂ　約款に定めるその他の投資制限　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　有価証券

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

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

③　金融商品

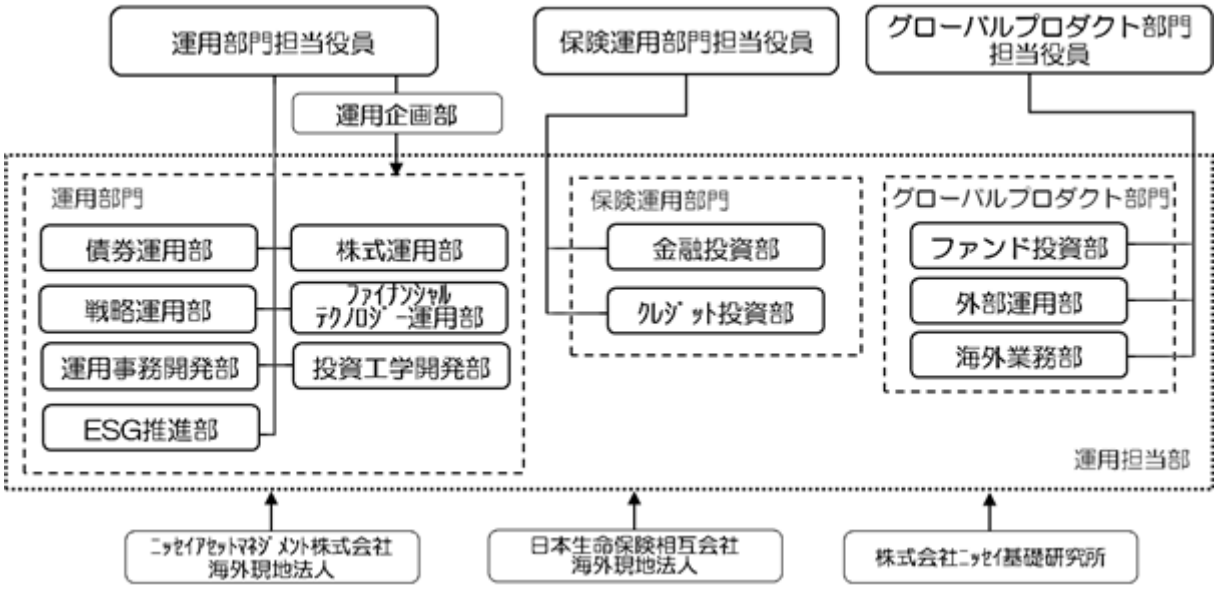
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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

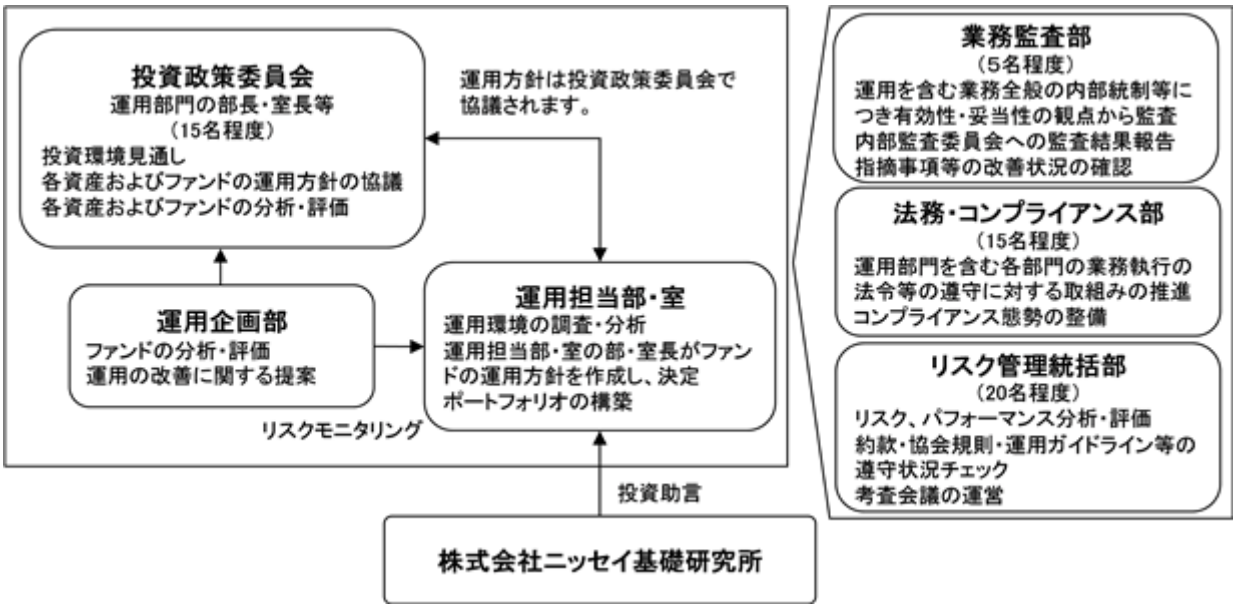
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



＜受託会社に対する管理体制等＞

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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（4）【分配方針】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1．分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2．分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

○　信託財産の十分な成長に資することに配慮し、分配を抑制する方針です。

3．留保益の運用方針

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

②　分配時期

毎決算日とし、決算日は11月20日（年１回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

③　支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

税金を差引いた後、原則として決算日から起算して５営業日目までにお支払いします。

＜分配金再投資コースの場合＞

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

○　将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

②　同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑥　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

⑦　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑧　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

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

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

②　信用取引の範囲

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

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

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

③　先物取引等

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

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

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

④　スワップ取引

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

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

３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

⑦　有価証券の空売り

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

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

２．前記１．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。

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

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

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

⑩　資金の借入れ

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

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

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

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

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

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

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

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

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

3【投資リスク】

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

リートの価格は、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－ＲＥＩＴの税制に関するリスク

一般に、Ｊ－ＲＥＩＴ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－ＲＥＩＴ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。

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・新興国の株式および債券投資に関する留意点

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社および委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2022年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に以下の通り保有しています。

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

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（%）	
	委託会社※	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	―	3.6
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	80.7	―
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	―	42.4

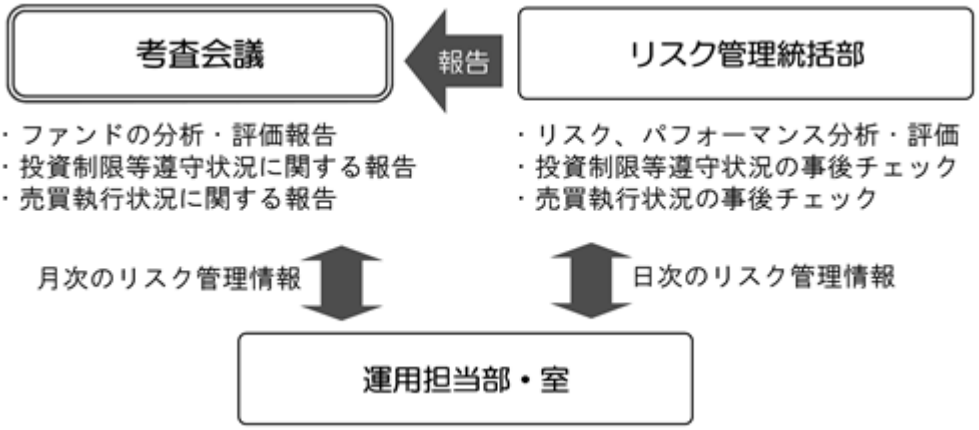
※　委託会社については実質保有比率が５%超のマザーファンドを記載しています。

・流動性に関する留意点

ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。

これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受付けを中止する、また既に受付けた換金の申込みの受付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

（2）投資リスク管理体制



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

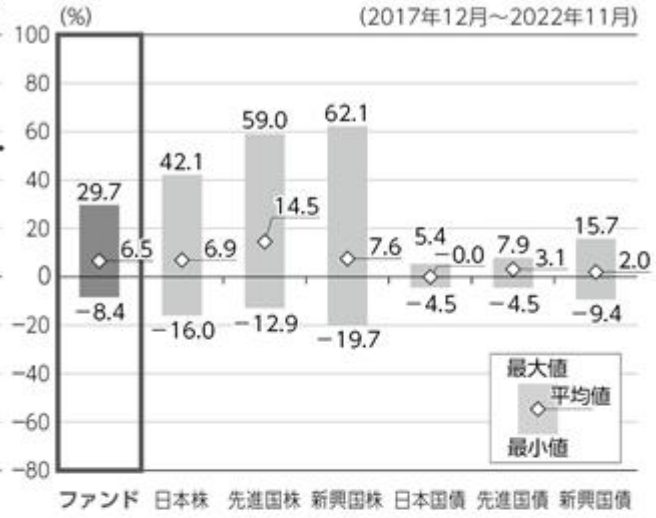
○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

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

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1749%（税抜0.159%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。

なお、2023年2月21日現在の信託報酬率は年0.1749%（税抜0.159%）であり、その配分は次の通りとします。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

（4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

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

＜ご参考＞

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

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

（5）【課税上の取扱い】

課税対象

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

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

買取請求時：買取請求時の買取価額と取得価額※の差益に対して課税されます。

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

個人の課税の取扱い

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

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

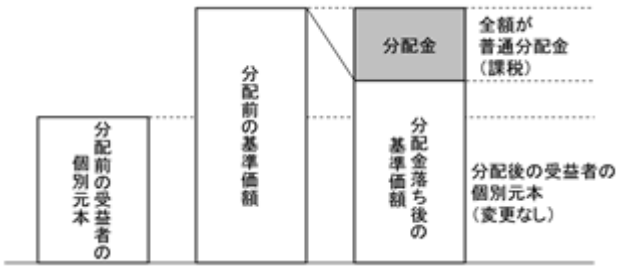
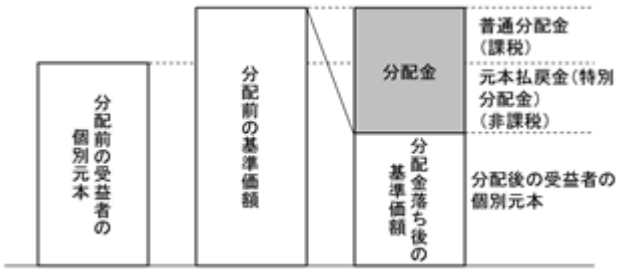
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		518,086,660	100.00
	内　日本	518,086,660	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△2,484	△0.00
純資産総額		518,084,176	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11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		179,201,965,590	97.17
	内　日本	179,201,965,590	97.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,220,503,864	2.83
純資産総額		184,422,469,454	100.00

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		5,174,000,000	2.81
	内　日本	5,174,000,000	2.81

（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11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		52,181,007,360	76.33
	内　日本	52,181,007,360	76.33
地方債証券		4,319,797,908	6.32
	内　日本	4,319,797,908	6.32
特殊債券		5,750,273,985	8.41
	内　日本	5,750,273,985	8.41
社債券		5,527,336,000	8.09
	内　日本	5,128,015,200	7.50
	内　スウェーデン	200,716,600	0.29
	内　フランス	198,604,200	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		585,838,049	0.86
純資産総額		68,364,253,302	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		32,240,504,450	98.51
	内　日本	32,240,504,450	98.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		486,771,933	1.49
純資産総額		32,727,276,383	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		563,266,378,882	95.68
	内　アメリカ	399,135,327,320	67.80
	内　イギリス	25,246,468,868	4.29
	内　カナダ	21,974,099,399	3.73
	内　スイス	19,550,914,879	3.32
	内　フランス	18,691,864,721	3.18
	内　ドイツ	13,799,237,054	2.34
	内　オーストラリア	12,838,668,312	2.18
	内　オランダ	10,011,713,457	1.70
	内　アイルランド	7,754,343,378	1.32
	内　スウェーデン	5,766,982,640	0.98
	内　デンマーク	4,740,339,683	0.81
	内　スペイン	4,114,315,962	0.70
	内　香港	4,047,792,541	0.69
	内　イタリア	3,334,631,474	0.57
	内　シンガポール	2,049,272,309	0.35
	内　フィンランド	1,725,017,759	0.29
	内　ベルギー	1,644,818,078	0.28
	内　ノルウェー	1,359,412,087	0.23
	内　ジャージィー	1,242,713,558	0.21
	内　イスラエル	1,096,704,616	0.19
	内　オランダ領キュラソー	869,029,316	0.15
	内　バミューダ	580,522,268	0.10
	内　ケイマン諸島	396,844,712	0.07
	内　ポルトガル	377,357,816	0.06
	内　ニュージーランド	331,174,386	0.06
	内　オーストリア	326,239,226	0.06
	内　ルクセンブルグ	260,573,063	0.04
投資証券		13,015,681,096	2.21
	内　アメリカ	11,228,548,477	1.91
	内　オーストラリア	773,741,853	0.13
	内　シンガポール	261,572,977	0.04
	内　イギリス	250,488,293	0.04
	内　フランス	218,459,155	0.04
	内　香港	171,680,739	0.03
	内　カナダ	62,044,787	0.01
	内　ベルギー	49,144,815	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,426,719,492	2.11
純資産総額		588,708,779,470	100.00

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		11,872,637,217	2.02
	内　アメリカ	8,775,736,893	1.49
	内　ドイツ	2,208,538,945	0.38
	内　イギリス	888,361,379	0.15

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		55,829,372,992	98.98
	内　アメリカ	28,186,143,839	49.97
	内　フランス	4,834,028,547	8.57
	内　イタリア	4,302,516,346	7.63
	内　ドイツ	3,733,590,758	6.62
	内　スペイン	2,908,025,056	5.16
	内　イギリス	2,673,562,554	4.74
	内　中国	1,797,907,688	3.19
	内　カナダ	1,158,408,282	2.05
	内　ベルギー	1,068,675,861	1.89
	内　オランダ	906,708,307	1.61
	内　オーストラリア	866,933,869	1.54
	内　オーストリア	670,363,407	1.19
	内　メキシコ	478,868,518	0.85
	内　アイルランド	364,059,415	0.65
	内　マレーシア	296,549,918	0.53
	内　フィンランド	289,569,191	0.51
	内　シンガポール	259,779,599	0.46
	内　ポーランド	239,251,169	0.42
	内　デンマーク	208,957,940	0.37
	内　イスラエル	208,214,145	0.37
	内　スウェーデン	143,529,408	0.25
	内　ニュージーランド	117,641,560	0.21
	内　ノルウェー	116,087,615	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		574,203,129	1.02
純資産総額		56,403,576,121	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		5,824,776,284	98.82
	内　アメリカ	4,555,963,152	77.30
	内　オーストラリア	403,391,052	6.84
	内　イギリス	274,845,142	4.66
	内　シンガポール	199,238,158	3.38
	内　カナダ	108,182,762	1.84
	内　フランス	101,261,722	1.72
	内　香港	71,488,935	1.21
	内　ベルギー	47,863,407	0.81
	内　スペイン	22,073,674	0.37
	内　ニュージーランド	17,956,034	0.30
	内　オランダ	11,045,992	0.19
	内　イスラエル	7,768,025	0.13
	内　ガーンジィ	1,549,030	0.03
	内　アイルランド	1,090,508	0.02
	内　ドイツ	532,452	0.01
	内　イタリア	526,239	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		69,381,602	1.18
純資産総額		5,894,157,886	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		4,440,816,834	80.80
	内　インド	722,847,686	13.15
	内　台湾	688,659,914	12.53
	内　韓国	575,678,081	10.47
	内　香港	539,494,447	9.82
	内　中国	512,104,826	9.32
	内　ケイマン諸島	281,071,673	5.11
	内　ブラジル	257,431,051	4.68
	内　南アフリカ	178,455,145	3.25
	内　アメリカ	122,677,142	2.23
	内　メキシコ	113,416,422	2.06
	内　タイ	102,818,050	1.87
	内　インドネシア	97,659,587	1.78
	内　マレーシア	70,370,739	1.28
	内　フィリピン	38,564,236	0.70
	内　ポーランド	31,716,712	0.58
	内　チリ	26,650,235	0.48
	内　トルコ	23,801,506	0.43
	内　バミューダ	16,800,628	0.31
	内　ギリシャ	15,029,580	0.27
	内　ハンガリー	9,464,655	0.17
	内　チェコ	7,971,701	0.15
	内　コロンビア	6,539,582	0.12
	内　オランダ	998,822	0.02
	内　ペルー	592,881	0.01
	内　ロシア	1,481	0.00
	内　イギリス	48	0.00
	内　イギリス領バージン諸島	4	0.00
投資信託受益証券		371,134,624	6.75
	内　アメリカ	371,134,624	6.75
投資証券		5,524,624	0.10
	内　メキシコ	3,260,014	0.06
	内　南アフリカ	2,264,610	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		678,696,355	12.35
純資産総額		5,496,172,437	100.00

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		697,061,436	12.68
	内　アメリカ	697,061,436	12.68

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		1,454,398,910	97.56
	内　サウジアラビア	182,492,952	12.24
	内　カタール	162,108,225	10.87
	内　アラブ首長国連邦	146,167,060	9.80
	内　メキシコ	139,066,916	9.33
	内　チリ	110,276,109	7.40
	内　ドミニカ共和国	85,157,165	5.71
	内　オマーン	80,302,687	5.39
	内　中国	74,903,699	5.02
	内　ブラジル	69,765,510	4.68
	内　インドネシア	69,484,159	4.66
	内　パナマ	62,698,137	4.21
	内　コロンビア	58,351,784	3.91
	内　ペルー	47,349,211	3.18
	内　フィリピン	46,112,893	3.09
	内　南アフリカ	46,067,900	3.09
	内　ハンガリー	37,876,514	2.54
	内　ウルグアイ	29,737,065	1.99
	内　ルーマニア	6,480,924	0.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		36,359,716	2.44
純資産総額		1,490,758,626	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	29,002,202	2.2722 65,901,547	2.2873 66,336,736	－ －	12.80
2	ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	57,633,462	1.1478 66,154,690	1.1502 66,290,007	－ －	12.80
3	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	33,586,231	1.9222 64,562,057	1.9300 64,821,425	－ －	12.51
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	21,311,959	3.0643 65,308,365	3.0349 64,679,664	－ －	12.48
5	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	45,497,741	1.4227 64,732,442	1.4157 64,411,151	－ －	12.43
6	ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	55,258,514	1.1544 63,795,011	1.1654 64,398,272	－ －	12.43
7	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	67,836,753	0.9477 64,294,956	0.9434 63,997,192	－ －	12.35
8	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	41,389,575	1.5301 63,332,723	1.5258 63,152,213	－ －	12.19

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年11月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	3,428,900	2,139.15 7,334,956,700	2,010.50 6,893,803,450	－ －	3.74
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	441,700	11,615.82 5,130,711,845	11,255.00 4,971,333,500	－ －	2.70

3	キーエンス 日本	株式 電気機器	62,500	50,574.94 3,160,934,032	57,140.00 3,571,250,000	－ －	1.94
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	802,500	3,636.62 2,918,390,887	3,820.00 3,065,550,000	－ －	1.66
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,032,100	740.70 2,986,582,736	755.10 3,044,638,710	－ －	1.65
6	第一三共 日本	株式 医薬品	545,600	2,979.86 1,625,813,931	4,518.00 2,465,020,800	－ －	1.34
7	任天堂 日本	株式 その他製品	394,200	5,844.34 2,303,840,655	5,894.00 2,323,414,800	－ －	1.26
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	316,700	6,254.18 1,980,699,089	7,299.00 2,311,593,300	－ －	1.25
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	554,200	3,593.00 1,991,240,985	4,050.00 2,244,510,000	－ －	1.22
10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	362,100	5,143.93 1,862,619,119	5,952.00 2,155,219,200	－ －	1.17
11	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	449,400	4,160.18 1,869,585,443	4,673.00 2,100,046,200	－ －	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	475,200	4,469.71 2,124,008,289	4,329.00 2,057,140,800	－ －	1.12
13	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	484,000	4,091.66 1,980,365,879	4,111.00 1,989,724,000	－ －	1.08
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	44,100	53,616.76 2,364,499,309	45,090.00 1,988,469,000	－ －	1.08
15	三井物産 日本	株式 卸売業	483,400	3,096.15 1,496,683,666	3,983.00 1,925,382,200	－ －	1.04
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	413,100	4,161.87 1,719,269,157	4,605.00 1,902,325,500	－ －	1.03
17	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	134,900	13,965.47 1,883,943,060	14,060.00 1,896,694,000	－ －	1.03
18	信越化学工業 日本	株式 化学	107,000	17,209.86 1,841,455,194	17,570.00 1,879,990,000	－ －	1.02
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	619,300	2,411.75 1,493,597,081	2,827.00 1,750,761,100	－ －	0.95
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	407,100	3,779.66 1,538,703,416	4,287.00 1,745,237,700	－ －	0.95
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	507,600	3,507.45 1,780,383,298	3,356.00 1,703,505,600	－ －	0.92
22	ダイキン工業 日本	株式 機械	75,300	20,851.38 1,570,109,079	22,405.00 1,687,096,500	－ －	0.91

23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	889,400	1,570.92 1,397,182,006	1,717.00 1,527,099,800	－ －	0.83
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,006,100	1,480.90 1,489,934,604	1,497.50 1,506,634,750	－ －	0.82
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	189,400	7,933.67 1,502,638,121	7,464.00 1,413,681,600	－ －	0.77
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	67,900	20,130.05 1,366,830,637	19,720.00 1,338,988,000	－ －	0.73
27	日本電産 日本	株式 電気機器	153,200	9,228.79 1,413,850,959	8,534.00 1,307,408,800	－ －	0.71
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	600,200	2,014.75 1,209,253,785	2,128.00 1,277,225,600	－ －	0.69
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	227,700	5,514.84 1,255,729,473	5,579.00 1,270,338,300	－ －	0.69
30	ＳＭＣ 日本	株式 機械	20,500	65,328.54 1,339,235,241	61,760.00 1,266,080,000	－ －	0.69

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	16.92
		情報・通信業	8.57
		輸送用機器	7.52
		化学	5.97
		卸売業	5.77
		医薬品	5.60
		銀行業	5.40
		サービス業	5.24
		機械	5.03
		小売業	4.37
		食料品	3.40
		陸運業	3.09
		精密機器	2.67
		その他製品	2.30
		保険業	2.29
		不動産業	2.06
		建設業	1.89
		電気・ガス業	1.16
		その他金融業	1.09
		鉄鋼	0.77
		ゴム製品	0.72
		証券、商品先物取引業	0.71
		非鉄金属	0.71
		ガラス・土石製品	0.68
		海運業	0.58
		金属製品	0.55
		空運業	0.50
		石油・石炭製品	0.47
		繊維製品	0.44
		鉱業	0.31
		パルプ・紙	0.17
		倉庫・運輸関連業	0.14
		水産・農林業	0.09
	小計		97.17
合　計（対純資産総額比）			97.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	第３５０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	637,000,000	100.39 639,484,300	99.84 635,993,540	0.1 2028/3/20	0.93
2	第３６４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	598,000,000	99.14 592,895,030	98.32 587,989,480	0.1 2031/9/20	0.86
3	第３５１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	564,000,000	100.40 566,256,000	99.77 562,753,560	0.1 2028/6/20	0.82
4	第３６５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	566,000,000	98.97 560,185,900	98.41 557,000,600	0.1 2031/12/20	0.81

5	第３３８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	519,000,000	101.08 524,608,950	100.95 523,951,260	0.4 2025/3/20	0.77
6	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	100.95 504,756,000	0.66 2024/5/31	0.74
7	第１４４回　利付国債（５年） 日本	国債証券	497,000,000	100.36 498,798,860	100.29 498,456,210	0.1 2025/6/20	0.73
8	第３４１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	493,000,000	101.15 498,688,650	100.93 497,589,830	0.3 2025/12/20	0.73
9	第３４９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	494,000,000	100.40 495,976,000	99.87 493,377,560	0.1 2027/12/20	0.72
10	第３４０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	470,000,000	101.44 476,768,000	101.14 475,400,300	0.4 2025/9/20	0.70
11	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	472,000,000	100.38 473,804,400	100.20 472,953,440	0.1 2026/12/20	0.69
12	第３６３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	480,000,000	99.46 477,408,920	98.41 472,387,200	0.1 2031/6/20	0.69
13	第３６１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	467,000,000	99.78 465,976,200	98.62 460,560,070	0.1 2030/12/20	0.67
14	第３６２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	466,000,000	99.61 464,206,160	98.50 459,010,000	0.1 2031/3/20	0.67
15	第１４９回　利付国債（５年） 日本	国債証券	456,000,000	99.95 455,772,000	99.90 455,566,800	0.005 2026/9/20	0.67
16	第３４２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	423,000,000	100.42 424,776,600	100.31 424,323,990	0.1 2026/3/20	0.62
17	第１５３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	408,000,000	99.71 406,841,280	99.61 406,425,120	0.005 2027/6/20	0.59
18	第１４２回　利付国債（５年） 日本	国債証券	405,000,000	100.44 406,789,890	100.25 406,036,800	0.1 2024/12/20	0.59
19	第４４１回　利付国債（２年） 日本	国債証券	400,000,000	100.12 400,508,000	100.08 400,328,000	0.005 2024/10/1	0.59
20	第２５回　首都高速道路債券 日本	社債券	400,000,000	99.78 399,141,600	99.71 398,841,200	0.03 2024/9/20	0.58
21	第５回　電通グループ 日本	社債券	400,000,000	100.19 400,778,800	99.55 398,211,600	0.32 2027/7/8	0.58

22	第３３９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	387,000,000	101.32 392,142,000	101.05 391,094,460	0.4 2025/6/20	0.57
23	第３３４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	387,000,000	101.39 392,413,200	101.00 390,870,000	0.6 2024/6/20	0.57
24	第３５７回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	100.19 384,729,600	99.20 380,931,840	0.1 2029/12/20	0.56
25	第３５８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	100.11 384,422,400	99.06 380,413,440	0.1 2030/3/20	0.56
26	第３６８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	381,000,000	99.57 379,372,410	99.52 379,175,010	0.2 2032/9/20	0.55
27	第１４３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	377,000,000	100.32 378,243,980	100.26 377,995,280	0.1 2025/3/20	0.55
28	第１４１回　利付国債（５年） 日本	国債証券	377,000,000	100.30 378,166,850	100.24 377,916,110	0.1 2024/9/20	0.55
29	第３５６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	380,000,000	100.26 380,988,000	99.36 377,575,600	0.1 2029/9/20	0.55
30	第３５２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	370,000,000	100.39 371,443,000	99.74 369,041,700	0.1 2028/9/20	0.54

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	76.33
		特殊債券	8.41
		社債券	7.50
		地方債証券	6.32
	小計		98.56
	外国	社債券	0.58
	小計		0.58
合　計（対純資産総額比）			99.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,417	646,955.26 2,210,646,134	640,000.00 2,186,880,000	－ －	6.68
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,929	603,000.09 1,766,187,288	609,000.00 1,783,761,000	－ －	5.45
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	9,471	167,408.93 1,585,530,056	172,500.00 1,633,747,500	－ －	4.99
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,778	105,905.51 1,565,071,738	110,100.00 1,627,057,800	－ －	4.97
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,799	333,490.34 1,600,420,178	337,500.00 1,619,662,500	－ －	4.95
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	9,454	155,592.60 1,470,972,518	154,000.00 1,455,916,000	－ －	4.45
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,415	304,502.11 1,344,376,824	307,500.00 1,357,612,500	－ －	4.15
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,836	186,700.06 1,089,581,591	193,500.00 1,129,266,000	－ －	3.45
9	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,593	153,202.60 1,010,064,786	154,200.00 1,016,640,600	－ －	3.11
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,928	341,004.06 998,459,891	344,000.00 1,007,232,000	－ －	3.08
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,003	386,502.62 774,164,764	393,000.00 787,179,000	－ －	2.41
12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,901	79,302.56 705,872,160	80,500.00 716,530,500	－ －	2.19
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,445	72,307.54 682,944,762	74,700.00 705,541,500	－ －	2.16
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,377	158,701.93 694,638,360	159,100.00 696,380,700	－ －	2.13
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,546	424,528.07 656,320,398	427,000.00 660,142,000	－ －	2.02
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,011	624,016.09 630,880,268	627,000.00 633,897,000	－ －	1.94
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,975	328,494.14 648,775,940	320,500.00 632,987,500	－ －	1.93
18	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,891	45,206.64 582,758,829	47,650.00 614,256,150	－ －	1.88

19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,586	165,002.01 591,697,215	161,300.00 578,421,800	－ －	1.77
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	1,157	503,008.02 581,980,290	499,500.00 577,921,500	－ －	1.77
21	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,704	334,500.00 569,988,000	337,500.00 575,100,000	－ －	1.76
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,087	514,045.49 558,767,450	529,000.00 575,023,000	－ －	1.76
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,444	158,109.64 544,529,608	161,500.00 556,206,000	－ －	1.70
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,242	157,703.88 511,275,997	159,600.00 517,423,200	－ －	1.58
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,059	117,501.25 476,937,600	118,000.00 478,962,000	－ －	1.46
26	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,740	169,804.77 465,265,090	172,400.00 472,376,000	－ －	1.44
27	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	1,006	458,967.26 461,721,064	440,500.00 443,143,000	－ －	1.35
28	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	2,101	212,902.40 447,307,958	208,900.00 438,898,900	－ －	1.34
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,362	314,507.47 428,359,185	315,500.00 429,711,000	－ －	1.31
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	1,964	206,702.24 405,963,216	215,600.00 423,438,400	－ －	1.29

（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11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	国内		98.51
	小計		98.51
合　計（対純資産総額比）			98.51

（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11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,392,345	21,009.19 29,252,053,900	19,604.27 27,295,918,312	－ －	4.64
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	613,809	33,497.65 20,561,160,051	33,374.62 20,485,646,485	－ －	3.48
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	794,408	13,071.11 10,383,799,161	12,834.36 10,195,722,548	－ －	1.73
4	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	519,306	13,528.79 7,025,582,024	13,219.03 6,864,724,345	－ －	1.17
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	480,673	13,581.48 6,528,253,620	13,253.75 6,370,721,119	－ －	1.08
6	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	81,043	73,599.82 5,964,750,621	73,323.35 5,942,345,064	－ －	1.01
7	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	230,761	25,024.37 5,774,650,786	25,111.86 5,794,838,410	－ －	0.98
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	227,838	24,468.79 5,574,922,119	24,453.61 5,571,463,486	－ －	0.95
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	361,124	15,564.54 5,620,732,409	15,350.68 5,543,502,503	－ －	0.94
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	112,814	43,166.91 4,869,832,347	43,762.10 4,936,977,899	－ －	0.84
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,026	18,588.58 4,721,982,643	18,964.08 4,817,371,215	－ －	0.82
12	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	215,722	21,399.10 4,616,258,465	21,717.87 4,685,024,358	－ －	0.80

13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	206,721	19,799.36 4,092,944,154	20,202.80 4,176,344,589	－ －	0.71
14	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	141,683	29,273.52 4,147,561,152	29,032.16 4,113,363,836	－ －	0.70
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	161,135	25,410.79 4,094,568,642	25,139.63 4,050,875,262	－ －	0.69
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	88,695	43,492.69 3,857,584,872	43,877.36 3,891,702,906	－ －	0.66
17	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	238,287	16,151.88 3,848,785,317	16,207.24 3,861,975,598	－ －	0.66
18	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	74,768	47,728.13 3,568,537,103	47,650.46 3,562,729,825	－ －	0.61
19	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	69,983	50,227.51 3,515,072,104	50,541.73 3,537,062,345	－ －	0.60
20	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	153,215	21,525.58 3,298,041,921	21,969.23 3,366,016,187	－ －	0.57
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	486,199	6,699.03 3,257,065,813	6,872.67 3,341,488,344	－ －	0.57
22	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	219,517	14,480.29 3,178,669,949	15,114.61 3,317,914,018	－ －	0.56
23	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	626,260	5,164.45 3,234,288,921	5,138.18 3,217,842,869	－ －	0.55

24	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	356,149	8,491.44 3,024,219,015	8,676.59 3,090,161,558	－ －	0.52
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	119,578	25,182.22 3,011,239,874	25,356.27 3,032,052,448	－ －	0.52
26	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	197,515	15,559.75 3,073,284,086	15,200.71 3,002,368,275	－ －	0.51
27	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	35,220	82,028.80 2,889,054,651	80,376.08 2,830,845,678	－ －	0.48
28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	38,350	72,727.25 2,789,090,209	73,456.67 2,817,063,493	－ －	0.48
29	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	130,526	20,863.63 2,723,247,418	21,242.94 2,772,756,495	－ －	0.47
30	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	60,827	44,867.71 2,729,168,607	45,048.44 2,740,161,916	－ －	0.47

（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11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	ソフトウェア・サービス	10.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.23
		資本財	6.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.09
		銀行	6.06
		エネルギー	5.91
		ヘルスケア機器・サービス	4.91
		各種金融	4.80
		メディア・娯楽	4.74
		小売	4.39
		素材	4.36
		食品・飲料・タバコ	4.33
		半導体・半導体製造装置	4.28
		保険	3.29
		公益事業	3.13
		消費者サービス	1.88
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	1.85
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		食品・生活必需品小売り	1.61
		耐久消費財・アパレル	1.54
		電気通信サービス	1.41
		商業・専門サービス	1.21
		不動産	0.37
	小計		95.68
投資証券	外国		2.21
	小計		2.21
合　計（対純資産総額比）			97.89

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

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,170,674,100	96.84 1,133,715,918	96.86 1,133,996,880	2.5 2024/5/15	2.01
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	865,160,100	95.72 828,148,550	95.78 828,693,601	2.25 2024/11/15	1.47
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	736,011,000	94.83 698,025,472	94.91 698,606,920	2 2025/2/15	1.24
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	697,127,400	96.21 670,762,041	96.28 671,229,117	2.375 2024/8/15	1.19
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	631,858,500	97.58 616,624,391	97.63 616,946,639	2.75 2024/2/15	1.09
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	649,911,600	94.70 615,511,779	94.81 616,194,186	2.125 2025/5/15	1.09
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	604,084,500	94.33 569,844,990	94.40 570,316,176	0.25 2024/3/15	1.01
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	597,141,000	92.51 552,468,881	92.86 554,546,932	2.625 2029/2/15	0.98
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	586,031,400	94.03 551,074,626	94.16 551,830,607	2 2025/8/15	0.98
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	592,974,900	92.72 549,865,624	92.85 550,630,562	0.375 2024/9/15	0.98
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	592,974,900	92.40 547,938,779	92.60 549,100,687	2.25 2027/8/15	0.97
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	542,981,700	93.10 505,521,392	93.28 506,520,478	2.375 2027/5/15	0.90
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	522,151,200	95.22 497,244,587	95.32 497,735,409	0.125 2023/12/15	0.88
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	522,151,200	94.33 492,571,334	94.48 493,349,339	2.25 2025/11/15	0.87
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	516,596,400	92.20 476,317,378	92.36 477,164,596	2 2026/11/15	0.85
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	520,762,500	90.95 473,669,947	91.33 475,638,429	2.375 2029/5/15	0.84
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	505,486,800	90.80 459,002,233	91.02 460,109,249	1.5 2026/8/15	0.82
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	495,765,900	92.10 456,625,182	92.26 457,438,238	1.625 2026/2/15	0.81
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	461,048,400	94.21 434,372,139	94.48 435,635,412	2.875 2028/8/15	0.77
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	459,659,700	92.85 426,798,628	93.02 427,607,629	2.25 2027/2/15	0.76
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	448,550,100	91.70 411,351,840	91.88 412,136,802	1.625 2026/5/15	0.73
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	472,158,000	86.69 409,337,378	87.09 411,235,453	1.625 2029/8/15	0.73
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	399,945,600	96.16 384,603,686	96.26 385,023,629	2.75 2025/6/30	0.68

24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	374,949,000	97.30 364,841,194	97.33 364,971,607	2.25 2023/12/31	0.65
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	388,836,000	92.07 358,004,008	92.25 358,712,875	2.25 2027/11/15	0.64
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	377,726,400	94.01 355,134,584	94.26 356,048,681	2.75 2028/2/15	0.63
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	358,284,600	93.96 336,658,541	94.11 337,192,385	2.25 2026/3/31	0.60
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	349,952,400	95.52 334,299,029	95.60 334,571,992	2.25 2024/12/31	0.59
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	343,008,900	96.17 329,875,089	96.24 330,146,066	2.625 2025/3/31	0.59
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	333,288,000	95.28 317,560,139	95.45 318,156,724	2.625 2025/12/31	0.56

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
公社債券	外国	国債証券	98.98
	小計		98.98
合　計（対純資産総額比）			98.98

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	30,625	15,908.94 487,211,508	15,804.79 484,021,837	－ －	8.21
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	3,032	89,905.82 272,594,466	93,176.21 282,510,284	－ －	4.79
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	5,242	40,759.73 213,662,524	40,355.62 211,544,170	－ －	3.59
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	10,996	16,372.77 180,035,011	16,311.67 179,363,125	－ －	3.04
5	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	20,355	8,984.88 182,887,415	8,651.60 176,103,338	－ －	2.99
6	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	32,095	4,485.50 143,962,154	4,675.75 150,068,289	－ －	2.55
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	15,369	9,412.60 144,662,381	9,609.80 147,693,077	－ －	2.51
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	9,613	15,339.58 147,459,384	15,102.11 145,176,607	－ －	2.46
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	4,624	23,495.41 108,642,800	23,717.60 109,670,216	－ －	1.86
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	4,950	20,854.10 103,227,834	21,180.45 104,843,239	－ －	1.78
11	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	57,082	1,703.62 97,246,288	1,734.24 98,994,178	－ －	1.68
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	11,151	8,739.08 97,449,582	8,829.35 98,456,133	－ －	1.67
13	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	4,462	21,960.90 97,989,543	21,319.32 95,126,816	－ －	1.61
14	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	3,817	22,040.05 84,126,900	22,485.83 85,828,414	－ －	1.46
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	19,257	4,342.46 83,622,846	4,432.73 85,361,089	－ －	1.45
16	VENTAS INC アメリカ	投資証券	13,308	6,120.00 81,444,971	6,304.69 83,902,920	－ －	1.42
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	4,124	19,858.40 81,896,082	20,109.76 82,932,669	－ －	1.41
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	6,847	11,070.71 75,801,195	10,862.41 74,374,930	－ －	1.26
19	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	9,601	7,262.90 69,731,112	7,479.53 71,811,046	－ －	1.22
20	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	20,690	3,075.97 63,641,829	3,155.12 65,279,565	－ －	1.11
21	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,164	29,383.50 63,585,901	29,786.22 64,457,393	－ －	1.09
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	18,039	3,423.14 61,750,121	3,560.62 64,230,146	－ －	1.09

23	LINK REIT 香港	投資証券	68,500	979.67 67,107,943	935.22 64,063,118	－ －	1.09
24	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	23,794	2,545.48 60,567,320	2,591.31 61,657,730	－ －	1.05
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIE アメリカ	投資証券	8,604	6,962.94 59,909,151	7,161.52 61,617,768	－ －	1.05
26	UDR INC アメリカ	投資証券	10,254	5,582.57 57,243,713	5,658.95 58,026,898	－ －	0.98
27	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	3,498	15,945.05 55,775,796	16,351.94 57,199,094	－ －	0.97
28	SEGRO PLC イギリス	投資証券	41,427	1,389.01 57,542,843	1,343.80 55,669,738	－ －	0.94
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	5,762	9,058.48 52,195,019	9,086.26 52,355,053	－ －	0.89
30	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	175,025	265.37 46,448,029	272.80 47,747,275	－ －	0.81

（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11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	外国		98.82
	小計		98.82
合　計（対純資産総額比）			98.82

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	137,000	2,186.72 299,581,653	2,186.72 299,581,653	－ －	5.45
2	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	38,012	5,640.89 214,421,867	5,439.53 206,767,714	－ －	3.76
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	34,800	5,117.08 178,074,523	5,081.52 176,837,035	－ －	3.22

4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	26,617	6,476.63 172,388,726	6,350.87 169,041,372	－ －	3.08
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 小売	84,800	1,421.51 120,544,132	1,400.17 118,734,840	－ －	2.16
6	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	16,984	4,441.98 75,442,613	4,637.86 78,769,448	－ －	1.43
7	MEITUAN-B 香港	株式 小売	24,700	2,851.91 70,442,226	2,763.01 68,246,396	－ －	1.24
8	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	31,508	2,166.37 68,258,048	2,124.71 66,945,394	－ －	1.22
9	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	19,503	2,896.41 56,488,715	2,828.78 55,169,733	－ －	1.00
10	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	18,780	2,724.71 51,170,128	2,785.67 52,314,985	－ －	0.95
11	VALE SA ブラジル	株式 素材	22,854	2,123.55 48,531,787	2,218.39 50,699,296	－ －	0.92
12	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	28,876	1,573.79 45,445,005	1,618.94 46,748,583	－ －	0.85
13	JD.COM INC - CL A 香港	株式 小売	12,207	3,876.03 47,314,820	3,748.02 45,752,128	－ －	0.83
14	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	531,000	80.18 42,579,721	83.92 44,562,369	－ －	0.81
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 各種金融	9,625	4,560.65 43,896,309	4,557.57 43,866,683	－ －	0.80
16	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	8,635	4,929.88 42,569,556	4,893.08 42,251,783	－ －	0.77
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	70,200	451.26 31,678,810	449.02 31,521,204	－ －	0.57
18	PINDUODUO INC-ADR アメリカ	株式 小売	2,852	9,741.73 27,783,415	10,891.57 31,062,769	－ －	0.57

19	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	36,500	754.76 27,548,776	840.10 30,663,832	－ －	0.56
20	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	5,117	5,717.29 29,255,421	5,809.46 29,727,050	－ －	0.54
21	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	9,000	3,241.92 29,177,319	3,201.51 28,813,613	－ －	0.52
22	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	3,090	9,264.31 28,626,748	8,771.75 27,104,738	－ －	0.49
23	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4,658	5,984.07 27,873,844	5,764.00 26,848,712	－ －	0.49
24	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	329,700	78.54 25,895,462	79.87 26,335,611	－ －	0.48
25	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 小売	1,231	20,896.45 25,723,535	20,273.60 24,956,803	－ －	0.45
26	SAMSUNG SDI CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	318	73,464.79 23,361,806	75,246.39 23,928,355	－ －	0.44
27	NETEASE INC 香港	株式 メディア・娯楽	11,800	1,907.79 22,511,969	1,950.46 23,015,498	－ －	0.42
28	BAIDU INC-CLASS A 香港	株式 メディア・娯楽	12,500	1,666.87 20,835,937	1,745.10 21,813,837	－ －	0.40
29	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	312,000	65.25 20,358,811	68.98 21,523,756	－ －	0.39
30	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 電気通信サービス	156,300	140.54 21,967,029	134.62 21,041,388	－ －	0.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	銀行	10.77
		半導体・半導体製造装置	7.79
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.26
		素材	6.95
		小売	6.25
		メディア・娯楽	5.34
		エネルギー	4.14
		食品・飲料・タバコ	3.32
		資本財	3.10
		各種金融	3.07
		自動車・自動車部品	2.76
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.43
		公益事業	2.38
		保険	2.35
		ソフトウェア・サービス	2.35
		電気通信サービス	2.16
		運輸	1.67
		不動産	1.48
		耐久消費財・アパレル	1.29
		食品・生活必需品小売り	1.13
		消費者サービス	1.07
		家庭用品・パーソナル用品	0.84
		ヘルスケア機器・サービス	0.83
		商業・専門サービス	0.05
	小計		80.80
投資信託受益証券	外国		6.75
	小計		6.75
投資証券	外国		0.10
	小計		0.10
合　計（対純資産総額比）			87.65

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

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	STATE OF QATAR カタール	国債証券	27,774,000	97.80 27,163,527	101.23 28,117,008	5.103 2048/4/23	1.89
2	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証券	27,774,000	99.36 27,598,746	99.36 27,597,912	6 2029/8/1	1.85
3	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	27,774,000	98.13 27,257,125	99.32 27,587,080	4.5 2030/4/17	1.85
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	27,774,000	97.95 27,204,633	98.93 27,478,484	4.375 2029/4/16	1.84
5	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	27,774,000	98.39 27,328,782	98.46 27,348,502	4 2025/4/17	1.83
6	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証券	27,774,000	98.92 27,474,874	98.42 27,336,559	5.625 2028/1/17	1.83
7	STATE OF QATAR カタール	国債証券	27,774,000	97.26 27,014,381	98.37 27,322,672	4 2029/3/14	1.83

8	STATE OF QATAR カタール	国債証券	27,774,000	93.90 26,080,341	97.82 27,171,304	4.817 2049/3/14	1.82
9	STATE OF QATAR カタール	国債証券	27,774,000	97.77 27,157,417	97.68 27,130,476	3.4 2025/4/16	1.82
10	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	27,774,000	96.06 26,681,926	97.06 26,959,388	4.5 2029/4/22	1.81
11	STATE OF QATAR カタール	国債証券	27,774,000	95.42 26,502,506	96.52 26,808,020	3.75 2030/4/16	1.80
12	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	27,774,000	94.34 26,202,547	96.05 26,678,871	4.75 2032/4/27	1.79
13	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	27,774,000	95.91 26,640,543	95.99 26,661,929	2.5 2025/4/16	1.79
14	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	27,774,000	95.35 26,483,897	95.56 26,542,223	2.9 2025/10/22	1.78
15	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	27,774,000	90.87 25,240,177	94.19 26,161,163	5 2049/4/17	1.75
16	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	27,774,000	91.33 25,367,660	93.67 26,018,127	3.85 2030/10/15	1.75
17	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	27,774,000	92.15 25,595,685	93.20 25,885,645	3.125 2030/4/16	1.74
18	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券	27,774,000	91.85 25,510,696	92.59 25,717,057	3 2028/2/1	1.73
19	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	27,774,000	91.02 25,282,672	92.42 25,669,286	4.5 2029/5/30	1.72
20	STATE OF QATAR カタール	国債証券	27,774,000	88.71 24,640,815	92.02 25,558,745	4.4 2050/4/16	1.71
21	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証券	27,774,000	89.52 24,865,784	91.33 25,368,216	6.75 2048/1/17	1.70
22	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	27,774,000	88.55 24,596,654	90.39 25,107,418	4.85 2029/9/30	1.68
23	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	27,774,000	89.42 24,838,010	90.27 25,071,867	2.5 2029/9/30	1.68
24	CHINA GOVT INTL BOND 中国	国債証券	27,774,000	89.59 24,883,282	90.09 25,021,874	1.25 2026/10/26	1.68
25	CHINA GOVT INTL BOND 中国	国債証券	27,774,000	89.22 24,782,462	89.99 24,994,100	2.125 2029/12/3	1.68
26	CHINA GOVT INTL BOND 中国	国債証券	27,774,000	88.91 24,694,974	89.60 24,887,725	0.55 2025/10/21	1.67
27	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	27,774,000	85.50 23,746,770	89.18 24,769,964	4.5 2060/4/22	1.66
28	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	27,774,000	87.40 24,275,031	88.22 24,503,889	1.625 2028/6/2	1.64
29	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	27,774,000	85.30 23,692,888	86.76 24,098,944	3.875 2030/6/12	1.62
30	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	27,774,000	81.78 22,714,410	85.50 23,746,770	4.35 2048/1/11	1.59

（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11月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）

公社債券	外国	国債証券	97.56
	小計		97.56
合　計（対純資産総額比）			97.56

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０４１２月	買建	260	4,936,413,000	5,174,000,000	2.81

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMINI FUTURE 202212	買建	319	8,802,316,611	8,775,736,893	1.49
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202212	買建	391	2,202,363,569	2,208,538,945	0.38
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE 202212	買建	71	872,251,198	888,361,379	0.15

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＮＹＳＥ ＬＩＦＦＥ　ＵＳ	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202212	買建	105	689,767,706	697,061,436	12.68

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2018年11月20日)	123,377,684	123,377,684	1.0166	1.0166
第2計算期間末(2019年11月20日)	240,300,010	240,300,010	1.1250	1.1250
第3計算期間末(2020年11月20日)	292,325,819	292,325,819	1.1316	1.1316
第4計算期間末(2021年11月22日)	442,125,000	442,125,000	1.3536	1.3536
第5計算期間末(2022年11月21日)	517,147,836	517,147,836	1.3282	1.3282
2021年11月末日	435,497,125	－	1.3246	－
12月末日	459,737,312	－	1.3607	－
2022年1月末日	452,907,530	－	1.3055	－
2月末日	456,379,099	－	1.2835	－
3月末日	486,517,922	－	1.3478	－
4月末日	483,142,049	－	1.3285	－
5月末日	487,094,267	－	1.3198	－
6月末日	490,264,134	－	1.3130	－
7月末日	505,915,315	－	1.3422	－
8月末日	509,874,113	－	1.3474	－
9月末日	492,009,143	－	1.2822	－
10月末日	514,954,993	－	1.3299	－
11月末日	518,084,176	－	1.3282	－

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	1.7
第2計算期間	10.7
第3計算期間	0.6
第4計算期間	19.6
第5計算期間	△1.9

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

（4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	155,808,418	34,441,297	121,367,121
第2計算期間	186,191,794	93,957,053	213,601,862
第3計算期間	139,113,792	94,394,937	258,320,717
第4計算期間	121,867,494	53,556,365	326,631,846
第5計算期間	92,492,553	29,754,376	389,370,023

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜参考情報＞

3.運用実績

2022年11月末現在

●基準価額・純資産の推移

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

基準価額	13,282円
純資産総額	518百万円

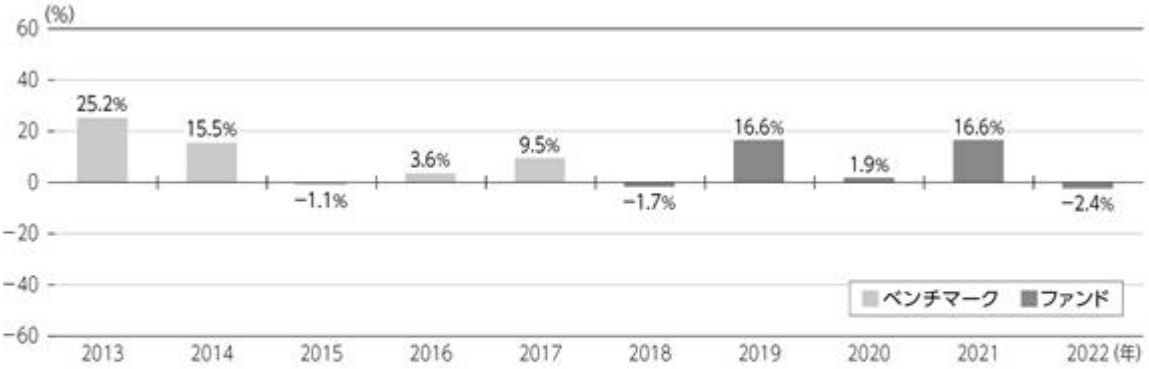
●分配の推移 1万口当り（税引前）

2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●資産別組入比率

・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
・2018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。
・2017年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.8%
2	ソニーグループ	2.8%
3	キーエンス	2.0%
4	日本電信電話	1.7%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	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	17.4%
2	情報・通信業	8.8%
3	輸送用機器	7.7%
4	化学	6.1%
5	卸売業	5.9%

・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	4.7%
2	マイクロソフト	情報技術	3.6%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	1.8%
4	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.2%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.1%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。
・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	73.1%
2	イギリス	4.6%
3	カナダ	3.7%
4	フランス	3.5%
5	スイス	3.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入株式等評価額比です。

3.ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	6.2%
2	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	4.3%
3	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	3.7%
4	サムスン電子	情報技術	3.5%
5	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	2.5%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。「その他」にはETFを含みます。
・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	中国	30.1%
2	インド	15.0%
3	台湾	14.5%
4	韓国	12.0%
5	その他	7.7%

・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。「その他」にはETFを含みます。
・比率は対組入株式等評価額比です。

4.ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第350回　利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	0.9%
2	第364回　利付国債(10年)	2031/09/20	0.100%	0.9%
3	第351回　利付国債(10年)	2028/06/20	0.100%	0.8%
4	第365回　利付国債(10年)	2031/12/20	0.100%	0.8%
5	第338回　利付国債(10年)	2025/03/20	0.400%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.1%
債券先物	－
現金、その他	0.9%

・比率は対純資産総額比です。

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

3.運用実績

2022年11月末現在

5.ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2024/05/15	2.500%	2.0%
2	アメリカ国債	米ドル	2024/11/15	2.250%	1.5%
3	アメリカ国債	米ドル	2025/02/15	2.000%	1.3%
4	アメリカ国債	米ドル	2024/08/15	2.375%	1.2%
5	アメリカ国債	米ドル	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	50.5%
2	フランス	8.7%
3	イタリア	7.7%
4	ドイツ	6.7%
5	スペイン	5.2%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入債券評価額比です。

6.ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	カタール国債	米ドル	2048/04/23	5.103%	1.9%
2	オマーン国債	米ドル	2029/08/01	6.000%	1.9%
3	サウジアラビア国債	米ドル	2030/04/17	4.500%	1.9%
4	サウジアラビア国債	米ドル	2029/04/16	4.375%	1.9%
5	サウジアラビア国債	米ドル	2025/04/17	4.000%	1.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	サウジアラビア	12.5%
2	カタール	11.1%
3	アラブ首長国連邦	10.1%
4	メキシコ	9.6%
5	チリ	7.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入債券評価額比です。

7.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.8%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.5%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.1%
4	日本都市ファンド投資法人	5.0%
5	日本プロロジスリート投資法人	5.0%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.5%
短期金融資産等	1.5%

・比率は対純資産総額比です。

8.ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.3%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.9%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.6%
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.1%
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	78.2%
2	オーストラリア	6.9%
3	イギリス	4.7%
4	シンガポール	3.4%
5	カナダ	1.9%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

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

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

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

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

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

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

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

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

② 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③ 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○ 換金手数料はありません。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

⑥ 支払開始日

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

⑦ その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

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

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限です。

（4）【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

（5）【その他】

① 繰上償還

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

ⅰ．受益権の口数が30億口を下回っている場合

ⅱ．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

ⅲ．やむを得ない事情が発生したとき

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

②　約款の変更等

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

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

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

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

③　反対者の買取請求の不適用

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

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

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

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

⑥　信託事務処理の再信託

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

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2021年11月23日から2022年11月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

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

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,246	1,184
コール・ローン	339,470	420,591
親投資信託受益証券	442,131,426	517,155,294
未収入金	1,431,403	721,912
流動資産合計	443,904,545	518,298,981
資産合計	443,904,545	518,298,981
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,416,477	704,523
未払受託者報酬	45,369	55,800
未払委託者報酬	315,522	388,121
その他未払費用	2,177	2,701
流動負債合計	1,779,545	1,151,145
負債合計	1,779,545	1,151,145
純資産の部		
元本等		
元本	326,631,846	389,370,023
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	115,493,154	127,777,813
（分配準備積立金）	71,782,270	66,114,075
元本等合計	442,125,000	517,147,836
純資産合計	442,125,000	517,147,836
負債純資産合計	443,904,545	518,298,981

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　2020年11月21日 至　2021年11月22日	第5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
営業収益		
受取利息	－	1
有価証券売買等損益	62,284,401	△6,854,065
営業収益合計	62,284,401	△6,854,064
営業費用		
支払利息	－	10
受託者報酬	80,509	105,739
委託者報酬	560,002	735,512
その他費用	3,839	5,102
営業費用合計	644,350	846,363
営業利益又は営業損失（△）	61,640,051	△7,700,427
経常利益又は経常損失（△）	61,640,051	△7,700,427
当期純利益又は当期純損失（△）	61,640,051	△7,700,427
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（△）	5,520,121	△594,259
期首剰余金又は期首欠損金（△）	34,005,102	115,493,154
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,298,500	29,796,181
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	33,298,500	29,796,181
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,930,378	10,405,354
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,930,378	10,405,354
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（△）	115,493,154	127,777,813

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年11月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2021年11月23日から2022年11月21日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
１．　期首元本額	258,320,717円	326,631,846円
期中追加設定元本額	121,867,494円	92,492,553円
期中一部解約元本額	53,556,365円	29,754,376円
２．　受益権の総数	326,631,846口	389,370,023口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第4期 自　2020年11月21日 至　2021年11月22日	第5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（56,119,930円）、収益調整金（43,710,884円）及び分配準備積立金（15,662,340円）より分配対象収益は115,493,154円（1万口当たり3,535.88円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（61,663,747円）及び分配準備積立金（66,114,075円）より分配対象収益は127,777,822円（1万口当たり3,281.66円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自　2020年11月21日 至　2021年11月22日	第5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	51,386,542	△6,337,983
合計	51,386,542	△6,337,983

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年11月22日現在	第5期 2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3536円 (13,536円)	1.3282円 (13,282円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	28,951,780	65,781,339	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	41,316,219	63,217,946	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	21,274,392	65,191,119	
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	33,525,524	64,446,114	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	67,716,133	64,181,350	
	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド	45,417,471	64,615,435	
	ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド	57,534,817	66,044,216	
	ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド	55,160,928	63,677,775	
親投資信託受益証券　合計		350,897,264	517,155,294	
合計			517,155,294	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」受益証券、「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りでありますが、それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,809,068
コール・ローン	3,128,100,093
株式	178,028,052,710
派生商品評価勘定	198,688,550
未収配当金	1,960,191,980
差入委託証拠金	200,760,000
流動資産合計	183,524,602,401
資産合計	183,524,602,401
負債の部	
流動負債	
前受金	184,480,000
未払解約金	339,220,374
その他未払費用	2,385
流動負債合計	523,702,759
負債合計	523,702,759
純資産の部	
元本等	
元本	80,542,683,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	102,458,216,287
元本等合計	183,000,899,642
純資産合計	183,000,899,642
負債純資産合計	183,524,602,401

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年11月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,189,089,554円
	同期中追加設定元本額	53,578,722,618円
	同期中一部解約元本額	25,225,128,817円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,647,990,989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）	3,349,734,369円
	ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,514,277円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,246,582,867円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,615,340,400円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	5,805,672,508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）	3,847,143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）	14,180,476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）	13,439,604円
	ＤＣニッセイ国内株式インデックス	1,596,291,071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	23,007,925,392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）	2,827,035,617円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	279,595,998円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	242,992,825円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	316,645,650円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	602,883,319円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	54,988,614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）	119,743,668円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	8,500,988円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	12,231,335円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	5,223,340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）	8,540,841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）	28,951,780円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	202,230,381円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	134,140,616円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	292,921,259円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	239,679,546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）	25,806,417,013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）	25,168,812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）	76,777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）	162,630円
	ＦＷニッセイ国内株インデックス	18,998,657円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	11,034,593円
	計	80,542,683,355円
２．	受益権の総数	80,542,683,355口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	7,099,260,096
合計	7,099,260,096

（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（2022年2月22日から2022年11月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,517,845,000	－	4,716,665,000	198,820,000
合計	4,517,845,000	－	4,716,665,000	198,820,000

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額	2.2721円
（1万口当たり純資産額）	(22,721円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年11月21日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	3,640.00	12,012,000	
日本水産	87,500	517.00	45,237,500	
マルハニチロ	13,500	2,440.00	32,940,000	
雪国まいたけ	7,500	1,018.00	7,635,000	
カネコ種苗	3,400	1,421.00	4,831,400	
サカタのタネ	11,100	4,715.00	52,336,500	
ホクト	7,800	1,904.00	14,851,200	
ショーボンドホールディングス	11,900	6,070.00	72,233,000	
ミライト・ワン	30,400	1,517.00	46,116,800	

タマホーム	6,200	2,489.00	15,431,800	
ファーストコーポレーション	1,300	720.00	936,000	
住石ホールディングス	14,000	201.00	2,814,000	
日鉄鉱業	3,500	3,150.00	11,025,000	
三井松島ホールディングス	4,000	2,963.00	11,852,000	
ＩＮＰＥＸ	323,800	1,506.00	487,642,800	
石油資源開発	10,100	4,105.00	41,460,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,000	2,219.00	8,876,000	
安藤・間	50,700	860.00	43,602,000	
東急建設	24,900	648.00	16,135,200	
コムシスホールディングス	29,600	2,489.00	73,674,400	
ビーアールホールディングス	14,000	335.00	4,690,000	
高松コンストラクショングループ	5,700	1,943.00	11,075,100	
東建コーポレーション	2,800	8,090.00	22,652,000	
ソネック	4,800	940.00	4,512,000	
ヤマウラ	4,900	1,003.00	4,914,700	
オリエンタル白石	31,500	276.00	8,694,000	
大成建設	61,000	4,020.00	245,220,000	
大林組	219,000	1,007.00	220,533,000	
清水建設	184,100	728.00	134,024,800	
飛島建設	6,800	1,018.00	6,922,400	
長谷工コーポレーション	63,200	1,505.00	95,116,000	
松井建設	8,700	567.00	4,932,900	
錢高組	1,500	2,672.00	4,008,000	
鹿島建設	135,800	1,523.00	206,823,400	
不動テトラ	4,200	1,510.00	6,342,000	
鉄建建設	4,400	1,785.00	7,854,000	
西松建設	10,400	3,795.00	39,468,000	
三井住友建設	49,400	417.00	20,599,800	
大豊建設	2,500	4,250.00	10,625,000	
佐田建設	10,800	429.00	4,633,200	
ナカノフドー建設	15,100	319.00	4,816,900	
奥村組	9,900	2,890.00	28,611,000	
東鉄工業	8,400	2,554.00	21,453,600	
淺沼組	4,900	2,858.00	14,004,200	
戸田建設	75,300	705.00	53,086,500	
熊谷組	10,600	2,497.00	26,468,200	
植木組	3,500	1,272.00	4,452,000	
矢作建設工業	8,300	734.00	6,092,200	
ピーエス三菱	7,900	598.00	4,724,200	
日本ハウスホールディングス	12,100	433.00	5,239,300	
大東建託	22,500	15,340.00	345,150,000	
新日本建設	8,600	758.00	6,518,800	
東亜道路工業	1,200	5,860.00	7,032,000	
日本道路	1,200	6,170.00	7,404,000	
東亜建設工業	5,300	2,291.00	12,142,300	
日本国土開発	18,400	580.00	10,672,000	
若築建設	2,700	2,749.00	7,422,300	
東洋建設	19,800	832.00	16,473,600	
五洋建設	86,800	649.00	56,333,200	

世紀東急工業	8,100	792.00	6,415,200	
福田組	2,300	4,765.00	10,959,500	
住友林業	47,000	2,332.00	109,604,000	
日本基礎技術	8,100	530.00	4,293,000	
巴コーポレーション	10,600	382.00	4,049,200	
大和ハウス工業	171,200	3,160.00	540,992,000	
ライト工業	11,700	1,957.00	22,896,900	
積水ハウス	191,900	2,501.50	480,037,850	
日特建設	5,800	905.00	5,249,000	
北陸電気工事	7,200	669.00	4,816,800	
ユアテック	13,500	716.00	9,666,000	
日本リーテック	6,600	732.00	4,831,200	
四電工	2,900	1,727.00	5,008,300	
中電工	9,500	2,057.00	19,541,500	
関電工	33,600	880.00	29,568,000	
きんでん	43,100	1,475.00	63,572,500	
東京エネシス	6,000	937.00	5,622,000	
トーエネック	2,000	3,390.00	6,780,000	
住友電設	5,800	2,475.00	14,355,000	
日本電設工業	10,100	1,653.00	16,695,300	
エクシオグループ	30,000	2,107.00	63,210,000	
新日本空調	3,400	1,931.00	6,565,400	
日本工営	4,600	3,345.00	15,387,000	
九電工	14,900	3,290.00	49,021,000	
三機工業	13,600	1,536.00	20,889,600	
日揮ホールディングス	60,600	1,865.00	113,019,000	
中外炉工業	3,100	1,568.00	4,860,800	
ヤマト	6,200	690.00	4,278,000	
太平電業	3,800	3,140.00	11,932,000	
高砂熱学工業	14,800	1,783.00	26,388,400	
三晃金属工業	1,700	2,933.00	4,986,100	
ＮＥＣネッツエスアイ	20,900	1,692.00	35,362,800	
朝日工業社	2,500	1,956.00	4,890,000	
明星工業	10,500	715.00	7,507,500	
大氣社	7,400	3,500.00	25,900,000	
ダイダン	4,000	2,158.00	8,632,000	
日比谷総合設備	5,300	1,915.00	10,149,500	
ニップン	16,600	1,600.00	26,560,000	
日清製粉グループ本社	56,900	1,617.00	92,007,300	
日東富士製粉	1,100	4,415.00	4,856,500	
昭和産業	5,400	2,435.00	13,149,000	
中部飼料	8,500	1,037.00	8,814,500	
フィード・ワン	9,000	676.00	6,084,000	
日本甜菜製糖	3,600	1,623.00	5,842,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	6,100	1,957.00	11,937,700	
塩水港精糖	23,200	200.00	4,640,000	
日新製糖	3,200	1,693.00	5,417,600	
ＬＩＦＵＬＬ	28,900	249.00	7,196,100	
ＭＩＸＩ	14,600	2,450.00	35,770,000	
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,488.00	14,430,400	

日本M&Aセンターホールディングス	110,100	1,854.00	204,125,400	
メンバーズ	2,300	2,141.00	4,924,300	
ＵＴグループ	9,400	2,827.00	26,573,800	
アイティメディア	2,900	1,804.00	5,231,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,100	1,343.00	5,506,300	
夢真ビーネックスグループ	23,400	1,903.00	44,530,200	
コシダカホールディングス	19,200	1,078.00	20,697,600	
アルトナー	1,300	1,000.00	1,300,000	
パソナグループ	7,800	2,042.00	15,927,600	
ＣＤＳ	2,700	1,849.00	4,992,300	
リンクアンドモチベーション	18,500	736.00	13,616,000	
エス・エム・エス	24,400	3,710.00	90,524,000	
サニーサイドアップグループ	7,000	589.00	4,123,000	
パーソルホールディングス	71,900	3,015.00	216,778,500	
クックパッド	23,900	207.00	4,947,300	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,700	625.00	4,812,500	
森永製菓	12,700	3,705.00	47,053,500	
中村屋	1,600	3,115.00	4,984,000	
江崎グリコ	17,600	3,585.00	63,096,000	
名糖産業	3,000	1,631.00	4,893,000	
井村屋グループ	3,400	2,240.00	7,616,000	
不二家	4,200	2,676.00	11,239,200	
山崎製パン	41,200	1,564.00	64,436,800	
モロゾフ	2,000	3,630.00	7,260,000	
亀田製菓	3,900	4,305.00	16,789,500	
寿スピリッツ	6,500	7,750.00	50,375,000	
カルビー	28,100	2,877.00	80,843,700	
森永乳業	11,200	4,420.00	49,504,000	
六甲バター	4,500	1,428.00	6,426,000	
ヤクルト本社	43,900	8,300.00	364,370,000	
明治ホールディングス	38,100	6,680.00	254,508,000	
雪印メグミルク	14,900	1,751.00	26,089,900	
プリマハム	8,300	2,058.00	17,081,400	
日本ハム	24,000	3,715.00	89,160,000	
林兼産業	7,000	478.00	3,346,000	
丸大食品	6,200	1,426.00	8,841,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,800	2,903.00	19,740,400	
柿安本店	2,400	2,195.00	5,268,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	47,800	679.00	32,456,200	
学情	3,200	1,514.00	4,844,800	
スタジオアリス	3,200	2,096.00	6,707,200	
クロスキャット	3,600	1,416.00	5,097,600	
シミックホールディングス	3,500	1,727.00	6,044,500	
システナ	105,300	434.00	45,700,200	
ＮＪＳ	2,300	2,041.00	4,694,300	
デジタルアーツ	4,000	6,480.00	25,920,000	
日鉄ソリューションズ	10,700	3,490.00	37,343,000	
綜合警備保障	23,800	3,730.00	88,774,000	
キューブシステム	4,900	1,020.00	4,998,000	
いちご	70,800	317.00	22,443,600	

日本駐車場開発	73,200	251.00	18,373,200	
コア	3,300	1,452.00	4,791,600	
カカクコム	47,900	2,295.00	109,930,500	
アイロムグループ	2,300	2,204.00	5,069,200	
セントケア・ホールディング	5,800	838.00	4,860,400	
ルネサンス	5,100	908.00	4,630,800	
ディップ	11,200	3,935.00	44,072,000	
ＳＢＳホールディングス	5,600	2,976.00	16,665,600	
デジタルホールディングス	5,000	1,170.00	5,850,000	
新日本科学	6,800	2,552.00	17,353,600	
ベネフィット・ワン	29,700	2,105.00	62,518,500	
エムスリー	126,800	4,416.00	559,948,800	
アウトソーシング	38,200	1,023.00	39,078,600	
ウェルネット	7,700	638.00	4,912,600	
ワールドホールディングス	2,900	2,894.00	8,392,600	
ディー・エヌ・エー	27,400	1,898.00	52,005,200	
博報堂ＤＹホールディングス	81,900	1,331.00	109,008,900	
ぐるなび	11,800	395.00	4,661,000	
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	843.00	4,720,800	
ファンコミュニケーションズ	12,600	441.00	5,556,600	
ライク	2,400	2,046.00	4,910,400	
ビジネス・ブレークスルー	11,700	396.00	4,633,200	
エスプール	18,400	909.00	16,725,600	
ＷＤＢホールディングス	3,300	2,521.00	8,319,300	
手間いらず	1,100	5,130.00	5,643,000	
アドウェイズ	8,800	564.00	4,963,200	
バリューコマース	4,800	2,111.00	10,132,800	
インフォマート	66,600	444.00	29,570,400	
サッポロホールディングス	20,200	3,515.00	71,003,000	
アサヒグループホールディングス	142,100	4,304.00	611,598,400	
キリンホールディングス	277,500	2,184.00	606,060,000	
宝ホールディングス	42,000	1,052.00	44,184,000	
オエノンホールディングス	18,400	282.00	5,188,800	
養命酒製造	2,700	1,795.00	4,846,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	48,200	1,458.00	70,275,600	
サントリー食品インターナショナル	43,300	4,635.00	200,695,500	
ダイドーグループホールディングス	3,500	4,680.00	16,380,000	
伊藤園	22,900	5,500.00	125,950,000	
キーコーヒー	6,900	2,060.00	14,214,000	
日清オイリオグループ	8,700	3,275.00	28,492,500	
不二製油グループ本社	14,300	2,088.00	29,858,400	
Ｊ－オイルミルズ	6,300	1,557.00	9,809,100	
ローソン	16,400	5,020.00	82,328,000	
サンエー	5,000	4,255.00	21,275,000	
カワチ薬品	5,200	2,153.00	11,195,600	
エービーシー・マート	9,600	7,050.00	67,680,000	
ハードオフコーポレーション	2,800	1,324.00	3,707,200	
高千穂交易	2,400	2,232.00	5,356,800	
アスクル	15,900	1,636.00	26,012,400	

ゲオホールディングス	6,900	1,822.00	12,571,800	
アダストリア	8,000	2,011.00	16,088,000	
伊藤忠食品	1,500	5,130.00	7,695,000	
くら寿司	7,700	3,445.00	26,526,500	
キャンドゥ	2,300	2,217.00	5,099,100	
エレマテック	5,900	1,521.00	8,973,900	
パルグループホールディングス	6,500	2,282.00	14,833,000	
エディオン	26,200	1,252.00	32,802,400	
あらた	5,100	4,010.00	20,451,000	
サーラコーポレーション	13,900	746.00	10,369,400	
トーメンデバイス	1,000	5,670.00	5,670,000	
ハローズ	3,000	2,919.00	8,757,000	
ＪＰホールディングス	18,500	272.00	5,032,000	
フジオフードグループ本社	5,500	1,411.00	7,760,500	
あみやき亭	1,700	2,908.00	4,943,600	
東京エレクトロン　デバイス	2,400	6,880.00	16,512,000	
円谷フィールズホールディングス	5,700	2,084.00	11,878,800	
双日	70,100	2,417.00	169,431,700	
アルフレッサ　ホールディングス	66,300	1,667.00	110,522,100	
大黒天物産	2,400	5,090.00	12,216,000	
ハニーズホールディングス	5,900	1,233.00	7,274,700	
ファーマライズホールディングス	7,000	652.00	4,564,000	
キッコーマン	40,700	7,700.00	313,390,000	
味の素	150,500	4,221.00	635,260,500	
ブルドックソース	2,900	1,717.00	4,979,300	
キユーピー	33,000	2,487.00	82,071,000	
ハウス食品グループ本社	18,800	2,740.00	51,512,000	
カゴメ	28,600	3,040.00	86,944,000	
アリアケジャパン	5,400	4,745.00	25,623,000	
エバラ食品工業	1,700	3,145.00	5,346,500	
ニチレイ	28,200	2,779.00	78,367,800	
横浜冷凍	18,000	970.00	17,460,000	
東洋水産	31,100	5,610.00	174,471,000	
イートアンドホールディングス	2,600	2,253.00	5,857,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,000	488.00	4,880,000	
日清食品ホールディングス	21,900	10,470.00	229,293,000	
永谷園ホールディングス	3,000	2,024.00	6,072,000	
一正蒲鉾	6,100	741.00	4,520,100	
フジッコ	6,300	1,914.00	12,058,200	
ロック・フィールド	7,500	1,501.00	11,257,500	
日本たばこ産業	404,800	2,795.00	1,131,416,000	
ケンコーマヨネーズ	4,200	1,636.00	6,871,200	
わらべや日洋ホールディングス	4,500	1,784.00	8,028,000	
なとり	3,900	2,070.00	8,073,000	
ファーマフーズ	9,500	1,332.00	12,654,000	
北の達人コーポレーション	26,400	303.00	7,999,200	
ユーグレナ	39,600	871.00	34,491,600	
紀文食品	5,400	935.00	5,049,000	
ピックルスホールディングス	4,600	1,056.00	4,857,600	
ＳＲＥホールディングス	3,000	4,565.00	13,695,000	

ＡＤワークスグループ	20,200	167.00	3,373,400	
片倉工業	5,800	1,855.00	10,759,000	
グンゼ	4,700	3,835.00	18,024,500	
ヒューリック	143,500	1,143.00	164,020,500	
アルペン	5,400	2,015.00	10,881,000	
ラクーンホールディングス	6,200	1,325.00	8,215,000	
クオールホールディングス	9,100	1,163.00	10,583,300	
アルコニックス	8,700	1,322.00	11,501,400	
神戸物産	51,100	3,470.00	177,317,000	
ソリトンシステムズ	4,700	1,148.00	5,395,600	
ジンズホールディングス	3,900	4,245.00	16,555,500	
ビックカメラ	43,900	1,192.00	52,328,800	
ＤＣＭホールディングス	40,300	1,201.00	48,400,300	
ハイパー	4,500	480.00	2,160,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	93,700	2,404.00	225,254,800	
東京一番フーズ	8,200	579.00	4,747,800	
あい　ホールディングス	10,600	2,190.00	23,214,000	
ディーブイエックス	4,700	989.00	4,648,300	
アークランドサービスホールディングス	5,400	2,216.00	11,966,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	82,100	1,123.00	92,198,300	
ドトール・日レスホールディングス	11,700	1,675.00	19,597,500	
マツキヨココカラ＆カンパニー	40,100	5,790.00	232,179,000	
ブロンコビリー	3,500	2,534.00	8,869,000	
ＺＯＺＯ	43,700	3,125.00	136,562,500	
トレジャー・ファクトリー	700	2,239.00	1,567,300	
物語コーポレーション	3,700	7,080.00	26,196,000	
三越伊勢丹ホールディングス	111,200	1,233.00	137,109,600	
東洋紡	27,000	1,031.00	27,837,000	
ユニチカ	18,900	257.00	4,857,300	
富士紡ホールディングス	2,500	3,300.00	8,250,000	
日清紡ホールディングス	51,300	1,009.00	51,761,700	
倉敷紡績	4,700	2,125.00	9,987,500	
ダイワボウホールディングス	27,000	2,216.00	59,832,000	
日東紡績	7,500	2,133.00	15,997,500	
トヨタ紡織	26,300	1,975.00	51,942,500	
マクニカホールディングス	16,200	3,430.00	55,566,000	
Ｈａｍｅｅ	5,800	885.00	5,133,000	
ラクト・ジャパン	2,500	2,061.00	5,152,500	
ウエルシアホールディングス	34,300	3,130.00	107,359,000	
クリエイトＳＤホールディングス	10,900	3,310.00	36,079,000	
グリムス	2,700	1,863.00	5,030,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,700	795.00	7,711,500	
八洲電機	5,300	1,024.00	5,427,200	
メディアスホールディングス	6,900	744.00	5,133,600	
レスターホールディングス	6,300	2,195.00	13,828,500	
ジューテックホールディングス	4,500	1,182.00	5,319,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,700	337.00	4,279,900	
ＯＣＨＩホールディングス	3,900	1,247.00	4,863,300	

ＴＯＫＡＩホールディングス	32,600	889.00	28,981,400	
ミサワ	8,000	601.00	4,808,000	
ティーライフ	3,400	1,298.00	4,413,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	6,600	733.00	4,837,800	
三洋貿易	6,800	1,114.00	7,575,200	
シュッピン	4,900	1,354.00	6,634,600	
オイシックス・ラ・大地	8,900	1,936.00	17,230,400	
ウイン・パートナーズ	5,000	982.00	4,910,000	
ネクステージ	15,100	2,927.00	44,197,700	
ジョイフル本田	21,300	1,905.00	40,576,500	
鳥貴族ホールディングス	2,400	2,306.00	5,534,400	
ホットランド	5,000	1,503.00	7,515,000	
すかいらーくホールディングス	90,300	1,622.00	146,466,600	
ＳＦＰホールディングス	3,600	1,686.00	6,069,600	
綿半ホールディングス	5,100	1,341.00	6,839,100	
日本毛織	18,200	1,003.00	18,254,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,500	1,115.00	23,972,500	
三栄建築設計	3,300	1,525.00	5,032,500	
野村不動産ホールディングス	38,400	3,225.00	123,840,000	
三重交通グループホールディングス	13,200	496.00	6,547,200	
サムティ	9,800	2,404.00	23,559,200	
ディア・ライフ	9,300	610.00	5,673,000	
コーセーアールイー	7,200	713.00	5,133,600	
地主	4,700	2,015.00	9,470,500	
プレサンスコーポレーション	8,100	1,588.00	12,862,800	
ハウスコム	4,000	1,119.00	4,476,000	
ＪＰＭＣ	4,800	1,042.00	5,001,600	
サンセイランディック	5,700	854.00	4,867,800	
エストラスト	8,700	574.00	4,993,800	
フージャースホールディングス	9,500	757.00	7,191,500	
オープンハウスグループ	22,500	5,870.00	132,075,000	
東急不動産ホールディングス	184,900	723.00	133,682,700	
飯田グループホールディングス	53,900	2,209.00	119,065,100	
ムゲンエステート	10,100	486.00	4,908,600	
帝国繊維	7,000	1,644.00	11,508,000	
日本コークス工業	56,500	83.00	4,689,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,400	1,683.00	5,722,200	
ＢＥＥＮＯＳ	3,700	3,200.00	11,840,000	
あさひ	5,500	1,328.00	7,304,000	
日本調剤	4,500	1,230.00	5,535,000	
コスモス薬品	7,500	14,710.00	110,325,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,700	2,784.00	65,980,800	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	3,485.00	9,061,000	
セブン&アイ・ホールディングス	227,700	5,578.00	1,270,110,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	49,700	955.00	47,463,500	
明治電機工業	4,700	1,032.00	4,850,400	
ツルハホールディングス	16,200	9,410.00	152,442,000	
サンマルクホールディングス	5,300	1,694.00	8,978,200	

フェリシモ	4,400	1,002.00	4,408,800	
トリドールホールディングス	16,400	2,753.00	45,149,200	
帝人	60,100	1,292.00	77,649,200	
東レ	419,100	737.60	309,128,160	
クラレ	99,400	1,076.00	106,954,400	
旭化成	390,600	1,015.50	396,654,300	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,000	314.00	4,396,000	
稲葉製作所	3,800	1,380.00	5,244,000	
宮地エンジニアリンググループ	1,800	3,370.00	6,066,000	
トーカロ	17,700	1,228.00	21,735,600	
アルファ	4,700	943.00	4,432,100	
ＳＵＭＣＯ	122,700	2,061.00	252,884,700	
川田テクノロジーズ	1,500	3,410.00	5,115,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,100	8,890.00	18,669,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,600	852.00	4,771,200	
シーアールイー	3,400	1,479.00	5,028,600	
ケイアイスター不動産	3,000	4,845.00	14,535,000	
グッドコムアセット	7,000	726.00	5,082,000	
ジェイ・エス・ビー	1,500	4,270.00	6,405,000	
ロードスターキャピタル	3,100	1,730.00	5,363,000	
日本フエルト	11,500	401.00	4,611,500	
イチカワ	3,500	1,302.00	4,557,000	
芦森工業	4,100	1,185.00	4,858,500	
アツギ	10,200	373.00	3,804,600	
ＪＭホールディングス	5,600	1,733.00	9,704,800	
コメダホールディングス	16,200	2,424.00	39,268,800	
アレンザホールディングス	5,100	976.00	4,977,600	
バロックジャパンリミテッド	6,100	793.00	4,837,300	
クスリのアオキホールディングス	6,600	7,710.00	50,886,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	37,900	2,590.00	98,161,000	
アセンテック	9,400	538.00	5,057,200	
セーレン	12,100	2,587.00	31,302,700	
ソトー	5,800	813.00	4,715,400	
東海染工	1,600	1,128.00	1,804,800	
小松マテーレ	9,100	793.00	7,216,300	
ワコールホールディングス	12,000	2,400.00	28,800,000	
ホギメディカル	8,400	3,485.00	29,274,000	
ＴＳＩホールディングス	22,400	471.00	10,550,400	
マツオカコーポレーション	5,300	1,046.00	5,543,800	
ワールド	8,000	1,315.00	10,520,000	
ＴＩＳ	70,400	3,995.00	281,248,000	
グリー	33,600	806.00	27,081,600	
コーエーテクモホールディングス	39,200	2,415.00	94,668,000	
三菱総合研究所	3,100	5,060.00	15,686,000	
ＡＧＳ	6,400	636.00	4,070,400	
ファインデックス	8,000	588.00	4,704,000	
ブレインパッド	6,200	929.00	5,759,800	
ＫＬａｂ	12,300	502.00	6,174,600	
ポールトゥウィンホールディングス	10,700	938.00	10,036,600	

ネクソン	161,800	2,781.00	449,965,800	
アイスタイル	20,000	503.00	10,060,000	
エムアップホールディングス	7,700	1,367.00	10,525,900	
エイチーム	6,400	804.00	5,145,600	
エニグモ	8,900	602.00	5,357,800	
コロプラ	24,300	690.00	16,767,000	
ブロードリーフ	36,600	500.00	18,300,000	
クロス・マーケティンググループ	5,600	784.00	4,390,400	
デジタルハーツホールディングス	3,900	1,918.00	7,480,200	
システム情報	5,500	906.00	4,983,000	
メディアドゥ	2,500	1,935.00	4,837,500	
じげん	18,300	352.00	6,441,600	
ブイキューブ	7,500	804.00	6,030,000	
サイバーリンクス	3,700	1,108.00	4,099,600	
フィックスターズ	7,100	1,114.00	7,909,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,000	1,697.00	5,091,000	
オプティム	5,400	1,178.00	6,361,200	
セレス	4,800	983.00	4,718,400	
ＳＨＩＦＴ	4,600	27,330.00	125,718,000	
特種東海製紙	3,100	2,864.00	8,878,400	
ティーガイア	6,500	1,669.00	10,848,500	
テクマトリックス	11,400	1,661.00	18,935,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,200	2,141.00	41,107,200	
GMOペイメントゲートウェイ	14,300	12,690.00	181,467,000	
インターネットイニシアティブ	34,900	2,375.00	82,887,500	
さくらインターネット	9,200	530.00	4,876,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	4,310.00	8,189,000	
ＳＲＡホールディングス	3,200	3,230.00	10,336,000	
朝日ネット	8,300	581.00	4,822,300	
ｅＢＡＳＥ	8,800	615.00	5,412,000	
アバントグループ	7,900	1,421.00	11,225,900	
アドソル日進	3,400	1,457.00	4,953,800	
フリービット	4,500	1,180.00	5,310,000	
コムチュア	8,300	2,532.00	21,015,600	
サイバーコム	600	1,517.00	910,200	
アステリア	6,100	824.00	5,026,400	
アイル	3,500	1,890.00	6,615,000	
王子ホールディングス	260,600	529.00	137,857,400	
日本製紙	32,600	961.00	31,328,600	
三菱製紙	8,100	278.00	2,251,800	
北越コーポレーション	39,500	794.00	31,363,000	
大王製紙	27,600	1,092.00	30,139,200	
阿波製紙	14,800	302.00	4,469,600	
マークラインズ	3,400	2,725.00	9,265,000	
メディカル・データ・ビジョン	9,300	1,025.00	9,532,500	
ｇｕｍｉ	10,200	783.00	7,986,600	
テラスカイ	2,700	2,337.00	6,309,900	

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,300	1,874.00	6,184,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,100	2,430.00	5,103,000	
ラクス	29,600	1,912.00	56,595,200	
ランドコンピュータ	5,500	878.00	4,829,000	
ダブルスタンダード	2,500	2,254.00	5,635,000	
オープンドア	4,400	1,800.00	7,920,000	
アカツキ	3,000	2,204.00	6,612,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	2,046.00	4,705,800	
カナミックネットワーク	9,000	674.00	6,066,000	
ノムラシステムコーポレーション	39,000	125.00	4,875,000	
レンゴー	57,000	890.00	50,730,000	
トーモク	3,600	1,625.00	5,850,000	
ザ・パック	4,600	2,504.00	11,518,400	
チェンジ	15,300	2,000.00	30,600,000	
シンクロ・フード	200	569.00	113,800	
オークネット	3,300	1,861.00	6,141,300	
キャピタル・アセット・プランニング	7,600	600.00	4,560,000	
マクロミル	14,200	1,100.00	15,620,000	
ビーグリー	3,500	1,313.00	4,595,500	
オロ	3,100	1,683.00	5,217,300	
ユーザーローカル	3,100	1,579.00	4,894,900	
マネーフォワード	15,100	5,020.00	75,802,000	
昭和電工	60,400	2,179.00	131,611,600	
住友化学	464,000	492.00	228,288,000	
住友精化	2,600	4,010.00	10,426,000	
日産化学	29,700	6,570.00	195,129,000	
ラサ工業	2,400	2,221.00	5,330,400	
クレハ	5,300	10,030.00	53,159,000	
多木化学	2,400	5,550.00	13,320,000	
テイカ	4,200	1,296.00	5,443,200	
石原産業	11,300	1,062.00	12,000,600	
片倉コープアグリ	3,900	1,473.00	5,744,700	
日本曹達	6,700	4,265.00	28,575,500	
東ソー	83,500	1,610.00	134,435,000	
トクヤマ	20,200	1,839.00	37,147,800	
セントラル硝子	10,000	3,755.00	37,550,000	
東亞合成	32,200	1,146.00	36,901,200	
大阪ソーダ	3,700	4,150.00	15,355,000	
関東電化工業	12,100	986.00	11,930,600	
デンカ	22,700	3,320.00	75,364,000	
イビデン	36,200	5,570.00	201,634,000	
信越化学工業	107,000	17,450.00	1,867,150,000	
日本カーバイド工業	3,500	1,292.00	4,522,000	
電算システムホールディングス	3,000	2,390.00	7,170,000	
堺化学工業	4,800	1,895.00	9,096,000	
第一稀元素化学工業	5,700	1,233.00	7,028,100	
エア・ウォーター	59,000	1,601.00	94,459,000	
日本酸素ホールディングス	60,700	2,287.00	138,820,900	
日本化学工業	2,600	1,824.00	4,742,400	

日本パーカライジング	31,000	996.00	30,876,000	
高圧ガス工業	9,100	662.00	6,024,200	
四国化成工業	7,400	1,324.00	9,797,600	
ステラ　ケミファ	3,700	2,625.00	9,712,500	
保土谷化学工業	1,800	3,030.00	5,454,000	
日本触媒	9,500	5,450.00	51,775,000	
大日精化工業	4,300	1,719.00	7,391,700	
カネカ	14,300	3,440.00	49,192,000	
協和キリン	75,700	3,270.00	247,539,000	
三菱瓦斯化学	46,700	1,942.00	90,691,400	
三井化学	52,600	3,095.00	162,797,000	
ＪＳＲ	58,400	2,749.00	160,541,600	
東京応化工業	10,900	6,770.00	73,793,000	
大阪有機化学工業	4,700	2,139.00	10,053,300	
三菱ケミカルグループ	422,100	719.00	303,489,900	
ＫＨネオケム	10,400	2,839.00	29,525,600	
ダイセル	92,000	983.00	90,436,000	
住友ベークライト	9,300	4,230.00	39,339,000	
積水化学工業	129,900	1,924.00	249,927,600	
日本ゼオン	37,500	1,358.00	50,925,000	
アイカ工業	15,800	3,270.00	51,666,000	
ＵＢＥ	32,200	2,007.00	64,625,400	
積水樹脂	9,100	1,801.00	16,389,100	
タキロンシーアイ	13,700	515.00	7,055,500	
旭有機材	4,200	2,692.00	11,306,400	
ニチバン	3,900	1,771.00	6,906,900	
リケンテクノス	13,500	502.00	6,777,000	
大倉工業	2,900	1,958.00	5,678,200	
積水化成品工業	12,500	392.00	4,900,000	
群栄化学工業	2,000	2,417.00	4,834,000	
ダイキョーニシカワ	13,800	608.00	8,390,400	
森六ホールディングス	3,200	1,760.00	5,632,000	
恵和	2,000	3,515.00	7,030,000	
日本化薬	47,800	1,196.00	57,168,800	
カーリットホールディングス	7,200	693.00	4,989,600	
ＣＬホールディングス	5,700	838.00	4,776,600	
プレステージ・インターナショナル	27,000	722.00	19,494,000	
プロトコーポレーション	7,800	1,217.00	9,492,600	
アミューズ	3,500	1,710.00	5,985,000	
野村総合研究所	128,500	3,355.00	431,117,500	
ドリームインキュベータ	2,100	2,789.00	5,856,900	
サイバネットシステム	5,200	1,016.00	5,283,200	
クイック	4,900	2,035.00	9,971,500	
ＴＡＣ	22,800	203.00	4,628,400	
ＣＥホールディングス	9,700	520.00	5,044,000	
電通グループ	67,300	4,435.00	298,475,500	
インテージホールディングス	8,500	1,455.00	12,367,500	
ぴあ	2,200	3,315.00	7,293,000	
イオンファンタジー	2,800	2,885.00	8,078,000	
ソースネクスト	31,800	260.00	8,268,000	

シーティーエス	7,100	833.00	5,914,300	
インフォコム	8,100	2,045.00	16,564,500	
メディカルシステムネットワーク	11,800	399.00	4,708,200	
日本精化	3,600	2,224.00	8,006,400	
扶桑化学工業	5,800	3,625.00	21,025,000	
トリケミカル研究所	8,300	2,420.00	20,086,000	
シンプレクス・ホールディングス	10,500	2,355.00	24,727,500	
ＨＥＲＯＺ	4,400	1,210.00	5,324,000	
ラクスル	8,800	3,045.00	26,796,000	
メルカリ	28,200	2,872.00	80,990,400	
ＩＰＳ	2,000	3,115.00	6,230,000	
ＦＩＧ	12,000	419.00	5,028,000	
ＡＤＥＫＡ	21,800	2,219.00	48,374,200	
日油	19,300	5,620.00	108,466,000	
ミヨシ油脂	3,300	1,012.00	3,339,600	
新日本理化	5,800	265.00	1,537,000	
ハリマ化成グループ	5,800	823.00	4,773,400	
イーソル	7,600	814.00	6,186,400	
アルテリア・ネットワークス	5,800	1,265.00	7,337,000	
ウイングアーク１ｓｔ	6,400	2,297.00	14,700,800	
サーバーワークス	1,900	2,746.00	5,217,400	
トビラシステムズ	4,900	1,161.00	5,688,900	
Ｓａｎｓａｎ	23,400	1,695.00	39,663,000	
ギフティ	6,700	2,137.00	14,317,900	
花王	152,300	5,530.00	842,219,000	
第一工業製薬	2,600	2,012.00	5,231,200	
石原ケミカル	3,900	1,238.00	4,828,200	
日華化学	5,500	881.00	4,845,500	
三洋化成工業	3,800	4,325.00	16,435,000	
ベース	2,100	3,800.00	7,980,000	
ＪＭＤＣ	10,300	5,250.00	54,075,000	
武田薬品工業	554,200	3,958.00	2,193,523,600	
アステラス製薬	600,200	2,104.50	1,263,120,900	
住友ファーマ	46,500	1,073.00	49,894,500	
塩野義製薬	80,000	6,978.00	558,240,000	
わかもと製薬	5,400	232.00	1,252,800	
日本新薬	14,800	8,520.00	126,096,000	
中外製薬	196,000	3,512.00	688,352,000	
科研製薬	10,700	3,945.00	42,211,500	
エーザイ	76,200	8,943.00	681,456,600	
理研ビタミン	5,300	1,817.00	9,630,100	
ロート製薬	30,300	4,325.00	131,047,500	
小野薬品工業	120,800	3,505.00	423,404,000	
久光製薬	13,900	3,830.00	53,237,000	
有機合成薬品工業	15,800	299.00	4,724,200	
持田製薬	7,500	3,275.00	24,562,500	
参天製薬	121,600	1,122.00	136,435,200	
扶桑薬品工業	2,400	2,109.00	5,061,600	
ツムラ	19,700	2,987.00	58,843,900	
日医工	18,300	58.00	1,061,400	

テルモ	195,100	3,949.00	770,449,900	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	18,800	2,790.00	52,452,000	
キッセイ薬品工業	9,700	2,513.00	24,376,100	
生化学工業	11,900	949.00	11,293,100	
栄研化学	10,200	1,944.00	19,828,800	
鳥居薬品	3,400	2,950.00	10,030,000	
ＪＣＲファーマ	21,200	1,955.00	41,446,000	
東和薬品	9,600	2,094.00	20,102,400	
富士製薬工業	4,500	1,032.00	4,644,000	
ゼリア新薬工業	8,700	2,214.00	19,261,800	
第一三共	545,600	4,615.00	2,517,944,000	
キョーリン製薬ホールディングス	13,600	1,842.00	25,051,200	
大幸薬品	11,400	538.00	6,133,200	
ダイト	4,700	2,578.00	12,116,600	
大塚ホールディングス	143,300	4,652.00	666,631,600	
大正製薬ホールディングス	13,900	5,500.00	76,450,000	
ペプチドリーム	30,400	1,808.00	54,963,200	
大日本塗料	7,600	766.00	5,821,600	
日本ペイントホールディングス	276,800	1,093.00	302,542,400	
関西ペイント	57,300	1,878.00	107,609,400	
中国塗料	11,600	1,037.00	12,029,200	
藤倉化成	12,300	403.00	4,956,900	
太陽ホールディングス	9,500	2,554.00	24,263,000	
ＤＩＣ	24,400	2,470.00	60,268,000	
サカタインクス	13,900	1,087.00	15,109,300	
東洋インキＳＣホールディングス	12,200	1,860.00	22,692,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,600	912.00	5,107,200	
アルプス技研	5,600	2,120.00	11,872,000	
日本空調サービス	6,900	699.00	4,823,100	
オリエンタルランド	67,900	19,640.00	1,333,556,000	
フォーカスシステムズ	4,800	1,012.00	4,857,600	
ダスキン	14,300	2,968.00	42,442,400	
パーク２４	47,900	2,005.00	96,039,500	
明光ネットワークジャパン	8,400	615.00	5,166,000	
ファルコホールディングス	2,900	1,784.00	5,173,600	
クレスコ	4,800	1,761.00	8,452,800	
フジ・メディア・ホールディングス	60,200	1,050.00	63,210,000	
秀英予備校	11,100	434.00	4,817,400	
ラウンドワン	53,700	567.00	30,447,900	
リゾートトラスト	25,300	2,335.00	59,075,500	
オービック	20,900	21,800.00	455,620,000	
ジャストシステム	9,000	3,315.00	29,835,000	
ＴＤＣソフト	5,300	1,493.00	7,912,900	
Ｚホールディングス	891,300	359.50	320,422,350	
ビー・エム・エル	8,000	3,480.00	27,840,000	
トレンドマイクロ	36,200	7,160.00	259,192,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,600	1,017.00	10,780,200	
ＩＤホールディングス	5,300	918.00	4,865,400	
リソー教育	29,200	323.00	9,431,600	
日本オラクル	12,000	8,580.00	102,960,000	

早稲田アカデミー	4,300	1,121.00	4,820,300	
アルファシステムズ	2,000	4,385.00	8,770,000	
フューチャー	15,600	1,647.00	25,693,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,800	1,504.00	5,715,200	
ＳＢテクノロジー	2,700	2,002.00	5,405,400	
トーセ	6,200	770.00	4,774,000	
ユー・エス・エス	66,000	2,160.00	142,560,000	
オービックビジネスコンサルタント	12,300	4,275.00	52,582,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	33,600	3,285.00	110,376,000	
アイティフォー	8,200	781.00	6,404,200	
東京個別指導学院	9,300	536.00	4,984,800	
東計電算	900	5,860.00	5,274,000	
サイバーエージェント	153,600	1,227.00	188,467,200	
楽天グループ	296,900	657.00	195,063,300	
エックスネット	4,800	1,010.00	4,848,000	
クリーク・アンド・リバー社	3,800	2,047.00	7,778,600	
モーニングスター	10,700	442.00	4,729,400	
テー・オー・ダブリュー	15,700	297.00	4,662,900	
大塚商会	35,500	4,675.00	165,962,500	
サイボウズ	8,600	2,126.00	18,283,600	
山田コンサルティンググループ	4,200	1,153.00	4,842,600	
セントラルスポーツ	2,400	2,429.00	5,829,600	
電通国際情報サービス	7,600	4,700.00	35,720,000	
ＡＣＣＥＳＳ	7,400	801.00	5,927,400	
デジタルガレージ	11,100	4,105.00	45,565,500	
イーエムシステムズ	10,400	961.00	9,994,400	
ウェザーニューズ	2,200	7,800.00	17,160,000	
ＣＩＪ	6,000	930.00	5,580,000	
日本エンタープライズ	30,300	144.00	4,363,200	
WOWOW	4,000	1,262.00	5,048,000	
スカラ	6,600	748.00	4,936,800	
フルキャストホールディングス	6,100	2,901.00	17,696,100	
エン・ジャパン	11,600	2,328.00	27,004,800	
あすか製薬ホールディングス	6,500	1,203.00	7,819,500	
サワイグループホールディングス	14,300	4,210.00	60,203,000	
富士フイルムホールディングス	120,200	7,335.00	881,667,000	
コニカミノルタ	140,900	557.00	78,481,300	
資生堂	130,800	5,784.00	756,547,200	
ライオン	75,100	1,475.00	110,772,500	
高砂香料工業	4,200	2,875.00	12,075,000	
マンダム	13,500	1,380.00	18,630,000	
ミルボン	9,300	5,650.00	52,545,000	
ファンケル	27,400	2,649.00	72,582,600	
コーセー	12,700	14,590.00	185,293,000	
コタ	5,200	1,648.00	8,569,600	
シーボン	2,900	1,588.00	4,605,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	32,100	1,779.00	57,105,900	
ノエビアホールディングス	5,600	5,710.00	31,976,000	
アジュバンホールディングス	5,000	927.00	4,635,000	
新日本製薬	3,600	1,410.00	5,076,000	

エステー	4,800	1,536.00	7,372,800	
アグロ　カネショウ	3,600	1,489.00	5,360,400	
コニシ	10,500	1,789.00	18,784,500	
長谷川香料	13,000	2,943.00	38,259,000	
星光ＰＭＣ	8,900	529.00	4,708,100	
小林製薬	19,200	8,640.00	165,888,000	
荒川化学工業	5,300	975.00	5,167,500	
メック	5,200	2,470.00	12,844,000	
日本高純度化学	2,100	2,462.00	5,170,200	
タカラバイオ	16,900	1,811.00	30,605,900	
ＪＣＵ	7,100	3,260.00	23,146,000	
新田ゼラチン	500	1,034.00	517,000	
ＯＡＴアグリオ	2,800	1,675.00	4,690,000	
デクセリアルズ	18,100	3,285.00	59,458,500	
アース製薬	5,700	5,440.00	31,008,000	
北興化学工業	6,300	913.00	5,751,900	
大成ラミック	2,000	3,060.00	6,120,000	
クミアイ化学工業	24,900	930.00	23,157,000	
日本農薬	11,500	718.00	8,257,000	
ニチレキ	7,400	1,260.00	9,324,000	
ユシロ化学工業	6,000	793.00	4,758,000	
富士石油	15,800	272.00	4,297,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	900	1,100.00	990,000	
出光興産	69,600	3,150.00	219,240,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,131,500	463.50	524,450,250	
コスモエネルギーホールディングス	23,800	3,860.00	91,868,000	
テスホールディングス	6,600	1,096.00	7,233,600	
インフロニア・ホールディングス	64,200	1,045.00	67,089,000	
横浜ゴム	35,600	2,137.00	76,077,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	36,000	1,533.00	55,188,000	
ブリヂストン	200,000	5,283.00	1,056,600,000	
住友ゴム工業	61,400	1,153.00	70,794,200	
藤倉コンポジット	2,600	875.00	2,275,000	
オカモト	3,500	3,780.00	13,230,000	
アキレス	4,100	1,378.00	5,649,800	
フコク	4,800	1,047.00	5,025,600	
ニッタ	6,400	2,936.00	18,790,400	
住友理工	12,100	610.00	7,381,000	
三ツ星ベルト	9,100	3,485.00	31,713,500	
バンドー化学	9,900	1,012.00	10,018,800	
ＡＧＣ	63,700	4,550.00	289,835,000	
日本板硝子	31,900	550.00	17,545,000	
有沢製作所	10,200	1,282.00	13,076,400	
日本電気硝子	25,600	2,591.00	66,329,600	
オハラ	3,900	1,295.00	5,050,500	
住友大阪セメント	8,800	3,200.00	28,160,000	
太平洋セメント	39,900	2,102.00	83,869,800	
日本ヒューム	7,800	648.00	5,054,400	
日本コンクリート工業	20,300	233.00	4,729,900	
三谷セキサン	2,600	4,110.00	10,686,000	

アジアパイルホールディングス	9,800	512.00	5,017,600	
東海カーボン	52,500	1,058.00	55,545,000	
日本カーボン	3,600	4,345.00	15,642,000	
東洋炭素	3,900	3,810.00	14,859,000	
ノリタケカンパニーリミテド	3,100	4,025.00	12,477,500	
ＴＯＴＯ	41,300	4,705.00	194,316,500	
日本碍子	74,100	1,754.00	129,971,400	
日本特殊陶業	47,700	2,654.00	126,595,800	
ＭＡＲＵＷＡ	2,300	18,360.00	42,228,000	
品川リフラクトリーズ	1,800	3,990.00	7,182,000	
黒崎播磨	1,300	4,995.00	6,493,500	
ヨータイ	4,200	1,368.00	5,745,600	
ニッカトー	5,200	497.00	2,584,400	
フジミインコーポレーテッド	5,000	6,920.00	34,600,000	
クニミネ工業	3,100	825.00	2,557,500	
ニチアス	15,800	2,419.00	38,220,200	
日本製鉄	288,500	2,228.00	642,778,000	
神戸製鋼所	129,600	611.00	79,185,600	
中山製鋼所	13,300	774.00	10,294,200	
合同製鐵	3,200	1,928.00	6,169,600	
ＪＦＥホールディングス	172,200	1,494.00	257,266,800	
東京製鐵	18,100	1,381.00	24,996,100	
共英製鋼	7,300	1,327.00	9,687,100	
大和工業	10,600	4,795.00	50,827,000	
東京鐵鋼	3,400	1,402.00	4,766,800	
大阪製鐵	4,400	1,160.00	5,104,000	
淀川製鋼所	7,300	2,560.00	18,688,000	
丸一鋼管	19,600	2,884.00	56,526,400	
大同特殊鋼	8,100	4,355.00	35,275,500	
日本高周波鋼業	15,200	319.00	4,848,800	
日本冶金工業	4,700	4,070.00	19,129,000	
山陽特殊製鋼	6,400	2,277.00	14,572,800	
愛知製鋼	3,700	2,332.00	8,628,400	
日立金属	60,100	2,171.00	130,477,100	
大平洋金属	4,600	1,920.00	8,832,000	
新日本電工	41,200	450.00	18,540,000	
栗本鐵工所	3,100	1,770.00	5,487,000	
日本製鋼所	17,400	3,015.00	52,461,000	
三菱製鋼	5,000	997.00	4,985,000	
日亜鋼業	18,500	237.00	4,384,500	
日本精線	1,200	4,310.00	5,172,000	
エンビプロ・ホールディングス	300	752.00	225,600	
大紀アルミニウム工業所	9,200	1,346.00	12,383,200	
日本軽金属ホールディングス	17,400	1,548.00	26,935,200	
三井金属鉱業	18,700	3,140.00	58,718,000	
東邦亜鉛	3,800	2,125.00	8,075,000	
三菱マテリアル	43,000	2,142.00	92,106,000	
住友金属鉱山	74,700	4,542.00	339,287,400	
ＤＯＷＡホールディングス	14,500	4,455.00	64,597,500	
古河機械金属	9,400	1,265.00	11,891,000	

大阪チタニウムテクノロジーズ	9,500	3,820.00	36,290,000	
東邦チタニウム	11,700	2,685.00	31,414,500	
ＵＡＣＪ	9,000	2,213.00	19,917,000	
ＣＫサンエツ	1,600	4,050.00	6,480,000	
古河電気工業	21,500	2,535.00	54,502,500	
住友電気工業	222,500	1,611.50	358,558,750	
フジクラ	69,100	1,123.00	77,599,300	
昭和電線ホールディングス	7,200	1,645.00	11,844,000	
東京特殊電線	1,200	5,640.00	6,768,000	
タツタ電線	13,200	434.00	5,728,800	
平河ヒューテック	4,300	1,113.00	4,785,900	
いよぎんホールディングス	73,200	654.00	47,872,800	
しずおかフィナンシャルグループ	139,000	941.00	130,799,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	51,800	913.00	47,293,400	
リョービ	6,900	1,232.00	8,500,800	
アーレスティ	7,800	388.00	3,026,400	
アサヒホールディングス	26,100	2,009.00	52,434,900	
東洋製罐グループホールディングス	42,600	1,580.00	67,308,000	
ホッカンホールディングス	3,700	1,321.00	4,887,700	
コロナ	5,700	848.00	4,833,600	
横河ブリッジホールディングス	8,500	1,893.00	16,090,500	
三和ホールディングス	59,300	1,267.00	75,133,100	
文化シヤッター	18,500	1,130.00	20,905,000	
三協立山	8,800	570.00	5,016,000	
アルインコ	5,000	996.00	4,980,000	
ＬＩＸＩＬ	93,900	2,118.00	198,880,200	
日本フイルコン	9,800	479.00	4,694,200	
ノーリツ	9,500	1,493.00	14,183,500	
長府製作所	6,500	1,990.00	12,935,000	
リンナイ	11,700	10,170.00	118,989,000	
ユニプレス	11,200	883.00	9,889,600	
ダイニチ工業	7,200	666.00	4,795,200	
日東精工	9,300	516.00	4,798,800	
三洋工業	2,900	1,716.00	4,976,400	
岡部	10,400	713.00	7,415,200	
ジーテクト	7,200	1,508.00	10,857,600	
東プレ	11,400	1,245.00	14,193,000	
高周波熱錬	10,500	671.00	7,045,500	
東京製綱	5,400	881.00	4,757,400	
サンコール	2,500	635.00	1,587,500	
モリテックスチール	7,200	244.00	1,756,800	
パイオラックス	8,900	1,746.00	15,539,400	
エイチワン	7,900	653.00	5,158,700	
日本発条	57,000	907.00	51,699,000	
三浦工業	26,300	3,335.00	87,710,500	
タクマ	19,400	1,289.00	25,006,600	
テクノプロ・ホールディングス	43,000	3,830.00	164,690,000	
インターワークス	12,900	371.00	4,785,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,300	1,834.00	6,052,200	

ＫｅｅＰｅｒ技研	4,600	4,055.00	18,653,000	
三機サービス	4,800	927.00	4,449,600	
イー・ガーディアン	2,400	2,823.00	6,775,200	
リブセンス	1,800	299.00	538,200	
ジャパンマテリアル	19,600	2,507.00	49,137,200	
ベクトル	10,100	1,191.00	12,029,100	
ウチヤマホールディングス	15,900	274.00	4,356,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,105.00	5,856,500	
キャリアリンク	2,400	3,055.00	7,332,000	
ＩＢＪ	5,000	985.00	4,925,000	
アサンテ	3,200	1,594.00	5,100,800	
バリューＨＲ	5,600	1,520.00	8,512,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,900	4,915.00	28,998,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,087.00	5,108,900	
シグマクシス・ホールディングス	9,700	1,297.00	12,580,900	
ウィルグループ	5,300	1,340.00	7,102,000	
メドピア	5,000	1,717.00	8,585,000	
リクルートホールディングス	475,200	4,430.00	2,105,136,000	
エラン	8,500	1,011.00	8,593,500	
ツガミ	14,000	1,118.00	15,652,000	
オークマ	6,300	5,150.00	32,445,000	
芝浦機械	7,000	2,620.00	18,340,000	
アマダ	100,600	1,109.00	111,565,400	
アイダエンジニアリング	13,000	813.00	10,569,000	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	4,000	1,087.00	4,348,000	
ＦＵＪＩ	27,400	2,095.00	57,403,000	
牧野フライス製作所	7,000	4,495.00	31,465,000	
オーエスジー	30,100	1,984.00	59,718,400	
ダイジェット工業	5,300	839.00	4,446,700	
旭ダイヤモンド工業	18,200	721.00	13,122,200	
DMG森精機	38,200	1,843.00	70,402,600	
ソディック	17,400	772.00	13,432,800	
ディスコ	10,100	40,500.00	409,050,000	
日東工器	3,100	1,547.00	4,795,700	
日進工具	5,300	1,097.00	5,814,100	
パンチ工業	10,500	424.00	4,452,000	
日本郵政	841,300	1,058.00	890,095,400	
ベルシステム２４ホールディングス	8,600	1,308.00	11,248,800	
鎌倉新書	7,300	769.00	5,613,700	
ＳＭＮ	8,300	458.00	3,801,400	
エアトリ	4,100	2,573.00	10,549,300	
アトラエ	5,000	1,485.00	7,425,000	
ストライク	3,200	4,265.00	13,648,000	
ソラスト	17,700	815.00	14,425,500	
インソース	8,000	3,255.00	26,040,000	
豊田自動織機	45,700	7,690.00	351,433,000	
東洋機械金属	7,200	546.00	3,931,200	
エンシュウ	5,600	720.00	4,032,000	
島精機製作所	10,000	2,024.00	20,240,000	

オプトラン	9,300	2,624.00	24,403,200	
ＮＣホールディングス	2,200	2,084.00	4,584,800	
イワキ	4,200	1,284.00	5,392,800	
フリュー	6,600	1,149.00	7,583,400	
ヤマシンフィルタ	15,000	493.00	7,395,000	
日阪製作所	6,100	825.00	5,032,500	
やまびこ	10,300	1,140.00	11,742,000	
野村マイクロ・サイエンス	2,100	4,770.00	10,017,000	
平田機工	3,000	5,600.00	16,800,000	
ペガサスミシン製造	7,000	939.00	6,573,000	
マルマエ	3,000	1,888.00	5,664,000	
タツモ	3,500	1,810.00	6,335,000	
ナブテスコ	39,600	3,330.00	131,868,000	
三井海洋開発	7,900	1,576.00	12,450,400	
レオン自動機	6,600	1,118.00	7,378,800	
ＳＭＣ	20,500	64,240.00	1,316,920,000	
ホソカワミクロン	4,800	2,870.00	13,776,000	
ユニオンツール	2,800	3,645.00	10,206,000	
オイレス工業	8,800	1,489.00	13,103,200	
日精エー・エス・ビー機械	2,900	4,005.00	11,614,500	
サトーホールディングス	9,000	1,939.00	17,451,000	
技研製作所	6,600	3,345.00	22,077,000	
日本エアーテック	4,300	1,159.00	4,983,700	
カワタ	4,900	830.00	4,067,000	
日精樹脂工業	5,000	938.00	4,690,000	
小松製作所	295,500	3,098.00	915,459,000	
住友重機械工業	37,300	2,860.00	106,678,000	
日立建機	25,100	3,095.00	77,684,500	
日工	9,300	618.00	5,747,400	
巴工業	2,700	2,451.00	6,617,700	
井関農機	5,900	1,245.00	7,345,500	
ＴＯＷＡ	6,400	2,027.00	12,972,800	
北川鉄工所	3,800	1,160.00	4,408,000	
シンニッタン	14,800	219.00	3,241,200	
ローツェ	3,300	8,530.00	28,149,000	
タカキタ	9,600	469.00	4,502,400	
クボタ	333,700	2,055.00	685,753,500	
荏原実業	3,100	2,190.00	6,789,000	
三菱化工機	2,300	2,123.00	4,882,900	
月島機械	8,500	986.00	8,381,000	
帝国電機製作所	4,800	2,368.00	11,366,400	
新東工業	12,700	676.00	8,585,200	
澁谷工業	5,900	2,483.00	14,649,700	
アイチコーポレーション	8,900	810.00	7,209,000	
小森コーポレーション	14,600	828.00	12,088,800	
鶴見製作所	4,800	2,053.00	9,854,400	
荏原製作所	25,800	5,030.00	129,774,000	
石井鐵工所	1,700	2,480.00	4,216,000	
酉島製作所	5,400	1,397.00	7,543,800	
北越工業	6,300	1,160.00	7,308,000	

ダイキン工業	75,300	22,580.00	1,700,274,000	
オルガノ	8,700	2,874.00	25,003,800	
トーヨーカネツ	2,400	2,440.00	5,856,000	
栗田工業	35,300	6,060.00	213,918,000	
椿本チエイン	8,900	3,170.00	28,213,000	
大同工業	3,900	764.00	2,979,600	
日機装	15,600	1,008.00	15,724,800	
木村化工機	6,700	683.00	4,576,100	
レイズネクスト	8,900	1,228.00	10,929,200	
アネスト岩田	10,700	917.00	9,811,900	
ダイフク	32,500	7,070.00	229,775,000	
サムコ	2,100	3,710.00	7,791,000	
加藤製作所	6,000	777.00	4,662,000	
タダノ	33,300	924.00	30,769,200	
フジテック	23,100	3,055.00	70,570,500	
ＣＫＤ	17,400	2,062.00	35,878,800	
キトー	5,400	2,718.00	14,677,200	
平和	21,000	2,389.00	50,169,000	
理想科学工業	5,600	2,274.00	12,734,400	
ＳＡＮＫＹＯ	12,400	4,775.00	59,210,000	
日本金銭機械	6,900	864.00	5,961,600	
マースグループホールディングス	3,700	1,966.00	7,274,200	
フクシマガリレイ	4,600	4,240.00	19,504,000	
ダイコク電機	3,500	1,449.00	5,071,500	
竹内製作所	11,400	3,050.00	34,770,000	
アマノ	17,900	2,498.00	44,714,200	
ＪＵＫＩ	9,800	663.00	6,497,400	
ジャノメ	7,600	633.00	4,810,800	
ブラザー工業	84,300	2,197.00	185,207,100	
マックス	7,800	2,018.00	15,740,400	
モリタホールディングス	11,000	1,232.00	13,552,000	
グローリー	16,300	2,202.00	35,892,600	
新晃工業	6,400	1,548.00	9,907,200	
大和冷機工業	9,700	1,245.00	12,076,500	
セガサミーホールディングス	50,700	1,802.00	91,361,400	
リケン	2,500	2,276.00	5,690,000	
ＴＰＲ	7,400	1,231.00	9,109,400	
ツバキ・ナカシマ	15,500	1,032.00	15,996,000	
ホシザキ	40,600	4,605.00	186,963,000	
大豊工業	6,700	711.00	4,763,700	
日本精工	115,900	769.00	89,127,100	
ＮＴＮ	124,300	283.00	35,176,900	
ジェイテクト	56,100	1,012.00	56,773,200	
不二越	4,700	4,045.00	19,011,500	
ミネベアミツミ	109,700	2,214.00	242,875,800	
日本トムソン	15,400	597.00	9,193,800	
ＴＨＫ	36,400	2,689.00	97,879,600	
ユーシン精機	7,100	684.00	4,856,400	
前澤給装工業	5,300	919.00	4,870,700	
イーグル工業	7,000	1,108.00	7,756,000	

日本ピラー工業	5,800	2,748.00	15,938,400	
キッツ	23,200	851.00	19,743,200	
日立製作所	316,700	7,297.00	2,310,959,900	
東芝	121,400	4,882.00	592,674,800	
三菱電機	651,800	1,392.00	907,305,600	
富士電機	38,300	5,870.00	224,821,000	
東洋電機製造	5,300	860.00	4,558,000	
安川電機	74,700	4,405.00	329,053,500	
シンフォニア　テクノロジー	7,000	1,447.00	10,129,000	
明電舎	9,600	2,033.00	19,516,800	
オリジン	1,600	1,311.00	2,097,600	
山洋電気	2,700	6,090.00	16,443,000	
デンヨー	4,800	1,464.00	7,027,200	
ＰＨＣホールディングス	8,800	1,645.00	14,476,000	
ベイカレント・コンサルティング	50,800	4,360.00	221,488,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,900	2,326.00	4,419,400	
アイモバイル	4,000	1,272.00	5,088,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	22,800	1,677.00	38,235,600	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	10,800	377.00	4,071,600	
ウェルビー	5,700	909.00	5,181,300	
ミダックホールディングス	3,900	3,190.00	12,441,000	
キュービーネットホールディングス	3,600	1,418.00	5,104,800	
ＲＰＡホールディングス	17,300	290.00	5,017,000	
三櫻工業	9,500	656.00	6,232,000	
マキタ	78,500	3,050.00	239,425,000	
東芝テック	9,400	3,695.00	34,733,000	
芝浦メカトロニクス	1,200	11,520.00	13,824,000	
マブチモーター	15,700	4,155.00	65,233,500	
日本電産	153,200	8,680.00	1,329,776,000	
トレックス・セミコンダクター	3,000	2,962.00	8,886,000	
東光高岳	3,800	1,867.00	7,094,600	
ダブル・スコープ	20,600	1,800.00	37,080,000	
ダイヘン	5,700	4,130.00	23,541,000	
ヤーマン	12,300	1,308.00	16,088,400	
ＪＶＣケンウッド	57,400	382.00	21,926,800	
Ｉ－ＰＥＸ	3,600	1,310.00	4,716,000	
日新電機	15,100	1,397.00	21,094,700	
大崎電気工業	15,000	526.00	7,890,000	
オムロン	57,800	7,060.00	408,068,000	
日東工業	8,500	2,255.00	19,167,500	
ＩＤＥＣ	9,300	3,155.00	29,341,500	
不二電機工業	4,100	1,120.00	4,592,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	20,700	2,156.00	44,629,200	
サクサホールディングス	3,800	1,376.00	5,228,800	
メルコホールディングス	1,700	3,155.00	5,363,500	
日本電気	89,200	4,865.00	433,958,000	
富士通	62,800	18,530.00	1,163,684,000	
沖電気工業	28,500	742.00	21,147,000	

岩崎通信機	6,000	782.00	4,692,000	
電気興業	3,000	2,121.00	6,363,000	
サンケン電気	5,900	7,110.00	41,949,000	
アイホン	3,800	1,853.00	7,041,400	
ルネサスエレクトロニクス	411,300	1,384.50	569,444,850	
セイコーエプソン	84,000	2,150.00	180,600,000	
ワコム	50,000	652.00	32,600,000	
アルバック	15,000	6,000.00	90,000,000	
ＥＩＺＯ	4,600	3,830.00	17,618,000	
ジャパンディスプレイ	242,200	47.00	11,383,400	
日本信号	14,400	1,036.00	14,918,400	
京三製作所	13,200	414.00	5,464,800	
能美防災	8,500	1,612.00	13,702,000	
ホーチキ	4,700	1,359.00	6,387,300	
星和電機	10,400	449.00	4,669,600	
エレコム	15,100	1,494.00	22,559,400	
パナソニック　ホールディングス	745,000	1,261.50	939,817,500	
シャープ	75,900	978.00	74,230,200	
アンリツ	44,400	1,511.00	67,088,400	
富士通ゼネラル	17,900	3,215.00	57,548,500	
ソニーグループ	441,700	11,255.00	4,971,333,500	
ＴＤＫ	99,900	4,945.00	494,005,500	
帝国通信工業	3,200	1,428.00	4,569,600	
タムラ製作所	27,100	806.00	21,842,600	
アルプスアルパイン	56,300	1,331.00	74,935,300	
池上通信機	8,000	531.00	4,248,000	
日本電波工業	7,600	1,660.00	12,616,000	
メイコー	6,900	3,155.00	21,769,500	
ローランド　ディー．ジー．	3,500	3,160.00	11,060,000	
フォスター電機	6,000	971.00	5,826,000	
ＳＭＫ	1,800	2,715.00	4,887,000	
ヨコオ	5,000	2,478.00	12,390,000	
ホシデン	15,100	1,796.00	27,119,600	
ヒロセ電機	10,400	18,440.00	191,776,000	
日本航空電子工業	12,900	2,424.00	31,269,600	
ＴＯＡ	7,300	767.00	5,599,100	
マクセル	13,700	1,395.00	19,111,500	
古野電気	8,200	1,017.00	8,339,400	
スミダコーポレーション	5,800	1,429.00	8,288,200	
アイコム	2,400	2,641.00	6,338,400	
リオン	2,600	1,982.00	5,153,200	
横河電機	69,000	2,498.00	172,362,000	
新電元工業	2,400	3,400.00	8,160,000	
アズビル	43,600	4,075.00	177,670,000	
東亜ディーケーケー	5,400	853.00	4,606,200	
日本光電工業	28,800	3,230.00	93,024,000	
共和電業	11,800	346.00	4,082,800	
日本電子材料	4,100	1,538.00	6,305,800	
堀場製作所	13,900	6,450.00	89,655,000	
アドバンテスト	49,200	9,120.00	448,704,000	

小野測器	11,300	385.00	4,350,500	
エスペック	5,000	2,067.00	10,335,000	
キーエンス	62,500	58,760.00	3,672,500,000	
日置電機	3,300	6,890.00	22,737,000	
シスメックス	53,900	8,454.00	455,670,600	
日本マイクロニクス	10,300	1,479.00	15,233,700	
メガチップス	5,100	2,541.00	12,959,100	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,900	3,595.00	10,425,500	
澤藤電機	3,300	1,300.00	4,290,000	
デンソー	128,800	7,604.00	979,395,200	
原田工業	5,500	812.00	4,466,000	
コーセル	8,300	861.00	7,146,300	
イリソ電子工業	5,700	5,080.00	28,956,000	
オプテックスグループ	11,500	2,077.00	23,885,500	
千代田インテグレ	2,500	2,400.00	6,000,000	
レーザーテック	30,800	25,135.00	774,158,000	
スタンレー電気	44,400	2,880.00	127,872,000	
岩崎電気	2,000	2,528.00	5,056,000	
ウシオ電機	32,600	1,776.00	57,897,600	
岡谷電機産業	100	267.00	26,700	
日本セラミック	6,400	2,632.00	16,844,800	
遠藤照明	6,300	744.00	4,687,200	
古河電池	4,600	1,087.00	5,000,200	
山一電機	5,400	1,910.00	10,314,000	
図研	5,400	3,195.00	17,253,000	
日本電子	15,600	5,020.00	78,312,000	
カシオ計算機	46,500	1,360.00	63,240,000	
ファナック	61,300	20,515.00	1,257,569,500	
日本シイエムケイ	13,300	595.00	7,913,500	
エンプラス	1,800	4,440.00	7,992,000	
大真空	7,600	857.00	6,513,200	
ローム	28,900	10,790.00	311,831,000	
浜松ホトニクス	50,100	7,190.00	360,219,000	
三井ハイテック	6,500	8,230.00	53,495,000	
新光電気工業	22,100	4,005.00	88,510,500	
京セラ	97,000	7,019.00	680,843,000	
太陽誘電	30,400	4,395.00	133,608,000	
村田製作所	189,400	7,640.00	1,447,016,000	
双葉電子工業	11,900	585.00	6,961,500	
日東電工	45,500	8,640.00	393,120,000	
北陸電気工業	4,300	1,274.00	5,478,200	
東海理化電機製作所	17,600	1,599.00	28,142,400	
ニチコン	12,800	1,429.00	18,291,200	
日本ケミコン	6,200	1,824.00	11,308,800	
ＫＯＡ	9,500	2,251.00	21,384,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	28,500	422.00	12,027,000	
日立造船	51,700	873.00	45,134,100	
三菱重工業	110,300	5,196.00	573,118,800	
川崎重工業	47,100	2,860.00	134,706,000	
ＩＨＩ	39,700	3,400.00	134,980,000	

名村造船所	16,000	498.00	7,968,000	
マネジメントソリューションズ	3,500	3,855.00	13,492,500	
プロレド・パートナーズ	9,400	528.00	4,963,200	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	11,700	389.00	4,551,300	
カーブスホールディングス	19,700	900.00	17,730,000	
フォーラムエンジニアリング	5,700	852.00	4,856,400	
日本車輌製造	2,500	1,965.00	4,912,500	
三菱ロジスネクスト	10,000	884.00	8,840,000	
フルサト・マルカホールディングス	6,600	3,575.00	23,595,000	
ヤマエグループホールディングス	3,700	1,444.00	5,342,800	
ＦＰＧ	25,000	1,076.00	26,900,000	
島根銀行	9,900	418.00	4,138,200	
じもとホールディングス	8,400	399.00	3,351,600	
全国保証	16,100	5,060.00	81,466,000	
めぶきフィナンシャルグループ	305,200	297.00	90,644,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,000	1,268.00	6,340,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	2,204.00	17,411,600	
九州フィナンシャルグループ	108,200	380.00	41,116,000	
かんぽ生命保険	74,700	2,197.00	164,115,900	
ゆうちょ銀行	175,100	1,026.00	179,652,600	
富山第一銀行	15,300	404.00	6,181,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	339,000	466.00	157,974,000	
ジェイリース	2,100	2,986.00	6,270,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	38,900	828.00	32,209,200	
イントラスト	4,200	755.00	3,171,000	
アルヒ	12,600	1,060.00	13,356,000	
プレミアグループ	10,300	1,789.00	18,426,700	
日産自動車	887,100	497.70	441,509,670	
いすゞ自動車	181,500	1,796.00	325,974,000	
トヨタ自動車	3,428,900	2,003.00	6,868,086,700	
日野自動車	80,500	632.00	50,876,000	
三菱自動車工業	243,600	591.00	143,967,600	
エフテック	9,000	520.00	4,680,000	
武蔵精密工業	15,300	1,792.00	27,417,600	
日産車体	11,000	825.00	9,075,000	
新明和工業	19,600	1,019.00	19,972,400	
極東開発工業	11,000	1,359.00	14,949,000	
トピー工業	5,100	1,696.00	8,649,600	
ティラド	1,700	2,531.00	4,302,700	
曙ブレーキ工業	38,200	163.00	6,226,600	
タチエス	9,900	1,132.00	11,206,800	
ＮＯＫ	24,300	1,291.00	31,371,300	
フタバ産業	16,700	361.00	6,028,700	
ＫＹＢ	6,000	3,530.00	21,180,000	
大同メタル工業	12,200	486.00	5,929,200	
プレス工業	27,900	427.00	11,913,300	
ミクニ	13,600	355.00	4,828,000	

太平洋工業	14,300	1,063.00	15,200,900	
アイシン	48,200	3,820.00	184,124,000	
マツダ	206,600	1,105.00	228,293,000	
今仙電機製作所	2,500	541.00	1,352,500	
本田技研工業	507,600	3,348.00	1,699,444,800	
スズキ	114,700	5,048.00	579,005,600	
ＳＵＢＡＲＵ	197,600	2,310.00	456,456,000	
ヤマハ発動機	98,100	3,395.00	333,049,500	
小糸製作所	75,100	2,230.00	167,473,000	
エクセディ	10,200	1,672.00	17,054,400	
ミツバ	11,700	522.00	6,107,400	
豊田合成	18,200	2,335.00	42,497,000	
愛三工業	10,300	709.00	7,302,700	
盟和産業	4,800	928.00	4,454,400	
ヨロズ	5,900	809.00	4,773,100	
エフ・シー・シー	11,100	1,429.00	15,861,900	
シマノ	25,500	23,040.00	587,520,000	
テイ・エス　テック	28,600	1,689.00	48,305,400	
三十三フィナンシャルグループ	5,500	1,440.00	7,920,000	
第四北越フィナンシャルグループ	9,700	2,542.00	24,657,400	
ひろぎんホールディングス	80,200	614.00	49,242,800	
マーキュリアホールディングス	5,000	621.00	3,105,000	
おきなわフィナンシャルグループ	5,900	2,043.00	12,053,700	
ダイレクトマーケティングミックス	7,300	1,500.00	10,950,000	
ポピンズ	3,200	1,662.00	5,318,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,000	2,418.00	12,090,000	
十六フィナンシャルグループ	8,000	2,460.00	19,680,000	
北國フィナンシャルホールディングス	5,200	4,220.00	21,944,000	
ネットプロテクションズホールディングス	20,300	502.00	10,190,600	
プロクレアホールディングス	7,500	2,073.00	15,547,500	
あいちフィナンシャルグループ	8,600	2,095.00	18,017,000	
ジャムコ	3,400	1,596.00	5,426,400	
小野建	6,100	1,459.00	8,899,900	
はるやまホールディングス	11,000	438.00	4,818,000	
南陽	2,700	1,806.00	4,876,200	
ノジマ	21,600	1,313.00	28,360,800	
佐鳥電機	4,100	1,392.00	5,707,200	
カッパ・クリエイト	10,400	1,406.00	14,622,400	
伯東	3,800	3,685.00	14,003,000	
コンドーテック	5,100	991.00	5,054,100	
中山福	14,500	329.00	4,770,500	
ライトオン	6,600	635.00	4,191,000	
ナガイレーベン	8,300	2,048.00	16,998,400	
三菱食品	6,100	3,305.00	20,160,500	
良品計画	85,200	1,451.00	123,625,200	
松田産業	5,000	2,286.00	11,430,000	
第一興商	12,800	4,010.00	51,328,000	
メディパルホールディングス	68,500	1,792.00	122,752,000	
アドヴァングループ	6,300	895.00	5,638,500	

ＳＰＫ	3,400	1,403.00	4,770,200	
萩原電気ホールディングス	2,500	2,583.00	6,457,500	
アルビス	2,200	2,315.00	5,093,000	
アズワン	9,700	6,320.00	61,304,000	
スズデン	2,300	2,373.00	5,457,900	
シモジマ	4,700	990.00	4,653,000	
ドウシシャ	7,000	1,529.00	10,703,000	
小津産業	2,600	1,459.00	3,793,400	
コナカ	14,200	335.00	4,757,000	
高速	3,400	1,760.00	5,984,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,900	1,603.00	4,648,700	
Ｇ－７ホールディングス	8,200	1,541.00	12,636,200	
イオン北海道	9,800	1,208.00	11,838,400	
コジマ	12,700	615.00	7,810,500	
ヒマラヤ	4,900	929.00	4,552,100	
コーナン商事	8,900	3,305.00	29,414,500	
ネットワンシステムズ	23,300	3,575.00	83,297,500	
エコス	2,700	1,835.00	4,954,500	
ワタミ	8,000	1,053.00	8,424,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	148,200	2,417.00	358,199,400	
丸文	5,900	919.00	5,422,100	
西松屋チェーン	14,600	1,378.00	20,118,800	
ゼンショーホールディングス	36,200	3,565.00	129,053,000	
ハピネット	5,600	1,833.00	10,264,800	
橋本総業ホールディングス	4,900	994.00	4,870,600	
日本ライフライン	19,400	954.00	18,507,600	
サイゼリヤ	11,000	2,920.00	32,120,000	
ＶＴホールディングス	25,100	496.00	12,449,600	
アルゴグラフィックス	5,700	3,645.00	20,776,500	
魚力	2,300	2,155.00	4,956,500	
ＩＤＯＭ	20,000	735.00	14,700,000	
日本エム・ディ・エム	4,800	1,032.00	4,953,600	
フジ・コーポレーション	3,900	1,269.00	4,949,100	
ユナイテッドアローズ	7,100	1,905.00	13,525,500	
進和	4,400	2,015.00	8,866,000	
ダイトロン	2,600	2,424.00	6,302,400	
ハイデイ日高	9,800	1,959.00	19,198,200	
シークス	9,400	1,329.00	12,492,600	
コロワイド	30,400	1,841.00	55,966,400	
ピーシーデポコーポレーション	18,300	297.00	5,435,100	
田中商事	8,300	549.00	4,556,700	
オーハシテクニカ	3,400	1,436.00	4,882,400	
壱番屋	5,200	4,615.00	23,998,000	
白銅	2,400	2,494.00	5,985,600	
スギホールディングス	13,300	6,320.00	84,056,000	
薬王堂ホールディングス	3,700	2,566.00	9,494,200	
島津製作所	76,100	4,190.00	318,859,000	
ＪＭＳ	9,600	501.00	4,809,600	
長野計器	4,500	1,166.00	5,247,000	

ブイ・テクノロジー	3,100	2,859.00	8,862,900	
スター精密	11,900	1,690.00	20,111,000	
東京計器	4,800	1,164.00	5,587,200	
愛知時計電機	3,600	1,383.00	4,978,800	
インターアクション	3,800	1,538.00	5,844,400	
オーバル	6,800	538.00	3,658,400	
東京精密	13,700	4,420.00	60,554,000	
マニー	27,500	2,228.00	61,270,000	
ニコン	97,100	1,321.00	128,269,100	
トプコン	32,900	1,614.00	53,100,600	
オリンパス	390,400	2,733.00	1,066,963,200	
理研計器	3,900	5,070.00	19,773,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	10,700	8,970.00	95,979,000	
キヤノン電子	6,900	1,588.00	10,957,200	
タムロン	4,700	3,190.00	14,993,000	
ＨＯＹＡ	134,900	14,300.00	1,929,070,000	
シード	2,600	491.00	1,276,600	
ノーリツ鋼機	5,900	2,570.00	15,163,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	9,100	1,024.00	9,318,400	
朝日インテック	82,500	2,503.00	206,497,500	
キヤノン	342,600	3,180.00	1,089,468,000	
リコー	163,700	1,057.00	173,030,900	
シチズン時計	68,700	592.00	40,670,400	
リズム	1,200	1,742.00	2,090,400	
メニコン	21,400	2,830.00	60,562,000	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	25,700	129.00	3,315,300	
スノーピーク	10,700	2,167.00	23,186,900	
パラマウントベッドホールディングス	14,400	2,586.00	37,238,400	
トランザクション	4,800	1,181.00	5,668,800	
粧美堂	2,200	355.00	781,000	
ニホンフラッシュ	5,900	975.00	5,752,500	
前田工繊	6,800	3,400.00	23,120,000	
永大産業	18,700	224.00	4,188,800	
アートネイチャー	6,400	752.00	4,812,800	
バンダイナムコホールディングス	57,000	8,855.00	504,735,000	
アイフィスジャパン	7,000	618.00	4,326,000	
ＳＨＯＥＩ	6,600	5,800.00	38,280,000	
フランスベッドホールディングス	7,700	918.00	7,068,600	
マーベラス	10,200	684.00	6,976,800	
パイロットコーポレーション	9,800	4,945.00	48,461,000	
エイベックス	10,600	1,545.00	16,377,000	
フジシールインターナショナル	12,600	1,816.00	22,881,600	
タカラトミー	28,800	1,207.00	34,761,600	
広済堂ホールディングス	4,200	1,913.00	8,034,600	
レック	8,900	818.00	7,280,200	
プロネクサス	5,200	959.00	4,986,800	
大建工業	3,800	2,113.00	8,029,400	
きもと	5,500	234.00	1,287,000	
凸版印刷	81,700	2,109.00	172,305,300	
大日本印刷	74,100	2,802.00	207,628,200	

共同印刷	1,900	2,896.00	5,502,400	
ＮＩＳＳＨＡ	11,900	1,752.00	20,848,800	
藤森工業	4,900	3,220.00	15,778,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,300	2,105.00	9,051,500	
前澤化成工業	4,000	1,387.00	5,548,000	
未来工業	3,300	1,477.00	4,874,100	
アシックス	57,600	3,085.00	177,696,000	
ツツミ	2,500	1,968.00	4,920,000	
ＪＳＰ	4,400	1,482.00	6,520,800	
ニチハ	7,800	2,908.00	22,682,400	
ローランド	4,600	3,985.00	18,331,000	
エフピコ	11,800	3,795.00	44,781,000	
小松ウオール工業	2,700	1,860.00	5,022,000	
ヤマハ	39,400	5,340.00	210,396,000	
河合楽器製作所	1,800	2,568.00	4,622,400	
ピジョン	39,800	2,037.00	81,072,600	
天馬	5,300	2,143.00	11,357,900	
兼松サステック	3,000	1,561.00	4,683,000	
キングジム	5,500	907.00	4,988,500	
象印マホービン	18,600	1,591.00	29,592,600	
リンテック	12,500	2,270.00	28,375,000	
信越ポリマー	11,600	1,273.00	14,766,800	
東リ	23,200	202.00	4,686,400	
イトーキ	12,800	483.00	6,182,400	
任天堂	394,200	5,887.00	2,320,655,400	
三菱鉛筆	8,900	1,416.00	12,602,400	
松風	2,800	2,366.00	6,624,800	
タカラスタンダード	12,100	1,288.00	15,584,800	
コクヨ	30,100	1,813.00	54,571,300	
ナカバヤシ	9,300	496.00	4,612,800	
ニフコ	22,600	3,620.00	81,812,000	
グローブライド	5,000	2,545.00	12,725,000	
オカムラ	18,800	1,460.00	27,448,000	
バルカー	5,200	2,722.00	14,154,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,400	1,766.00	4,238,400	
伊藤忠商事	407,100	4,210.00	1,713,891,000	
丸紅	521,600	1,494.50	779,531,200	
スクロール	9,800	719.00	7,046,200	
ヨンドシーホールディングス	5,700	1,744.00	9,940,800	
長瀬産業	31,100	2,013.00	62,604,300	
蝶理	3,500	1,955.00	6,842,500	
豊田通商	57,900	5,120.00	296,448,000	
オンワードホールディングス	40,600	316.00	12,829,600	
三共生興	10,200	498.00	5,079,600	
兼松	25,700	1,520.00	39,064,000	
美津濃	6,200	2,840.00	17,608,000	
三井物産	483,400	3,843.00	1,857,706,200	
日本紙パルプ商事	3,500	5,020.00	17,570,000	
東京エレクトロン	44,100	44,750.00	1,973,475,000	
カメイ	7,000	1,169.00	8,183,000	

ＯＵＧホールディングス	1,700	2,425.00	4,122,500	
スターゼン	5,000	2,044.00	10,220,000	
セイコーグループ	9,700	3,025.00	29,342,500	
山善	17,800	1,040.00	18,512,000	
椿本興業	1,300	3,800.00	4,940,000	
住友商事	409,200	2,197.00	899,012,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	23,000	3,185.00	73,255,000	
内田洋行	2,900	4,625.00	13,412,500	
三菱商事	413,100	4,445.00	1,836,229,500	
第一実業	2,300	4,265.00	9,809,500	
キヤノンマーケティングジャパン	15,300	3,180.00	48,654,000	
西華産業	2,900	1,545.00	4,480,500	
佐藤商事	4,600	1,179.00	5,423,400	
菱洋エレクトロ	5,600	2,361.00	13,221,600	
東京産業	6,200	787.00	4,879,400	
ユアサ商事	5,900	3,630.00	21,417,000	
神鋼商事	1,700	4,340.00	7,378,000	
阪和興業	11,900	3,650.00	43,435,000	
正栄食品工業	4,400	4,345.00	19,118,000	
カナデン	5,300	1,105.00	5,856,500	
菱電商事	5,300	1,712.00	9,073,600	
ニプロ	52,100	1,027.00	53,506,700	
岩谷産業	15,000	5,650.00	84,750,000	
ナイス	2,900	1,354.00	3,926,600	
極東貿易	3,900	1,334.00	5,202,600	
アステナホールディングス	11,700	424.00	4,960,800	
兼松エレクトロニクス	4,000	4,520.00	18,080,000	
三愛オブリ	18,200	1,227.00	22,331,400	
稲畑産業	13,500	2,389.00	32,251,500	
ＧＳＩクレオス	3,800	1,465.00	5,567,000	
明和産業	8,800	715.00	6,292,000	
クワザワホールディングス	10,600	420.00	4,452,000	
ゴールドウイン	11,100	9,500.00	105,450,000	
ユニ・チャーム	130,500	5,088.00	663,984,000	
デサント	10,800	3,430.00	37,044,000	
ワキタ	12,100	1,198.00	14,495,800	
ヤマトインターナショナル	17,500	249.00	4,357,500	
東邦ホールディングス	16,400	2,068.00	33,915,200	
サンゲツ	16,600	2,022.00	33,565,200	
ミツウロコグループホールディングス	8,500	1,040.00	8,840,000	
シナネンホールディングス	2,100	3,840.00	8,064,000	
伊藤忠エネクス	16,400	1,028.00	16,859,200	
サンリオ	18,700	4,345.00	81,251,500	
サンワ　テクノス	3,400	1,498.00	5,093,200	
リョーサン	7,000	2,909.00	20,363,000	
新光商事	8,900	1,132.00	10,074,800	
トーホー	2,900	1,697.00	4,921,300	
三信電気	2,700	2,208.00	5,961,600	
東陽テクニカ	7,300	1,357.00	9,906,100	
モスフードサービス	9,700	3,145.00	30,506,500	

加賀電子	5,400	4,280.00	23,112,000	
三益半導体工業	5,800	2,608.00	15,126,400	
都築電気	3,600	1,323.00	4,762,800	
立花エレテック	4,800	1,763.00	8,462,400	
木曽路	10,000	2,155.00	21,550,000	
ＳＲＳホールディングス	10,900	853.00	9,297,700	
千趣会	12,200	402.00	4,904,400	
リテールパートナーズ	9,800	1,252.00	12,269,600	
ケーヨー	10,600	910.00	9,646,000	
上新電機	5,900	1,925.00	11,357,500	
日本瓦斯	35,400	2,151.00	76,145,400	
ロイヤルホールディングス	12,700	2,400.00	30,480,000	
東天紅	5,400	805.00	4,347,000	
いなげや	6,400	1,214.00	7,769,600	
チヨダ	6,600	773.00	5,101,800	
ライフコーポレーション	5,800	2,460.00	14,268,000	
リンガーハット	8,500	2,235.00	18,997,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	9,300	670.00	6,231,000	
ＡＯＫＩホールディングス	12,300	670.00	8,241,000	
オークワ	10,600	922.00	9,773,200	
コメリ	10,200	2,637.00	26,897,400	
青山商事	14,100	977.00	13,775,700	
しまむら	7,800	12,330.00	96,174,000	
高島屋	49,800	1,702.00	84,759,600	
松屋	11,200	971.00	10,875,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	32,200	1,196.00	38,511,200	
近鉄百貨店	2,100	2,438.00	5,119,800	
丸井グループ	48,700	2,311.00	112,545,700	
クレディセゾン	39,000	1,712.00	66,768,000	
アクシアル　リテイリング	4,500	3,455.00	15,547,500	
イオン	224,000	2,787.50	624,400,000	
イズミ	10,000	3,110.00	31,100,000	
平和堂	11,000	1,988.00	21,868,000	
フジ	10,100	1,901.00	19,200,100	
ヤオコー	7,500	6,800.00	51,000,000	
ゼビオホールディングス	9,000	967.00	8,703,000	
ケーズホールディングス	52,500	1,120.00	58,800,000	
ＰＡＬＴＡＣ	10,400	4,400.00	45,760,000	
三谷産業	16,100	310.00	4,991,000	
日産東京販売ホールディングス	4,800	281.00	1,348,800	
新生銀行	18,100	2,183.00	39,512,300	
あおぞら銀行	38,700	2,573.00	99,575,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,032,100	719.70	2,901,902,370	
りそなホールディングス	784,900	629.40	494,016,060	
三井住友トラスト・ホールディングス	113,900	4,251.00	484,188,900	
三井住友フィナンシャルグループ	449,400	4,579.00	2,057,802,600	
千葉銀行	171,400	810.00	138,834,000	
群馬銀行	119,300	423.00	50,463,900	
武蔵野銀行	7,900	1,772.00	13,998,800	
千葉興業銀行	11,400	347.00	3,955,800	

筑波銀行	27,000	187.00	5,049,000	
七十七銀行	19,700	1,805.00	35,558,500	
秋田銀行	4,100	1,556.00	6,379,600	
山形銀行	6,800	1,086.00	7,384,800	
岩手銀行	4,200	1,841.00	7,732,200	
東邦銀行	48,600	203.00	9,865,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	49,100	2,530.00	124,223,000	
スルガ銀行	54,200	416.00	22,547,200	
八十二銀行	126,200	498.00	62,847,600	
山梨中央銀行	6,300	987.00	6,218,100	
大垣共立銀行	11,700	1,748.00	20,451,600	
福井銀行	5,500	1,387.00	7,628,500	
清水銀行	3,400	1,498.00	5,093,200	
富山銀行	1,100	1,640.00	1,804,000	
滋賀銀行	10,200	2,518.00	25,683,600	
南都銀行	9,300	2,149.00	19,985,700	
百五銀行	57,900	329.00	19,049,100	
京都銀行	19,500	5,600.00	109,200,000	
紀陽銀行	22,000	1,427.00	31,394,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	39,100	878.00	34,329,800	
山陰合同銀行	38,500	696.00	26,796,000	
百十四銀行	5,600	1,694.00	9,486,400	
四国銀行	9,800	857.00	8,398,600	
阿波銀行	9,100	1,926.00	17,526,600	
大分銀行	3,700	1,856.00	6,867,200	
宮崎銀行	4,000	2,212.00	8,848,000	
佐賀銀行	3,600	1,517.00	5,461,200	
琉球銀行	14,100	778.00	10,969,800	
セブン銀行	220,300	258.00	56,837,400	
みずほフィナンシャルグループ	889,400	1,630.00	1,449,722,000	
山口フィナンシャルグループ	67,900	776.00	52,690,400	
芙蓉総合リース	5,700	8,550.00	48,735,000	
みずほリース	9,200	3,245.00	29,854,000	
東京センチュリー	11,500	4,830.00	55,545,000	
ＳＢＩホールディングス	89,000	2,619.00	233,091,000	
日本証券金融	24,700	994.00	24,551,800	
アイフル	101,900	396.00	40,352,400	
長野銀行	3,700	1,188.00	4,395,600	
名古屋銀行	4,100	3,010.00	12,341,000	
北洋銀行	93,200	229.00	21,342,800	
大光銀行	3,600	1,154.00	4,154,400	
愛媛銀行	8,300	822.00	6,822,600	
京葉銀行	28,600	509.00	14,557,400	
栃木銀行	28,200	292.00	8,234,400	
北日本銀行	2,600	1,872.00	4,867,200	
東和銀行	11,300	525.00	5,932,500	
リコーリース	5,800	3,605.00	20,909,000	
イオンフィナンシャルサービス	35,300	1,445.00	51,008,500	
アコム	109,800	316.00	34,696,800	
ジャックス	6,600	3,740.00	24,684,000	

オリエントコーポレーション	16,100	1,190.00	19,159,000	
オリックス	411,400	2,162.00	889,446,800	
三菱ＨＣキャピタル	239,800	636.00	152,512,800	
ジャフコ　グループ	20,500	2,288.00	46,904,000	
九州リースサービス	3,400	653.00	2,220,200	
トモニホールディングス	49,700	325.00	16,152,500	
大和証券グループ本社	439,800	598.00	263,000,400	
野村ホールディングス	1,132,600	490.00	554,974,000	
岡三証券グループ	54,000	373.00	20,142,000	
丸三証券	20,500	410.00	8,405,000	
東洋証券	20,400	270.00	5,508,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	66,900	350.00	23,415,000	
光世証券	5,100	368.00	1,876,800	
水戸証券	22,100	222.00	4,906,200	
いちよし証券	11,300	613.00	6,926,900	
松井証券	36,300	777.00	28,205,100	
ＳＯＭＰＯホールディングス	105,600	5,631.00	594,633,600	
日本取引所グループ	172,800	1,957.00	338,169,600	
マネックスグループ	68,700	447.00	30,708,900	
極東証券	7,900	613.00	4,842,700	
岩井コスモホールディングス	7,000	1,257.00	8,799,000	
アイザワ証券グループ	8,900	658.00	5,856,200	
フィデアホールディングス	6,400	1,302.00	8,332,800	
池田泉州ホールディングス	78,700	216.00	16,999,200	
アニコム　ホールディングス	20,900	684.00	14,295,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	138,700	3,963.00	549,668,100	
スパークス・グループ	6,900	1,645.00	11,350,500	
第一生命ホールディングス	313,100	2,369.00	741,733,900	
東京海上ホールディングス	619,300	2,791.00	1,728,466,300	
イー・ギャランティ	9,900	2,459.00	24,344,100	
アサックス	8,000	598.00	4,784,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,000	2,070.00	6,210,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	165,100	1,520.00	250,952,000	
アドバンスクリエイト	2,900	1,073.00	3,111,700	
三井不動産	267,300	2,671.00	713,958,300	
三菱地所	389,900	1,908.00	743,929,200	
平和不動産	10,000	4,030.00	40,300,000	
東京建物	58,600	1,924.00	112,746,400	
京阪神ビルディング	7,900	1,317.00	10,404,300	
住友不動産	111,200	3,659.00	406,880,800	
テーオーシー	11,100	709.00	7,869,900	
東京楽天地	1,100	4,240.00	4,664,000	
レオパレス２１	69,200	303.00	20,967,600	
スターツコーポレーション	8,800	2,881.00	25,352,800	
フジ住宅	8,600	619.00	5,323,400	
空港施設	9,100	539.00	4,904,900	
ゴールドクレスト	5,800	1,780.00	10,324,000	
リログループ	35,700	2,277.00	81,288,900	

エスリード	2,900	1,860.00	5,394,000	
日神グループホールディングス	11,300	425.00	4,802,500	
日本エスコン	13,800	836.00	11,536,800	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	31,100	390.00	12,129,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,800	794.00	4,605,200	
イオンモール	31,900	1,693.00	54,006,700	
ファースト住建	4,300	1,017.00	4,373,100	
カチタス	16,500	3,280.00	54,120,000	
東祥	4,500	1,195.00	5,377,500	
トーセイ	10,200	1,481.00	15,106,200	
穴吹興産	2,300	1,988.00	4,572,400	
サンフロンティア不動産	10,200	1,138.00	11,607,600	
ＦＪネクストホールディングス	6,500	959.00	6,233,500	
グランディハウス	8,700	543.00	4,724,100	
東武鉄道	68,600	3,215.00	220,549,000	
相鉄ホールディングス	20,600	2,147.00	44,228,200	
東急	175,100	1,654.00	289,615,400	
京浜急行電鉄	70,800	1,407.00	99,615,600	
小田急電鉄	94,700	1,750.00	165,725,000	
京王電鉄	33,000	4,935.00	162,855,000	
京成電鉄	40,300	3,685.00	148,505,500	
富士急行	7,700	4,860.00	37,422,000	
東日本旅客鉄道	105,900	7,750.00	820,725,000	
西日本旅客鉄道	79,800	5,652.00	451,029,600	
東海旅客鉄道	48,100	16,365.00	787,156,500	
西武ホールディングス	75,500	1,313.00	99,131,500	
鴻池運輸	10,600	1,536.00	16,281,600	
西日本鉄道	16,700	2,740.00	45,758,000	
ハマキョウレックス	4,900	3,460.00	16,954,000	
サカイ引越センター	3,000	4,585.00	13,755,000	
近鉄グループホールディングス	62,300	4,670.00	290,941,000	
阪急阪神ホールディングス	83,100	4,160.00	345,696,000	
南海電気鉄道	29,800	2,902.00	86,479,600	
京阪ホールディングス	25,800	3,445.00	88,881,000	
神戸電鉄	1,700	3,235.00	5,499,500	
名古屋鉄道	68,900	2,191.00	150,959,900	
山陽電気鉄道	4,700	2,223.00	10,448,100	
アルプス物流	5,000	1,137.00	5,685,000	
トランコム	1,800	7,780.00	14,004,000	
ヤマトホールディングス	79,800	2,288.00	182,582,400	
山九	15,900	4,885.00	77,671,500	
日新	4,700	2,026.00	9,522,200	
丸全昭和運輸	3,900	3,200.00	12,480,000	
センコーグループホールディングス	33,000	1,004.00	33,132,000	
トナミホールディングス	1,400	3,735.00	5,229,000	
ニッコンホールディングス	20,000	2,427.00	48,540,000	
日本石油輸送	1,300	2,222.00	2,888,600	
福山通運	5,200	3,400.00	17,680,000	
セイノーホールディングス	38,800	1,184.00	45,939,200	
神奈川中央交通	1,800	3,350.00	6,030,000	

日立物流	13,700	8,900.00	121,930,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	15,000	1,481.00	22,215,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,000	1,222.00	7,332,000	
日本郵船	166,800	2,743.00	457,532,400	
商船三井	109,900	3,080.00	338,492,000	
川崎汽船	53,100	2,522.00	133,918,200	
ＮＳユナイテッド海運	3,400	3,580.00	12,172,000	
明治海運	6,200	692.00	4,290,400	
飯野海運	22,900	863.00	19,762,700	
共栄タンカー	600	915.00	549,000	
九州旅客鉄道	44,100	2,889.00	127,404,900	
ＳＧホールディングス	119,600	2,044.00	244,462,400	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	23,300	7,850.00	182,905,000	
日本航空	153,100	2,637.00	403,724,700	
ＡＮＡホールディングス	169,600	2,863.00	485,564,800	
パスコ	1,200	1,288.00	1,545,600	
ＴＲＥホールディングス	13,500	1,537.00	20,749,500	
人・夢・技術グループ	2,900	2,064.00	5,985,600	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,700	3,695.00	6,281,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,300	3,625.00	11,962,500	
ＫＰＰグループホールディングス	15,400	1,017.00	15,661,800	
ナルミヤ・インターナショナル	5,600	839.00	4,698,400	
ブックオフグループホールディングス	3,900	1,322.00	5,155,800	
ギフトホールディングス	1,400	3,750.00	5,250,000	
三菱倉庫	13,400	3,220.00	43,148,000	
三井倉庫ホールディングス	5,800	3,555.00	20,619,000	
住友倉庫	17,100	2,006.00	34,302,600	
澁澤倉庫	2,500	2,055.00	5,137,500	
ヤマタネ	2,900	1,667.00	4,834,300	
東陽倉庫	16,500	249.00	4,108,500	
乾汽船	8,000	1,745.00	13,960,000	
日本トランスシティ	12,500	499.00	6,237,500	
中央倉庫	5,200	928.00	4,825,600	
安田倉庫	5,200	926.00	4,815,200	
東洋埠頭	3,800	1,262.00	4,795,600	
上組	31,000	2,762.00	85,622,000	
キユーソー流通システム	4,200	1,055.00	4,431,000	
東海運	13,300	280.00	3,724,000	
エーアイテイー	3,900	1,434.00	5,592,600	
日本コンセプト	2,700	1,775.00	4,792,500	
ＴＢＳホールディングス	32,100	1,523.00	48,888,300	
日本テレビホールディングス	55,400	1,059.00	58,668,600	
朝日放送グループホールディングス	7,800	621.00	4,843,800	
テレビ朝日ホールディングス	15,200	1,345.00	20,444,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	55,600	496.00	27,577,600	
テレビ東京ホールディングス	4,500	1,829.00	8,230,500	
日本ＢＳ放送	4,800	920.00	4,416,000	
ビジョン	8,200	1,408.00	11,545,600	

ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,600	2,306.00	12,913,600	
コネクシオ	4,400	1,169.00	5,143,600	
日本通信	57,800	226.00	13,062,800	
日本電信電話	802,500	3,843.00	3,084,007,500	
ＫＤＤＩ	484,000	4,098.00	1,983,432,000	
ソフトバンク	1,006,100	1,477.00	1,486,009,700	
光通信	7,400	20,010.00	148,074,000	
エムティーアイ	9,400	509.00	4,784,600	
GMOインターネットグループ	23,300	2,571.00	59,904,300	
アイドママーケティングコミュニケーション	16,400	283.00	4,641,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	33,100	2,538.00	84,007,800	
学研ホールディングス	10,400	972.00	10,108,800	
ゼンリン	10,700	875.00	9,362,500	
インプレスホールディングス	22,700	212.00	4,812,400	
東京電力ホールディングス	562,900	464.00	261,185,600	
中部電力	230,100	1,263.00	290,616,300	
関西電力	241,100	1,157.00	278,952,700	
中国電力	99,400	719.00	71,468,600	
北陸電力	58,900	517.00	30,451,300	
東北電力	152,700	629.00	96,048,300	
四国電力	53,300	721.00	38,429,300	
九州電力	143,900	728.00	104,759,200	
北海道電力	60,300	446.00	26,893,800	
沖縄電力	14,600	1,022.00	14,921,200	
電源開発	47,000	2,073.00	97,431,000	
エフオン	7,600	586.00	4,453,600	
イーレックス	11,100	2,437.00	27,050,700	
レノバ	16,600	2,733.00	45,367,800	
東京瓦斯	132,000	2,491.00	328,812,000	
大阪瓦斯	126,500	2,084.00	263,626,000	
東邦瓦斯	24,600	2,669.00	65,657,400	
北海道瓦斯	3,700	1,660.00	6,142,000	
広島ガス	7,900	340.00	2,686,000	
西部ガスホールディングス	5,900	1,650.00	9,735,000	
静岡ガス	14,200	987.00	14,015,400	
メタウォーター	7,800	1,849.00	14,422,200	
アイネット	3,800	1,314.00	4,993,200	
松竹	3,600	11,900.00	42,840,000	
東宝	39,200	5,300.00	207,760,000	
エイチ・アイ・エス	16,800	1,966.00	33,028,800	
東映	1,700	17,930.00	30,481,000	
ラックランド	2,000	2,955.00	5,910,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	196,500	2,092.00	411,078,000	
共立メンテナンス	11,000	5,620.00	61,820,000	
イチネンホールディングス	6,800	1,234.00	8,391,200	
建設技術研究所	3,300	3,135.00	10,345,500	
スペース	5,600	895.00	5,012,000	
アインホールディングス	9,100	7,050.00	64,155,000	

燦ホールディングス	2,800	1,753.00	4,908,400	
ピー・シー・エー	4,300	1,265.00	5,439,500	
東京テアトル	4,000	1,128.00	4,512,000	
タナベコンサルティンググループ	7,000	650.00	4,550,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,700	1,965.00	5,305,500	
ナガワ	1,700	7,420.00	12,614,000	
東京都競馬	5,400	3,910.00	21,114,000	
カナモト	11,800	2,237.00	26,396,600	
ＤＴＳ	13,800	3,435.00	47,403,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	6,370.00	200,655,000	
シーイーシー	8,800	1,492.00	13,129,600	
カプコン	62,200	4,400.00	273,680,000	
西尾レントオール	6,000	3,010.00	18,060,000	
アイ・エス・ビー	3,600	1,326.00	4,773,600	
日本空港ビルデング	21,800	6,180.00	134,724,000	
トランス・コスモス	8,000	3,330.00	26,640,000	
乃村工藝社	28,000	1,028.00	28,784,000	
ジャステック	3,800	1,267.00	4,814,600	
ＳＣＳＫ	51,100	2,156.00	110,171,600	
藤田観光	2,900	2,889.00	8,378,100	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,800	1,615.00	6,137,000	
日本管財	6,700	2,551.00	17,091,700	
トーカイ	5,700	1,876.00	10,693,200	
セコム	65,400	8,259.00	540,138,600	
ＮＳＷ	2,400	2,193.00	5,263,200	
セントラル警備保障	3,500	2,407.00	8,424,500	
アイネス	4,400	1,442.00	6,344,800	
丹青社	12,400	791.00	9,808,400	
メイテック	25,600	2,505.00	64,128,000	
ＴＫＣ	11,200	3,700.00	41,440,000	
富士ソフト	7,100	8,250.00	58,575,000	
応用地質	6,200	2,083.00	12,914,600	
船井総研ホールディングス	13,500	2,773.00	37,435,500	
ＮＳＤ	22,300	2,545.00	56,753,500	
進学会ホールディングス	14,600	306.00	4,467,600	
丸紅建材リース	2,500	1,747.00	4,367,500	
コナミグループ	26,800	6,770.00	181,436,000	
学究社	2,900	1,780.00	5,162,000	
ベネッセホールディングス	24,000	1,990.00	47,760,000	
イオンディライト	7,100	2,965.00	21,051,500	
ナック	5,200	930.00	4,836,000	
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,982.00	13,120,800	
ダイセキ	13,100	4,690.00	61,439,000	
ステップ	2,600	1,831.00	4,760,600	
日鉄物産	4,500	5,150.00	23,175,000	
泉州電業	3,300	2,665.00	8,794,500	
元気寿司	2,100	3,150.00	6,615,000	
トラスコ中山	13,900	2,058.00	28,606,200	
ヤマダホールディングス	270,900	468.00	126,781,200	

オートバックスセブン	23,000	1,435.00	33,005,000	
モリト	6,400	766.00	4,902,400	
アークランズ	9,700	1,492.00	14,472,400	
ニトリホールディングス	26,700	15,545.00	415,051,500	
グルメ杵屋	5,400	1,016.00	5,486,400	
愛眼	27,500	175.00	4,812,500	
吉野家ホールディングス	25,900	2,359.00	61,098,100	
加藤産業	8,000	3,520.00	28,160,000	
イノテック	4,200	1,306.00	5,485,200	
イエローハット	11,700	1,714.00	20,053,800	
松屋フーズホールディングス	3,100	4,050.00	12,555,000	
ＪＢＣＣホールディングス	4,600	1,864.00	8,574,400	
ＪＫホールディングス	5,200	1,018.00	5,293,600	
サガミホールディングス	10,600	1,231.00	13,048,600	
日伝	3,900	1,712.00	6,676,800	
関西フードマーケット	6,000	1,376.00	8,256,000	
ミロク情報サービス	5,700	1,435.00	8,179,500	
北沢産業	23,800	196.00	4,664,800	
杉本商事	2,900	2,062.00	5,979,800	
因幡電機産業	17,100	2,717.00	46,460,700	
王将フードサービス	4,400	6,070.00	26,708,000	
プレナス	7,300	2,638.00	19,257,400	
ミニストップ	4,800	1,436.00	6,892,800	
アークス	12,100	2,104.00	25,458,400	
バローホールディングス	12,600	1,808.00	22,780,800	
東テク	2,200	3,355.00	7,381,000	
ミスミグループ本社	99,700	3,480.00	346,956,000	
ベルク	3,300	5,680.00	18,744,000	
大　庄	4,100	1,053.00	4,317,300	
ファーストリテイリング	9,900	82,160.00	813,384,000	
ソフトバンクグループ	362,100	6,077.00	2,200,481,700	
蔵王産業	2,600	1,746.00	4,539,600	
スズケン	24,100	3,695.00	89,049,500	
サンドラッグ	25,100	3,720.00	93,372,000	
サックスバー　ホールディングス	6,500	734.00	4,771,000	
ジェコス	5,900	797.00	4,702,300	
ヤマザワ	3,400	1,210.00	4,114,000	
やまや	1,900	2,490.00	4,731,000	
ベルーナ	15,900	703.00	11,177,700	
合計	73,257,200		178,028,052,710	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,398,511
コール・ローン	496,611,273
国債証券	52,618,675,550
地方債証券	4,333,529,644
特殊債券	5,773,708,231
社債券	5,537,825,000
未収利息	157,844,667
前払費用	3,520,782
流動資産合計	68,923,113,658
資産合計	68,923,113,658
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,152,178
その他未払費用	423
流動負債合計	7,152,601
負債合計	7,152,601
純資産の部	
元本等	
元本	72,708,390,073
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△3,792,429,016
元本等合計	68,915,961,057
純資産合計	68,915,961,057
負債純資産合計	68,923,113,658

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	79,850,448,372円
同期中追加設定元本額	9,861,892,221円
同期中一部解約元本額	17,003,950,520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）	54,298,319,506円
ＤＣニッセイ日本債券インデックス	4,112,198,577円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	159,373,606円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	6,811,731,377円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	302,657,411円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	1,551,148,326円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	2,381,628,621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）	278,338,957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）	30,542,852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）	93,226,202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）	67,716,133円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	82,050,748円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	100,507,526円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	370,873,708円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	2,043,192,356円
ＦＷニッセイ国内債インデックス	21,154,230円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	3,729,937円
計	72,708,390,073円
２．　受益権の総数	72,708,390,073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3,792,429,016円であります。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,812,242,230
地方債証券	△73,976,566
特殊債券	△76,550,979
社債券	△30,847,800
合計	△1,993,617,575

（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（2022年3月11日から2022年11月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9478円 (9,478円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第４３１回　利付国債（２年）	130,000,000	130,132,600	
	第４３２回　利付国債（２年）	138,000,000	138,136,620	
	第４３３回　利付国債（２年）	140,000,000	140,133,000	
	第４３４回　利付国債（２年）	140,000,000	140,133,000	
	第４３５回　利付国債（２年）	319,000,000	319,303,050	
	第４３６回　利付国債（２年）	156,000,000	156,156,000	
	第４３７回　利付国債（２年）	350,000,000	350,290,500	
	第４３８回　利付国債（２年）	350,000,000	350,252,000	
	第４３９回　利付国債（２年）	200,000,000	200,134,000	
	第４４０回　利付国債（２年）	175,000,000	175,108,500	
	第４４１回　利付国債（２年）	400,000,000	400,332,000	
	第１３８回　利付国債（５年）	59,000,000	59,120,360	
	第１３９回　利付国債（５年）	67,000,000	67,146,060	
	第１４０回　利付国債（５年）	371,000,000	371,845,880	
	第１４１回　利付国債（５年）	377,000,000	377,893,490	
	第１４２回　利付国債（５年）	405,000,000	405,963,900	
	第１４３回　利付国債（５年）	243,000,000	243,619,650	

第１４４回　利付国債（５年）	445,000,000	446,259,350	
第１４５回　利付国債（５年）	290,000,000	290,901,900	
第１４６回　利付国債（５年）	80,000,000	80,270,400	
第１４９回　利付国債（５年）	456,000,000	455,822,160	
第１５０回　利付国債（５年）	200,000,000	199,754,000	
第１５３回　利付国債（５年）	408,000,000	406,882,080	
第１回　利付国債（４０年）	95,000,000	117,596,700	
第２回　利付国債（４０年）	115,000,000	137,044,350	
第３回　利付国債（４０年）	107,000,000	128,224,520	
第４回　利付国債（４０年）	157,000,000	186,249,100	
第５回　利付国債（４０年）	159,000,000	181,089,870	
第６回　利付国債（４０年）	167,000,000	184,970,870	
第７回　利付国債（４０年）	183,000,000	193,687,200	
第８回　利付国債（４０年）	184,000,000	180,583,120	
第９回　利付国債（４０年）	232,000,000	166,425,200	
第１０回　利付国債（４０年）	211,000,000	178,077,670	
第１１回　利付国債（４０年）	174,000,000	141,467,220	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	76,745,060	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	122,160,300	
第１４回　利付国債（４０年）	236,000,000	181,233,840	
第１５回　利付国債（４０年）	106,000,000	89,141,760	
第３３２回　利付国債（１０年）	83,000,000	83,616,690	
第３３３回　利付国債（１０年）	89,000,000	89,783,200	
第３３４回　利付国債（１０年）	522,000,000	527,303,520	
第３３５回　利付国債（１０年）	152,000,000	153,472,880	
第３３６回　利付国債（１０年）	205,000,000	207,191,450	
第３３７回　利付国債（１０年）	348,000,000	350,275,920	
第３３８回　利付国債（１０年）	239,000,000	241,275,280	
第３３９回　利付国債（１０年）	347,000,000	350,664,320	
第３４０回　利付国債（１０年）	470,000,000	475,447,300	
第３４１回　利付国債（１０年）	493,000,000	497,703,220	
第３４２回　利付国債（１０年）	423,000,000	424,476,270	
第３４３回　利付国債（１０年）	341,000,000	342,217,370	
第３４４回　利付国債（１０年）	334,000,000	335,085,500	
第３４５回　利付国債（１０年）	472,000,000	473,246,080	
第３４６回　利付国債（１０年）	328,000,000	328,777,360	

第３４７回　利付国債（１０年）	272,000,000	272,432,480	
第３４８回　利付国債（１０年）	338,000,000	338,324,480	
第３４９回　利付国債（１０年）	494,000,000	494,247,000	
第３５０回　利付国債（１０年）	637,000,000	637,165,620	
第３５１回　利付国債（１０年）	564,000,000	564,000,000	
第３５２回　利付国債（１０年）	370,000,000	369,892,700	
第３５３回　利付国債（１０年）	353,000,000	352,784,670	
第３５４回　利付国債（１０年）	333,000,000	332,683,650	
第３５５回　利付国債（１０年）	339,000,000	338,444,040	
第３５６回　利付国債（１０年）	380,000,000	379,099,400	
第３５７回　利付国債（１０年）	384,000,000	382,652,160	
第３５８回　利付国債（１０年）	384,000,000	382,053,120	
第３５９回　利付国債（１０年）	337,000,000	334,731,990	
第３６０回　利付国債（１０年）	297,000,000	294,710,130	
第３６１回　利付国債（１０年）	467,000,000	462,918,420	
第３６２回　利付国債（１０年）	466,000,000	461,614,940	
第３６３回　利付国債（１０年）	480,000,000	475,152,000	
第３６４回　利付国債（１０年）	549,000,000	543,059,820	
第３６５回　利付国債（１０年）	474,000,000	469,146,240	
第３６６回　利付国債（１０年）	244,000,000	244,222,040	
第３６７回　利付国債（１０年）	189,000,000	188,467,020	
第３６８回　利付国債（１０年）	226,000,000	225,129,900	
第１回　利付国債（３０年）	6,000,000	7,086,480	
第２回　利付国債（３０年）	66,000,000	76,645,140	
第３回　利付国債（３０年）	81,000,000	93,759,930	
第４回　利付国債（３０年）	40,000,000	48,536,000	
第５回　利付国債（３０年）	52,000,000	60,682,440	
第６回　利付国債（３０年）	39,000,000	46,560,150	
第７回　利付国債（３０年）	31,000,000	36,908,290	

第８回　利付国債（３０年）	63,000,000	72,209,340	
第９回　利付国債（３０年）	62,000,000	68,603,000	
第１０回　利付国債（３０年）	21,000,000	22,602,930	
第１１回　利付国債（３０年）	25,000,000	28,441,750	
第１２回　利付国債（３０年）	73,000,000	86,146,570	
第１３回　利付国債（３０年）	14,000,000	16,384,480	
第１４回　利付国債（３０年）	35,000,000	42,536,550	
第１５回　利付国債（３０年）	74,000,000	90,889,760	
第１６回　利付国債（３０年）	53,000,000	65,164,030	
第１７回　利付国債（３０年）	54,000,000	65,872,440	
第１８回　利付国債（３０年）	63,000,000	76,207,320	
第１９回　利付国債（３０年）	52,000,000	62,962,120	
第２０回　利付国債（３０年）	59,000,000	72,959,990	
第２１回　利付国債（３０年）	60,000,000	72,764,400	
第２２回　利付国債（３０年）	72,000,000	89,262,000	
第２３回　利付国債（３０年）	73,000,000	90,638,260	
第２４回　利付国債（３０年）	42,000,000	52,221,960	
第２５回　利付国債（３０年）	51,000,000	62,052,210	
第２６回　利付国債（３０年）	108,000,000	132,939,360	
第２７回　利付国債（３０年）	132,000,000	164,469,360	
第２８回　利付国債（３０年）	177,000,000	220,480,050	
第２９回　利付国債（３０年）	209,000,000	257,241,380	
第３０回　利付国債（３０年）	226,000,000	274,745,940	
第３１回　利付国債（３０年）	193,000,000	231,526,660	
第３２回　利付国債（３０年）	242,000,000	294,095,340	
第３３回　利付国債（３０年）	273,000,000	318,399,900	
第３４回　利付国債（３０年）	252,000,000	302,102,640	
第３５回　利付国債（３０年）	281,000,000	327,598,230	
第３６回　利付国債（３０年）	271,000,000	316,164,860	
第３７回　利付国債（３０年）	289,000,000	331,760,440	
第３８回　利付国債（３０年）	191,000,000	215,715,400	
第３９回　利付国債（３０年）	175,000,000	200,676,000	
第４０回　利付国債（３０年）	145,000,000	163,584,650	
第４１回　利付国債（３０年）	150,000,000	166,251,000	
第４２回　利付国債（３０年）	163,000,000	180,514,350	
第４３回　利付国債（３０年）	156,000,000	172,621,800	
第４４回　利付国債（３０年）	165,000,000	182,424,000	
第４５回　利付国債（３０年）	180,000,000	191,766,600	
第４６回　利付国債（３０年）	216,000,000	229,836,960	
第４７回　利付国債（３０年）	201,000,000	217,600,590	
第４８回　利付国債（３０年）	223,000,000	232,238,890	
第４９回　利付国債（３０年）	220,000,000	228,778,000	
第５０回　利付国債（３０年）	222,000,000	203,591,760	
第５１回　利付国債（３０年）	155,000,000	125,894,100	
第５２回　利付国債（３０年）	202,000,000	171,663,640	
第５３回　利付国債（３０年）	185,000,000	160,370,950	
第５４回　利付国債（３０年）	223,000,000	202,020,160	
第５５回　利付国債（３０年）	181,000,000	163,533,500	
第５６回　利付国債（３０年）	188,000,000	169,243,240	
第５７回　利付国債（３０年）	188,000,000	168,628,480	

第５８回　利付国債（３０年）	233,000,000	208,225,110	
第５９回　利付国債（３０年）	178,000,000	154,680,220	
第６０回　利付国債（３０年）	184,000,000	167,340,640	
第６１回　利付国債（３０年）	162,000,000	139,669,920	
第６２回　利付国債（３０年）	160,000,000	130,419,200	
第６３回　利付国債（３０年）	132,000,000	104,113,680	
第６４回　利付国債（３０年）	134,000,000	105,298,540	
第６５回　利付国債（３０年）	122,000,000	96,065,240	
第６６回　利付国債（３０年）	125,000,000	98,446,250	
第６７回　利付国債（３０年）	192,000,000	157,829,760	
第６８回　利付国債（３０年）	159,000,000	130,138,320	
第６９回　利付国債（３０年）	198,000,000	166,213,080	
第７０回　利付国債（３０年）	190,000,000	158,993,900	
第７１回　利付国債（３０年）	155,000,000	129,291,700	
第７２回　利付国債（３０年）	153,000,000	127,340,370	
第７３回　利付国債（３０年）	81,000,000	67,334,490	
第７４回　利付国債（３０年）	191,000,000	171,900,000	
第７５回　利付国債（３０年）	148,000,000	143,702,080	
第７６回　利付国債（３０年）	67,000,000	66,371,540	
第６８回　利付国債（２０年）	27,000,000	27,809,730	
第６９回　利付国債（２０年）	74,000,000	76,121,580	
第７０回　利付国債（２０年）	249,000,000	258,596,460	
第７１回　利付国債（２０年）	151,000,000	156,343,890	
第７２回　利付国債（２０年）	136,000,000	141,295,840	
第７３回　利付国債（２０年）	105,000,000	109,394,250	
第７４回　利付国債（２０年）	64,000,000	66,811,520	
第７５回　利付国債（２０年）	50,000,000	52,451,500	
第７６回　利付国債（２０年）	68,000,000	71,017,840	
第７７回　利付国債（２０年）	52,000,000	54,428,400	
第７８回　利付国債（２０年）	77,000,000	80,788,400	
第７９回　利付国債（２０年）	64,000,000	67,313,280	
第８０回　利付国債（２０年）	77,000,000	81,184,950	
第８１回　利付国債（２０年）	121,000,000	127,877,640	
第８２回　利付国債（２０年）	135,000,000	143,055,450	
第８３回　利付国債（２０年）	106,000,000	112,882,580	
第８４回　利付国債（２０年）	152,000,000	161,402,720	
第８５回　利付国債（２０年）	115,000,000	123,045,400	
第８６回　利付国債（２０年）	122,000,000	131,346,420	
第８７回　利付国債（２０年）	101,000,000	108,402,290	
第８８回　利付国債（２０年）	158,000,000	170,992,340	
第８９回　利付国債（２０年）	103,000,000	111,100,950	
第９０回　利付国債（２０年）	260,000,000	281,730,800	
第９１回　利付国債（２０年）	185,000,000	201,169,000	
第９２回　利付国債（２０年）	336,000,000	364,244,160	
第９３回　利付国債（２０年）	219,000,000	237,472,650	
第９４回　利付国債（２０年）	267,000,000	290,674,890	
第９５回　利付国債（２０年）	229,000,000	252,346,550	
第９６回　利付国債（２０年）	134,000,000	146,439,220	
第９７回　利付国債（２０年）	196,000,000	215,980,240	
第９８回　利付国債（２０年）	139,000,000	152,501,070	

第９９回　利付国債（２０年）	257,000,000	283,175,450	
第１００回　利付国債（２０年）	189,000,000	210,126,420	
第１０１回　利付国債（２０年）	118,000,000	132,440,840	
第１０２回　利付国債（２０年）	119,000,000	134,211,770	
第１０３回　利付国債（２０年）	112,000,000	125,695,360	
第１０４回　利付国債（２０年）	98,000,000	108,896,620	
第１０５回　利付国債（２０年）	88,000,000	98,196,560	
第１０６回　利付国債（２０年）	53,000,000	59,447,980	
第１０７回　利付国債（２０年）	74,000,000	82,914,040	
第１０８回　利付国債（２０年）	99,000,000	109,729,620	
第１０９回　利付国債（２０年）	79,000,000	87,879,600	
第１１０回　利付国債（２０年）	103,000,000	115,870,880	
第１１１回　利付国債（２０年）	79,000,000	89,719,510	
第１１２回　利付国債（２０年）	126,000,000	142,275,420	
第１１３回　利付国債（２０年）	300,000,000	340,110,000	
第１１４回　利付国債（２０年）	201,000,000	228,605,340	
第１１５回　利付国債（２０年）	120,000,000	137,322,000	
第１１６回　利付国債（２０年）	138,000,000	158,377,080	
第１１７回　利付国債（２０年）	210,000,000	239,488,200	
第１１８回　利付国債（２０年）	134,000,000	152,225,340	
第１１９回　利付国債（２０年）	121,000,000	135,648,260	
第１２０回　利付国債（２０年）	150,000,000	165,918,000	
第１２１回　利付国債（２０年）	206,000,000	233,167,280	
第１２２回　利付国債（２０年）	149,000,000	167,501,330	
第１２３回　利付国債（２０年）	201,000,000	231,445,470	
第１２４回　利付国債（２０年）	128,000,000	146,370,560	

第１２５回　利付国債（２０年）	133,000,000	154,777,420	
第１２６回　利付国債（２０年）	123,000,000	141,125,280	
第１２７回　利付国債（２０年）	119,000,000	135,561,230	
第１２８回　利付国債（２０年）	232,000,000	265,138,880	
第１２９回　利付国債（２０年）	122,000,000	138,398,020	
第１３０回　利付国債（２０年）	189,000,000	215,044,200	
第１３１回　利付国債（２０年）	124,000,000	140,012,120	
第１３２回　利付国債（２０年）	131,000,000	148,385,010	
第１３３回　利付国債（２０年）	156,000,000	178,092,720	
第１３４回　利付国債（２０年）	157,000,000	179,416,460	
第１３５回　利付国債（２０年）	114,000,000	129,236,100	
第１３６回　利付国債（２０年）	118,000,000	132,694,540	
第１３７回　利付国債（２０年）	101,000,000	114,534,000	
第１３８回　利付国債（２０年）	110,000,000	122,685,200	
第１３９回　利付国債（２０年）	114,000,000	128,211,240	
第１４０回　利付国債（２０年）	104,000,000	118,067,040	
第１４１回　利付国債（２０年）	173,000,000	196,592,010	
第１４２回　利付国債（２０年）	119,000,000	136,391,850	
第１４３回　利付国債（２０年）	173,000,000	194,932,940	
第１４４回　利付国債（２０年）	123,000,000	137,366,400	
第１４５回　利付国債（２０年）	246,000,000	279,866,820	
第１４６回　利付国債（２０年）	194,000,000	220,744,840	
第１４７回　利付国債（２０年）	214,000,000	241,237,920	
第１４８回　利付国債（２０年）	184,000,000	205,367,920	
第１４９回　利付国債（２０年）	199,000,000	221,988,480	

第１５０回　利付国債（２０年）	216,000,000	238,373,280	
第１５１回　利付国債（２０年）	216,000,000	233,219,520	
第１５２回　利付国債（２０年）	198,000,000	213,592,500	
第１５３回　利付国債（２０年）	234,000,000	254,940,660	
第１５４回　利付国債（２０年）	220,000,000	236,706,800	
第１５５回　利付国債（２０年）	211,000,000	221,501,470	
第１５６回　利付国債（２０年）	180,000,000	174,909,600	
第１５７回　利付国債（２０年）	182,000,000	171,567,760	
第１５８回　利付国債（２０年）	192,000,000	187,987,200	
第１５９回　利付国債（２０年）	163,000,000	161,220,040	
第１６０回　利付国債（２０年）	176,000,000	176,000,000	
第１６１回　利付国債（２０年）	180,000,000	176,916,600	
第１６２回　利付国債（２０年）	244,000,000	238,956,520	
第１６３回　利付国債（２０年）	237,000,000	231,243,270	
第１６４回　利付国債（２０年）	285,000,000	272,955,900	
第１６５回　利付国債（２０年）	242,000,000	230,824,440	
第１６６回　利付国債（２０年）	230,000,000	225,342,500	
第１６７回　利付国債（２０年）	252,000,000	238,512,960	
第１６８回　利付国債（２０年）	219,000,000	203,124,690	
第１６９回　利付国債（２０年）	245,000,000	222,511,450	
第１７０回　利付国債（２０年）	219,000,000	198,059,220	
第１７１回　利付国債（２０年）	234,000,000	210,721,680	
第１７２回　利付国債（２０年）	217,000,000	198,066,750	
第１７３回　利付国債（２０年）	277,000,000	251,779,150	
第１７４回　利付国債（２０年）	273,000,000	247,095,030	

	第１７５回　利付国債（２０年）	264,000,000	242,491,920	
	第１７６回　利付国債（２０年）	261,000,000	238,940,280	
	第１７７回　利付国債（２０年）	254,000,000	227,451,920	
	第１７８回　利付国債（２０年）	264,000,000	240,229,440	
	第１７９回　利付国債（２０年）	268,000,000	243,218,040	
	第１８０回　利付国債（２０年）	258,000,000	247,042,740	
	第１８１回　利付国債（２０年）	211,000,000	205,359,970	
	第１８２回　利付国債（２０年）	45,000,000	45,257,400	
国債証券　合計		51,394,000,000	52,618,675,550	
地方債証券	第７３０回　東京都公募公債	300,000,000	302,375,400	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	97,185,900	
	平成２７年度第１回　北海道公募公債	300,000,000	302,091,900	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	105,278,500	
	第４４８回　大阪府公募公債（１０年）	38,000,000	37,178,554	
	第４５５回　大阪府公募公債（１０年）	180,000,000	176,873,940	
	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	112,521,900	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	111,526,600	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	108,923,700	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債（２０年）	100,000,000	96,427,200	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	111,326,900	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	109,907,300	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債	100,000,000	104,706,400	
	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	198,349,600	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債	100,000,000	111,606,000	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債	100,000,000	111,553,400	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	297,637,500	

	第１３３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,638,500	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	94,394,600	
	第１回　名古屋市公募公債	100,000,000	121,717,900	
	第１回　京都市公募公債	300,000,000	312,615,300	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	112,349,300	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	112,658,200	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	105,746,700	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	113,610,300	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	116,033,400	
	平成２６年度第２回　北九州市公募公債	150,000,000	151,047,150	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	199,301,400	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債（２０年）	100,000,000	95,946,200	
地方債証券　合計		4,168,000,000	4,333,529,644	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	315,207,600	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,167,000	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,541,800	
	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	110,991,700	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	110,655,700	
	第２１８回　政保道路機構債券	500,000,000	504,888,000	
	第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	108,371,500	
	第２４９回　政保道路機構債券	179,000,000	180,979,024	
	第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	93,923,900	
	第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,375,600	
	第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	96,846,100	
	第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,544,700	
	第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	224,653,400	
	第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	109,956,300	
	第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	110,185,700	
	第７２回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,227,600	
	第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,840,865	
	第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	137,243,898	

	第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,718,300	
	第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	195,746,200	
	第１６回　公営企業債券	200,000,000	211,840,200	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	104,533,000	
	第４６回　福祉医療機構債券	200,000,000	199,127,400	
	第５９回　一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	224,084,000	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,167,800	
	第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,526,000	21,484,564	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,002,000	53,281,789	
	第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,268,000	62,237,326	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,384,000	51,487,758	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,254,000	57,613,345	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,796,000	60,130,958	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,150,000	30,228,550	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,984,000	269,317,425	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,260,000	166,307,438	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,024,000	118,630,569	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,967,000	101,916,216	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	207,633,000	203,895,606	
	い第８４５号　利付商工債券	200,000,000	200,175,400	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	199,370,800	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	99,759,200	
	第３５３回　利付しんきん中金債券	100,000,000	100,054,000	
特殊債券　合計		5,584,248,000	5,773,708,231	
社債券	第２９回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１９）	100,000,000	99,037,700	
	第１３回　クレディ・アグリコル	100,000,000	99,594,500	
	第５回　スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	200,782,600	
	第２５回　首都高速道路債券	400,000,000	398,730,800	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	195,314,800	
	第６０回　中日本高速道路債券	100,000,000	100,668,600	

	第２５回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,258,400	
	第２６回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,791,000	
	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	99,551,500	
	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	100,965,700	
	第５回　電通グループ	400,000,000	398,690,800	
	第１回　オリックス銀行	200,000,000	199,564,800	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	102,335,500	
	第１回　三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	100,581,100	
	第２９回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	100,000,000	105,239,200	
	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	100,590,200	
	第８回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後特約付	100,000,000	104,751,600	
	第１６回　ＮＴＴファイナンス	200,000,000	199,456,800	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	98,946,600	
	第９６回　トヨタファイナンス	100,000,000	99,509,400	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,810,200	
	第４０回　三菱ＵＦＪリース	300,000,000	298,883,700	
	第６回　三井住友海上火災保険	100,000,000	99,858,100	
	第６６回　三井不動産	100,000,000	100,061,300	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	99,316,200	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	223,155,800	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	101,919,600	
	第３回　東日本旅客鉄道サステナビリティボンド	100,000,000	97,753,100	
	第２７回　ＫＤＤＩ	200,000,000	199,892,000	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,748,600	
	第３８１回　中国電力	200,000,000	202,516,200	
	第３０６回　北陸電力	100,000,000	101,185,800	
	第４２９回　九州電力	200,000,000	202,472,000	
	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,639,000	
	第３３１回　北海道電力	100,000,000	100,223,800	
	第３５２回　北海道電力	100,000,000	100,314,100	
	第１３回　電源開発	100,000,000	104,713,900	
社債券　合計		5,500,000,000	5,537,825,000	
合計			68,263,738,425	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,003,501
コール・ローン	356,343,047
投資証券	32,056,508,100
未収配当金	218,346,409
流動資産合計	32,632,201,057
資産合計	32,632,201,057
負債の部	
流動負債	
未払解約金	53,924,162
その他未払費用	200
流動負債合計	53,924,362
負債合計	53,924,362
純資産の部	
元本等	
元本	16,947,494,605
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,630,782,090
元本等合計	32,578,276,695
純資産合計	32,578,276,695
負債純資産合計	32,632,201,057

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年11月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,553,467,034円
	同期中追加設定元本額	5,171,239,275円
	同期中一部解約元本額	4,777,211,704円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家限定）	737,966,460円
	ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	1,182,678,261円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＪリートインデックスファンド	8,610,732,108円
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０１３－０２（適格機関投資家限定）	1,691,808,658円
	ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	2,867,707,755円
	ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	1,653,722,454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）	137,767,601円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	14,165,377円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	6,048,555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）	9,889,734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）	33,525,524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）	87,397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）	185,176円
	ＦＷニッセイ国内リートインデックス	1,209,545円
	計	16,947,494,605円
２．	受益権の総数	16,947,494,605口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	283,682,900
合計	283,682,900

（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（2022年11月15日から2022年11月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9223円 (19,223円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	1,130	232,441,000	
	ＧＬＰ投資法人	9,416	1,456,655,200	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,804	407,140,800	
	Ｏｎｅリート投資法人	509	126,995,500	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	1,364	191,505,600	
	いちごオフィスリート投資法人	2,390	207,213,000	
	いちごホテルリート投資法人	483	49,266,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,540	663,740,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,917	1,007,823,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,272	188,383,200	
	イオンリート投資法人	3,229	516,962,900	
	インヴィンシブル投資法人	12,840	598,986,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	593	68,610,100	
	オリックス不動産投資法人	5,813	1,084,705,800	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,999	217,491,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,714	577,618,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,092	451,872,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,268	338,302,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,357	433,561,500	

サムティ・レジデンシャル投資法人	758	91,490,600	
サンケイリアルエステート投資法人	935	87,983,500	
ザイマックス・リート投資法人	473	57,091,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,408	700,896,000	
ジャパンエクセレント投資法人	2,676	363,936,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,917	1,773,536,000	
スターアジア不動産投資法人	3,642	202,859,400	
スターツプロシード投資法人	454	106,871,600	
タカラレーベン不動産投資法人	1,278	128,311,200	
トーセイ・リート投資法人	647	87,215,600	
ヒューリックリート投資法人	2,729	469,115,100	
フロンティア不動産投資法人	1,082	570,214,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	719	138,910,800	
マリモ地方創生リート投資法人	364	49,504,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,567	1,008,691,200	
ラサールロジポート投資法人	3,571	597,785,400	
阪急阪神リート投資法人	1,318	202,444,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,152	581,760,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,002	460,419,000	
産業ファンド投資法人	4,359	693,081,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	684	95,212,800	
森トラスト総合リート投資法人	2,085	300,240,000	
森ヒルズリート投資法人	3,430	550,515,000	
星野リゾート・リート投資法人	510	351,900,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,865	713,632,500	
大江戸温泉リート投資法人	471	31,462,800	
大和ハウスリート投資法人	4,397	1,358,673,000	
大和証券オフィス投資法人	610	414,800,000	
大和証券リビング投資法人	4,042	483,423,200	
投資法人みらい	3,544	169,226,000	
東海道リート投資法人	354	43,081,800	
東急リアル・エステート投資法人	1,956	407,239,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,007	638,438,000	
日本ビルファンド投資法人	3,403	2,157,502,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,995	779,047,500	
日本プロロジスリート投資法人	4,780	1,582,180,000	
日本リート投資法人	948	349,338,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,967	651,077,000	
日本都市ファンド投資法人	14,719	1,595,539,600	

	福岡リート投資法人	1,509	259,698,900	
	平和不動産リート投資法人	1,994	316,846,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,434	1,616,044,200	
投資証券　合計		173,485	32,056,508,100	
合計			32,056,508,100	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,340,334,673
金銭信託	47,806,723
コール・ローン	16,976,166,965
株式	565,772,218,149
投資証券	12,919,106,397
派生商品評価勘定	528,439,518
未収入金	472,284,976
未収配当金	700,778,656
差入委託証拠金	8,125,013,872
流動資産合計	606,882,149,929
資産合計	606,882,149,929
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,684,133
未払金	388,412,439
未払解約金	5,039,648,281
その他未払費用	10,602
流動負債合計	5,429,755,455
負債合計	5,429,755,455
純資産の部	
元本等	
元本	196,274,174,923
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	405,178,219,551
元本等合計	601,452,394,474
純資産合計	601,452,394,474
負債純資産合計	606,882,149,929

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	174,007,653,499円
同期中追加設定元本額	52,148,675,562円
同期中一部解約元本額	29,882,154,138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）	825,022,663円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,718,273,868円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,185,594,884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）	2,032,763,097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）	1,412,743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）	6,943,163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）	7,433,298円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	3,496,818,251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	142,849,511,480円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	33,441,839,240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）	2,076,464,020円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	294,419,641円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	178,471,014円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	330,717,293円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	616,417,169円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	16,828,661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）	87,947,391円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	6,246,980円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	8,988,067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）	3,838,200円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	21,274,392円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	213,426,091円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	140,608,871円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	304,173,587円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	219,200,953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）	195,635,840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）	199,656,819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）	197,031,619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）	193,095,563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）	193,060,286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）	173,825,784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）	28,452,808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）	979,463,778円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	17,645,667円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	11,671,742円
計	196,274,174,923円
２．　受益権の総数	196,274,174,923口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	9,440,717,343
投資証券	△1,287,572,710
合計	8,153,144,633

（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（2022年5月21日から2022年11月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	4,265,358,728	－	4,265,613,931	△255,203
アメリカ・ドル	3,139,025,947	－	3,139,549,102	△523,155
イギリス・ポンド	324,270,261	－	324,197,529	72,732
ユーロ	802,062,520	－	801,867,300	195,220
買建	11,182,158,676	－	11,244,180,996	62,022,320
アメリカ・ドル	7,996,245,303	－	8,052,252,001	56,006,698
イギリス・ポンド	984,258,009	－	989,034,983	4,776,974
ユーロ	2,201,655,364	－	2,202,894,012	1,238,648
合計	15,447,517,404	－	15,509,794,927	61,767,117

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	17,231,704,232	－	17,696,692,499	464,988,267
合計	17,231,704,232	－	17,696,692,499	464,988,267

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額	3.0643円
（1万口当たり純資産額）	(30,643円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年11月21日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	48,979	126.760	6,208,578.04	
	ABBOTT LABORATORIES	150,588	103.870	15,641,575.56	
	ABBVIE INC	152,014	154.980	23,559,129.72	
	ABIOMED INC	3,890	377.290	1,467,658.10	
	ACCENTURE PLC	54,460	286.500	15,602,790.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	67,275	74.100	4,985,077.50	
	ADOBE INC	40,607	330.860	13,435,232.02	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,218	147.500	769,655.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	139,323	73.570	10,249,993.11	
	AERCAP HOLDINGS NV	11,627	59.340	689,946.18	
	AES CORP	57,544	27.660	1,591,667.04	
	AFFIRM HOLDINGS INC	16,582	13.510	224,022.82	
	AFLAC INC	52,487	70.940	3,723,427.78	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,690	146.190	3,755,621.10	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,092	296.480	5,660,396.16	
	AIRBNB INC-CLASS A	32,229	97.770	3,151,029.33	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,765	90.950	1,251,926.75	
	ALBEMARLE CORP	10,057	276.980	2,785,587.86	
	ALCOA CORP	15,767	47.310	745,936.77	

ALIGN TECHNOLOGY INC	6,396	193.560	1,238,009.76	
ALLEGION PLC	7,644	112.960	863,466.24	
ALLIANT ENERGY CORP	21,577	55.260	1,192,345.02	
ALLSTATE CORP	23,559	132.740	3,127,221.66	
ALLY FINANCIAL INC	27,487	26.010	714,936.87	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,390	217.360	2,258,370.40	
ALPHABET INC-CL A	517,111	97.430	50,382,124.73	
ALPHABET INC-CL C	485,139	97.800	47,446,594.20	
ALTRIA GROUP INC	155,808	44.200	6,886,713.60	
AMAZON.COM INC	787,397	94.140	74,125,553.58	
AMC ENTERTAINMENT HLDGS	43,146	1.380	59,541.48	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	43,146	7.590	327,478.14	
AMCOR PLC	130,819	11.820	1,546,280.58	
AMERCO-NON VOTING	8,298	58.000	481,284.00	
AMEREN CORPORATION	22,262	86.180	1,918,539.16	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	44,186	91.280	4,033,298.08	
AMERICAN EXPRESS CO	55,075	152.500	8,398,937.50	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,132	142.140	871,602.48	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	67,717	59.820	4,050,830.94	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,572	146.710	2,284,568.12	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,392	328.700	3,087,150.40	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,627	162.000	2,207,574.00	
AMETEK INC	19,972	139.320	2,782,499.04	
AMGEN INC	45,965	287.290	13,205,284.85	
AMPHENOL CORP-CL A	51,614	79.710	4,114,151.94	
ANALOG DEVICES INC	44,801	161.850	7,251,041.85	
ANSYS INC	7,467	243.760	1,820,155.92	
AON PLC	18,256	301.320	5,500,897.92	
APA CORP	28,834	46.340	1,336,167.56	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,696	61.940	2,149,070.24	
APPLE INC	1,391,791	151.290	210,564,060.39	
APPLIED MATERIALS INC	74,729	104.700	7,824,126.30	
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,199	13.950	142,276.05	
APTIV PLC	23,304	108.030	2,517,531.12	
ARAMARK	20,276	40.640	824,016.64	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,955	57.670	1,842,844.85	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,390	95.150	4,604,308.50	
ARISTA NETWORKS INC	21,181	135.480	2,869,601.88	
ARROW ELECTRONICS INC	5,714	108.070	617,511.98	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,095	194.330	3,516,401.35	
ASSURANT INC	4,617	124.950	576,894.15	

AT&T INC	616,192	18.970	11,689,162.24	
ATMOS ENERGY CORP	12,000	115.050	1,380,600.00	
AUTODESK INC	18,692	210.370	3,932,236.04	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	36,173	256.020	9,261,011.46	
AUTOZONE INC	1,684	2,460.840	4,144,054.56	
AVANTOR INC	52,569	20.880	1,097,640.72	
AVERY DENNISON CORP	7,033	188.220	1,323,751.26	
BAKER HUGHES COMPANY	84,778	29.130	2,469,583.14	
BALL CORP	27,532	55.090	1,516,737.88	
BANK OF AMERICA CORP	623,292	37.190	23,180,229.48	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	65,983	44.560	2,940,202.48	
BATH & BODY WORKS INC	20,362	38.230	778,439.26	
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,433	55.000	2,388,815.00	
BECTON DICKINSON & CO	24,578	225.590	5,544,551.02	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	16,609	38.540	640,110.86	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	110,647	310.760	34,384,661.72	
BEST BUY CO INC	17,332	72.050	1,248,770.60	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,065	113.310	913,845.15	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,924	398.120	765,982.88	
BIO-TECHNE CORP	3,360	328.610	1,104,129.60	
BIOGEN INC	12,585	302.890	3,811,870.65	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,944	88.310	1,408,014.64	
BLACK KNIGHT INC	13,453	60.800	817,942.40	
BLACKROCK INC	13,012	720.610	9,376,577.32	
BLACKSTONE INC	60,190	91.680	5,518,219.20	
BLOCK INC	44,559	65.820	2,932,873.38	
BOEING CO	48,403	173.890	8,416,797.67	
BOOKING HOLDINGS INC	3,489	1,940.280	6,769,636.92	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,373	107.230	1,219,526.79	
BORGWARNER INC	20,597	42.220	869,605.34	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,038	42.960	5,285,712.48	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	183,279	77.450	14,194,958.55	
BROADCOM INC	34,741	515.160	17,897,173.56	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,162	144.600	1,469,425.20	
BROWN & BROWN INC	20,485	56.940	1,166,415.90	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	26,668	69.790	1,861,159.72	
BUNGE LIMITED	13,037	100.700	1,312,825.90	
BURLINGTON STORES INC	5,678	157.860	896,329.08	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,223	97.090	1,089,641.07	
CABLE ONE INC	465	683.350	317,757.75	

CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	23,658	165.020	3,904,043.16	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,350	49.980	917,133.00	
CAMPBELL SOUP CO	18,224	51.560	939,629.44	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,710	98.960	3,335,941.60	
CARDINAL HEALTH INC	23,624	77.680	1,835,112.32	
CARLISLE COS INC	4,467	250.750	1,120,100.25	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,944	28.290	479,345.76	
CARMAX INC	13,783	66.560	917,396.48	
CARNIVAL CORP	85,734	9.470	811,900.98	
CARRIER GLOBAL CORP	73,098	43.920	3,210,464.16	
CATALENT INC	14,648	43.040	630,449.92	
CATERPILLAR INC	45,886	231.430	10,619,396.98	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,194	121.510	1,117,162.94	
CBRE GROUP INC	28,089	75.300	2,115,101.70	
CDW CORP/DE	11,659	185.600	2,163,910.40	
CELANESE CORP-SERIES A	9,226	101.230	933,947.98	
CENTENE CORP	50,282	82.680	4,157,315.76	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,587	29.670	1,619,596.29	
CENTURYLINK INC	80,555	5.870	472,857.85	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,759	65.280	767,627.52	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,939	101.340	1,817,938.26	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,346	242.150	1,052,383.90	
CHARLES SCHWAB CORP	125,007	79.810	9,976,808.67	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	10,091	374.380	3,777,868.58	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,813	129.290	1,139,432.77	
CHENIERE ENERGY INC	19,718	167.750	3,307,694.50	
CHEVRON CORP	160,527	182.990	29,374,835.73	
CHEWY INC - CLASS A	7,943	40.920	325,027.56	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,502.480	3,604,449.52	
CHUBB LTD	36,605	210.140	7,692,174.70	
CHURCH & DWIGHT CO INC	20,933	76.420	1,599,699.86	
CIGNA CORP	27,280	319.210	8,708,048.80	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,035	106.860	1,392,920.10	
CINTAS CORP	7,902	449.370	3,550,921.74	
CISCO SYSTEMS INC	356,100	47.790	17,018,019.00	
CITIGROUP INC	166,948	48.660	8,123,689.68	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,323	40.410	1,710,272.43	
CLARIVATE PLC	26,052	9.260	241,241.52	
CLEVELAND-CLIFFS INC	44,751	14.330	641,281.83	
CLOROX CO	10,595	146.790	1,555,240.05	

CLOUDFLARE INC - CLASS A	21,726	47.010	1,021,339.26	
CME GROUP INC	30,942	172.500	5,337,495.00	
CMS ENERGY CORP	25,063	60.000	1,503,780.00	
COCA-COLA CO	354,368	61.140	21,666,059.52	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	17,651	50.790	896,494.29	
COGNEX CORP	14,872	47.740	709,989.28	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	44,785	59.970	2,685,756.45	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	10,429	45.260	472,016.54	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,559	76.460	5,242,021.14	
COMCAST CORP	384,219	34.500	13,255,555.50	
CONAGRA BRANDS INC	41,275	35.950	1,483,836.25	
CONOCOPHILLIPS	111,161	128.590	14,294,192.99	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,522	93.530	2,854,722.66	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,024	247.650	3,473,043.60	
CONSTELLATION ENERGY	28,070	93.300	2,618,931.00	
COOPER COS INC/THE	4,224	307.400	1,298,457.60	
COPART INC	36,611	64.420	2,358,480.62	
CORNING INC	69,103	33.890	2,341,900.67	
CORTEVA INC	62,297	65.200	4,061,764.40	
COSTAR GROUP INC	34,044	80.800	2,750,755.20	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,079	523.670	19,940,829.93	
COTERRA ENERGY INC	69,297	26.600	1,843,300.20	
COUPA SOFTWARE INC	6,453	45.870	295,999.11	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,409	138.990	2,419,676.91	
CROWN HOLDINGS INC	10,648	80.400	856,099.20	
CSX CORP	189,035	30.880	5,837,400.80	
CUMMINS INC	12,179	250.310	3,048,525.49	
CVS HEALTH CORP	112,783	97.350	10,979,425.05	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,502	148.900	521,447.80	
DANAHER CORP	59,399	260.650	15,482,349.35	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,672	147.140	1,570,278.08	
DATADOG INC - CLASS A	20,656	76.520	1,580,597.12	
DAVITA INC	4,869	70.650	343,994.85	
DEERE & CO	24,972	414.260	10,344,900.72	
DELL TECHNOLOGIES -C	23,525	42.040	988,991.00	
DELTA AIR LINES INC	13,297	34.470	458,347.59	
DENTSPLY SIRONA INC	18,508	31.130	576,154.04	
DEVON ENERGY CORPORATION	53,788	69.620	3,744,720.56	
DEXCOM INC	33,701	113.720	3,832,477.72	
DIAMONDBACK ENERGY INC	14,449	156.220	2,257,222.78	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	24,139	107.260	2,589,149.14	
DISH NETWORK CORP	21,198	15.230	322,845.54	

DOCUSIGN INC	17,091	46.000	786,186.00	
DOLLAR GENERAL CORP	19,535	257.700	5,034,169.50	
DOLLAR TREE INC	19,317	163.360	3,155,625.12	
DOMINION ENERGY INC	69,961	59.160	4,138,892.76	
DOMINO'S PIZZA INC	3,089	367.890	1,136,412.21	
DOORDASH INC - A	16,537	58.290	963,941.73	
DOVER CORP	12,397	139.470	1,729,009.59	
DOW INC	62,554	50.070	3,132,078.78	
DR HORTON INC	28,637	81.390	2,330,765.43	
DROPBOX INC-CLASS A	25,069	22.280	558,537.32	
DTE ENERGY COMPANY	16,793	114.600	1,924,477.80	
DUKE ENERGY CORP	66,288	96.790	6,416,015.52	
DUPONT DE NEMOURS INC	43,924	69.380	3,047,447.12	
DYNATRACE INC	17,233	36.590	630,555.47	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,044	84.250	930,457.00	
EATON CORP PLC	34,353	165.010	5,668,588.53	
EBAY INC	48,056	45.680	2,195,198.08	
ECOLAB INC	22,152	148.110	3,280,932.72	
EDISON INTERNATIONAL	32,936	61.720	2,032,809.92	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,433	75.040	4,009,612.32	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,815	11.910	438,466.65	
ELECTRONIC ARTS INC	24,076	130.080	3,131,806.08	
ELEVANCE HEALTH, INC	20,715	495.320	10,260,553.80	
ELI LILLY & CO	69,454	361.670	25,119,428.18	
EMERSON ELECTRIC CO	51,143	93.700	4,792,099.10	
ENPHASE ENERGY INC	11,607	311.940	3,620,687.58	
ENTEGRIS INC	12,809	73.340	939,412.06	
ENTERGY CORP	17,541	111.920	1,963,188.72	
EOG RESOURCES INC	50,301	141.020	7,093,447.02	
EPAM SYSTEMS INC	4,904	341.460	1,674,519.84	
EQT CORP	28,547	41.030	1,171,283.41	
EQUIFAX INC	10,511	200.180	2,104,091.98	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,780	30.650	1,004,707.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,194	267.980	587,948.12	
ESSENTIAL UTILITIES INC	21,566	47.120	1,016,189.92	
ESTEE LAUDER COS INC	19,899	233.460	4,645,620.54	
ETSY INC	10,899	113.920	1,241,614.08	
EVEREST RE GROUP LTD	3,339	323.490	1,080,133.11	
EVERGY INC	19,798	58.650	1,161,152.70	
EVERSOURCE ENERGY	29,692	79.650	2,364,967.80	
EXACT SCIENCES CORP	15,198	42.530	646,370.94	
EXELON CORP	84,256	38.580	3,250,596.48	
EXPEDIA GROUP INC	12,971	98.310	1,275,179.01	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	14,888	112.770	1,678,919.76	
EXXON MOBIL CORP	362,230	112.080	40,598,738.40	
F5 INC	5,180	149.370	773,736.60	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,258	437.770	1,426,254.66	
FAIR ISAAC CORP	2,229	576.200	1,284,349.80	
FASTENAL CO	49,399	51.660	2,551,952.34	
FEDEX CORP	21,309	174.720	3,723,108.48	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	22,785	39.700	904,564.50	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,572	61.410	3,228,446.52	
FIFTH THIRD BANCORP	58,854	35.630	2,096,968.02	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,027	789.140	810,446.78	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,464	121.950	1,885,834.80	
FIRSTENERGY CORP	46,855	38.480	1,802,980.40	
FISERV INC	52,874	99.860	5,279,997.64	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,325	188.450	1,191,946.25	
FMC CORP	10,882	127.650	1,389,087.30	
FORD MOTOR CO	339,468	13.990	4,749,157.32	
FORTINET INC	58,573	52.150	3,054,581.95	
FORTIVE CORP	29,399	66.610	1,958,267.39	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,271	64.410	725,965.11	
FOX CORP - CLASS A	25,697	30.930	794,808.21	
FOX CORP- CLASS B	13,823	29.140	402,802.22	
FRANKLIN RESOURCES INC	25,610	26.150	669,701.50	
FREEPORT-MCMORAN INC	124,251	36.340	4,515,281.34	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,071	50.620	256,694.02	
GARMIN LTD	13,261	91.030	1,207,148.83	
GARTNER INC	6,930	337.690	2,340,191.70	
GEN DIGITAL INC	50,001	22.620	1,131,022.62	
GENERAC HOLDINGS INC	5,467	102.870	562,390.29	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,345	248.220	5,050,035.90	
GENERAL ELECTRIC CO	94,669	85.480	8,092,306.12	
GENERAL MILLS INC	51,770	81.030	4,194,923.10	
GENERAL MOTORS CO	118,937	39.770	4,730,124.49	
GENUINE PARTS CO	12,263	180.680	2,215,678.84	
GILEAD SCIENCES INC	107,955	83.620	9,027,197.10	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,228	98.010	2,374,586.28	
GLOBE LIFE INC	8,046	113.720	914,991.12	
GODADDY INC - CLASS A	13,983	74.030	1,035,161.49	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,524	379.200	11,195,500.80	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	114,478	3.210	367,474.38	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,094	57.060	404,783.64	
HALLIBURTON CO	77,588	36.710	2,848,255.48	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	27,992	73.690	2,062,730.48	
HASBRO INC	11,479	59.520	683,230.08	
HCA HEALTHCARE INC	20,293	230.080	4,669,013.44	

HEICO CORP	3,778	163.760	618,685.28	
HEICO CORP-CLASS A	6,255	127.950	800,327.25	
HENRY SCHEIN INC	11,852	78.910	935,241.32	
HERSHEY CO/THE	12,565	225.210	2,829,763.65	
HESS CORP	24,047	143.990	3,462,527.53	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	111,433	15.770	1,757,298.41	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,841	139.510	3,326,057.91	
HOLOGIC INC	21,407	73.480	1,572,986.36	
HOME DEPOT INC	88,376	313.180	27,677,595.68	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,602	214.530	12,571,887.06	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	99,900	3.970	396,603.00	
HORIZON PHARMA PLC	18,729	76.260	1,428,273.54	
HORMEL FOODS CORP	25,856	48.660	1,258,152.96	
HOWMET AEROSPACE INC	32,329	37.100	1,199,405.90	
HP INC	90,424	29.480	2,665,699.52	
HUBSPOT INC	3,886	272.600	1,059,323.60	
HUMANA INC	10,865	529.900	5,757,363.50	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	124,089	14.890	1,847,685.21	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,445	227.310	783,082.95	
IAC INC	6,962	47.110	327,979.82	
IDEX CORP	6,577	233.550	1,536,058.35	
IDEXX LABORATORIES INC	7,187	413.890	2,974,627.43	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	26,846	226.880	6,090,820.48	
ILLUMINA INC	13,497	220.560	2,976,898.32	
INCYTE CORP	16,169	77.450	1,252,289.05	
INGERSOLL-RAND INC	35,103	53.700	1,885,031.10	
INSULET CORP	5,959	295.530	1,761,063.27	
INTEL CORP	351,563	29.870	10,501,186.81	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,039	104.210	5,006,144.19	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	77,415	147.640	11,429,550.60	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	21,987	98.270	2,160,662.49	
INTERNATIONAL PAPER CO	30,400	35.770	1,087,408.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,831	33.100	1,119,806.10	
INTUIT INC	23,026	380.070	8,751,491.82	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,825	262.110	8,079,540.75	
INVESCO LTD	28,742	18.940	544,373.48	
IQVIA HOLDINGS INC	16,291	213.780	3,482,689.98	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,293	186.960	1,176,539.28	

JACOBS SOLUTIONS INC	11,068	126.040	1,395,010.72	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	13,700	46.160	632,392.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,383	147.180	792,269.94	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,490	180.250	1,350,072.50	
JM SMUCKER CO	9,310	146.140	1,360,563.40	
JOHNSON & JOHNSON	226,367	176.200	39,885,865.40	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	59,928	66.980	4,013,977.44	
JPMORGAN CHASE & CO	252,535	133.840	33,799,284.40	
JUNIPER NETWORKS INC	27,823	31.570	878,372.11	
KELLOGG CO	21,873	70.610	1,544,452.53	
KEURIG DR PEPPER INC	67,705	37.420	2,533,521.10	
KEYCORP	79,973	18.610	1,488,297.53	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,653	171.900	2,690,750.70	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,059	131.400	3,818,352.60	
KINDER MORGAN INC	175,774	18.420	3,237,757.08	
KKR & CO INC -A	48,340	51.840	2,505,945.60	
KLA CORPORATION	12,848	376.340	4,835,216.32	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	14,301	54.730	782,693.73	
KRAFT HEINZ CO/THE	63,212	38.100	2,408,377.20	
KROGER CO	59,272	48.260	2,860,466.72	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,584	224.000	3,714,816.00	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,967	230.180	1,833,844.06	
LAM RESEARCH CORP	11,928	456.700	5,447,517.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,669	43.620	1,294,161.78	
LEAR CORP	5,153	145.640	750,482.92	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,204	106.300	1,190,985.20	
LENNAR CORP-CL A	22,150	84.710	1,876,326.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,790	268.570	749,310.30	
LIBERTY BROADBAND-C	11,228	86.260	968,527.28	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	10,031	19.300	193,598.30	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	29,059	20.020	581,761.18	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	5,899	42.300	249,527.70	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	14,681	41.980	616,308.38	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	17,027	57.610	980,925.47	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,773	37.730	519,655.29	
LINDE PLC	43,271	334.910	14,491,890.61	
LIVE NATION INC	14,829	66.210	981,828.09	
LKQ CORP	23,078	54.020	1,246,673.56	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,595	476.820	9,820,107.90	
LOEWS CORP	17,885	56.620	1,012,648.70	

LOWE'S COS INC	54,954	209.930	11,536,493.22	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,847	218.220	1,494,152.34	
LUCID GROUP INC	36,118	11.260	406,688.68	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,020	347.850	3,485,457.00	
LYFT INC-A	27,118	11.210	303,992.78	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,426	82.300	1,845,659.80	
M&T BANK CORP	15,433	170.610	2,633,024.13	
MARATHON OIL CORP	60,263	30.800	1,856,100.40	
MARATHON PETROLEUM CORP	46,335	121.180	5,614,875.30	
MARKEL CORP	1,168	1,259.290	1,470,850.72	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,238	259.790	841,200.02	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	23,844	161.710	3,855,813.24	
MARSH & MCLENNAN COS INC	43,195	167.500	7,235,162.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,378	356.320	1,916,288.96	
MARVELL TECHNOLOGY INC	73,160	44.000	3,219,040.00	
MASCO CORP	20,247	49.930	1,010,932.71	
MASIMO CORPORATION	4,494	141.460	635,721.24	
MASTERCARD INC-CLASS A	74,674	343.690	25,664,707.06	
MATCH GROUP INC	24,479	46.400	1,135,825.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,607	83.760	1,809,802.32	
MCDONALD'S CORP	63,639	273.370	17,396,993.43	
MCKESSON CORP	12,541	369.730	4,636,783.93	
MEDTRONIC PLC	114,462	81.300	9,305,760.60	
MERCADOLIBRE INC	3,896	962.080	3,748,263.68	
MERCK & CO INC	217,505	104.230	22,670,546.15	
META PLATFORMS INC-A	197,167	112.050	22,092,562.35	
METLIFE INC	59,214	75.500	4,470,657.00	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,947	1,401.310	2,728,350.57	
MGM MIRAGE	28,981	36.740	1,064,761.94	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47,791	74.170	3,544,658.47	
MICRON TECHNOLOGY INC	95,991	58.580	5,623,152.78	
MICROSOFT CORP	610,964	241.220	147,376,736.08	
MODERNA INC	29,033	181.590	5,272,102.47	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,347	99.970	434,569.59	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,042	317.750	1,602,095.50	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	15,493	53.500	828,875.50	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	119,084	64.990	7,739,269.16	
MONGODB INC	5,845	159.880	934,498.60	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,805	377.310	1,435,664.55	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,073	99.700	3,397,078.10	
MOODY'S CORP	14,278	292.330	4,173,887.74	

MORGAN STANLEY	112,807	89.200	10,062,384.40	
MOSAIC CO/THE	31,012	48.970	1,518,657.64	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,417	262.940	3,790,805.98	
MSCI INC	6,957	490.310	3,411,086.67	
NASDAQ INC	29,690	65.520	1,945,288.80	
NETAPP INC	19,147	73.720	1,411,516.84	
NETFLIX INC	38,171	287.980	10,992,484.58	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,225	120.160	988,316.00	
NEWELL BRANDS INC	33,878	13.350	452,271.30	
NEWMONT CORP	68,140	45.130	3,075,158.20	
NEWS CORP - CLASS A	33,295	17.830	593,649.85	
NEXTERA ENERGY INC	168,922	83.200	14,054,310.40	
NIKE INC	109,118	105.420	11,503,219.56	
NISOURCE INC	35,181	26.320	925,963.92	
NORDSON CORP	4,476	231.010	1,034,000.76	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,800	246.760	5,132,608.00	
NORTHERN TRUST CORP	17,041	92.320	1,573,225.12	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,693	520.420	6,605,691.06	
NOVOCURE LTD	8,075	77.490	625,731.75	
NRG ENERGY INC	20,202	42.240	853,332.48	
NUCOR CORP	22,804	142.030	3,238,852.12	
NVIDIA CORP	215,297	154.090	33,175,114.73	
NVR INC	269	4,392.590	1,181,606.71	
NXP SEMICONDUCTORS NV	22,597	171.940	3,885,328.18	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,652	838.270	4,737,902.04	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,556	71.250	5,739,615.00	
OKTA INC	12,953	49.860	645,836.58	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,443	298.340	2,518,884.62	
OMNICOM GROUP	17,724	77.200	1,368,292.80	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	37,344	72.460	2,705,946.24	
ONEOK INC	38,370	64.470	2,473,713.90	
ORACLE CORP	137,678	79.730	10,977,066.94	
OTIS WORLDWIDE CORP	36,465	77.760	2,835,518.40	
OWENS CORNING	8,298	90.060	747,317.88	
PACCAR INC	30,005	103.870	3,116,619.35	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,082	129.040	1,042,901.28	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	142,080	7.390	1,049,971.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	25,709	167.480	4,305,743.32	
PARAMOUNT GLOBAL	52,216	18.660	974,350.56	
PARKER HANNIFIN CORP	11,043	305.630	3,375,072.09	
PAYCHEX INC	27,944	120.830	3,376,473.52	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,395	316.390	1,390,534.05	
PAYPAL HOLDINGS INC	94,550	84.920	8,029,186.00	

PENTAIR PLC	14,117	45.030	635,688.51	
PEPSICO INC	118,947	181.330	21,568,659.51	
PERKINELMER INC	10,860	136.170	1,478,806.20	
PFIZER INC	482,483	48.230	23,270,155.09	
PG&E CORP	128,752	15.020	1,933,855.04	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,259	96.280	12,830,176.52	
PHILLIPS 66	41,313	108.990	4,502,703.87	
PINTEREST INC- CLASS A	49,320	24.380	1,202,421.60	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,746	249.940	4,935,315.24	
PLUG POWER INC	44,768	15.840	709,125.12	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,583	161.160	5,734,556.28	
POOL CORP	3,430	321.980	1,104,391.40	
PPG INDUSTRIES INC	20,310	128.470	2,609,225.70	
PPL CORPORATION	63,438	28.090	1,781,973.42	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,598	90.900	1,963,258.20	
PROCTER & GAMBLE CO	206,380	142.570	29,423,596.60	
PROGRESSIVE CORP	50,237	128.360	6,448,421.32	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,240	107.330	3,460,319.20	
PTC INC	9,563	123.300	1,179,117.90	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,236	57.690	2,494,284.84	
PULTE GROUP INC	20,197	42.850	865,441.45	
QORVO INC	9,063	98.920	896,511.96	
QUALCOMM INC	96,306	123.850	11,927,498.10	
QUANTA SERVICES INC	12,388	148.660	1,841,600.08	
QUEST DIAGNOSTICS	10,112	146.420	1,480,599.04	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,619	121.590	2,020,704.21	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	128,015	95.360	12,207,510.40	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,285	736.730	6,840,538.05	
REGIONS FINANCIAL CORP	80,065	22.490	1,800,661.85	
REPUBLIC SERVICES INC	19,080	133.890	2,554,621.20	
RESMED INC	12,569	224.400	2,820,483.60	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,901	36.210	249,885.21	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,009	30.340	819,453.06	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	9,371	75.500	707,510.50	
ROBLOX CORP -CLASS A	30,266	31.720	960,037.52	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,007	264.740	2,649,253.18	
ROKU INC	10,245	55.650	570,134.25	
ROLLINS INC	18,996	42.460	806,570.16	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,132	433.010	3,954,247.32	
ROSS STORES INC	30,234	107.590	3,252,876.06	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,848	58.690	1,164,879.12	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,033	42.870	1,287,514.71	
RPM INTERNATIONAL INC	11,221	100.600	1,128,832.60	
S&P GLOBAL INC	29,845	345.870	10,322,490.15	
SALESFORCE INC	85,482	148.040	12,654,755.28	
SCHLUMBERGER LTD	121,558	53.440	6,496,059.52	
SEA LTD-ADR	31,005	56.940	1,765,424.70	
SEAGATE TECHNOLOGY	17,511	54.570	955,575.27	
SEAGEN INC	11,898	131.760	1,567,680.48	
SEALED AIR CORP	12,646	51.140	646,716.44	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,729	60.900	592,496.10	
SEMPRA ENERGY	27,070	157.840	4,272,728.80	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,649	44.030	600,965.47	
SERVICENOW INC	17,230	399.380	6,881,317.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,253	240.040	5,101,570.12	
SIGNATURE BANK	5,379	132.030	710,189.37	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,910	6.390	440,334.90	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,793	94.330	1,301,093.69	
SMITH (A.O.) CORP	11,228	61.280	688,051.84	
SNAP INC - A	95,012	10.520	999,526.24	
SNAP-ON INC	4,581	236.380	1,082,856.78	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,139	146.200	2,798,121.80	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,760	306.390	1,458,416.40	
SOUTHERN CO	91,555	65.570	6,003,261.35	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,394	38.110	472,335.34	
SPLUNK INC	13,874	77.300	1,072,460.20	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,774	52.220	1,032,598.28	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,966	80.200	1,039,873.20	
STARBUCKS CORP	98,582	97.950	9,656,106.90	
STATE STREET CORP	31,422	75.590	2,375,188.98	
STEEL DYNAMICS INC	16,091	100.640	1,619,398.24	
STERIS PLC	8,632	166.010	1,432,998.32	
STRYKER CORP	29,272	223.610	6,545,511.92	
SVB FINANCIAL GROUP	5,043	223.530	1,127,261.79	
SYNCHRONY FINANCIAL	42,843	35.890	1,537,635.27	
SYNOPSYS INC	13,143	325.890	4,283,172.27	
SYSCO CORP	43,762	85.060	3,722,395.72	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,310	122.070	2,357,171.70	
T-MOBILE US INC	53,981	148.830	8,033,992.23	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	13,932	98.770	1,376,063.64	
TARGA RESOURCES CORP	18,474	72.330	1,336,224.42	
TARGET CORP	39,826	162.880	6,486,858.88	
TE CONNECTIVITY LTD	27,758	126.390	3,508,333.62	

TELADOC HEALTH INC	13,959	28.790	401,879.61	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,050	407.090	1,648,714.50	
TELEFLEX INC	4,022	217.400	874,382.80	
TERADYNE INC	13,731	92.900	1,275,609.90	
TESLA, INC.	227,162	180.190	40,932,320.78	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	95,433	8.720	832,175.76	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,313	175.180	13,894,051.34	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	532	2,703.890	1,438,469.48	
TEXTRON INC	18,379	70.070	1,287,816.53	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,670	535.240	18,021,530.80	
TJX COS INC	100,807	78.160	7,879,075.12	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,620	219.860	2,115,053.20	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	37,967	49.770	1,889,617.59	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,244	57.250	529,219.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,167	176.240	3,554,232.08	
TRANSDIGM GROUP INC	4,461	620.610	2,768,541.21	
TRANSUNION	16,503	60.440	997,441.32	
TRAVELERS COS INC/THE	20,570	184.560	3,796,399.20	
TRIMBLE INC	21,496	57.990	1,246,553.04	
TRUIST FINANCIAL CORP	114,795	45.660	5,241,539.70	
TWILIO INC - A	14,744	49.250	726,142.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,572	313.450	1,119,643.40	
TYSON FOODS INC-CL A	24,938	65.520	1,633,937.76	
UBER TECHNOLOGIES INC	127,220	28.960	3,684,291.20	
UGI CORP	17,964	38.610	693,590.04	
ULTA BEAUTY INC	4,447	440.500	1,958,903.50	
UNION PACIFIC CORP	54,374	210.580	11,450,076.92	
UNITED PARCEL SERVICE INC	63,344	178.970	11,336,675.68	
UNITED RENTALS INC	6,118	345.700	2,114,992.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,669	530.000	42,754,570.00	
UNITY SOFTWARE INC	16,503	34.680	572,324.04	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,658	128.670	728,014.86	
US BANCORP	121,447	43.380	5,268,370.86	
VAIL RESORTS INC	3,470	243.360	844,459.20	
VALERO ENERGY CORP	35,006	137.620	4,817,525.72	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,022	184.080	2,213,009.76	
VERISIGN INC	8,468	194.250	1,644,909.00	
VERISK ANALYTICS INC	13,580	173.540	2,356,673.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	361,681	38.550	13,942,802.55	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,990	314.630	6,918,713.70	
VF CORP	28,495	33.080	942,614.60	
VIATRIS INC	104,290	11.000	1,147,190.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	141,525	210.800	29,833,470.00	
VISTRA CORP	33,679	22.910	771,585.89	
VMWARE INC-CLASS A	18,135	116.560	2,113,815.60	
VULCAN MATERIALS CO	11,472	178.890	2,052,226.08	
WABTEC CORP	15,043	99.160	1,491,663.88	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,938	39.750	2,501,785.50	
WALMART INC	130,115	150.230	19,547,176.45	
WALT DISNEY CO	156,605	91.800	14,376,339.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	197,963	10.770	2,132,061.51	
WASTE CONNECTIONS INC	22,180	140.200	3,109,636.00	
WASTE MANAGEMENT INC	35,740	161.180	5,760,573.20	
WATERS CORP	5,170	321.160	1,660,397.20	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,540	33.240	217,389.60	
WEBSTER FINANCIAL CORP	15,265	52.610	803,091.65	
WEC ENERGY GROUP INC	27,175	95.700	2,600,647.50	
WELLS FARGO & CO	325,789	46.500	15,149,188.50	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,345	225.000	1,427,625.00	
WESTERN DIGITAL CORP	26,928	36.860	992,566.08	
WESTERN UNION CO	33,482	13.890	465,064.98	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,256	104.430	340,024.08	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	21,917	36.510	800,189.67	
WEYERHAEUSER CO	63,796	32.270	2,058,696.92	
WHIRLPOOL CORP	4,850	147.420	714,987.00	
WILLIAMS COS INC	104,916	33.400	3,504,194.40	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,549	232.730	2,222,338.77	
WIX.COM LTD	4,918	85.090	418,472.62	
WORKDAY INC-CLASS A	17,105	146.740	2,509,987.70	
WR BERKLEY CORP	18,114	73.330	1,328,299.62	
WW GRAINGER INC	3,951	597.030	2,358,865.53	
WYNN RESORTS LTD	9,587	76.000	728,612.00	
XCEL ENERGY INC	46,915	68.380	3,208,047.70	
XYLEM INC	15,505	112.630	1,746,328.15	
YUM! BRANDS INC	24,475	124.610	3,049,829.75	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,498	256.100	1,151,937.80	
ZENDESK INC	10,527	77.460	815,421.42	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	13,913	35.260	490,572.38	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,468	24.780	185,057.04	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,064	114.090	2,060,921.76	
ZOETIS INC	40,479	145.640	5,895,361.56	

	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,402	81.640	1,583,979.28	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	22,487	26.610	598,379.07	
	ZSCALER INC	7,257	138.730	1,006,763.61	
アメリカ・ドル　小計		29,409,243		2,950,807,234.38 (414,175,303,418)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	82,110	13.135	1,078,514.85	
	ABRDN PLC	181,404	2.025	367,343.10	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,470	20.920	323,632.40	
	ANGLO AMERICAN PLC	108,833	31.605	3,439,666.96	
	ANTOFAGASTA PLC	33,692	13.230	445,745.16	
	ASHTEAD GROUP PLC	37,994	50.100	1,903,499.40	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,561	15.340	468,805.74	
	ASTRAZENECA PLC	133,309	109.200	14,557,342.80	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	80,296	5.668	455,117.72	
	AVEVA GROUP PLC	10,432	31.640	330,068.48	
	AVIVA PLC	244,316	4.551	1,111,882.11	
	BAE SYSTEMS PLC	271,351	7.702	2,089,945.40	
	BARCLAYS PLC	1,434,431	1.582	2,269,269.84	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	87,617	3.992	349,767.06	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	9,736	37.280	362,958.08	
	BP PLC	1,664,824	4.760	7,924,562.24	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	185,229	33.110	6,132,932.19	
	BT GROUP PLC	600,117	1.228	736,943.67	
	BUNZL PLC	29,268	30.260	885,649.68	
	BURBERRY GROUP PLC	34,200	20.980	717,516.00	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,081	19.950	340,765.95	
	COMPASS GROUP PLC	153,269	18.505	2,836,242.84	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,982	69.140	828,435.48	
	DCC PLC	8,563	43.420	371,805.46	
	DIAGEO PLC	196,743	36.740	7,228,337.82	
	ENTAIN PLC	50,125	13.400	671,675.00	
	EXPERIAN PLC	79,003	28.890	2,282,396.67	
	FERGUSON PLC	18,389	98.500	1,811,316.50	
	GLENCORE PLC	845,429	5.058	4,276,179.88	
	GSK PLC	349,964	13.684	4,788,907.37	
	HALEON PLC	435,240	2.872	1,250,009.28	
	HALMA PLC	32,592	22.250	725,172.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,230	8.374	253,146.02	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,984	14.290	199,831.36	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,729,538	4.789	8,282,757.48	
	IMPERIAL BRANDS PLC	77,608	21.210	1,646,065.68	
	INFORMA PLC	127,097	5.916	751,905.85	

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	15,822	47.400	749,962.80	
INTERTEK GROUP PLC	13,950	39.240	547,398.00	
JD SPORTS FASHION PLC	215,849	1.196	258,155.40	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,858	20.310	322,075.98	
KINGFISHER PLC	170,277	2.461	419,051.69	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	514,764	2.614	1,345,593.09	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,977,432	0.454	2,713,754.12	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	28,392	81.220	2,305,998.24	
M&G PLC	232,270	1.983	460,591.41	
MELROSE INDUSTRIES PLC	376,036	1.308	491,855.08	
MONDI PLC/WI	41,401	15.750	652,065.75	
NATIONAL GRID PLC	314,406	10.175	3,199,081.05	
NATWEST GROUP PLC	449,714	2.581	1,160,711.83	
NEXT PLC	11,183	57.320	641,009.56	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	49,455	6.782	335,403.81	
PEARSON PLC	57,608	9.770	562,830.16	
PERSIMMON PLC	27,356	12.995	355,491.22	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	69,742	5.960	415,662.32	
PRUDENTIAL PLC	236,011	9.786	2,309,603.64	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	61,596	58.120	3,579,959.52	
RELX PLC	165,744	22.830	3,783,935.52	
RENTOKIL INITIAL PLC	160,771	5.344	859,160.22	
RIO TINTO PLC	96,346	53.850	5,188,232.10	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	724,075	0.854	618,360.05	
SAGE GROUP PLC	87,885	8.002	703,255.77	
SAINSBURY (J) PLC	147,631	2.168	320,064.00	
SCHRODERS PLC	62,653	4.593	287,765.22	
SEVERN TRENT PLC	22,034	27.300	601,528.20	
SHELL PLC-NEW	639,405	23.445	14,990,850.22	
SMITH & NEPHEW PLC	75,047	10.680	801,501.96	
SMITHS GROUP PLC	32,309	15.750	508,866.75	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,337	114.000	722,418.00	
SSE PLC	91,833	16.965	1,557,946.84	
ST JAMES'S PLACE PLC	47,054	11.880	559,001.52	
STANDARD CHARTERED PLC	216,062	5.816	1,256,616.59	
TAYLOR WIMPEY PLC	306,565	1.031	316,068.51	
TESCO PLC	651,147	2.313	1,506,103.01	
UNILEVER PLC	219,578	40.405	8,872,049.09	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	60,005	10.260	615,651.30	
VODAFONE GROUP PLC	2,315,272	0.974	2,255,074.92	
WHITBREAD PLC	17,524	25.120	440,202.88	

	WPP PLC	94,028	8.688	816,915.26	
イギリス・ポンド　小計		24,575,212		154,903,940.87 (25,805,447,510)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	3,760	263.000	988,880.00	
	BANK HAPOALIM BM	109,400	32.950	3,604,730.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	132,737	32.480	4,311,297.76	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	183,396	6.135	1,125,134.46	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,297	670.000	1,538,990.00	
	ICL GROUP LTD	61,011	28.330	1,728,441.63	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	106,231	19.920	2,116,121.52	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,364	131.400	1,756,029.60	
	NICE LTD	5,459	688.600	3,759,067.40	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	9,468	150.500	1,424,934.00	
イスラエル・シュケル　小計		627,123		22,353,626.37 (903,269,805)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	22,379	28.820	644,962.78	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	53,446	36.200	1,934,745.20	
	ASX LTD	18,039	72.800	1,313,239.20	
	AURIZON HOLDINGS LTD	189,476	3.690	699,166.44	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	263,088	24.500	6,445,656.00	
	BHP GROUP LIMITED	437,156	43.940	19,208,634.64	
	BLUESCOPE STEEL LTD	44,422	16.620	738,293.64	
	BRAMBLES LTD	131,089	11.520	1,510,145.28	
	COCHLEAR LTD	6,031	206.130	1,243,170.03	
	COLES GROUP LTD	121,102	16.940	2,051,467.88	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	147,890	105.820	15,649,719.80	
	COMPUTERSHARE LIMITED	49,434	27.090	1,339,167.06	
	CSL LIMITED	41,755	294.400	12,292,672.00	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,628	64.060	360,529.68	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	122,635	7.160	878,066.60	
	EVOLUTION MINING LTD	165,646	2.560	424,053.76	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	147,228	19.960	2,938,670.88	
	IDP EDUCATION LTD	18,972	30.210	573,144.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	226,273	4.900	1,108,737.70	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	40,089	29.550	1,184,629.95	
	LOTTERY CORP LTD/THE	209,986	4.500	944,937.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	32,284	179.320	5,789,166.88	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	259,908	2.830	735,539.64	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,992	83.170	1,246,884.64	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	281,621	30.660	8,634,499.86	
	NEWCREST MINING LIMITED	80,754	19.060	1,539,171.24	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	104,537	10.000	1,045,370.00	
	ORICA LTD	42,986	15.090	648,658.74	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,209	7.500	1,239,067.50	
	QANTAS AIRWAYS LTD	94,924	5.880	558,153.12	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	133,492	12.400	1,655,300.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	16,950	62.420	1,058,019.00	
	REA GROUP LTD	5,119	121.430	621,600.17	
	REECE LTD	21,732	15.000	325,980.00	
	RIO TINTO LTD	32,560	106.380	3,463,732.80	
	SANTOS LTD	287,795	7.380	2,123,927.10	
	SEEK LTD	32,310	21.560	696,603.60	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,646	31.900	1,328,507.40	
	SOUTH32 LTD	415,957	3.910	1,626,391.87	
	SUNCORP GROUP LTD	117,886	11.950	1,408,737.70	
	TELSTRA GROUP LTD	401,953	3.940	1,583,694.82	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	66,842	13.460	899,693.32	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	21,307	27.500	585,942.50	
	WESFARMERS LIMITED	100,187	47.570	4,765,895.59	
	WESTPAC BANKING CORP	306,334	23.620	7,235,609.08	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,250	58.800	779,100.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	164,794	37.890	6,244,044.66	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	107,197	34.660	3,715,448.02	
	XERO LTD	12,119	68.920	835,241.48	
オーストラリア・ドル　小計		5,838,409		135,873,791.17 (12,691,970,833)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	38,989	63.960	2,493,736.44	
	AIR CANADA	16,194	18.610	301,370.34	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	60,086	10.280	617,684.08	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	71,266	61.720	4,398,537.52	
	ALTAGAS LTD	25,050	22.390	560,869.50	
	ARC RESOURCES LTD	58,354	18.970	1,106,975.38	
	BANK OF MONTREAL	57,868	132.270	7,654,200.36	
	BANK OF NOVA SCOTIA	103,150	69.040	7,121,476.00	
	BARRICK GOLD CORP	152,711	20.910	3,193,187.01	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	23,001	10.140	233,230.14	
	BCE INC	7,744	63.370	490,737.28	
	BLACKBERRY LTD	47,593	6.340	301,739.62	

BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	121,392	59.870	7,267,739.04	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,362	41.250	468,682.50	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,273	93.310	305,403.63	
CAE INC	27,340	28.420	777,002.80	
CAMECO CORP	34,253	31.890	1,092,328.17	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	77,774	63.560	4,943,315.44	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	51,039	166.490	8,497,483.11	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	99,220	79.950	7,932,639.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	80,938	105.090	8,505,774.42	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,847	147.860	716,677.42	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	11,933	35.850	427,798.05	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	62.370	819,479.43	
CENOVUS ENERGY INC	119,286	27.130	3,236,229.18	
CGI INC	18,717	114.230	2,138,042.91	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,736	2,022.290	3,510,695.44	
DOLLARAMA INC	24,048	77.700	1,868,529.60	
EMERA INC	23,610	51.320	1,211,665.20	
EMPIRE CO LTD 'A'	14,053	34.780	488,763.34	
ENBRIDGE INC	175,169	53.970	9,453,870.93	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,992	747.660	1,489,338.72	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,237	29.510	1,482,493.87	
FIRSTSERVICE CORP	3,513	165.910	582,841.83	
FORTIS INC	42,008	53.430	2,244,487.44	
FRANCO-NEVADA CORP	16,418	185.680	3,048,494.24	
GEORGE WESTON LTD	6,349	157.420	999,459.58	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	16,092	37.020	595,725.84	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,239	38.390	623,415.21	
GREAT-WEST LIFECO INC	24,744	31.390	776,714.16	
HYDRO ONE LTD	29,833	35.510	1,059,369.83	
IA FINANCIAL CORP INC	9,189	72.970	670,521.33	
IGM FINANCIAL INC	7,514	38.880	292,144.32	
IMPERIAL OIL LTD	20,105	75.580	1,519,535.90	
INTACT FINANCIAL CORP	15,257	194.260	2,963,824.82	
IVANHOE MINES LTD-CL A	52,711	10.400	548,194.40	
KEYERA CORP	19,209	29.380	564,360.42	
KINROSS GOLD CORP	108,888	5.480	596,706.24	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,481	20.150	231,342.15	
LOBLAW COS LTD	14,334	110.940	1,590,213.96	

	LUNDIN MINING CORP	55,871	7.680	429,089.28	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	24,202	82.960	2,007,797.92	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	165,604	23.570	3,903,286.28	
	METRO INC	20,830	76.670	1,597,036.10	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,086	97.390	2,832,685.54	
	NORTHLAND POWER INC	20,031	37.000	741,147.00	
	NUTRIEN LTD	47,410	104.110	4,935,855.10	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,570	40.190	223,858.30	
	ONEX CORPORATION	6,513	69.510	452,718.63	
	OPEN TEXT CORP	23,707	38.790	919,594.53	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,420	19.860	365,821.20	
	PARKLAND CORP	13,667	25.820	352,881.94	
	PEMBINA PIPELINE CORP	47,625	47.070	2,241,708.75	
	POWER CORP OF CANADA	48,475	33.080	1,603,553.00	
	QUEBECOR INC -CL B	14,135	27.150	383,765.25	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	25,382	89.380	2,268,643.16	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,594	73.420	704,391.48	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	31,144	59.710	1,859,608.24	
	ROYAL BANK OF CANADA	122,206	132.700	16,216,736.20	
	SAPUTO INC	21,733	34.500	749,788.50	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	41,595	36.450	1,516,137.75	
	SHOPIFY INC - CLASS A	98,242	49.020	4,815,822.84	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,770	61.820	3,138,601.40	
	SUNCOR ENERGY INC	123,450	47.660	5,883,627.00	
	TC ENERGY CORP	84,701	64.000	5,420,864.00	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,949	43.970	1,800,527.53	
	TFI INTERNATIONAL INC	7,322	140.170	1,026,324.74	
	THOMSON REUTERS CORP	14,926	151.950	2,268,005.70	
	TMX GROUP LTD	5,042	135.650	683,947.30	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,230	99.980	722,855.40	
	TORONTO-DOMINION BANK	156,605	89.420	14,003,619.10	
	TOURMALINE OIL CORP	27,276	79.730	2,174,715.48	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,212	109.070	568,472.84	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	38,622	49.550	1,913,720.10	
	WSP GLOBAL INC	10,729	159.850	1,715,030.65	
カナダ・ドル　小計		3,505,124		206,457,285.77 (21,640,852,694)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	228,600	3.620	827,532.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	38,000	8.170	310,460.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,300	35.540	5,519,362.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	534,100	0.865	461,996.50	
	KEPPEL CORP LTD	128,300	7.410	950,703.00	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	290,600	12.550	3,647,030.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	119,900	5.480	657,052.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	73,900	9.390	693,921.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	137,300	3.470	476,431.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	721,800	2.680	1,934,424.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	101,300	30.250	3,064,325.00	
	UOL Group Limited	40,000	6.610	264,400.00	
	VENTURE CORP LTD	24,200	17.570	425,194.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	162,700	4.120	670,324.00	
シンガポール・ドル　小計		2,756,000		19,903,154.50 (2,031,514,980)	
スイス・フラン	ABB LTD	141,205	29.280	4,134,482.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,829	33.170	458,707.93	
	ALCON INC	43,021	62.200	2,675,906.20	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	2,818	82.750	233,189.50	
	BALOISE HOLDING AG	3,948	138.600	547,192.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	310	1,927.000	597,370.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	91	9,980.000	908,180.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	9	98,800.000	889,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	44,881	116.250	5,217,416.25	
	CLARIANT AG	18,737	16.080	301,290.96	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	229,787	4.056	932,016.07	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	598	674.500	403,351.00	
	GEBERIT AG-REG	3,085	465.100	1,434,833.50	
	GIVAUDAN-REG	794	3,205.000	2,544,770.00	
	HOLCIM LTD	47,697	48.080	2,293,271.76	
	JULIUS BAER GROUP LTD	19,040	52.560	1,000,742.40	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,713	225.900	1,064,666.70	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,772	55.800	824,277.60	
	LONZA GROUP AG	6,397	495.200	3,167,794.40	
	NESTLE SA	242,084	110.880	26,842,273.92	
	NOVARTIS AG	186,027	81.510	15,163,060.77	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,937	968.400	1,875,790.80	
	ROCHE HOLDING AG	60,376	308.000	18,595,808.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,319	364.800	845,971.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,245	168.600	378,507.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,307	176.600	584,016.20	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	547	2,304.000	1,260,288.00	

	SIG GROUP AG	26,487	20.080	531,858.96	
	SIKA AG-BEARER	12,540	245.000	3,072,300.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,595	251.800	1,157,021.00	
	STRAUMANN HOLDING AG	9,527	108.800	1,036,537.60	
	SWATCH GROUP AG	2,347	247.300	580,413.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,711	502.600	1,362,548.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,894	81.200	559,792.80	
	SWISS RE AG	25,863	80.520	2,082,488.76	
	SWISSCOM AG	2,289	499.700	1,143,813.30	
	TEMENOS GROUP AG-REG	5,437	58.680	319,043.16	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,317	45.880	243,943.96	
	UBS GROUP AG	302,060	17.485	5,281,519.10	
	VAT GROUP AG	2,274	262.600	597,152.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,937	441.800	5,715,566.60	
スイス・フラン　小計		1,515,852		118,858,374.70 (17,484,066,918)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	24,849	296.400	7,365,243.60	
	ASSA ABLOY AB	86,514	239.800	20,746,057.20	
	ATLAS COPCO AB	134,785	116.800	15,742,888.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	229,726	129.460	29,740,327.96	
	BIOVITRUM	14,600	212.800	3,106,880.00	
	BOLIDEN AB	23,191	369.900	8,578,350.90	
	ELECTROLUX AB	19,178	141.900	2,721,358.20	
	EMBRACER GROUP AB	58,174	45.915	2,671,059.21	
	EPIROC AB-A	56,189	189.100	10,625,339.90	
	EPIROC AB-B	33,961	162.050	5,503,380.05	
	EQT AB	25,286	241.500	6,106,569.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,424	248.000	13,001,152.00	
	EVOLUTION AB	15,648	999.000	15,632,352.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	52,746	46.105	2,431,854.33	
	GETINGE AB-B SHS	19,295	235.800	4,549,761.00	
	HENNES & MAURITZ AB	62,665	117.700	7,375,670.50	
	HEXAGON AB-B SHS	167,329	121.100	20,263,541.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,158	419.100	3,419,017.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,026	80.060	2,804,181.56	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,223	266.000	1,389,318.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	20,098	264.900	5,323,960.20	
	INDUTRADE AB	23,591	217.500	5,131,042.50	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	12,363	209.700	2,592,521.10	
	INVESTOR AB	154,796	191.480	29,640,338.08	
	INVESTOR AB-A SHS	44,788	199.000	8,912,812.00	
	KINNEVIK AB - B	20,904	157.150	3,285,063.60	
	LIFCO AB-B SHS	19,666	182.900	3,596,911.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,538	471.100	3,080,051.80	

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	130,079	98.860	12,859,609.94	
	NORDEA BANK ABP	293,709	108.340	31,820,433.06	
	SAGAX AB-B	16,053	226.900	3,642,425.70	
	SANDVIK AB	91,504	190.900	17,468,113.60	
	SECURITAS AB	26,073	90.260	2,353,348.98	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	140,463	118.150	16,595,703.45	
	SKANSKA AB-B SHS	29,638	181.100	5,367,441.80	
	SKF AB	32,827	173.250	5,687,277.75	
	SVENSKA CELLULOSA AB	52,297	138.650	7,250,979.05	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	126,452	106.150	13,422,879.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	77,829	166.000	12,919,614.00	
	SWEDISH MATCH AB	130,893	115.100	15,065,784.30	
	TELE2 AB	50,744	93.260	4,732,385.44	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	250,946	64.920	16,291,414.32	
	TELIA CO AB	237,197	29.220	6,930,896.34	
	VOLVO AB	126,816	192.100	24,361,353.60	
	VOLVO AB-A SHS	20,090	202.000	4,058,180.00	
	VOLVO CAR AB-B	51,282	50.670	2,598,458.94	
スウェーデン・クローナ　小計		3,312,603		448,763,303.86 (5,914,700,345)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	434	15,020.000	6,518,680.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	280	14,700.000	4,116,000.00	
	CARLSBERG AS-B	8,304	916.800	7,613,107.20	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,112	436.800	3,980,121.60	
	COLOPLAST-B	10,157	888.000	9,019,416.00	
	DANSKE BANK A/S	59,027	122.400	7,224,904.80	
	DEMANT A/S	7,680	203.300	1,561,344.00	
	DSV A/S	16,413	1,088.000	17,857,344.00	
	GENMAB A/S	5,637	3,131.000	17,649,447.00	
	GN STORE NORD A/S	11,036	173.300	1,912,538.80	
	NOVO-NORDISK A/S	142,295	812.000	115,543,540.00	
	NOVOZYMES A/S	17,535	402.100	7,050,823.50	
	ORSTED A/S	16,235	637.700	10,353,059.50	
	PANDORA A/S	7,646	507.600	3,881,109.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	740	1,669.500	1,235,430.00	
	TRYGVESTA AS	31,237	162.700	5,082,259.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	86,745	173.280	15,031,173.60	
デンマーク・クローネ　小計		430,513		235,630,299.50 (4,587,721,931)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,670	7.915	939,273.05	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	49,506	20.500	1,014,873.00	
	MERCURY NZ LTD	60,551	5.660	342,718.66	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,809	4.700	520,802.30	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	171,760	5.120	879,411.20	

ニュージーランド・ドル　小計		511,296		3,697,078.21 (318,725,112)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	24,890	79.900	1,988,711.00	
	AKER BP ASA	27,198	336.800	9,160,286.40	
	DNB BANK ASA	80,948	184.050	14,898,479.40	
	EQUINOR ASA	84,044	342.550	28,789,272.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,809	189.800	3,380,148.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,766	378.800	2,941,760.80	
	MOWI ASA	35,528	150.350	5,341,634.80	
	NORSK HYDRO ASA	114,366	71.220	8,145,146.52	
	ORKLA ASA	65,172	68.260	4,448,640.72	
	SALMAR ASA	5,046	341.800	1,724,722.80	
	TELENOR ASA	63,651	98.180	6,249,255.18	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,288	457.800	6,541,046.40	
ノルウェー・クローネ　小計		540,706		93,609,104.42 (1,286,189,095)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	36,032	11.680	420,853.76	
	ACCIONA SA	2,096	180.400	378,118.40	
	ACCOR	14,778	24.470	361,617.66	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,143	26.450	532,782.35	
	ADIDAS AG	14,856	129.200	1,919,395.20	
	ADP	2,927	143.850	421,048.95	
	ADYEN NV	1,862	1,521.600	2,833,219.20	
	AEGON NV	152,398	4.701	716,422.99	
	AENA SME SA	6,862	120.500	826,871.00	
	AGEAS	13,779	37.810	520,983.99	
	AIR LIQUIDE	45,031	136.640	6,153,035.84	
	AIRBUS SE	50,803	114.640	5,824,055.92	
	AKZO NOBEL NV	15,555	70.180	1,091,649.90	
	ALLIANZ SE	35,107	203.950	7,160,072.65	
	ALSTOM RGPT	27,403	24.500	671,373.50	
	AMADEUS IT GROUP SA	38,839	49.690	1,929,909.91	
	AMPLIFON SPA	10,624	27.630	293,541.12	
	AMUNDI SA	5,235	54.100	283,213.50	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	74,717	53.580	4,003,336.86	
	ARCELORMITTAL	44,604	25.075	1,118,445.30	
	ARGENX SE	4,749	356.100	1,691,118.90	
	ARKEMA	5,000	86.880	434,400.00	
	AROUNDTOWN SA	87,476	2.488	217,640.28	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,019	252.000	1,012,788.00	
	ASML HOLDING NV	34,949	571.400	19,969,858.60	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	94,900	17.260	1,637,974.00	
	ATLANTIA SPA	43,749	22.960	1,004,477.04	
	AXA SA	160,335	27.080	4,341,871.80	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	568,911	5.448	3,099,427.12	
BANCO SANTANDER SA	1,455,180	2.606	3,792,199.08	
BASF SE	78,831	49.625	3,911,988.37	
BAYER AG	84,543	53.790	4,547,567.97	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,402	84.150	2,390,028.30	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,077	80.200	407,175.40	
BECHTLE AG	7,010	36.670	257,056.70	
BEIERSDORF AG	8,676	102.350	887,988.60	
BIOMERIEUX	3,583	97.440	349,127.52	
BNP PARIBAS	95,236	53.310	5,077,031.16	
BOLLORE SE	76,574	5.070	388,230.18	
BOUYGUES	20,225	28.890	584,300.25	
BRENNTAG SE	13,233	65.700	869,408.10	
BUREAU VERITAS SA	25,654	26.000	667,004.00	
CAIXABANK	377,156	3.397	1,281,198.93	
CAPGEMINI SA	14,079	178.050	2,506,765.95	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,427	132.650	454,591.55	
CARREFOUR SA	51,528	16.250	837,330.00	
CELLNEX TELECOM SAU	46,851	33.330	1,561,543.83	
CIE DE SAINT-GOBAIN	42,725	44.315	1,893,358.37	
CNH INDUSTRIAL NV	88,095	14.880	1,310,853.60	
COMMERZBANK AG	90,505	8.068	730,194.34	
CONTINENTAL AG	9,367	56.760	531,670.92	
COVESTRO AG	16,315	36.290	592,071.35	
CREDIT AGRICOLE SA	102,911	9.705	998,751.25	
CRH PLC	65,498	38.020	2,490,233.96	
D'IETEREN GROUP	2,139	174.300	372,827.70	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	38,823	30.115	1,169,154.64	
DANONE	55,234	49.885	2,755,348.09	
DASSAULT AVIATION SA	2,155	146.300	315,276.50	
DASSAULT SYSTEMES SA	57,329	36.245	2,077,889.60	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	44,926	10.030	450,607.78	
DELIVERY HERO SE	14,065	44.190	621,532.35	
DEUTSCHE BANK AG	176,948	10.212	1,806,992.97	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,402	170.400	2,794,900.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	52,012	7.336	381,560.03	
DEUTSCHE POST AG	86,075	38.685	3,329,811.37	
DEUTSCHE TELEKOM AG	280,358	19.332	5,419,880.85	
DIASORIN ITALIA SPA	2,144	132.100	283,222.40	
E.ON SE	193,350	9.116	1,762,578.60	
EDENRED	21,652	51.020	1,104,685.04	
EDF	48,488	11.930	578,461.84	
EDP RENOVAVEIS SA	24,544	22.300	547,331.20	
EIFFAGE	7,299	93.200	680,266.80	
ELIA GROUP SA/NV	2,859	136.200	389,395.80	

ELISA OYJ	12,593	49.400	622,094.20	
ENAGAS SA	21,921	17.305	379,342.90	
ENDESA SA	27,043	18.660	504,622.38	
ENEL SPA	698,368	5.157	3,601,483.77	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	239,691	4.432	1,062,310.51	
ENGIE	157,120	14.380	2,259,385.60	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	215,928	14.188	3,063,586.46	
ERSTE GROUP BANK AG	29,373	29.270	859,747.71	
ESSILORLUXOTTICA	24,798	173.350	4,298,733.30	
EURAZEO	3,713	60.350	224,079.55	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,579	66.260	767,224.54	
EURONEXT NV	7,513	70.120	526,811.56	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,765	19.460	345,706.90	
EXOR NV	9,487	73.920	701,279.04	
FERRARI NV	10,868	208.200	2,262,717.60	
FERROVIAL S.A.	42,566	24.890	1,059,467.74	
FERROVIAL SA-RTS	43,511	0.450	19,579.95	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	188,030	14.410	2,709,512.30	
FINECOBANK SPA	51,851	15.000	777,765.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	14,324	133.550	1,912,970.20	
FORTUM OYJ	38,272	15.060	576,376.32	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	17,618	29.840	525,721.12	
FRESENIUS SE & CO KGAA	35,873	24.410	875,659.93	
GALP ENERGIA SGPS SA	43,214	11.255	486,373.57	
GEA GROUP AG	13,069	39.840	520,668.96	
GETLINK SE - REGR	41,180	15.790	650,232.20	
GRIFOLS SA	25,610	9.730	249,185.30	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,923	78.540	700,812.42	
HANNOVER RUECK SE	5,163	177.750	917,723.25	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,061	51.700	623,553.70	
HEINEKEN HOLDING NV	8,628	71.700	618,627.60	
HEINEKEN NV	22,210	87.900	1,952,259.00	
HELLOFRESH SE	13,948	23.950	334,054.60	
HENKEL AG & CO KGAA	9,719	62.850	610,839.15	
HENKEL KGAA-VORZUG	14,723	66.980	986,146.54	
HERMES INTERNATIONAL	2,724	1,470.000	4,004,280.00	
IBERDROLA SA	510,810	10.590	5,409,477.90	
IMCD NV	4,905	137.150	672,720.75	
INDITEX SA	93,615	24.120	2,257,993.80	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	112,233	32.095	3,602,118.13	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	31,132	9.514	296,189.84	
ING GROEP NV-CVA	334,820	11.438	3,829,671.16	
INTESA SANPAOLO	1,412,267	2.216	3,129,583.67	

IPSEN	3,225	104.000	335,400.00	
JDE PEET'S BV	8,670	28.220	244,667.40	
JERONIMO MARTINS	24,095	20.440	492,501.80	
JUST EAT TAKEAWAY	15,872	21.360	339,025.92	
KBC GROEP NV	21,337	52.460	1,119,339.02	
KERING	6,431	551.100	3,544,124.10	
KERRY GROUP PLC-A	13,653	92.100	1,257,441.30	
KESKO OYJ-B SHS	23,050	21.030	484,741.50	
KINGSPAN GROUP PLC	13,232	58.240	770,631.68	
KION GROUP AG	6,083	27.090	164,788.47	
KNORR-BREMSE AG	6,276	54.180	340,033.68	
KONE OYJ	29,208	47.360	1,383,290.88	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,338	27.595	2,465,282.11	
KONINKLIJKE DSM NV	15,028	127.500	1,916,070.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	75,545	13.726	1,036,930.67	
L'OREAL SA	20,721	348.100	7,212,980.10	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,859	35.790	317,063.61	
LEG IMMOBILIEN SE	6,257	63.340	396,318.38	
LEGRAND SA	23,061	79.440	1,831,965.84	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,873	698.200	16,668,128.60	
MEDIOBANCA SPA	51,888	10.175	527,960.40	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	68,875	62.220	4,285,402.50	
MERCK KGAA	11,100	176.200	1,955,820.00	
MICHELIN (C.G.D.E.)	58,126	26.270	1,526,970.02	
MONCLER SPA	17,575	49.830	875,762.25	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,584	193.300	886,087.20	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	12,018	293.300	3,524,879.40	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,586	26.740	336,549.64	
NEMETSCHEK SE	4,909	47.000	230,723.00	
NESTE OYJ	36,124	45.240	1,634,249.76	
NEXI SPA	45,011	8.636	388,714.99	
NN GROUP NV	23,785	42.380	1,008,008.30	
NOKIA OYJ	464,660	4.696	2,182,043.36	
OCI NV	9,191	35.520	326,464.32	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	5,838	88.300	515,495.40	
OMV AG	12,496	48.380	604,556.48	
ORANGE S.A.	175,119	9.806	1,717,216.91	
ORION OYJ-CLASS B	9,128	47.370	432,393.36	
PERNOD-RICARD	18,008	185.700	3,344,085.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	12,991	58.920	765,429.72	
POSTE ITALIANE SPA	47,654	9.604	457,669.01	
PROSUS	71,342	59.030	4,211,318.26	

PROXIMUS	14,119	10.690	150,932.11	
PRYSMIAN SPA	21,942	32.620	715,748.04	
PUBLICIS GROUPE	19,502	62.200	1,213,024.40	
PUMA AG	9,063	51.440	466,200.72	
QIAGEN NV	19,680	46.230	909,806.40	
RANDSTAD NV	10,134	55.060	557,978.04	
RATIONAL AG	436	590.000	257,240.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	9,014	39.490	355,962.86	
RED ELECTRICA DE ESPANA	34,898	17.290	603,386.42	
REMY COINTREAU	1,961	162.300	318,270.30	
RENAULT SA	16,587	33.045	548,117.41	
REPSOL SA	123,211	13.795	1,699,695.74	
RHEINMETALL AG	3,715	180.550	670,743.25	
ROYAL KPN NV	293,170	2.802	821,462.34	
RWE AG	55,470	41.210	2,285,918.70	
SAFRAN SA	29,412	114.740	3,374,732.88	
SAMPO OYJ	41,298	47.770	1,972,805.46	
SANOFI	97,935	86.040	8,426,327.40	
SAP SE	89,839	105.160	9,447,469.24	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,086	377.300	787,047.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,365	331.800	784,707.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,641	142.280	6,636,081.48	
SCOUT24 SE	6,970	54.760	381,677.20	
SEB SA	2,177	74.000	161,098.00	
SIEMENS AG	65,779	132.500	8,715,717.50	
SIEMENS ENERGY AG	37,721	14.675	553,555.67	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	20,594	18.020	371,103.88	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,267	52.140	1,265,281.38	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	21,051	35.110	739,100.61	
SNAM SPA	175,493	4.769	836,926.11	
SOCIETE GENERALE	67,734	24.030	1,627,648.02	
SODEXO	7,618	88.960	677,697.28	
SOFINA	1,249	225.800	282,024.20	
SOLVAY SA	6,336	98.860	626,376.96	
STMICROELECTRONICS NV	58,687	36.995	2,171,125.56	
STORA ENSO OYJ	46,892	14.140	663,052.88	
SYMRISE AG	11,449	111.700	1,278,853.30	
TELECOM ITALIA SPA	881,059	0.223	196,476.15	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,641	2.377	234,469.65	
TELEFONICA SA	454,562	3.541	1,609,604.04	
TELEPERFORMANCE	5,038	224.500	1,131,031.00	
TENARIS SA	40,584	16.415	666,186.36	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	121,305	7.316	887,467.38	
THALES SA	9,166	117.000	1,072,422.00	
TOTALENERGIES SE	213,021	57.400	12,227,405.40	

	UBISOFT ENTERTAINMENT	8,103	25.920	210,029.76	
	UCB SA	10,855	74.260	806,092.30	
	UMICORE	17,978	34.120	613,409.36	
	UNICREDIT SPA	177,450	13.102	2,324,949.90	
	UNIPER SE	8,015	5.460	43,761.90	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,633	19.590	169,120.47	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	62,379	20.720	1,292,492.88	
	UPM-KYMMENE OYJ	45,823	34.420	1,577,227.66	
	VALEO SA	17,663	18.270	322,703.01	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,233	24.820	1,420,523.06	
	VINCI SA	46,086	95.440	4,398,447.84	
	VIVENDI SA	61,652	8.450	520,959.40	
	VOESTALPINE AG	9,316	25.760	239,980.16	
	VOLKSWAGEN AG	2,597	188.600	489,794.20	
	VOLKSWAGEN AG	15,936	141.860	2,260,680.96	
	VONOVIA SE	61,771	24.340	1,503,506.14	
	WARTSILA OYJ	40,299	8.110	326,824.89	
	WENDEL	2,364	87.700	207,322.80	
	WOLTERS KLUWER NV	22,548	102.250	2,305,533.00	
	WORLDLINE SA	20,574	44.200	909,370.80	
	ZALANDO SE	18,902	30.000	567,060.00	
ユーロ　小計		15,838,851		376,765,861.85 (54,559,464,454)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,035,675	76.100	78,814,867.50	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	320,539	24.000	7,692,936.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,700	22.400	3,308,480.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,800	16.400	2,833,920.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	173,409	46.900	8,132,882.10	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	232,409	43.550	10,121,411.95	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	56,500	38.750	2,189,375.00	
	CLP HOLDINGS LTD	143,643	57.200	8,216,379.60	
	ESR GROUP LIMITED	174,800	17.080	2,985,584.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	188,810	45.900	8,666,379.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	180,157	12.860	2,316,819.02	
	HANG SENG BANK LTD	66,612	122.100	8,133,325.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	130,641	23.100	3,017,807.10	
	HONG KONG & CHINA GAS	976,437	6.590	6,434,719.83	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	103,711	301.000	31,217,011.00	
	MTR CORP	147,255	37.450	5,514,699.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	137,917	19.220	2,650,764.74	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	122,087	39.350	4,804,123.45	
	SANDS CHINA LTD	212,580	19.620	4,170,819.60	
	SINO LAND CO	312,000	9.980	3,113,760.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	15.000	1,800,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	125,523	91.250	11,453,973.75	
	SWIRE PACIFIC LTD	43,366	60.750	2,634,484.50	
	SWIRE PROPERTIES LTD	109,400	17.560	1,921,064.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	118,000	92.600	10,926,800.00	
	WH GROUP LTD	709,000	4.330	3,069,970.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	145,733	36.650	5,341,114.45	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	156,000	13.700	2,137,200.00	
香港・ドル　小計		6,562,704		243,620,671.54 (4,372,991,054)	
合計		95,423,636		565,772,218,149 (565,772,218,149)	

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,309.00	1,998,612.53	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,677.00	853,664.00	
		AMERICAN TOWER REIT INC	39,238.00	8,472,661.34	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	37,479.00	746,206.89	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,986.00	2,027,911.34	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,738.00	902,996.82	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,612.00	988,829.84	
		CROWN CASTLE INC	37,229.00	5,057,187.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,461.00	2,701,962.06	
		EQUINIX INC	7,820.00	5,062,746.20	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,151.00	988,299.73	
		EQUITY RESIDENTIAL	30,685.00	1,931,007.05	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,581.00	1,180,883.79	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,512.00	1,820,507.68	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,889.00	1,097,514.46	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	32,937.00	639,965.91	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,370.00	1,143,020.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	61,743.00	1,131,749.19	

	INVITATION HOMES INC	52,220.00	1,632,919.40	
	IRON MOUNTAIN INC	24,983.00	1,306,610.90	
	KIMCO REALTY CORP	53,029.00	1,174,592.35	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	51,268.00	634,185.16	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,829.00	1,559,960.59	
	PROLOGIS INC	79,237.00	9,077,390.72	
	PUBLIC STORAGE	13,567.00	3,982,050.17	
	REALTY INCOME CORP	51,769.00	3,349,454.30	
	REGENCY CENTERS CORP	13,173.00	864,017.07	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,262.00	2,692,278.16	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,199.00	3,324,662.10	
	SUN COMMUNITIES INC	10,436.00	1,492,348.00	
	UDR INC	27,271.00	1,096,294.20	
	VENTAS INC	34,270.00	1,510,278.90	
	VICI PROPERTIES INC	82,623.00	2,668,722.90	
	VORNADO REALTY TRUST	14,176.00	339,940.48	
	WELLTOWER INC	38,977.00	2,641,861.06	
	WP CAREY INC	16,543.00	1,318,807.96	
アメリカ・ドル　小計		1,056,249.00	79,412,101.11 (11,146,282,512)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	74,431.00	302,934.17	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,584.00	372,280.83	
	SEGRO PLC	102,056.00	852,779.93	
イギリス・ポンド　小計		236,071.00	1,527,994.93 (254,548,675)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	106,417.00	802,384.18	
	GOODMAN GROUP	148,031.00	2,717,849.16	
	GPT GROUP	187,753.00	803,582.84	
	MIRVAC GROUP	373,410.00	791,629.20	
	SCENTRE GROUP	482,975.00	1,381,308.50	
	STOCKLAND	228,057.00	836,969.19	
	VICINITY CENTRES	372,343.00	713,036.84	
オーストラリア・ドル　小計		1,898,986.00	8,046,759.91 (751,647,843)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,443.00	317,741.67	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,209.00	277,785.27	
カナダ・ドル　小計		20,652.00	595,526.94 (62,423,134)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	287,800.00	791,450.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	455,590.00	924,847.70	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,600.00	451,440.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	199,300.00	348,775.00	
	シンガポール・ドル　小計		1,216,290.00	2,516,512.70 (256,860,451)	
	ユーロ	COVIVIO	3,811.00	218,179.75	
		GECINA SA	3,754.00	359,257.80	
		KLEPIERRE	18,388.00	407,845.84	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,109.00	520,613.50	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,362.00	331,548.84	
	ユーロ　小計		48,424.00	1,837,445.73 (266,080,516)	
	香港・ドル	LINK REIT	183,271.00	10,098,232.10	
	香港・ドル　小計		183,271.00	10,098,232.10 (181,263,266)	
投資証券　合計			4,659,943	12,919,106,397 (12,919,106,397)	
合計				12,919,106,397 (12,919,106,397)	

（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	599銘柄	68.86	－	73.50
	投資証券	36銘柄	－	1.85	
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.29	－	4.50
	投資証券	3銘柄	－	0.04	
イスラエル・シュケル	株式	10銘柄	0.15	－	0.16
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.11	－	2.32
	投資証券	7銘柄	－	0.12	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.60	－	3.75
	投資証券	2銘柄	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.34	－	0.40
	投資証券	4銘柄	－	0.04	
スイス・フラン	株式	41銘柄	2.91	－	3.02
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	0.98	－	1.02
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.76	－	0.79
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.05	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.21	－	0.22
ユーロ	株式	224銘柄	9.07	－	9.47
	投資証券	5銘柄	－	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.73	－	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11月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	225,666,510
金銭信託	381,661
コール・ローン	135,527,663
国債証券	55,727,800,029
派生商品評価勘定	198,287
未収利息	297,051,718
前払費用	22,803,287
流動資産合計	56,409,429,155
資産合計	56,409,429,155
負債の部	
流動負債	
未払金	42,547,669
未払解約金	81,359,225
その他未払費用	128
流動負債合計	123,907,022
負債合計	123,907,022
純資産の部	
元本等	
元本	36,786,269,889
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	19,499,252,244
元本等合計	56,285,522,133
純資産合計	56,285,522,133
負債純資産合計	56,409,429,155

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年11月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,507,939,274円
	同期中追加設定元本額	12,642,312,025円
	同期中一部解約元本額	6,363,981,410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）	3,204,719,220円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,416,454,023円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,062,600,685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）	864,520,535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）	2,743,596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）	6,743,242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）	5,156,272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	14,361,888,951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）	4,034,335,050円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	3,289,166,819円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	194,490,072円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,733,127,766円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	222,180,351円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	437,042,241円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	70,272,806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）	170,801,283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）	18,635,379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）	41,316,219円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	140,408,215円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	93,510,516円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	206,076,638円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	191,924,583円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	10,493,180円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	7,662,247円
	計	36,786,269,889円
２．	受益権の総数	36,786,269,889口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,672,767,821
合計	△3,672,767,821

（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（2022年5月21日から2022年11月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	31,696,388	－	31,894,675	198,287
アメリカ・ドル	31,696,388	－	31,894,675	198,287
合計	31,696,388	－	31,894,675	198,287

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額	1.5301円
（1万口当たり純資産額）	(15,301円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	131,014.80	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	127,434.00	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	187,503.20	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	105,207.00	

		US TREASURY N/B	460,000.00	368,303.60	
		US TREASURY N/B	170,000.00	182,663.30	
		US TREASURY N/B	620,000.00	505,275.20	
		US TREASURY N/B	430,000.00	395,647.30	
		US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,628,543.00	
		US TREASURY N/B	450,000.00	421,258.50	
		US TREASURY N/B	4,550,000.00	4,440,299.50	
		US TREASURY N/B	8,430,000.00	8,163,864.90	
		US TREASURY N/B	5,020,000.00	4,830,143.60	
		US TREASURY N/B	560,000.00	470,988.00	
		US TREASURY N/B	6,230,000.00	5,963,480.60	
		US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,026,467.00	
		US TREASURY N/B	4,680,000.00	4,432,287.60	
		US TREASURY N/B	390,000.00	331,956.30	
		US TREASURY N/B	490,000.00	449,134.00	
		US TREASURY N/B	450,000.00	395,383.50	
		US TREASURY N/B	510,000.00	419,112.90	
		US TREASURY N/B	670,000.00	502,419.60	
		US TREASURY N/B	330,000.00	270,623.10	
		US TREASURY N/B	450,000.00	360,351.00	
		US TREASURY N/B	4,220,000.00	3,968,277.00	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,546,996.00	
		US TREASURY N/B	260,000.00	212,986.80	
		US TREASURY N/B	3,570,000.00	3,288,148.50	
		US TREASURY N/B	540,000.00	402,024.60	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	2,962,136.10	
		US TREASURY N/B	550,000.00	408,908.50	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,305,265.60	
		US TREASURY N/B	680,000.00	479,400.00	
		US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,429,951.60	
		US TREASURY N/B	290,000.00	231,852.10	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,432,500.00	
		US TREASURY N/B	3,310,000.00	3,073,368.10	
		US TREASURY N/B	600,000.00	490,542.00	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,960,837.90	
		US TREASURY N/B	3,910,000.00	3,640,249.10	
		US TREASURY N/B	470,000.00	384,554.00	
		US TREASURY N/B	2,090,000.00	2,004,017.40	
		US TREASURY N/B	3,970,000.00	3,667,406.60	
		US TREASURY N/B	670,000.00	522,600.00	
		US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,904,091.70	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,393,118.00	
		US TREASURY N/B	160,000.00	168,755.20	
		US TREASURY N/B	670,000.00	522,834.50	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,407,280.40	
		US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,557,316.80	
		US TREASURY N/B	150,000.00	160,264.50	
		US TREASURY N/B	770,000.00	631,007.30	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,375,423.70	

		US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,378,780.20	
		US TREASURY N/B	820,000.00	689,472.40	
		US TREASURY N/B	160,000.00	151,049.60	
		US TREASURY N/B	240,000.00	248,061.60	
		US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,769,523.20	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,127,904.80	
		US TREASURY N/B	900,000.00	740,565.00	
		US TREASURY N/B	260,000.00	276,806.40	
		US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,689,765.00	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,182,600.40	
		US TREASURY N/B	920,000.00	813,335.20	
		US TREASURY N/B	270,000.00	282,622.50	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,286,744.00	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	3,978,317.00	
		US TREASURY N/B	980,000.00	809,333.00	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,424,271.20	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,410,887.50	
		US TREASURY N/B	290,000.00	312,837.50	
		US TREASURY N/B	950,000.00	766,564.50	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,875,679.40	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	2,947,630.00	
		US TREASURY N/B	900,000.00	635,130.00	
		US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,759,310.80	
		US TREASURY N/B	690,000.00	603,315.30	
		US TREASURY N/B	270,000.00	263,290.50	
		US TREASURY N/B	840,000.00	609,781.20	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,943,113.80	
		US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,031,754.90	
		US TREASURY N/B	260,000.00	266,021.60	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	695,415.00	
		US TREASURY N/B	130,000.00	146,051.10	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,787,879.70	
		US TREASURY N/B	820,000.00	511,122.40	
		US TREASURY N/B	280,000.00	305,046.00	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	1,892,194.80	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	1,702,166.40	
		US TREASURY N/B	1,390,000.00	773,618.40	
		US TREASURY N/B	1,010,000.00	623,866.90	
		US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,437,597.00	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	1,789,218.20	
		US TREASURY N/B	1,370,000.00	817,492.70	
		US TREASURY N/B	1,120,000.00	722,612.80	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,580,648.00	
		US TREASURY N/B	1,120,000.00	946,433.60	
		US TREASURY N/B	2,180,000.00	1,780,362.40	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	977,165.10	
		US TREASURY N/B	1,370,000.00	964,877.30	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,071,719.60	
		US TREASURY N/B	4,350,000.00	4,103,442.00	

		US TREASURY N/B	1,150,000.00	998,568.00	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	1,804,769.00	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,104,767.10	
		US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,204,240.40	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,470,551.00	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	884,351.00	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	1,907,448.00	
		US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,000,160.00	
		US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,046,645.60	
		US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,959,571.00	
		US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,198,976.00	
		US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,681,651.10	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	1,859,340.00	
		US TREASURY N/B	1,430,000.00	910,495.30	
		US TREASURY N/B	280,000.00	241,718.40	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	915,293.70	
		US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,673,618.60	
		US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,319,253.60	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	1,834,984.80	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	903,954.60	
		US TREASURY N/B	290,000.00	250,101.80	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	796,236.00	
		US TREASURY N/B	270,000.00	227,232.00	
		US TREASURY N/B	1,230,000.00	994,762.50	
		US TREASURY N/B	2,090,000.00	1,932,581.20	
		US TREASURY N/B	920,000.00	806,435.20	
		US TREASURY N/B	1,960,000.00	1,789,401.60	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,074,518.40	
		US TREASURY N/B	700,000.00	625,401.00	
		US TREASURY N/B	320,000.00	256,998.40	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,566,240.00	
		US TREASURY NOTES	150,000.00	172,129.50	
		WI TREASURY SEC.	270,000.00	281,853.00	
		WI TREASURY SEC.	1,230,000.00	662,035.20	
		WI TREASURY SEC.	1,630,000.00	1,291,823.90	
		WI TREASURY SEC.	260,000.00	269,911.20	
		WI TREASURY SEC.	260,000.00	247,059.80	
	アメリカ・ドル　小計		226,470,000.00 (31,787,329,200)	200,709,951.30 (28,171,648,764)	
	イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	343,116.00	
		UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	357,516.80	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	354,320.70	
		UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	267,572.70	
		UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	396,760.00	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	278,015.40	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	291,156.00	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	263,325.00	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	310,968.90	

	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	229,207.60	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	349,047.60	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	261,216.30	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	368,369.10	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	311,943.00	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	246,429.00	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	416,489.50	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	237,504.80	
	UNITED KINGDOM GILT	250,000.00	169,312.50	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	320,172.60	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	163,714.00	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	299,346.30	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	291,689.10	
	UNITED KINGDOM GILT	220,000.00	251,198.20	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	399,826.80	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	182,077.20	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	307,858.20	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	256,407.00	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	328,597.50	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	336,870.80	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	367,329.20	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	419,206.30	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	336,370.30	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	248,899.00	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	149,130.80	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	236,553.20	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	263,571.30	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	101,520.00	
	UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	298,103.40	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	626,743.00	
	UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	440,724.00	
	UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	163,951.20	
	UNITED KINGDOM GILT	460,000.00	411,746.00	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	225,888.70	
	UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	196,414.40	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	294,980.00	
	UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	186,444.00	
	UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	467,340.00	
	UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	123,496.20	
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	490,770.00	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	109,264.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	295,331.40	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	322,229.50	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	422,483.10	
	UNITED KINGDOM GILT	100,000.00	102,720.00	
イギリス・ポンド　小計		**17,720,000.00** **(2,951,974,800)**	**15,891,237.60** **(2,647,321,272)**	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	360,000.00	344,700.00	

	ISRAEL FIXED BOND	310,000.00	310,186.00	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	453,706.00	
	ISRAEL FIXED BOND	680,000.00	657,050.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	323,393.50	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	366,757.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	431,200.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	518,739.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	528,750.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	293,743.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	366,658.50	
	ISRAEL FIXED BOND	230,000.00	212,934.00	
	ISRAEL FIXED BOND	250,000.00	237,125.00	
	ISRAEL FIXED BOND	160,000.00	136,312.00	
イスラエル・シュケル　小計		5,250,000.00 (212,143,050)	5,181,254.00 (209,365,148)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	375,823.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	308,456.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	473,695.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	392,239.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	188,651.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	411,049.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	246,320.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	191,280.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	273,600.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	369,580.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	233,996.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	260,000.00	250,731.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	334,204.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	457,493.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	232,568.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	423,840.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	479,569.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	345,219.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	538,553.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	357,282.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	233,783.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	513,472.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	441,191.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	414,001.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	339,030.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	476,352.00	
オーストラリア・ドル　小計		10,200,000.00 (952,782,000)	9,301,984.80 (868,898,400)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	728,503.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,217,460.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,360,661.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,015,990.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,407,392.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,607,392.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,456,160.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,348,884.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	3,829,981.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,161,600.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,574,260.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,003,010.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,600,180.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,644,725.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,490,396.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,492,980.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,474,810.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,064,617.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,192,256.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,766,832.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	984,990.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	3,041,348.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,951,630.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,382,290.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,976,160.00	
オフショア・人民元　小計			92,670,000.00 (1,820,724,558)	92,774,508.50 (1,822,777,878)	
カナダ・ドル		CANADA GOVERNMENT	140,000.00	124,853.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	217,501.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	201,124.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	131,808.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	224,981.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	221,623.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	149,270.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	184,449.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	153,715.70	
		CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	131,770.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	208,853.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	175,414.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	830,000.00	638,892.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	123,396.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	127,075.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	172,548.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	587,382.30	
		CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	141,498.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	521,173.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	580,000.00	473,413.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	331,353.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	389,791.10	
		CANADIAN GOVERNMENT	750,000.00	660,052.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	327,668.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	273,612.10	
		CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	406,980.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	279,968.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	630,000.00	550,286.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	301,405.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	310,000.00	297,894.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	236,812.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	310,000.00	299,001.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	445,267.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	94,684.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	321,255.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	323,363.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	117,548.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	260,000.00	246,204.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	280,000.00	275,035.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	80,692.00	
カナダ・ドル　小計		12,200,000.00 (1,278,804,000)	11,169,622.70 (1,170,799,851)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	133,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	116,823.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	138,110.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	167,875.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	136,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	155,840.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	153,970.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	107,998.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	177,422.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	63,595.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	113,820.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	199,934.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	190,000.00	194,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	177,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	102,674.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	106,710.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	81,423.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	93,820.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	52,594.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	40,000.00	38,353.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	49,842.50	
シンガポール・ドル　小計		2,670,000.00 (272,526,900)	2,561,725.90 (261,475,363)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,030,000.00	2,012,907.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,610,000.00	1,615,200.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,740,000.00	1,661,247.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,040,000.00	1,066,644.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,320,000.00	1,228,722.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,390,000.00	1,271,516.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	890,000.00	1,089,529.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	914,999.80	

スウェーデン・クローナ　小計		11,090,000.00 (146,166,200)	10,860,767.40 (143,144,914)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	990,000.00	985,802.40	
	KINGDOM OF DENMARK	980,000.00	968,318.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,450,000.00	1,336,987.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,243,942.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,150,000.00	686,032.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,490,000.00	1,218,998.80	
	KINGDOM OF DENMARK	2,280,000.00	2,966,530.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,220,000.00	1,169,004.00	
デンマーク・クローネ　小計		10,960,000.00 (213,391,200)	10,575,615.90 (205,907,242)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	328,171.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	234,070.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	99,084.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	113,839.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	94,330.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	65,279.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	71,897.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	263,850.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	110,000.00	91,658.60	
ニュージーランド・ドル　小計		1,560,000.00 (134,487,600)	1,362,179.60 (117,433,503)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,430,000.00	1,423,364.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	1,205,850.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	980,000.00	926,031.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	880,000.00	827,895.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	840,000.00	788,365.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	860,000.00	784,130.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,050,756.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	760,000.00	647,208.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	740,000.00	675,353.60	
ノルウェー・クローネ　小計		8,940,000.00 (122,835,600)	8,328,955.40 (114,439,847)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	810,000.00	732,888.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	950,000.00	805,030.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	549,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	760,000.00	612,902.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	827,798.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	970,000.00	748,840.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	703,780.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	167,976.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	581,258.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	720,000.00	472,852.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	690,000.00	527,850.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND	640,000.00	413,344.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	590,000.00	510,544.70	
ポーランド・ズロチ　小計		9,300,000.00 (286,531,140)	7,654,464.40 (235,832,517)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	439,443.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	424,657.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	389,438.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	164,395.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	780,425.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	606,394.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	680,952.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	364,752.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	376,633.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	310,732.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	368,405.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	210,161.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	451,378.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	120,000.00	121,303.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	330,000.00	325,861.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	160,209.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	185,200.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	192,610.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	360,994.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	241,238.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	337,759.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	437,178.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	580,000.00	521,739.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	167,486.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	140,000.00	132,017.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	220,000.00	221,009.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	162,174.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	332,237.80	
マレーシア・リンギット　小計		9,650,000.00 (295,456,945)	9,466,790.90 (289,847,577)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,532,399.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,610,000.00	7,860,327.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,070,000.00	4,342,556.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,870,000.00	7,958,164.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	4,588,877.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,040,000.00	5,045,594.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,450,000.00	1,530,475.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,580,000.00	6,375,888.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,760,000.00	4,638,096.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,820,000.00	6,384,884.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,940,000.00	5,725,625.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,710,000.00	4,387,035.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,920,000.00	2,535,465.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,100,000.00	1,892,583.00	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	870,790.00	
メキシコ・ペソ　小計		70,830,000.00 (510,903,873)	65,668,762.00 (473,675,347)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	310,000.00	312,582.30	
	BELGIUM KINGDOM	410,000.00	505,579.20	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	226,270.00	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	213,472.60	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	185,032.80	
	BELGIUM KINGDOM	360,000.00	322,034.40	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	258,739.20	
	BELGIUM KINGDOM	460,000.00	445,464.00	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	149,950.20	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	336,563.50	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	178,346.60	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	137,094.40	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	300,720.00	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	252,499.00	
	BELGIUM KINGDOM	140,000.00	123,566.80	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	125,206.50	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	454,997.40	
	BELGIUM KINGDOM	360,000.00	333,226.80	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	194,880.40	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	356,374.20	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	178,871.00	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	220,009.40	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	118,816.20	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	179,302.00	
	BELGIUM KINGDOM	360,000.00	427,186.80	
	BELGIUM KINGDOM	290,000.00	234,006.80	
	BELGIUM KINGDOM	110,000.00	51,471.20	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	269,025.90	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	141,320.00	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	88,483.50	
	BONOS Y OBLIG DE	440,000.00	359,097.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	357,017.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	400,259.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	520,684.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	504,645.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	575,121.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	514,574.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	443,391.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	495,589.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	492,235.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	463,417.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	528,293.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	522,855.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	356,911.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	301,737.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	518,551.20	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	470,591.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	367,571.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	466,004.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	460,947.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	321,422.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	489,368.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	623,340.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	450,148.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	484,156.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	399,362.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	358,078.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	409,637.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	298,937.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	418,102.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	403,560.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	419,073.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	416,605.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	250,810.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	455,725.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	529,034.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	264,561.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	408,042.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	383,414.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	453,944.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	70,188.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	341,667.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	270,000.00	194,119.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	150,000.00	101,289.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	369,713.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	368,802.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	395,984.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	150,681.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	230,000.00	203,333.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	365,567.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	100,729.00	
		BUNDESOBLIGATION	470,000.00	452,031.90	
		BUNDESOBLIGATION	470,000.00	448,262.50	
		BUNDESOBLIGATION	520,000.00	491,457.20	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	94,735.00	
		BUNDESOBLIGATION	570,000.00	534,027.30	
		BUNDESOBLIGATION	520,000.00	505,523.20	
		BUNDESOBLIGATION	490,000.00	453,867.40	
		BUNDESOBLIGATION	460,000.00	422,017.80	
		BUNDESOBLIGATION	490,000.00	474,702.20	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	96,955.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	558,000.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	486,094.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	698,956.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	460,000.00	452,097.20	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	599,614.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	594,201.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	658,805.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	639,025.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	623,723.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	587,424.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	627,254.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	490,036.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	420,000.00	578,915.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	609,385.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	566,482.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	545,166.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	549,762.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	526,806.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	412,566.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	473,164.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	495,626.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	427,262.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	460,000.00	354,278.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	594,448.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	700,074.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	180,988.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	486,130.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	384,631.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	124,070.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	540,729.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	490,215.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	160,000.00	135,233.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	221,395.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	525,678.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	294,800.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	658,806.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	170,156.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	428,128.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	80,566.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	76,420.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	390,000.00	381,525.30	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	430,000.00	418,514.70	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	350,000.00	340,158.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	290,000.00	281,595.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	410,219.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	520,983.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	574,423.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	399,055.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	429,329.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	324,576.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	552,238.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	572,251.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	437,668.40	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	516,600.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	418,105.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	409,466.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	659,058.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	303,326.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	448,549.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	289,023.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	420,367.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	153,166.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	339,651.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	365,962.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	484,428.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	354,152.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	371,662.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	272,031.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	574,491.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	704,604.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	486,740.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	280,788.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	287,149.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	459,030.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	257,209.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	570,664.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	421,841.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	504,340.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	516,193.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	243,868.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	224,784.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	569,966.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	201,246.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	409,033.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	321,516.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	409,164.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	407,137.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	245,636.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	353,005.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	407,171.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	467,039.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	212,487.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	730,000.00	708,735.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	232,308.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	348,268.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	181,190.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	406,381.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	64,455.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	290,995.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	324,215.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	540,411.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	267,786.40	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	322,560.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	355,341.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	375,391.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	415,904.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	349,496.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	349,056.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	350,956.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	577,150.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	284,314.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	311,952.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	386,193.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	294,376.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	133,110.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	261,495.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	145,527.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	284,735.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	219,742.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	293,634.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	269,248.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	136,480.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	271,619.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	120,252.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	60,000.00	60,780.00	
		DEUTSCHLAND REP	290,000.00	340,236.70	
		DEUTSCHLAND REP	270,000.00	322,644.60	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	343,344.00	
		DEUTSCHLAND REP	440,000.00	555,196.40	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	112,131.80	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	99,892.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	108,251.00	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	86,932.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	125,525.40	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	132,349.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	128,177.00	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	76,214.70	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	71,095.50	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	114,164.70	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	56,818.40	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	94,463.10	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	52,155.20	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	99,145.20	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	41,375.20	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	105,875.90	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	89,741.00	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	96,361.00	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	73,379.20	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	65,907.00	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	90,676.00	
		FINNISH GOVERNMENT	60,000.00	57,600.00	

		FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,128,171.00	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	728,412.00	
		FRANCE (GOVT OF)	610,000.00	655,420.60	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	698,159.70	
		FRANCE (GOVT OF)	810,000.00	811,182.60	
		FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	783,474.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,180,000.00	1,202,018.80	
		FRANCE (GOVT OF)	950,000.00	911,696.00	
		FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	763,495.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,128,780.00	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	975,972.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	971,320.90	
		FRANCE (GOVT OF)	310,000.00	237,001.20	
		FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	759,613.40	
		FRANCE (GOVT OF)	810,000.00	750,408.30	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	551,250.00	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	759,104.00	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	539,059.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,180,000.00	1,089,293.40	
		FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	724,920.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,120,000.00	1,025,830.40	
		FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	845,918.40	
		FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	633,462.50	
		FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	979,473.60	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	517,507.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	966,351.60	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	940,905.90	
		FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	803,436.80	
		FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	400,125.00	
		FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	875,760.40	
		FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	949,011.70	
		FRANCE (GOVT OF)	340,000.00	430,827.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	883,298.00	
		FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	343,430.00	
		FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	92,248.80	
		FRANCE (GOVT OF)	340,000.00	217,209.00	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	754,192.80	
		FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	774,630.50	
		FRANCE (GOVT OF)	640,000.00	623,731.20	
		FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	303,271.50	
		FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	590,046.40	
		FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	494,967.20	
		FRANCE (GOVT OF)	120,000.00	97,093.20	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	941,232.80	
		FRANCE (GOVT OF)	570,000.00	527,842.80	
		FRANCE (GOVT OF)	430,000.00	412,120.60	
		FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	524,806.80	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	94,876.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	172,913.80	

		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	191,523.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	191,578.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	231,148.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	123,078.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	157,836.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	88,753.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	130,131.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	194,869.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	122,160.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	83,993.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	246,946.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	137,277.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	144,117.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	153,896.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	60,939.90	
		IRISH GOVERNMENT BOND	100,000.00	81,647.00	
		ITALIAN GOVT	200,000.00	232,336.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	461,239.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	315,502.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	349,814.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	391,504.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	368,706.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	301,081.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	312,288.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	324,572.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	440,954.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	250,000.00	220,500.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	236,934.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	246,476.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	473,561.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	293,756.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	151,992.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	224,397.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	160,000.00	111,795.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	313,661.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	260,000.00	227,526.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	159,142.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	220,000.00	186,318.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	95,197.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	175,123.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	100,481.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	172,059.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	247,862.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	282,950.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	322,231.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	142,362.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	259,126.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	40,574.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	97,683.60	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	211,525.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	212,324.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	348,513.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	222,512.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	162,882.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	209,360.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	100,603.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	73,910.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	43,911.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	227,696.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	35,378.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	142,486.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	92,779.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	231,686.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	104,132.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	163,990.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	67,978.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	99,317.00	
	ユーロ　小計		138,740,000.00 (20,090,939,400)	131,173,485.30 (18,995,232,406)	
国債証券　合計			61,076,996,466 (61,076,996,466)	55,727,800,029 (55,727,800,029)	
合計				55,727,800,029 (55,727,800,029)	

（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	139銘柄	50.05	50.55
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	4.70	4.75
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	0.37	0.38
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	1.54	1.56
オフショア・人民元	国債証券	25銘柄	3.24	3.27
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.08	2.10
シンガポール・ドル	国債証券	21銘柄	0.46	0.47
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.25	0.26
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.37	0.37
ニュージーランド・ドル	国債証券	9銘柄	0.21	0.21
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.20	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.42	0.42
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.51	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.84	0.85
ユーロ	国債証券	358銘柄	33.75	34.09

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	20,873,212
金銭信託	262,035
コール・ローン	93,048,459
投資証券	5,856,929,421
未収入金	317,260
未収配当金	6,920,330
流動資産合計	5,978,350,717
資産合計	5,978,350,717
負債の部	
流動負債	
未払解約金	81,780,360
その他未払費用	69
流動負債合計	81,780,429
負債合計	81,780,429
純資産の部	
元本等	
元本	4,144,508,902
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,752,061,386
元本等合計	5,896,570,288
純資産合計	5,896,570,288
負債純資産合計	5,978,350,717

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
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11月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,144,586,020円
	同期中追加設定元本額	1,901,841,582円
	同期中一部解約元本額	901,918,700円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,725,162,274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）	187,796,823円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	19,188,841円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	8,193,816円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	45,417,471円
	ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	54,319,279円
	ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	241,819,126円
	ＦＷニッセイ先進国リートインデックス	2,750,367円
	ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	1,859,860,905円
	計	4,144,508,902円
２．	受益権の総数	4,144,508,902口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目		自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．	金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．	金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．	金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△1,326,353,740
合計	△1,326,353,740

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4227円 (14,227円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,516.00	52,388.40	
		AGREE REALTY CORP	2,584.00	180,828.32	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,024.00	40,277.60	
		ALEXANDER'S INC	45.00	10,974.15	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,950.00	743,341.50	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	337.00	6,305.27	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,831.00	52,769.42	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,770.00	312,640.00	
AMERICOLD REALTY TRUST	8,590.00	248,852.30	
APARTMENT INCOME REIT CO	5,231.00	189,309.89	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4,788.00	38,160.36	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	7,128.00	117,398.16	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,833.00	22,399.26	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	629.00	4,245.75	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,624.00	782,334.56	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	147.00	3,614.73	
BOSTON PROPERTIES INC	4,764.00	337,719.96	
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1,295.00	4,700.85	
BRANDYWINE REALTY TRUST	5,036.00	32,633.28	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	10,404.00	236,378.88	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	5,190.00	90,254.10	
BRT APARTMENTS CORP	345.00	7,024.20	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,498.00	401,640.36	
CARETRUST REIT INC	3,028.00	56,108.84	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	610.00	17,464.30	
CENTERSPACE	486.00	32,464.80	
CHATHAM LODGING TRUST	1,594.00	20,977.04	
CITY OFFICE REIT INC	1,032.00	9,958.80	
CLIPPER REALTY INC	93.00	697.50	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	490.00	16,983.40	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,241.00	86,113.37	
COUSINS PROPERTIES INC	4,701.00	117,336.96	
CTO REALTY GROWTH INC	453.00	9,236.67	
CUBESMART	7,425.00	301,009.50	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	6,673.00	60,590.84	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	14,100.00	8,248.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	9,613.00	1,061,851.98	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5,848.00	6,257.36	
DOUGLAS EMMETT INC	5,580.00	92,460.60	

		EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,206.00	34,810.68	
		EASTGROUP PROPERTIES	1,430.00	223,351.70	
		ELME COMMUNITIES	2,576.00	49,072.80	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	4,951.00	36,884.95	
		EPR PROPERTIES	2,532.00	101,355.96	
		EQUINIX INC	3,032.00	1,962,947.12	
		EQUITY COMMONWEALTH	2,361.00	61,929.03	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,762.00	375,855.26	
		EQUITY RESIDENTIAL	11,151.00	701,732.43	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5,150.00	117,420.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,164.00	457,880.76	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,462.00	705,620.68	
		FARMLAND PARTNERS INC	1,393.00	19,098.03	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,535.00	274,819.35	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	4,352.00	213,639.68	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,581.00	69,945.10	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,666.00	4,798.08	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8,604.00	431,404.56	
		GETTY REALTY CORP	1,344.00	43,344.00	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,555.00	29,078.50	
		GLADSTONE LAND CORP	938.00	19,454.12	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,212.00	20,770.68	
		GLOBAL NET LEASE INC	4,183.00	54,964.62	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	12,653.00	245,847.79	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,039.00	444,661.35	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	962.00	9,283.30	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,597.00	101,543.31	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	23,794.00	436,144.02	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	4,295.00	45,913.55	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7,630.00	134,822.10	
		INDUS REALTY TRUST INC	103.00	5,823.62	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,205.00	7,629.30	

INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	857.00	96,258.24	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	2,068.00	51,824.08	
INVITATION HOMES INC	19,257.00	602,166.39	
IRON MOUNTAIN INC	9,601.00	502,132.30	
ISTAR FINANCIAL INC	3,256.00	34,220.56	
JBG SMITH PROPERTIES	3,107.00	60,555.43	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	15,200.00	8,892.00	
KILROY REALTY CORP	3,417.00	140,507.04	
KIMCO REALTY CORP	20,690.00	458,283.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	7,063.00	154,962.22	
LIFE STORAGE INC	2,797.00	300,621.56	
LTC PROPERTIES INC	1,210.00	47,129.50	
LXP INDUSTRIAL TRUST	8,016.00	84,087.84	
MACERICH CO/THE	7,299.00	97,368.66	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	59,100.00	21,867.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,125.00	248,946.25	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,817.00	605,796.07	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,189.00	281,723.28	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,016.00	118,589.12	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,380.00	74,092.20	
NETSTREIT CORP	1,594.00	29,552.76	
NEXPOINT RESIDENTIAL	720.00	34,480.80	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,864.00	27,531.28	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7,845.00	237,781.95	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	420.00	10,222.80	
ORION OFFICE REIT INC	1,316.00	12,396.72	
PARAMOUNT GROUP INC	5,579.00	35,817.18	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	7,556.00	92,258.76	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4,423.00	70,679.54	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	3,412.00	107,682.72	
PHYSICIANS REALTY TRUST	6,474.00	93,614.04	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3,447.00	35,331.75	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,193.00	24,098.60	

POSTAL REALTY TRUST INC-A	399.00	6,264.30	
PRIME US REIT	11,300.00	5,650.00	
PROLOGIS INC	30,625.00	3,508,400.00	
PUBLIC STORAGE	5,242.00	1,538,579.42	
REALTY INCOME CORP	20,355.00	1,316,968.50	
REGENCY CENTERS CORP	5,178.00	339,625.02	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4,045.00	60,877.25	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	5,698.00	317,150.68	
RLJ LODGING TRUST	5,534.00	65,079.84	
RPT REALTY	3,789.00	41,792.67	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,922.00	174,037.10	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	7,411.00	87,746.24	
SAFEHOLD INC	586.00	17,568.28	
SAUL CENTERS INC	390.00	16,965.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	6,142.00	47,846.18	
SIMON PROPERTY GROUP INC	10,996.00	1,296,428.40	
SITE CENTERS CORP	6,186.00	81,778.92	
SL GREEN REALTY CORP	2,166.00	86,510.04	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,922.00	202,638.74	
STAG INDUSTRIAL INC	5,768.00	188,959.68	
STORE CAPITAL CORP	9,208.00	292,169.84	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,004.00	34,274.24	
SUN COMMUNITIES INC	4,124.00	589,732.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,035.00	64,212.40	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3,331.00	64,921.19	
TERRENO REALTY CORP	2,039.00	119,057.21	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	3,794.00	24,812.76	
UDR INC	10,254.00	412,210.80	
UMH PROPERTIES INC	1,956.00	34,073.52	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	291.00	14,814.81	
URBAN EDGE PROPERTIES	4,275.00	64,638.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	1,030.00	19,570.00	
VENTAS INC	13,308.00	586,483.56	
VERIS RESIDENTIAL INC	2,115.00	31,280.85	
VICI PROPERTIES INC	32,095.00	1,036,668.50	
VORNADO REALTY TRUST	5,592.00	134,096.16	
WELLTOWER INC	15,369.00	1,041,710.82	
WHITESTONE REIT	1,800.00	16,920.00	

	WP CAREY INC	6,847.00	545,842.84	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	3,511.00	53,156.54	
アメリカ・ドル　小計		839,184.00	32,638,802.93 (4,581,182,378)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	9,970.00	5,264.16	
	AEW UK REIT PLC	3,378.00	3,209.10	
	ASSURA PLC	88,440.00	49,437.96	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	25,690.00	21,810.81	
	BIG YELLOW GROUP PLC	5,794.00	67,442.16	
	BRITISH LAND CO PLC	29,833.00	121,420.31	
	CAPITAL & COUNTIES PRO-W/I	27,207.00	30,308.59	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	14,406.00	9,046.96	
	CUSTODIAN REIT PLC	5,885.00	5,484.82	
	DERWENT LONDON PLC	3,766.00	90,760.60	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	16,612.00	15,415.93	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	7,677.00	41,494.18	
	HAMMERSON PLC	134,681.00	33,400.88	
	HOME REIT PLC	24,530.00	18,544.68	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	10,174.00	10,723.39	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	6,989.00	3,159.02	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	25,531.00	159,517.68	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	32,983.00	63,195.42	
	LXI REIT PLC	60,381.00	75,959.29	
	NEWRIVER REIT PLC	6,981.00	4,991.41	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	13,020.00	11,145.12	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	39,176.00	45,561.68	
	PRS REIT PLC/THE	21,946.00	19,049.12	
	REGIONAL REIT LTD	15,531.00	9,598.15	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,372.00	69,665.40	
	SEGRO PLC	41,427.00	346,164.01	
	SHAFTESBURY PLC	8,402.00	32,919.03	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	32,679.00	34,312.95	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	11,942.00	8,120.56	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	60,390.00	92,577.87	

	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	28,186.00	16,967.97	
	UNITE GROUP PLC	13,755.00	130,672.50	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	15,973.00	23,001.12	
	WAREHOUSE REIT PLC	17,045.00	19,840.38	
	WORKSPACE GROUP PLC	4,836.00	22,255.27	
イギリス・ポンド　小計		892,175.00	1,712,458.06 (285,278,388)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	23,959.00	46,576.29	
	REIT 1 LTD	5,482.00	103,116.42	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	5,434.00	49,117.92	
イスラエル・シュケル　小計		34,875.00	198,810.63 (8,033,580)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	14,277.00	38,976.21	
	ARENA REIT	9,254.00	36,275.68	
	BWP TRUST	13,743.00	54,972.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	28,258.00	52,277.30	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	21,663.00	67,805.19	
	CENTURIA OFFICE REIT	17,874.00	28,240.92	
	CHARTER HALL GROUP	16,211.00	222,901.25	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	23,392.00	101,053.44	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	17,184.00	68,907.84	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	11,269.00	38,089.22	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	40,078.00	28,655.77	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	10,419.00	29,589.96	
	DEXUS/AU	35,878.00	270,520.12	
	GDI PROPERTY GROUP	14,036.00	10,597.18	
	GOODMAN GROUP	57,082.00	1,048,025.52	
	GPT GROUP	67,140.00	287,359.20	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	10,991.00	35,720.75	
	HEALTHCO REIT	12,478.00	19,840.02	
	HOME CONSORTIUM LTD	7,990.00	40,189.70	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	56,053.00	71,467.57	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	5,048.00	15,800.24	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,306.00	47,372.14	
	MIRVAC GROUP	131,788.00	279,390.56	
	NATIONAL STORAGE REIT	36,613.00	88,603.46	
	RURAL FUNDS GROUP	14,484.00	36,934.20	
	SCENTRE GROUP	175,025.00	500,571.50	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	39,483.00	103,840.29	
	STOCKLAND	83,079.00	304,899.93	

	VICINITY CENTRES	131,393.00	251,617.59	
	WAYPOINT REIT LTD	24,160.00	65,956.80	
オーストラリア・ドル　小計		1,137,649.00	4,246,451.55 (396,661,039)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,100.00	54,453.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,100.00	19,467.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	800.00	9,800.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	900.00	45,765.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,600.00	110,994.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	3,548.00	50,807.36	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1,700.00	27,438.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,100.00	16,973.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4,100.00	48,708.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000.00	15,370.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	2,100.00	6,363.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,100.00	68,306.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,100.00	85,855.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	4,800.00	58,752.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,800.00	10,696.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,600.00	19,424.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,000.00	32,960.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,300.00	18,941.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	200.00	3,194.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	800.00	8,312.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,200.00	22,572.00	
	PRIMARIS REIT	1,900.00	28,538.00	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	2,600.00	16,276.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700.00	98,841.00	
	SLATE GROCERY REIT	1,700.00	26,333.00	

	SLATE OFFICE REIT	2,200.00	10,054.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,200.00	59,202.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	2,800.00	62,720.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	900.00	5,499.00	
カナダ・ドル　小計		61,948.00	1,042,613.36 (109,286,732)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	22,800.00	28,956.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	106,400.00	292,600.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	63,042.00	60,205.11	
	CAPITALAND CHINA TRUST	50,300.00	53,821.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	169,328.00	343,735.84	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	37,800.00	47,628.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	32,200.00	20,286.00	
	ESR-LOGOS REIT	213,133.00	74,596.55	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	26,300.00	15,780.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	29,400.00	7,497.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	37,300.00	75,719.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	95,611.00	108,996.54	
	KEPPEL DC REIT	36,500.00	67,525.00	
	KEPPEL REIT	63,200.00	57,196.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	59,800.00	42,458.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	61,900.00	142,370.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	106,100.00	175,065.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	64,700.00	113,225.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	52,000.00	17,940.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	7,400.00	30,044.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	5,200.00	4,030.00	
	SPH REIT	16,900.00	15,379.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	42,000.00	22,680.00	
	SUNTEC REIT	70,900.00	99,260.00	
シンガポール・ドル　小計		1,470,214.00	1,916,993.04 (195,667,480)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	34,700.00	41,640.00	

	GOODMAN PROPERTY TRUST	23,913.00	49,141.21	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	33,732.00	30,358.80	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	27,156.00	33,673.44	
	STRIDE PROPERTY GROUP	15,725.00	25,160.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	14,429.00	34,413.16	
ニュージーランド・ドル　小計		149,655.00	214,386.61 (18,482,270)	
ユーロ	AEDIFICA	1,210.00	96,074.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	508.00	4,005.58	
	ALTAREA	195.00	26,091.00	
	CARMILA	1,868.00	26,002.56	
	COFINIMMO	914.00	78,923.90	
	COVIVIO	1,469.00	84,100.25	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,633.00	37,722.30	
	GECINA SA	1,800.00	172,260.00	
	ICADE	966.00	39,316.20	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	3,496.23	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	8,602.00	49,891.60	
	INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	773.00	16,619.50	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	6,593.00	7,463.27	
	KLEPIERRE	6,358.00	141,020.44	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1,218.00	5,292.21	
	MERCIALYS	2,968.00	27,943.72	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	10,699.00	95,542.07	
	MONTEA NV	231.00	15,592.50	
	NSI NV	299.00	7,504.90	
	RETAIL ESTATES	211.00	12,997.60	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,651.00	188,026.50	
	VASTNED RETAIL NV	513.00	10,926.90	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,259.00	114,226.38	
	WERELDHAVE NV	1,496.00	20,540.08	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	383.00	11,758.10	
ユーロ　小計		59,943.00	1,293,337.79 (187,288,245)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	50,000.00	131,500.00	
	FORTUNE REIT	30,000.00	161,400.00	
	LINK REIT	68,500.00	3,774,350.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	15,000.00	45,750.00	

		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	38,000.00	68,020.00	
	香港・ドル　小計		201,500.00	4,181,020.00 (75,049,309)	
投資証券　合計			4,847,143	5,856,929,421 (5,856,929,421)	
合計				5,856,929,421 (5,856,929,421)	

（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 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資証券	145銘柄	77.69	78.22
イギリス・ポンド	投資証券	36銘柄	4.84	4.87
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	0.14	0.14
オーストラリア・ドル	投資証券	30銘柄	6.73	6.77
カナダ・ドル	投資証券	29銘柄	1.85	1.87
シンガポール・ドル	投資証券	24銘柄	3.32	3.34
ニュージーランド・ドル	投資証券	6銘柄	0.31	0.32
ユーロ	投資証券	25銘柄	3.18	3.20
香港・ドル	投資証券	5銘柄	1.27	1.28

（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

該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	71,278,317
金銭信託	1,202,155
コール・ローン	426,885,200
株式	4,419,549,027
投資信託受益証券	385,834,033
投資証券	5,391,090
派生商品評価勘定	20,585,410
未収入金	1,020,333
未収配当金	2,170,315
差入委託証拠金	142,020,222
流動資産合計	5,475,936,102
資産合計	5,475,936,102
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,877,336
未払金	18,254,862
未払解約金	15,865,991
その他未払費用	296
流動負債合計	46,998,485
負債合計	46,998,485
純資産の部	
元本等	
元本	4,729,645,782
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	699,291,835
元本等合計	5,428,937,617
純資産合計	5,428,937,617
負債純資産合計	5,475,936,102

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,649,078,821円
同期中追加設定元本額	1,909,977,624円
同期中一部解約元本額	829,410,663円
元本の内訳	
ファンド名	
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ新興国株式インデックスファンド	2,726,076,259円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	16,946,776円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	24,304,522円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	10,380,272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）	57,534,817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）	410,879,411円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	216,604,789円
ＦＷニッセイ新興国株インデックス	5,451,850円
ＤＣニッセイ新興国株式インデックス	1,261,467,086円
計	4,729,645,782円
２．　受益権の総数	4,729,645,782口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△1,070,588,394
投資信託受益証券	△24,176,122
投資証券	409,913
合計	△1,094,354,603

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	89,071	－	88,774	297
メキシコ・ペソ	89,071	－	88,774	297
買建	389,656,277	－	392,305,480	2,649,203
アメリカ・ドル	389,656,277	－	392,305,480	2,649,203
合計	389,745,348	－	392,394,254	2,649,500

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	599,603,884	－	604,662,458	5,058,574
合計	599,603,884	－	604,662,458	5,058,574

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1479円 (11,479円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年11月21日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	360 DIGITECH INC	500	14.000	7,000.00	
	AUTOHOME INC-ADR	534	28.390	15,160.26	
	BEIGENE LTD-ADR	239	203.130	48,548.07	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	7.880	4,200.04	
	CREDICORP LTD	437	151.140	66,048.18	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	400	53.090	21,236.00	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	1,017	37.380	38,015.46	
	HUTCHMED CHINA LIMITED ADR	600	10.770	6,462.00	
	IQIYI INC-ADR	900	2.780	2,502.00	
	JOYY INC	334	28.140	9,398.76	
	KANZHUN LTD	1,100	15.920	17,512.00	
	KE HOLDINGS INC	3,874	14.810	57,373.94	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	200	52.110	10,422.00	

	LI AUTO INC - ADR	3,150	17.880	56,322.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,444	0.000	0.14	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
	NIO INC - ADR	7,757	10.470	81,215.79	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	0.000	0.04	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	729	0.000	0.07	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	0.000	0.03	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	552	0.000	0.05	
	PINDUODUO INC-ADR	2,852	70.150	200,067.80	
	PJSC GAZPROM ADR	27,971	0.000	2.79	
	PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	2,732	0.000	0.27	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	460	0.000	0.04	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	3,200	1.760	5,632.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	5,479	0.000	0.54	
	SBERBANK OF RUSSIA	49,840	0.000	4.98	
	SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1,314	0.000	0.13	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	2,280	0.785	1,789.80	
	SOUTHERN COPPER CORP	434	58.020	25,180.68	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,824	5.550	15,673.20	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	1,225	0.000	0.12	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	0.000	0.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,468	5.580	19,351.44	
	TRIP.COM GROUP LTD	3,104	28.350	87,998.40	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	2,315	9.360	21,668.40	
	VK COMPANY LTD-GDR	380	0.000	0.03	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	0.000	0.66	
	WEIBO CORP-SPON ADR	334	14.400	4,809.60	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	0.000	0.04	
	XPENG INC - ADR	2,413	7.760	18,724.88	
	YANDEX NV-A	1,315	0.000	0.13	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,222	52.810	117,343.82	
	ZAI LAB LTD-ADR	559	34.960	19,542.64	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,452	21.900	53,698.80	
アメリカ・ドル　小計		161,888		1,032,909.05 (144,979,114)	

イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	1,915	0.000	0.19	
イギリス・ポンド　小計		1,915		0.19 (32)	
インド・ルピー	ACC LTD	285	2,460.700	701,299.50	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,515	4,019.800	6,089,997.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	1,846	2,085.400	3,849,648.40	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,356	888.900	2,983,148.40	
	ADANI POWER LTD	5,133	336.500	1,727,254.50	
	ADANI TOTAL GAS LTD	1,602	3,644.650	5,838,729.30	
	ADANI TRANSMISSION LTD	1,617	3,116.250	5,038,976.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,593	574.100	1,488,641.30	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	495	4,399.150	2,177,579.25	
	ASIAN PAINTS LTD	2,244	3,095.500	6,946,302.00	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	1,152	612.200	705,254.40	
	AUROBINDO PHARMA LTD	802	469.000	376,138.00	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	839	3,910.600	3,280,993.40	
	AXIS BANK LTD	13,164	859.200	11,310,508.80	
	BAJAJ AUTO LTD	269	3,632.950	977,263.55	
	BAJAJ FINANCE LTD	1,566	6,791.500	10,635,489.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,100	1,654.400	3,474,240.00	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	331	1,972.750	652,980.25	
	BANDHAN BANK LTD	3,556	216.200	768,807.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	1,972	603.550	1,190,200.60	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	21,234	107.350	2,279,469.90	
	BHARAT FORGE LTD	1,798	836.700	1,504,386.60	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,051	304.100	1,536,009.10	
	BHARTI AIRTEL LTD	12,090	837.300	10,122,957.00	
	BIOCON LTD	1,590	287.350	456,886.50	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	585	4,106.050	2,402,039.25	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	2,189	713.800	1,562,508.20	
	CIPLA LIMITED	2,591	1,102.400	2,856,318.40	
	COAL INDIA LTD	12,030	229.550	2,761,486.50	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	740	1,582.850	1,171,309.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,694	739.100	1,252,035.40	
	DABUR INDIA LTD	3,788	548.500	2,077,718.00	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	710	3,287.350	2,334,018.50	
	DLF LTD	4,020	400.400	1,609,608.00	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	621	4,409.050	2,738,020.05	
	EICHER MOTORS LTD	677	3,390.250	2,295,199.25	
	GAIL INDIA LTD	14,833	90.300	1,339,419.90	

GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,634	838.900	2,209,662.60	
GODREJ PROPERTIES LTD	606	1,273.950	772,013.70	
GRASIM INDUSTRIES LTD	1,475	1,708.850	2,520,553.75	
HAVELLS INDIA LTD	1,487	1,221.550	1,816,444.85	
HCL TECHNOLOGIES LTD	6,199	1,103.150	6,838,426.85	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	5,150	531.550	2,737,482.50	
HERO MOTOCORP LTD	729	2,723.150	1,985,176.35	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	8,856	438.600	3,884,241.60	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	209.100	403,563.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	4,490	2,483.700	11,151,813.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	9,625	2,667.050	25,670,356.25	
ICICI BANK LTD	28,876	920.350	26,576,026.60	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,456	1,136.700	1,655,035.20	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	469.700	1,101,916.20	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	8,985	69.250	622,211.25	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	1,331	718.100	955,791.10	
INDRAPRASTHA GAS LTD	1,088	418.050	454,838.40	
INDUS TOWERS LTD	4,167	196.850	820,273.95	
INFO EDGE INDIA LTD	364	3,894.750	1,417,689.00	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	18,780	1,593.400	29,924,052.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	562	1,782.950	1,002,017.90	
ITC LTD	15,959	341.050	5,442,816.95	
JINDAL STEEL & POWER LTD	2,793	517.750	1,446,075.75	
JSW STEEL LTD	4,649	708.200	3,292,421.80	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	551.050	1,137,918.25	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	3,220	1,959.550	6,309,751.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	4,015	2,024.450	8,128,166.75	
LTIMINDTREE LIMITED	327	4,895.900	1,600,959.30	
LUPIN LTD	907	721.050	653,992.35	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,052	1,227.150	6,199,561.80	
MARICO LTD	2,894	486.100	1,406,773.40	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	661	8,848.050	5,848,561.05	
MINDTREE LTD	308	3,506.150	1,079,894.20	
MPHASIS LTD	416	1,948.600	810,617.60	
MRF LTD	7	88,092.700	616,648.90	
MUTHOOT FINANCE LTD	448	1,061.450	475,529.60	
NESTLE INDIA LTD	178	19,925.100	3,546,667.80	
NTPC LTD	24,490	165.850	4,061,666.50	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	14,568	141.750	2,065,014.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	33	46,139.450	1,522,601.85	
PETRONET LNG LTD	1,873	212.250	397,544.25	

	PI INDUSTRIES LTD	332	3,299.000	1,095,268.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	836	2,699.250	2,256,573.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	16,661	218.350	3,637,929.35	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	16,984	2,597.650	44,118,487.60	
	SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	9,052	72.200	653,554.40	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	1,031	793.200	817,789.20	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,308	1,242.750	2,868,267.00	
	SHREE CEMENT LTD	75	23,148.000	1,736,100.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	1,214	1,251.250	1,519,017.50	
	SRF LTD	761	2,275.250	1,731,465.25	
	STATE BANK OF INDIA	10,593	602.700	6,384,401.10	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	5,168	1,009.600	5,217,612.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	5,117	3,343.450	17,108,433.65	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	3,367	775.700	2,611,781.90	
	TATA ELXSI LTD	210	6,894.600	1,447,866.00	
	TATA MOTORS LTD	9,540	423.800	4,043,052.00	
	TATA STEEL LTD	44,652	105.500	4,710,786.00	
	TECH MAHINDRA LTD	3,212	1,060.850	3,407,450.20	
	TITAN CO LTD	1,900	2,565.800	4,875,020.00	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	514	1,621.750	833,579.50	
	TRENT LTD	1,146	1,383.050	1,584,975.30	
	ULTRATECH CEMENT LTD	538	6,814.450	3,666,174.10	
	UNITED SPIRITS LTD	1,802	874.050	1,575,038.10	
	UPL LTD	2,564	765.950	1,963,895.80	
	VEDANTA LTD	4,714	310.400	1,463,225.60	
	WIPRO LTD	6,705	393.850	2,640,764.25	
	ZOMATO LTD	7,891	67.150	529,880.65	
インド・ルピー　小計		487,564		415,573,998.05 (718,943,017)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	84,200	3,590.000	302,278,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	52,900	1,810.000	95,749,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	53,200	1,960.000	104,272,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	122,000	6,225.000	759,450,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	329,700	8,825.000	2,909,602,500.00	
	BANK JAGO TBK PT	22,400	6,125.000	137,200,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	108,100	10,175.000	1,099,917,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	48,700	9,200.000	448,040,000.00	

	BANK RAKYAT INDONESIA	375,700	4,610.000	1,731,977,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	88,500	820.000	72,570,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	45,500	5,850.000	266,175,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	1,100	21,075.000	23,182,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	9,875.000	59,250,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	9,650.000	92,640,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	6,500.000	67,600,000.00	
	INTERNATIONAL NICKEL INDONES	18,100	6,900.000	124,890,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	56,900	2,060.000	117,214,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	62,800	4,410.000	276,948,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	162,600	1,150.000	186,990,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	7,725.000	72,615,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	99,800	2,830.000	282,434,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	269,000	4,010.000	1,078,690,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	4,640.000	227,824,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	28,800.000	305,280,000.00	
インドネシア・ルピア　小計		2,096,300		10,842,788,500.00 (97,585,097)	
オフショア・人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	7.260	32,670.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	528	103.090	54,431.52	
	AECC AVIATION POWER CO-A	1,000	43.850	43,850.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	33,800	2.790	94,302.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,567	28.110	100,268.37	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	27.880	27,880.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	237.320	71,196.00	
	ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	140	152.390	21,334.60	
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	9,200	3.190	29,348.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD - A	8,600	4.160	35,776.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	32,100	3.040	97,584.00	

BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	4.570	101,454.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	7.040	54,912.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	1,700	28.680	48,756.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	5.780	26,010.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	5,700	5.320	30,324.00	
BBMG CORPORATION-A	14,100	2.540	35,814.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	271.040	59,086.72	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	400	156.010	62,404.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	19,700	4.730	93,181.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	11,000	3.620	39,820.00	
BYD CO LTD -A	700	254.680	178,276.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	7.550	56,625.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	176.530	17,653.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	5.620	69,126.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,600	5.370	51,552.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	3,200	24.780	79,296.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	5.070	34,476.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	9,700	2.820	27,354.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	9.710	66,999.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,000	32.100	32,100.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	6,900	32.070	221,283.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,700	13.240	35,748.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	14.250	27,075.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	3.400	72,080.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	6.130	64,978.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	1,600	25.980	41,568.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	1,500	22.950	34,425.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	8,400	4.250	35,700.00	

CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8,800	5.230	46,024.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	17,114	4.560	78,039.84	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	2,000	28.280	56,560.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	7.040	33,088.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	10,800	5.230	56,484.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	12,800	5.670	72,576.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	800	190.800	152,640.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	2,200	15.650	34,430.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	9,000	21.050	189,450.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	118.780	59,390.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.880	70,848.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	11.830	69,205.50	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	400	95.170	38,068.00	
CITIC SECURITIES CO-A	2,800	19.150	53,620.00	
CMOC GROUP LTD-A	11,300	4.690	52,997.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	900	380.790	342,711.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	11.820	59,927.40	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,600	25.740	66,924.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,011	18.200	91,200.20	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	83.800	75,420.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	5.990	35,341.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,029	71.900	73,985.10	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	8,300	6.800	56,440.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	2,600	8.950	23,270.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	700	80.290	56,203.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.160	54,912.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	15.590	57,683.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	103.750	20,335.00	

GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	197.110	39,422.00	
GOERTEK INC -A	1,000	18.480	18,480.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	32.500	58,500.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	700	29.030	20,321.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	31.760	101,632.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,000	59.700	59,700.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	10.270	55,458.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	29.920	38,896.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	44.710	44,710.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	9,800	6.240	61,152.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	9.020	101,024.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	13.810	45,573.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,000	24.020	48,040.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,900	8.800	25,520.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	840	67.750	56,910.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	25.100	20,080.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	2,800	16.270	45,556.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	16.120	45,136.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	5,700	7.070	40,299.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	97.470	38,988.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,300	43.770	56,901.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	7.450	57,365.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	2,100	12.960	27,216.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	4,100	8.160	33,456.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	4.950	30,690.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	17.850	24,990.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	111.200	55,600.00	

HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	43.680	51,673.44	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	34.850	41,820.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	100	492.500	49,250.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	28,000	4.170	116,760.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	8,900	16.220	144,358.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.970	63,828.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	4.170	8,757.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	29.120	81,536.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	980	58.000	56,840.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	13.350	38,715.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	64.750	64,750.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	3,384	40.270	136,273.68	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	400	146.000	58,400.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	18.790	41,338.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	17.020	34,040.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	400	1,567.130	626,852.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	17.280	50,112.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	10.600	25,440.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	4.920	68,388.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	3,080	47.000	144,760.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	3,089	32.620	100,763.18	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	400	185.230	74,092.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	26.750	34,775.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	121.990	58,555.20	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.100	63,550.00	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	2,190	47.200	103,368.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	2,592	26.400	68,428.80	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	230.530	46,106.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	26.700	24,030.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	13.460	24,228.00	

NINESTAR CORP-A	1,700	56.730	96,441.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	68.340	47,838.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	13.100	57,640.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	8.820	39,690.00	
PETROCHINA CO LTD-A	6,900	5.000	34,500.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	450	69.660	31,347.00	
PICC HOLDING CO-A	14,900	4.950	73,755.00	
PING AN BANK CO LTD-A	9,700	11.590	112,423.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	3,700	42.160	155,992.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	15.570	42,039.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	4.230	51,606.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	7.130	71,300.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	2,700	24.480	66,096.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,000	12.110	36,330.00	
S F HOLDING CO LTD-A	2,200	52.490	115,478.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	2,100	14.410	30,261.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	15.480	46,440.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	5,700	10.360	59,052.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	2,300	20.280	46,644.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	19.280	90,616.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	19.640	9,034.40	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	29.720	56,468.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,300	42.050	54,665.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	4.090	25,767.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	700	38.440	26,908.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,600	5.270	45,322.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	12.270	62,577.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	6,700	6.910	46,297.00	

SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	800	55.580	44,464.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	5.600	31,360.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	480	263.230	126,350.40	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	79.210	11,089.40	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	4.080	44,880.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	100	258.020	25,802.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	71.000	106,500.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	480	37.940	18,211.20	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	326.520	163,260.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	336	74.530	25,042.08	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	1,900	8.880	16,872.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	500	114.890	57,445.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	100	464.180	46,418.00	
TBEA CO LTD-A	2,200	21.640	47,608.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,000	4.340	17,360.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,500	45.480	68,220.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	7,200	9.320	67,104.00	
TONGWEI CO LTD-A	1,500	43.940	65,910.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	64.300	70,215.60	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	600	98.800	59,280.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	141.440	59,263.36	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	19.370	18,982.60	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,500	89.000	133,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	3,400	10.340	35,156.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	17.460	31,428.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.420	62,274.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	85.400	34,587.00	

	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	58.450	11,690.00	
	WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	4.420	22,542.00	
	WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	4,000	12.290	49,160.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	1,500	153.610	230,415.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-A	672	86.510	58,134.72	
	XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	5.020	13,052.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,900	11.470	44,733.00	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	42.450	55,185.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	26.020	43,973.80	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	19.700	49,250.00	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	58.070	40,649.00	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	153.710	46,113.00	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	262.990	78,897.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	28.630	31,493.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	12.530	37,590.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	62.940	40,911.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	67.400	53,920.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	19.500	19,656.00	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	10.750	21,500.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	7,100	9.640	68,444.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	5.670	53,298.00	
	ZTE CORP-A	700	25.120	17,584.00	
オフショア・人民元　小計		924,403		12,347,190.11 (242,590,183)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	41,500.000	104,455,500.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,664	31,800.000	52,915,200.00	
	ECOPETROL SA	18,083	2,469.000	44,646,927.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	18,670.000	27,295,540.00	
コロンビア・ペソ　小計		23,726		229,313,167.00 (6,444,388)	

タイ・バーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	6,600	190.000	1,254,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	25,500	74.000	1,887,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	88,100	5.850	515,385.00	
	B GRIMM POWER PCL-FOREIGN	3,100	36.750	113,925.00	
	BANGKOK COMMERCIAL-FOREIGN	9,000	15.300	137,700.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	59,700	29.250	1,746,225.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	23,600	9.450	223,020.00	
	BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	6,000	34.000	204,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	57,400	8.100	464,940.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	3,900	212.000	826,800.00	
	CARABAO GROUP PCL-F	2,600	96.500	250,900.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	12,600	68.750	866,250.00	
	CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	6,700	42.000	281,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	26,800	24.400	653,920.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	34,300	62.750	2,152,325.00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	1,000	168.000	168,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	8,900	94.000	836,600.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	2,400	66.500	159,600.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	17,300	50.500	873,650.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	18,400	14.800	272,320.00	
	INDORAMA VENTURES-FOREIGN	12,200	42.500	518,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	74.250	467,775.00	
	JMT NETWORK SERVICES-FOREIGN	5,700	65.000	370,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	143.000	700,700.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	32,300	17.400	562,020.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	5,400	58.500	315,900.00	
	LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	28,500	9.300	265,050.00	

	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	18,500	30.250	559,625.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	2,100	35.250	74,025.00	
	OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	28.250	90,400.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	7,900	187.000	1,477,300.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	14,300	47.250	675,675.00	
	PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	14,200	24.200	343,640.00	
	PTT PCL/FOREIGN	52,600	33.500	1,762,100.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	2,300	40.250	92,575.00	
	SCB X PCL-FOREIGN	6,800	105.500	717,400.00	
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	7,300	56.250	410,625.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	4,200	344.000	1,444,800.00	
	SRISAWADCORP PCL -FOREIGN	2,400	42.000	100,800.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	54.500	506,850.00	
	THAI UNION GROUP PCL-F	9,800	17.200	168,560.00	
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	101,300	4.940	500,422.00	
タイ・バーツ　小計		765,400		26,013,202.00 (101,451,488)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	1,019	816.500	832,013.50	
	KOMERCNI BANKA AS	654	749.000	489,846.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	72.500	81,490.00	
チェコ・コルナ　小計		2,797		1,403,349.50 (8,342,071)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	306,426	84.760	25,972,667.76	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	183	26,100.000	4,776,300.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	553,318	33.700	18,646,816.60	
	CENCOSUD SA	4,383	1,285.000	5,632,155.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	5,308.600	1,449,247.80	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	92,857	73.000	6,778,561.00	
	EMPRESAS CMPC SA	3,736	1,500.000	5,604,000.00	
	EMPRESAS COPEC SA	3,034	6,330.000	19,205,220.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	35.500	3,212,253.00	
	ENERSIS SA	99,456	94.000	9,348,864.00	
	FALABELLA SA	2,406	1,601.000	3,852,006.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	784	85,400.000	66,953,600.00	
チリ・ペソ　小計		1,157,342		171,431,691.16 (25,541,608)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	25,852	16.250	420,095.00	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,100	39.720	83,412.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,552	130.700	333,546.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	36.900	300,181.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	425.600	66,819.20	
	KOC HOLDING AS	8,792	62.950	553,456.40	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,082	425.600	460,499.20	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	31.320	370,609.56	
	TURKIYE IS BANKASI-C	32,580	9.550	311,139.00	
トルコ・リラ　小計		93,083		2,899,758.26 (21,864,177)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	2,658	2,680.000	7,123,440.00	
	OTP BANK RT	1,120	10,580.000	11,849,600.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	875	8,000.000	7,000,000.00	
ハンガリー・フォリント　小計		4,653		25,973,040.00 (9,249,051)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	56.750	358,092.50	
	ACEN CORPORATION	46,985	7.000	328,895.00	
	AYALA CORPORATION	1,795	665.500	1,194,572.50	
	AYALA LAND INC	48,800	29.700	1,449,360.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	12,570	97.500	1,225,575.00	
	BDO UNIBANK INC	11,140	128.900	1,435,946.00	
	GLOBE TELECOM INC	65	2,214.000	143,910.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	190	433.000	82,270.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	5,650	188.000	1,062,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	44.900	833,254.20	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,380	244.000	336,720.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	306.200	419,494.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	28,100	3.410	95,821.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	51.650	781,309.55	
	MONDE NISSIN CORP	29,200	12.720	371,424.00	
	PLDT INC	585	1,579.000	923,715.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,585	859.000	1,361,515.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	60,300	34.000	2,050,200.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	2,810	131.900	370,639.00	
フィリピン・ペソ　小計		292,520		14,824,912.75 (36,332,896)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	26,800	15.620	418,616.00	
	AMERICANAS SA	3,814	10.380	39,589.32	

ATACADAO SA	1,900	15.800	30,020.00	
BANCO BRADESCO S.A.	6,303	13.260	83,577.78	
BANCO BRADESCO SA-PREF	32,979	15.610	514,802.19	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	6,900	24.890	171,741.00	
BANCO DO BRASIL SA	5,700	34.380	195,966.00	
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	3,000	27.860	83,580.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	3,900	30.160	117,624.00	
BM&FBOVESPA SA	34,900	11.870	414,263.00	
BRF SA	4,300	10.220	43,946.00	
CCR SA	6,800	11.330	77,044.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	700	47.530	33,271.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	6,900	44.030	303,807.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	8,475	10.340	87,631.50	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,200	55.210	121,462.00	
COSAN SA	5,600	17.050	95,480.00	
ENERGISA SA-UNITS	600	44.500	26,700.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	39.650	26,763.75	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	5,300	27.510	145,803.00	
GERDAU SA-PREF	6,200	29.830	184,946.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	27,606	5.680	156,802.08	
HYPERA S.A	2,600	44.700	116,220.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	28,250	26.640	752,580.00	
ITAUSA SA	28,216	8.910	251,404.56	
JBS SA	4,200	23.060	96,852.00	
KLABIN SA - UNIT	4,000	22.060	88,240.00	
LOCALIZA RENT A CAR	4,195	60.220	252,622.90	
LOJAS RENNER S.A.	5,962	24.240	144,518.88	
MAGAZINE LUIZA SA	15,200	3.150	47,880.00	
NATURA &CO HOLDING SA	4,200	12.310	51,702.00	
PETRO RIO SA	3,800	34.500	131,100.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	21,100	30.390	641,229.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	27,100	26.700	723,570.00	
RAIA DROGASIL SA	5,900	23.200	136,880.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	2,500	28.550	71,375.00	
RUMO SA	7,200	19.260	138,672.00	
SUZANO S.A.	3,722	57.570	214,275.54	
TELEFONICA BRASIL S.A.	2,700	38.710	104,517.00	
TIM SA	3,500	12.820	44,870.00	

	TOTVS SA	2,500	29.510	73,775.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	2,200	13.140	28,908.00	
	VALE SA	22,854	80.830	1,847,288.82	
	VIBRA ENERGIA SA	6,900	17.170	118,473.00	
	WEG SA	8,520	39.280	334,665.60	
ブラジル・レアル　小計		418,871		9,785,054.92 (255,065,070)	
ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	1,606	24.405	39,194.43	
	BANK PEKAO SA	1,177	83.800	98,632.60	
	CD PROJEKT SA	427	145.000	61,915.00	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	17.820	18,212.04	
	DINO POLSKA SA	292	357.000	104,244.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	838	113.950	95,490.10	
	LPP SA	4	9,250.000	37,000.00	
	ORANGE POLSKA SA	1,329	6.576	8,739.50	
	PGE SA	1,780	6.558	11,673.24	
	PKO BANK POLSKI SA	5,021	28.060	140,889.26	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,087	62.760	256,500.12	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,437	29.590	101,700.83	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	157	272.000	42,704.00	
ポーランド・ズロチ　小計		21,177		1,016,895.12 (31,330,335)	
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	3.980	38,606.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.850	58,425.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	40,300	5.410	218,023.00	
	DIALOG GROUP BHD	14,900	2.100	31,290.00	
	DIGI.COM BHD	22,500	3.870	87,075.00	
	GENTING BHD	6,700	4.480	30,016.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.710	30,623.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	1,100	6.500	7,150.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,700	1.810	8,507.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,500	20.660	92,970.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	18.780	35,682.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	6,300	5.970	37,611.00	
	INARI AMERTRON BHD	16,600	2.580	42,828.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	4.100	80,770.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	21.420	72,828.00	
	MALAYAN BANKING BHD	28,700	8.560	245,672.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	6.070	29,743.00	
	MAXIS BHD	19,600	3.830	75,068.00	
	MISC BHD	5,000	7.200	36,000.00	

	MR DIY GROUP M BHD	16,300	2.000	32,600.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	130.200	26,040.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	13,300	8.620	114,646.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	700	22.820	15,974.00	
	PETRONAS GAS BHD	2,200	17.060	37,532.00	
	PPB GROUP BERHAD	1,880	16.300	30,644.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	23,000	4.750	109,250.00	
	PUBLIC BANK BHD	87,400	4.310	376,694.00	
	QL RESOURCES BHD	3,000	5.450	16,350.00	
	RHB BANK BHD	4,900	5.520	27,048.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.200	10,560.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	7,700	4.310	33,187.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	2,200	5.350	11,770.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	12,900	8.380	108,102.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	34,100	0.925	31,542.50	
マレーシア・リンギット　小計		456,880		2,240,826.50 (68,608,057)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	17,900	14.150	253,285.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	156,300	19.460	3,041,598.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	165.890	298,602.00	
	CEMEX SAB-CPO	78,200	8.760	685,032.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	2,890	134.360	388,300.40	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	11,100	154.950	1,719,945.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,200	234.370	281,244.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,070	470.930	503,895.10	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	1,900	318.700	605,530.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	8,900	87.560	779,284.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	86.920	78,228.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	15,200	152.840	2,323,168.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	14,600	37.480	547,208.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	16,900	75.050	1,268,345.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	14,000	21.070	294,980.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	360	282.000	101,520.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	32.910	329,100.00	

	OPERADORA DE SITES MEX-A-1	12,000	23.680	284,160.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	3,300	38.320	126,456.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	430	171.240	73,633.20	
	SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	7,815	7.360	57,518.40	
	WALMART DE MEXICO-SER V	30,000	71.320	2,139,600.00	
メキシコ・ペソ　小計		406,765		16,180,632.10 (116,712,517)	
ユーロ	FF GROUP	129	4.800	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,568	15.170	23,786.56	
	JUMBO SA	994	15.070	14,979.58	
	MYTILINEOS S.A.	1,320	16.940	22,360.80	
	OPAP SA	1,819	12.730	23,155.87	
	PUBLIC POWER CORP	2,762	6.450	17,814.90	
ユーロ　小計		8,592		102,716.91 (14,874,436)	
韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	98	41,100.000	4,027,800.00	
	AMOREPACIFIC CORP	173	118,500.000	20,500,500.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	305	31,700.000	9,668,500.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	195,000.000	2,925,000.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	430	65,700.000	28,251,000.00	
	CELLTRION INC	565	178,000.000	100,570,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	24,300.000	3,207,600.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	394,500.000	24,064,500.00	
	CJ CORP	53	77,300.000	4,096,900.00	
	CJ ENM CO LTD	28	82,200.000	2,301,600.00	
	CJ LOGISTICS	16	89,500.000	1,432,000.00	
	COWAY CO LTD	312	57,800.000	18,033,600.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	1,791	57,700.000	103,340,700.00	
	DB INSURANCE CO LTD	161	58,500.000	9,418,500.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	272	40,400.000	10,988,800.00	
	E-MART CO LTD	63	92,200.000	5,808,600.00	
	ECOPRO BM CO LTD	276	109,300.000	30,166,800.00	
	F&F CO LTD / NEW	90	159,000.000	14,310,000.00	
	GREEN CROSS CORP	38	134,000.000	5,092,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	188	23,350.000	4,389,800.00	
	GS HOLDINGS CORP	407	46,300.000	18,844,100.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	1,656	41,400.000	68,558,400.00	
	HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	33,600.000	17,841,600.00	
	HANMI PHARM CO LTD	58	265,500.000	15,399,000.00	
	HANON SYSTEMS	960	8,770.000	8,419,200.00	

HANWHA SOLUTIONS CORP	624	49,800.000	31,075,200.00	
HD HYUNDAI	361	62,900.000	22,706,900.00	
HLB INC	591	36,200.000	21,394,200.00	
HLB INC-RIGHTS	52	6,410.000	333,320.00	
HMM CO LTD	1,215	20,400.000	24,786,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	99	72,400.000	7,167,600.00	
HYBE CO LTD	99	137,000.000	13,563,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	474	41,050.000	19,457,700.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	131	174,000.000	22,794,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	128	117,500.000	15,040,000.00	
HYUNDAI MOBIS	346	216,000.000	74,736,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	781	169,500.000	132,379,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	239	82,100.000	19,621,900.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	80,900.000	13,753,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	528	33,000.000	17,424,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	126	65,100.000	8,202,600.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,205	10,800.000	23,814,000.00	
KAKAO GAMES CORP	157	43,350.000	6,805,950.00	
KAKAOBANK CORP	748	27,700.000	20,719,600.00	
KANGWON LAND INC	358	24,050.000	8,609,900.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	2,164	49,000.000	106,036,000.00	
KIA CORPORATION	1,508	66,000.000	99,528,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	515	45,850.000	23,612,750.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	1,311	19,700.000	25,826,700.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	139	55,600.000	7,728,400.00	
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	222	78,100.000	17,338,200.00	
KOREA ZINC CO LTD	53	648,000.000	34,344,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,198	25,200.000	30,189,600.00	
KRAFTON INC	150	230,000.000	34,500,000.00	
KT&G CORP	477	95,000.000	45,315,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	147,000.000	14,847,000.00	
L&F CO LTD	112	219,600.000	24,595,200.00	
LG CHEM LTD	278	704,000.000	195,712,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	321,500.000	18,004,000.00	
LG CORP	564	83,300.000	46,981,200.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,329	14,850.000	19,735,650.00	
LG ELECTRONICS INC	632	92,000.000	58,144,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	145	598,000.000	86,710,000.00	
LG H AND H CO LTD	64	663,000.000	42,432,000.00	
LG H AND H CO LTD(PFD	4	312,500.000	1,250,000.00	

LG INNOTEK CO LTD	83	307,500.000	25,522,500.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	9,400.000	12,596,000.00	
LG UPLUS CORP	815	12,050.000	9,820,750.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	167,000.000	18,871,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	22	87,400.000	1,922,800.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	281	35,950.000	10,101,950.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,040	4,630.000	4,815,200.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	6,530.000	8,567,360.00	
NAVER CORP	748	185,500.000	138,754,000.00	
NCSOFT CORPORATION	86	451,000.000	38,786,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	51,900.000	3,010,200.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	92	110,500.000	10,166,000.00	
PEARL ABYSS CORP	159	43,250.000	6,876,750.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	155	224,000.000	34,720,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	427	289,500.000	123,616,500.00	
S-1 CORPORATION	32	64,300.000	2,057,600.00	
S-OIL CORPORATION	300	88,200.000	26,460,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	103	882,000.000	90,846,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	457	121,500.000	55,525,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	336	138,500.000	46,536,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	26,617	61,800.000	1,644,930,600.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	4,658	57,100.000	265,971,800.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	821	25,550.000	20,976,550.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	177	194,000.000	34,338,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,275	5,330.000	17,455,750.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	437	66,500.000	29,060,500.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	318	701,000.000	222,918,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	186	127,500.000	23,715,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	452	34,250.000	15,481,000.00	
SD BIOSENSOR INC	218	35,100.000	7,651,800.00	
SEEGENE INC	110	32,850.000	3,613,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	2,619	36,300.000	95,069,700.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	152	77,500.000	11,780,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	115	91,400.000	10,511,000.00	
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	36	103,500.000	3,726,000.00	
SK HYNIX INC	3,090	88,400.000	273,156,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	181	61,700.000	11,167,700.00	

	SK INC	203	211,000.000	42,833,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	336	172,500.000	57,960,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	542	38,500.000	20,867,000.00	
	SKC CO LTD	129	108,500.000	13,996,500.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	1,852	5,220.000	9,667,440.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	3,811	11,750.000	44,779,250.00	
	YUHAN CORP	159	58,500.000	9,301,500.00	
韓国・ウォン　小計		87,586		5,529,370,270.00 (576,713,319)	
香港・ドル	3SBIO INC	4,000	6.880	27,520.00	
	A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	1,500	9.300	13,950.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	17.300	60,550.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	158,000	2.420	382,360.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	5.830	58,300.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	84,800	79.950	6,779,760.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	30,000	5.880	176,400.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	40,000	0.455	18,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	3.000	72,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	6,000	26.850	161,100.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	110.000	77,000.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	7,000	88.750	621,250.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	3.480	13,920.00	
	BAIDU INC-CLASS A	12,500	93.750	1,171,875.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	421,000	2.620	1,103,020.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	38,000	4.140	157,320.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	4.560	18,240.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,500	22.900	34,350.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	1.900	30,400.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	1,180	119.200	140,656.00	
	BOC AVIATION LTD	500	57.350	28,675.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.870	61,920.00	
	BYD CO LTD	4,500	184.600	830,700.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,000	23.050	69,150.00	
	CANSINO BIOLOGICS INC-H	400	120.000	48,000.00	

CGN POWER CO LTD-H	65,000	1.760	114,400.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	0.870	24,360.00	
CHINA CITIC BANK	49,000	3.200	156,800.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	2.490	19,920.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	8,500	15.920	135,320.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	531,000	4.510	2,394,810.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	14,650	9.300	136,245.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	2.200	26,400.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	3.230	48,450.00	
CHINA FEIHE LTD	17,000	5.750	97,750.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	3.590	41,285.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	15,000	8.640	129,600.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	14,000	6.840	95,760.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	11,600	13.480	156,368.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	56,000	1.630	91,280.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	5,000	8.750	43,750.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	44,000	10.520	462,880.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	27.100	97,560.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	17,000	9.500	161,500.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	8,000	10.520	84,160.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	2,000	13.640	27,280.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	17,000	32.750	556,750.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	23,000	34.550	794,650.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	10.960	109,600.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	22,900	2.460	56,334.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	20,000	6.020	120,400.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	9.020	108,240.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	23,000	19.200	441,600.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	7.890	39,450.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	14,800	16.660	246,568.00	

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	134,000	3.390	454,260.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	52,880	10.060	531,972.80	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	2.790	92,070.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	3.830	107,240.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	10,000	49.500	495,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	18,000	3.860	69,480.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	4,000	27.450	109,800.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	18,000	32.500	585,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	4,400	34.000	149,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	10,000	14.060	140,600.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	18,500	22.100	408,850.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	4.390	105,360.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	12,000	8.350	100,200.00	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	14,000	3.380	47,320.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	6.750	44,550.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	216,000	0.800	172,800.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.970	23,820.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	13.000	179,400.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	12,000	6.610	79,320.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	24,960	1.200	29,952.00	
CITIC LTD	32,000	7.500	240,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	14,500	14.600	211,700.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	24,000	3.510	84,240.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	5.600	33,600.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	48,000	2.610	125,280.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	11,000	17.060	187,660.00	
CRRC CORP LTD H	34,000	2.900	98,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	21,500	3.390	72,885.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	18,000	4.070	73,260.00	
DONGYUE GROUP	8,000	7.900	63,200.00	

ENN ENERGY HOLDINGS LTD	4,300	100.300	431,290.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	5.560	38,920.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	3,000	21.100	63,300.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	5.840	99,280.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	32.750	104,800.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	2,200	62.500	137,500.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	5,700	14.540	82,878.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	35,000	10.440	365,400.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	20.300	121,800.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	10.500	50,400.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	15,000	10.120	151,800.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	6,000	4.830	28,980.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	16,000	7.370	117,920.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	19,600	5.210	102,116.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	5,000	16.540	82,700.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	11,400	24.450	278,730.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	17.900	89,500.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	4.420	44,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,200	77.100	92,520.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	8,000	14.780	118,240.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	34.800	156,600.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	5,324	8.380	44,615.12	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	26.550	79,650.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	3.350	46,900.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	8.700	46,980.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	2,000	47.450	94,900.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	312,000	3.670	1,145,040.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	5,500	32.450	178,475.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,950	67.000	465,650.00	
JD.COM INC - CL A	12,207	218.000	2,661,126.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	6.240	12,480.00	

JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	10.620	95,580.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	4,000	5.540	22,160.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	3,000	16.760	50,280.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,000	23.850	95,400.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	7.690	19,225.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	14,000	14.480	202,720.00	
KINGSOFT CORP LTD	5,200	25.900	134,680.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	9,700	54.300	526,710.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	20,000	5.490	109,800.00	
LEGEND GROUP LTD	40,000	6.530	261,200.00	
LI NING CO LTD	13,500	57.850	780,975.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	9,000	20.100	180,900.00	
MEITUAN-B	24,700	160.400	3,961,880.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	5,300	18.760	99,428.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	2,000	6.000	12,000.00	
MINTH GROUP LTD	4,000	19.300	77,200.00	
NETEASE INC	11,800	107.300	1,266,140.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,000	16.100	96,600.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	9,800	21.300	208,740.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	5.790	17,370.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	10,200	42.900	437,580.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	123.100	123,100.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	2.400	55,200.00	
PETROCHINA CO LTD-H	122,000	3.360	409,920.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	900	45.750	41,175.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	41,000	7.300	299,300.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,600	19.600	31,360.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	36,500	42.450	1,549,425.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	3,800	14.960	56,848.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	40,000	4.390	175,600.00	
SEAZEN GROUP LTD	8,000	2.810	22,480.00	

SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	14.480	83,260.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	11.220	184,008.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	3,000	26.450	79,350.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	13.060	35,262.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,500	6.840	10,260.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	4,400	67.300	296,120.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	57,000	4.500	256,500.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	8,800	17.560	154,528.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	2,000	9.630	19,260.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	10,000	12.320	123,200.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	23,000	4.580	105,340.00	
SUNNY OPTICAL TECH	4,200	92.700	389,340.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	34,800	287.800	10,015,440.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	11.700	140,400.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	8,000	16.100	128,800.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	4,000	4.880	19,520.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3,000	14.420	43,260.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	69.250	277,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	6.580	19,740.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	28,000	5.100	142,800.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	12,000	9.200	110,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	7,000	20.050	140,350.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	2,540	84.000	213,360.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	20,500	51.650	1,058,825.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	88,400	10.300	910,520.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,400	8.210	19,704.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	26,000	9.390	244,140.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	9.150	82,350.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	4,000	12.460	49,840.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	10,000	22.250	222,500.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	2,000	21.800	43,600.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	3,200	8.590	27,488.00	

	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.640	11,280.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,100	18.560	57,536.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	3,500	37.850	132,475.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	36.100	140,790.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	30,000	9.810	294,300.00	
	ZTE CORP-H	6,200	16.460	102,052.00	
香港・ドル　小計		4,370,841		59,633,669.92 (1,070,424,369)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	3,000	259.500	778,500.00	
	ACER INC	13,000	25.050	325,650.00	
	ADVANTECH CO LTD	2,099	312.500	655,937.50	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	845.000	845,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	17,000	94.900	1,613,300.00	
	ASIA CEMENT CORP	7,000	41.250	288,750.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	4,000	256.000	1,024,000.00	
	AUO CORPORATION	32,800	16.700	547,760.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	184.000	736,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	46,000	41.900	1,927,400.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	7,870	185.500	1,459,885.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,952	17.000	339,184.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	33.500	435,500.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	83,083	13.000	1,080,079.00	
	CHINA STEEL CORP	70,000	28.400	1,988,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	21,000	109.000	2,289,000.00	
	COMPAL ELECTRONICS	13,000	21.650	281,450.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	108,000	21.400	2,311,200.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	11,000	293.000	3,223,000.00	
	E INK HOLDINGS INC	5,000	170.000	850,000.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	77,300	23.700	1,832,010.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	438.500	438,500.00	
	EVERGREEN MARINE	5,660	150.500	851,830.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	10,000	31.350	313,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	8,000	66.200	529,600.00	

FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,320	183.000	607,560.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	56,002	25.300	1,416,850.60	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	18,000	72.000	1,296,000.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	7,000	82.800	579,600.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	23,000	87.700	2,017,100.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	42,735	55.300	2,363,245.50	
GIANT MANUFACTURING	1,000	234.500	234,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	476.000	476,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	70,200	100.500	7,055,100.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	611.000	1,222,000.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	45,314	21.700	983,313.80	
INNOLUX CORPORATION	42,535	12.600	535,941.00	
INVENTEC CO LTD	8,000	25.000	200,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,280.000	2,280,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	11,000	67.400	741,400.00	
MEDIATEK INC	9,000	722.000	6,498,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	59,450	30.200	1,795,390.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	4,000	130.500	522,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	25,000	73.200	1,830,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	1,000	258.000	258,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	60.700	485,600.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	282.000	282,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	3,000	301.500	904,500.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,000	755.000	755,000.00	
PEGATRON CORP	10,000	60.300	603,000.00	
POU CHEN	7,000	32.350	226,450.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	15,000	33.650	504,750.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	265.000	530,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	15,000	71.500	1,072,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	3,000	321.000	963,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,780	44.450	434,721.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	56,244	8.540	480,323.76	
SILERGY CORP	2,000	504.000	1,008,000.00	

	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	60,074	16.950	1,018,254.30	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	8,000	55.500	444,000.00	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	50,895	14.450	735,432.75	
	TAIWAN CEMENT	34,090	33.300	1,135,197.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	60,254	25.800	1,554,553.20	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	28.000	168,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	8,000	93.800	750,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	137,000	487.000	66,719,000.00	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	22,000	44.850	986,700.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	25,000	64.100	1,602,500.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	8,000	154.000	1,232,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	68,000	45.600	3,100,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	4,000	88.100	352,400.00	
	WALSIN LIHWA CORP	15,000	43.700	655,500.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	3,795	71.800	272,481.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	156.000	312,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	17,000	21.900	372,300.00	
	WIWYNN CORP	1,000	852.000	852,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	5,760	45.850	264,096.00	
	YAGEO CORPORATION	2,387	453.500	1,082,504.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	9,000	63.000	567,000.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	59,556	20.900	1,244,720.40	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	118.500	474,000.00	
台湾・ドル　小計		1,758,155		154,022,720.31 (694,087,987)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	4,723	202.240	955,179.52	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	654	285.310	186,592.74	
	ANGLO PLATINUM LTD	287	1,647.990	472,973.13	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	2,818	297.210	837,537.78	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,248	149.860	336,885.28	
	BID CORP LTD	1,933	307.500	594,397.50	
	BIDVEST GROUP LTD	1,706	217.850	371,652.10	

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	534	1,997.910	1,066,883.94	
	CLICKS GROUP LTD	1,256	296.230	372,064.88	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	2,428	123.400	299,615.20	
	EXXARO RESOURCES LTD	1,516	211.510	320,649.16	
	FIRSTRAND LTD	29,955	65.330	1,956,960.15	
	GOLD FIELDS LTD	4,684	180.330	844,665.72	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	3,846	57.460	220,991.16	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	4,521	198.520	897,508.92	
	KUMBA IRON ORE LTD	436	488.210	212,859.56	
	MR PRICE GROUP LTD	1,395	185.220	258,381.90	
	MTN GROUP LTD	9,955	131.600	1,310,078.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	1,332	117.860	156,989.52	
	NASPERS LTD-N SHS	1,231	2,560.840	3,152,394.04	
	NEDBANK GROUP LTD	2,522	220.000	554,840.00	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	1,207	99.640	120,265.48	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	1,947	192.950	375,673.65	
	OLD MUTUAL LTD	28,719	11.150	320,216.85	
	REINET INVESTMENTS SCA	764	296.410	226,457.24	
	REMGRO LTD	2,748	136.980	376,421.04	
	SANLAM LIMITED	9,720	54.920	533,822.40	
	SASOL LTD	3,082	297.180	915,908.76	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	2,531	247.840	627,283.04	
	SIBANYE STILLWATER LTD	15,663	44.430	695,907.09	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	596	137.330	81,848.68	
	STANDARD BANK GROUP LTD	7,811	178.860	1,397,075.46	
	VODACOM GROUP LTD	4,205	122.040	513,178.20	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	6,082	67.000	407,494.00	
南アフリカ・ランド　小計		165,055		21,971,652.09 (178,409,815)	
合計		13,705,513		4,419,549,027 (4,419,549,027)	

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	8,635.00	306,542.50	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	19,503.00	406,774.07	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	38,012.00	1,544,047.44	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	31,508.00	491,524.80	
	アメリカ・ドル　小計		97,658.00	2,748,888.81 (385,834,033)	

投資信託受益証券　合計			97,658	385,834,033 (385,834,033)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	18,800.00	441,612.00	
	メキシコ・ペソ　小計		18,800.00	441,612.00 (3,185,392)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	19,627.00	271,637.68	
	南アフリカ・ランド　小計		19,627.00	271,637.68 (2,205,698)	
投資証券　合計			38,427	5,391,090 (5,391,090)	
合計				391,225,123 (391,225,123)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式 48銘柄	2.67	－	－	11.03
	投資信託受益証券 4銘柄	－	7.11	－	
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.00	－	－	0.00
インド・ルピー	株式 105銘柄	13.24	－	－	14.94
インドネシア・ルピア	株式 24銘柄	1.80	－	－	2.03
オフショア・人民元	株式 201銘柄	4.47	－	－	5.04
コロンビア・ペソ	株式 4銘柄	0.12	－	－	0.13
タイ・バーツ	株式 42銘柄	1.87	－	－	2.11
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.15	－	－	0.17
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.47	－	－	0.53
トルコ・リラ	株式 9銘柄	0.40	－	－	0.45
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.17	－	－	0.19
フィリピン・ペソ	株式 19銘柄	0.67	－	－	0.76
ブラジル・レアル	株式 45銘柄	4.70	－	－	5.30
ポーランド・ズロチ	株式 13銘柄	0.58	－	－	0.65
マレーシア・リンギット	株式 34銘柄	1.26	－	－	1.43
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄	2.15	－	－	2.49
	投資証券 1銘柄	－	－	0.06	
ユーロ	株式 6銘柄	0.27	－	－	0.31
韓国・ウォン	株式 109銘柄	10.62	－	－	11.99
香港・ドル	株式 185銘柄	19.72	－	－	22.25
台湾・ドル	株式 81銘柄	12.78	－	－	14.43
南アフリカ・ランド	株式 34銘柄	3.29	－	－	3.75
	投資証券 1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	38,350,750
金銭信託	18,676
コール・ローン	6,631,997
国債証券	1,414,226,249
派生商品評価勘定	21,994
未収利息	11,605,249
前払費用	2,370,157
流動資産合計	1,473,225,072
資産合計	1,473,225,072
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,068
未払金	17,169,694
未払解約金	242,635
その他未払費用	6
流動負債合計	17,413,403
負債合計	17,413,403
純資産の部	
元本等	
元本	1,261,138,911
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	194,672,758
元本等合計	1,455,811,669
純資産合計	1,455,811,669
負債純資産合計	1,473,225,072

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11月23日 至　2022年11月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,030,988,108円
同期中追加設定元本額	242,291,064円
同期中一部解約元本額	12,140,261円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	982,312,277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）	55,160,928円
ニッセイ新興国債券インデックス（ラップ専用）	215,590,486円
ＦＷニッセイ新興国債インデックス	8,075,220円
計	1,261,138,911円
２．　受益権の総数	1,261,138,911口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年11月23日 至　2022年11月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△136,646,383
合計	△136,646,383

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月21日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	9,123,253	－	9,144,179	20,926
アメリカ・ドル	9,123,253	－	9,144,179	20,926
合計	9,123,253	－	9,144,179	20,926

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1544円 (11,544円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	178,858.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	141,934.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	191,838.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	162,122.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	174,804.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	184,314.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	178,458.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	177,828.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	179,184.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	117,967.50	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	126,010.50	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	108,550.50	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	122,925.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	133,426.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	182,060.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	138,706.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	170,612.00	
		HUNGARY	200,000.00	150,880.00	
		HUNGARY	200,000.00	119,740.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	197,846.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	179,058.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	198,738.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	142,958.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	168,262.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	142,586.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	165,792.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	158,288.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	130,792.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	145,758.00	

		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	142,292.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	163,566.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	182,672.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	135,060.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	147,014.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	142,544.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	146,578.00	
		REPUBLIC OF PERU	180,000.00	148,912.20	
		REPUBLIC OF PERU	110,000.00	62,780.30	
		REPUBLIC OF PERU	60,000.00	42,154.20	
		REPUBLIC OF PERU	100,000.00	79,065.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	183,702.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	140,560.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	177,120.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	143,188.00	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	120,000.00	110,110.80	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	100,000.00	98,424.00	
		ROMANIA	70,000.00	44,462.60	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	190,710.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	196,794.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	196,278.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	181,754.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	195,900.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	171,000.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	159,482.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	195,604.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	194,530.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	187,804.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	190,844.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	177,438.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	192,136.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	188,684.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	162,394.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	128,862.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	156,458.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	148,534.00	
	アメリカ・ドル　小計		12,090,000.00 (1,696,952,400)	10,075,707.10 (1,414,226,249)	
国債証券　合計			1,696,952,400 (1,696,952,400)	1,414,226,249 (1,414,226,249)	
合計				1,414,226,249 (1,414,226,249)	

（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　65銘柄	97.14	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】
【純資産額計算書】

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	520,968,561円
Ⅱ　負債総額	2,884,385円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	518,084,176円
Ⅳ　発行済数量	390,078,047口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3282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11月30日現在

Ⅰ　資産総額	184,923,605,060円
Ⅱ　負債総額	501,135,606円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	184,422,469,454円
Ⅳ　発行済数量	80,629,432,761口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2873円

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	69,839,673,869円
Ⅱ　負債総額	1,475,420,567円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	68,364,253,302円
Ⅳ　発行済数量	72,463,022,985口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9434円

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	32,840,672,554円
Ⅱ　負債総額	113,396,171円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,727,276,383円
Ⅳ　発行済数量	16,957,273,337口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9300円

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	600,322,423,758円
Ⅱ　負債総額	11,613,644,288円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	588,708,779,470円
Ⅳ　発行済数量	193,979,123,187口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0349円

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	**56,732,822,703円**
Ⅱ　負債総額	**329,246,582円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**56,403,576,121円**
Ⅳ　発行済数量	**36,965,966,757口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.5258円**

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	**5,921,645,859円**
Ⅱ　負債総額	**27,487,973円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**5,894,157,886円**
Ⅳ　発行済数量	**4,163,544,676口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4157円**

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	**5,522,640,217円**
Ⅱ　負債総額	**26,467,780円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**5,496,172,437円**
Ⅳ　発行済数量	**4,778,253,216口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.1502円**

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	**1,518,351,880円**
Ⅱ　負債総額	**27,593,254円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**1,490,758,626円**
Ⅳ　発行済数量	**1,279,202,680口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.1654円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2022年11月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年11月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	417	71,983
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	148	24,722
単位型公社債投資信託	0	0
合計	565	96,705

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

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

(1)　委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
　財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2)　当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。
　中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．監査証明について

　当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第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。
　また、第28期事業年度に係る中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部				
流動資産				
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
固定資産				
有形固定資産				
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
無形固定資産				
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
投資その他の資産				
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		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		75,152,647		75,984,720
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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△5,500,048	△5,500,048	△5,500,048
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	11,800,283	11,800,283	11,800,283
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	6,300,235	6,300,235	6,300,235
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197

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

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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197
当期変動額										
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	①　満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②　その他有価証券 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。 ③　関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①　賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。 ②　退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 ③　役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

５．収益及び費用の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 ①投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 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。 ②投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 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。 ③投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 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。
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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。
７．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 ③ヘッジ方針 ヘッジ指定は、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。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
８．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

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

(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

①配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

①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

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

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△で示しております。

なお、投資信託の時価は上記に含めておりません。投資信託の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）
①現金・預金	40,822,894	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	―	15,020,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	2,802,653	17,140,145	2,093,118	―
合計	43,625,547	32,160,145	2,093,118	―

（注）投資信託受益証券であります。

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）
①現金・預金	38,492,350	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,250,000	11,070,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	14,512,369	12,884,500	1,627,869
	小計	14,512,369	12,884,500	1,627,869
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	7,527,550	7,711,000	△183,449
	小計	7,527,550	7,711,000	△183,449
合計		22,039,919	20,595,500	1,444,419

（注１）投資信託受益証券等であります。

（注２）関係会社株式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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第28期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,922,736
有価証券		4,999,607
前払費用		696,927
未収委託者報酬		6,102,711
未収運用受託報酬		4,547,678
未収投資助言報酬		301,446
その他		13,613
流動資産合計		48,584,722
固定資産		
有形固定資産	※1	250,910
無形固定資産		2,748,851
投資その他の資産		
投資有価証券		29,022,996
関係会社株式		66,222
長期前払費用		14,976
差入保証金		371,537
繰延税金資産		1,550,185
その他		10,037
投資その他の資産合計		31,035,955
固定資産合計		34,035,717
資産合計		82,620,440

負債の部		
流動負債		
預り金		54,545
未払収益分配金		8,607
未払手数料		2,259,195
未払運用委託報酬		1,309,778
未払投資助言報酬		839,490
その他未払金		2,191,391
未払費用		176,836
未払法人税等		596,860
未払消費税等	※2	331,280
前受投資助言報酬		42,288
賞与引当金		591,419
その他		106,326
流動負債合計		8,508,020
固定負債		
退職給付引当金		2,480,768
役員退職慰労引当金		18,550
固定負債合計		2,499,318
負債合計		11,007,339
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		53,328,702
利益剰余金合計		54,008,509
株主資本合計		72,290,349
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△ 332,677
繰延ヘッジ損益		△ 344,570
評価・換算差額等合計		△ 677,248
純資産合計		71,613,100
負債・純資産合計		82,620,440

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第28期中間会計期間 （自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		14,131,708
運用受託報酬		9,006,031
投資助言報酬		601,508
その他営業収益		1,755
営業収益計		23,741,004
営業費用		10,519,635
一般管理費	※1	5,778,920
営業利益		7,442,448
営業外収益	※2	367,562
営業外費用	※3	1,953
経常利益		7,808,057
特別利益	※4	43,744
特別損失	※5	35,137
税引前中間純利益		7,816,664
法人税、住民税及び事業税		2,145,754
法人税等調整額		199,594
法人税等合計		2,345,349
中間純利益		5,471,315

(3)中間株主資本等変動計算書

第28期中間会計期間(自 2022年4月１日　至 2022年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△9,008,883	△9,008,883	△9,008,883
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	5,471,315	5,471,315	5,471,315
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	△3,537,568	△3,537,568	△3,537,568
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	53,328,702	54,008,509	72,290,349

	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	348,871	△192,067	156,803	75,984,720
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△9,008,883
中間純利益	-	-	-	5,471,315
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△681,548	△152,502	△834,051	△834,051
当中間期変動額合計	△681,548	△152,502	△834,051	△4,371,620
当中間期末残高	△332,677	△344,570	△677,248	71,613,100

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第28期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②その他有価証券 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 ③関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 ②退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 ③役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

５．収益及び費用の計上基準	**当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。** **①投資信託委託業務** **投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。** **当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。** **②投資運用業務** **投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。** **当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。** **③投資助言業務** **投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。** **当該契約については、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。**
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	**外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。**
７．ヘッジ会計の方法	**①ヘッジ会計の方法** **繰延ヘッジ処理によっております。** **②ヘッジ手段とヘッジ対象** **ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。** **ヘッジ手段・・・為替予約** **ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券** **③ヘッジ方針** **ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。** **④ヘッジ有効性評価の方法** **ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。**
８．グループ通算制度の適用	**当社は日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算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。**

（会計方針の変更）

「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。以下「時価算定基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計基準を将来にわたって適用することとしております。なお、中間財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）	
※１．有形固定資産の減価償却累計額	860,224千円
※２．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
※１．減価償却の実施額	
有形固定資産	30,875千円
無形固定資産	282,557千円
※２．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	182,529千円
為替差益	179,198千円
※３．営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	1,685千円
※４．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	43,213千円
※５．特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	34,624千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間
（自 2022年4月1日
至 2022年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月30日定時株主総会	普通株式	9,008,883	83,071	2022年3月31日	2022年6月30日

（金融商品関係）

第28期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

１．金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。なお、市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
①有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,607	5,000,670	1,062
その他有価証券	－	－	－
②投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,489,858	10,470,611	△19,247
その他有価証券	18,533,138	18,533,138	－
③デリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	－	－	－
ヘッジ会計が適用されているもの	△92,614	△92,614	－

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

（注１）市場価格のない株式等

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

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

第28期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

区分	時価（千円）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券				
その他有価証券	－	18,533,138	－	18,533,138
デリバティブ取引（※）				
為替予約	－	△92,614	－	△92,614
合計	－	18,440,523	－	18,440,523

(※)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。

（２）時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

第28期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

区分	時価（千円）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	－	15,471,281	－	15,471,281
合計	－	15,471,281	－	15,471,281

（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。

市場における取引価格が存在しない投資信託について、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額を時価とし、レベル２の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

１．満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	5,299,607	5,300,720	1,112
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	5,299,607	5,300,720	1,112
時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	10,189,858	10,170,561	△19,297
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	10,189,858	10,170,561	△19,297
合計		15,489,466	15,471,281	△18,185

２．その他有価証券

	種類	取得原価または償却原価（千円）	中間貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	－	－	－
	(2)債券	－	－	－
	①国債・地方債等	－	－	－
	②社債	－	－	－
	③その他	－	－	－
	(3)その他（注）	6,807,000	7,311,616	504,616
	小計	6,807,000	7,311,616	504,616
中間貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	－	－	－
	(2)債券	－	－	－
	①国債・地方債等	－	－	－
	②社債	－	－	－
	③その他	－	－	－
	(3)その他（注）	12,322,000	11,221,521	△1,100,478
	小計	12,322,000	11,221,521	△1,100,478
合計		19,129,000	18,533,138	△595,861

（注）投資信託受益証券等であります。

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第28期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

第28期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	1,245,366	－	△92,614
合計			1,245,366	－	△92,614

（注１）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

区分	第28期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	14,131,708千円
投資運用業務	9,006,031千円
投資助言業務	601,508千円
その他	1,755千円
計	23,741,004千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第28期中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第28期中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	3,172,123

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]
第28期中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）
該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]
第28期中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）
該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]
第28期中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第28期中間会計期間 （自 2022年4月１日 至 2022年9月30日）
1株当たり純資産額	660,345円05銭
1株当たり中間純利益金額	50,451円05銭

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

中間純利益金額	5,471,315千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る中間純利益金額	5,471,315千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）
第28期中間会計期間（自 2022年4月1日　至 2022年9月30日）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

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ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	
Ｊトラストグローバル証券株式会社	3,000	
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
ニュース証券株式会社	1,000	
楽天証券株式会社	17,495	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
PayPay銀行株式会社	37,250	

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

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】

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

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

第３【その他】

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

独立監査人の監査報告書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月17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

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）の2021年11月23日から2022年11月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）の2022年11月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　樋　口　誠　之

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　大　竹　新

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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