【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月20日提出
【計算期間】	第4期（自　2021年12月21日　至　2022年12月20日） ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０ 第6期（自　2021年12月21日　至　2022年12月20日） ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５ 第7期（自　2021年12月21日　至　2022年12月20日） ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５ 第1期（自　2022年1月11日　至　2022年12月20日） ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５
【ファンド名】	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０ ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　大関　洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部　　茶木　健
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

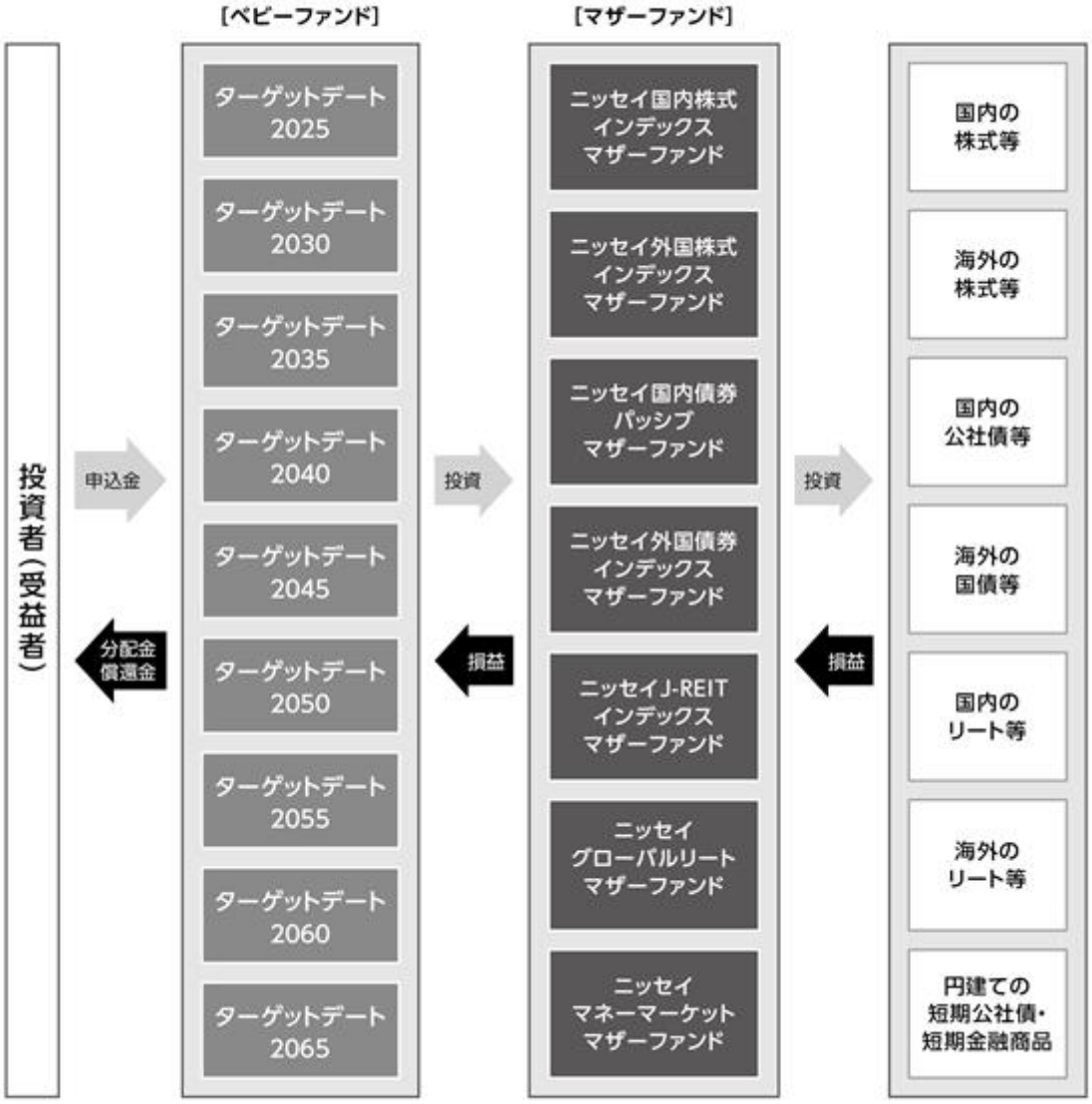
（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　基本方針

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

②　運用の形態

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



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

③　ファンドの特色

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

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

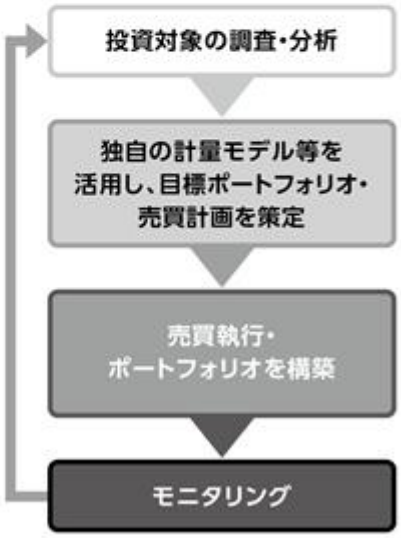
※為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

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

●マザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債に実質的な投資を行います。

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

〈マザーファンドの運用プロセス〉



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

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

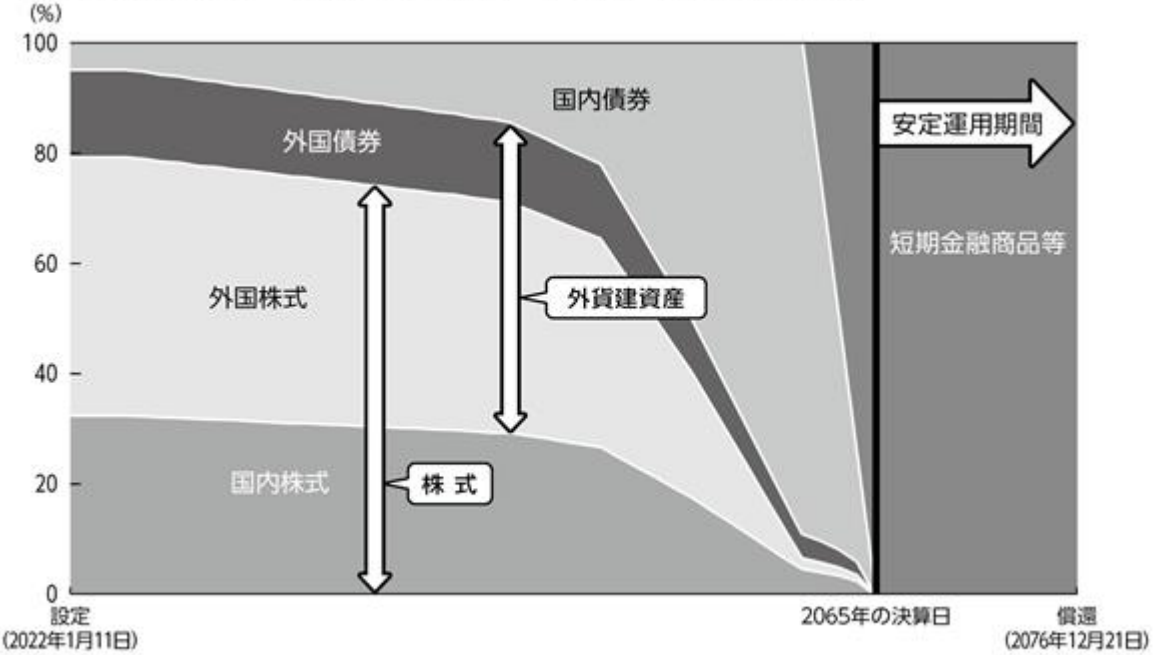
●当初設定時の基本資産配分を参考にポートフォリオを構築し、安定運用開始時期に近づくにしたがって株式の組入れを漸減させ、国内債券や短期金融商品等の組入れを漸増させること等により、長期的にリスクを低減させていく運用を行います。

●安定運用開始時期の到来以降は、原則として短期金融商品等に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。
・市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

〈各ファンドの安定運用開始時期（ターゲットデート）〉

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

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



・上記は2022年12月末現在で計画している基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。将来の基本資産配分比率は、市況動向等により変更となる場合があります。

〈2022年12月末現在の基本資産配分〉

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
DCニッセイターゲットデートファンド2025	4.2%	1.8%	65.1%	3.9%	25.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2030	13.4%	15.8%	63.0%	7.8%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2035	23.2%	31.8%	33.1%	11.9%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2040	28.5%	40.2%	17.2%	14.1%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2045	30.0%	42.7%	12.6%	14.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2050	30.7%	43.8%	10.5%	15.0%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2055	31.4%	45.1%	8.1%	15.4%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2060	32.2%	46.3%	5.9%	15.6%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2065	32.6%	46.9%	4.7%	15.8%	0.0%

・実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。なお、2022年12月末現在においては、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンドは組入れを行っていません。

〈当初設定時の基本資産配分〉

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

・各ファンドの設定日は以下の通りです。
DCニッセイターゲットデートファンド2055：2016年7月29日
DCニッセイターゲットデートファンド2025／2035／2045：2017年7月31日
DCニッセイターゲットデートファンド2030／2040／2050／2060：2019年1月10日
DCニッセイターゲットデートファンド2065：2022年1月11日

〈各インデックスについて〉

●TOPIX（東証株価指数）

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

●MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●NOMURA−BPI総合

日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村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。

●東証REIT指数

東証REIT指数とは、東証市場に上場する不動産投資信託（Real Estate Investment Trust）全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。
東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

●S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「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」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

＜ＭＳＣＩ指数にかかる免責条項等＞

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

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

（２）【ファンドの沿革】

「ターゲットデート２０５５」

2016年7月29日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

「ターゲットデート２０２５／２０３５／２０４５」

2017年7月31日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

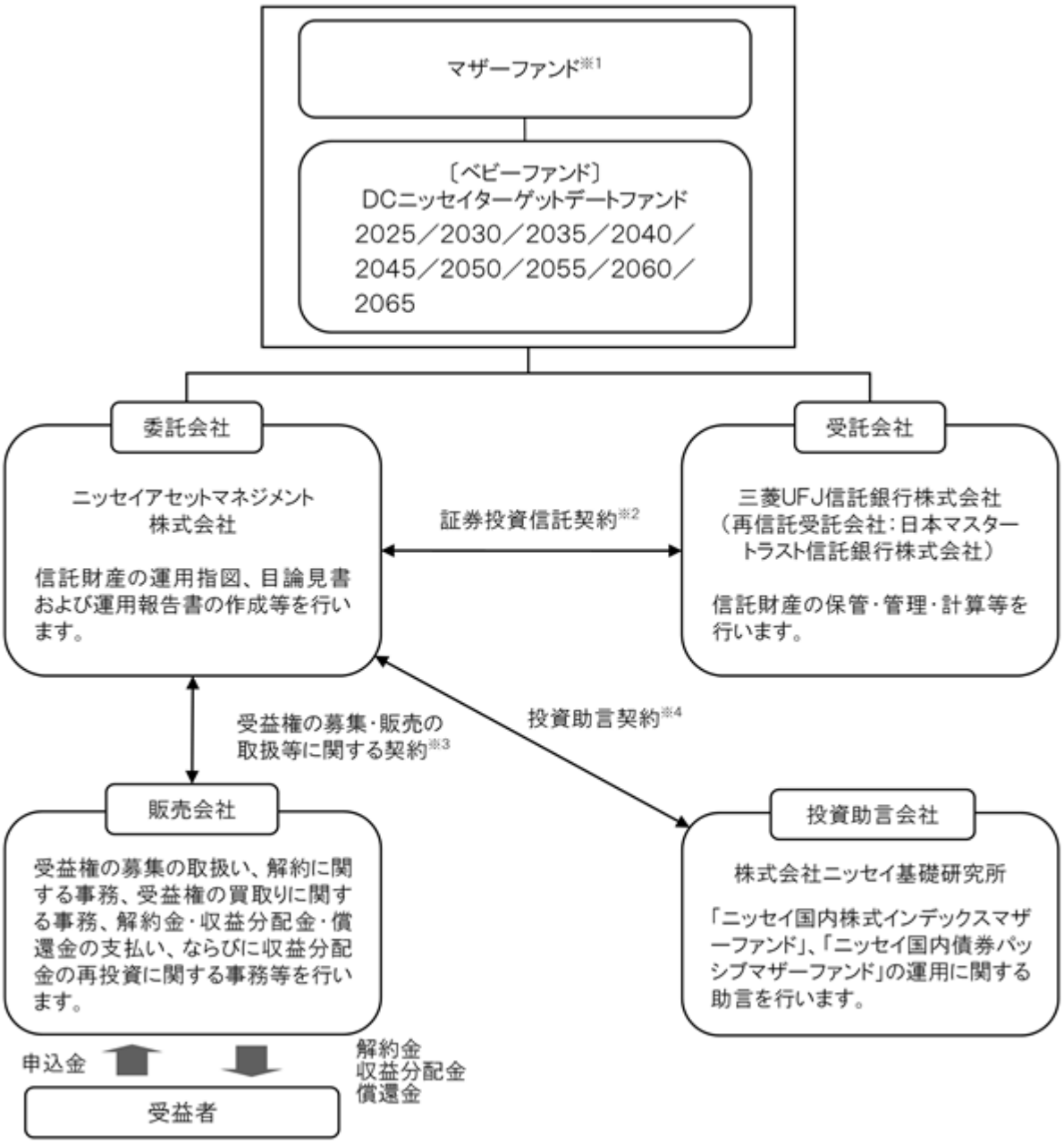
「ターゲットデート２０３０／２０４０／２０５０／２０６０」

2019年1月10日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

「ターゲットデート２０６５」

2022年1月11日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



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

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

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

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

委託会社の概況（2022年12月末現在）

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

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

・大株主の状況

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

「ターゲットデート２０２５」

① 主として、複数のマザーファンド※を通じて、実質的に国内外の株式（リートを含みます。以下同じ）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資を行います。また、将来の市場構造の変化等によっては、投資対象とするマザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

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

② 当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：20.6%
外国株式：14.7%
国内債券：58.7%
外国債券： 6.0%

③ 資産配分は、時間の経過により西暦2025年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④ 西暦2025年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤ マザーファンドの組入は、原則として高位を維持します。

⑥ 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。

⑦ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

「ターゲットデート２０３０」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：29.1%
外国株式：21.2%
国内債券：41.8%
外国債券：　7.9%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2030年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2030年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０３５」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：40.2%
外国株式：29.8%
国内債券：19.5%
外国債券：10.5%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2035年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2035年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０４０」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：41.4%
外国株式：30.7%
国内債券：17.1%
外国債券：10.8%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2040年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2040年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０４５」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：43.1%
外国株式：31.9%
国内債券：13.8%
外国債券：11.2%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2045年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2045年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０５０」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：43.8%
外国株式：32.4%
国内債券：12.5%
外国債券：11.3%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2050年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2050年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０５５」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：45.6%
外国株式：33.8%
国内債券：　8.9%
外国債券：11.7%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2055年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2055年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０６０」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：45.7%
外国株式：34.0%
国内債券：　8.5%
外国債券：11.8%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2060年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2060年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

「ターゲットデート２０６５」

①　（「ターゲットデート２０２５」の①と同規定）

②　当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：32.6%
外国株式：46.9%
国内債券：　4.7%
外国債券：15.8%

③　資産配分は、時間の経過により西暦2065年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④　西暦2065年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤　（「ターゲットデート２０２５」の⑤と同規定）

⑥　（「ターゲットデート２０２５」の⑥と同規定）

⑦　（「ターゲットデート２０２５」の⑦と同規定）

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

※　金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号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（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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

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

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

③　組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

（３）投資制限

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

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

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

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

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

ニッセイ外国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。

ニッセイグローバルリートマザーファンド

（1）基本方針

このマザーファンドは、Ｓ＆Ｐグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行うことを基本方針とします。

（2）運用方法

ａ　投資対象

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

ｂ　投資態度

①　主として、日本を除く世界各国の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している不動産投資信託証券に投資することにより、Ｓ＆Ｐグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

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割合には、制限を設けません。

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。

ニッセイマネーマーケットマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

円建ての短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

b　投資態度

① 円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

② 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。

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は行いません。

⑥ 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。

⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（２）【投資対象】

ａ　主な投資対象

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

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

ｂ　約款に定める投資対象

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

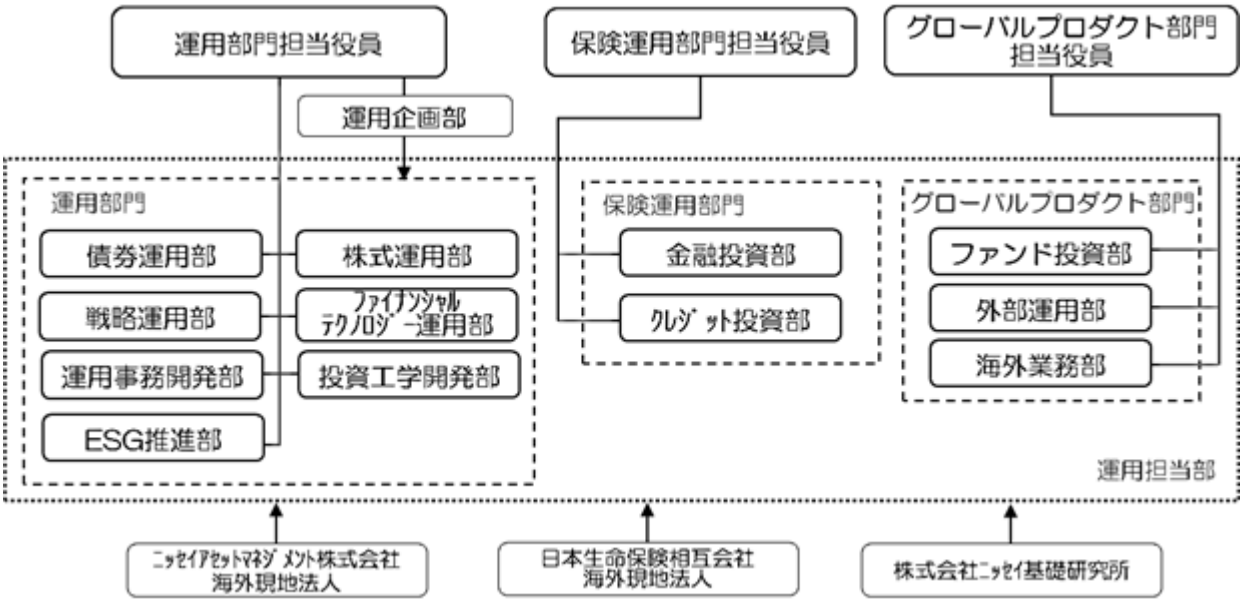
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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。

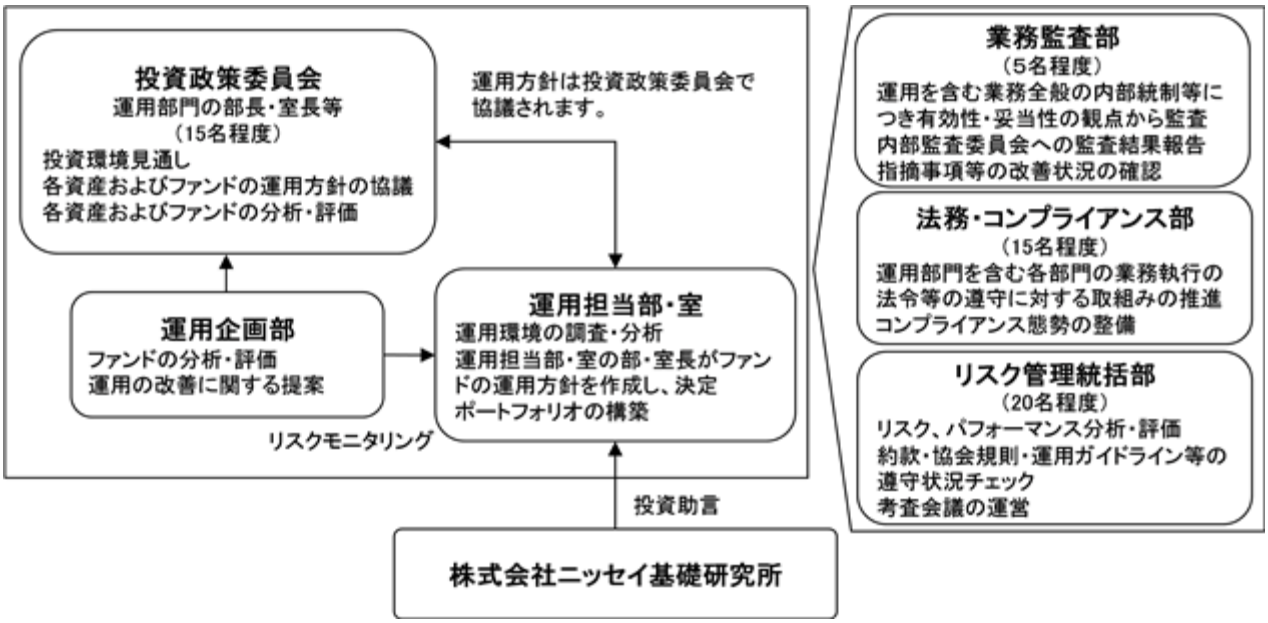
（３）【運用体制】

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、残存信託期間等を勘案して決定します。

３．留保益の運用方針

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

②　分配時期

毎決算日とし、決算日は12月20日（年１回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

③　支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

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

＜分配金再投資コースの場合＞

税金を差引いた後※、自動的に無手数料で再投資されます。

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

○　将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式への実質投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

④　デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

⑤　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

⑥　同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑦　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。

⑧　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。

⑨　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。

⑩　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。

⑪　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

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

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

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

②　信用取引の範囲

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

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

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

③　先物取引等

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

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

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

④　スワップ取引

１．信託財産に属する資産を効率的に運用するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。

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

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

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

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

６．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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．信託財産に属する資産を効率的に運用するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

４．金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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の50%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の50%を超えないものとします。

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

３．有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、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．信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

・短期金融資産の運用に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

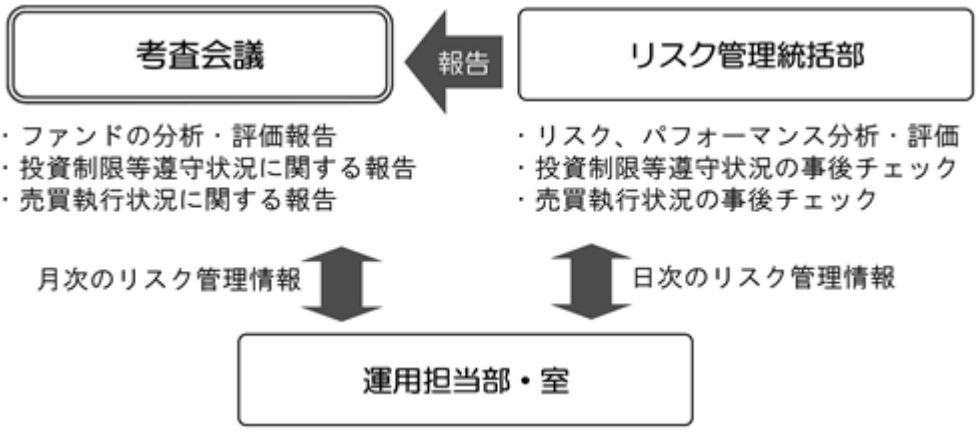
委託会社は2022年12月20日現在、「ターゲットデート2065」を0.9百万円（受益権口数１百万口、ファンド全体の1.0%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

（2）投資リスク管理体制



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

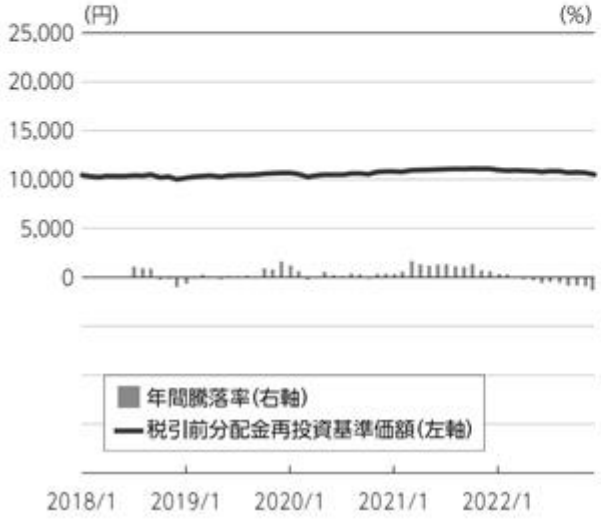
○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

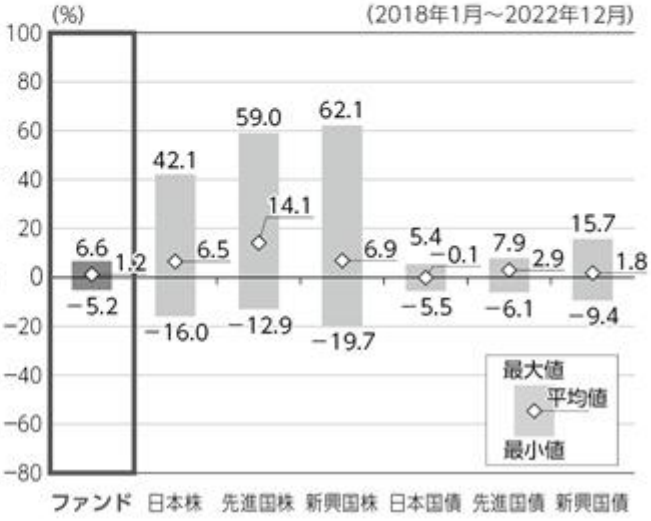
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

◉DCニッセイターゲットデートファンド2025

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移



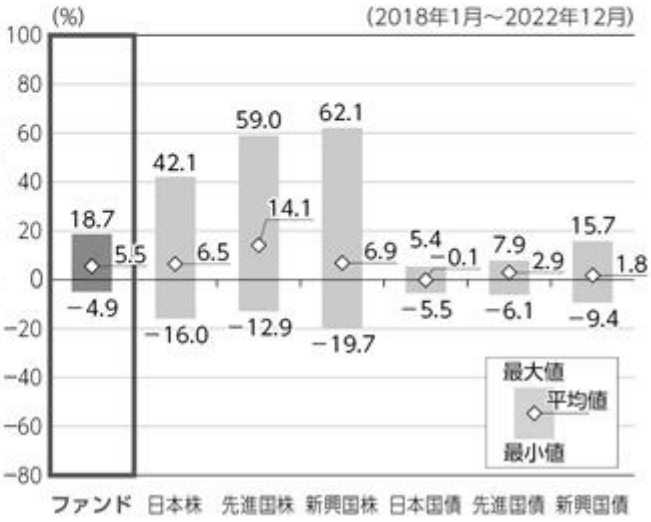
②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



◉DCニッセイターゲットデートファンド2030

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

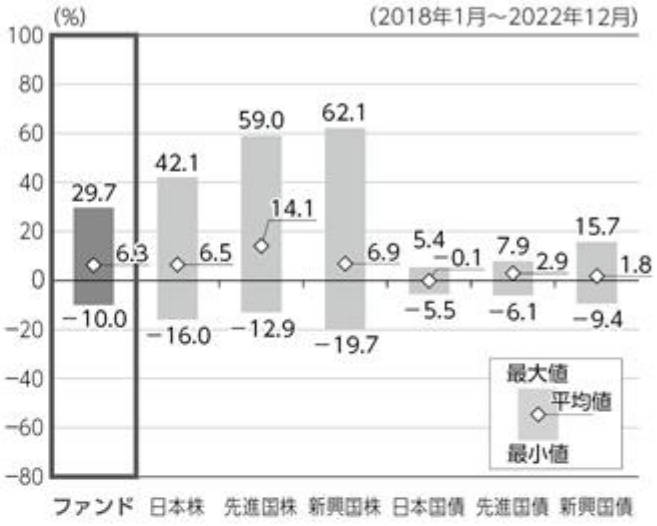
②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



◉DCニッセイターゲットデートファンド2035

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移

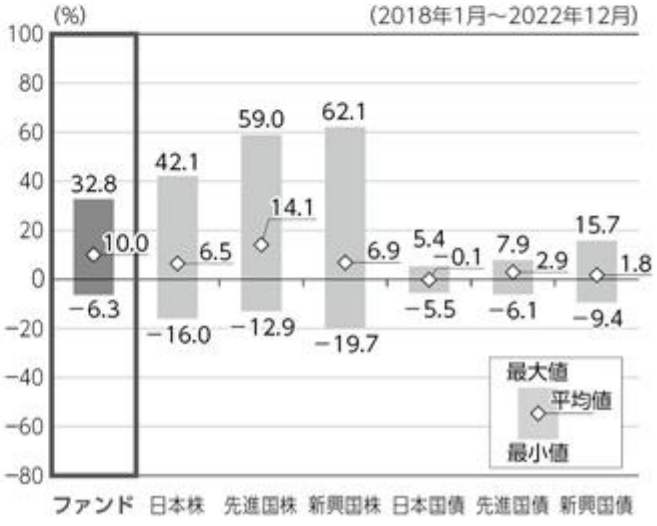
②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



◉DCニッセイターゲットデートファンド2040

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移

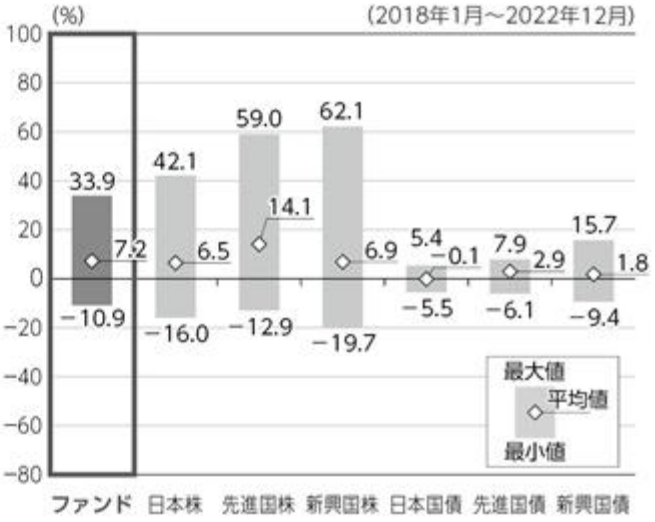
②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



◉DCニッセイターゲットデートファンド2045

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移

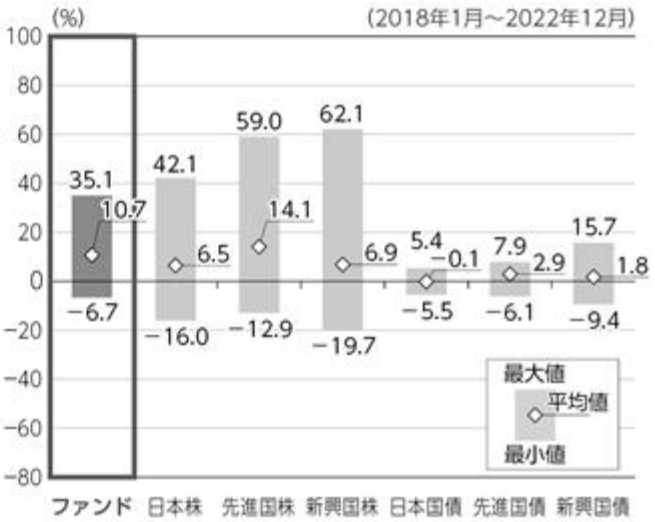
②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



◉DCニッセイターゲットデートファンド2050

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移

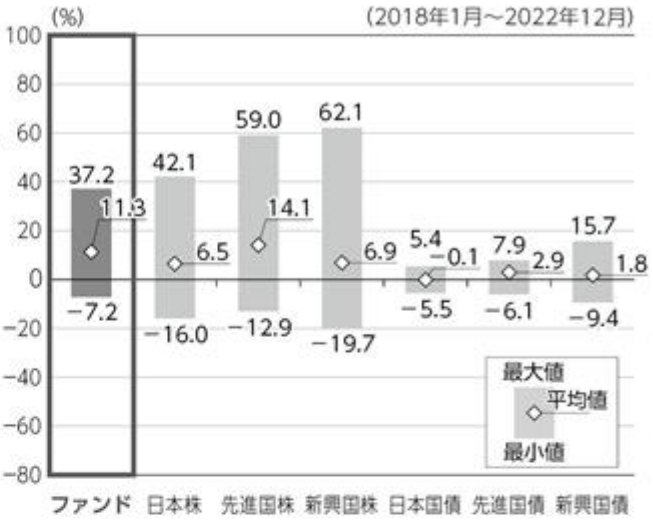
②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



◉DCニッセイターゲットデートファンド2060

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

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

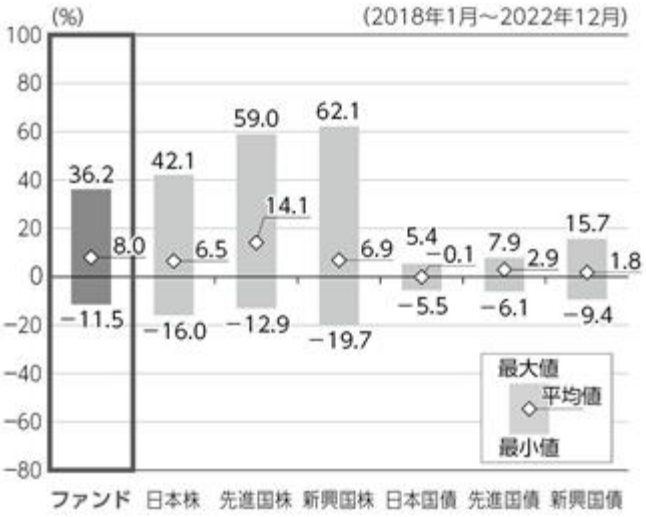
・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
・NOMURA-BPI 国債とは、野村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。

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

◉DCニッセイターゲットデートファンド2055

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>
日 本 株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債 … NOMURA-BPI 国債
先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(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。

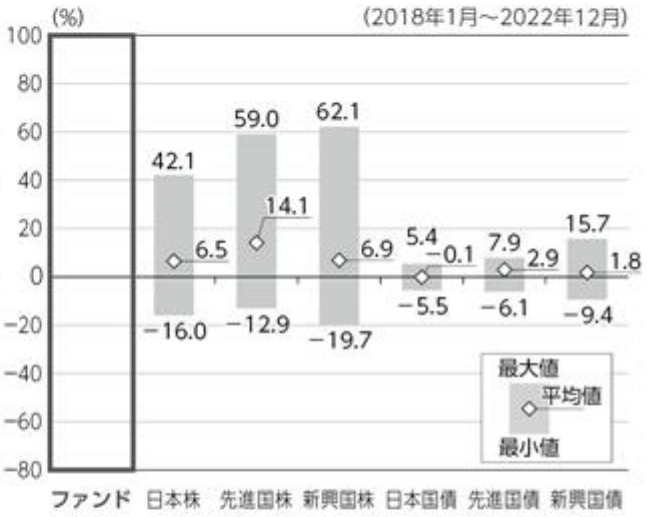
・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数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。

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

◉DCニッセイターゲットデートファンド2065

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の月末データが1年に満たないため、騰落率を記載していません。

・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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 各ファンドにおいて、信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

[ターゲットデート2025]

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

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

[ターゲットデート2030]

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

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

[ターゲットデート2035]

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

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

[ターゲットデート2040]

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

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

[ターゲットデート2045]

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

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

[ターゲットデート2050]

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

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

[ターゲットデート2055]

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

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

[ターゲットデート2060]

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

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

[ターゲットデート2065]

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

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

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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下記の監査報酬率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

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

＜ご参考＞

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

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

（５）【課税上の取扱い】

≪確定拠出年金としてファンドを取得した場合≫

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

≪確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合≫

課税対象

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

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

買取請求時：買取請求時の買取価額と取得価額※の差益に対して課税されます。

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

個人の課税の取扱い

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

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

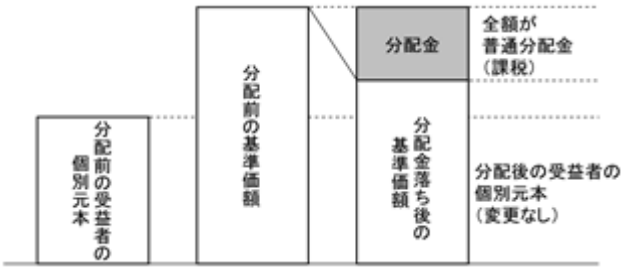
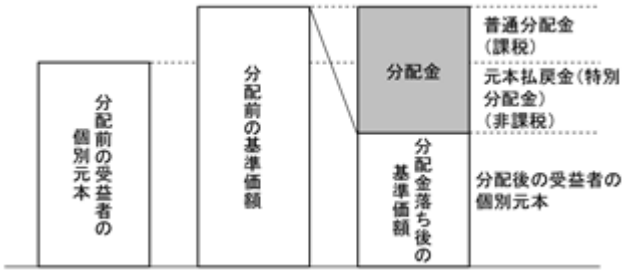
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		2,538,233,193	100.00
	内　日本	2,538,233,193	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△11,222	△0.00
純資産総額		2,538,221,971	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		3,421,071,103	100.00
	内　日本	3,421,071,103	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△23,259	△0.00
純資産総額		3,421,047,844	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

2022年12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		5,341,085,640	100.00
	内　日本	5,341,085,640	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△36,239	△0.00
純資産総額		5,341,049,401	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		2,252,012,550	100.00
	内　日本	2,252,012,550	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△15,269	△0.00
純資産総額		2,251,997,281	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		2,385,415,109	100.00
	内　日本	2,385,415,109	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△16,228	△0.00
純資産総額		2,385,398,881	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

2022年12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		979,598,044	100.00
	内　日本	979,598,044	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△6,683	△0.00
純資産総額		979,591,361	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		1,952,170,860	100.00
	内　日本	1,952,170,860	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△13,315	△0.00
純資産総額		1,952,157,545	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		1,407,149,047	100.00
	内　日本	1,407,149,047	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△9,563	△0.00
純資産総額		1,407,139,484	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

2022年12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		96,291,627	100.00
	内　日本	96,291,627	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△662	△0.00
純資産総額		96,290,965	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（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12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		173,598,983,220	98.16
	内　日本	173,598,983,220	98.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,245,817,245	1.84
純資産総額		176,844,800,465	100.00

その他資産の投資状況

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		3,215,550,000	1.82
	内　日本	3,215,550,000	1.82

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		527,846,999,629	94.03
	内　アメリカ	370,206,179,832	65.95
	内　イギリス	24,346,711,488	4.34
	内　カナダ	20,243,942,215	3.61
	内　スイス	18,894,884,988	3.37
	内　フランス	18,142,585,135	3.23
	内　ドイツ	13,265,946,664	2.36
	内　オーストラリア	12,029,059,112	2.14
	内　オランダ	9,552,732,383	1.70
	内　アイルランド	7,355,902,117	1.31
	内　スウェーデン	5,534,047,744	0.99
	内　デンマーク	4,878,687,382	0.87
	内　香港	4,269,076,137	0.76
	内　スペイン	4,007,381,849	0.71
	内　イタリア	3,235,910,522	0.58
	内　シンガポール	1,969,851,250	0.35
	内　フィンランド	1,687,064,459	0.30
	内　ベルギー	1,651,135,336	0.29
	内　ノルウェー	1,282,234,076	0.23
	内　ジャージィー	1,171,590,864	0.21
	内　イスラエル	991,639,758	0.18
	内　オランダ領キュラソー	860,674,488	0.15
	内　バミューダ	570,536,086	0.10
	内　ケイマン諸島	414,277,474	0.07
	内　ポルトガル	383,657,170	0.07
	内　ニュージーランド	334,192,722	0.06
	内　オーストリア	315,390,354	0.06
	内　ルクセンブルグ	251,708,024	0.04
投資証券		12,186,882,927	2.17
	内　アメリカ	10,484,078,864	1.87
	内　オーストラリア	719,249,170	0.13
	内　シンガポール	249,098,267	0.04
	内　イギリス	235,408,940	0.04
	内　フランス	211,859,049	0.04
	内　香港	177,464,694	0.03
	内　カナダ	58,740,894	0.01
	内　ベルギー	50,983,049	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		21,316,865,690	3.80
純資産総額		561,350,748,246	100.00

その他資産の投資状況

2022年12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）		19,797,373,382	3.53
	内　アメリカ	14,642,764,912	2.61
	内　ドイツ	3,690,218,070	0.66
	内　イギリス	1,464,390,400	0.26

（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12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		52,505,003,400	77.61
	内　日本	52,505,003,400	77.61
地方債証券		3,652,373,622	5.40
	内　日本	3,652,373,622	5.40
特殊債券		5,680,368,553	8.40
	内　日本	5,680,368,553	8.40
社債券		5,295,066,300	7.83
	内　日本	4,896,509,300	7.24
	内　スウェーデン	200,189,000	0.30
	内　フランス	198,368,000	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		520,151,642	0.77
純資産総額		67,652,963,517	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		54,568,791,346	98.98
	内　アメリカ	27,714,415,714	50.27
	内　フランス	4,691,250,335	8.51
	内　イタリア	4,108,420,555	7.45
	内　ドイツ	3,676,473,382	6.67
	内　スペイン	2,763,012,688	5.01
	内　イギリス	2,526,671,616	4.58
	内　中国	1,925,057,067	3.49
	内　カナダ	1,119,880,530	2.03
	内　ベルギー	1,022,516,596	1.85
	内　オランダ	874,599,971	1.59
	内　オーストラリア	864,935,684	1.57
	内　オーストリア	646,674,708	1.17
	内　メキシコ	470,293,905	0.85
	内　アイルランド	350,678,062	0.64
	内　マレーシア	300,423,114	0.54
	内　フィンランド	283,699,329	0.51
	内　シンガポール	261,516,213	0.47
	内　ポーランド	243,926,480	0.44
	内　イスラエル	189,921,358	0.34
	内　デンマーク	182,493,449	0.33
	内　ニュージーランド	124,399,823	0.23
	内　ノルウェー	115,522,861	0.21
	内　スウェーデン	112,007,906	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		560,186,317	1.02
純資産総額		55,128,977,663	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。

ニッセイマネーマーケット　マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		14,013,720	2.02
	内　日本	14,013,720	2.02
地方債証券		175,115,992	25.18
	内　日本	175,115,992	25.18
特殊債券		301,525,273	43.36
	内　日本	301,525,273	43.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		204,749,458	29.44
純資産総額		695,404,443	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】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,772,499,435	0.9366 1,660,130,590	0.9310 1,650,196,973	－ －	65.01
2	ニッセイマネーマーケット　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	643,095,043	1.0028 644,895,718	1.0028 644,895,709	－ －	25.41
3	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	48,035,811	2.1952 105,452,863	2.1829 104,857,371	－ －	4.13
4	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	64,907,095	1.4897 96,692,521	1.4507 94,160,722	－ －	3.71
5	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	15,484,267	2.8593 44,275,441	2.8495 44,122,418	－ －	1.74

（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12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率 （%）
1	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,346,762,847	0.9366 2,198,111,215	0.9310 2,184,836,210	－ －	63.86
2	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	183,948,883	2.8594 525,993,082	2.8495 524,162,342	－ －	15.32
3	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	208,744,317	2.1953 458,261,126	2.1829 455,667,969	－ －	13.32
4	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	176,745,421	1.4898 263,317,338	1.4507 256,404,582	－ －	7.49

（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12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率 （%）
1	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,940,898,840	0.9366 1,817,941,011	0.9310 1,806,976,820	－ －	33.83
2	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	587,064,926	2.8593 1,678,648,716	2.8495 1,672,841,506	－ －	31.32
3	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	569,857,975	2.1953 1,251,025,771	2.1829 1,243,942,973	－ －	23.29
4	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	425,535,494	1.4895 633,873,526	1.4507 617,324,341	－ －	11.56

（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12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	315,148,659	2.8593 901,114,532	2.8495 898,016,103	－ －	39.88
2	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	296,443,220	2.1952 650,775,440	2.1829 647,105,904	－ －	28.73
3	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	426,133,374	0.9366 399,124,877	0.9310 396,730,171	－ －	17.62
4	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	213,800,491	1.4896 318,490,301	1.4507 310,160,372	－ －	13.77

（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12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	355,232,778	2.8590 1,015,611,986	2.8495 1,012,235,800	－ －	42.43
2	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	330,893,735	2.1953 726,422,536	2.1829 722,307,934	－ －	30.28
3	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	236,441,235	1.4893 352,147,481	1.4507 343,005,299	－ －	14.38
4	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	330,683,219	0.9365 309,710,796	0.9310 307,866,076	－ －	12.91

（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12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	149,715,481	2.8588 428,009,064	2.8495 426,614,263	－ －	43.55
2	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	139,133,997	2.1952 305,428,893	2.1829 303,715,602	－ －	31.00
3	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	99,146,136	1.4893 147,660,552	1.4507 143,831,299	－ －	14.68
4	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	113,251,214	0.9365 106,070,242	0.9310 105,436,880	－ －	10.76

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	307,388,446	2.8590 878,848,613	2.8495 875,903,376	－ －	44.87
2	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	283,806,817	2.1953 623,044,634	2.1829 619,521,900	－ －	31.74
3	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	203,015,026	1.4895 302,391,557	1.4507 294,513,898	－ －	15.09
4	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	174,255,302	0.9365 163,206,087	0.9310 162,231,686	－ －	8.31

（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12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	227,645,260	2.8586 650,763,889	2.8495 648,675,168	－ －	46.10
2	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	209,886,213	2.1952 460,746,290	2.1829 458,160,614	－ －	32.56
3	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	148,281,597	1.4892 220,828,664	1.4507 215,112,112	－ －	15.29
4	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	91,515,739	0.9365 85,711,538	0.9310 85,201,153	－ －	6.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2022年12月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	15,569,160	2.8595 44,520,515	2.8495 44,364,321	－ －	46.07
2	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	14,645,185	2.1954 32,152,406	2.1829 31,968,974	－ －	33.20
3	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	10,536,024	1.4893 15,691,633	1.4507 15,284,610	－ －	15.87
4	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,020,110	0.9365 4,701,672	0.9310 4,673,722	－ －	4.85

（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12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12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	3,497,000	2,132.93 7,458,880,313	1,812.50 6,338,312,500	－ －	3.58
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	450,500	11,586.80 5,219,857,341	10,035.00 4,520,767,500	－ －	2.56
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,982,500	740.70 2,949,844,016	889.00 3,540,442,500	－ －	2.00
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	63,700	50,595.52 3,222,934,900	51,420.00 3,275,454,000	－ －	1.85
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	818,400	3,639.48 2,978,551,240	3,762.00 3,078,820,800	－ －	1.74
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	458,400	4,181.96 1,917,014,453	5,296.00 2,427,686,400	－ －	1.37
7	第一三共 日本	株式 医薬品	556,400	3,004.11 1,671,490,695	4,250.00 2,364,700,000	－ －	1.34
8	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	565,300	3,603.66 2,037,152,805	4,111.00 2,323,948,300	－ －	1.31
9	任天堂 日本	株式 その他製品	402,100	5,839.86 2,348,210,294	5,532.00 2,224,417,200	－ －	1.26
10	日立製作所 日本	株式 電気機器	322,900	6,263.74 2,022,562,171	6,691.00 2,160,523,900	－ －	1.22
11	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	369,300	5,153.34 1,903,129,415	5,644.00 2,084,329,200	－ －	1.18
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	484,700	4,465.39 2,164,377,209	4,177.00 2,024,591,900	－ －	1.14
13	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	493,600	4,089.92 2,018,784,983	3,982.00 1,965,515,200	－ －	1.11
14	三井物産 日本	株式 卸売業	493,000	3,111.34 1,533,891,346	3,853.00 1,899,529,000	－ －	1.07

15	三菱商事 日本	株式 卸売業	421,300	4,164.31 1,754,426,001	4,283.00 1,804,427,900	－ －	1.02
16	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	631,600	2,419.95 1,528,445,933	2,827.50 1,785,849,000	－ －	1.01
17	信越化学工業 日本	株式 化学	107,700	17,203.84 1,852,854,267	16,225.00 1,747,432,500	－ －	0.99
18	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	44,900	53,359.33 2,395,834,237	38,880.00 1,745,712,000	－ －	0.99
19	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	136,000	13,955.23 1,897,911,982	12,705.00 1,727,880,000	－ －	0.98
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	415,200	3,787.44 1,572,547,322	4,146.00 1,721,419,200	－ －	0.97
21	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	907,100	1,576.43 1,429,985,062	1,856.00 1,683,577,600	－ －	0.95
22	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	517,700	3,498.30 1,811,072,653	3,032.00 1,569,666,400	－ －	0.89
23	ダイキン工業 日本	株式 機械	76,800	20,843.16 1,600,754,979	20,200.00 1,551,360,000	－ －	0.88
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,026,100	1,481.27 1,519,939,604	1,488.00 1,526,836,800	－ －	0.86
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	69,300	20,109.62 1,393,596,733	19,160.00 1,327,788,000	－ －	0.75
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	232,200	5,517.81 1,281,237,678	5,660.00 1,314,252,000	－ －	0.74
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	193,100	7,908.38 1,527,109,588	6,588.00 1,272,142,800	－ －	0.72
28	ファナック 日本	株式 電気機器	62,500	21,112.45 1,319,528,199	19,835.00 1,239,687,500	－ －	0.70
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	612,100	2,015.00 1,233,387,461	2,006.50 1,228,178,650	－ －	0.69
30	ＳＭＣ 日本	株式 機械	20,900	65,148.74 1,361,608,753	55,580.00 1,161,622,000	－ －	0.66

（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12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	16.25
		情報・通信業	8.79
		輸送用機器	7.17
		銀行業	6.35
		化学	6.01
		卸売業	5.93
		医薬品	5.70
		サービス業	5.27
		機械	4.94
		小売業	4.68
		食料品	3.46
		陸運業	3.08
		精密機器	2.53
		保険業	2.50
		その他製品	2.30
		不動産業	1.94
		建設業	1.94
		電気・ガス業	1.25
		その他金融業	1.12
		鉄鋼	0.76
		証券、商品先物取引業	0.74
		非鉄金属	0.73
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.68
		海運業	0.62
		金属製品	0.55
		空運業	0.51
		石油・石炭製品	0.48
		繊維製品	0.45
		鉱業	0.30
		パルプ・紙	0.18
		倉庫・運輸関連業	0.14
		水産・農林業	0.10
	小計		98.16
合　計（対純資産総額比）			98.16

（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12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	20,075.75 27,952,383,902	17,199.24 23,947,285,564	－ －	4.27
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	613,809	32,009.34 19,647,626,837	31,982.02 19,630,856,010	－ －	3.50
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	794,408	12,490.36 9,922,446,523	11,170.68 8,874,082,323	－ －	1.58
4	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	519,306	12,927.70 6,713,435,116	11,737.31 6,095,258,103	－ －	1.09
5	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	81,043	70,329.78 5,699,736,497	70,315.07 5,698,544,704	－ －	1.02
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	480,673	12,978.05 6,238,203,034	11,803.66 5,673,703,066	－ －	1.01
7	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	23,381.64 5,327,228,093	23,562.21 5,368,367,257	－ －	0.96
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	361,124	14,873.01 5,371,003,029	14,490.83 5,232,990,104	－ －	0.93
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	112,814	41,249.00 4,653,465,489	41,012.26 4,626,757,325	－ －	0.82
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,026	17,762.68 4,512,184,754	17,678.29 4,490,746,311	－ －	0.80
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	206,721	18,919.67 3,911,094,472	20,248.69 4,185,830,065	－ －	0.75
12	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	215,722	20,448.34 4,411,157,906	19,378.18 4,180,299,961	－ －	0.74

13	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	141,683	27,972.90 3,963,284,833	27,609.56 3,911,805,572	－ －	0.70
14	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	161,135	24,281.79 3,912,646,783	23,663.06 3,812,947,817	－ －	0.68
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	88,695	41,560.31 3,686,192,212	42,518.40 3,771,170,108	－ －	0.67
16	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	230,761	23,912.54 5,518,082,806	16,165.51 3,730,370,176	－ －	0.66
17	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	238,287	15,937.89 3,797,792,280	15,561.29 3,708,053,682	－ －	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	45,607.57 3,409,986,848	46,207.46 3,454,839,892	－ －	0.62
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	47,995.90 3,358,897,301	48,703.55 3,408,420,819	－ －	0.61
20	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	6,401.39 3,112,354,241	6,811.49 3,311,740,112	－ －	0.59
21	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	153,215	20,569.19 3,151,509,779	21,571.71 3,305,109,854	－ －	0.59
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	13,836.93 3,037,441,508	14,705.81 3,228,176,171	－ －	0.58
23	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	197,515	14,868.42 2,936,737,943	15,958.50 3,152,043,522	－ －	0.56

24	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	356,149	8,114.16 2,889,852,836	8,486.16 3,022,339,178	－ －	0.54
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	119,578	24,063.37 2,877,450,358	24,148.74 2,887,658,749	－ －	0.51
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	626,260	4,934.99 3,090,589,327	4,397.67 2,754,089,824	－ －	0.49
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	35,004	68,367.95 2,393,151,858	74,021.38 2,591,044,630	－ －	0.46
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	35,220	80,823.34 2,846,598,144	73,097.54 2,574,495,675	－ －	0.46
29	NOVO-NORDISK A/S デンマーク	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	143,343	15,453.68 2,215,177,493	17,895.91 2,565,254,573	－ －	0.46
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	44,273.25 2,693,009,512	42,094.25 2,560,467,492	－ －	0.46

（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12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	10.06
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.37
		資本財	6.52
		銀行	5.89
		エネルギー	5.72
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.93
		各種金融	4.66
		メディア・娯楽	4.58
		食品・飲料・タバコ	4.37
		素材	4.34
		小売	4.23
		半導体・半導体製造装置	4.08
		保険	3.36
		公益事業	3.22
		家庭用品・パーソナル用品	1.85
		消費者サービス	1.83
		運輸	1.81
		耐久消費財・アパレル	1.59
		食品・生活必需品小売り	1.49
		自動車・自動車部品	1.47
		電気通信サービス	1.39
		商業・専門サービス	1.20
		不動産	0.39
	小計		94.03
投資証券	外国		2.17
	小計		2.17
合　計（対純資産総額比）			96.20

（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。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2022年12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	99.10 631,273,370	0.1 2028/3/20	0.93
2	第３６４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	601,000,000	99.13 595,807,640	96.62 580,692,210	0.1 2031/9/20	0.86
3	第３６８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	571,000,000	99.05 565,629,410	98.03 559,802,690	0.2 2032/9/20	0.83
4	第３５１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	564,000,000	100.40 566,256,000	98.92 557,942,640	0.1 2028/6/20	0.82
5	第３６５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	562,000,000	98.95 556,139,800	96.69 543,420,280	0.1 2031/12/20	0.80

6	第３６０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	545,000,000	98.63 537,545,630	97.10 529,205,900	0.1 2030/9/20	0.78
7	第３３８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	519,000,000	101.08 524,608,950	100.78 523,058,580	0.4 2025/3/20	0.77
8	第３５９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	535,000,000	99.02 529,796,270	97.29 520,549,650	0.1 2030/6/20	0.77
9	第３６１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	533,000,000	99.42 529,926,240	96.90 516,482,330	0.1 2030/12/20	0.76
10	第３４９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	518,000,000	100.34 519,798,400	99.26 514,192,700	0.1 2027/12/20	0.76
11	第３５７回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	523,000,000	99.54 520,621,560	97.77 511,337,100	0.1 2029/12/20	0.76
12	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	100.78 503,946,000	0.66 2024/5/31	0.74
13	第１４４回　利付国債（５年） 日本	国債証券	497,000,000	100.36 498,798,860	100.12 497,606,340	0.1 2025/6/20	0.74
14	第３４１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	493,000,000	101.15 498,688,650	100.70 496,490,440	0.3 2025/12/20	0.73
15	第３６３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	499,000,000	99.37 495,871,600	96.67 482,408,250	0.1 2031/6/20	0.71
16	第３４０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	470,000,000	101.44 476,768,000	100.93 474,385,100	0.4 2025/9/20	0.70
17	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	472,000,000	100.38 473,804,400	99.78 470,975,760	0.1 2026/12/20	0.70
18	第１４９回　利付国債（５年） 日本	国債証券	456,000,000	99.95 455,772,000	99.55 453,975,360	0.005 2026/9/20	0.67
19	第３６２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	466,000,000	99.61 464,206,160	96.77 450,948,200	0.1 2031/3/20	0.67
20	第３５８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	443,000,000	99.76 441,957,430	97.52 432,026,890	0.1 2030/3/20	0.64
21	第３４２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	423,000,000	100.42 424,776,600	100.11 423,469,530	0.1 2026/3/20	0.63
22	第１４２回　利付国債（５年） 日本	国債証券	405,000,000	100.44 406,789,890	100.12 405,514,350	0.1 2024/12/20	0.60

23	第１５３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	408,000,000	99.71 406,841,280	99.09 404,303,520	0.005 2027/6/20	0.60
24	第４４１回　利付国債（２年） 日本	国債証券	400,000,000	100.12 400,508,000	99.95 399,824,000	0.005 2024/10/1	0.59
25	第２５回　首都高速道路債券 日本	社債券	400,000,000	99.78 399,141,600	99.59 398,373,600	0.03 2024/9/20	0.59
26	第５回　電通グループ 日本	社債券	400,000,000	100.19 400,778,800	98.98 395,922,400	0.32 2027/7/8	0.59
27	第３３９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	387,000,000	101.32 392,142,000	100.85 390,324,330	0.4 2025/6/20	0.58
28	第３３４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	387,000,000	101.39 392,413,200	100.83 390,239,190	0.6 2024/6/20	0.58
29	第１１３回　利付国債（２０年） 日本	国債証券	342,000,000	114.46 391,485,270	111.25 380,485,260	2.1 2029/9/20	0.56
30	第１４３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	377,000,000	100.32 378,243,980	100.12 377,456,170	0.1 2025/3/20	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12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	77.61
		特殊債券	8.40
		社債券	7.24
		地方債証券	5.40
	小計		98.64
	外国	社債券	0.59
	小計		0.59
合　計（対純資産総額比）			99.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年12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	866,531,000	96.84 839,174,616	97.11 841,548,911	2.5 2024/5/15	1.53
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	814,778,000	95.72 779,921,797	96.12 783,205,352	2.25 2024/11/15	1.42
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	772,314,000	94.89 732,869,932	95.21 735,381,944	2 2025/2/15	1.33
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	753,736,000	96.25 725,523,439	96.58 727,973,303	2.375 2024/8/15	1.32
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	667,481,000	94.75 632,470,060	95.09 634,727,707	2.125 2025/5/15	1.15
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	626,344,000	94.09 589,358,495	94.44 591,575,644	2 2025/8/15	1.07
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	603,785,000	97.58 589,227,743	97.89 591,093,439	2.75 2024/2/15	1.07
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	577,245,000	94.33 544,526,753	94.84 547,499,565	0.25 2024/3/15	0.99
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	587,861,000	92.37 543,027,418	92.31 542,666,246	2.25 2027/11/15	0.98
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	566,629,000	92.72 525,435,071	93.26 528,443,871	0.375 2024/9/15	0.96
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	556,013,000	94.38 524,776,870	94.76 526,927,959	2.25 2025/11/15	0.96
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	566,629,000	92.40 523,593,836	92.65 525,015,766	2.25 2027/8/15	0.95
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	559,994,000	92.51 518,100,848	92.72 519,237,636	2.625 2029/2/15	0.94
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	550,705,000	94.32 519,479,410	94.22 518,907,293	2.75 2028/2/15	0.94
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	518,857,000	93.10 483,061,055	93.40 484,622,815	2.375 2027/5/15	0.88
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	498,952,000	95.22 475,151,989	95.84 478,230,523	0.125 2023/12/15	0.87
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	493,644,000	92.20 455,154,577	92.61 457,178,517	2 2026/11/15	0.83
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	497,625,000	90.95 452,624,771	91.17 453,709,593	2.375 2029/5/15	0.82
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	483,028,000	90.80 438,608,745	91.30 441,043,206	1.5 2026/8/15	0.80
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	473,739,000	92.10 436,337,305	92.63 438,871,809	1.625 2026/2/15	0.80
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	469,758,000	92.92 436,513,665	93.19 437,809,758	2.25 2027/2/15	0.79
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	440,564,000	94.21 415,072,966	94.40 415,936,472	2.875 2028/8/15	0.75
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	428,621,000	91.70 393,075,460	92.13 394,914,244	1.625 2026/5/15	0.72

24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	451,180,000	86.69 391,150,501	87.02 392,648,418	1.625 2029/8/15	0.71
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	382,176,000	96.16 367,515,728	96.45 368,635,504	2.75 2025/6/30	0.67
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	358,290,000	97.30 348,631,284	97.61 349,751,949	2.25 2023/12/31	0.63
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	342,366,000	93.96 321,700,788	94.38 323,131,878	2.25 2026/3/31	0.59
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	334,404,000	95.52 319,446,109	95.92 320,777,037	2.25 2024/12/31	0.58
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	327,769,000	96.17 315,218,724	96.46 316,179,088	2.625 2025/3/31	0.57
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	318,480,000	88.31 281,262,201	87.54 278,816,500	1.75 2029/11/15	0.51

（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。

種類別及び業種別投資比率

2022年12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。

ニッセイマネーマーケット　マザーファンド

2022年12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	平成３０年度第２回　北海道公募公債 日本	地方債証券	155,000,000	100.03 155,048,903	100.03 155,048,903	0.03 2023/5/31	22.30
2	第２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券 日本	特殊債券	100,000,000	100.60 100,605,119	100.60 100,605,119	0.699 2023/10/31	14.47
3	第２６回　政保日本政策金融公庫債券 日本	特殊債券	100,000,000	100.51 100,510,234	100.51 100,510,234	0.911 2023/7/19	14.45
4	第４９回　政保地方公共団体金融機構債券 日本	特殊債券	100,000,000	100.40 100,409,920	100.40 100,409,920	0.882 2023/6/16	14.44
5	第１１２１回　国庫短期証券 日本	国債証券	14,000,000	100.09 14,013,720	100.09 14,013,720	－ 2023/11/20	2.02
6	第３７４回　大阪府公募公債 日本	地方債証券	10,000,000	100.54 10,054,259	100.54 10,054,259	0.938 2023/7/28	1.45
7	平成２４年度第２回　新潟県公募公債 日本	地方債証券	10,000,000	100.12 10,012,830	100.12 10,012,830	0.79 2023/2/27	1.44

（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12月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	特殊債券	43.36
		地方債証券	25.18
		国債証券	2.02
	小計		70.56
合　計（対純資産総額比）			70.56

（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】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５
該当事項はありません。

（参考）
ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイマネーマーケット　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】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５
該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

該当事項はありません。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2022年12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　０５０３月	買建	170	3,298,893,500	3,215,550,000	1.82

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年12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 202303	買建	570	15,100,122,761	14,642,764,912	2.61
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202303	買建	677	3,758,009,645	3,690,218,070	0.66
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE 202303	買建	122	1,458,665,760	1,464,390,400	0.26

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイマネーマーケット　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】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2017年12月20日)	1,042,745	1,042,745	1.0427	1.0427
第2計算期間末(2018年12月20日)	75,725,362	75,725,362	1.0070	1.0070
第3計算期間末(2019年12月20日)	457,912,286	457,912,286	1.0627	1.0627
第4計算期間末(2020年12月21日)	1,301,134,378	1,301,134,378	1.0837	1.0837
第5計算期間末(2021年12月20日)	2,216,280,204	2,216,280,204	1.1106	1.1106
第6計算期間末(2022年12月20日)	2,533,256,615	2,533,256,615	1.0578	1.0578
2021年12月末日	2,248,347,495	－	1.1096	－
2022年1月末日	2,225,105,164	－	1.0974	－
2月末日	2,218,176,315	－	1.0909	－
3月末日	2,294,965,788	－	1.0942	－
4月末日	2,297,795,099	－	1.0894	－
5月末日	2,326,588,475	－	1.0879	－
6月末日	2,344,331,686	－	1.0781	－
7月末日	2,402,413,578	－	1.0872	－
8月末日	2,466,544,253	－	1.0850	－
9月末日	2,472,653,381	－	1.0701	－
10月末日	2,513,036,327	－	1.0746	－
11月末日	2,551,366,616	－	1.0691	－
12月末日	2,538,221,971	－	1.0515	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2019年12月20日)	73,587,808	73,587,808	1.1045	1.1045
第2計算期間末(2020年12月21日)	1,170,122,248	1,170,122,248	1.1535	1.1535
第3計算期間末(2021年12月20日)	2,832,119,430	2,832,119,430	1.2486	1.2486
第4計算期間末(2022年12月20日)	3,415,761,311	3,415,761,311	1.2115	1.2115
2021年12月末日	2,911,850,742	－	1.2635	－
2022年1月末日	2,842,700,735	－	1.2298	－
2月末日	2,855,490,915	－	1.2213	－
3月末日	2,966,347,893	－	1.2566	－
4月末日	2,918,116,556	－	1.2398	－
5月末日	2,983,998,480	－	1.2390	－
6月末日	3,035,935,420	－	1.2253	－
7月末日	3,086,193,441	－	1.2465	－
8月末日	3,328,930,089	－	1.2474	－
9月末日	3,262,200,347	－	1.2161	－
10月末日	3,428,126,290	－	1.2495	－
11月末日	3,463,625,250	－	1.2409	－
12月末日	3,421,047,844	－	1.2013	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2017年12月20日)	1,082,306	1,082,306	1.0823	1.0823
第2計算期間末(2018年12月20日)	70,055,216	70,055,216	0.9897	0.9897
第3計算期間末(2019年12月20日)	564,969,332	564,969,332	1.1252	1.1252
第4計算期間末(2020年12月21日)	1,687,473,196	1,687,473,196	1.1936	1.1936
第5計算期間末(2021年12月20日)	3,957,865,139	3,957,865,139	1.3568	1.3568
第6計算期間末(2022年12月20日)	5,290,595,383	5,290,595,383	1.3354	1.3354
2021年12月末日	4,115,283,361	－	1.3886	－
2022年1月末日	4,011,459,627	－	1.3321	－
2月末日	4,056,806,941	－	1.3218	－
3月末日	4,405,943,002	－	1.3897	－
4月末日	4,342,672,085	－	1.3597	－
5月末日	4,425,357,586	－	1.3594	－
6月末日	4,540,180,629	－	1.3418	－
7月末日	4,748,201,026	－	1.3757	－
8月末日	5,041,923,535	－	1.3800	－
9月末日	4,966,675,483	－	1.3315	－
10月末日	5,336,744,971	－	1.3962	－
11月末日	5,427,510,703	－	1.3843	－
12月末日	5,341,049,401	－	1.3239	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2019年12月20日)	46,572,387	46,572,387	1.1461	1.1461
第2計算期間末(2020年12月21日)	520,318,560	520,318,560	1.2197	1.2197
第3計算期間末(2021年12月20日)	1,600,494,859	1,600,494,859	1.4045	1.4045
第4計算期間末(2022年12月20日)	2,233,691,382	2,233,691,382	1.3899	1.3899
2021年12月末日	1,679,842,749	－	1.4440	－
2022年1月末日	1,641,606,142	－	1.3769	－
2月末日	1,656,789,655	－	1.3660	－
3月末日	1,814,451,342	－	1.4484	－
4月末日	1,785,505,316	－	1.4122	－
5月末日	1,810,353,042	－	1.4121	－
6月末日	1,903,741,238	－	1.3927	－
7月末日	1,971,070,961	－	1.4325	－
8月末日	2,141,106,966	－	1.4384	－
9月末日	2,108,119,692	－	1.3819	－
10月末日	2,258,695,448	－	1.4611	－
11月末日	2,286,889,687	－	1.4478	－
12月末日	2,251,997,281	－	1.3786	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2017年12月20日)	1,088,135	1,088,135	1.0881	1.0881
第2計算期間末(2018年12月20日)	43,412,324	43,412,324	0.9867	0.9867
第3計算期間末(2019年12月20日)	264,521,692	264,521,692	1.1346	1.1346
第4計算期間末(2020年12月21日)	682,760,159	682,760,159	1.2107	1.2107
第5計算期間末(2021年12月20日)	1,665,050,649	1,665,050,649	1.3997	1.3997
第6計算期間末(2022年12月20日)	2,343,102,893	2,343,102,893	1.3874	1.3874
2021年12月末日	1,745,054,180	－	1.4410	－
2022年1月末日	1,695,211,303	－	1.3717	－
2月末日	1,713,921,296	－	1.3607	－
3月末日	1,868,516,022	－	1.4463	－
4月末日	1,832,871,302	－	1.4089	－
5月末日	1,871,992,171	－	1.4089	－
6月末日	1,952,026,679	－	1.3892	－
7月末日	2,044,655,594	－	1.4302	－
8月末日	2,210,408,967	－	1.4364	－
9月末日	2,156,581,175	－	1.3783	－
10月末日	2,338,933,019	－	1.4608	－
11月末日	2,397,809,226	－	1.4472	－
12月末日	2,385,398,881	－	1.3762	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2019年12月20日)	25,150,378	25,150,378	1.1540	1.1540
第2計算期間末(2020年12月21日)	146,693,410	146,693,410	1.2328	1.2328
第3計算期間末(2021年12月20日)	680,452,088	680,452,088	1.4312	1.4312
第4計算期間末(2022年12月20日)	961,493,290	961,493,290	1.4202	1.4202
2021年12月末日	717,512,372	－	1.4748	－
2022年1月末日	694,295,545	－	1.4022	－
2月末日	696,578,388	－	1.3909	－
3月末日	778,794,543	－	1.4809	－
4月末日	764,392,747	－	1.4416	－
5月末日	783,602,496	－	1.4416	－
6月末日	818,909,044	－	1.4212	－
7月末日	847,248,548	－	1.4641	－
8月末日	901,683,317	－	1.4709	－
9月末日	901,885,039	－	1.4101	－
10月末日	970,708,948	－	1.4970	－
11月末日	984,915,569	－	1.4829	－
12月末日	979,591,361	－	1.4086	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2016年12月20日)	1,141,342	1,141,342	1.1413	1.1413
第2計算期間末(2017年12月20日)	2,854,940	2,854,940	1.3107	1.3107
第3計算期間末(2018年12月20日)	71,901,230	71,901,230	1.1820	1.1820
第4計算期間末(2019年12月20日)	359,193,901	359,193,901	1.3682	1.3682
第5計算期間末(2020年12月21日)	653,687,309	653,687,309	1.4629	1.4629
第6計算期間末(2021年12月20日)	1,303,595,387	1,303,595,387	1.7047	1.7047
第7計算期間末(2022年12月20日)	1,936,383,924	1,936,383,924	1.6932	1.6932
2021年12月末日	1,370,096,889	－	1.7582	－
2022年1月末日	1,335,844,529	－	1.6696	－
2月末日	1,361,510,929	－	1.6561	－
3月末日	1,497,799,982	－	1.7662	－
4月末日	1,485,814,578	－	1.7182	－
5月末日	1,536,973,377	－	1.7183	－
6月末日	1,609,079,430	－	1.6937	－
7月末日	1,700,568,098	－	1.7459	－
8月末日	1,804,963,256	－	1.7542	－
9月末日	1,805,577,434	－	1.6804	－
10月末日	1,956,284,189	－	1.7867	－
11月末日	2,004,016,739	－	1.7697	－
12月末日	1,952,157,545	－	1.6795	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

直近日（2022年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2019年12月20日)	32,944,282	32,944,282	1.1609	1.1609
第2計算期間末(2020年12月21日)	175,309,722	175,309,722	1.2428	1.2428
第3計算期間末(2021年12月20日)	855,240,032	855,240,032	1.4537	1.4537
第4計算期間末(2022年12月20日)	1,380,917,359	1,380,917,359	1.4453	1.4453
2021年12月末日	914,251,955	－	1.5005	－
2022年1月末日	894,802,579	－	1.4235	－
2月末日	899,177,883	－	1.4119	－
3月末日	994,401,591	－	1.5079	－
4月末日	989,548,406	－	1.4661	－
5月末日	1,039,910,457	－	1.4662	－
6月末日	1,123,412,737	－	1.4450	－
7月末日	1,199,343,997	－	1.4904	－
8月末日	1,264,944,948	－	1.4977	－
9月末日	1,269,759,630	－	1.4336	－
10月末日	1,369,526,428	－	1.5266	－
11月末日	1,417,449,067	－	1.5118	－
12月末日	1,407,139,484	－	1.4336	－

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

直近日（2022年12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(2022年12月20日)	101,765,896	101,765,896	0.9679	0.9679
2022年1月末日	953,066	－	0.9531	－
2月末日	945,334	－	0.9453	－
3月末日	1,010,255	－	1.0095	－
4月末日	31,533,755	－	0.9814	－
5月末日	39,213,270	－	0.9813	－
6月末日	39,488,402	－	0.9673	－
7月末日	52,056,997	－	0.9979	－
8月末日	58,248,157	－	1.0030	－
9月末日	85,046,854	－	0.9598	－
10月末日	68,916,764	－	1.0227	－
11月末日	88,979,678	－	1.0128	－
12月末日	96,290,965	－	0.9600	－

②【分配の推移】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

	収益率（％）
第1計算期間	4.3
第2計算期間	△3.4
第3計算期間	5.5
第4計算期間	2.0
第5計算期間	2.5
第6計算期間	△4.8

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

	収益率（%）
第1計算期間	10.5
第2計算期間	4.4
第3計算期間	8.2
第4計算期間	△3.0

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

	収益率（%）
第1計算期間	8.2
第2計算期間	△8.6
第3計算期間	13.7
第4計算期間	6.1
第5計算期間	13.7
第6計算期間	△1.6

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

	収益率（%）
第1計算期間	14.6
第2計算期間	6.4
第3計算期間	15.2
第4計算期間	△1.0

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

	収益率（%）
第1計算期間	8.8
第2計算期間	△9.3
第3計算期間	15.0
第4計算期間	6.7
第5計算期間	15.6
第6計算期間	△0.9

（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。）。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

	収益率（％）
第1計算期間	15.4
第2計算期間	6.8
第3計算期間	16.1
第4計算期間	△0.8

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

	収益率（％）
第1計算期間	14.1
第2計算期間	14.8
第3計算期間	△9.8
第4計算期間	15.8
第5計算期間	6.9
第6計算期間	16.5
第7計算期間	△0.7

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

	収益率（％）
第1計算期間	16.1
第2計算期間	7.1
第3計算期間	17.0
第4計算期間	△0.6

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

	収益率（％）
第1計算期間	△3.2

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	86,246,774	12,050,899	75,195,875
第3計算期間	387,560,915	31,880,755	430,876,035
第4計算期間	922,348,817	152,580,214	1,200,644,638
第5計算期間	1,051,584,639	256,647,601	1,995,581,676
第6計算期間	692,135,856	292,900,893	2,394,816,639

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	73,774,281	7,147,035	66,627,246
第2計算期間	973,321,960	25,560,840	1,014,388,366
第3計算期間	1,471,484,708	217,636,186	2,268,236,888
第4計算期間	777,589,965	226,321,591	2,819,505,262

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	75,898,281	6,116,182	70,782,099
第3計算期間	472,272,256	40,931,452	502,122,903
第4計算期間	1,069,111,112	157,447,877	1,413,786,138
第5計算期間	1,722,619,889	219,279,074	2,917,126,953
第6計算期間	1,270,427,866	225,885,421	3,961,669,398

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	43,349,876	2,715,954	40,633,922
第2計算期間	409,608,219	23,643,836	426,598,305
第3計算期間	793,296,990	80,312,773	1,139,582,522
第4計算期間	577,964,059	110,442,564	1,607,104,017

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	45,814,915	2,817,018	43,997,897
第3計算期間	215,465,288	26,325,617	233,137,568
第4計算期間	414,415,117	83,597,702	563,954,983
第5計算期間	735,655,901	110,059,244	1,189,551,640
第6計算期間	657,710,443	158,392,989	1,688,869,094

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	25,368,600	3,574,381	21,794,219
第2計算期間	113,562,838	16,369,433	118,987,624
第3計算期間	418,895,243	62,456,116	475,426,751
第4計算期間	302,826,414	101,223,638	677,029,527

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	2,178,145	1,000,000	2,178,145
第3計算期間	67,199,823	8,549,894	60,828,074
第4計算期間	228,564,856	26,865,852	262,527,078
第5計算期間	290,087,575	105,775,306	446,839,347
第6計算期間	495,378,300	177,500,475	764,717,172
第7計算期間	560,878,174	182,005,090	1,143,590,256

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	37,713,552	9,335,463	28,378,089
第2計算期間	179,902,566	67,216,411	141,064,244
第3計算期間	605,255,833	158,007,296	588,312,781
第4計算期間	680,503,778	313,376,343	955,440,216

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	221,837,749	116,696,572	105,141,177

（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12月末現在

DCニッセイターゲットデートファンド2025

●基準価額・純資産の推移

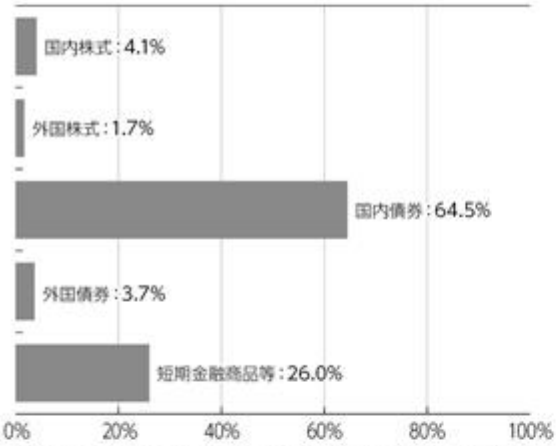
基準価額	10,515円
純資産総額	25億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

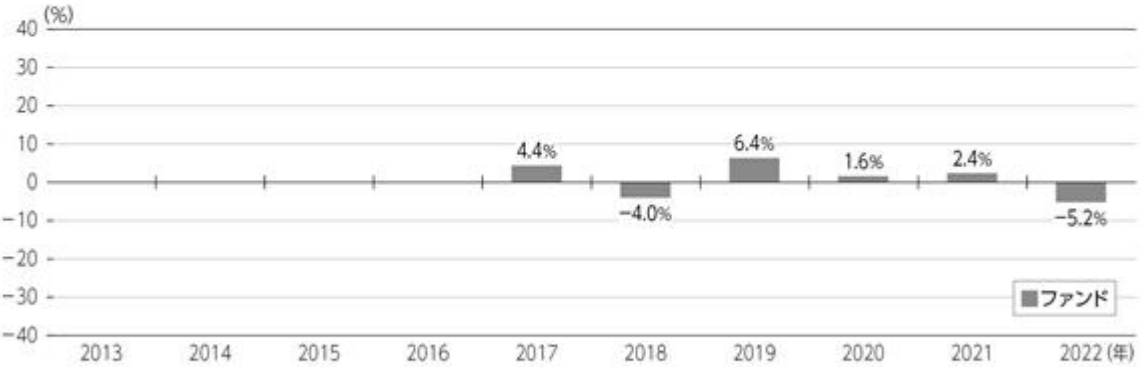
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



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

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

3.運用実績

2022年12月末現在

DCニッセイターゲットデートファンド2030

●基準価額・純資産の推移

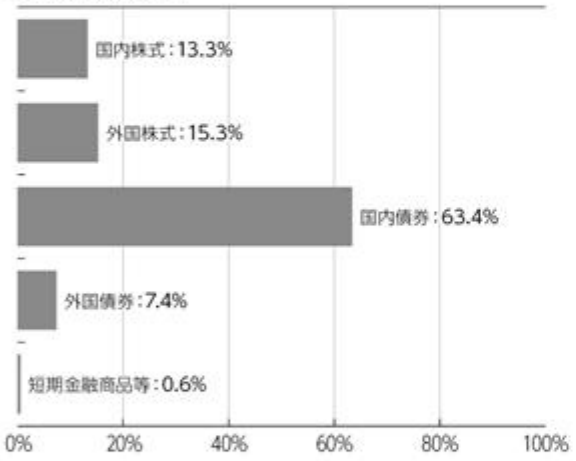
基準価額	12,013円
純資産総額	34億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

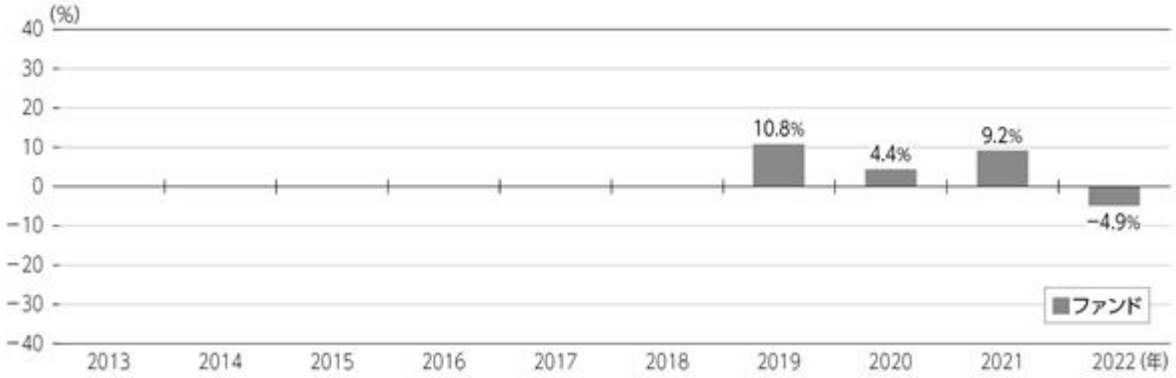
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2019年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

DCニッセイターゲットデートファンド2035

●基準価額・純資産の推移

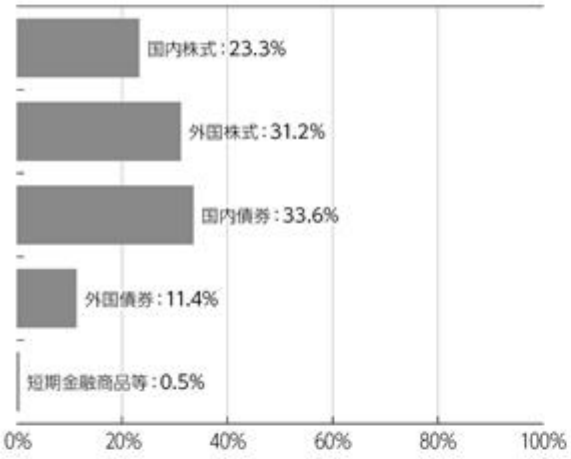
基準価額	13,239円
純資産総額	53億円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

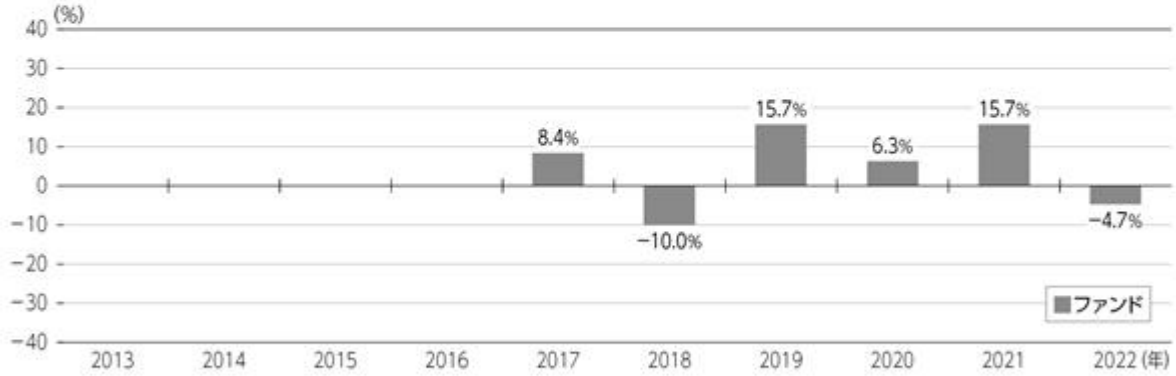
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



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

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

3.運用実績

2022年12月末現在

DCニッセイターゲットデートファンド2040

●基準価額・純資産の推移

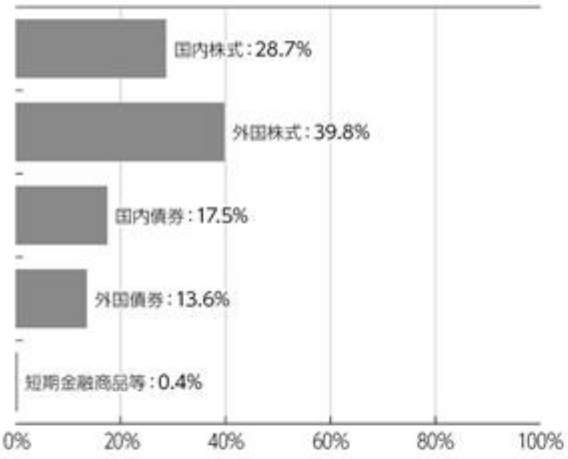
基準価額	13,786円
純資産総額	22億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

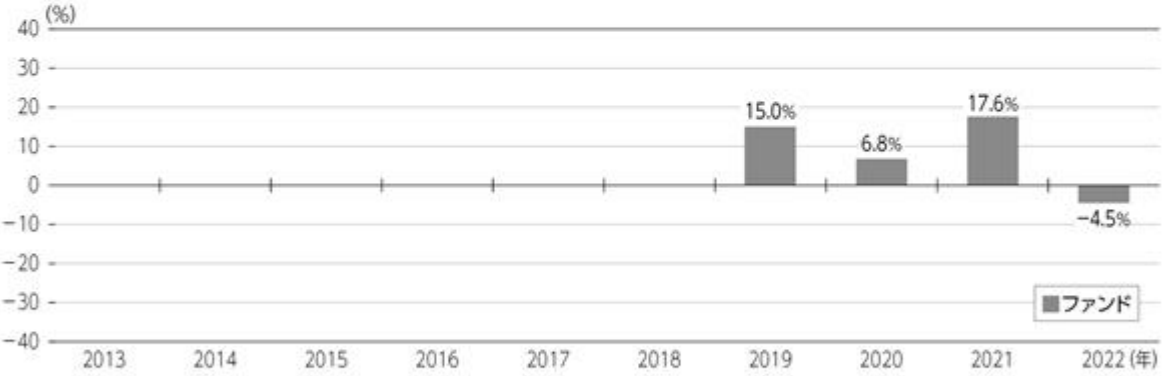
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2019年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

DCニッセイターゲットデートファンド2045

●基準価額・純資産の推移

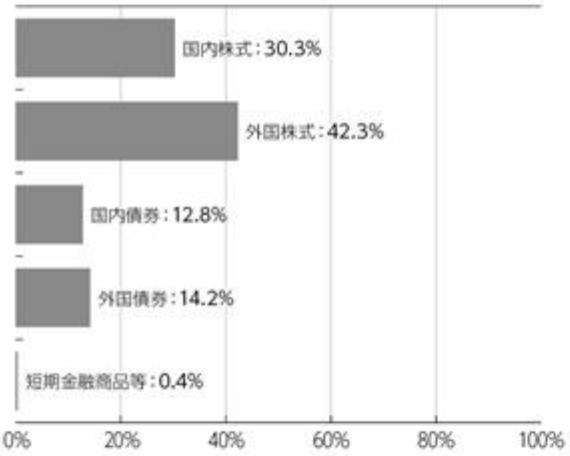
基準価額	13,762円
純資産総額	23億円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

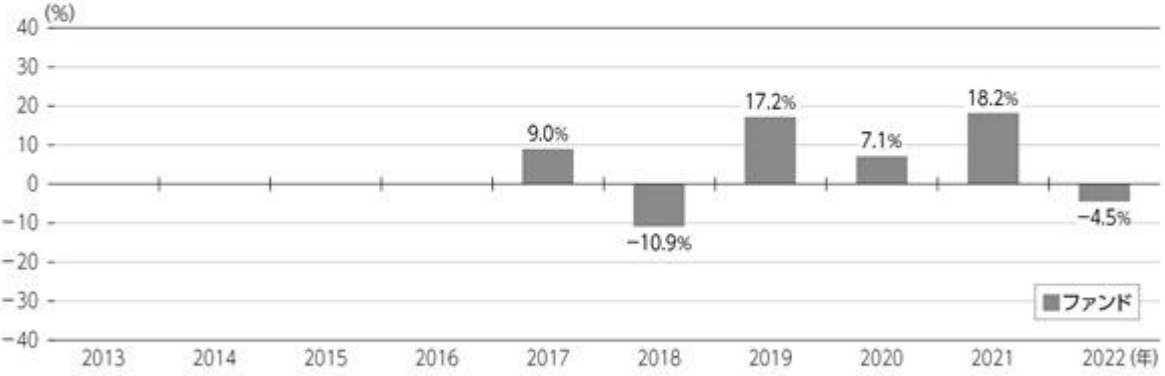
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



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

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

3.運用実績

2022年12月末現在

DCニッセイターゲットデートファンド2050

●基準価額・純資産の推移

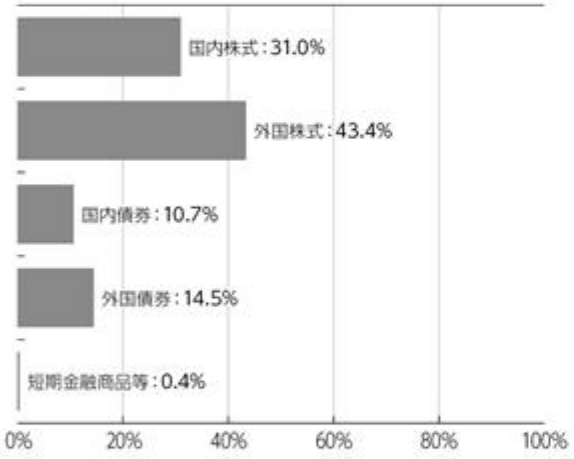
基準価額	14,086円
純資産総額	979百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

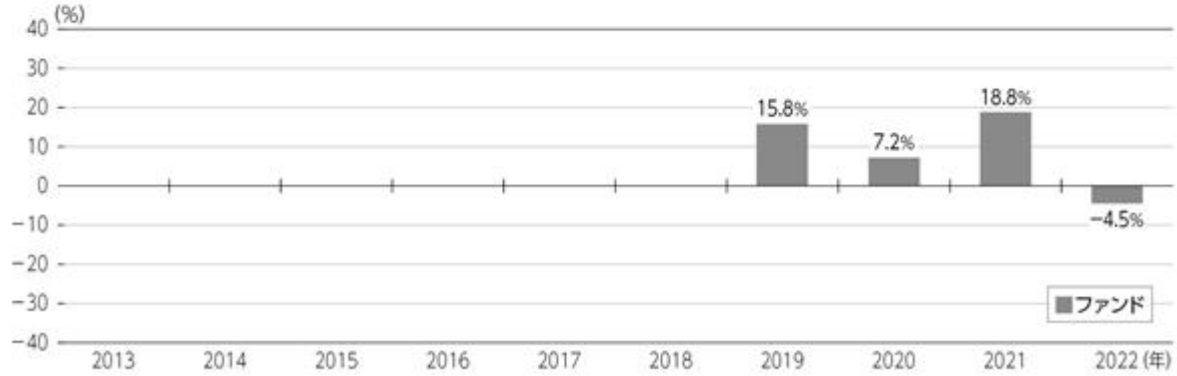
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2019年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

DCニッセイターゲットデートファンド2055

●基準価額・純資産の推移

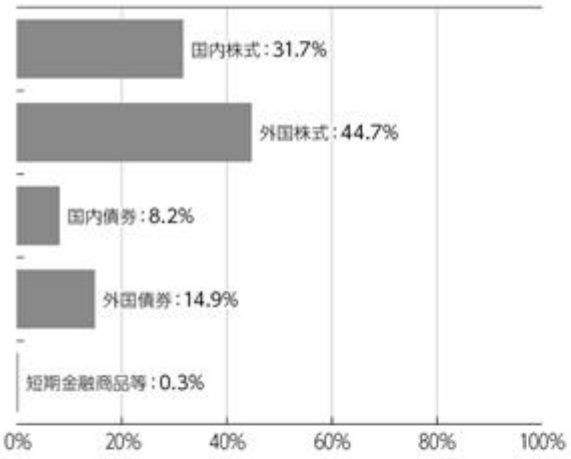
基準価額	16,795円
純資産総額	19億円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

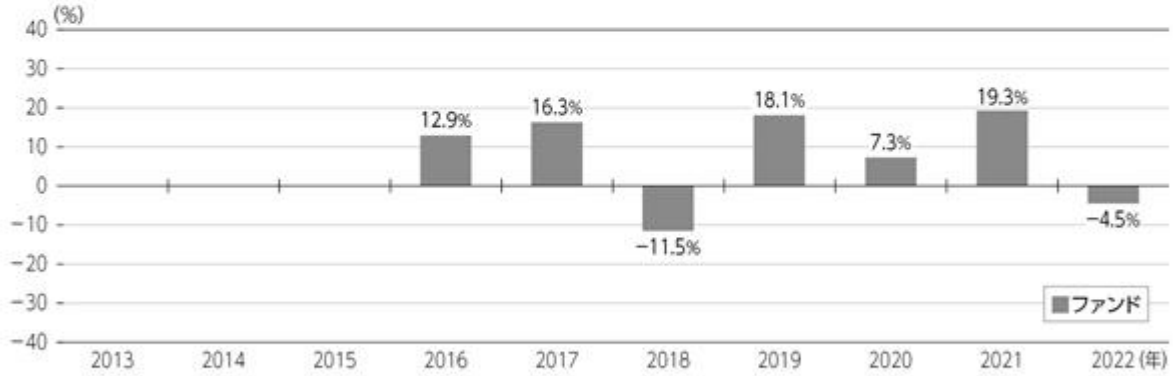
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2016年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

3.運用実績

2022年12月末現在

DCニッセイターゲットデートファンド2060

●基準価額・純資産の推移

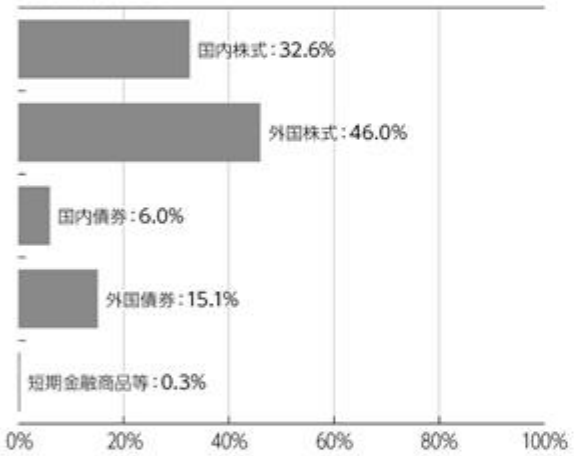
基準価額	14,336円
純資産総額	14億円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

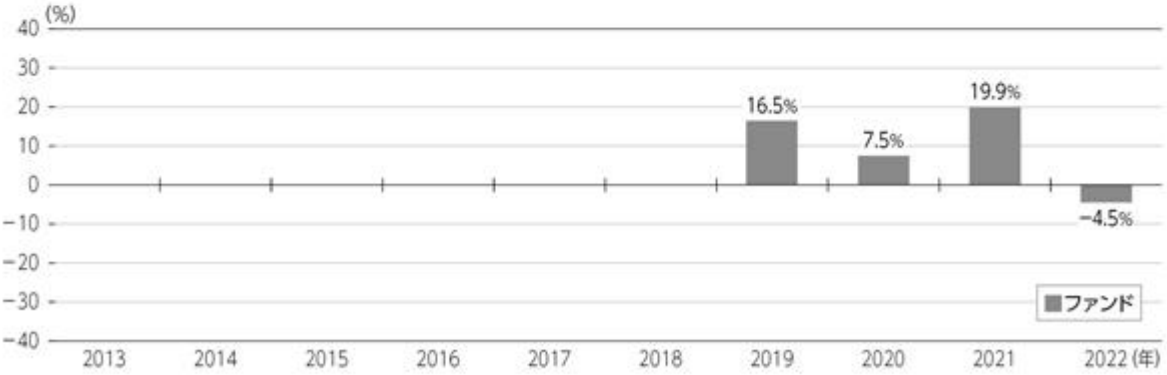
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2019年はファンド設定時から年末まで、2022年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

DCニッセイターゲットデートファンド2065

●基準価額・純資産の推移

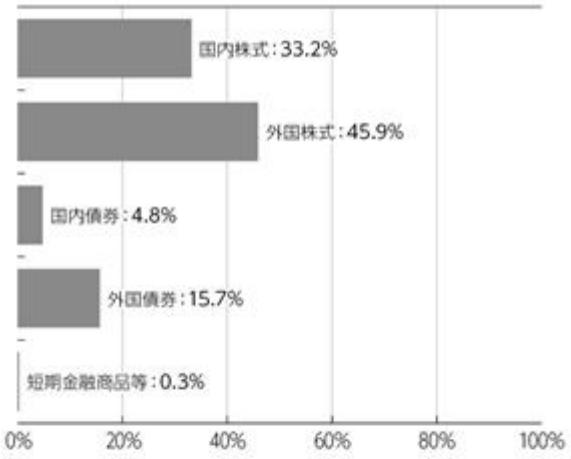
基準価額	9,600円
純資産総額	96百万円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

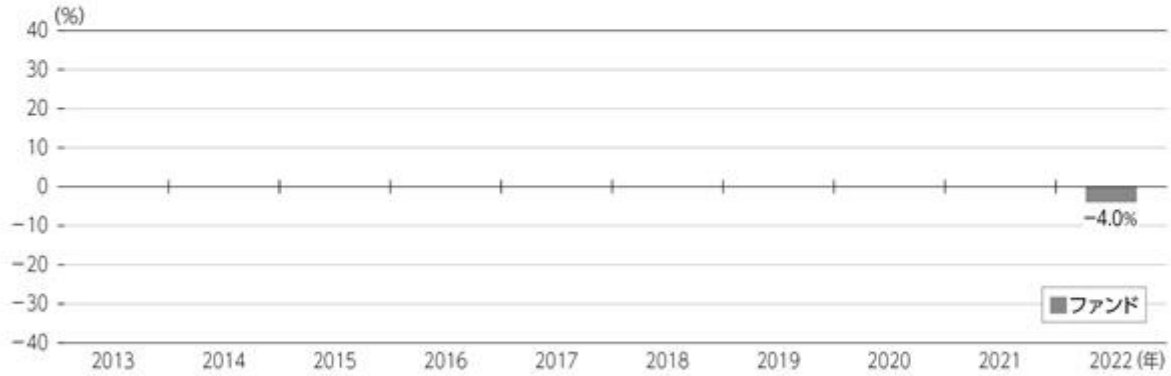
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



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

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

3.運用実績

2022年12月末現在

◉マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.7%
2	ソニーグループ	2.6%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.0%
4	キーエンス	1.9%
5	日本電信電話	1.8%

・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	16.6%
2	情報・通信業	9.0%
3	輸送用機器	7.3%
4	銀行業	6.5%
5	化学	6.1%

・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	4.4%
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	1.6%
4	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.1%
5	ユナイテッドヘルス・グループ	ヘルスケア	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	72.4%
2	イギリス	4.7%
3	カナダ	3.7%
4	フランス	3.6%
5	スイス	3.1%

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

3.ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第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368回　利付国債(10年)	2032/09/20	0.200%	0.8%
4	第351回　利付国債(10年)	2028/06/20	0.100%	0.8%
5	第365回　利付国債(10年)	2031/12/20	0.100%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入債券種別

種別	比率
日本国債	78.2%
その他	21.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

4.ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	2024/05/15	2.500%	1.5%
2	アメリカ国債	2024/11/15	2.250%	1.4%
3	アメリカ国債	2025/02/15	2.000%	1.3%
4	アメリカ国債	2024/08/15	2.375%	1.3%
5	アメリカ国債	2025/05/15	2.125%	1.2%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	50.8%
2	フランス	8.6%
3	イタリア	7.5%
4	ドイツ	6.7%
5	スペイン	5.1%

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

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

5. ニッセイマネーマーケットマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	種別	償還日	比率
1	平成30年度第2回　北海道公募公債	地方債	2023/05/31	31.6%
2	第202回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	特殊債	2023/10/31	20.5%
3	第26回　政保日本政策金融公庫債券	特殊債	2023/07/19	20.5%
4	第49回　政保地方公共団体金融機構債券	特殊債	2023/06/16	20.5%
5	第1121回　国庫短期証券	国債	2023/11/20	2.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	70.6%
現金、その他	29.4%

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

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

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

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

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

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

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

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

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６営業日目からお支払いします。

⑦　その他

１．受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
２．換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記④の規定に準じて算出した価額とします。
３．詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

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

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

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

「ターゲットデート２０２５」

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

「ターゲットデート２０３０」

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

「ターゲットデート２０３５」

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

「ターゲットデート２０４０」

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

「ターゲットデート２０４５」

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

「ターゲットデート２０５０」

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

「ターゲットデート２０５５」

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

「ターゲットデート２０６０」

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

「ターゲットデート２０６５」

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

（４）【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

（５）【その他】

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10億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。

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

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

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2021年12月21日から2022年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

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

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2021年12月21日から2022年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

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

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

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2021年12月21日から2022年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（2021年12月21日から2022年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2021年12月21日から2022年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

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1期計算期間（2022年1月11日から2022年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	29,352	34,059
コール・ローン	2,698,432	3,284,401
親投資信託受益証券	2,216,336,145	2,533,274,153
未収入金	28,357,966	154,137
流動資産合計	2,247,421,895	2,536,746,750
資産合計	2,247,421,895	2,536,746,750
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,301,578	66,107
未払受託者報酬	305,780	337,444
未払委託者報酬	2,446,605	2,975,316
その他未払費用	87,728	111,268
流動負債合計	31,141,691	3,490,135
負債合計	31,141,691	3,490,135
純資産の部		
元本等		
元本	1,995,581,676	2,394,816,639
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	220,698,528	138,439,976
（分配準備積立金）	66,232,197	57,837,724
元本等合計	2,216,280,204	2,533,256,615
純資産合計	2,216,280,204	2,533,256,615
負債純資産合計	2,247,421,895	2,536,746,750

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	12	18
有価証券売買等損益	42,575,073	△108,772,637
営業収益合計	42,575,085	△108,772,619
営業費用		
支払利息	551	816
受託者報酬	541,656	710,792
委託者報酬	4,333,880	5,962,420
その他費用	159,137	214,750
営業費用合計	5,035,224	6,888,778
営業利益又は営業損失（△）	37,539,861	△115,661,397
経常利益又は経常損失（△）	37,539,861	△115,661,397
当期純利益又は当期純損失（△）	37,539,861	△115,661,397
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（△）	3,703,217	△6,518,473
期首剰余金又は期首欠損金（△）	100,489,740	220,698,528
剰余金増加額又は欠損金減少額	108,869,314	58,499,075
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	108,869,314	58,499,075
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,497,170	31,614,703
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,497,170	31,614,703
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（△）	220,698,528	138,439,976

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	1,200,644,638円	1,995,581,676円
期中追加設定元本額	1,051,584,639円	692,135,856円
期中一部解約元本額	256,647,601円	292,900,893円
２．　受益権の総数	1,995,581,676口	2,394,816,639口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（33,836,995円）、収益調整金（154,466,853円）及び分配準備積立金（32,395,202円）より分配対象収益は220,699,050円（1万口当たり1,105.94円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（199,880,320円）及び分配準備積立金（57,837,724円）より分配対象収益は257,718,044円（1万口当たり1,076.15円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	30,613,934	△102,784,388
合計	30,613,934	△102,784,388

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1106円 (11,106円)	1.0578円 (10,578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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	54,739,098	120,174,215	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	72,883,582	108,611,113	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	16,868,522	48,238,912	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	2,408,722,017	2,256,249,913	
親投資信託受益証券　合計		2,553,213,219	2,533,274,153	
合計			2,533,274,153	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	31,745	46,142
コール・ローン	2,918,490	4,449,666
親投資信託受益証券	2,832,193,593	3,415,784,981
未収入金	548,719	1,282,641
流動資産合計	2,835,692,547	3,421,563,430
資産合計	2,835,692,547	3,421,563,430
負債の部		
流動負債		
未払解約金	474,687	1,163,184
未払受託者報酬	322,130	448,505
未払委託者報酬	2,684,767	4,047,620
その他未払費用	91,533	142,810
流動負債合計	3,573,117	5,802,119
負債合計	3,573,117	5,802,119
純資産の部		
元本等		
元本	2,268,236,888	2,819,505,262
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	563,882,542	596,256,049
（分配準備積立金）	159,580,466	145,730,152
元本等合計	2,832,119,430	3,415,761,311
純資産合計	2,832,119,430	3,415,761,311
負債純資産合計	2,835,692,547	3,421,563,430

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	13	25
有価証券売買等損益	112,517,710	△94,082,272
営業収益合計	112,517,723	△94,082,247
営業費用		
支払利息	625	1,143
受託者報酬	540,334	926,571
委託者報酬	4,503,477	8,031,871
その他費用	158,829	270,758
営業費用合計	5,203,265	9,230,343
営業利益又は営業損失（△）	107,314,458	△103,312,590
経常利益又は経常損失（△）	107,314,458	△103,312,590
当期純利益又は当期純損失（△）	107,314,458	△103,312,590
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（△）	10,925,307	△2,709,677
期首剰余金又は期首欠損金（△）	155,733,882	563,882,542
剰余金増加額又は欠損金減少額	349,147,326	189,091,016
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	349,147,326	189,091,016
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,387,817	56,114,596
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,387,817	56,114,596
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（△）	563,882,542	596,256,049

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	1,014,388,366円	2,268,236,888円
期中追加設定元本額	1,471,484,708円	777,589,965円
期中一部解約元本額	217,636,186円	226,321,591円
２．　受益権の総数	2,268,236,888口	2,819,505,262口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（96,389,626円）、収益調整金（404,302,673円）及び分配準備積立金（63,190,840円）より分配対象収益は563,883,139円（1万口当たり2,486.00円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（450,527,000円）及び分配準備積立金（145,730,152円）より分配対象収益は596,257,152円（1万口当たり2,114.76円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	82,264,702	△96,696,838
合計	82,264,702	△96,696,838

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2486円 (12,486円)	1.2115円 (12,115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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	240,808,726	528,671,477	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	200,892,569	299,370,106	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	221,778,338	634,219,513	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	2,085,538,471	1,953,523,885	
親投資信託受益証券　合計		2,749,018,104	3,415,784,981	
合計			3,415,784,981	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	49,768	72,029
コール・ローン	4,575,458	6,946,059
親投資信託受益証券	3,957,972,731	5,290,632,155
未収入金	529,186	572,025
流動資産合計	3,963,127,143	5,298,222,268
資産合計	3,963,127,143	5,298,222,268
負債の部		
流動負債		
未払解約金	422,071	385,694
未払受託者報酬	487,196	687,641
未払委託者報酬	4,222,676	6,344,558
その他未払費用	130,061	208,992
流動負債合計	5,262,004	7,626,885
負債合計	5,262,004	7,626,885
純資産の部		
元本等		
元本	2,917,126,953	3,961,669,398
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,040,738,186	1,328,925,985
（分配準備積立金）	390,484,392	365,280,967
元本等合計	3,957,865,139	5,290,595,383
純資産合計	3,957,865,139	5,290,595,383
負債純資産合計	3,963,127,143	5,298,222,268

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	21	40
有価証券売買等損益	270,698,509	△82,926,104
営業収益合計	270,698,530	△82,926,064
営業費用		
支払利息	1,046	1,833
受託者報酬	811,434	1,380,653
委託者報酬	7,033,118	12,351,017
その他費用	222,094	387,110
営業費用合計	8,067,692	14,120,613
営業利益又は営業損失（△）	262,630,838	△97,046,677
経常利益又は経常損失（△）	262,630,838	△97,046,677
当期純利益又は当期純損失（△）	262,630,838	△97,046,677
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（△）	18,632,082	895,636
期首剰余金又は期首欠損金（△）	273,687,058	1,040,738,186
剰余金増加額又は欠損金減少額	570,799,354	466,924,347
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	570,799,354	466,924,347
剰余金減少額又は欠損金増加額	47,746,982	80,794,235
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	47,746,982	80,794,235
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,040,738,186	1,328,925,985

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	1,413,786,138円	2,917,126,953円
期中追加設定元本額	1,722,619,889円	1,270,427,866円
期中一部解約元本額	219,279,074円	225,885,421円
２．　受益権の総数	2,917,126,953口	3,961,669,398口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（243,999,482円）、収益調整金（650,254,810円）及び分配準備積立金（146,484,910円）より分配対象収益は1,040,739,202円（1万口当たり3,567.69円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（963,646,793円）及び分配準備積立金（365,280,967円）より分配対象収益は1,328,927,760円（1万口当たり3,354.46円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	211,232,626	△92,184,668
合計	211,232,626	△92,184,668

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3568円 (13,568円)	1.3354円 (13,354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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	607,219,681	1,333,090,087	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	458,411,028	683,124,113	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	625,220,647	1,787,943,484	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	1,586,926,947	1,486,474,471	
親投資信託受益証券　合計		3,277,778,303	5,290,632,155	
合計			5,290,632,155	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17,766	30,432
コール・ローン	1,633,318	2,934,641
親投資信託受益証券	1,600,538,602	2,233,706,992
未収入金	427,072	179,741
流動資産合計	1,602,616,758	2,236,851,806
資産合計	1,602,616,758	2,236,851,806
負債の部		
流動負債		
未払解約金	383,381	100,486
未払受託者報酬	174,046	289,540
未払委託者報酬	1,508,656	2,672,154
その他未払費用	55,816	98,244
流動負債合計	2,121,899	3,160,424
負債合計	2,121,899	3,160,424
純資産の部		
元本等		
元本	1,139,582,522	1,607,104,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	460,912,337	626,587,365
（分配準備積立金）	131,666,074	121,127,630
元本等合計	1,600,494,859	2,233,691,382
純資産合計	1,600,494,859	2,233,691,382
負債純資産合計	1,602,616,758	2,236,851,806

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	4	14
有価証券売買等損益	96,323,652	△28,887,721
営業収益合計	96,323,656	△28,887,707
営業費用		
支払利息	268	684
受託者報酬	277,741	574,132
委託者報酬	2,407,650	5,138,921
その他費用	90,295	181,033
営業費用合計	2,775,954	5,894,770
営業利益又は営業損失（△）	93,547,702	△34,782,477
経常利益又は経常損失（△）	93,547,702	△34,782,477
当期純利益又は当期純損失（△）	93,547,702	△34,782,477
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（△）	7,622,904	368,683
期首剰余金又は期首欠損金（△）	93,720,255	460,912,337
剰余金増加額又は欠損金減少額	301,792,519	245,719,641
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	301,792,519	245,719,641
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,525,235	44,893,453
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,525,235	44,893,453
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（△）	460,912,337	626,587,365

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	426,598,305円	1,139,582,522円
期中追加設定元本額	793,296,990円	577,964,059円
期中一部解約元本額	80,312,773円	110,442,564円
２．　受益権の総数	1,139,582,522口	1,607,104,017口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（85,925,033円）、収益調整金（329,246,526円）及び分配準備積立金（45,741,041円）より分配対象収益は460,912,600円（1万口当たり4,044.57円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（505,460,401円）及び分配準備積立金（121,127,630円）より分配対象収益は626,588,031円（1万口当たり3,898.86円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	74,996,946	△32,518,226
合計	74,996,946	△32,518,226

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4045円 (14,045円)	1.3899円 (13,899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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	298,502,600	655,332,608	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	218,749,571	325,980,610	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	312,177,684	892,734,522	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	383,964,185	359,659,252	
親投資信託受益証券　合計		1,213,394,040	2,233,706,992	
合計			2,233,706,992	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	20,879	31,513
コール・ローン	1,919,524	3,038,878
親投資信託受益証券	1,665,096,096	2,343,119,271
未収入金	376,716	482,785
流動資産合計	1,667,413,215	2,346,672,447
資産合計	1,667,413,215	2,346,672,447
負債の部		
流動負債		
未払解約金	331,440	399,516
未払受託者報酬	203,469	299,975
未払委託者報酬	1,763,832	2,768,841
その他未払費用	63,825	101,222
流動負債合計	2,362,566	3,569,554
負債合計	2,362,566	3,569,554
純資産の部		
元本等		
元本	1,189,551,640	1,688,869,094
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	475,499,009	654,233,799
（分配準備積立金）	174,756,797	155,813,549
元本等合計	1,665,050,649	2,343,102,893
純資産合計	1,665,050,649	2,343,102,893
負債純資産合計	1,667,413,215	2,346,672,447

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	7	15
有価証券売買等損益	127,444,367	△27,383,427
営業収益合計	127,444,374	△27,383,412
営業費用		
支払利息	351	715
受託者報酬	337,635	593,385
委託者報酬	2,926,917	5,312,194
その他費用	108,478	186,067
営業費用合計	3,373,381	6,092,361
営業利益又は営業損失（△）	124,070,993	△33,475,773
経常利益又は経常損失（△）	124,070,993	△33,475,773
当期純利益又は当期純損失（△）	124,070,993	△33,475,773
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（△）	10,719,630	73,723
期首剰余金又は期首欠損金（△）	118,805,176	475,499,009
剰余金増加額又は欠損金減少額	269,869,961	275,894,265
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	269,869,961	275,894,265
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,527,491	63,609,979
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,527,491	63,609,979
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（△）	475,499,009	654,233,799

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	563,954,983円	1,189,551,640円
期中追加設定元本額	735,655,901円	657,710,443円
期中一部解約元本額	110,059,244円	158,392,989円
２．　受益権の総数	1,189,551,640口	1,688,869,094口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（113,351,646円）、収益調整金（300,742,554円）及び分配準備積立金（61,405,151円）より分配対象収益は475,499,351円（1万口当たり3,997.30円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（498,420,943円）及び分配準備積立金（155,813,549円）より分配対象収益は654,234,492円（1万口当たり3,873.80円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第6期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	99,261,734	△30,940,153
合計	99,261,734	△30,940,153

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 2021年12月20日現在	第6期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3997円 (13,997円)	1.3874円 (13,874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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	325,367,777	714,312,417	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	237,750,190	354,295,333	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	342,211,221	978,621,428	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	315,885,656	295,890,093	
親投資信託受益証券　合計		1,221,214,844	2,343,119,271	
合計			2,343,119,271	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	7,122	13,153
コール・ローン	654,771	1,268,418
親投資信託受益証券	680,470,781	961,500,055
未収入金	1,274,846	131,410
流動資産合計	682,407,520	962,913,036
資産合計	682,407,520	962,913,036
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,256,147	97,021
未払受託者報酬	69,909	124,394
未払委託者報酬	606,152	1,148,222
その他未払費用	23,224	50,109
流動負債合計	1,955,432	1,419,746
負債合計	1,955,432	1,419,746
純資産の部		
元本等		
元本	475,426,751	677,029,527
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	205,025,337	284,463,763
（分配準備積立金）	37,162,625	31,057,365
元本等合計	680,452,088	961,493,290
純資産合計	680,452,088	961,493,290
負債純資産合計	682,407,520	962,913,036

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	1	4
有価証券売買等損益	33,040,109	△10,477,806
営業収益合計	33,040,110	△10,477,802
営業費用		
支払利息	62	230
受託者報酬	101,823	246,134
委託者報酬	883,186	2,203,705
その他費用	33,786	90,620
営業費用合計	1,018,857	2,540,689
営業利益又は営業損失（△）	32,021,253	△13,018,491
経常利益又は経常損失（△）	32,021,253	△13,018,491
当期純利益又は当期純損失（△）	32,021,253	△13,018,491
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（△）	5,789,782	763,552
期首剰余金又は期首欠損金（△）	27,705,786	205,025,337
剰余金増加額又は欠損金減少額	170,198,754	137,143,663
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	170,198,754	137,143,663
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,110,674	43,923,194
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,110,674	43,923,194
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（△）	205,025,337	284,463,763

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	118,987,624円	475,426,751円
期中追加設定元本額	418,895,243円	302,826,414円
期中一部解約元本額	62,456,116円	101,223,638円
２．　受益権の総数	475,426,751口	677,029,527口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（26,231,531円）、収益調整金（167,862,772円）及び分配準備積立金（10,931,094円）より分配対象収益は205,025,397円（1万口当たり4,312.45円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（253,406,621円）及び分配準備積立金（31,057,365円）より分配対象収益は284,463,986円（1万口当たり4,201.65円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	23,286,973	△12,675,806
合計	23,286,973	△12,675,806

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4312円 (14,312円)	1.4202円 (14,202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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	137,166,509	301,135,353	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	99,611,331	148,440,805	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	144,812,171	414,119,365	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	104,413,935	97,804,532	
親投資信託受益証券　合計		486,003,946	961,500,055	
合計			961,500,055	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2021年12月20日現在	第7期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	18,845	26,190
コール・ローン	1,732,475	2,525,599
親投資信託受益証券	1,303,631,192	1,936,397,467
未収入金	4,733,601	5,912,167
流動資産合計	1,310,116,113	1,944,861,423
資産合計	1,310,116,113	1,944,861,423
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,697,956	5,843,197
未払受託者報酬	182,449	248,908
未払委託者報酬	1,581,609	2,298,520
その他未払費用	58,712	86,874
流動負債合計	6,520,726	8,477,499
負債合計	6,520,726	8,477,499
純資産の部		
元本等		
元本	764,717,172	1,143,590,256
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	538,878,215	792,793,668
（分配準備積立金）	155,898,556	127,911,475
元本等合計	1,303,595,387	1,936,383,924
純資産合計	1,303,595,387	1,936,383,924
負債純資産合計	1,310,116,113	1,944,861,423

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第7期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	6	11
有価証券売買等損益	128,342,343	△17,803,723
営業収益合計	128,342,349	△17,803,712
営業費用		
支払利息	314	553
受託者報酬	309,539	483,757
委託者報酬	2,683,366	4,334,158
その他費用	100,999	158,044
営業費用合計	3,094,218	4,976,512
営業利益又は営業損失（△）	125,248,131	△22,780,224
経常利益又は経常損失（△）	125,248,131	△22,780,224
当期純利益又は当期純損失（△）	125,248,131	△22,780,224
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（△）	21,603,665	1,891,692
期首剰余金又は期首欠損金（△）	206,847,962	538,878,215
剰余金増加額又は欠損金減少額	317,960,390	407,326,737
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	317,960,390	407,326,737
剰余金減少額又は欠損金増加額	89,574,603	128,739,368
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	89,574,603	128,739,368
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（△）	538,878,215	792,793,668

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第6期 2021年12月20日現在	第7期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	446,839,347円	764,717,172円
期中追加設定元本額	495,378,300円	560,878,174円
期中一部解約元本額	177,500,475円	182,005,090円
２．　受益権の総数	764,717,172口	1,143,590,256口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第7期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（103,644,696円）、収益調整金（382,979,958円）及び分配準備積立金（52,253,860円）より分配対象収益は538,878,514円（1万口当たり7,046.77円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（664,882,724円）及び分配準備積立金（127,911,475円）より分配対象収益は792,794,199円（1万口当たり6,932.50円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（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6期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第7期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2021年12月20日現在	第7期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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6期 2021年12月20日現在	第7期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	91,419,352	△22,593,253
合計	91,419,352	△22,593,253

（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6期 2021年12月20日現在	第7期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7047円 (17,047円)	1.6932円 (16,932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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	282,717,737	620,678,519	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	204,765,084	305,140,928	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	299,775,264	857,267,322	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	163,671,078	153,310,698	
親投資信託受益証券　合計		950,929,163	1,936,397,467	
合計			1,936,397,467	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	10,599	18,488
コール・ローン	974,433	1,782,848
親投資信託受益証券	855,263,528	1,380,927,052
未収入金	598,580	3,196,543
流動資産合計	856,847,140	1,385,924,931
資産合計	856,847,140	1,385,924,931
負債の部		
流動負債		
未払解約金	575,169	3,147,185
未払受託者報酬	103,170	175,302
未払委託者報酬	894,459	1,619,024
その他未払費用	34,310	66,061
流動負債合計	1,607,108	5,007,572
負債合計	1,607,108	5,007,572
純資産の部		
元本等		
元本	588,312,781	955,440,216
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	266,927,251	425,477,143
（分配準備積立金）	48,073,943	31,304,985
元本等合計	855,240,032	1,380,917,359
純資産合計	855,240,032	1,380,917,359
負債純資産合計	856,847,140	1,385,924,931

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
営業収益		
受取利息	2	7
有価証券売買等損益	52,648,472	△12,235,305
営業収益合計	52,648,474	△12,235,298
営業費用		
支払利息	125	338
受託者報酬	149,610	332,387
委託者報酬	1,297,252	2,980,790
その他費用	49,707	118,222
営業費用合計	1,496,694	3,431,737
営業利益又は営業損失（△）	51,151,780	△15,667,035
経常利益又は経常損失（△）	51,151,780	△15,667,035
当期純利益又は当期純損失（△）	51,151,780	△15,667,035
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（△）	12,671,626	3,745,459
期首剰余金又は期首欠損金（△）	34,245,478	266,927,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	245,043,701	320,956,199
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	245,043,701	320,956,199
剰余金減少額又は欠損金増加額	50,842,082	142,993,813
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	50,842,082	142,993,813
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（△）	266,927,251	425,477,143

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	141,064,244円	588,312,781円
期中追加設定元本額	605,255,833円	680,503,778円
期中一部解約元本額	158,007,296円	313,376,343円
２．　受益権の総数	588,312,781口	955,440,216口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（38,480,274円）、収益調整金（218,853,428円）及び分配準備積立金（9,593,669円）より分配対象収益は266,927,371円（1万口当たり4,537.17円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（394,172,478円）及び分配準備積立金（31,304,985円）より分配対象収益は425,477,463円（1万口当たり4,453.21円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2020年12月22日 至　2021年12月20日	第4期 自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	34,892,951	△17,987,580
合計	34,892,951	△17,987,580

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2021年12月20日現在	第4期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4537円 (14,537円)	1.4453円 (14,453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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	206,222,621	452,741,142	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	148,970,707	221,996,147	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	219,121,500	626,621,753	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	84,945,031	79,568,010	
親投資信託受益証券　合計		659,259,859	1,380,927,052	
合計			1,380,927,052	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りでありますが、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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	54,749,994
コール・ローン	5,279,738,972
株式	171,861,245,710
派生商品評価勘定	1,089,000
未収配当金	23,374,145
前払金	31,200,000
差入委託証拠金	210,600,000
流動資産合計	177,461,997,821
資産合計	177,461,997,821
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	108,043,000
未払解約金	174,542,052
その他未払費用	8,271
流動負債合計	282,593,323
負債合計	282,593,323
純資産の部	
元本等	
元本	80,706,172,215
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	96,473,232,283
元本等合計	177,179,404,498
純資産合計	177,179,404,498
負債純資産合計	177,461,997,821

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年12月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,267,646,540円
同期中追加設定元本額	52,878,361,826円
同期中一部解約元本額	25,439,836,151円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,608,108,766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）	3,301,108,142円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,478,197円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,223,059,163円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,578,112,418円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	5,806,173,111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）	3,786,589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）	13,802,145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）	13,300,503円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	1,693,878,579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	23,184,020,438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）	2,873,318,982円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	282,717,737円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	241,820,425円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	325,367,777円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	607,219,681円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	54,739,098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）	120,639,202円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	8,837,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	12,210,650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）	5,246,639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）	8,626,829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）	28,750,290円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	206,222,621円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	137,166,509円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	298,502,600円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	240,808,726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）	25,762,055,921円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）	20,956,359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）	73,536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）	157,515円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	26,567,179円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	15,338,605円
計	80,706,172,215円
２．　受益権の総数	80,706,172,215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12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,067,553,485
合計	1,067,553,485

（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12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	5,439,400,000	－	5,332,600,000	△106,800,000
合計	5,439,400,000	－	5,332,600,000	△106,800,000

（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12月20日現在
1口当たり純資産額	2.1954円
（1万口当たり純資産額）	(21,954円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年12月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	3,705.00	12,226,500	
ニッスイ	87,500	534.00	46,725,000	
マルハニチロ	13,500	2,437.00	32,899,500	
雪国まいたけ	7,500	993.00	7,447,500	
カネコ種苗	3,400	1,410.00	4,794,000	
サカタのタネ	11,100	4,340.00	48,174,000	
ホクト	7,800	1,869.00	14,578,200	
ショーボンドホールディングス	11,900	5,730.00	68,187,000	
ミライト・ワン	30,400	1,511.00	45,934,400	

タマホーム	6,200	2,480.00	15,376,000	
ファーストコーポレーション	1,300	702.00	912,600	
住石ホールディングス	14,000	393.00	5,502,000	
日鉄鉱業	3,500	2,999.00	10,496,500	
三井松島ホールディングス	4,000	3,070.00	12,280,000	
ＩＮＰＥＸ	323,800	1,408.00	455,910,400	
石油資源開発	10,100	3,825.00	38,632,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,000	2,096.00	8,384,000	
安藤・間	50,700	821.00	41,624,700	
東急建設	24,900	634.00	15,786,600	
コムシスホールディングス	29,600	2,358.00	69,796,800	
ビーアールホールディングス	14,000	329.00	4,606,000	
高松コンストラクショングループ	5,700	1,885.00	10,744,500	
東建コーポレーション	2,800	7,290.00	20,412,000	
ソネック	4,800	958.00	4,598,400	
ヤマウラ	4,900	997.00	4,885,300	
オリエンタル白石	31,500	281.00	8,851,500	
大成建設	61,000	4,175.00	254,675,000	
大林組	219,000	1,004.00	219,876,000	
清水建設	184,100	708.00	130,342,800	
飛島建設	6,800	998.00	6,786,400	
長谷工コーポレーション	63,200	1,489.00	94,104,800	
松井建設	8,700	560.00	4,872,000	
錢高組	1,500	2,610.00	3,915,000	
鹿島建設	135,800	1,503.00	204,107,400	
不動テトラ	4,200	1,446.00	6,073,200	
鉄建建設	4,400	1,754.00	7,717,600	
西松建設	10,400	3,910.00	40,664,000	
三井住友建設	49,400	414.00	20,451,600	
大豊建設	2,500	4,020.00	10,050,000	
佐田建設	10,800	443.00	4,784,400	
ナカノフドー建設	15,100	314.00	4,741,400	
奥村組	9,900	2,934.00	29,046,600	
東鉄工業	8,400	2,576.00	21,638,400	
淺沼組	4,900	2,947.00	14,440,300	
戸田建設	75,300	714.00	53,764,200	
熊谷組	10,600	2,562.00	27,157,200	
植木組	3,500	1,297.00	4,539,500	
矢作建設工業	8,300	749.00	6,216,700	
ピーエス三菱	7,900	601.00	4,747,900	
日本ハウスホールディングス	12,100	368.00	4,452,800	
大東建託	22,500	13,750.00	309,375,000	
新日本建設	8,600	729.00	6,269,400	
東亜道路工業	1,200	5,870.00	7,044,000	
日本道路	1,200	5,790.00	6,948,000	
東亜建設工業	5,300	2,307.00	12,227,100	
日本国土開発	18,400	564.00	10,377,600	
若築建設	2,700	2,864.00	7,732,800	
東洋建設	19,800	841.00	16,651,800	
五洋建設	86,800	622.00	53,989,600	

世紀東急工業	8,100	768.00	6,220,800	
福田組	2,300	4,600.00	10,580,000	
住友林業	47,000	2,385.00	112,095,000	
日本基礎技術	8,100	480.00	3,888,000	
巴コーポレーション	10,600	395.00	4,187,000	
大和ハウス工業	171,200	3,083.00	527,809,600	
ライト工業	11,700	1,911.00	22,358,700	
積水ハウス	191,900	2,385.00	457,681,500	
日特建設	5,800	897.00	5,202,600	
北陸電気工事	7,200	655.00	4,716,000	
ユアテック	13,500	709.00	9,571,500	
日本リーテック	6,600	763.00	5,035,800	
四電工	2,900	1,700.00	4,930,000	
中電工	9,500	2,059.00	19,560,500	
関電工	33,600	865.00	29,064,000	
きんでん	43,100	1,425.00	61,417,500	
東京エネシス	6,000	902.00	5,412,000	
トーエネック	2,000	3,385.00	6,770,000	
住友電設	5,800	2,362.00	13,699,600	
日本電設工業	10,100	1,516.00	15,311,600	
エクシオグループ	30,000	2,155.00	64,650,000	
新日本空調	3,400	1,848.00	6,283,200	
日本工営	4,600	3,250.00	14,950,000	
九電工	14,900	3,210.00	47,829,000	
三機工業	13,600	1,543.00	20,984,800	
日揮ホールディングス	60,600	1,692.00	102,535,200	
中外炉工業	3,100	1,598.00	4,953,800	
ヤマト	6,200	679.00	4,209,800	
太平電業	3,800	3,115.00	11,837,000	
高砂熱学工業	14,800	1,761.00	26,062,800	
三晃金属工業	1,700	2,962.00	5,035,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	20,900	1,600.00	33,440,000	
朝日工業社	2,500	2,090.00	5,225,000	
明星工業	10,500	737.00	7,738,500	
大氣社	7,400	3,415.00	25,271,000	
ダイダン	4,000	2,186.00	8,744,000	
日比谷総合設備	5,300	1,880.00	9,964,000	
ニップン	16,600	1,596.00	26,493,600	
日清製粉グループ本社	56,900	1,540.00	87,626,000	
日東富士製粉	1,100	4,360.00	4,796,000	
昭和産業	5,400	2,416.00	13,046,400	
中部飼料	8,500	1,022.00	8,687,000	
フィード・ワン	9,000	676.00	6,084,000	
日本甜菜製糖	3,600	1,613.00	5,806,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	6,100	1,993.00	12,157,300	
塩水港精糖	23,200	194.00	4,500,800	
日新製糖	3,200	1,902.00	6,086,400	
ＬＩＦＵＬＬ	28,900	223.00	6,444,700	
ＭＩＸＩ	14,600	2,380.00	34,748,000	
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,484.00	14,407,200	

日本M&Aセンターホールディングス	110,100	1,611.00	177,371,100	
メンバーズ	2,300	1,991.00	4,579,300	
ＵＴグループ	9,400	2,207.00	20,745,800	
アイティメディア	2,900	1,622.00	4,703,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,100	1,283.00	5,260,300	
夢真ビーネックスグループ	23,400	1,782.00	41,698,800	
コシダカホールディングス	19,200	1,057.00	20,294,400	
アルトナー	1,300	975.00	1,267,500	
パソナグループ	7,800	1,845.00	14,391,000	
ＣＤＳ	2,700	1,788.00	4,827,600	
リンクアンドモチベーション	18,500	641.00	11,858,500	
エス・エム・エス	24,400	3,210.00	78,324,000	
サニーサイドアップグループ	7,000	559.00	3,913,000	
パーソルホールディングス	71,900	2,872.00	206,496,800	
クックパッド	23,900	194.00	4,636,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,700	636.00	4,897,200	
森永製菓	12,700	3,865.00	49,085,500	
中村屋	1,600	3,090.00	4,944,000	
江崎グリコ	17,600	3,675.00	64,680,000	
名糖産業	3,000	1,602.00	4,806,000	
井村屋グループ	3,400	2,224.00	7,561,600	
不二家	4,200	2,584.00	10,852,800	
山崎製パン	41,200	1,609.00	66,290,800	
モロゾフ	2,000	3,475.00	6,950,000	
亀田製菓	3,900	4,400.00	17,160,000	
寿スピリッツ	6,500	7,290.00	47,385,000	
カルビー	28,100	3,060.00	85,986,000	
森永乳業	11,200	4,800.00	53,760,000	
六甲バター	4,500	1,333.00	5,998,500	
ヤクルト本社	43,900	8,830.00	387,637,000	
明治ホールディングス	38,100	6,660.00	253,746,000	
雪印メグミルク	14,900	1,758.00	26,194,200	
プリマハム	8,300	2,095.00	17,388,500	
日本ハム	24,000	3,635.00	87,240,000	
林兼産業	7,000	434.00	3,038,000	
丸大食品	6,200	1,406.00	8,717,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,800	2,901.00	19,726,800	
柿安本店	2,400	2,108.00	5,059,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	47,800	687.00	32,838,600	
学情	3,200	1,362.00	4,358,400	
スタジオアリス	3,200	2,036.00	6,515,200	
クロスキャット	3,600	1,394.00	5,018,400	
シミックホールディングス	3,500	1,677.00	5,869,500	
システナ	105,300	404.00	42,541,200	
ＮＪＳ	2,300	2,011.00	4,625,300	
デジタルアーツ	4,000	5,700.00	22,800,000	
日鉄ソリューションズ	10,700	3,160.00	33,812,000	
綜合警備保障	23,800	3,455.00	82,229,000	
キューブシステム	4,900	1,054.00	5,164,600	
いちご	70,800	292.00	20,673,600	

日本駐車場開発	73,200	290.00	21,228,000	
コア	3,300	1,422.00	4,692,600	
カカクコム	47,900	2,057.00	98,530,300	
アイロムグループ	2,300	2,404.00	5,529,200	
セントケア・ホールディング	5,800	821.00	4,761,800	
ルネサンス	5,100	861.00	4,391,100	
ディップ	11,200	3,730.00	41,776,000	
ＳＢＳホールディングス	5,600	2,900.00	16,240,000	
デジタルホールディングス	5,000	1,212.00	6,060,000	
新日本科学	6,800	2,218.00	15,082,400	
ベネフィット・ワン	29,700	1,892.00	56,192,400	
エムスリー	126,800	3,614.00	458,255,200	
アウトソーシング	38,200	919.00	35,105,800	
ウェルネット	7,700	593.00	4,566,100	
ワールドホールディングス	2,900	2,733.00	7,925,700	
ディー・エヌ・エー	27,400	1,750.00	47,950,000	
博報堂ＤＹホールディングス	81,900	1,282.00	104,995,800	
ぐるなび	11,800	385.00	4,543,000	
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	850.00	4,760,000	
ファンコミュニケーションズ	12,600	427.00	5,380,200	
ライク	2,400	1,955.00	4,692,000	
ビジネス・ブレークスルー	11,700	382.00	4,469,400	
エスプール	18,400	898.00	16,523,200	
ＷＤＢホールディングス	3,300	2,114.00	6,976,200	
手間いらず	1,100	4,715.00	5,186,500	
アドウェイズ	8,800	494.00	4,347,200	
バリューコマース	4,800	1,802.00	8,649,600	
インフォマート	66,600	383.00	25,507,800	
サッポロホールディングス	20,200	3,425.00	69,185,000	
アサヒグループホールディングス	142,100	4,168.00	592,272,800	
キリンホールディングス	277,500	2,059.50	571,511,250	
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	272.00	5,004,800	
養命酒製造	2,700	1,794.00	4,843,800	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	48,200	1,444.00	69,600,800	
サントリー食品インターナショナル	43,300	4,555.00	197,231,500	
ダイドーグループホールディングス	3,500	4,805.00	16,817,500	
伊藤園	22,900	4,905.00	112,324,500	
キーコーヒー	6,900	2,054.00	14,172,600	
日清オイリオグループ	8,700	3,210.00	27,927,000	
不二製油グループ本社	14,300	2,045.00	29,243,500	
Ｊ－オイルミルズ	6,300	1,502.00	9,462,600	
ローソン	16,400	4,920.00	80,688,000	
サンエー	5,000	4,270.00	21,350,000	
カワチ薬品	5,200	2,156.00	11,211,200	
エービーシー・マート	9,600	7,130.00	68,448,000	
ハードオフコーポレーション	2,800	1,328.00	3,718,400	
高千穂交易	2,400	2,131.00	5,114,400	
アスクル	15,900	1,609.00	25,583,100	

ゲオホールディングス	6,900	1,932.00	13,330,800	
アダストリア	8,000	1,923.00	15,384,000	
伊藤忠食品	1,500	4,905.00	7,357,500	
くら寿司	7,700	3,115.00	23,985,500	
キャンドゥ	2,300	2,163.00	4,974,900	
エレマテック	5,900	1,512.00	8,920,800	
パルグループホールディングス	6,500	2,197.00	14,280,500	
エディオン	26,200	1,265.00	33,143,000	
あらた	5,100	3,955.00	20,170,500	
サーラコーポレーション	13,900	707.00	9,827,300	
トーメンデバイス	1,000	5,540.00	5,540,000	
ハローズ	3,000	2,913.00	8,739,000	
ＪＰホールディングス	18,500	284.00	5,254,000	
フジオフードグループ本社	5,500	1,388.00	7,634,000	
あみやき亭	1,700	2,889.00	4,911,300	
東京エレクトロン　デバイス	2,400	6,900.00	16,560,000	
円谷フィールズホールディングス	5,700	2,570.00	14,649,000	
双日	70,100	2,486.00	174,268,600	
アルフレッサ　ホールディングス	66,300	1,666.00	110,455,800	
大黒天物産	2,400	5,050.00	12,120,000	
ハニーズホールディングス	5,900	1,272.00	7,504,800	
ファーマライズホールディングス	7,000	654.00	4,578,000	
キッコーマン	40,700	7,290.00	296,703,000	
味の素	150,500	4,367.00	657,233,500	
ブルドックソース	2,900	1,729.00	5,014,100	
キユーピー	33,000	2,438.00	80,454,000	
ハウス食品グループ本社	18,800	2,754.00	51,775,200	
カゴメ	28,600	3,055.00	87,373,000	
アリアケジャパン	5,400	4,475.00	24,165,000	
エバラ食品工業	1,700	3,005.00	5,108,500	
ニチレイ	28,200	2,800.00	78,960,000	
横浜冷凍	18,000	1,059.00	19,062,000	
東洋水産	31,100	5,200.00	161,720,000	
イートアンドホールディングス	2,600	2,267.00	5,894,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,000	568.00	5,680,000	
日清食品ホールディングス	21,900	10,490.00	229,731,000	
永谷園ホールディングス	3,000	2,001.00	6,003,000	
一正蒲鉾	6,100	719.00	4,385,900	
フジッコ	6,300	1,893.00	11,925,900	
ロック・フィールド	7,500	1,496.00	11,220,000	
日本たばこ産業	404,800	2,832.50	1,146,596,000	
ケンコーマヨネーズ	4,200	1,485.00	6,237,000	
わらべや日洋ホールディングス	4,500	1,878.00	8,451,000	
なとり	3,900	2,025.00	7,897,500	
ファーマフーズ	9,500	1,438.00	13,661,000	
北の達人コーポレーション	26,400	267.00	7,048,800	
ユーグレナ	39,600	987.00	39,085,200	
紀文食品	5,400	950.00	5,130,000	
ピックルスホールディングス	4,600	1,069.00	4,917,400	
ＳＲＥホールディングス	3,000	3,790.00	11,370,000	

ＡＤワークスグループ	20,200	148.00	2,989,600	
片倉工業	5,800	1,742.00	10,103,600	
グンゼ	4,700	3,985.00	18,729,500	
ヒューリック	143,500	1,093.00	156,845,500	
アルペン	5,400	1,991.00	10,751,400	
ラクーンホールディングス	6,200	1,075.00	6,665,000	
クオールホールディングス	9,100	1,160.00	10,556,000	
アルコニックス	8,700	1,299.00	11,301,300	
神戸物産	51,100	3,630.00	185,493,000	
ソリトンシステムズ	4,700	1,009.00	4,742,300	
ジンズホールディングス	3,900	4,440.00	17,316,000	
ビックカメラ	43,900	1,256.00	55,138,400	
ＤＣＭホールディングス	40,300	1,166.00	46,989,800	
ハイパー	4,500	533.00	2,398,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	93,700	1,877.00	175,874,900	
東京一番フーズ	8,200	485.00	3,977,000	
あい　ホールディングス	10,600	2,117.00	22,440,200	
ディーブイエックス	4,700	1,013.00	4,761,100	
アークランドサービスホールディングス	5,400	2,210.00	11,934,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	82,100	1,135.00	93,183,500	
ドトール・日レスホールディングス	11,700	1,692.00	19,796,400	
マツキヨココカラ＆カンパニー	40,100	5,990.00	240,199,000	
ブロンコビリー	3,500	2,497.00	8,739,500	
ＺＯＺＯ	43,700	3,175.00	138,747,500	
トレジャー・ファクトリー	700	2,433.00	1,703,100	
物語コーポレーション	3,700	6,250.00	23,125,000	
三越伊勢丹ホールディングス	111,200	1,311.00	145,783,200	
東洋紡	27,000	1,003.00	27,081,000	
ユニチカ	18,900	243.00	4,592,700	
富士紡ホールディングス	2,500	3,355.00	8,387,500	
日清紡ホールディングス	51,300	988.00	50,684,400	
倉敷紡績	4,700	2,170.00	10,199,000	
ダイワボウホールディングス	27,000	1,937.00	52,299,000	
日東紡績	7,500	1,922.00	14,415,000	
トヨタ紡織	26,300	1,782.00	46,866,600	
マクニカホールディングス	16,200	3,385.00	54,837,000	
Ｈａｍｅｅ	5,800	691.00	4,007,800	
ラクト・ジャパン	2,500	2,099.00	5,247,500	
ウエルシアホールディングス	34,300	3,005.00	103,071,500	
クリエイトＳＤホールディングス	10,900	3,230.00	35,207,000	
グリムス	2,700	1,908.00	5,151,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,700	840.00	8,148,000	
八洲電機	5,300	1,007.00	5,337,100	
メディアスホールディングス	6,900	700.00	4,830,000	
レスターホールディングス	6,300	2,054.00	12,940,200	
ジューテックホールディングス	4,500	1,125.00	5,062,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,700	324.00	4,114,800	
ＯＣＨＩホールディングス	3,900	1,206.00	4,703,400	

ＴＯＫＡＩホールディングス	32,600	856.00	27,905,600	
ミサワ	8,000	613.00	4,904,000	
ティーライフ	3,400	1,289.00	4,382,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	6,600	725.00	4,785,000	
三洋貿易	6,800	1,081.00	7,350,800	
シュッピン	4,900	1,217.00	5,963,300	
オイシックス・ラ・大地	8,900	1,960.00	17,444,000	
ウイン・パートナーズ	5,000	974.00	4,870,000	
ネクステージ	15,100	2,549.00	38,489,900	
ジョイフル本田	21,300	1,851.00	39,426,300	
鳥貴族ホールディングス	2,400	2,080.00	4,992,000	
ホットランド	5,000	1,444.00	7,220,000	
すかいらーくホールディングス	90,300	1,584.00	143,035,200	
ＳＦＰホールディングス	3,600	1,732.00	6,235,200	
綿半ホールディングス	5,100	1,313.00	6,696,300	
日本毛織	18,200	975.00	17,745,000	
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	1,128.00	24,252,000	
三栄建築設計	3,300	1,499.00	4,946,700	
野村不動産ホールディングス	38,400	2,982.00	114,508,800	
三重交通グループホールディングス	13,200	481.00	6,349,200	
サムティ	9,800	2,157.00	21,138,600	
ディア・ライフ	9,300	614.00	5,710,200	
コーセーアールイー	7,200	767.00	5,522,400	
地主	4,700	1,920.00	9,024,000	
プレサンスコーポレーション	8,100	1,480.00	11,988,000	
ハウスコム	4,000	1,058.00	4,232,000	
ＪＰＭＣ	4,800	1,010.00	4,848,000	
サンセイランディック	5,700	842.00	4,799,400	
エストラスト	8,700	585.00	5,089,500	
フージャースホールディングス	9,500	727.00	6,906,500	
オープンハウスグループ	22,500	5,170.00	116,325,000	
東急不動産ホールディングス	184,900	664.00	122,773,600	
飯田グループホールディングス	53,900	2,047.00	110,333,300	
ムゲンエステート	10,100	519.00	5,241,900	
帝国繊維	7,000	1,626.00	11,382,000	
日本コークス工業	56,500	86.00	4,859,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,400	1,543.00	5,246,200	
ＢＥＥＮＯＳ	3,700	2,303.00	8,521,100	
あさひ	5,500	1,347.00	7,408,500	
日本調剤	4,500	1,174.00	5,283,000	
コスモス薬品	7,500	13,670.00	102,525,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,700	2,634.00	62,425,800	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	3,090.00	8,034,000	
セブン&アイ・ホールディングス	227,700	5,585.00	1,271,704,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	49,700	911.00	45,276,700	
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	9,140.00	148,068,000	
サンマルクホールディングス	5,300	1,672.00	8,861,600	

フェリシモ	4,400	1,001.00	4,404,400	
トリドールホールディングス	16,400	2,706.00	44,378,400	
帝人	60,100	1,310.00	78,731,000	
東レ	419,100	754.60	316,252,860	
クラレ	99,400	1,098.00	109,141,200	
旭化成	390,600	965.40	377,085,240	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,000	256.00	3,584,000	
稲葉製作所	3,800	1,369.00	5,202,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,800	3,350.00	6,030,000	
トーカロ	17,700	1,187.00	21,009,900	
アルファ	4,700	918.00	4,314,600	
ＳＵＭＣＯ	122,700	1,904.00	233,620,800	
川田テクノロジーズ	1,500	3,305.00	4,957,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,100	7,800.00	16,380,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,600	825.00	4,620,000	
シーアールイー	3,400	1,211.00	4,117,400	
ケイアイスター不動産	3,000	4,535.00	13,605,000	
グッドコムアセット	7,000	819.00	5,733,000	
ジェイ・エス・ビー	1,500	3,785.00	5,677,500	
ロードスターキャピタル	3,100	1,567.00	4,857,700	
日本フエルト	11,500	405.00	4,657,500	
イチカワ	3,500	1,308.00	4,578,000	
芦森工業	4,100	1,135.00	4,653,500	
アツギ	10,200	393.00	4,008,600	
ＪＭホールディングス	5,600	1,694.00	9,486,400	
コメダホールディングス	16,200	2,457.00	39,803,400	
アレンザホールディングス	5,100	985.00	5,023,500	
バロックジャパンリミテッド	6,100	808.00	4,928,800	
クスリのアオキホールディングス	6,600	8,210.00	54,186,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	37,900	2,666.00	101,041,400	
アセンテック	9,400	449.00	4,220,600	
セーレン	12,100	2,486.00	30,080,600	
ソトー	5,800	827.00	4,796,600	
東海染工	1,600	1,125.00	1,800,000	
小松マテーレ	9,100	765.00	6,961,500	
ワコールホールディングス	12,000	2,301.00	27,612,000	
ホギメディカル	8,400	3,400.00	28,560,000	
ＴＳＩホールディングス	22,400	434.00	9,721,600	
マツオカコーポレーション	5,300	1,063.00	5,633,900	
ワールド	8,000	1,235.00	9,880,000	
ＴＩＳ	70,400	3,540.00	249,216,000	
グリー	33,600	686.00	23,049,600	
コーエーテクモホールディングス	39,200	2,259.00	88,552,800	
三菱総合研究所	3,100	4,730.00	14,663,000	
ＡＧＳ	6,400	670.00	4,288,000	
ファインデックス	8,000	498.00	3,984,000	
ブレインパッド	6,200	784.00	4,860,800	
ＫＬａｂ	12,300	406.00	4,993,800	
ポールトゥウィンホールディングス	10,700	811.00	8,677,700	

ネクソン	161,800	2,871.00	464,527,800	
アイスタイル	20,000	553.00	11,060,000	
エムアップホールディングス	7,700	1,256.00	9,671,200	
エイチーム	6,400	769.00	4,921,600	
エニグモ	8,900	606.00	5,393,400	
コロプラ	24,300	635.00	15,430,500	
ブロードリーフ	36,600	418.00	15,298,800	
クロス・マーケティンググループ	5,600	693.00	3,880,800	
デジタルハーツホールディングス	3,900	1,793.00	6,992,700	
システム情報	5,500	860.00	4,730,000	
メディアドゥ	2,500	1,713.00	4,282,500	
じげん	18,300	364.00	6,661,200	
ブイキューブ	7,500	745.00	5,587,500	
サイバーリンクス	3,700	940.00	3,478,000	
フィックスターズ	7,100	1,222.00	8,676,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,000	1,562.00	4,686,000	
オプティム	5,400	1,041.00	5,621,400	
セレス	4,800	870.00	4,176,000	
ＳＨＩＦＴ	4,600	24,810.00	114,126,000	
特種東海製紙	3,100	2,765.00	8,571,500	
ティーガイア	6,500	1,683.00	10,939,500	
テクマトリックス	11,400	1,666.00	18,992,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,200	2,106.00	40,435,200	
GMOペイメントゲートウェイ	14,300	11,370.00	162,591,000	
インターネットイニシアティブ	34,900	2,409.00	84,074,100	
さくらインターネット	9,200	496.00	4,563,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	3,740.00	7,106,000	
ＳＲＡホールディングス	3,200	3,000.00	9,600,000	
朝日ネット	8,300	562.00	4,664,600	
ｅＢＡＳＥ	8,800	561.00	4,936,800	
アバントグループ	7,900	1,346.00	10,633,400	
アドソル日進	3,400	1,382.00	4,698,800	
フリービット	4,500	992.00	4,464,000	
コムチュア	8,300	2,494.00	20,700,200	
サイバーコム	600	1,416.00	849,600	
アステリア	6,100	716.00	4,367,600	
アイル	3,500	1,827.00	6,394,500	
王子ホールディングス	260,600	534.00	139,160,400	
日本製紙	32,600	952.00	31,035,200	
三菱製紙	8,100	280.00	2,268,000	
北越コーポレーション	39,500	770.00	30,415,000	
大王製紙	27,600	1,042.00	28,759,200	
阿波製紙	14,800	300.00	4,440,000	
マークラインズ	3,400	2,511.00	8,537,400	
メディカル・データ・ビジョン	9,300	914.00	8,500,200	
ｇｕｍｉ	10,200	712.00	7,262,400	
テラスカイ	2,700	2,571.00	6,941,700	

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,300	1,889.00	6,233,700	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,100	2,396.00	5,031,600	
ラクス	29,600	1,589.00	47,034,400	
ランドコンピュータ	5,500	904.00	4,972,000	
ダブルスタンダード	2,500	2,045.00	5,112,500	
オープンドア	4,400	1,718.00	7,559,200	
アカツキ	3,000	2,167.00	6,501,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	2,038.00	4,687,400	
カナミックネットワーク	9,000	569.00	5,121,000	
ノムラシステムコーポレーション	39,000	118.00	4,602,000	
レンゴー	57,000	908.00	51,756,000	
トーモク	3,600	1,598.00	5,752,800	
ザ・パック	4,600	2,388.00	10,984,800	
チェンジ	15,300	2,347.00	35,909,100	
シンクロ・フード	200	417.00	83,400	
オークネット	3,300	1,787.00	5,897,100	
キャピタル・アセット・プランニング	7,600	573.00	4,354,800	
マクロミル	14,200	1,039.00	14,753,800	
ビーグリー	3,500	1,184.00	4,144,000	
オロ	3,100	1,783.00	5,527,300	
ユーザーローカル	3,100	1,378.00	4,271,800	
マネーフォワード	15,100	4,120.00	62,212,000	
昭和電工	60,400	2,131.00	128,712,400	
住友化学	464,000	472.00	219,008,000	
住友精化	2,600	4,140.00	10,764,000	
日産化学	29,700	6,190.00	183,843,000	
ラサ工業	2,400	1,895.00	4,548,000	
クレハ	5,300	8,200.00	43,460,000	
多木化学	2,400	4,690.00	11,256,000	
テイカ	4,200	1,181.00	4,960,200	
石原産業	11,300	1,061.00	11,989,300	
片倉コープアグリ	3,900	1,532.00	5,974,800	
日本曹達	6,700	4,235.00	28,374,500	
東ソー	83,500	1,588.00	132,598,000	
トクヤマ	20,200	1,838.00	37,127,600	
セントラル硝子	10,000	3,045.00	30,450,000	
東亞合成	32,200	1,113.00	35,838,600	
大阪ソーダ	3,700	3,995.00	14,781,500	
関東電化工業	12,100	928.00	11,228,800	
デンカ	22,700	3,080.00	69,916,000	
イビデン	36,200	4,835.00	175,027,000	
信越化学工業	107,000	16,920.00	1,810,440,000	
日本カーバイド工業	3,500	1,259.00	4,406,500	
電算システムホールディングス	3,000	2,168.00	6,504,000	
堺化学工業	4,800	1,790.00	8,592,000	
第一稀元素化学工業	5,700	1,044.00	5,950,800	
エア・ウォーター	59,000	1,527.00	90,093,000	
日本酸素ホールディングス	60,700	2,014.00	122,249,800	
日本化学工業	2,600	1,749.00	4,547,400	

日本パーカライジング	31,000	946.00	29,326,000	
高圧ガス工業	9,100	654.00	5,951,400	
四国化成工業	7,400	1,305.00	9,657,000	
ステラ　ケミファ	3,700	2,501.00	9,253,700	
保土谷化学工業	1,800	2,855.00	5,139,000	
日本触媒	9,500	5,300.00	50,350,000	
大日精化工業	4,300	1,695.00	7,288,500	
カネカ	14,300	3,295.00	47,118,500	
協和キリン	75,700	3,040.00	230,128,000	
三菱瓦斯化学	46,700	1,860.00	86,862,000	
三井化学	52,600	3,065.00	161,219,000	
ＪＳＲ	58,400	2,731.00	159,490,400	
東京応化工業	10,900	6,450.00	70,305,000	
大阪有機化学工業	4,700	1,961.00	9,216,700	
三菱ケミカルグループ	422,100	695.70	293,654,970	
ＫＨネオケム	10,400	2,653.00	27,591,200	
ダイセル	92,000	977.00	89,884,000	
住友ベークライト	9,300	4,035.00	37,525,500	
積水化学工業	129,900	1,892.00	245,770,800	
日本ゼオン	37,500	1,326.00	49,725,000	
アイカ工業	15,800	3,215.00	50,797,000	
ＵＢＥ	32,200	1,946.00	62,661,200	
積水樹脂	9,100	1,773.00	16,134,300	
タキロンシーアイ	13,700	506.00	6,932,200	
旭有機材	4,200	2,718.00	11,415,600	
ニチバン	3,900	1,794.00	6,996,600	
リケンテクノス	13,500	481.00	6,493,500	
大倉工業	2,900	1,980.00	5,742,000	
積水化成品工業	12,500	391.00	4,887,500	
群栄化学工業	2,000	2,332.00	4,664,000	
ダイキョーニシカワ	13,800	560.00	7,728,000	
森六ホールディングス	3,200	1,699.00	5,436,800	
恵和	2,000	3,150.00	6,300,000	
日本化薬	47,800	1,168.00	55,830,400	
カーリットホールディングス	7,200	772.00	5,558,400	
ＣＬホールディングス	5,700	786.00	4,480,200	
プレステージ・インターナショナル	27,000	691.00	18,657,000	
プロトコーポレーション	7,800	1,221.00	9,523,800	
アミューズ	3,500	1,725.00	6,037,500	
野村総合研究所	128,500	3,115.00	400,277,500	
ドリームインキュベータ	2,100	2,225.00	4,672,500	
サイバネットシステム	5,200	902.00	4,690,400	
クイック	4,900	1,993.00	9,765,700	
ＴＡＣ	22,800	209.00	4,765,200	
ＣＥホールディングス	9,700	547.00	5,305,900	
電通グループ	67,300	4,105.00	276,266,500	
インテージホールディングス	8,500	1,392.00	11,832,000	
ぴあ	2,200	3,080.00	6,776,000	
イオンファンタジー	2,800	2,735.00	7,658,000	
ソースネクスト	31,800	276.00	8,776,800	

シーティーエス	7,100	848.00	6,020,800	
インフォコム	8,100	1,966.00	15,924,600	
メディカルシステムネットワーク	11,800	402.00	4,743,600	
日本精化	3,600	2,279.00	8,204,400	
扶桑化学工業	5,800	3,475.00	20,155,000	
トリケミカル研究所	8,300	2,065.00	17,139,500	
シンプレクス・ホールディングス	10,500	2,100.00	22,050,000	
ＨＥＲＯＺ	4,400	971.00	4,272,400	
ラクスル	8,800	3,300.00	29,040,000	
メルカリ	28,200	2,668.00	75,237,600	
ＩＰＳ	2,000	2,769.00	5,538,000	
ＦＩＧ	12,000	419.00	5,028,000	
ＡＤＥＫＡ	21,800	2,178.00	47,480,400	
日油	19,300	5,410.00	104,413,000	
ミヨシ油脂	3,300	984.00	3,247,200	
新日本理化	5,800	242.00	1,403,600	
ハリマ化成グループ	5,800	825.00	4,785,000	
イーソル	7,600	813.00	6,178,800	
アルテリア・ネットワークス	5,800	1,234.00	7,157,200	
ウイングアーク１ｓｔ	6,400	2,100.00	13,440,000	
サーバーワークス	1,900	2,440.00	4,636,000	
トビラシステムズ	4,900	852.00	4,174,800	
Ｓａｎｓａｎ	23,400	1,457.00	34,093,800	
ギフティ	6,700	2,110.00	14,137,000	
花王	152,300	5,301.00	807,342,300	
第一工業製薬	2,600	1,869.00	4,859,400	
石原ケミカル	3,900	1,230.00	4,797,000	
日華化学	5,500	864.00	4,752,000	
三洋化成工業	3,800	4,030.00	15,314,000	
ベース	2,100	3,420.00	7,182,000	
ＪＭＤＣ	10,300	4,325.00	44,547,500	
武田薬品工業	554,200	4,072.00	2,256,702,400	
アステラス製薬	600,200	2,071.50	1,243,314,300	
住友ファーマ	46,500	1,009.00	46,918,500	
塩野義製薬	80,000	6,675.00	534,000,000	
わかもと製薬	5,400	223.00	1,204,200	
日本新薬	14,800	7,470.00	110,556,000	
中外製薬	196,000	3,452.00	676,592,000	
科研製薬	10,700	3,885.00	41,569,500	
エーザイ	76,200	9,038.00	688,695,600	
理研ビタミン	5,300	1,783.00	9,449,900	
ロート製薬	30,300	4,485.00	135,895,500	
小野薬品工業	120,800	3,357.00	405,525,600	
久光製薬	13,900	3,785.00	52,611,500	
有機合成薬品工業	15,800	288.00	4,550,400	
持田製薬	7,500	3,400.00	25,500,000	
参天製薬	121,600	1,098.00	133,516,800	
扶桑薬品工業	2,400	1,998.00	4,795,200	
ツムラ	19,700	2,960.00	58,312,000	
テルモ	195,100	3,785.00	738,453,500	

Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	18,800	2,744.00	51,587,200	
キッセイ薬品工業	9,700	2,518.00	24,424,600	
生化学工業	11,900	927.00	11,031,300	
栄研化学	10,200	1,785.00	18,207,000	
鳥居薬品	3,400	2,856.00	9,710,400	
ＪＣＲファーマ	21,200	1,707.00	36,188,400	
東和薬品	9,600	2,095.00	20,112,000	
富士製薬工業	4,500	980.00	4,410,000	
ゼリア新薬工業	8,700	2,256.00	19,627,200	
第一三共	545,600	4,317.00	2,355,355,200	
キョーリン製薬ホールディングス	13,600	1,719.00	23,378,400	
大幸薬品	11,400	420.00	4,788,000	
ダイト	4,700	2,473.00	11,623,100	
大塚ホールディングス	143,300	4,450.00	637,685,000	
大正製薬ホールディングス	13,900	5,730.00	79,647,000	
ペプチドリーム	30,400	1,578.00	47,971,200	
大日本塗料	7,600	754.00	5,730,400	
日本ペイントホールディングス	276,800	1,075.00	297,560,000	
関西ペイント	57,300	1,665.00	95,404,500	
中国塗料	11,600	979.00	11,356,400	
藤倉化成	12,300	407.00	5,006,100	
太陽ホールディングス	9,500	2,344.00	22,268,000	
ＤＩＣ	24,400	2,402.00	58,608,800	
サカタインクス	13,900	1,089.00	15,137,100	
東洋インキＳＣホールディングス	12,200	1,871.00	22,826,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,600	1,089.00	6,098,400	
アルプス技研	5,600	2,069.00	11,586,400	
日本空調サービス	6,900	693.00	4,781,700	
オリエンタルランド	67,900	18,540.00	1,258,866,000	
フォーカスシステムズ	4,800	976.00	4,684,800	
ダスキン	14,300	2,958.00	42,299,400	
パーク２４	47,900	2,122.00	101,643,800	
明光ネットワークジャパン	8,400	618.00	5,191,200	
ファルコホールディングス	2,900	1,717.00	4,979,300	
クレスコ	4,800	1,722.00	8,265,600	
フジ・メディア・ホールディングス	60,200	1,054.00	63,450,800	
秀英予備校	11,100	432.00	4,795,200	
ラウンドワン	53,700	495.00	26,581,500	
リゾートトラスト	25,300	2,313.00	58,518,900	
オービック	20,900	19,880.00	415,492,000	
ジャストシステム	9,000	2,864.00	25,776,000	
ＴＤＣソフト	5,300	1,469.00	7,785,700	
Ｚホールディングス	891,300	340.60	303,576,780	
ビー・エム・エル	8,000	3,360.00	26,880,000	
トレンドマイクロ	36,200	6,180.00	223,716,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,600	994.00	10,536,400	
ＩＤホールディングス	5,300	896.00	4,748,800	
リソー教育	29,200	348.00	10,161,600	
日本オラクル	12,000	7,890.00	94,680,000	
早稲田アカデミー	4,300	1,098.00	4,721,400	

アルファシステムズ	2,000	3,970.00	7,940,000	
フューチャー	15,600	1,618.00	25,240,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,800	1,459.00	5,544,200	
ＳＢテクノロジー	2,700	1,893.00	5,111,100	
トーセ	6,200	738.00	4,575,600	
ユー・エス・エス	66,000	2,148.00	141,768,000	
オービックビジネスコンサルタント	12,300	4,235.00	52,090,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	33,600	3,085.00	103,656,000	
アイティフォー	8,200	833.00	6,830,600	
東京個別指導学院	9,300	526.00	4,891,800	
東計電算	900	5,510.00	4,959,000	
サイバーエージェント	153,600	1,126.00	172,953,600	
楽天グループ	296,900	582.00	172,795,800	
エックスネット	4,800	995.00	4,776,000	
クリーク・アンド・リバー社	3,800	2,005.00	7,619,000	
モーニングスター	10,700	459.00	4,911,300	
テー・オー・ダブリュー	15,700	294.00	4,615,800	
大塚商会	35,500	4,190.00	148,745,000	
サイボウズ	8,600	2,326.00	20,003,600	
山田コンサルティンググループ	4,200	1,126.00	4,729,200	
セントラルスポーツ	2,400	2,354.00	5,649,600	
電通国際情報サービス	7,600	3,980.00	30,248,000	
ＡＣＣＥＳＳ	7,400	842.00	6,230,800	
デジタルガレージ	11,100	4,085.00	45,343,500	
イーエムシステムズ	10,400	799.00	8,309,600	
ウェザーニューズ	2,200	7,040.00	15,488,000	
ＣＩＪ	6,000	904.00	5,424,000	
日本エンタープライズ	30,300	132.00	3,999,600	
WOWOW	4,000	1,204.00	4,816,000	
スカラ	6,600	728.00	4,804,800	
フルキャストホールディングス	6,100	2,859.00	17,439,900	
エン・ジャパン	11,600	2,254.00	26,146,400	
あすか製薬ホールディングス	6,500	1,240.00	8,060,000	
サワイグループホールディングス	14,300	4,065.00	58,129,500	
富士フイルムホールディングス	120,200	6,822.00	820,004,400	
コニカミノルタ	140,900	529.00	74,536,100	
資生堂	130,800	6,074.00	794,479,200	
ライオン	75,100	1,482.00	111,298,200	
高砂香料工業	4,200	2,591.00	10,882,200	
マンダム	13,500	1,407.00	18,994,500	
ミルボン	9,300	5,560.00	51,708,000	
ファンケル	27,400	2,458.00	67,349,200	
コーセー	12,700	13,980.00	177,546,000	
コタ	5,200	1,674.00	8,704,800	
シーボン	2,900	1,580.00	4,582,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	32,100	1,817.00	58,325,700	
ノエビアホールディングス	5,600	5,780.00	32,368,000	
アジュバンホールディングス	5,000	940.00	4,700,000	
新日本製薬	3,600	1,332.00	4,795,200	
エステー	4,800	1,509.00	7,243,200	

アグロ　カネショウ	3,600	1,674.00	6,026,400	
コニシ	10,500	1,640.00	17,220,000	
長谷川香料	13,000	2,963.00	38,519,000	
星光ＰＭＣ	8,900	528.00	4,699,200	
小林製薬	19,200	8,340.00	160,128,000	
荒川化学工業	5,300	983.00	5,209,900	
メック	5,200	2,252.00	11,710,400	
日本高純度化学	2,100	2,487.00	5,222,700	
タカラバイオ	16,900	1,712.00	28,932,800	
ＪＣＵ	7,100	3,280.00	23,288,000	
新田ゼラチン	500	906.00	453,000	
ＯＡＴアグリオ	2,800	1,570.00	4,396,000	
デクセリアルズ	18,100	2,751.00	49,793,100	
アース製薬	5,700	5,130.00	29,241,000	
北興化学工業	6,300	824.00	5,191,200	
大成ラミック	2,000	2,960.00	5,920,000	
クミアイ化学工業	24,900	914.00	22,758,600	
日本農薬	11,500	710.00	8,165,000	
ニチレキ	7,400	1,249.00	9,242,600	
ユシロ化学工業	6,000	781.00	4,686,000	
富士石油	15,800	256.00	4,044,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	900	1,132.00	1,018,800	
出光興産	69,600	3,035.00	211,236,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,131,500	444.80	503,291,200	
コスモエネルギーホールディングス	23,800	3,570.00	84,966,000	
テスホールディングス	6,600	1,017.00	6,712,200	
インフロニア・ホールディングス	64,200	1,009.00	64,777,800	
横浜ゴム	35,600	2,114.00	75,258,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	36,000	1,546.00	55,656,000	
ブリヂストン	200,000	4,839.00	967,800,000	
住友ゴム工業	61,400	1,176.00	72,206,400	
藤倉コンポジット	2,600	825.00	2,145,000	
オカモト	3,500	3,735.00	13,072,500	
アキレス	4,100	1,258.00	5,157,800	
フコク	4,800	1,065.00	5,112,000	
ニッタ	6,400	2,881.00	18,438,400	
住友理工	12,100	597.00	7,223,700	
三ツ星ベルト	9,100	3,425.00	31,167,500	
バンドー化学	9,900	974.00	9,642,600	
ＡＧＣ	63,700	4,510.00	287,287,000	
日本板硝子	31,900	602.00	19,203,800	
有沢製作所	10,200	1,293.00	13,188,600	
日本電気硝子	25,600	2,465.00	63,104,000	
オハラ	3,900	1,056.00	4,118,400	
住友大阪セメント	8,800	3,110.00	27,368,000	
太平洋セメント	39,900	2,029.00	80,957,100	
日本ヒューム	7,800	649.00	5,062,200	
日本コンクリート工業	20,300	220.00	4,466,000	
三谷セキサン	2,600	3,775.00	9,815,000	
アジアパイルホールディングス	9,800	526.00	5,154,800	

東海カーボン	52,500	1,096.00	57,540,000	
日本カーボン	3,600	4,325.00	15,570,000	
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	3,975.00	12,322,500	
ＴＯＴＯ	41,300	4,585.00	189,360,500	
日本碍子	74,100	1,710.00	126,711,000	
日本特殊陶業	47,700	2,513.00	119,870,100	
ＭＡＲＵＷＡ	2,300	16,150.00	37,145,000	
品川リフラクトリーズ	1,800	3,770.00	6,786,000	
黒崎播磨	1,300	4,835.00	6,285,500	
ヨータイ	4,200	1,385.00	5,817,000	
ニッカトー	5,200	464.00	2,412,800	
フジミインコーポレーテッド	5,000	6,560.00	32,800,000	
クニミネ工業	3,100	822.00	2,548,200	
ニチアス	15,800	2,366.00	37,382,800	
日本製鉄	288,500	2,198.00	634,123,000	
神戸製鋼所	129,600	624.00	80,870,400	
中山製鋼所	13,300	750.00	9,975,000	
合同製鐵	3,200	2,025.00	6,480,000	
ＪＦＥホールディングス	172,200	1,535.00	264,327,000	
東京製鐵	18,100	1,204.00	21,792,400	
共英製鋼	7,300	1,234.00	9,008,200	
大和工業	10,600	4,495.00	47,647,000	
東京鐵鋼	3,400	1,373.00	4,668,200	
大阪製鐵	4,400	1,052.00	4,628,800	
淀川製鋼所	7,300	2,496.00	18,220,800	
丸一鋼管	19,600	2,745.00	53,802,000	
大同特殊鋼	8,100	4,290.00	34,749,000	
日本高周波鋼業	15,200	312.00	4,742,400	
日本冶金工業	4,700	4,150.00	19,505,000	
山陽特殊製鋼	6,400	2,129.00	13,625,600	
愛知製鋼	3,700	2,122.00	7,851,400	
大平洋金属	4,600	1,910.00	8,786,000	
新日本電工	41,200	365.00	15,038,000	
栗本鐵工所	3,100	1,750.00	5,425,000	
日本製鋼所	17,400	2,723.00	47,380,200	
三菱製鋼	5,000	990.00	4,950,000	
日亜鋼業	18,500	243.00	4,495,500	
日本精線	1,200	4,220.00	5,064,000	
エンビプロ・ホールディングス	300	724.00	217,200	
大紀アルミニウム工業所	9,200	1,239.00	11,398,800	
日本軽金属ホールディングス	17,400	1,497.00	26,047,800	
三井金属鉱業	18,700	3,075.00	57,502,500	
東邦亜鉛	3,800	2,066.00	7,850,800	
三菱マテリアル	43,000	2,085.00	89,655,000	
住友金属鉱山	74,700	4,588.00	342,723,600	
ＤＯＷＡホールディングス	14,500	4,210.00	61,045,000	
古河機械金属	9,400	1,301.00	12,229,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,500	4,075.00	38,712,500	
東邦チタニウム	11,700	3,015.00	35,275,500	

ＵＡＣＪ	9,000	2,156.00	19,404,000	
ＣＫサンエツ	1,600	3,980.00	6,368,000	
古河電気工業	21,500	2,600.00	55,900,000	
住友電気工業	222,500	1,537.50	342,093,750	
フジクラ	69,100	1,063.00	73,453,300	
昭和電線ホールディングス	7,200	1,751.00	12,607,200	
東京特殊電線	1,200	5,630.00	6,756,000	
タツタ電線	13,200	419.00	5,530,800	
平河ヒューテック	4,300	1,117.00	4,803,100	
いよぎんホールディングス	73,200	712.00	52,118,400	
しずおかフィナンシャルグループ	139,000	1,011.00	140,529,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	51,800	964.00	49,935,200	
リョービ	6,900	1,202.00	8,293,800	
アーレスティ	7,800	459.00	3,580,200	
アサヒホールディングス	26,100	1,959.00	51,129,900	
東洋製罐グループホールディングス	42,600	1,606.00	68,415,600	
ホッカンホールディングス	3,700	1,332.00	4,928,400	
コロナ	5,700	867.00	4,941,900	
横河ブリッジホールディングス	8,500	1,865.00	15,852,500	
三和ホールディングス	59,300	1,223.00	72,523,900	
文化シヤッター	18,500	1,087.00	20,109,500	
三協立山	8,800	535.00	4,708,000	
アルインコ	5,000	994.00	4,970,000	
ＬＩＸＩＬ	93,900	2,019.00	189,584,100	
日本フイルコン	9,800	450.00	4,410,000	
ノーリツ	9,500	1,474.00	14,003,000	
長府製作所	6,500	1,942.00	12,623,000	
リンナイ	11,700	9,730.00	113,841,000	
ユニプレス	11,200	779.00	8,724,800	
ダイニチ工業	7,200	656.00	4,723,200	
日東精工	9,300	505.00	4,696,500	
三洋工業	2,900	1,755.00	5,089,500	
岡部	10,400	711.00	7,394,400	
ジーテクト	7,200	1,450.00	10,440,000	
東プレ	11,400	1,159.00	13,212,600	
高周波熱錬	10,500	677.00	7,108,500	
東京製綱	5,400	827.00	4,465,800	
サンコール	2,500	628.00	1,570,000	
モリテックスチール	7,200	224.00	1,612,800	
パイオラックス	8,900	1,669.00	14,854,100	
エイチワン	7,900	623.00	4,921,700	
日本発条	57,000	854.00	48,678,000	
三浦工業	26,300	3,070.00	80,741,000	
タクマ	19,400	1,244.00	24,133,600	
テクノプロ・ホールディングス	43,000	3,495.00	150,285,000	
インターワークス	12,900	363.00	4,682,700	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,300	1,776.00	5,860,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,600	3,805.00	17,503,000	
三機サービス	4,800	900.00	4,320,000	

イー・ガーディアン	2,400	2,626.00	6,302,400	
リブセンス	1,800	283.00	509,400	
ジャパンマテリアル	19,600	2,278.00	44,648,800	
ベクトル	10,100	1,292.00	13,049,200	
ウチヤマホールディングス	15,900	269.00	4,277,100	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,176.00	6,232,800	
キャリアリンク	2,400	2,969.00	7,125,600	
ＩＢＪ	5,000	857.00	4,285,000	
アサンテ	3,200	1,582.00	5,062,400	
バリューＨＲ	5,600	1,566.00	8,769,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,900	4,530.00	26,727,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,075.00	5,052,500	
シグマクシス・ホールディングス	9,700	1,367.00	13,259,900	
ウィルグループ	5,300	1,195.00	6,333,500	
メドピア	5,000	1,501.00	7,505,000	
リクルートホールディングス	475,200	4,091.00	1,944,043,200	
エラン	8,500	933.00	7,930,500	
ツガミ	14,000	1,188.00	16,632,000	
オークマ	6,300	4,875.00	30,712,500	
芝浦機械	7,000	2,558.00	17,906,000	
アマダ	100,600	1,050.00	105,630,000	
アイダエンジニアリング	13,000	801.00	10,413,000	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	4,000	1,070.00	4,280,000	
ＦＵＪＩ	27,400	1,978.00	54,197,200	
牧野フライス製作所	7,000	4,485.00	31,395,000	
オーエスジー	30,100	1,873.00	56,377,300	
ダイジェット工業	5,300	822.00	4,356,600	
旭ダイヤモンド工業	18,200	683.00	12,430,600	
DMG森精機	38,200	1,788.00	68,301,600	
ソディック	17,400	726.00	12,632,400	
ディスコ	10,100	39,150.00	395,415,000	
日東工器	3,100	1,505.00	4,665,500	
日進工具	5,300	1,047.00	5,549,100	
パンチ工業	10,500	404.00	4,242,000	
日本郵政	841,300	1,099.00	924,588,700	
ベルシステム２４ホールディングス	8,600	1,354.00	11,644,400	
鎌倉新書	7,300	930.00	6,789,000	
ＳＭＮ	8,300	474.00	3,934,200	
エアトリ	4,100	2,372.00	9,725,200	
アトラエ	5,000	1,265.00	6,325,000	
ストライク	3,200	4,290.00	13,728,000	
ソラスト	17,700	716.00	12,673,200	
インソース	8,000	2,925.00	23,400,000	
豊田自動織機	45,700	7,370.00	336,809,000	
東洋機械金属	7,200	543.00	3,909,600	
エンシュウ	5,600	667.00	3,735,200	
島精機製作所	10,000	1,917.00	19,170,000	
オプトラン	9,300	2,374.00	22,078,200	
ＮＣホールディングス	2,200	2,004.00	4,408,800	

イワキ	4,200	1,224.00	5,140,800	
フリュー	6,600	1,140.00	7,524,000	
ヤマシンフィルタ	15,000	473.00	7,095,000	
日阪製作所	6,100	818.00	4,989,800	
やまびこ	10,300	1,128.00	11,618,400	
野村マイクロ・サイエンス	2,100	4,475.00	9,397,500	
平田機工	3,000	5,510.00	16,530,000	
ペガサスミシン製造	7,000	860.00	6,020,000	
マルマエ	3,000	1,578.00	4,734,000	
タツモ	3,500	1,654.00	5,789,000	
ナブテスコ	39,600	3,315.00	131,274,000	
三井海洋開発	7,900	1,346.00	10,633,400	
レオン自動機	6,600	1,080.00	7,128,000	
ＳＭＣ	20,500	58,320.00	1,195,560,000	
ホソカワミクロン	4,800	2,732.00	13,113,600	
ユニオンツール	2,800	3,300.00	9,240,000	
オイレス工業	8,800	1,463.00	12,874,400	
日精エー・エス・ビー機械	2,900	4,480.00	12,992,000	
サトーホールディングス	9,000	1,912.00	17,208,000	
技研製作所	6,600	3,015.00	19,899,000	
日本エアーテック	4,300	1,193.00	5,129,900	
カワタ	4,900	820.00	4,018,000	
日精樹脂工業	5,000	948.00	4,740,000	
小松製作所	295,500	3,014.00	890,637,000	
住友重機械工業	37,300	2,794.00	104,216,200	
日立建機	25,100	3,025.00	75,927,500	
日工	9,300	607.00	5,645,100	
巴工業	2,700	2,393.00	6,461,100	
井関農機	5,900	1,215.00	7,168,500	
ＴＯＷＡ	6,400	1,791.00	11,462,400	
北川鉄工所	3,800	1,167.00	4,434,600	
シンニッタン	14,800	218.00	3,226,400	
ローツェ	3,300	7,610.00	25,113,000	
タカキタ	9,600	444.00	4,262,400	
クボタ	333,700	1,900.50	634,196,850	
荏原実業	3,100	2,295.00	7,114,500	
三菱化工機	2,300	2,037.00	4,685,100	
月島機械	8,500	962.00	8,177,000	
帝国電機製作所	4,800	2,252.00	10,809,600	
新東工業	12,700	653.00	8,293,100	
澁谷工業	5,900	2,357.00	13,906,300	
アイチコーポレーション	8,900	776.00	6,906,400	
小森コーポレーション	14,600	813.00	11,869,800	
鶴見製作所	4,800	2,008.00	9,638,400	
荏原製作所	25,800	4,895.00	126,291,000	
石井鐵工所	1,700	2,409.00	4,095,300	
酉島製作所	5,400	1,439.00	7,770,600	
北越工業	6,300	1,266.00	7,975,800	
ダイキン工業	75,300	20,705.00	1,559,086,500	
オルガノ	8,700	3,035.00	26,404,500	

トーヨーカネツ	2,400	2,504.00	6,009,600	
栗田工業	35,300	5,650.00	199,445,000	
椿本チエイン	8,900	2,974.00	26,468,600	
大同工業	3,900	732.00	2,854,800	
日機装	15,600	990.00	15,444,000	
木村化工機	6,700	699.00	4,683,300	
レイズネクスト	8,900	1,248.00	11,107,200	
アネスト岩田	10,700	871.00	9,319,700	
ダイフク	32,500	6,450.00	209,625,000	
サムコ	2,100	3,700.00	7,770,000	
加藤製作所	6,000	712.00	4,272,000	
タダノ	33,300	940.00	31,302,000	
フジテック	23,100	3,140.00	72,534,000	
ＣＫＤ	17,400	1,947.00	33,877,800	
キトー	5,400	2,719.00	14,682,600	
平和	21,000	2,446.00	51,366,000	
理想科学工業	5,600	2,032.00	11,379,200	
ＳＡＮＫＹＯ	12,400	5,310.00	65,844,000	
日本金銭機械	6,900	1,060.00	7,314,000	
マースグループホールディングス	3,700	2,260.00	8,362,000	
フクシマガリレイ	4,600	4,090.00	18,814,000	
ダイコク電機	3,500	1,968.00	6,888,000	
竹内製作所	11,400	2,944.00	33,561,600	
アマノ	17,900	2,418.00	43,282,200	
ＪＵＫＩ	9,800	670.00	6,566,000	
ジャノメ	7,600	588.00	4,468,800	
ブラザー工業	84,300	2,030.00	171,129,000	
マックス	7,800	1,932.00	15,069,600	
モリタホールディングス	11,000	1,130.00	12,430,000	
グローリー	16,300	2,126.00	34,653,800	
新晃工業	6,400	1,418.00	9,075,200	
大和冷機工業	9,700	1,119.00	10,854,300	
セガサミーホールディングス	50,700	1,884.00	95,518,800	
リケン	2,500	2,234.00	5,585,000	
ＴＰＲ	7,400	1,207.00	8,931,800	
ツバキ・ナカシマ	15,500	1,012.00	15,686,000	
ホシザキ	40,600	4,500.00	182,700,000	
大豊工業	6,700	646.00	4,328,200	
日本精工	115,900	707.00	81,941,300	
ＮＴＮ	124,300	274.00	34,058,200	
ジェイテクト	56,100	934.00	52,397,400	
不二越	4,700	3,665.00	17,225,500	
ミネベアミツミ	109,700	2,118.00	232,344,600	
日本トムソン	15,400	549.00	8,454,600	
ＴＨＫ	36,400	2,581.00	93,948,400	
ユーシン精機	7,100	668.00	4,742,800	
前澤給装工業	5,300	939.00	4,976,700	
イーグル工業	7,000	1,055.00	7,385,000	
日本ピラー工業	5,800	2,755.00	15,979,000	
キッツ	23,200	801.00	18,583,200	

日立製作所	316,700	6,890.00	2,182,063,000	
東芝	121,400	4,365.00	529,911,000	
三菱電機	651,800	1,331.00	867,545,800	
富士電機	38,300	5,250.00	201,075,000	
東洋電機製造	5,300	846.00	4,483,800	
安川電機	74,700	4,280.00	319,716,000	
シンフォニア　テクノロジー	7,000	1,452.00	10,164,000	
明電舎	9,600	1,920.00	18,432,000	
オリジン	1,600	1,220.00	1,952,000	
山洋電気	2,700	5,730.00	15,471,000	
デンヨー	4,800	1,480.00	7,104,000	
ＰＨＣホールディングス	8,800	1,481.00	13,032,800	
ベイカレント・コンサルティング	50,800	4,520.00	229,616,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,900	1,804.00	3,427,600	
アイモバイル	4,000	1,128.00	4,512,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	22,800	1,594.00	36,343,200	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	10,800	335.00	3,618,000	
ウェルビー	5,700	716.00	4,081,200	
ミダックホールディングス	3,900	2,567.00	10,011,300	
キュービーネットホールディングス	3,600	1,319.00	4,748,400	
ＲＰＡホールディングス	17,300	267.00	4,619,100	
三櫻工業	9,500	619.00	5,880,500	
マキタ	78,500	3,145.00	246,882,500	
東芝テック	9,400	3,485.00	32,759,000	
芝浦メカトロニクス	1,200	10,410.00	12,492,000	
マブチモーター	15,700	3,865.00	60,680,500	
日本電産	153,200	7,359.00	1,127,398,800	
トレックス・セミコンダクター	3,000	2,702.00	8,106,000	
東光高岳	3,800	1,793.00	6,813,400	
ダブル・スコープ	20,600	1,439.00	29,643,400	
ダイヘン	5,700	3,925.00	22,372,500	
ヤーマン	12,300	1,341.00	16,494,300	
ＪＶＣケンウッド	57,400	387.00	22,213,800	
Ｉ－ＰＥＸ	3,600	1,228.00	4,420,800	
日新電機	15,100	1,266.00	19,116,600	
大崎電気工業	15,000	535.00	8,025,000	
オムロン	57,800	6,417.00	370,902,600	
日東工業	8,500	2,312.00	19,652,000	
ＩＤＥＣ	9,300	3,090.00	28,737,000	
不二電機工業	4,100	1,116.00	4,575,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	20,700	2,052.00	42,476,400	
サクサホールディングス	3,800	1,235.00	4,693,000	
メルコホールディングス	1,700	3,010.00	5,117,000	
日本電気	89,200	4,645.00	414,334,000	
富士通	62,800	17,460.00	1,096,488,000	
沖電気工業	28,500	705.00	20,092,500	
岩崎通信機	6,000	782.00	4,692,000	
電気興業	3,000	2,017.00	6,051,000	

サンケン電気	5,900	6,610.00	38,999,000	
アイホン	3,800	1,830.00	6,954,000	
ルネサスエレクトロニクス	411,300	1,218.00	500,963,400	
セイコーエプソン	84,000	1,985.00	166,740,000	
ワコム	50,000	602.00	30,100,000	
アルバック	15,000	5,830.00	87,450,000	
ＥＩＺＯ	4,600	3,340.00	15,364,000	
ジャパンディスプレイ	242,200	41.00	9,930,200	
日本信号	14,400	1,010.00	14,544,000	
京三製作所	13,200	402.00	5,306,400	
能美防災	8,500	1,552.00	13,192,000	
ホーチキ	4,700	1,387.00	6,518,900	
星和電機	10,400	445.00	4,628,000	
エレコム	15,100	1,353.00	20,430,300	
パナソニック　ホールディングス	745,000	1,189.50	886,177,500	
シャープ	75,900	956.00	72,560,400	
アンリツ	44,400	1,351.00	59,984,400	
富士通ゼネラル	17,900	3,080.00	55,132,000	
ソニーグループ	441,700	10,350.00	4,571,595,000	
ＴＤＫ	99,900	4,535.00	453,046,500	
帝国通信工業	3,200	1,363.00	4,361,600	
タムラ製作所	27,100	751.00	20,352,100	
アルプスアルパイン	56,300	1,239.00	69,755,700	
池上通信機	8,000	531.00	4,248,000	
日本電波工業	7,600	1,719.00	13,064,400	
メイコー	6,900	2,654.00	18,312,600	
ローランド　ディー．ジー．	3,500	2,917.00	10,209,500	
フォスター電機	6,000	827.00	4,962,000	
ＳＭＫ	1,800	2,336.00	4,204,800	
ヨコオ	5,000	2,218.00	11,090,000	
ホシデン	15,100	1,553.00	23,450,300	
ヒロセ電機	10,400	17,290.00	179,816,000	
日本航空電子工業	12,900	2,128.00	27,451,200	
ＴＯＡ	7,300	773.00	5,642,900	
マクセル	13,700	1,361.00	18,645,700	
古野電気	8,200	995.00	8,159,000	
スミダコーポレーション	5,800	1,416.00	8,212,800	
アイコム	2,400	2,593.00	6,223,200	
リオン	2,600	1,889.00	4,911,400	
横河電機	69,000	2,307.00	159,183,000	
新電元工業	2,400	3,015.00	7,236,000	
アズビル	43,600	3,480.00	151,728,000	
東亜ディーケーケー	5,400	820.00	4,428,000	
日本光電工業	28,800	3,100.00	89,280,000	
共和電業	11,800	355.00	4,189,000	
日本電子材料	4,100	1,404.00	5,756,400	
堀場製作所	13,900	6,000.00	83,400,000	
アドバンテスト	49,200	9,110.00	448,212,000	
小野測器	11,300	387.00	4,373,100	
エスペック	5,000	1,879.00	9,395,000	

キーエンス	62,500	53,370.00	3,335,625,000	
日置電機	3,300	6,290.00	20,757,000	
シスメックス	53,900	8,289.00	446,777,100	
日本マイクロニクス	10,300	1,367.00	14,080,100	
メガチップス	5,100	2,488.00	12,688,800	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,900	3,435.00	9,961,500	
澤藤電機	3,300	1,133.00	3,738,900	
デンソー	128,800	6,905.00	889,364,000	
原田工業	5,500	832.00	4,576,000	
コーセル	8,300	973.00	8,075,900	
イリソ電子工業	5,700	4,205.00	23,968,500	
オプテックスグループ	11,500	1,928.00	22,172,000	
千代田インテグレ	2,500	2,320.00	5,800,000	
レーザーテック	30,800	23,230.00	715,484,000	
スタンレー電気	44,400	2,548.00	113,131,200	
岩崎電気	2,000	2,324.00	4,648,000	
ウシオ電機	32,600	1,692.00	55,159,200	
岡谷電機産業	100	251.00	25,100	
日本セラミック	6,400	2,511.00	16,070,400	
遠藤照明	6,300	714.00	4,498,200	
古河電池	4,600	1,116.00	5,133,600	
山一電機	5,400	1,675.00	9,045,000	
図研	5,400	3,030.00	16,362,000	
日本電子	15,600	3,780.00	58,968,000	
カシオ計算機	46,500	1,293.00	60,124,500	
ファナック	61,300	20,090.00	1,231,517,000	
日本シイエムケイ	13,300	500.00	6,650,000	
エンプラス	1,800	4,035.00	7,263,000	
大真空	7,600	710.00	5,396,000	
ローム	28,900	10,090.00	291,601,000	
浜松ホトニクス	50,100	6,730.00	337,173,000	
三井ハイテック	6,500	6,660.00	43,290,000	
新光電気工業	22,100	3,470.00	76,687,000	
京セラ	97,000	6,723.00	652,131,000	
太陽誘電	30,400	4,000.00	121,600,000	
村田製作所	189,400	6,946.00	1,315,572,400	
双葉電子工業	11,900	539.00	6,414,100	
日東電工	45,500	7,890.00	358,995,000	
北陸電気工業	4,300	1,239.00	5,327,700	
東海理化電機製作所	17,600	1,418.00	24,956,800	
ニチコン	12,800	1,273.00	16,294,400	
日本ケミコン	6,200	1,640.00	10,168,000	
ＫＯＡ	9,500	1,962.00	18,639,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	28,500	386.00	11,001,000	
日立造船	51,700	830.00	42,911,000	
三菱重工業	110,300	5,394.00	594,958,200	
川崎重工業	47,100	3,105.00	146,245,500	
ＩＨＩ	39,700	3,855.00	153,043,500	
名村造船所	16,000	421.00	6,736,000	
マネジメントソリューションズ	3,500	3,725.00	13,037,500	

プロレド・パートナーズ	9,400	465.00	4,371,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	11,700	353.00	4,130,100	
カーブスホールディングス	19,700	889.00	17,513,300	
フォーラムエンジニアリング	5,700	840.00	4,788,000	
日本車輌製造	2,500	1,926.00	4,815,000	
三菱ロジスネクスト	10,000	799.00	7,990,000	
フルサト・マルカホールディングス	6,600	3,390.00	22,374,000	
ヤマエグループホールディングス	3,700	1,388.00	5,135,600	
ＦＰＧ	25,000	1,119.00	27,975,000	
島根銀行	9,900	464.00	4,593,600	
じもとホールディングス	8,400	409.00	3,435,600	
全国保証	16,100	4,990.00	80,339,000	
めぶきフィナンシャルグループ	305,200	323.00	98,579,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,000	1,189.00	5,945,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	2,444.00	19,307,600	
九州フィナンシャルグループ	108,200	428.00	46,309,600	
かんぽ生命保険	74,700	2,311.00	172,631,700	
ゆうちょ銀行	175,100	1,118.00	195,761,800	
富山第一銀行	15,300	591.00	9,042,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	339,000	526.00	178,314,000	
ジェイリース	2,100	2,826.00	5,934,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	38,900	893.00	34,737,700	
イントラスト	4,200	782.00	3,284,400	
アルヒ	12,600	1,001.00	12,612,600	
プレミアグループ	10,300	1,700.00	17,510,000	
日産自動車	887,100	428.00	379,678,800	
いすゞ自動車	181,500	1,652.00	299,838,000	
トヨタ自動車	3,428,900	1,845.00	6,326,320,500	
日野自動車	80,500	540.00	43,470,000	
三菱自動車工業	243,600	530.00	129,108,000	
エフテック	9,000	507.00	4,563,000	
武蔵精密工業	15,300	1,620.00	24,786,000	
日産車体	11,000	819.00	9,009,000	
新明和工業	19,600	1,052.00	20,619,200	
極東開発工業	11,000	1,370.00	15,070,000	
トピー工業	5,100	1,600.00	8,160,000	
ティラド	1,700	2,566.00	4,362,200	
曙ブレーキ工業	38,200	155.00	5,921,000	
タチエス	9,900	1,071.00	10,602,900	
ＮＯＫ	24,300	1,186.00	28,819,800	
フタバ産業	16,700	343.00	5,728,100	
ＫＹＢ	6,000	3,320.00	19,920,000	
大同メタル工業	12,200	480.00	5,856,000	
プレス工業	27,900	418.00	11,662,200	
ミクニ	13,600	323.00	4,392,800	
太平洋工業	14,300	1,039.00	14,857,700	
アイシン	48,200	3,575.00	172,315,000	

マツダ	206,600	999.00	206,393,400	
今仙電機製作所	2,500	651.00	1,627,500	
本田技研工業	507,600	3,120.00	1,583,712,000	
スズキ	114,700	4,470.00	512,709,000	
ＳＵＢＡＲＵ	197,600	2,127.00	420,295,200	
ヤマハ発動機	98,100	3,130.00	307,053,000	
小糸製作所	75,100	2,005.00	150,575,500	
エクセディ	10,200	1,595.00	16,269,000	
ミツバ	11,700	476.00	5,569,200	
豊田合成	18,200	2,058.00	37,455,600	
愛三工業	10,300	692.00	7,127,600	
盟和産業	4,800	912.00	4,377,600	
ヨロズ	5,900	703.00	4,147,700	
エフ・シー・シー	11,100	1,347.00	14,951,700	
シマノ	25,500	21,270.00	542,385,000	
テイ・エス　テック	28,600	1,563.00	44,701,800	
三十三フィナンシャルグループ	5,500	1,500.00	8,250,000	
第四北越フィナンシャルグループ	9,700	2,658.00	25,782,600	
ひろぎんホールディングス	80,200	642.00	51,488,400	
マーキュリアホールディングス	5,000	575.00	2,875,000	
おきなわフィナンシャルグループ	5,900	2,163.00	12,761,700	
ダイレクトマーケティングミックス	7,300	1,455.00	10,621,500	
ポピンズ	3,200	1,535.00	4,912,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,000	2,266.00	11,330,000	
十六フィナンシャルグループ	8,000	2,732.00	21,856,000	
北國フィナンシャルホールディングス	5,200	4,630.00	24,076,000	
ネットプロテクションズホールディングス	20,300	489.00	9,926,700	
プロクレアホールディングス	7,500	2,145.00	16,087,500	
あいちフィナンシャルグループ	8,600	2,208.00	18,988,800	
ジャムコ	3,400	1,556.00	5,290,400	
小野建	6,100	1,438.00	8,771,800	
はるやまホールディングス	11,000	432.00	4,752,000	
南陽	2,700	1,883.00	5,084,100	
ノジマ	21,600	1,347.00	29,095,200	
佐鳥電機	4,100	1,313.00	5,383,300	
カッパ・クリエイト	10,400	1,376.00	14,310,400	
伯東	3,800	4,085.00	15,523,000	
コンドーテック	5,100	972.00	4,957,200	
中山福	14,500	321.00	4,654,500	
ライトオン	6,600	597.00	3,940,200	
ナガイレーベン	8,300	2,020.00	16,766,000	
三菱食品	6,100	3,125.00	19,062,500	
良品計画	85,200	1,460.00	124,392,000	
松田産業	5,000	2,270.00	11,350,000	
第一興商	12,800	3,890.00	49,792,000	
メディパルホールディングス	68,500	1,752.00	120,012,000	
アドヴァングループ	6,300	843.00	5,310,900	
ＳＰＫ	3,400	1,383.00	4,702,200	
萩原電気ホールディングス	2,500	2,427.00	6,067,500	

アルビス	2,200	2,345.00	5,159,000	
アズワン	9,700	5,530.00	53,641,000	
スズデン	2,300	2,215.00	5,094,500	
シモジマ	4,700	915.00	4,300,500	
ドウシシャ	7,000	1,555.00	10,885,000	
小津産業	2,600	1,466.00	3,811,600	
コナカ	14,200	332.00	4,714,400	
高速	3,400	1,686.00	5,732,400	
ハウス　オブ　ローゼ	2,900	1,637.00	4,747,300	
Ｇ－７ホールディングス	8,200	1,505.00	12,341,000	
イオン北海道	9,800	1,124.00	11,015,200	
コジマ	12,700	602.00	7,645,400	
ヒマラヤ	4,900	926.00	4,537,400	
コーナン商事	8,900	3,295.00	29,325,500	
ネットワンシステムズ	23,300	3,335.00	77,705,500	
エコス	2,700	1,801.00	4,862,700	
ワタミ	8,000	996.00	7,968,000	
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	2,266.00	335,821,200	
丸文	5,900	935.00	5,516,500	
西松屋チェーン	14,600	1,434.00	20,936,400	
ゼンショーホールディングス	36,200	3,345.00	121,089,000	
ハピネット	5,600	1,884.00	10,550,400	
橋本総業ホールディングス	4,900	996.00	4,880,400	
日本ライフライン	19,400	911.00	17,673,400	
サイゼリヤ	11,000	2,940.00	32,340,000	
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	3,825.00	21,802,500	
魚力	2,300	2,097.00	4,823,100	
ＩＤＯＭ	20,000	683.00	13,660,000	
日本エム・ディ・エム	4,800	983.00	4,718,400	
フジ・コーポレーション	3,900	1,288.00	5,023,200	
ユナイテッドアローズ	7,100	1,753.00	12,446,300	
進和	4,400	1,951.00	8,584,400	
ダイトロン	2,600	2,358.00	6,130,800	
ハイデイ日高	9,800	1,933.00	18,943,400	
シークス	9,400	1,309.00	12,304,600	
コロワイド	30,400	1,742.00	52,956,800	
ピーシーデポコーポレーション	18,300	270.00	4,941,000	
田中商事	8,300	564.00	4,681,200	
オーハシテクニカ	3,400	1,385.00	4,709,000	
壱番屋	5,200	4,580.00	23,816,000	
白銅	2,400	2,417.00	5,800,800	
スギホールディングス	13,300	6,120.00	81,396,000	
薬王堂ホールディングス	3,700	2,644.00	9,782,800	
島津製作所	76,100	3,830.00	291,463,000	
ＪＭＳ	9,600	509.00	4,886,400	
長野計器	4,500	1,091.00	4,909,500	
ブイ・テクノロジー	3,100	2,575.00	7,982,500	
スター精密	11,900	1,673.00	19,908,700	

東京計器	4,800	1,322.00	6,345,600	
愛知時計電機	3,600	1,324.00	4,766,400	
インターアクション	3,800	1,504.00	5,715,200	
オーバル	6,800	462.00	3,141,600	
東京精密	13,700	4,430.00	60,691,000	
マニー	27,500	2,090.00	57,475,000	
ニコン	97,100	1,209.00	117,393,900	
トプコン	32,900	1,496.00	49,218,400	
オリンパス	390,400	2,443.50	953,942,400	
理研計器	3,900	4,380.00	17,082,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	10,700	8,810.00	94,267,000	
キヤノン電子	6,900	1,531.00	10,563,900	
タムロン	4,700	3,320.00	15,604,000	
ＨＯＹＡ	134,900	13,125.00	1,770,562,500	
シード	2,600	484.00	1,258,400	
ノーリツ鋼機	5,900	2,727.00	16,089,300	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	9,100	1,016.00	9,245,600	
朝日インテック	82,500	2,267.00	187,027,500	
キヤノン	342,600	2,989.00	1,024,031,400	
リコー	163,700	1,009.00	165,173,300	
シチズン時計	68,700	581.00	39,914,700	
リズム	1,200	1,670.00	2,004,000	
メニコン	21,400	2,836.00	60,690,400	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	25,700	120.00	3,084,000	
スノーピーク	10,700	2,158.00	23,090,600	
パラマウントベッドホールディングス	14,400	2,546.00	36,662,400	
トランザクション	4,800	1,155.00	5,544,000	
粧美堂	2,200	354.00	778,800	
ニホンフラッシュ	5,900	872.00	5,144,800	
前田工繊	6,800	3,005.00	20,434,000	
永大産業	18,700	220.00	4,114,000	
アートネイチャー	6,400	742.00	4,748,800	
バンダイナムコホールディングス	57,000	8,363.00	476,691,000	
アイフィスジャパン	7,000	609.00	4,263,000	
ＳＨＯＥＩ	6,600	5,260.00	34,716,000	
フランスベッドホールディングス	7,700	928.00	7,145,600	
マーベラス	10,200	657.00	6,701,400	
パイロットコーポレーション	9,800	4,685.00	45,913,000	
エイベックス	10,600	1,577.00	16,716,200	
フジシールインターナショナル	12,600	1,697.00	21,382,200	
タカラトミー	28,800	1,242.00	35,769,600	
広済堂ホールディングス	4,200	2,019.00	8,479,800	
レック	8,900	854.00	7,600,600	
プロネクサス	5,200	936.00	4,867,200	
大建工業	3,800	2,131.00	8,097,800	
きもと	5,500	224.00	1,232,000	
凸版印刷	81,700	2,029.00	165,769,300	
大日本印刷	74,100	2,687.00	199,106,700	
共同印刷	1,900	2,732.00	5,190,800	
ＮＩＳＳＨＡ	11,900	1,842.00	21,919,800	

藤森工業	4,900	3,120.00	15,288,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,300	2,101.00	9,034,300	
前澤化成工業	4,000	1,362.00	5,448,000	
未来工業	3,300	1,433.00	4,728,900	
アシックス	57,600	2,849.00	164,102,400	
ツツミ	2,500	1,911.00	4,777,500	
ＪＳＰ	4,400	1,479.00	6,507,600	
ニチハ	7,800	2,637.00	20,568,600	
ローランド	4,600	3,755.00	17,273,000	
エフピコ	11,800	3,520.00	41,536,000	
小松ウオール工業	2,700	1,804.00	4,870,800	
ヤマハ	39,400	5,040.00	198,576,000	
河合楽器製作所	1,800	2,533.00	4,559,400	
ピジョン	39,800	2,159.00	85,928,200	
天馬	5,300	2,049.00	10,859,700	
兼松サステック	3,000	1,570.00	4,710,000	
キングジム	5,500	880.00	4,840,000	
象印マホービン	18,600	1,622.00	30,169,200	
リンテック	12,500	2,174.00	27,175,000	
信越ポリマー	11,600	1,164.00	13,502,400	
東リ	23,200	221.00	5,127,200	
イトーキ	12,800	567.00	7,257,600	
任天堂	394,200	5,541.00	2,184,262,200	
三菱鉛筆	8,900	1,382.00	12,299,800	
松風	2,800	2,312.00	6,473,600	
タカラスタンダード	12,100	1,358.00	16,431,800	
コクヨ	30,100	1,861.00	56,016,100	
ナカバヤシ	9,300	483.00	4,491,900	
ニフコ	22,600	3,290.00	74,354,000	
グローブライド	5,000	2,562.00	12,810,000	
オカムラ	18,800	1,351.00	25,398,800	
バルカー	5,200	2,638.00	13,717,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,400	1,713.00	4,111,200	
伊藤忠商事	407,100	4,187.00	1,704,527,700	
丸紅	521,600	1,532.00	799,091,200	
スクロール	9,800	708.00	6,938,400	
ヨンドシーホールディングス	5,700	1,706.00	9,724,200	
長瀬産業	31,100	2,004.00	62,324,400	
蝶理	3,500	2,077.00	7,269,500	
豊田通商	57,900	5,110.00	295,869,000	
オンワードホールディングス	40,600	306.00	12,423,600	
三共生興	10,200	463.00	4,722,600	
兼松	25,700	1,501.00	38,575,700	
美津濃	6,200	2,765.00	17,143,000	
三井物産	483,400	3,926.00	1,897,828,400	
日本紙パルプ商事	3,500	4,900.00	17,150,000	
東京エレクトロン	44,100	41,590.00	1,834,119,000	
カメイ	7,000	1,183.00	8,281,000	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,390.00	4,063,000	
スターゼン	5,000	2,058.00	10,290,000	

セイコーグループ	9,700	2,946.00	28,576,200	
山善	17,800	998.00	17,764,400	
椿本興業	1,300	3,805.00	4,946,500	
住友商事	409,200	2,230.50	912,720,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	23,000	3,300.00	75,900,000	
内田洋行	2,900	4,320.00	12,528,000	
三菱商事	413,100	4,330.00	1,788,723,000	
第一実業	2,300	4,320.00	9,936,000	
キヤノンマーケティングジャパン	15,300	3,015.00	46,129,500	
西華産業	2,900	1,563.00	4,532,700	
佐藤商事	4,600	1,189.00	5,469,400	
菱洋エレクトロ	5,600	2,327.00	13,031,200	
東京産業	6,200	751.00	4,656,200	
ユアサ商事	5,900	3,520.00	20,768,000	
神鋼商事	1,700	4,540.00	7,718,000	
阪和興業	11,900	3,685.00	43,851,500	
正栄食品工業	4,400	3,780.00	16,632,000	
カナデン	5,300	1,098.00	5,819,400	
菱電商事	5,300	1,655.00	8,771,500	
ニプロ	52,100	1,018.00	53,037,800	
岩谷産業	15,000	5,730.00	85,950,000	
ナイス	2,900	1,360.00	3,944,000	
極東貿易	3,900	1,340.00	5,226,000	
アステナホールディングス	11,700	430.00	5,031,000	
兼松エレクトロニクス	4,000	4,215.00	16,860,000	
三愛オブリ	18,200	1,246.00	22,677,200	
稲畑産業	13,500	2,341.00	31,603,500	
ＧＳＩクレオス	3,800	1,414.00	5,373,200	
明和産業	8,800	670.00	5,896,000	
クワザワホールディングス	10,600	405.00	4,293,000	
ゴールドウイン	11,100	9,330.00	103,563,000	
ユニ・チャーム	130,500	5,207.00	679,513,500	
デサント	10,800	2,986.00	32,248,800	
ワキタ	12,100	1,181.00	14,290,100	
ヤマトインターナショナル	17,500	242.00	4,235,000	
東邦ホールディングス	16,400	2,132.00	34,964,800	
サンゲツ	16,600	2,097.00	34,810,200	
ミツウロコグループホールディングス	8,500	1,121.00	9,528,500	
シナネンホールディングス	2,100	3,685.00	7,738,500	
伊藤忠エネクス	16,400	1,013.00	16,613,200	
サンリオ	18,700	4,420.00	82,654,000	
サンワ　テクノス	3,400	1,525.00	5,185,000	
リョーサン	7,000	2,875.00	20,125,000	
新光商事	8,900	1,205.00	10,724,500	
トーホー	2,900	1,686.00	4,889,400	
三信電気	2,700	2,271.00	6,131,700	
東陽テクニカ	7,300	1,335.00	9,745,500	
モスフードサービス	9,700	3,070.00	29,779,000	
加賀電子	5,400	4,080.00	22,032,000	
三益半導体工業	5,800	2,439.00	14,146,200	

都築電気	3,600	1,260.00	4,536,000	
立花エレテック	4,800	1,762.00	8,457,600	
木曽路	10,000	2,086.00	20,860,000	
ＳＲＳホールディングス	10,900	861.00	9,384,900	
千趣会	12,200	397.00	4,843,400	
リテールパートナーズ	9,800	1,264.00	12,387,200	
ケーヨー	10,600	890.00	9,434,000	
上新電機	5,900	1,912.00	11,280,800	
日本瓦斯	35,400	2,146.00	75,968,400	
ロイヤルホールディングス	12,700	2,386.00	30,302,200	
東天紅	5,400	789.00	4,260,600	
いなげや	6,400	1,173.00	7,507,200	
チヨダ	6,600	753.00	4,969,800	
ライフコーポレーション	5,800	2,555.00	14,819,000	
リンガーハット	8,500	2,202.00	18,717,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	9,300	654.00	6,082,200	
ＡＯＫＩホールディングス	12,300	654.00	8,044,200	
オークワ	10,600	912.00	9,667,200	
コメリ	10,200	2,643.00	26,958,600	
青山商事	14,100	873.00	12,309,300	
しまむら	7,800	12,620.00	98,436,000	
高島屋	49,800	1,682.00	83,763,600	
松屋	11,200	998.00	11,177,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	32,200	1,165.00	37,513,000	
近鉄百貨店	2,100	2,457.00	5,159,700	
丸井グループ	48,700	2,178.00	106,068,600	
クレディセゾン	39,000	1,699.00	66,261,000	
アクシアル　リテイリング	4,500	3,305.00	14,872,500	
イオン	224,000	2,786.00	624,064,000	
イズミ	10,000	2,907.00	29,070,000	
平和堂	11,000	2,074.00	22,814,000	
フジ	10,100	1,801.00	18,190,100	
ヤオコー	7,500	6,790.00	50,925,000	
ゼビオホールディングス	9,000	914.00	8,226,000	
ケーズホールディングス	52,500	1,112.00	58,380,000	
ＰＡＬＴＡＣ	10,400	4,330.00	45,032,000	
三谷産業	16,100	309.00	4,974,900	
日産東京販売ホールディングス	4,800	287.00	1,377,600	
新生銀行	18,100	2,258.00	40,869,800	
あおぞら銀行	38,700	2,627.00	101,664,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,032,100	818.40	3,299,870,640	
りそなホールディングス	784,900	692.50	543,543,250	
三井住友トラスト・ホールディングス	113,900	4,439.00	505,602,100	
三井住友フィナンシャルグループ	449,400	4,974.00	2,235,315,600	
千葉銀行	171,400	914.00	156,659,600	
群馬銀行	119,300	476.00	56,786,800	
武蔵野銀行	7,900	1,963.00	15,507,700	
千葉興業銀行	11,400	431.00	4,913,400	
筑波銀行	27,000	218.00	5,886,000	
七十七銀行	19,700	2,030.00	39,991,000	

秋田銀行	4,100	1,839.00	7,539,900	
山形銀行	6,800	1,180.00	8,024,000	
岩手銀行	4,200	1,955.00	8,211,000	
東邦銀行	48,600	215.00	10,449,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	49,100	2,849.00	139,885,900	
スルガ銀行	54,200	428.00	23,197,600	
八十二銀行	126,200	526.00	66,381,200	
山梨中央銀行	6,300	1,084.00	6,829,200	
大垣共立銀行	11,700	1,800.00	21,060,000	
福井銀行	5,500	1,455.00	8,002,500	
清水銀行	3,400	1,523.00	5,178,200	
富山銀行	1,100	1,726.00	1,898,600	
滋賀銀行	10,200	2,653.00	27,060,600	
南都銀行	9,300	2,396.00	22,282,800	
百五銀行	57,900	354.00	20,496,600	
京都銀行	19,500	5,620.00	109,590,000	
紀陽銀行	22,000	1,454.00	31,988,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	39,100	914.00	35,737,400	
山陰合同銀行	38,500	747.00	28,759,500	
百十四銀行	5,600	1,790.00	10,024,000	
四国銀行	9,800	933.00	9,143,400	
阿波銀行	9,100	2,040.00	18,564,000	
大分銀行	3,700	1,942.00	7,185,400	
宮崎銀行	4,000	2,342.00	9,368,000	
佐賀銀行	3,600	1,614.00	5,810,400	
琉球銀行	14,100	840.00	11,844,000	
セブン銀行	220,300	264.00	58,159,200	
みずほフィナンシャルグループ	889,400	1,767.00	1,571,569,800	
山口フィナンシャルグループ	67,900	831.00	56,424,900	
芙蓉総合リース	5,700	8,460.00	48,222,000	
みずほリース	9,200	3,275.00	30,130,000	
東京センチュリー	11,500	4,495.00	51,692,500	
ＳＢＩホールディングス	89,000	2,605.00	231,845,000	
日本証券金融	24,700	1,076.00	26,577,200	
アイフル	101,900	399.00	40,658,100	
長野銀行	3,700	1,286.00	4,758,200	
名古屋銀行	4,100	3,220.00	13,202,000	
北洋銀行	93,200	242.00	22,554,400	
大光銀行	3,600	1,175.00	4,230,000	
愛媛銀行	8,300	876.00	7,270,800	
京葉銀行	28,600	561.00	16,044,600	
栃木銀行	28,200	302.00	8,516,400	
北日本銀行	2,600	1,968.00	5,116,800	
東和銀行	11,300	544.00	6,147,200	
リコーリース	5,800	3,640.00	21,112,000	
イオンフィナンシャルサービス	35,300	1,414.00	49,914,200	
アコム	109,800	314.00	34,477,200	
ジャックス	6,600	4,135.00	27,291,000	
オリエントコーポレーション	16,100	1,145.00	18,434,500	
オリックス	411,400	2,139.50	880,190,300	

三菱ＨＣキャピタル	239,800	647.00	155,150,600	
ジャフコ　グループ	20,500	2,310.00	47,355,000	
九州リースサービス	3,400	667.00	2,267,800	
トモニホールディングス	49,700	352.00	17,494,400	
大和証券グループ本社	439,800	585.00	257,283,000	
野村ホールディングス	1,132,600	476.20	539,344,120	
岡三証券グループ	54,000	384.00	20,736,000	
丸三証券	20,500	400.00	8,200,000	
東洋証券	20,400	277.00	5,650,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	66,900	351.00	23,481,900	
光世証券	5,100	365.00	1,861,500	
水戸証券	22,100	211.00	4,663,100	
いちよし証券	11,300	614.00	6,938,200	
松井証券	36,300	772.00	28,023,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	105,600	5,761.00	608,361,600	
日本取引所グループ	172,800	1,825.00	315,360,000	
マネックスグループ	68,700	402.00	27,617,400	
極東証券	7,900	583.00	4,605,700	
岩井コスモホールディングス	7,000	1,265.00	8,855,000	
アイザワ証券グループ	8,900	706.00	6,283,400	
フィデアホールディングス	6,400	1,365.00	8,736,000	
池田泉州ホールディングス	78,700	237.00	18,651,900	
アニコム　ホールディングス	20,900	590.00	12,331,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	138,700	4,108.00	569,779,600	
スパークス・グループ	6,900	1,678.00	11,578,200	
第一生命ホールディングス	313,100	2,885.50	903,450,050	
東京海上ホールディングス	619,300	2,891.50	1,790,705,950	
イー・ギャランティ	9,900	2,212.00	21,898,800	
アサックス	8,000	616.00	4,928,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,000	2,055.00	6,165,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	165,100	1,789.00	295,363,900	
アドバンスクリエイト	2,900	1,034.00	2,998,600	
三井不動産	267,300	2,441.50	652,612,950	
三菱地所	389,900	1,712.50	667,703,750	
平和不動産	10,000	3,855.00	38,550,000	
東京建物	58,600	1,742.00	102,081,200	
京阪神ビルディング	7,900	1,235.00	9,756,500	
住友不動産	111,200	3,187.00	354,394,400	
テーオーシー	11,100	665.00	7,381,500	
東京楽天地	1,100	4,085.00	4,493,500	
レオパレス２１	69,200	282.00	19,514,400	
スターツコーポレーション	8,800	2,613.00	22,994,400	
フジ住宅	8,600	643.00	5,529,800	
空港施設	9,100	510.00	4,641,000	
ゴールドクレスト	5,800	1,689.00	9,796,200	
リログループ	35,700	2,070.00	73,899,000	
エスリード	2,900	1,812.00	5,254,800	
日神グループホールディングス	11,300	436.00	4,926,800	

日本エスコン	13,800	818.00	11,288,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	31,100	368.00	11,444,800	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,800	783.00	4,541,400	
イオンモール	31,900	1,685.00	53,751,500	
ファースト住建	4,300	1,000.00	4,300,000	
カチタス	16,500	2,937.00	48,460,500	
東祥	4,500	1,104.00	4,968,000	
トーセイ	10,200	1,352.00	13,790,400	
穴吹興産	2,300	1,930.00	4,439,000	
サンフロンティア不動産	10,200	1,095.00	11,169,000	
ＦＪネクストホールディングス	6,500	948.00	6,162,000	
グランディハウス	8,700	540.00	4,698,000	
東武鉄道	68,600	3,130.00	214,718,000	
相鉄ホールディングス	20,600	2,155.00	44,393,000	
東急	175,100	1,659.00	290,490,900	
京浜急行電鉄	70,800	1,338.00	94,730,400	
小田急電鉄	94,700	1,701.00	161,084,700	
京王電鉄	33,000	4,865.00	160,545,000	
京成電鉄	40,300	3,760.00	151,528,000	
富士急行	7,700	4,785.00	36,844,500	
東日本旅客鉄道	105,900	7,537.00	798,168,300	
西日本旅客鉄道	79,800	5,647.00	450,630,600	
東海旅客鉄道	48,100	16,010.00	770,081,000	
西武ホールディングス	75,500	1,398.00	105,549,000	
鴻池運輸	10,600	1,549.00	16,419,400	
西日本鉄道	16,700	2,534.00	42,317,800	
ハマキョウレックス	4,900	3,230.00	15,827,000	
サカイ引越センター	3,000	4,440.00	13,320,000	
近鉄グループホールディングス	62,300	4,420.00	275,366,000	
阪急阪神ホールディングス	83,100	3,970.00	329,907,000	
南海電気鉄道	29,800	2,825.00	84,185,000	
京阪ホールディングス	25,800	3,410.00	87,978,000	
神戸電鉄	1,700	3,165.00	5,380,500	
名古屋鉄道	68,900	2,182.00	150,339,800	
山陽電気鉄道	4,700	2,104.00	9,888,800	
アルプス物流	5,000	1,117.00	5,585,000	
トランコム	1,800	7,570.00	13,626,000	
ヤマトホールディングス	79,800	2,205.00	175,959,000	
山九	15,900	4,885.00	77,671,500	
日新	4,700	2,044.00	9,606,800	
丸全昭和運輸	3,900	3,035.00	11,836,500	
センコーグループホールディングス	33,000	966.00	31,878,000	
トナミホールディングス	1,400	3,610.00	5,054,000	
ニッコンホールディングス	20,000	2,352.00	47,040,000	
日本石油輸送	1,300	2,190.00	2,847,000	
福山通運	5,200	3,195.00	16,614,000	
セイノーホールディングス	38,800	1,190.00	46,172,000	
神奈川中央交通	1,800	3,250.00	5,850,000	
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	1,517.00	22,755,000	

C&Fロジホールディングス	6,000	1,170.00	7,020,000	
日本郵船	166,800	3,143.00	524,252,400	
商船三井	109,900	3,325.00	365,417,500	
川崎汽船	53,100	2,725.00	144,697,500	
ＮＳユナイテッド海運	3,400	3,780.00	12,852,000	
明治海運	6,200	708.00	4,389,600	
飯野海運	22,900	923.00	21,136,700	
共栄タンカー	600	923.00	553,800	
九州旅客鉄道	44,100	2,894.00	127,625,400	
ＳＧホールディングス	119,600	1,974.00	236,090,400	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	23,300	7,820.00	182,206,000	
日本航空	153,100	2,652.00	406,021,200	
ＡＮＡホールディングス	169,600	2,819.50	478,187,200	
パスコ	1,200	1,328.00	1,593,600	
ＴＲＥホールディングス	13,500	1,474.00	19,899,000	
人・夢・技術グループ	2,900	1,801.00	5,222,900	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,700	3,500.00	5,950,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,300	3,425.00	11,302,500	
ＫＰＰグループホールディングス	15,400	785.00	12,089,000	
ナルミヤ・インターナショナル	5,600	864.00	4,838,400	
ブックオフグループホールディングス	3,900	1,315.00	5,128,500	
ギフトホールディングス	1,400	3,885.00	5,439,000	
三菱倉庫	13,400	3,120.00	41,808,000	
三井倉庫ホールディングス	5,800	3,600.00	20,880,000	
住友倉庫	17,100	1,966.00	33,618,600	
澁澤倉庫	2,500	2,048.00	5,120,000	
ヤマタネ	2,900	1,645.00	4,770,500	
東陽倉庫	16,500	248.00	4,092,000	
乾汽船	8,000	1,938.00	15,504,000	
日本トランスシティ	12,500	506.00	6,325,000	
中央倉庫	5,200	932.00	4,846,400	
安田倉庫	5,200	914.00	4,752,800	
東洋埠頭	3,800	1,279.00	4,860,200	
上組	31,000	2,728.00	84,568,000	
キユーソー流通システム	4,200	957.00	4,019,400	
東海運	13,300	277.00	3,684,100	
エーアイテイー	3,900	1,408.00	5,491,200	
日本コンセプト	2,700	1,581.00	4,268,700	
ＴＢＳホールディングス	32,100	1,505.00	48,310,500	
日本テレビホールディングス	55,400	1,027.00	56,895,800	
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	1,312.00	19,942,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	55,600	471.00	26,187,600	
テレビ東京ホールディングス	4,500	1,769.00	7,960,500	
日本ＢＳ放送	4,800	896.00	4,300,800	
ビジョン	8,200	1,280.00	10,496,000	
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,600	2,024.00	11,334,400	

コネクシオ	4,400	1,206.00	5,306,400	
日本通信	57,800	211.00	12,195,800	
日本電信電話	802,500	3,727.00	2,990,917,500	
ＫＤＤＩ	484,000	3,989.00	1,930,676,000	
ソフトバンク	1,006,100	1,484.00	1,493,052,400	
光通信	7,400	17,290.00	127,946,000	
エムティーアイ	9,400	508.00	4,775,200	
GMOインターネットグループ	23,300	2,373.00	55,290,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	16,400	274.00	4,493,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	33,100	2,465.00	81,591,500	
学研ホールディングス	10,400	922.00	9,588,800	
ゼンリン	10,700	815.00	8,720,500	
インプレスホールディングス	22,700	206.00	4,676,200	
東京電力ホールディングス	562,900	499.00	280,887,100	
中部電力	230,100	1,305.00	300,280,500	
関西電力	241,100	1,174.00	283,051,400	
中国電力	99,400	630.00	62,622,000	
北陸電力	58,900	531.00	31,275,900	
東北電力	152,700	663.00	101,240,100	
四国電力	53,300	726.00	38,695,800	
九州電力	143,900	695.00	100,010,500	
北海道電力	60,300	439.00	26,471,700	
沖縄電力	14,600	1,003.00	14,643,800	
電源開発	47,000	2,105.00	98,935,000	
エフオン	7,600	499.00	3,792,400	
イーレックス	11,100	2,328.00	25,840,800	
レノバ	16,600	2,516.00	41,765,600	
東京瓦斯	132,000	2,574.00	339,768,000	
大阪瓦斯	126,500	2,101.00	265,776,500	
東邦瓦斯	24,600	2,526.00	62,139,600	
北海道瓦斯	3,700	1,615.00	5,975,500	
広島ガス	7,900	337.00	2,662,300	
西部ガスホールディングス	5,900	1,663.00	9,811,700	
静岡ガス	14,200	1,081.00	15,350,200	
メタウォーター	7,800	1,683.00	13,127,400	
アイネット	3,800	1,257.00	4,776,600	
松竹	3,600	11,680.00	42,048,000	
東宝	39,200	5,070.00	198,744,000	
エイチ・アイ・エス	16,800	1,919.00	32,239,200	
東映	1,700	18,420.00	31,314,000	
ラックランド	2,000	2,936.00	5,872,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	196,500	1,917.00	376,690,500	
共立メンテナンス	11,000	5,610.00	61,710,000	
イチネンホールディングス	6,800	1,240.00	8,432,000	
建設技術研究所	3,300	3,320.00	10,956,000	
スペース	5,600	906.00	5,073,600	
アインホールディングス	9,100	5,970.00	54,327,000	
燦ホールディングス	2,800	1,719.00	4,813,200	
ピー・シー・エー	4,300	1,241.00	5,336,300	

東京テアトル	4,000	1,118.00	4,472,000	
タナベコンサルティンググループ	7,000	634.00	4,438,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,700	1,797.00	4,851,900	
ナガワ	1,700	7,000.00	11,900,000	
東京都競馬	5,400	3,680.00	19,872,000	
カナモト	11,800	2,283.00	26,939,400	
ＤＴＳ	13,800	3,070.00	42,366,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	6,020.00	189,630,000	
シーイーシー	8,800	1,543.00	13,578,400	
カプコン	62,200	4,185.00	260,307,000	
西尾レントオール	6,000	3,160.00	18,960,000	
アイ・エス・ビー	3,600	1,274.00	4,586,400	
日本空港ビルデング	21,800	6,230.00	135,814,000	
トランス・コスモス	8,000	3,235.00	25,880,000	
乃村工藝社	28,000	924.00	25,872,000	
ジャステック	3,800	1,173.00	4,457,400	
ＳＣＳＫ	51,100	2,014.00	102,915,400	
藤田観光	2,900	2,759.00	8,001,100	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,800	1,568.00	5,958,400	
日本管財	6,700	2,508.00	16,803,600	
トーカイ	5,700	1,904.00	10,852,800	
セコム	65,400	7,784.00	509,073,600	
ＮＳＷ	2,400	2,080.00	4,992,000	
セントラル警備保障	3,500	2,297.00	8,039,500	
アイネス	4,400	1,337.00	5,882,800	
丹青社	12,400	685.00	8,494,000	
メイテック	25,600	2,376.00	60,825,600	
ＴＫＣ	11,200	3,580.00	40,096,000	
富士ソフト	7,100	7,510.00	53,321,000	
応用地質	6,200	2,193.00	13,596,600	
船井総研ホールディングス	13,500	2,706.00	36,531,000	
ＮＳＤ	22,300	2,331.00	51,981,300	
進学会ホールディングス	14,600	300.00	4,380,000	
丸紅建材リース	2,500	1,719.00	4,297,500	
コナミグループ	26,800	5,760.00	154,368,000	
学究社	2,900	1,782.00	5,167,800	
ベネッセホールディングス	24,000	1,982.00	47,568,000	
イオンディライト	7,100	2,988.00	21,214,800	
ナック	5,200	919.00	4,778,800	
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,711.00	11,928,400	
ダイセキ	13,100	4,625.00	60,587,500	
ステップ	2,600	1,772.00	4,607,200	
日鉄物産	4,500	5,020.00	22,590,000	
泉州電業	3,300	3,195.00	10,543,500	
元気寿司	2,100	3,075.00	6,457,500	
トラスコ中山	13,900	2,076.00	28,856,400	
ヤマダホールディングス	270,900	469.00	127,052,100	
オートバックスセブン	23,000	1,424.00	32,752,000	
モリト	6,400	741.00	4,742,400	

アークランズ	9,700	1,493.00	14,482,100	
ニトリホールディングス	26,700	15,935.00	425,464,500	
グルメ杵屋	5,400	989.00	5,340,600	
愛眼	27,500	169.00	4,647,500	
吉野家ホールディングス	25,900	2,310.00	59,829,000	
加藤産業	8,000	3,410.00	27,280,000	
イノテック	4,200	1,266.00	5,317,200	
イエローハット	11,700	1,759.00	20,580,300	
松屋フーズホールディングス	3,100	3,935.00	12,198,500	
ＪＢＣＣホールディングス	4,600	1,874.00	8,620,400	
ＪＫホールディングス	5,200	997.00	5,184,400	
サガミホールディングス	10,600	1,191.00	12,624,600	
日伝	3,900	1,711.00	6,672,900	
関西フードマーケット	6,000	1,233.00	7,398,000	
ミロク情報サービス	5,700	1,408.00	8,025,600	
北沢産業	23,800	191.00	4,545,800	
杉本商事	2,900	1,950.00	5,655,000	
因幡電機産業	17,100	2,708.00	46,306,800	
王将フードサービス	4,400	5,980.00	26,312,000	
プレナス	7,300	2,635.00	19,235,500	
ミニストップ	4,800	1,421.00	6,820,800	
アークス	12,100	2,131.00	25,785,100	
バローホールディングス	12,600	1,770.00	22,302,000	
東テク	2,200	3,105.00	6,831,000	
ミスミグループ本社	99,700	3,070.00	306,079,000	
ベルク	3,300	5,640.00	18,612,000	
大　庄	4,100	1,031.00	4,227,100	
ファーストリテイリング	9,900	79,200.00	784,080,000	
ソフトバンクグループ	362,100	5,726.00	2,073,384,600	
蔵王産業	2,600	1,700.00	4,420,000	
スズケン	24,100	3,650.00	87,965,000	
サンドラッグ	25,100	3,715.00	93,246,500	
サックスバー　ホールディングス	6,500	722.00	4,693,000	
ジェコス	5,900	788.00	4,649,200	
ヤマザワ	3,400	1,279.00	4,348,600	
やまや	1,900	2,457.00	4,668,300	
ベルーナ	15,900	673.00	10,700,700	
合計	73,178,800		171,861,245,710	

（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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,645,398,186
金銭信託	76,269,701
コール・ローン	7,354,961,729
株式	530,189,806,408
投資証券	12,197,642,364
未収入金	239,883,549
未収配当金	501,379,945
差入委託証拠金	8,370,560,104
流動資産合計	561,575,901,986
資産合計	561,575,901,986
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	736,111,178
未払金	240,076,711
未払解約金	429,566,863
その他未払費用	7,184
流動負債合計	1,405,761,936
負債合計	1,405,761,936
純資産の部	
元本等	
元本	195,884,516,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	364,285,624,016
元本等合計	560,170,140,050
純資産合計	560,170,140,050
負債純資産合計	561,575,901,986

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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12月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	177,341,691,085円
同期中追加設定元本額	51,071,576,757円
同期中一部解約元本額	32,528,751,808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）	822,037,069円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,723,708,985円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,205,462,590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）	2,052,486,227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）	1,400,421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）	6,805,644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）	7,400,537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）	644,238,465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	144,408,213,043円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	33,931,490,127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）	2,125,403,981円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	299,775,264円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	178,834,346円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	342,211,221円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	625,220,647円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	16,868,522円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	89,243,784円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	6,511,907円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	8,993,093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）	3,864,532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）	21,172,042円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	219,121,500円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	144,812,171円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	312,177,684円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	221,778,338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）	195,601,380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）	200,716,746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）	196,996,913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）	193,061,557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）	193,026,421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）	173,795,704円
ニッセイ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	30,375,295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）	1,240,569,742円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	24,803,284円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	16,336,852円
計	195,884,516,034円
２．　受益権の総数	195,884,516,034口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△17,743,652,091
投資証券	△319,002,480
合計	△18,062,654,571

（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22日から2022年12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	6,148,256,650	－	6,063,483,440	△84,773,210
アメリカ・ドル	4,181,301,375	－	4,135,747,080	△45,554,295
イギリス・ポンド	631,246,864	－	613,568,960	△17,677,904
ユーロ	1,335,708,411	－	1,314,167,400	△21,541,011
合計	6,148,256,650	－	6,063,483,440	△84,773,210

（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12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	17,450,622,936	－	16,799,284,968	△651,337,968
合計	17,450,622,936	－	16,799,284,968	△651,337,968

（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12月20日現在
1口当たり純資産額	2.8597円
（1万口当たり純資産額）	(28,597円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年12月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	47,950	122.130	5,856,133.50	
	ABBOTT LABORATORIES	151,725	106.590	16,172,367.75	
	ABBVIE INC	153,215	161.490	24,742,690.35	
	ABIOMED INC	3,919	381.300	1,494,314.70	
	ACCENTURE PLC	54,780	255.400	13,990,812.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	67,807	75.990	5,152,653.93	
	ADOBE INC	40,521	328.760	13,321,683.96	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,201	140.900	732,820.90	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	139,863	64.590	9,033,751.17	
	AERCAP HOLDINGS NV	11,689	56.710	662,883.19	
	AES CORP	57,973	28.200	1,634,838.60	
	AFFIRM HOLDINGS INC	16,953	9.480	160,714.44	
	AFLAC INC	51,828	68.920	3,571,985.76	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,637	146.950	3,767,357.15	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,245	313.720	6,037,541.40	
	AIRBNB INC-CLASS A	32,834	85.930	2,821,425.62	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,783	84.070	1,158,736.81	
	ALBEMARLE CORP	10,145	233.340	2,367,234.30	
	ALCOA CORP	15,506	42.320	656,213.92	

ALIGN TECHNOLOGY INC	6,404	198.760	1,272,859.04	
ALLEGION PLC	7,696	104.570	804,770.72	
ALLIANT ENERGY CORP	21,750	54.290	1,180,807.50	
ALLSTATE CORP	23,372	130.990	3,061,498.28	
ALLY FINANCIAL INC	26,275	23.470	616,674.25	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,426	234.070	2,440,413.82	
ALPHABET INC-CL A	519,306	88.440	45,927,422.64	
ALPHABET INC-CL C	480,673	89.150	42,851,997.95	
ALTRIA GROUP INC	156,093	46.380	7,239,593.34	
AMAZON.COM INC	794,408	84.920	67,461,127.36	
AMCOR PLC	130,583	12.020	1,569,607.66	
AMEREN CORPORATION	22,427	87.300	1,957,877.10	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	44,573	94.000	4,189,862.00	
AMERICAN EXPRESS CO	55,231	145.010	8,009,047.31	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,190	132.430	819,741.70	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	65,497	61.470	4,026,100.59	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,725	151.480	2,382,023.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,324	306.570	2,858,458.68	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,547	167.220	2,265,329.34	
AMETEK INC	19,974	136.980	2,736,038.52	
AMGEN INC	46,359	265.700	12,317,586.30	
AMPHENOL CORP-CL A	51,767	75.950	3,931,703.65	
ANALOG DEVICES INC	44,658	165.140	7,374,822.12	
ANSYS INC	7,525	235.400	1,771,385.00	
AON PLC	18,262	297.060	5,424,909.72	
APA CORP	28,083	43.840	1,231,158.72	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,759	62.330	2,166,528.47	
APPLE INC	1,392,345	132.370	184,304,707.65	
APPLIED MATERIALS INC	74,513	103.990	7,748,606.87	
APTIV PLC	23,479	93.110	2,186,129.69	
ARAMARK	20,450	41.000	838,450.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,857	60.540	1,928,622.78	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,540	92.650	4,497,231.00	
ARES MANAGEMENT CORP - A	13,435	66.570	894,367.95	
ARISTA NETWORKS INC	21,080	122.550	2,583,354.00	
ARROW ELECTRONICS INC	5,441	101.900	554,437.90	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,206	185.090	3,369,748.54	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,522	199.970	504,324.34	
ASSURANT INC	4,620	122.950	568,029.00	
AT&T INC	617,490	17.860	11,028,371.40	
ATMOS ENERGY CORP	12,200	113.480	1,384,456.00	
AUTODESK INC	18,832	188.540	3,550,585.28	

AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	36,046	245.060	8,833,432.76	
AUTOZONE INC	1,687	2,379.170	4,013,659.79	
AVANTOR INC	58,540	20.300	1,188,362.00	
AVERY DENNISON CORP	7,039	176.480	1,242,242.72	
BAKER HUGHES COMPANY	87,862	28.260	2,482,980.12	
BALL CORP	27,275	50.610	1,380,387.75	
BANK OF AMERICA CORP	626,260	32.060	20,077,895.60	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,493	44.170	2,936,995.81	
BATH & BODY WORKS INC	19,588	40.340	790,179.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,813	49.950	2,188,459.35	
BECTON DICKINSON & CO	24,735	248.460	6,145,658.10	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	16,763	37.100	621,907.30	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	112,814	300.030	33,847,584.42	
BEST BUY CO INC	17,499	79.800	1,396,420.20	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,176	106.170	868,045.92	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,929	401.820	775,110.78	
BIO-TECHNE CORP	13,528	80.790	1,092,927.12	
BIOGEN INC	12,559	284.380	3,571,528.42	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,097	106.610	1,716,101.17	
BLACK KNIGHT INC	13,576	58.300	791,480.80	
BLACKROCK INC	13,045	692.470	9,033,271.15	
BLACKSTONE INC	60,708	73.480	4,460,823.84	
BLOCK INC	45,897	60.440	2,774,014.68	
BOEING CO	48,904	185.680	9,080,494.72	
BOOKING HOLDINGS INC	3,440	1,931.440	6,644,153.60	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,456	103.630	1,187,185.28	
BORGWARNER INC	20,661	40.620	839,249.82	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,111	45.800	5,684,283.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	185,152	73.160	13,545,720.32	
BROADCOM INC	35,004	549.630	19,239,248.52	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,219	133.210	1,361,272.99	
BROWN & BROWN INC	20,664	55.410	1,144,992.24	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	26,904	65.460	1,761,135.84	
BUNGE LIMITED	13,075	96.190	1,257,684.25	
BURLINGTON STORES INC	5,673	187.640	1,064,481.72	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,041	93.510	1,032,443.91	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	23,672	160.950	3,810,008.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,562	45.040	836,032.48	

CAMPBELL SOUP CO	18,259	56.830	1,037,658.97	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,131	87.870	2,911,220.97	
CARDINAL HEALTH INC	23,767	79.340	1,885,673.78	
CARLISLE COS INC	4,473	237.310	1,061,487.63	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,733	28.510	477,057.83	
CARMAX INC	13,777	58.090	800,305.93	
CARNIVAL CORP	86,118	8.090	696,694.62	
CARRIER GLOBAL CORP	72,912	41.500	3,025,848.00	
CATALENT INC	14,762	43.880	647,756.56	
CATERPILLAR INC	45,753	232.290	10,627,964.37	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,222	123.260	1,136,703.72	
CBRE GROUP INC	27,754	75.010	2,081,827.54	
CDW CORP/DE	11,769	178.330	2,098,765.77	
CELANESE CORP-SERIES A	9,288	100.980	937,902.24	
CENTENE CORP	49,528	81.420	4,032,569.76	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,691	29.980	1,639,636.18	
CENTURYLINK INC	80,597	5.290	426,358.13	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,984	63.140	756,669.76	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,227	92.720	1,597,287.44	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,393	216.530	951,216.29	
CHARLES SCHWAB CORP	126,018	78.260	9,862,168.68	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,737	306.160	2,981,079.92	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,698	127.480	1,108,821.04	
CHENIERE ENERGY INC	19,494	152.270	2,968,351.38	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,793	95.940	843,600.42	
CHEVRON CORP	161,135	169.880	27,373,613.80	
CHEWY INC - CLASS A	8,092	40.600	328,535.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,406	1,414.980	3,404,441.88	
CHUBB LTD	36,168	211.960	7,666,169.28	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,065	79.890	1,682,882.85	
CIGNA CORP	26,462	330.780	8,753,100.36	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,041	100.940	1,316,358.54	
CINTAS CORP	7,866	443.510	3,488,649.66	
CISCO SYSTEMS INC	358,677	47.400	17,001,289.80	
CITIGROUP INC	167,719	43.930	7,367,895.67	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,704	38.200	1,631,292.80	
CLARIVATE PLC	26,630	8.050	214,371.50	
CLEVELAND-CLIFFS INC	44,732	14.320	640,562.24	
CLOROX CO	10,708	144.810	1,550,625.48	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,058	45.070	994,154.06	
CME GROUP INC	31,188	170.680	5,323,167.84	
CMS ENERGY CORP	25,322	61.580	1,559,328.76	

COCA-COLA CO	356,149	62.840	22,380,403.16	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	17,858	53.980	963,974.84	
COGNEX CORP	14,983	46.780	700,904.74	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	44,709	54.980	2,458,100.82	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	10,682	35.170	375,685.94	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,735	77.980	5,359,955.30	
COMCAST CORP	381,403	33.980	12,960,073.94	
CONAGRA BRANDS INC	41,731	38.130	1,591,203.03	
CONOCOPHILLIPS	110,259	110.440	12,177,003.96	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,770	94.850	2,918,534.50	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,840	230.290	3,187,213.60	
CONSTELLATION ENERGY	28,303	87.730	2,483,022.19	
COOPER COS INC/THE	4,275	316.260	1,352,011.50	
COPART INC	36,971	60.310	2,229,721.01	
CORNING INC	69,858	31.750	2,217,991.50	
CORTEVA INC	62,439	58.300	3,640,193.70	
COSTAR GROUP INC	34,315	77.160	2,647,745.40	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,350	458.630	17,588,460.50	
COTERRA ENERGY INC	68,845	24.310	1,673,621.95	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,589	108.090	1,901,195.01	
CROWN HOLDINGS INC	10,550	80.000	844,000.00	
CSX CORP	187,633	31.180	5,850,396.94	
CUMMINS INC	12,244	237.190	2,904,154.36	
CVS HEALTH CORP	113,758	95.050	10,812,697.90	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,562	127.630	454,618.06	
DANAHER CORP	59,861	258.720	15,487,237.92	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,613	138.450	1,469,369.85	
DARLING INTERNATIONAL INC	13,818	59.660	824,381.88	
DATADOG INC - CLASS A	21,419	76.050	1,628,914.95	
DAVITA INC	4,747	72.270	343,065.69	
DEERE & CO	25,161	432.670	10,886,409.87	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,897	39.000	892,983.00	
DELTA AIR LINES INC	13,508	32.920	444,683.36	
DENTSPLY SIRONA INC	18,860	30.600	577,116.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	53,714	59.260	3,183,091.64	
DEXCOM INC	34,000	112.230	3,815,820.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	14,599	133.580	1,950,134.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,656	95.170	2,251,341.52	
DISH NETWORK CORP	21,069	13.870	292,227.03	
DOCUSIGN INC	17,270	54.220	936,379.40	
DOLLAR GENERAL CORP	19,555	242.440	4,740,914.20	

DOLLAR TREE INC	19,410	139.420	2,706,142.20	
DOMINION ENERGY INC	72,232	59.250	4,279,746.00	
DOMINO'S PIZZA INC	3,099	356.330	1,104,266.67	
DOORDASH INC - A	20,238	51.440	1,041,042.72	
DOVER CORP	12,407	132.380	1,642,438.66	
DOW INC	62,201	49.330	3,068,375.33	
DR HORTON INC	28,468	88.090	2,507,746.12	
DROPBOX INC-CLASS A	23,795	22.380	532,532.10	
DTE ENERGY COMPANY	16,897	115.180	1,946,196.46	
DUKE ENERGY CORP	66,817	100.230	6,697,067.91	
DUPONT DE NEMOURS INC	43,419	67.560	2,933,387.64	
DYNATRACE INC	17,404	37.170	646,906.68	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,618	80.710	856,978.78	
EATON CORP PLC	34,524	154.500	5,333,958.00	
EBAY INC	47,480	41.340	1,962,823.20	
ECOLAB INC	22,282	141.210	3,146,441.22	
EDISON INTERNATIONAL	33,226	64.950	2,158,028.70	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,570	73.430	3,933,645.10	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	37,212	11.850	440,962.20	
ELECTRONIC ARTS INC	24,079	120.790	2,908,502.41	
ELEVANCE HEALTH, INC	20,786	502.890	10,453,071.54	
ELI LILLY & CO	69,983	357.780	25,038,517.74	
EMERSON ELECTRIC CO	51,344	94.580	4,856,115.52	
ENPHASE ENERGY INC	11,740	305.010	3,580,817.40	
ENTEGRIS INC	12,899	64.410	830,824.59	
ENTERGY CORP	17,719	113.140	2,004,727.66	
EOG RESOURCES INC	50,716	125.530	6,366,379.48	
EPAM SYSTEMS INC	4,958	328.570	1,629,050.06	
EQT CORP	28,840	36.110	1,041,412.40	
EQUIFAX INC	10,591	191.170	2,024,681.47	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,262	28.480	918,821.76	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,205	271.400	598,437.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	21,888	46.610	1,020,199.68	
ESTEE LAUDER COS INC	20,010	236.240	4,727,162.40	
ETSY INC	10,948	125.910	1,378,462.68	
EVEREST RE GROUP LTD	3,398	322.380	1,095,447.24	
EVERGY INC	19,983	61.690	1,232,751.27	
EVERSOURCE ENERGY	30,105	82.830	2,493,597.15	
EXACT SCIENCES CORP	15,510	50.000	775,500.00	
EXELON CORP	85,794	41.770	3,583,615.38	
EXPEDIA GROUP INC	13,067	85.260	1,114,092.42	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	14,443	108.010	1,559,988.43	
EXXON MOBIL CORP	361,124	105.170	37,979,411.08	
F5 INC	5,122	141.720	725,889.84	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,290	419.900	1,381,471.00	

FAIR ISAAC CORP	2,186	585.650	1,280,230.90	
FASTENAL CO	49,701	47.750	2,373,222.75	
FEDEX CORP	21,570	168.780	3,640,584.60	
FERGUSON PLC	17,974	125.390	2,253,759.86	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	22,501	36.400	819,036.40	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,735	67.350	3,551,702.25	
FIFTH THIRD BANCORP	59,195	31.650	1,873,521.75	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,032	730.180	753,545.76	
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	46,867	24.420	1,144,492.14	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,816	119.480	1,889,695.68	
FIRST SOLAR INC	8,305	156.770	1,301,974.85	
FIRSTENERGY CORP	47,198	41.010	1,935,589.98	
FISERV INC	52,756	98.670	5,205,434.52	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,182	178.960	1,106,330.72	
FMC CORP	10,988	122.760	1,348,886.88	
FORD MOTOR CO	341,915	11.690	3,996,986.35	
FORTINET INC	57,967	49.980	2,897,190.66	
FORTIVE CORP	29,370	63.610	1,868,225.70	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	11,199	55.150	617,624.85	
FOX CORP - CLASS A	24,948	29.490	735,716.52	
FOX CORP- CLASS B	14,236	27.630	393,340.68	
FRANKLIN RESOURCES INC	25,769	25.780	664,324.82	
FREEPORT-MCMORAN INC	123,377	37.360	4,609,364.72	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,206	64.710	336,880.26	
GARMIN LTD	13,350	90.300	1,205,505.00	
GARTNER INC	6,849	339.060	2,322,221.94	
GEN DIGITAL INC	51,905	21.580	1,120,109.90	
GENERAC HOLDINGS INC	5,484	91.730	503,047.32	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,222	244.300	4,940,234.60	
GENERAL ELECTRIC CO	95,145	78.060	7,427,018.70	
GENERAL MILLS INC	51,512	87.120	4,487,725.44	
GENERAL MOTORS CO	119,890	35.420	4,246,503.80	
GENUINE PARTS CO	12,250	175.870	2,154,407.50	
GILEAD SCIENCES INC	108,578	86.420	9,383,310.76	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,060	93.130	2,240,707.80	
GLOBE LIFE INC	8,067	117.860	950,776.62	
GODADDY INC - CLASS A	13,664	73.130	999,248.32	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,547	344.610	10,182,191.67	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	116,128	3.010	349,545.28	
HALLIBURTON CO	78,561	36.060	2,832,909.66	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	27,769	73.660	2,045,464.54	
HASBRO INC	11,434	55.910	639,274.94	

HCA HEALTHCARE INC	19,866	238.670	4,741,418.22	
HEICO CORP	3,780	149.440	564,883.20	
HEICO CORP-CLASS A	6,314	115.450	728,951.30	
HENRY SCHEIN INC	11,755	80.690	948,510.95	
HERSHEY CO/THE	12,724	234.890	2,988,740.36	
HESS CORP	24,230	133.630	3,237,854.90	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,179	15.480	1,736,530.92	
HF SINCLAIR CORP	14,020	49.730	697,214.60	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,817	129.900	3,093,828.30	
HOLOGIC INC	21,645	73.310	1,586,794.95	
HOME DEPOT INC	88,695	317.330	28,145,584.35	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,408	209.410	12,231,219.28	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,900	4.580	452,962.00	
HORIZON PHARMA PLC	18,919	112.970	2,137,279.43	
HORMEL FOODS CORP	26,129	45.490	1,188,608.21	
HOWMET AEROSPACE INC	32,526	37.580	1,222,327.08	
HP INC	89,353	26.560	2,373,215.68	
HUBBELL INC	4,661	236.780	1,103,631.58	
HUBSPOT INC	3,946	287.520	1,134,553.92	
HUMANA INC	10,964	504.840	5,535,065.76	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	124,783	13.690	1,708,279.27	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,451	229.570	792,246.07	
IDEX CORP	6,584	226.270	1,489,761.68	
IDEXX LABORATORIES INC	7,187	402.170	2,890,395.79	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	26,868	217.290	5,838,147.72	
ILLUMINA INC	13,624	191.590	2,610,222.16	
INCYTE CORP	16,454	80.590	1,326,027.86	
INGERSOLL-RAND INC	35,073	51.070	1,791,178.11	
INSULET CORP	6,030	294.290	1,774,568.70	
INTEL CORP	355,616	26.790	9,526,952.64	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,408	100.280	4,854,354.24	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	78,327	138.870	10,877,270.49	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	22,219	101.660	2,258,783.54	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,900	34.920	1,044,108.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,786	32.170	1,086,895.62	
INTUIT INC	23,201	383.520	8,898,047.52	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,905	261.010	8,066,514.05	
INVESCO LTD	28,975	18.100	524,447.50	
IQVIA HOLDINGS INC	16,175	199.840	3,232,412.00	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,330	175.370	1,110,092.10	
JACOBS SOLUTIONS INC	11,041	118.520	1,308,579.32	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	13,800	50.400	695,520.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,457	156.380	853,365.66	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,525	179.530	1,350,963.25	
JM SMUCKER CO	9,210	155.820	1,435,102.20	
JOHNSON & JOHNSON	227,838	175.480	39,981,012.24	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	59,776	63.460	3,793,384.96	
JPMORGAN CHASE & CO	254,026	130.060	33,038,621.56	
JUNIPER NETWORKS INC	27,993	31.670	886,538.31	
KELLOGG CO	22,064	71.510	1,577,796.64	
KEURIG DR PEPPER INC	67,675	36.320	2,457,956.00	
KEYCORP	80,202	16.650	1,335,363.30	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,508	171.380	2,657,761.04	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,343	135.660	3,980,671.38	
KINDER MORGAN INC	176,915	17.510	3,097,781.65	
KKR & CO INC -A	48,359	46.000	2,224,514.00	
KLA CORPORATION	12,300	383.660	4,719,018.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,997	52.360	732,882.92	
KRAFT HEINZ CO/THE	63,728	40.110	2,556,130.08	
KROGER CO	58,650	44.400	2,604,060.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,553	205.550	3,402,469.15	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,795	229.010	1,785,132.95	
LAM RESEARCH CORP	11,873	438.690	5,208,566.37	
LAMB WESTON HOLDING INC	12,532	87.110	1,091,662.52	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,734	46.360	1,378,468.24	
LEAR CORP	5,240	123.430	646,773.20	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,265	104.450	1,176,629.25	
LENNAR CORP-CL A	22,069	90.100	1,988,416.90	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,785	244.880	681,990.80	
LIBERTY BROADBAND-C	10,907	69.560	758,690.92	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,828	18.410	217,753.48	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	27,120	18.750	508,500.00	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	6,171	38.590	238,138.89	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	14,710	38.500	566,335.00	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	17,030	58.400	994,552.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,990	29.240	409,067.60	
LINDE PLC	43,225	327.050	14,136,736.25	
LIVE NATION INC	14,885	68.390	1,017,985.15	

LKQ CORP	22,500	52.730	1,186,425.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,663	481.790	9,955,226.77	
LOEWS CORP	17,755	54.950	975,637.25	
LOWE'S COS INC	53,747	203.170	10,919,777.99	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,896	209.150	1,442,298.40	
LUCID GROUP INC	36,879	7.230	266,635.17	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,064	316.920	3,189,482.88	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,538	80.300	1,809,801.40	
M&T BANK CORP	15,245	140.650	2,144,209.25	
MARATHON OIL CORP	58,205	27.030	1,573,281.15	
MARATHON PETROLEUM CORP	43,062	111.070	4,782,896.34	
MARKEL CORP	1,180	1,260.230	1,487,071.40	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,261	271.480	885,296.28	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	23,916	151.370	3,620,164.92	
MARSH & MCLENNAN COS INC	43,227	163.730	7,077,556.71	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,431	340.850	1,851,156.35	
MARVELL TECHNOLOGY INC	73,917	38.400	2,838,412.80	
MASCO CORP	19,574	46.960	919,195.04	
MASIMO CORPORATION	4,282	138.720	593,999.04	
MASTERBRAND INC	11,199	8.470	94,855.53	
MASTERCARD INC-CLASS A	74,768	341.260	25,515,327.68	
MATCH GROUP INC	24,520	40.370	989,872.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,782	82.840	1,804,420.88	
MCDONALD'S CORP	63,770	265.830	16,951,979.10	
MCKESSON CORP	12,475	375.540	4,684,861.50	
MEDTRONIC PLC	115,182	77.120	8,882,835.84	
MERCADOLIBRE INC	3,932	884.270	3,476,949.64	
MERCK & CO INC	219,517	109.440	24,023,940.48	
META PLATFORMS INC-A	197,515	114.480	22,611,517.20	
METLIFE INC	58,456	71.160	4,159,728.96	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,947	1,397.930	2,721,769.71	
MGM MIRAGE	26,980	34.220	923,255.60	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47,979	71.480	3,429,538.92	
MICRON TECHNOLOGY INC	95,456	51.720	4,936,984.32	
MICROSOFT CORP	613,809	240.450	147,590,374.05	
MODERNA INC	28,760	189.890	5,461,236.40	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,370	95.420	416,985.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,033	331.650	1,669,194.45	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	16,482	51.690	851,954.58	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	118,767	65.700	7,802,991.90	
MONGODB INC	5,904	193.360	1,141,597.44	

MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,849	359.010	1,381,829.49	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,211	100.420	3,435,468.62	
MOODY'S CORP	14,289	278.320	3,976,914.48	
MORGAN STANLEY	111,513	85.550	9,539,937.15	
MOSAIC CO/THE	29,712	44.540	1,323,372.48	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,472	254.590	3,684,426.48	
MSCI INC	6,958	461.940	3,214,178.52	
NASDAQ INC	29,867	60.460	1,805,758.82	
NETAPP INC	19,006	59.190	1,124,965.14	
NETFLIX INC	38,507	288.300	11,101,568.10	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,349	117.930	984,597.57	
NEWELL BRANDS INC	34,081	12.760	434,873.56	
NEWMONT CORP	68,598	45.600	3,128,068.80	
NEWS CORP - CLASS A	33,206	17.430	578,780.58	
NEXTERA ENERGY INC	170,225	83.520	14,217,192.00	
NIKE INC	109,503	103.050	11,284,284.15	
NISOURCE INC	35,501	27.050	960,302.05	
NORDSON CORP	4,476	233.400	1,044,698.40	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,636	247.000	5,097,092.00	
NORTHERN TRUST CORP	17,159	87.230	1,496,779.57	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,711	532.520	6,768,861.72	
NOVOCURE LTD	8,210	73.770	605,651.70	
NRG ENERGY INC	20,367	31.540	642,375.18	
NUCOR CORP	22,628	131.760	2,981,465.28	
NVIDIA CORP	215,722	162.540	35,063,453.88	
NVR INC	270	4,685.200	1,265,004.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	22,776	160.270	3,650,309.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,481	816.430	4,474,852.83	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,694	62.410	5,036,112.54	
OKTA INC	13,151	65.350	859,417.85	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,360	290.190	2,425,988.40	
OMNICOM GROUP	17,773	77.310	1,374,030.63	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	37,507	64.150	2,406,074.05	
ONEOK INC	38,684	63.370	2,451,405.08	
ORACLE CORP	138,527	80.500	11,151,423.50	
OTIS WORLDWIDE CORP	36,512	77.870	2,843,189.44	
OVINTIV INC	21,854	49.300	1,077,402.20	
OWENS CORNING	8,288	87.660	726,526.08	
PACCAR INC	30,246	99.110	2,997,681.06	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,124	128.610	1,044,827.64	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	144,893	6.350	920,070.55	
PALO ALTO NETWORKS INC	25,900	150.520	3,898,468.00	

PARAMOUNT GLOBAL	52,492	16.920	888,164.64	
PARKER HANNIFIN CORP	11,131	282.700	3,146,733.70	
PAYCHEX INC	28,065	115.520	3,242,068.80	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,418	309.590	1,367,768.62	
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,583	195.610	700,870.63	
PAYPAL HOLDINGS INC	95,143	68.950	6,560,109.85	
PENTAIR PLC	14,033	43.830	615,066.39	
PEPSICO INC	119,578	181.340	21,684,274.52	
PERKINELMER INC	10,907	138.320	1,508,656.24	
PFIZER INC	486,199	51.360	24,971,180.64	
PG&E CORP	129,371	15.840	2,049,236.64	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	134,276	100.610	13,509,508.36	
PHILLIPS 66	41,596	100.610	4,184,973.56	
PINTEREST INC- CLASS A	50,517	24.170	1,220,995.89	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,641	218.070	4,283,112.87	
PLUG POWER INC	45,174	12.910	583,196.34	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,526	150.160	5,334,584.16	
POOL CORP	3,419	308.140	1,053,530.66	
PPG INDUSTRIES INC	20,386	125.630	2,561,093.18	
PPL CORPORATION	64,234	29.110	1,869,851.74	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,413	84.310	1,805,330.03	
PROCTER & GAMBLE CO	206,721	150.400	31,090,838.40	
PROGRESSIVE CORP	50,704	127.070	6,442,957.28	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,161	97.120	3,123,476.32	
PTC INC	9,680	122.500	1,185,800.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,420	59.360	2,577,411.20	
PULTE GROUP INC	19,953	45.080	899,481.24	
QORVO INC	8,924	93.020	830,110.48	
QUALCOMM INC	97,280	112.610	10,954,700.80	
QUANTA SERVICES INC	12,404	142.360	1,765,833.44	
QUEST DIAGNOSTICS	10,064	151.450	1,524,192.80	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,773	105.150	1,763,680.95	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	127,937	97.540	12,478,974.98	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,275	721.100	6,688,202.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	80,215	20.600	1,652,429.00	
REPLIGEN CORP	4,571	162.420	742,421.82	
REPUBLIC SERVICES INC	19,149	129.650	2,482,667.85	
RESMED INC	12,675	209.150	2,650,976.25	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,827	22.030	613,028.81	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	9,346	72.070	673,566.22	

ROBLOX CORP -CLASS A	30,803	27.190	837,533.57	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,005	250.660	2,507,853.30	
ROKU INC	10,521	44.500	468,184.50	
ROLLINS INC	19,158	36.940	707,696.52	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,203	423.350	3,896,090.05	
ROSS STORES INC	30,323	114.920	3,484,719.16	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,868	51.470	1,022,605.96	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,468	39.570	1,205,618.76	
RPM INTERNATIONAL INC	11,293	98.110	1,107,956.23	
S&P GLOBAL INC	29,509	335.660	9,904,990.94	
SALESFORCE INC	86,648	129.010	11,178,458.48	
SCHLUMBERGER LTD	122,583	49.830	6,108,310.89	
SEA LTD-ADR	31,347	53.020	1,662,017.94	
SEAGATE TECHNOLOGY	17,111	50.990	872,489.89	
SEAGEN INC	12,035	127.630	1,536,027.05	
SEALED AIR CORP	12,600	49.990	629,874.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,791	57.850	566,409.35	
SEMPRA ENERGY	27,284	157.280	4,291,227.52	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,548	40.440	547,881.12	
SERVICENOW INC	17,500	382.300	6,690,250.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,340	238.110	5,081,267.40	
SIGNATURE BANK	5,396	114.000	615,144.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,736	5.900	405,542.40	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,881	91.680	1,272,610.08	
SMITH (A.O.) CORP	11,153	56.060	625,237.18	
SNAP INC - A	96,598	8.190	791,137.62	
SNAP-ON INC	4,596	224.130	1,030,101.48	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,316	138.100	2,667,539.60	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,824	309.580	1,493,413.92	
SOUTHERN CO	94,524	68.910	6,513,648.84	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,500	36.350	454,375.00	
SPLUNK INC	14,119	82.800	1,169,053.20	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	20,117	49.940	1,004,642.98	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,833	74.790	959,780.07	
STARBUCKS CORP	99,434	98.300	9,774,362.20	
STATE STREET CORP	31,723	77.560	2,460,435.88	
STEEL DYNAMICS INC	15,726	101.540	1,596,818.04	
STERIS PLC	8,662	180.500	1,563,491.00	
STRYKER CORP	29,495	239.030	7,050,189.85	
SVB FINANCIAL GROUP	5,085	210.390	1,069,833.15	
SYNCHRONY FINANCIAL	41,473	32.380	1,342,895.74	
SYNOPSYS INC	13,231	323.390	4,278,773.09	
SYSCO CORP	43,867	77.910	3,417,677.97	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,362	109.530	2,120,719.86	

T-MOBILE US INC	54,511	141.620	7,719,847.82	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	14,453	98.590	1,424,921.27	
TARGA RESOURCES CORP	18,506	69.040	1,277,654.24	
TARGET CORP	39,825	144.650	5,760,686.25	
TE CONNECTIVITY LTD	27,738	115.540	3,204,848.52	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,079	390.280	1,591,952.12	
TELEFLEX INC	4,057	243.350	987,270.95	
TERADYNE INC	13,535	88.400	1,196,494.00	
TESLA, INC.	230,761	149.870	34,584,151.07	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,352	8.570	825,736.64	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,186	167.610	13,272,365.46	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	535	2,474.870	1,324,055.45	
TEXTRON INC	18,177	69.280	1,259,302.56	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,943	530.170	17,995,560.31	
TJX COS INC	100,655	78.090	7,860,148.95	
TOAST INC-CLASS A	21,340	17.770	379,211.80	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,602	211.460	2,030,438.92	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	38,404	44.130	1,694,768.52	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,319	61.700	574,982.30	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,133	168.810	3,398,651.73	
TRANSDIGM GROUP INC	4,473	602.050	2,692,969.65	
TRANSUNION	16,664	56.390	939,682.96	
TRAVELERS COS INC/THE	20,489	183.510	3,759,936.39	
TRIMBLE INC	21,443	49.560	1,062,715.08	
TRUIST FINANCIAL CORP	115,093	41.120	4,732,624.16	
TWILIO INC - A	15,187	46.310	703,309.97	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,599	320.050	1,151,859.95	
TYSON FOODS INC-CL A	24,939	60.810	1,516,540.59	
U-HAUL HOLDING CO	8,001	52.600	420,852.60	
UBER TECHNOLOGIES INC	129,370	24.950	3,227,781.50	
UGI CORP	18,108	36.790	666,193.32	
ULTA BEAUTY INC	4,422	440.510	1,947,935.22	
UNION PACIFIC CORP	54,473	206.390	11,242,682.47	
UNITED PARCEL SERVICE INC	63,614	178.430	11,350,646.02	
UNITED RENTALS INC	6,037	351.250	2,120,496.25	
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,043	523.600	42,434,114.80	
UNITY SOFTWARE INC	21,436	27.920	598,493.12	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,660	134.500	761,270.00	
US BANCORP	122,271	41.950	5,129,268.45	
VAIL RESORTS INC	3,527	245.900	867,289.30	
VALERO ENERGY CORP	34,050	119.710	4,076,125.50	

VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,133	167.280	2,029,608.24	
VERISIGN INC	8,350	200.490	1,674,091.50	
VERISK ANALYTICS INC	13,583	173.220	2,352,847.26	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	364,222	37.030	13,487,140.66	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,222	291.590	6,479,712.98	
VF CORP	28,817	26.050	750,682.85	
VIATRIS INC	104,937	10.910	1,144,862.67	
VISA INC-CLASS A SHARES	141,683	204.820	29,019,512.06	
VISTRA CORP	32,814	23.860	782,942.04	
VMWARE INC-CLASS A	18,346	120.820	2,216,563.72	
VULCAN MATERIALS CO	11,594	175.420	2,033,819.48	
WABTEC CORP	15,043	99.460	1,496,176.78	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,438	39.320	2,494,382.16	
WALMART INC	130,526	142.800	18,639,112.80	
WALT DISNEY CO	157,993	85.780	13,552,639.54	
WARNER BROS DISCOVERY INC	199,903	9.250	1,849,102.75	
WASTE CONNECTIONS INC	22,307	133.310	2,973,746.17	
WASTE MANAGEMENT INC	35,815	157.590	5,644,085.85	
WATERS CORP	5,178	337.300	1,746,539.40	
WEBSTER FINANCIAL CORP	15,146	45.360	687,022.56	
WEC ENERGY GROUP INC	27,401	94.240	2,582,270.24	
WELLS FARGO & CO	328,462	41.820	13,736,280.84	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,389	228.230	1,458,161.47	
WESTERN DIGITAL CORP	27,205	31.560	858,589.80	
WESTERN UNION CO	33,570	13.490	452,859.30	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,245	103.210	334,916.45	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	22,068	34.800	767,966.40	
WEYERHAEUSER CO	64,090	30.830	1,975,894.70	
WHIRLPOOL CORP	4,725	139.570	659,468.25	
WILLIAMS COS INC	105,773	32.070	3,392,140.11	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,511	239.310	2,276,077.41	
WIX.COM LTD	5,002	78.740	393,857.48	
WOLFSPEED INC	10,756	75.550	812,615.80	
WORKDAY INC-CLASS A	17,407	170.040	2,959,886.28	
WR BERKLEY CORP	18,218	71.530	1,303,133.54	
WW GRAINGER INC	3,969	561.270	2,227,680.63	
WYNN RESORTS LTD	9,363	81.560	763,646.28	
XCEL ENERGY INC	47,492	69.400	3,295,944.80	
XYLEM INC	15,602	108.480	1,692,504.96	
YUM! BRANDS INC	24,635	128.380	3,162,641.30	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,470	243.710	1,089,383.70	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	13,877	34.380	477,091.26	

	ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,594	16.290	123,706.26	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,210	124.960	2,275,521.60	
	ZOETIS INC	40,565	143.190	5,808,502.35	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,522	69.090	1,348,774.98	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	22,805	27.940	637,171.70	
	ZSCALER INC	7,382	112.270	828,777.14	
アメリカ・ドル　小計		29,565,583		2,856,025,288.85 (384,249,642,362)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	82,542	12.875	1,062,728.25	
	ABRDN PLC	183,576	1.866	342,552.81	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,515	20.390	316,350.85	
	ANGLO AMERICAN PLC	109,713	31.130	3,415,365.69	
	ANTOFAGASTA PLC	33,802	14.710	497,227.42	
	ASHTEAD GROUP PLC	38,100	47.550	1,811,655.00	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,056	15.620	485,094.72	
	ASTRAZENECA PLC	134,304	111.080	14,918,488.32	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	80,922	5.218	422,250.99	
	AVEVA GROUP PLC	10,550	32.090	338,549.50	
	AVIVA PLC	244,297	4.384	1,070,998.04	
	BAE SYSTEMS PLC	270,960	8.438	2,286,360.48	
	BARCLAYS PLC	1,383,830	1.553	2,149,087.99	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	88,577	3.937	348,727.64	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	9,414	37.380	351,895.32	
	BP PLC	1,632,335	4.666	7,616,475.11	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	185,314	33.320	6,174,662.48	
	BT GROUP PLC	602,147	1.126	678,017.52	
	BUNZL PLC	29,376	28.320	831,928.32	
	BURBERRY GROUP PLC	34,109	20.330	693,435.97	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,262	19.610	338,507.82	
	COMPASS GROUP PLC	153,287	19.035	2,917,818.04	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,043	66.460	800,377.78	
	DCC PLC	8,615	40.450	348,476.75	
	DIAGEO PLC	197,419	36.360	7,178,154.84	
	ENTAIN PLC	50,978	13.095	667,556.91	
	EXPERIAN PLC	79,603	28.330	2,255,152.99	
	GLENCORE PLC	845,252	5.368	4,537,312.73	
	GSK PLC	352,189	14.208	5,003,901.31	
	HALEON PLC	438,200	3.138	1,375,071.60	
	HALMA PLC	32,845	20.620	677,263.90	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,489	8.508	259,400.41	

HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,215	15.155	215,428.32	
HSBC HOLDINGS PLC	1,730,928	4.957	8,580,210.09	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,193	20.620	1,612,339.66	
INFORMA PLC	127,322	6.050	770,298.10	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,206	47.620	771,729.72	
INTERTEK GROUP PLC	14,127	39.370	556,179.99	
JD SPORTS FASHION PLC	218,145	1.156	252,175.62	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,955	21.150	337,448.25	
KINGFISHER PLC	166,908	2.272	379,214.97	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	518,094	2.471	1,280,210.27	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,905,568	0.450	2,657,505.60	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	28,615	71.340	2,041,394.10	
M&G PLC	224,948	1.827	410,979.99	
MELROSE INDUSTRIES PLC	356,390	1.280	456,179.20	
MONDI PLC/WI	41,966	14.095	591,510.77	
NATIONAL GRID PLC	317,946	9.964	3,168,013.94	
NATWEST GROUP PLC	459,510	2.593	1,191,509.43	
NEXT PLC	11,073	55.300	612,336.90	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	49,999	6.340	316,993.66	
PEARSON PLC	57,553	9.242	531,904.82	
PERSIMMON PLC	27,565	12.090	333,260.85	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	69,831	5.984	417,868.70	
PRUDENTIAL PLC	237,619	10.550	2,506,880.45	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,116	57.480	3,570,427.68	
RELX PLC	166,408	22.970	3,822,391.76	
RENTOKIL INITIAL PLC	217,379	5.148	1,119,067.09	
RIO TINTO PLC	97,199	56.090	5,451,891.91	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	732,590	0.888	650,539.92	
SAGE GROUP PLC	88,652	7.712	683,684.22	
SAINSBURY (J) PLC	147,359	2.201	324,337.15	
SCHRODERS PLC	62,921	4.392	276,349.03	
SEVERN TRENT PLC	22,097	26.850	593,304.45	
SHELL PLC-NEW	629,031	22.870	14,385,938.97	
SMITH & NEPHEW PLC	75,547	10.785	814,774.39	
SMITHS GROUP PLC	31,514	15.810	498,236.34	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,373	107.350	684,141.55	
SSE PLC	92,492	16.890	1,562,189.88	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,186	10.915	525,950.19	
STANDARD CHARTERED PLC	216,639	6.172	1,337,095.90	
TAYLOR WIMPEY PLC	306,756	0.997	305,835.73	
TESCO PLC	644,589	2.237	1,441,945.59	

	UNILEVER PLC	220,703	41.735	9,211,039.70	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	59,742	10.215	610,264.53	
	VODAFONE GROUP PLC	2,310,016	0.842	1,945,033.47	
	WHITBREAD PLC	17,286	26.000	449,436.00	
	WPP PLC	94,644	8.000	757,152.00	
イギリス・ポンド　小計		24,462,294		153,183,453.10 (25,034,771,740)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	3,677	244.300	898,291.10	
	BANK HAPOALIM BM	109,931	31.050	3,413,357.55	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	133,756	29.220	3,908,350.32	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	182,644	5.988	1,093,672.27	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,315	584.300	1,352,654.50	
	ICL GROUP LTD	61,345	26.130	1,602,944.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	106,584	18.690	1,992,054.96	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,561	113.600	1,540,529.60	
	NICE LTD	5,507	682.500	3,758,527.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	9,593	157.300	1,508,978.90	
イスラエル・シュケル　小計		628,913		21,069,361.55 (819,872,066)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	22,702	28.010	635,883.02	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	53,546	32.300	1,729,535.80	
	ASX LTD	18,240	67.200	1,225,728.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	199,691	3.780	754,831.98	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	264,885	23.720	6,283,072.20	
	BHP GROUP LIMITED	440,595	45.990	20,262,964.05	
	BLUESCOPE STEEL LTD	43,320	17.160	743,371.20	
	BRAMBLES LTD	129,201	12.200	1,576,252.20	
	COCHLEAR LTD	6,100	203.380	1,240,618.00	
	COLES GROUP LTD	121,996	16.920	2,064,172.32	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	148,481	105.630	15,684,048.03	
	COMPUTERSHARE LIMITED	49,525	26.400	1,307,460.00	
	CSL LIMITED	42,104	288.410	12,143,214.64	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	124,139	6.470	803,179.33	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,328	20.230	3,000,675.44	
	IDP EDUCATION LTD	19,296	27.810	536,621.76	
	IGO LTD	60,822	14.070	855,765.54	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	230,642	4.640	1,070,178.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	39,829	28.800	1,147,075.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	211,437	4.560	964,152.72	
	MACQUARIE GROUP LTD	32,565	168.770	5,495,995.05	

	MEDIBANK PRIVATE LTD	259,889	2.930	761,474.77	
	MINERAL RESOURCES LTD	15,141	81.720	1,237,322.52	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	279,354	30.260	8,453,252.04	
	NEWCREST MINING LIMITED	81,175	20.590	1,671,393.25	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	105,140	11.020	1,158,642.80	
	ORICA LTD	43,294	15.260	660,666.44	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	157,823	7.100	1,120,543.30	
	PILBARA MINERALS LTD	222,508	4.030	896,707.24	
	QANTAS AIRWAYS LTD	86,875	6.220	540,362.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	134,717	13.030	1,755,362.51	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	17,167	65.550	1,125,296.85	
	REA GROUP LTD	5,177	118.020	610,989.54	
	REECE LTD	22,550	14.080	317,504.00	
	RIO TINTO LTD	32,799	114.630	3,759,749.37	
	SANTOS LTD	287,585	7.220	2,076,363.70	
	SEEK LTD	32,128	21.510	691,073.28	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,805	30.760	1,285,921.80	
	SOUTH32 LTD	412,048	4.130	1,701,758.24	
	SUNCORP GROUP LTD	118,360	11.780	1,394,280.80	
	TELSTRA GROUP LTD	406,709	4.050	1,647,171.45	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	68,685	13.720	942,358.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	21,479	27.500	590,672.50	
	WESFARMERS LIMITED	100,852	46.950	4,735,001.40	
	WESTPAC BANKING CORP	308,010	23.250	7,161,232.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,321	54.800	729,990.80	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	166,040	35.750	5,935,930.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	108,114	34.410	3,720,202.74	
	XERO LTD	12,494	73.200	914,560.80	
オーストラリア・ドル　小計		5,968,683		137,120,580.70 (12,355,935,527)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	39,411	68.640	2,705,171.04	
	AIR CANADA	16,023	18.850	302,033.55	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	60,911	9.100	554,290.10	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	70,803	61.310	4,340,931.93	
	ALTAGAS LTD	25,227	22.670	571,896.09	
	ARC RESOURCES LTD	56,706	17.400	986,684.40	
	BANK OF MONTREAL	58,221	120.090	6,991,759.89	
	BANK OF NOVA SCOTIA	103,936	64.480	6,701,793.28	
	BARRICK GOLD CORP	152,743	22.580	3,448,936.94	
	BCE INC	7,610	59.670	454,088.70	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	30,525	38.220	1,166,665.50	

BROOKFIELD CORPORATION-A	122,100	42.850	5,231,985.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,480	39.810	457,018.80	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,159	102.670	324,334.53	
CAE INC	27,579	26.650	734,980.35	
CAMECO CORP	37,352	29.220	1,091,425.44	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	78,496	54.350	4,266,257.60	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	51,450	163.620	8,418,249.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	97,117	72.590	7,049,723.03	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	81,537	101.620	8,285,789.94	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,863	141.310	687,190.53	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	12,119	36.750	445,373.25	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,082	58.000	758,756.00	
CENOVUS ENERGY INC	120,292	24.360	2,930,313.12	
CGI INC	18,444	116.260	2,144,299.44	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,750	2,121.710	3,712,992.50	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	7,444	93.500	696,014.00	
DOLLARAMA INC	24,071	80.130	1,928,809.23	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	34,784	18.330	637,590.72	
EMERA INC	23,870	51.680	1,233,601.60	
EMPIRE CO LTD 'A'	13,980	35.550	496,989.00	
ENBRIDGE INC	176,421	51.760	9,131,550.96	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,006	796.230	1,597,237.38	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,767	27.530	1,397,615.51	
FIRSTSERVICE CORP	3,531	164.270	580,037.37	
FORTIS INC	42,819	54.340	2,326,784.46	
FRANCO-NEVADA CORP	16,576	180.040	2,984,343.04	
GEORGE WESTON LTD	6,211	173.180	1,075,620.98	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	16,515	38.210	631,038.15	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,827	36.690	580,692.63	
GREAT-WEST LIFECO INC	25,321	30.230	765,453.83	
HYDRO ONE LTD	30,015	35.960	1,079,339.40	
IA FINANCIAL CORP INC	9,215	77.090	710,384.35	
IGM FINANCIAL INC	7,496	36.950	276,977.20	
IMPERIAL OIL LTD	19,347	63.990	1,238,014.53	
INTACT FINANCIAL CORP	15,308	196.050	3,001,133.40	
IVANHOE MINES LTD-CL A	52,346	11.390	596,220.94	
KEYERA CORP	19,692	28.430	559,843.56	

	KINROSS GOLD CORP	110,406	5.510	608,337.06	
	LOBLAW COS LTD	14,106	122.810	1,732,357.86	
	LUNDIN MINING CORP	56,400	8.400	473,760.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,924	77.920	1,864,158.08	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	166,111	23.910	3,971,714.01	
	METRO INC	20,826	76.540	1,594,022.04	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,264	91.230	2,669,754.72	
	NORTHLAND POWER INC	20,930	38.740	810,828.20	
	NUTRIEN LTD	46,657	99.490	4,641,904.93	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,669	34.890	197,791.41	
	ONEX CORPORATION	6,234	64.060	399,350.04	
	OPEN TEXT CORP	23,585	39.090	921,937.65	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,452	21.420	395,241.84	
	PARKLAND CORP	14,201	28.860	409,840.86	
	PEMBINA PIPELINE CORP	48,566	44.390	2,155,844.74	
	POWER CORP OF CANADA	48,260	32.330	1,560,245.80	
	QUEBECOR INC -CL B	13,982	27.510	384,644.82	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	25,390	88.560	2,248,538.40	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,700	74.450	722,165.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	31,334	59.640	1,868,759.76	
	ROYAL BANK OF CANADA	120,849	126.760	15,318,819.24	
	SAPUTO INC	22,011	33.800	743,971.80	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,019	36.230	1,522,348.37	
	SHOPIFY INC - CLASS A	102,785	48.470	4,981,988.95	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	51,246	61.910	3,172,639.86	
	SUNCOR ENERGY INC	118,343	40.600	4,804,725.80	
	TC ENERGY CORP	88,028	54.310	4,780,800.68	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	41,121	49.860	2,050,293.06	
	TFI INTERNATIONAL INC	7,172	139.980	1,003,936.56	
	THOMSON REUTERS CORP	14,937	152.600	2,279,386.20	
	TMX GROUP LTD	5,015	133.480	669,402.20	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,268	97.310	707,249.08	
	TORONTO-DOMINION BANK	157,794	86.610	13,666,538.34	
	TOURMALINE OIL CORP	27,512	71.000	1,953,352.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,073	98.170	498,016.41	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	38,946	52.290	2,036,486.34	
	WSP GLOBAL INC	10,791	155.160	1,674,331.56	
カナダ・ドル　小計		3,511,405		199,783,715.86 (19,690,683,035)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,700	3.650	816,505.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	35,600	8.180	291,208.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	156,900	34.110	5,351,859.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	537,900	0.945	508,315.50	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,600	28.480	244,928.00	
	KEPPEL CORP LTD	131,000	7.310	957,610.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	294,200	12.210	3,592,182.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	116,600	5.580	650,628.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	75,200	8.980	675,296.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	140,900	3.380	476,242.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	725,000	2.600	1,885,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,300	30.960	3,167,208.00	
	UOL Group Limited	43,700	6.720	293,664.00	
	VENTURE CORP LTD	24,400	17.140	418,216.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	166,600	4.140	689,724.00	
シンガポール・ドル　小計		2,782,600		20,018,585.50 (1,985,443,310)	
スイス・フラン	ABB LTD	136,187	28.180	3,837,749.66	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,880	30.020	416,677.60	
	ALCON INC	43,303	62.580	2,709,901.74	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	2,850	83.150	236,977.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,028	139.200	560,697.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,806	89.150	250,154.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	314	1,830.000	574,620.00	
	BKW AG	1,866	126.200	235,489.20	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	88	9,430.000	829,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	94,400.000	944,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	45,260	118.100	5,345,206.00	
	CLARIANT AG	18,938	14.790	280,093.02	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	233,333	2.779	648,432.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	599	625.000	374,375.00	
	GEBERIT AG-REG	3,093	432.600	1,338,031.80	
	GIVAUDAN-REG	800	2,857.000	2,285,600.00	
	HOLCIM LTD	48,238	47.290	2,281,175.02	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,564	53.160	986,862.24	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,736	212.900	1,008,294.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,910	54.920	818,857.20	
	LONZA GROUP AG	6,444	444.600	2,865,002.40	
	NESTLE SA	238,287	107.920	25,715,933.04	
	NOVARTIS AG	187,443	84.140	15,771,454.02	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,947	820.600	1,597,708.20	
	ROCHE HOLDING AG	60,827	300.300	18,266,348.10	

	ROCHE HOLDING AG-BR	2,333	368.800	860,410.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,349	164.600	386,645.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,258	173.150	564,122.70	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	551	2,133.000	1,175,283.00	
	SIG GROUP AG	26,690	20.520	547,678.80	
	SIKA AG-BEARER	12,643	225.200	2,847,203.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,612	216.200	997,114.40	
	STRAUMANN HOLDING AG	9,584	102.450	981,880.80	
	SWATCH GROUP AG	2,209	254.400	561,969.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,674	471.700	1,261,325.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,784	78.950	535,596.80	
	SWISS RE AG	26,289	84.520	2,221,946.28	
	SWISSCOM AG	2,266	498.300	1,129,147.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	5,497	51.400	282,545.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,247	46.740	291,984.78	
	UBS GROUP AG	289,804	16.755	4,855,666.02	
	VAT GROUP AG	2,279	261.200	595,274.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,045	438.500	5,720,232.50	
スイス・フラン　小計		1,507,865		115,995,510.32 (16,782,230,433)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	25,007	300.000	7,502,100.00	
	ASSA ABLOY AB	87,389	229.600	20,064,514.40	
	ATLAS COPCO AB	136,387	114.660	15,638,133.42	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	231,129	126.520	29,242,441.08	
	BIOVITRUM	14,788	220.200	3,256,317.60	
	BOLIDEN AB	23,572	393.350	9,272,046.20	
	ELECTROLUX AB	19,243	140.000	2,694,020.00	
	EMBRACER GROUP AB	56,592	47.360	2,680,197.12	
	EPIROC AB-A	56,197	192.300	10,806,683.10	
	EPIROC AB-B	34,671	169.850	5,888,869.35	
	EQT AB	25,492	215.900	5,503,722.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	53,123	276.000	14,661,948.00	
	EVOLUTION AB	15,802	991.500	15,667,683.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	52,398	47.100	2,467,945.80	
	GETINGE AB-B SHS	19,459	213.800	4,160,334.20	
	HENNES & MAURITZ AB	63,441	111.960	7,102,854.36	
	HEXAGON AB-B SHS	168,612	112.850	19,027,864.20	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,192	413.900	3,390,668.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,535	72.880	2,589,790.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,203	254.000	1,575,562.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	19,406	254.000	4,929,124.00	
	INDUTRADE AB	22,907	213.300	4,886,063.10	

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	12,510	194.700	2,435,697.00	
	INVESTOR AB	156,284	188.920	29,525,173.28	
	INVESTOR AB-A SHS	45,421	195.550	8,882,076.55	
	KINNEVIK AB - B	20,469	142.250	2,911,715.25	
	LIFCO AB-B SHS	19,843	172.900	3,430,854.70	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,644	444.200	2,951,264.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	130,987	98.400	12,889,120.80	
	NORDEA BANK ABP	291,969	107.580	31,410,025.02	
	SAGAX AB-B	16,055	227.600	3,654,118.00	
	SANDVIK AB	92,194	188.600	17,387,788.40	
	SECURITAS AB	42,368	83.540	3,539,422.72	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	140,249	117.950	16,542,369.55	
	SKANSKA AB-B SHS	29,799	163.250	4,864,686.75	
	SKF AB	33,157	160.100	5,308,435.70	
	SVENSKA CELLULOSA AB	52,716	133.200	7,021,771.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	127,467	103.350	13,173,714.45	
	SWEDBANK AB - A SHARES	78,448	173.000	13,571,504.00	
	TELE2 AB	51,329	85.260	4,376,310.54	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	252,909	61.260	15,493,205.34	
	TELIA CO AB	239,772	26.330	6,313,196.76	
	VOLVO AB	127,289	190.000	24,184,910.00	
	VOLVO AB-A SHS	20,628	200.200	4,129,725.60	
	VOLVO CAR AB-B	51,142	46.850	2,396,002.70	
スウェーデン・クローナ　小計		3,215,194		429,401,972.44 (5,556,461,523)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	427	14,825.000	6,330,275.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	289	14,590.000	4,216,510.00	
	CARLSBERG AS-B	8,366	911.400	7,624,772.40	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,180	512.200	4,701,996.00	
	COLOPLAST-B	10,262	817.200	8,386,106.40	
	DANSKE BANK A/S	59,915	130.200	7,800,933.00	
	DEMANT A/S	7,621	180.650	1,376,733.65	
	DSV A/S	16,519	1,088.500	17,980,931.50	
	GENMAB A/S	5,694	3,034.000	17,275,596.00	
	NOVO-NORDISK A/S	143,343	916.000	131,302,188.00	
	NOVOZYMES A/S	17,610	358.300	6,309,663.00	
	ORSTED A/S	16,298	628.000	10,235,144.00	
	PANDORA A/S	7,628	492.800	3,759,078.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	745	1,540.500	1,147,672.50	
	TRYGVESTA AS	31,778	162.750	5,171,869.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	87,499	196.840	17,223,303.16	
デンマーク・クローネ　小計		423,174		250,842,772.51 (4,808,655,949)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	119,484	8.030	959,456.52	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	50,109	22.000	1,102,398.00	
	MERCURY NZ LTD	63,181	5.595	353,497.69	
	MERIDIAN ENERGY LTD	115,394	5.180	597,740.92	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	171,855	5.270	905,675.85	
ニュージーランド・ドル　小計		520,023		3,918,768.98 (334,623,683)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	25,762	67.400	1,736,358.80	
	AKER BP ASA	27,436	300.000	8,230,800.00	
	DNB BANK ASA	81,592	186.900	15,249,544.80	
	EQUINOR ASA	82,310	361.650	29,767,411.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,901	192.500	3,445,942.50	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,758	407.800	3,163,712.40	
	MOWI ASA	35,722	160.150	5,720,878.30	
	NORSK HYDRO ASA	116,182	70.000	8,132,740.00	
	ORKLA ASA	66,435	70.540	4,686,324.90	
	SALMAR ASA	5,605	359.200	2,013,316.00	
	TELENOR ASA	64,219	89.700	5,760,444.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,430	425.100	6,134,193.00	
ノルウェー・クローネ　小計		545,352		94,041,666.50 (1,277,085,831)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	34,811	12.610	438,966.71	
	ACCIONA SA	2,098	174.300	365,681.40	
	ACCOR	14,774	23.940	353,689.56	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,392	26.130	506,712.96	
	ADIDAS AG	14,992	121.180	1,816,730.56	
	ADP	2,931	124.750	365,642.25	
	ADYEN NV	1,877	1,335.000	2,505,795.00	
	AEGON NV	152,383	4.683	713,609.58	
	AENA SME SA	6,983	121.100	845,641.30	
	AGEAS	13,949	41.300	576,093.70	
	AIB GROUP PLC	90,821	3.362	305,340.20	
	AIR LIQUIDE	45,410	133.100	6,044,071.00	
	AIRBUS SE	51,181	110.940	5,678,020.14	
	AKZO NOBEL NV	15,734	63.080	992,500.72	
	ALLIANZ SE	35,405	199.320	7,056,924.60	
	ALSTOM RGPT	27,802	23.080	641,670.16	
	AMADEUS IT GROUP SA	38,948	50.600	1,970,768.80	
	AMPLIFON SPA	10,778	26.910	290,035.98	
	AMUNDI SA	5,243	52.050	272,898.15	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	75,355	56.220	4,236,458.10	
	ARCELORMITTAL	44,398	24.040	1,067,327.92	
	ARGENX SE	4,794	355.700	1,705,225.80	
	ARKEMA	4,977	84.620	421,153.74	
	AROUNDTOWN SA	89,248	2.339	208,751.07	

ASM INTERNATIONAL NV	4,044	247.950	1,002,709.80	
ASML HOLDING NV	35,220	537.300	18,923,706.00	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	95,722	16.685	1,597,121.57	
AXA SA	161,386	26.260	4,237,996.36	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	521,830	5.404	2,819,969.32	
BANCO SANTANDER SA	1,445,600	2.717	3,927,695.20	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	92,221	8.362	771,152.00	
BASF SE	79,496	45.520	3,618,657.92	
BAYER AG	85,159	48.805	4,156,184.99	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,567	83.620	2,388,772.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,058	79.800	403,628.40	
BECHTLE AG	7,010	33.330	233,643.30	
BEIERSDORF AG	8,805	106.450	937,292.25	
BIOMERIEUX	3,620	95.620	346,144.40	
BNP PARIBAS	96,040	52.200	5,013,288.00	
BOLLORE SE	77,796	5.210	405,317.16	
BOUYGUES	20,197	27.930	564,102.21	
BRENNTAG SE	13,373	57.000	762,261.00	
BUREAU VERITAS SA	25,663	24.470	627,973.61	
CAIXABANK	382,469	3.532	1,350,880.50	
CAPGEMINI SA	14,144	157.500	2,227,680.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,449	116.050	400,256.45	
CARREFOUR SA	51,124	15.730	804,180.52	
CELLNEX TELECOM SAU	47,215	31.340	1,479,718.10	
CIE DE SAINT-GOBAIN	42,647	44.625	1,903,122.37	
CNH INDUSTRIAL NV	88,555	14.970	1,325,668.35	
COMMERZBANK AG	91,224	8.224	750,226.17	
CONTINENTAL AG	9,490	55.680	528,403.20	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,614	37.260	209,177.64	
COVESTRO AG	16,429	36.110	593,251.19	
CREDIT AGRICOLE SA	105,284	9.449	994,828.51	
CRH PLC	65,298	37.015	2,417,005.47	
D'IETEREN GROUP	2,134	175.700	374,943.80	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,044	30.150	1,177,176.60	
DANONE	55,667	49.560	2,758,856.52	
DASSAULT AVIATION SA	2,152	160.200	344,750.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	57,677	34.090	1,966,208.93	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	45,202	9.852	445,330.10	
DELIVERY HERO SE	14,856	42.650	633,608.40	
DEUTSCHE BANK AG	178,686	9.938	1,775,781.46	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,529	164.600	2,720,673.40	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	51,350	8.061	413,932.35	

DEUTSCHE POST AG	86,645	34.815	3,016,545.67	
DEUTSCHE TELEKOM AG	282,096	18.946	5,344,590.81	
DIASORIN ITALIA SPA	2,185	128.150	280,007.75	
DR ING HC F PORSCHE AG	9,882	96.880	957,368.16	
E.ON SE	194,610	9.086	1,768,226.46	
EDENRED	21,784	50.840	1,107,498.56	
EDF	50,931	12.000	611,172.00	
EDP RENOVAVEIS SA	24,431	21.530	525,999.43	
EIFFAGE	7,321	92.300	675,728.30	
ELIA GROUP SA/NV	2,925	135.200	395,460.00	
ELISA OYJ	12,591	49.390	621,869.49	
ENAGAS SA	21,440	15.970	342,396.80	
ENDESA SA	27,553	17.495	482,039.73	
ENEL SPA	705,639	5.046	3,560,654.39	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	241,615	4.634	1,119,643.91	
ENGIE	158,369	13.954	2,209,881.02	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	215,808	12.990	2,803,345.92	
ERSTE GROUP BANK AG	29,954	28.560	855,486.24	
ESSILORLUXOTTICA	25,195	171.750	4,327,241.25	
EURAZEO	3,790	57.700	218,683.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,611	63.740	740,085.14	
EURONEXT NV	7,553	69.100	521,912.30	
EVONIK INDUSTRIES AG	18,165	17.700	321,520.50	
EXOR NV	9,607	69.280	665,572.96	
FERRARI NV	10,947	204.900	2,243,040.30	
FERROVIAL S.A.	43,166	24.500	1,057,567.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	189,117	13.474	2,548,162.45	
FINECOBANK SPA	52,629	14.875	782,856.37	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	14,470	131.050	1,896,293.50	
FORTUM OYJ	38,628	15.155	585,407.34	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	17,912	29.520	528,762.24	
FRESENIUS SE & CO KGAA	36,578	25.790	943,346.62	
GALP ENERGIA SGPS SA	44,181	11.940	527,521.14	
GEA GROUP AG	13,100	39.060	511,686.00	
GETLINK SE - REGR	41,031	15.005	615,670.15	
GRIFOLS SA	25,819	10.170	262,579.23	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,088	74.460	676,692.48	
HANNOVER RUECK SE	5,246	182.700	958,444.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,368	52.340	647,341.12	
HEINEKEN HOLDING NV	8,734	72.400	632,341.60	
HEINEKEN NV	22,461	88.280	1,982,857.08	
HELLOFRESH SE	14,078	21.080	296,764.24	
HENKEL AG & CO KGAA	9,898	61.450	608,232.10	
HENKEL KGAA-VORZUG	14,813	66.200	980,620.60	

HERMES INTERNATIONAL	2,744	1,478.500	4,057,004.00	
IBERDROLA SA	523,141	10.780	5,639,459.98	
IMCD NV	4,883	137.600	671,900.80	
INDITEX SA	94,278	24.510	2,310,753.78	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	113,082	29.415	3,326,307.03	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	31,685	9.368	296,825.08	
ING GROEP NV-CVA	325,629	11.262	3,667,233.79	
INTESA SANPAOLO	1,446,399	2.034	2,941,975.56	
IPSEN	3,227	98.500	317,859.50	
JDE PEET'S BV	8,818	27.700	244,258.60	
JERONIMO MARTINS	24,242	20.320	492,597.44	
JUST EAT TAKEAWAY	16,138	20.410	329,376.58	
KBC GROEP NV	21,483	57.400	1,233,124.20	
KERING	6,487	485.850	3,151,708.95	
KERRY GROUP PLC-A	13,786	86.360	1,190,558.96	
KESKO OYJ-B SHS	23,193	20.500	475,456.50	
KINGSPAN GROUP PLC	13,302	50.320	669,356.64	
KNORR-BREMSE AG	6,275	52.400	328,810.00	
KONE OYJ	29,479	47.870	1,411,159.73	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,850	27.280	2,451,108.00	
KONINKLIJKE DSM NV	15,109	116.350	1,757,932.15	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,073	12.768	984,068.06	
L'OREAL SA	20,905	335.050	7,004,220.25	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,994	37.870	340,602.78	
LEG IMMOBILIEN SE	6,379	59.840	381,719.36	
LEGRAND SA	23,118	76.640	1,771,763.52	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,980	687.300	16,481,454.00	
MEDIOBANCA SPA	53,448	8.936	477,611.32	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	69,330	62.630	4,342,137.90	
MERCK KGAA	11,163	179.350	2,002,084.05	
MICHELIN (C.G.D.E.)	58,637	25.900	1,518,698.30	
MONCLER SPA	17,756	48.530	861,698.68	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,633	203.900	944,668.70	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	12,132	299.400	3,632,320.80	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,630	25.540	322,570.20	
NEMETSCHEK SE	4,922	47.830	235,419.26	
NESTE OYJ	36,498	45.390	1,656,644.22	
NEXI SPA	51,110	7.530	384,858.30	
NN GROUP NV	23,933	41.170	985,321.61	
NOKIA OYJ	467,723	4.368	2,043,014.06	
OCI NV	9,276	34.560	320,578.56	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	5,930	80.250	475,882.50	

OMV AG	12,645	46.660	590,015.70	
ORANGE S.A.	175,603	9.225	1,619,937.67	
ORION OYJ-CLASS B	9,203	51.740	476,163.22	
PERNOD-RICARD	17,883	183.150	3,275,271.45	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	13,136	51.780	680,182.08	
POSTE ITALIANE SPA	47,608	9.056	431,138.04	
PROSUS	71,877	63.950	4,596,534.15	
PRYSMIAN SPA	22,163	35.260	781,467.38	
PUBLICIS GROUPE	19,656	59.420	1,167,959.52	
PUMA AG	9,180	51.640	474,055.20	
QIAGEN NV	19,772	46.350	916,432.20	
RANDSTAD NV	10,159	56.240	571,342.16	
RATIONAL AG	443	562.500	249,187.50	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	9,073	39.220	355,843.06	
RED ELECTRICA DE ESPANA	34,554	16.695	576,879.03	
REMY COINTREAU	2,004	159.800	320,239.20	
RENAULT SA	16,705	32.920	549,928.60	
REPSOL SA	118,514	14.220	1,685,269.08	
RHEINMETALL AG	3,761	185.750	698,605.75	
ROYAL KPN NV	293,053	2.916	854,542.54	
RWE AG	55,671	41.570	2,314,243.47	
SAFRAN SA	29,732	116.580	3,466,156.56	
SAMPO OYJ	41,351	48.740	2,015,447.74	
SANOFI	98,865	88.760	8,775,257.40	
SAP SE	90,435	98.890	8,943,117.15	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,101	339.500	713,289.50	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,396	297.300	712,330.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,964	131.960	6,197,369.44	
SCOUT24 SE	7,104	47.500	337,440.00	
SEB SA	2,189	76.800	168,115.20	
SIEMENS AG	66,262	128.020	8,482,861.24	
SIEMENS ENERGY AG	37,861	16.910	640,229.51	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	20,802	17.985	374,123.97	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,392	47.340	1,154,717.28	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	21,253	35.210	748,318.13	
SNAM SPA	175,890	4.666	820,702.74	
SOCIETE GENERALE	69,368	22.390	1,553,149.52	
SODEXO	7,670	92.160	706,867.20	
SOFINA	1,346	206.800	278,352.80	
SOLVAY SA	6,398	93.640	599,108.72	
STMICROELECTRONICS NV	59,158	34.650	2,049,824.70	
STORA ENSO OYJ	47,336	13.200	624,835.20	
SYMRISE AG	11,556	104.650	1,209,335.40	
TELECOM ITALIA SPA	894,546	0.211	188,749.20	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	97,121	2.287	222,115.72	

	TELEFONICA SA	454,676	3.290	1,495,884.04	
	TELEPERFORMANCE	5,096	214.900	1,095,130.40	
	TENARIS SA	40,485	15.710	636,019.35	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	122,299	7.184	878,596.01	
	THALES SA	9,222	119.600	1,102,951.20	
	TOTALENERGIES SE	215,376	56.650	12,201,050.40	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	8,188	25.870	211,823.56	
	UCB SA	10,897	74.200	808,557.40	
	UMICORE	18,090	34.800	629,532.00	
	UNICREDIT SPA	165,966	12.686	2,105,444.67	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,592	18.710	160,756.32	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	62,839	22.325	1,402,880.67	
	UPM-KYMMENE OYJ	46,167	35.130	1,621,846.71	
	VALEO SA	18,169	17.340	315,050.46	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,659	24.170	1,393,618.03	
	VINCI SA	46,836	92.860	4,349,190.96	
	VIVENDI SA	61,751	8.732	539,209.73	
	VOESTALPINE AG	9,763	24.260	236,850.38	
	VOLKSWAGEN AG	2,612	156.300	408,255.60	
	VOLKSWAGEN AG	16,069	121.980	1,960,096.62	
	VONOVIA SE	62,167	21.480	1,335,347.16	
	WARTSILA OYJ	40,996	8.074	331,001.70	
	WENDEL	2,406	86.750	208,720.50	
	WOLTERS KLUWER NV	22,684	100.750	2,285,413.00	
	WORLDLINE SA	20,803	37.330	776,575.99	
	ZALANDO SE	19,313	31.640	611,063.32	
ユーロ　小計		15,979,974		369,872,123.41 (52,758,559,683)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,034,675	83.550	86,447,096.25	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	323,039	26.200	8,463,621.80	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	150,300	24.750	3,719,925.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	173,909	46.350	8,060,682.15	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	234,909	45.250	10,629,632.25	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	57,000	39.850	2,271,450.00	
	CLP HOLDINGS LTD	144,643	55.900	8,085,543.70	
	ESR GROUP LIMITED	176,600	16.620	2,935,092.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,810	50.150	9,518,971.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	180,157	15.100	2,720,370.70	
	HANG SENG BANK LTD	67,212	127.000	8,535,924.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	132,641	26.600	3,528,250.60	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,005,437	7.330	7,369,853.21	

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,411	329.600	34,413,865.60	
	MTR CORP	146,255	40.150	5,872,138.25	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	141,917	21.900	3,107,982.30	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	122,587	41.750	5,118,007.25	
	SANDS CHINA LTD	212,180	24.900	5,283,282.00	
	SINO LAND CO	314,000	9.830	3,086,620.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	122,000	18.560	2,264,320.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	127,023	105.100	13,350,117.30	
	SWIRE PACIFIC LTD	43,366	65.500	2,840,473.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	109,400	19.480	2,131,112.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	88.100	10,483,900.00	
	WH GROUP LTD	721,500	4.490	3,239,535.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	146,733	45.200	6,632,331.60	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	155,000	14.380	2,228,900.00	
香港・ドル　小計		6,455,704		262,338,997.46 (4,535,841,266)	
合計		95,566,764		530,189,806,408 (530,189,806,408)	

（２）株式以外の有価証券

2022年12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,390.00	1,929,632.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	27,257.00	826,159.67	
		AMERICAN TOWER REIT INC	40,331.00	8,454,184.22	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	40,542.00	866,787.96	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,012.00	1,948,586.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,945.00	861,101.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,676.00	957,743.64	
		CROWN CASTLE INC	37,544.00	5,001,236.24	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,829.00	2,467,754.31	
		EQUINIX INC	7,897.00	5,197,726.43	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,264.00	969,111.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	30,680.00	1,830,062.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,624.00	1,172,997.68	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,551.00	1,694,647.21	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,199.00	1,148,132.28	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	32,979.00	609,451.92	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,297.00	1,152,795.30	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	61,710.00	1,035,493.80	
	INVITATION HOMES INC	52,919.00	1,574,340.25	
	IRON MOUNTAIN INC	25,168.00	1,263,685.28	
	KIMCO REALTY CORP	52,844.00	1,108,667.12	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	51,724.00	565,343.32	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,889.00	1,535,860.59	
	PROLOGIS INC	79,896.00	8,953,944.72	
	PUBLIC STORAGE	13,643.00	3,880,478.49	
	REALTY INCOME CORP	53,482.00	3,398,246.28	
	REGENCY CENTERS CORP	13,193.00	822,319.69	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,364.00	2,598,135.44	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,303.00	3,272,392.86	
	SUN COMMUNITIES INC	10,703.00	1,503,450.41	
	UDR INC	28,141.00	1,082,021.45	
	VENTAS INC	34,549.00	1,539,157.95	
	VICI PROPERTIES INC	83,705.00	2,768,961.40	
	WELLTOWER INC	40,211.00	2,561,440.70	
	WP CAREY INC	16,667.00	1,333,693.34	
アメリカ・ドル　小計		1,056,128.00	77,885,744.25 (10,478,748,033)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	74,543.00	289,599.55	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	60,949.00	375,202.04	
	SEGRO PLC	102,295.00	782,352.16	
イギリス・ポンド　小計		237,787.00	1,447,153.75 (236,508,337)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	106,401.00	854,400.03	
	GOODMAN GROUP	150,506.00	2,695,562.46	
	GPT GROUP	186,828.00	810,833.52	
	MIRVAC GROUP	378,070.00	827,973.30	
	SCENTRE GROUP	483,270.00	1,396,650.30	
	STOCKLAND	227,957.00	875,354.88	
	VICINITY CENTRES	367,764.00	731,850.36	
オーストラリア・ドル　小計		1,900,796.00	8,192,624.85 (738,237,425)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,538.00	313,128.52	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,208.00	270,631.92	
カナダ・ドル　小計		20,746.00	583,760.44 (57,535,429)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	295,300.00	794,357.00	

		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	459,290.00	923,172.90	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	288,400.00	458,556.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	204,700.00	335,708.00	
	シンガポール・ドル　小計		1,247,690.00	2,511,793.90 (249,119,719)	
	ユーロ	COVIVIO	3,886.00	212,369.90	
		GECINA SA	3,853.00	364,301.15	
		KLEPIERRE	18,422.00	401,599.60	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,139.00	507,761.12	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,308.00	349,468.08	
	ユーロ　小計		49,608.00	1,835,499.85 (261,815,699)	
	香港・ドル	LINK REIT	183,571.00	10,160,654.85	
	香港・ドル　小計		183,571.00	10,160,654.85 (175,677,722)	
投資証券　合計			4,696,326	12,197,642,364 (12,197,642,364)	
合計				12,197,642,364 (12,197,642,364)	

（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	603銘柄	68.60	－	72.78
	投資証券	35銘柄	－	1.87	
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	4.47	－	4.66
	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	－	0.15
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.21	－	2.41
	投資証券	7銘柄	－	0.13	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.52	－	3.64
	投資証券	2銘柄	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.35	－	0.41
	投資証券	4銘柄	－	0.04	
スイス・フラン	株式	43銘柄	3.00	－	3.09
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	0.99	－	1.02
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.86	－	0.89
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.06	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.23	－	0.24
ユーロ	株式	223銘柄	9.42	－	9.78
	投資証券	5銘柄	－	0.05	
香港・ドル	株式	27銘柄	0.81	－	0.87
	投資証券	1銘柄	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,294,684
コール・ローン	607,019,013
国債証券	51,735,766,020
地方債証券	4,285,705,876
特殊債券	5,709,732,634
社債券	5,512,607,800
未収利息	99,217,260
前払費用	1,290,646
流動資産合計	67,957,633,933
資産合計	67,957,633,933
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,914,433
その他未払費用	794
流動負債合計	20,915,227
負債合計	20,915,227
純資産の部	
元本等	
元本	72,528,911,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△4,592,192,685
元本等合計	67,936,718,706
純資産合計	67,936,718,706
負債純資産合計	67,957,633,933

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	79,006,185,912円
	同期中追加設定元本額	9,426,921,381円
	同期中一部解約元本額	15,904,195,902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）	53,825,077,005円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	4,183,836,858円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	163,671,078円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	6,885,363,681円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	315,885,656円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	1,586,926,947円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	2,408,722,017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）	284,914,361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）	31,245,699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）	95,646,654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）	68,483,210円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	84,945,031円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	104,413,935円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	383,964,185円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	2,085,538,471円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	15,022,723円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	5,253,880円
	計	72,528,911,391円
２．	受益権の総数	72,528,911,391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4,592,192,685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12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△2,538,914,040
地方債証券	△121,800,334
特殊債券	△128,950,942
社債券	△56,065,000
合計	△2,845,730,316

（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12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9367円 (9,367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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第４３２回　利付国債（２年）	111,000,000	111,074,370	
	第４３３回　利付国債（２年）	114,000,000	114,069,540	
	第４３４回　利付国債（２年）	114,000,000	114,067,260	
	第４３５回　利付国債（２年）	102,000,000	102,058,140	
	第４３６回　利付国債（２年）	95,000,000	95,051,300	
	第４３７回　利付国債（２年）	106,000,000	106,045,580	
	第４３８回　利付国債（２年）	92,000,000	92,027,600	
	第４３９回　利付国債（２年）	200,000,000	200,048,000	
	第４４０回　利付国債（２年）	175,000,000	175,028,000	
	第４４１回　利付国債（２年）	400,000,000	400,032,000	
	第４４２回　利付国債（２年）	200,000,000	200,018,000	
	第１３９回　利付国債（５年）	53,000,000	53,088,510	
	第１４０回　利付国債（５年）	296,000,000	296,529,840	
	第１４１回　利付国債（５年）	377,000,000	377,689,910	
	第１４２回　利付国債（５年）	405,000,000	405,724,950	
	第１４３回　利付国債（５年）	377,000,000	377,716,300	
	第１４４回　利付国債（５年）	497,000,000	498,053,640	

第１４５回　利付国債（５年）	290,000,000	290,635,100	
第１４６回　利付国債（５年）	80,000,000	80,179,200	
第１４９回　利付国債（５年）	456,000,000	454,891,920	
第１５０回　利付国債（５年）	200,000,000	199,282,000	
第１５３回　利付国債（５年）	408,000,000	405,445,920	
第１回　利付国債（４０年）	95,000,000	114,534,850	
第２回　利付国債（４０年）	115,000,000	133,552,950	
第３回　利付国債（４０年）	118,000,000	137,429,880	
第４回　利付国債（４０年）	157,000,000	181,502,990	
第５回　利付国債（４０年）	159,000,000	176,594,940	
第６回　利付国債（４０年）	167,000,000	180,521,990	
第７回　利付国債（４０年）	183,000,000	188,976,780	
第８回　利付国債（４０年）	184,000,000	175,984,960	
第９回　利付国債（４０年）	232,000,000	161,755,040	
第１０回　利付国債（４０年）	211,000,000	173,338,610	
第１１回　利付国債（４０年）	174,000,000	137,665,320	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	74,708,800	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	118,869,100	
第１４回　利付国債（４０年）	236,000,000	176,596,440	
第１５回　利付国債（４０年）	106,000,000	86,497,060	
第３３３回　利付国債（１０年）	89,000,000	89,703,100	
第３３４回　利付国債（１０年）	387,000,000	390,587,490	
第３３５回　利付国債（１０年）	152,000,000	153,340,640	
第３３６回　利付国債（１０年）	205,000,000	207,004,900	
第３３７回　利付国債（１０年）	348,000,000	350,014,920	
第３３８回　利付国債（１０年）	519,000,000	523,478,970	
第３３９回　利付国債（１０年）	387,000,000	390,715,200	
第３４０回　利付国債（１０年）	470,000,000	474,902,100	
第３４１回　利付国債（１０年）	493,000,000	497,057,390	
第３４２回　利付国債（１０年）	423,000,000	423,888,300	
第３４３回　利付国債（１０年）	341,000,000	341,593,340	
第３４４回　利付国債（１０年）	334,000,000	334,374,080	
第３４５回　利付国債（１０年）	472,000,000	472,089,680	
第３４６回　利付国債（１０年）	328,000,000	327,721,200	
第３４７回　利付国債（１０年）	272,000,000	271,450,560	

第３４８回　利付国債（１０年）	338,000,000	336,884,600	
第３４９回　利付国債（１０年）	494,000,000	491,312,640	
第３５０回　利付国債（１０年）	637,000,000	632,216,130	
第３５１回　利付国債（１０年）	564,000,000	559,256,760	
第３５２回　利付国債（１０年）	370,000,000	366,540,500	
第３５３回　利付国債（１０年）	353,000,000	349,251,140	
第３５４回　利付国債（１０年）	333,000,000	329,017,320	
第３５５回　利付国債（１０年）	339,000,000	334,464,180	
第３５６回　利付国債（１０年）	380,000,000	374,353,200	
第３５７回　利付国債（１０年）	384,000,000	377,698,560	
第３５８回　利付国債（１０年）	384,000,000	376,285,440	
第３５９回　利付国債（１０年）	337,000,000	329,521,970	
第３６０回　利付国債（１０年）	297,000,000	289,975,950	
第３６１回　利付国債（１０年）	467,000,000	455,259,620	
第３６２回　利付国債（１０年）	466,000,000	453,753,520	
第３６３回　利付国債（１０年）	480,000,000	466,824,000	
第３６４回　利付国債（１０年）	598,000,000	581,112,480	
第３６５回　利付国債（１０年）	566,000,000	550,055,780	
第３６６回　利付国債（１０年）	244,000,000	240,720,640	
第３６７回　利付国債（１０年）	189,000,000	185,626,350	
第３６８回　利付国債（１０年）	381,000,000	373,498,110	
第１回　利付国債（３０年）	6,000,000	6,992,100	
第２回　利付国債（３０年）	66,000,000	75,486,180	
第３回　利付国債（３０年）	81,000,000	92,276,010	
第４回　利付国債（３０年）	40,000,000	47,726,800	
第５回　利付国債（３０年）	52,000,000	59,592,000	
第６回　利付国債（３０年）	39,000,000	45,714,240	
第７回　利付国債（３０年）	31,000,000	36,358,350	
第８回　利付国債（３０年）	63,000,000	71,144,010	
第９回　利付国債（３０年）	80,000,000	87,228,800	

第１０回　利付国債（３０年）	21,000,000	22,260,210	
第１１回　利付国債（３０年）	25,000,000	28,005,500	
第１２回　利付国債（３０年）	73,000,000	84,826,730	
第１３回　利付国債（３０年）	14,000,000	16,130,100	
第１４回　利付国債（３０年）	35,000,000	41,856,150	
第１５回　利付国債（３０年）	74,000,000	89,408,280	
第１６回　利付国債（３０年）	53,000,000	64,121,520	
第１７回　利付国債（３０年）	54,000,000	64,769,220	
第１８回　利付国債（３０年）	63,000,000	74,873,610	
第１９回　利付国債（３０年）	52,000,000	61,844,120	
第２０回　利付国債（３０年）	59,000,000	71,638,390	
第２１回　利付国債（３０年）	60,000,000	71,479,200	
第２２回　利付国債（３０年）	72,000,000	87,600,960	
第２３回　利付国債（３０年）	73,000,000	88,928,600	
第２４回　利付国債（３０年）	43,000,000	52,443,660	
第２５回　利付国債（３０年）	51,000,000	60,859,320	
第２６回　利付国債（３０年）	108,000,000	130,345,200	
第２７回　利付国債（３０年）	132,000,000	161,175,960	
第２８回　利付国債（３０年）	177,000,000	216,120,540	
第２９回　利付国債（３０年）	209,000,000	252,413,480	
第３０回　利付国債（３０年）	226,000,000	269,312,900	
第３１回　利付国債（３０年）	193,000,000	227,037,480	
第３２回　利付国債（３０年）	242,000,000	288,057,440	
第３３回　利付国債（３０年）	273,000,000	311,798,760	
第３４回　利付国債（３０年）	252,000,000	295,691,760	
第３５回　利付国債（３０年）	281,000,000	320,803,650	
第３６回　利付国債（３０年）	271,000,000	309,243,520	
第３７回　利付国債（３０年）	289,000,000	323,879,410	
第３８回　利付国債（３０年）	191,000,000	210,522,110	
第３９回　利付国債（３０年）	175,000,000	195,956,250	
第４０回　利付国債（３０年）	145,000,000	159,584,100	
第４１回　利付国債（３０年）	150,000,000	162,169,500	
第４２回　利付国債（３０年）	163,000,000	176,051,410	
第４３回　利付国債（３０年）	156,000,000	168,320,880	
第４４回　利付国債（３０年）	165,000,000	177,846,900	
第４５回　利付国債（３０年）	180,000,000	186,957,000	
第４６回　利付国債（３０年）	216,000,000	224,033,040	
第４７回　利付国債（３０年）	201,000,000	212,048,970	
第４８回　利付国債（３０年）	223,000,000	226,318,240	
第４９回　利付国債（３０年）	220,000,000	222,906,200	
第５０回　利付国債（３０年）	222,000,000	197,946,300	
第５１回　利付国債（３０年）	155,000,000	122,260,900	
第５２回　利付国債（３０年）	202,000,000	166,627,780	
第５３回　利付国債（３０年）	187,000,000	157,440,910	
第５４回　利付国債（３０年）	223,000,000	196,117,350	
第５５回　利付国債（３０年）	184,000,000	161,360,640	
第５６回　利付国債（３０年）	188,000,000	164,248,080	
第５７回　利付国債（３０年）	191,000,000	166,389,650	
第５８回　利付国債（３０年）	234,000,000	203,076,900	
第５９回　利付国債（３０年）	181,000,000	152,744,090	

第６０回　利付国債（３０年）	184,000,000	162,437,040	
第６１回　利付国債（３０年）	164,000,000	137,404,120	
第６２回　利付国債（３０年）	160,000,000	126,766,400	
第６３回　利付国債（３０年）	132,000,000	101,393,160	
第６４回　利付国債（３０年）	134,000,000	102,534,120	
第６５回　利付国債（３０年）	122,000,000	93,691,120	
第６６回　利付国債（３０年）	125,000,000	95,812,500	
第６７回　利付国債（３０年）	192,000,000	153,431,040	
第６８回　利付国債（３０年）	159,000,000	126,500,400	
第６９回　利付国債（３０年）	198,000,000	161,512,560	
第７０回　利付国債（３０年）	190,000,000	154,481,400	
第７１回　利付国債（３０年）	155,000,000	125,726,700	
第７２回　利付国債（３０年）	153,000,000	123,812,190	
第７３回　利付国債（３０年）	81,000,000	65,457,720	
第７４回　利付国債（３０年）	191,000,000	167,168,930	
第７５回　利付国債（３０年）	191,000,000	180,966,770	
第７６回　利付国債（３０年）	129,000,000	124,552,080	
第６９回　利付国債（２０年）	32,000,000	32,849,920	
第７０回　利付国債（２０年）	234,000,000	242,473,140	
第７２回　利付国債（２０年）	136,000,000	141,003,440	
第７３回　利付国債（２０年）	105,000,000	109,171,650	
第７４回　利付国債（２０年）	64,000,000	66,670,720	
第７５回　利付国債（２０年）	50,000,000	52,338,000	
第７６回　利付国債（２０年）	71,000,000	74,001,880	
第７７回　利付国債（２０年）	52,000,000	54,315,040	
第７８回　利付国債（２０年）	77,000,000	80,620,540	
第７９回　利付国債（２０年）	64,000,000	67,169,280	
第８０回　利付国債（２０年）	77,000,000	81,004,770	
第８１回　利付国債（２０年）	121,000,000	127,578,770	
第８２回　利付国債（２０年）	135,000,000	142,711,200	
第８３回　利付国債（２０年）	106,000,000	112,586,840	
第８４回　利付国債（２０年）	152,000,000	160,990,800	
第８５回　利付国債（２０年）	115,000,000	122,693,500	
第８６回　利付国債（２０年）	122,000,000	130,952,360	
第８７回　利付国債（２０年）	101,000,000	108,084,140	
第８８回　利付国債（２０年）	158,000,000	170,406,160	
第８９回　利付国債（２０年）	103,000,000	110,728,090	
第９０回　利付国債（２０年）	260,000,000	280,701,200	
第９１回　利付国債（２０年）	185,000,000	200,421,600	
第９２回　利付国債（２０年）	336,000,000	362,826,240	
第９３回　利付国債（２０年）	219,000,000	236,432,400	
第９４回　利付国債（２０年）	267,000,000	289,382,610	
第９５回　利付国債（２０年）	229,000,000	251,098,500	
第９６回　利付国債（２０年）	134,000,000	145,733,040	
第９７回　利付国債（２０年）	196,000,000	214,788,560	
第９８回　利付国債（２０年）	139,000,000	151,669,850	
第９９回　利付国債（２０年）	257,000,000	281,158,000	
第１００回　利付国債（２０年）	189,000,000	208,236,420	

第１０１回　利付国債（２０年）	118,000,000	131,232,520	
第１０２回　利付国債（２０年）	119,000,000	132,906,340	
第１０３回　利付国債（２０年）	112,000,000	124,481,280	
第１０４回　利付国債（２０年）	98,000,000	107,857,820	
第１０５回　利付国債（２０年）	88,000,000	97,196,880	
第１０６回　利付国債（２０年）	53,000,000	58,839,540	
第１０７回　利付国債（２０年）	74,000,000	82,015,680	
第１０８回　利付国債（２０年）	99,000,000	108,555,480	
第１０９回　利付国債（２０年）	79,000,000	86,853,390	
第１１０回　利付国債（２０年）	103,000,000	114,503,040	
第１１１回　利付国債（２０年）	79,000,000	88,591,390	
第１１２回　利付国債（２０年）	126,000,000	140,495,040	
第１１３回　利付国債（２０年）	300,000,000	335,493,000	
第１１４回　利付国債（２０年）	201,000,000	225,485,820	
第１１５回　利付国債（２０年）	120,000,000	135,439,200	
第１１６回　利付国債（２０年）	138,000,000	155,924,820	
第１１７回　利付国債（２０年）	210,000,000	235,794,300	
第１１８回　利付国債（２０年）	134,000,000	149,766,440	
第１１９回　利付国債（２０年）	121,000,000	133,473,890	
第１２０回　利付国債（２０年）	150,000,000	163,278,000	
第１２１回　利付国債（２０年）	206,000,000	229,393,360	
第１２２回　利付国債（２０年）	149,000,000	164,799,960	
第１２３回　利付国債（２０年）	201,000,000	227,566,170	
第１２４回　利付国債（２０年）	128,000,000	143,925,760	
第１２５回　利付国債（２０年）	133,000,000	152,105,450	

第１２６回　利付国債（２０年）	123,000,000	138,705,870	
第１２７回　利付国債（２０年）	119,000,000	133,245,490	
第１２８回　利付国債（２０年）	232,000,000	260,378,240	
第１２９回　利付国債（２０年）	122,000,000	135,921,420	
第１３０回　利付国債（２０年）	189,000,000	211,184,820	
第１３１回　利付国債（２０年）	124,000,000	137,508,560	
第１３２回　利付国債（２０年）	131,000,000	145,789,900	
第１３３回　利付国債（２０年）	156,000,000	174,966,480	
第１３４回　利付国債（２０年）	157,000,000	176,592,030	
第１３５回　利付国債（２０年）	114,000,000	127,210,320	
第１３６回　利付国債（２０年）	118,000,000	130,622,460	
第１３７回　利付国債（２０年）	101,000,000	112,959,410	
第１３８回　利付国債（２０年）	110,000,000	121,013,200	
第１３９回　利付国債（２０年）	114,000,000	126,456,780	
第１４０回　利付国債（２０年）	104,000,000	116,411,360	
第１４１回　利付国債（２０年）	173,000,000	193,687,340	
第１４２回　利付国債（２０年）	119,000,000	134,368,850	
第１４３回　利付国債（２０年）	173,000,000	192,010,970	
第１４４回　利付国債（２０年）	123,000,000	135,314,760	
第１４５回　利付国債（２０年）	246,000,000	275,574,120	
第１４６回　利付国債（２０年）	194,000,000	217,301,340	
第１４７回　利付国債（２０年）	214,000,000	237,424,440	
第１４８回　利付国債（２０年）	184,000,000	202,079,840	
第１４９回　利付国債（２０年）	199,000,000	218,376,630	
第１５０回　利付国債（２０年）	216,000,000	234,448,560	

第１５１回　利付国債（２０年）	216,000,000	229,221,360	
第１５２回　利付国債（２０年）	198,000,000	209,874,060	
第１５３回　利付国債（２０年）	234,000,000	250,419,780	
第１５４回　利付国債（２０年）	220,000,000	232,465,200	
第１５５回　利付国債（２０年）	211,000,000	217,503,020	
第１５６回　利付国債（２０年）	180,000,000	171,583,200	
第１５７回　利付国債（２０年）	182,000,000	168,288,120	
第１５８回　利付国債（２０年）	192,000,000	184,295,040	
第１５９回　利付国債（２０年）	197,000,000	190,958,010	
第１６０回　利付国債（２０年）	180,000,000	176,344,200	
第１６１回　利付国債（２０年）	184,000,000	177,147,840	
第１６２回　利付国債（２０年）	244,000,000	234,010,640	
第１６３回　利付国債（２０年）	260,000,000	248,378,000	
第１６４回　利付国債（２０年）	324,000,000	303,775,920	
第１６５回　利付国債（２０年）	246,000,000	229,803,360	
第１６６回　利付国債（２０年）	234,000,000	224,600,220	
第１６７回　利付国債（２０年）	255,000,000	236,275,350	
第１６８回　利付国債（２０年）	222,000,000	201,553,800	
第１６９回　利付国債（２０年）	248,000,000	220,452,160	
第１７０回　利付国債（２０年）	219,000,000	193,810,620	
第１７１回　利付国債（２０年）	234,000,000	206,158,680	
第１７２回　利付国債（２０年）	217,000,000	193,718,070	
第１７３回　利付国債（２０年）	277,000,000	246,380,420	
第１７４回　利付国債（２０年）	277,000,000	245,291,810	
第１７５回　利付国債（２０年）	264,000,000	237,172,320	

	第１７６回　利付国債（２０年）	261,000,000	233,480,160	
	第１７７回　利付国債（２０年）	254,000,000	222,399,860	
	第１７８回　利付国債（２０年）	264,000,000	234,817,440	
	第１７９回　利付国債（２０年）	274,000,000	243,010,600	
	第１８０回　利付国債（２０年）	258,000,000	241,299,660	
	第１８１回　利付国債（２０年）	253,000,000	240,436,020	
	第１８２回　利付国債（２０年）	175,000,000	171,657,500	
国債証券　合計		51,261,000,000	51,735,766,020	
地方債証券	第７３０回　東京都公募公債	300,000,000	302,045,400	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	95,230,000	
	平成２７年度第１回　北海道公募公債	300,000,000	301,825,500	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	103,530,000	
	第４４８回　大阪府公募公債	38,000,000	36,719,856	
	第４５５回　大阪府公募公債	180,000,000	174,127,320	
	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	110,561,800	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	109,966,700	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	107,322,900	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債	100,000,000	94,440,800	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	109,803,400	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	108,300,300	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債	100,000,000	103,272,800	
	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	195,561,800	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債	100,000,000	110,407,400	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債	100,000,000	109,972,400	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	293,435,400	
	第１３３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,312,700	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	92,617,300	

	第１回　名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	119,723,400	
	第１回　京都市公募公債	300,000,000	311,781,600	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	110,711,300	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	111,042,000	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	104,031,600	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	111,601,200	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	113,204,100	
	平成２６年度第２回　北九州市公募公債	150,000,000	150,862,500	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	197,331,400	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債	100,000,000	93,963,000	
地方債証券　合計		4,168,000,000	4,285,705,876	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	310,585,500	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,219,200	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,790,600	
	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	109,291,600	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	108,969,000	
	第２１８回　政保道路機構債券	500,000,000	504,255,000	
	第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	106,755,800	
	第２４９回　政保道路機構債券	179,000,000	180,725,023	
	第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	92,130,800	
	第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,615,700	
	第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	94,864,200	
	第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,548,600	
	第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	219,173,000	
	第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	107,523,800	
	第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	107,208,200	
	第７２回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,971,400	
	第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,636,925	
	第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	135,750,876	
	第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,466,300	

	第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	191,775,000	
	第１６回　公営企業債券	200,000,000	211,026,200	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	103,059,800	
	第４６回　福祉医療機構債券	200,000,000	198,602,000	
	第５９回　一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,058,400	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,939,600	
	第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,404,000	21,324,220	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,546,000	52,729,587	
	第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,698,000	61,538,983	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,854,000	50,866,784	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,712,000	56,982,548	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,128,000	59,367,416	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,744,000	29,775,909	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,968,000	265,910,486	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,350,000	164,178,305	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,055,000	117,509,367	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,181,000	101,008,612	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	206,451,000	202,053,593	
	い第８４５号　利付商工債券	200,000,000	199,938,000	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	199,085,800	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	99,527,100	
	第３５３回　利付しんきん中金債券	100,000,000	99,993,400	
特殊債券　合計		5,573,091,000	5,709,732,634	
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	98,977,700	
	第１３回　クレディ・アグリコル・エス・エー	100,000,000	99,564,100	
	第5回　スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	200,547,400	
	第２５回　首都高速道路債券	400,000,000	398,521,600	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	191,783,200	
	第６０回　中日本高速道路債券	100,000,000	100,543,600	
	第２５回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,007,600	
	第２６回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,594,000	

	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	98,601,900	
	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	100,867,600	
	第５回　電通グループ	400,000,000	397,186,800	
	第１回　オリックス銀行	200,000,000	199,271,800	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	101,884,600	
	第１回　三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	100,493,900	
	第２９回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	100,000,000	104,960,200	
	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	100,491,200	
	第８回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後特約付	100,000,000	104,219,900	
	第１６回　ＮＴＴファイナンス	200,000,000	198,926,600	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,737,000	
	第９６回　トヨタファイナンス	100,000,000	99,148,300	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,133,700	
	第４０回　三菱ＵＦＪリース	300,000,000	297,403,500	
	第６回　三井住友海上火災保険	100,000,000	99,803,600	
	第６６回　三井不動産	100,000,000	99,904,100	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	97,545,800	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	221,279,600	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	99,481,000	
	第３回　東日本旅客鉄道サステナビリティボンド	100,000,000	95,430,000	
	第２７回　ＫＤＤＩ	200,000,000	199,174,800	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,388,800	
	第３８１回　中国電力	200,000,000	202,259,200	
	第３０６回　北陸電力	100,000,000	101,070,300	
	第４２９回　九州電力	200,000,000	202,271,000	
	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,329,500	
	第３３１回　北海道電力	100,000,000	100,096,100	
	第３５２回　北海道電力	100,000,000	100,208,600	
	第１３回　電源開発	100,000,000	104,499,200	
社債券　合計		5,500,000,000	5,512,607,800	
合計			67,243,812,330	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年12月20日現在
資産の部	
流動資産	

預金	230,536,471
金銭信託	1,121,358
コール・ローン	108,136,604
国債証券	55,773,160,347
未収利息	331,827,654
前払費用	30,554,406
流動資産合計	56,475,336,840
資産合計	56,475,336,840
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	729,261
未払金	125,883,033
未払解約金	46,645,582
その他未払費用	317
流動負債合計	173,258,193
負債合計	173,258,193
純資産の部	
元本等	
元本	37,781,398,788
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,520,679,859
元本等合計	56,302,078,647
純資産合計	56,302,078,647
負債純資産合計	56,475,336,840

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年12月21日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	31,033,769,786円
	同期中追加設定元本額	13,032,987,782円
	同期中一部解約元本額	6,285,358,780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）	3,304,092,083円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,611,763,630円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,146,778,695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）	873,087,023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）	2,813,851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）	6,837,757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）	5,311,051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	14,507,090,467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）	4,270,011,413円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	3,346,998,828円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	204,765,084円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,797,172,356円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	237,750,190円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	458,411,028円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	72,883,582円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	179,287,503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）	19,477,010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）	42,690,164円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	148,970,707円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	99,611,331円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	218,749,571円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	200,892,569円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	14,912,474円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	11,040,421円
	計	37,781,398,788円
２．	受益権の総数	37,781,398,788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12月21日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	137,640,011
合計	137,640,011

（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22日から2022年12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	37,065,637	－	36,336,376	△729,261
アメリカ・ドル	31,216,237	－	30,556,276	△659,961
オフショア・人民元	5,849,400	－	5,780,100	△69,300
合計	37,065,637	－	36,336,376	△729,261

（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12月20日現在
1口当たり純資産額	1.4902円
（1万口当たり純資産額）	(14,902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12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	132,472.80	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	129,098.40	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	190,473.10	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	105,941.00	
		US TREASURY N/B	460,000.00	387,674.20	
		US TREASURY N/B	170,000.00	187,916.30	
		US TREASURY N/B	650,000.00	557,908.00	
		US TREASURY N/B	450,000.00	434,317.50	
		US TREASURY N/B	460,000.00	452,147.80	
		US TREASURY N/B	4,550,000.00	4,454,177.00	
		US TREASURY N/B	6,530,000.00	6,346,572.30	
		US TREASURY N/B	5,680,000.00	5,492,730.40	
		US TREASURY N/B	610,000.00	542,540.10	
		US TREASURY N/B	6,140,000.00	5,912,574.40	
		US TREASURY N/B	5,760,000.00	5,498,496.00	
		US TREASURY N/B	4,830,000.00	4,607,916.60	
		US TREASURY N/B	390,000.00	349,108.50	
		US TREASURY N/B	490,000.00	472,712.80	
		US TREASURY N/B	450,000.00	417,109.50	
		US TREASURY N/B	510,000.00	443,995.80	
		US TREASURY N/B	670,000.00	533,407.10	
		US TREASURY N/B	330,000.00	286,829.40	
		US TREASURY N/B	450,000.00	382,585.50	
		US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,474,560.00	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,578,730.40	
		US TREASURY N/B	280,000.00	243,457.20	
		US TREASURY N/B	3,570,000.00	3,323,848.50	
		US TREASURY N/B	540,000.00	427,987.80	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	2,992,142.80	
		US TREASURY N/B	580,000.00	458,739.40	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,345,669.60	
		US TREASURY N/B	680,000.00	511,298.80	
		US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,470,908.80	
		US TREASURY N/B	310,000.00	263,233.40	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,635,443.00	
		US TREASURY N/B	3,460,000.00	3,251,708.00	
		US TREASURY N/B	610,000.00	529,101.80	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,967,983.50	
		US TREASURY N/B	3,910,000.00	3,684,080.20	
		US TREASURY N/B	470,000.00	407,687.40	
		US TREASURY N/B	2,090,000.00	2,013,255.20	
		US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,995,439.00	
		US TREASURY N/B	690,000.00	572,154.90	
		US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,914,579.00	
		US TREASURY N/B	4,160,000.00	3,881,113.60	
		US TREASURY N/B	160,000.00	174,486.40	

		US TREASURY N/B	670,000.00	555,858.80	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,423,509.20	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,812,640.00	
		US TREASURY N/B	150,000.00	165,855.00	
		US TREASURY N/B	770,000.00	670,254.20	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,389,725.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,436,475.00	
		US TREASURY N/B	840,000.00	749,103.60	
		US TREASURY N/B	160,000.00	156,931.20	
		US TREASURY N/B	240,000.00	257,652.00	
		US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,789,193.60	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,172,525.60	
		US TREASURY N/B	930,000.00	811,090.20	
		US TREASURY N/B	260,000.00	287,380.60	
		US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,701,735.00	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,200,034.80	
		US TREASURY N/B	920,000.00	861,239.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	304,718.40	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,827,477.00	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,041,140.00	
		US TREASURY N/B	980,000.00	858,989.60	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,447,955.60	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,466,837.50	
		US TREASURY N/B	290,000.00	324,933.40	
		US TREASURY N/B	970,000.00	831,163.90	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,897,177.10	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,001,554.00	
		US TREASURY N/B	900,000.00	676,791.00	
		US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,781,023.30	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,009,366.00	
		US TREASURY N/B	270,000.00	274,954.50	
		US TREASURY N/B	850,000.00	657,186.00	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,967,736.60	
		US TREASURY N/B	1,950,000.00	1,693,828.50	
		US TREASURY N/B	260,000.00	277,274.40	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	771,643.70	
		US TREASURY N/B	130,000.00	150,707.70	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,812,285.00	
		US TREASURY N/B	840,000.00	552,165.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	317,755.20	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	1,919,856.00	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,759,862.10	
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	845,661.60	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	671,704.20	
		US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,459,040.40	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	1,862,554.80	
		US TREASURY N/B	1,370,000.00	878,882.40	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	783,656.00	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,598,996.80	

	US TREASURY N/B	1,120,000.00	961,228.80	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,832,952.00	
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,059,921.00	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,029,892.70	
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,088,236.40	
	US TREASURY N/B	4,350,000.00	4,124,322.00	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,013,932.00	
	US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,883,553.30	
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,192,461.50	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,223,686.50	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,493,535.00	
	US TREASURY N/B	1,190,000.00	936,006.40	
	US TREASURY N/B	2,380,000.00	1,973,615.00	
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,091,587.50	
	US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,126,035.40	
	US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,986,941.70	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,214,167.20	
	US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,708,344.60	
	US TREASURY N/B	2,320,000.00	1,933,302.40	
	US TREASURY N/B	1,430,000.00	974,573.60	
	US TREASURY N/B	280,000.00	253,234.80	
	US TREASURY N/B	1,310,000.00	979,172.60	
	US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,701,962.00	
	US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,341,278.40	
	US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,900,832.40	
	US TREASURY N/B	1,290,000.00	963,759.00	
	US TREASURY N/B	290,000.00	261,756.90	
	US TREASURY N/B	1,070,000.00	853,111.00	
	US TREASURY N/B	270,000.00	238,158.90	
	US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,055,106.30	
	US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,019,282.60	
	US TREASURY N/B	940,000.00	862,741.40	
	US TREASURY N/B	2,040,000.00	1,902,300.00	
	US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,121,168.70	
	US TREASURY N/B	820,000.00	766,314.60	
	US TREASURY N/B	320,000.00	270,262.40	
	US TREASURY N/B	2,070,000.00	2,040,875.10	
	US TREASURY N/B	760,000.00	794,078.40	
	US TREASURY N/B	460,000.00	491,408.80	
	US TREASURY N/B	330,000.00	338,250.00	
	US TREASURY NOTES	150,000.00	174,498.00	
	WI TREASURY SEC.	270,000.00	293,106.60	
	WI TREASURY SEC.	1,230,000.00	713,633.70	
	WI TREASURY SEC.	1,660,000.00	1,341,678.40	
	WI TREASURY SEC.	260,000.00	281,489.00	
	WI TREASURY SEC.	260,000.00	258,151.40	
アメリカ・ドル　小計		233,080,000.00 (31,358,583,200)	210,668,301.30 (28,343,313,252)	

イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	335,871.20	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	312,480.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	354,883.20	
	UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	236,203.20	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	376,840.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	256,802.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	288,744.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	229,323.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	299,075.20	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	225,622.80	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	338,892.40	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	237,500.00	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	347,800.20	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	331,206.40	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	272,247.00	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	393,188.40	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	245,203.20	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	147,807.40	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	299,537.50	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	151,162.90	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	313,669.80	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	282,325.50	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	260,479.60	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	393,516.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	157,856.40	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	276,850.60	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	262,749.80	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	327,071.50	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	334,134.40	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	358,805.40	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	400,695.20	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	319,862.20	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	261,330.30	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	127,995.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	271,566.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	262,216.60	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	92,140.00	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	303,820.00	
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	644,540.00	
	UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	433,393.80	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	185,551.60	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	435,752.10	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	228,509.40	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	202,644.00	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	334,648.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	228,168.00	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	446,145.60	
	UNITED KINGDOM GILT	210,000.00	123,870.60	

	UNITED KINGDOM GILT	680,000.00	546,536.40	
	UNITED KINGDOM GILT	210,000.00	94,416.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	276,114.80	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	350,580.80	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	424,996.00	
	UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	183,150.00	
	UNITED KINGDOM GILT	120,000.00	118,738.80	
イギリス・ポンド　小計		18,530,000.00 (3,028,357,900)	15,945,230.20 (2,605,928,972)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	420,000.00	399,210.00	
	ISRAEL FIXED BOND	310,000.00	305,071.00	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	453,200.00	
	ISRAEL FIXED BOND	680,000.00	653,786.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	321,305.50	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	364,173.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	428,950.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	517,861.50	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	554,554.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	292,762.50	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	365,137.50	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	303,798.00	
	ISRAEL FIXED BOND	250,000.00	236,462.50	
	ISRAEL FIXED BOND	160,000.00	135,728.00	
イスラエル・シュケル　小計		5,430,000.00 (211,297,590)	5,331,999.50 (207,484,097)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	397,240.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	308,180.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	476,524.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	392,304.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	190,474.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	440,836.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	249,375.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	194,779.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	274,702.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	370,747.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	239,677.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	290,394.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	354,996.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	460,051.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	237,958.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	444,163.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	508,102.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	347,739.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	539,145.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	358,332.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	254,064.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	517,728.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	460,958.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	451,570.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	360,684.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	476,820.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	304,341.00	
オーストラリア・ドル　小計		10,760,000.00 (969,583,600)	9,901,889.00 (892,259,218)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,306,608.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	729,381.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,217,976.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,355,382.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,011,610.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,404,488.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,604,480.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,439,366.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,333,520.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	3,807,862.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,159,584.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,564,588.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,995,240.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,599,460.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,634,943.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,464,530.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,475,295.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,466,615.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,057,893.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,195,226.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,766,784.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	983,540.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,415,685.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	8,236,754.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,236,771.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,971,720.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,579,920.00	
オフショア・人民元　小計		101,070,000.00 (1,947,426,867)	101,015,222.50 (1,946,371,409)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	140,000.00	132,687.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	226,405.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	210,337.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	134,801.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	225,866.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	223,895.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	160,995.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	187,310.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	165,904.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	134,253.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	212,637.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	203,761.80	

		CANADIAN GOVERNMENT	840,000.00	680,828.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	125,760.70	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	127,452.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	173,617.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	598,832.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	142,822.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	527,626.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	500,166.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	336,244.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	391,681.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	760,000.00	682,138.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	342,460.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	275,618.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	467,821.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	640,000.00	570,572.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	316,244.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	310,000.00	299,084.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	239,075.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	309,961.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	463,240.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	96,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	326,894.70	
		CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	324,713.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	227,518.30	
		CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	337,907.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	286,554.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	164,312.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	80,220.00	
	カナダ・ドル　小計		**12,460,000.00** **(1,228,057,600)**	**11,634,826.90** **(1,146,728,539)**	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	135,176.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	120,535.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	139,339.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	167,926.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	143,570.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	156,352.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	157,093.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	108,452.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	177,696.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	65,590.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	120,260.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	209,787.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	215,667.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	178,844.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	102,905.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	108,566.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	85,740.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	94,350.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	55,017.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	49,038.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	50,191.50	
シンガポール・ドル　小計		2,710,000.00 (268,777,800)	2,642,099.50 (262,043,428)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,610,000.00	1,606,989.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,770,000.00	1,683,836.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	1,098,579.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,350,000.00	1,255,918.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,430,000.00	1,311,038.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	890,000.00	1,089,965.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	915,021.20	
スウェーデン・クローナ　小計		9,190,000.00 (118,918,600)	8,961,348.60 (115,959,851)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	980,830.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,450,000.00	1,324,125.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,232,630.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,210,000.00	733,550.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,600,000.00	1,293,184.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,340,000.00	3,053,161.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,270,000.00	1,211,275.20	
デンマーク・クローネ　小計		10,270,000.00 (196,875,900)	9,828,756.90 (188,417,270)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	324,846.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	232,280.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	98,983.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	113,169.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	30,000.00	24,190.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	93,794.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	66,067.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	73,933.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	320,000.00	279,532.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	99,427.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	70,000.00	69,760.60	
ニュージーランド・ドル　小計		1,690,000.00 (144,309,100)	1,475,983.80 (126,034,257)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,430,000.00	1,427,683.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	1,215,787.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	980,000.00	936,693.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	940,000.00	898,085.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	850,368.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	827,949.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,074,468.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	800,000.00	698,184.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	770,000.00	720,435.10	
ノルウェー・クローネ　小計		9,150,000.00	8,649,654.70	

		(124,257,000)	(117,462,311)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	810,000.00	739,781.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	970,000.00	833,870.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	557,038.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	780,000.00	641,472.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	833,650.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000.00	778,407.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	850,000.00	783,564.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	171,243.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	583,402.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	519,418.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	690,000.00	536,820.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	680,000.00	448,630.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	640,000.00	562,636.80	
ポーランド・ズロチ　小計		9,580,000.00 (291,770,396)	7,989,934.20 (243,343,034)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	446,337.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	434,225.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	403,276.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	170,428.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	777,307.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	613,196.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	684,678.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	367,700.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	386,224.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	321,686.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	372,290.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	217,116.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	569,953.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	120,000.00	120,975.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	401,656.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	160,713.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	191,885.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	199,268.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	438,675.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	253,521.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	350,060.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	454,906.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	580,000.00	536,123.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	217,029.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	140,000.00	135,326.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	312,048.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	164,753.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	336,226.00	
マレーシア・リンギット　小計		10,020,000.00 (304,125,036)	10,037,591.10 (304,658,958)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,573,731.20	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,010,000.00	8,460,660.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,370,000.00	4,745,361.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,870,000.00	8,108,510.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	4,759,282.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	5,271,544.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,789,573.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,580,000.00	6,379,770.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,760,000.00	4,642,428.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,020,000.00	6,698,413.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,140,000.00	6,060,671.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,710,000.00	4,514,487.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,220,000.00	2,852,115.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,278,025.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,089,960.00	
メキシコ・ペソ　小計		73,230,000.00 (498,117,783)	69,224,535.80 (470,872,215)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	310,000.00	310,520.80	
	BELGIUM KINGDOM	410,000.00	495,005.30	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	224,244.00	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	208,097.50	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	201,322.00	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	322,721.40	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	266,720.00	
	BELGIUM KINGDOM	480,000.00	461,572.80	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	155,428.20	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	333,826.50	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	176,014.40	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	138,075.20	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	297,446.40	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	251,001.40	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	130,371.00	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	123,009.00	
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	483,151.20	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	320,547.50	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	189,945.80	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	351,908.70	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	175,713.10	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	223,970.40	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	116,053.20	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	177,290.00	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	430,554.20	
	BELGIUM KINGDOM	290,000.00	228,035.70	
	BELGIUM KINGDOM	110,000.00	52,690.00	
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	270,599.20	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	152,196.00	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	86,511.60	
	BONOS Y OBLIG DE	450,000.00	358,645.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	340,000.00	427,281.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	518,073.30	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	500,750.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	609,512.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	500,728.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	424,311.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	532,166.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	488,400.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	463,270.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	572,268.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	526,489.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	357,103.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	300,207.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	512,098.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	474,095.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	366,740.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	459,012.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	463,025.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	312,951.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	475,724.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	632,949.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	442,886.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	457,300.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	396,459.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	356,125.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	410,510.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	297,189.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	409,723.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	398,965.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	435,192.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	410,701.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	248,894.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	472,608.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	536,410.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	255,292.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	413,293.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	375,278.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	394,735.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	66,844.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	336,839.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	270,000.00	188,198.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	160,000.00	103,734.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	392,088.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	383,659.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	411,677.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	146,157.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	216,980.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	403,864.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	97,550.00	
		BUNDESOBLIGATION	470,000.00	450,668.90	
		BUNDESOBLIGATION	500,000.00	474,585.00	

		BUNDESOBLIGATION	520,000.00	488,482.80	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	94,269.00	
		BUNDESOBLIGATION	590,000.00	548,747.20	
		BUNDESOBLIGATION	520,000.00	505,310.00	
		BUNDESOBLIGATION	510,000.00	468,914.40	
		BUNDESOBLIGATION	460,000.00	418,250.40	
		BUNDESOBLIGATION	570,000.00	545,997.30	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	95,914.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	556,959.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	504,696.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	701,532.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	509,308.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	596,830.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	619,123.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	654,444.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	641,396.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	619,046.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	591,225.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	629,809.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	484,568.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	599,354.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	601,064.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	569,451.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	548,292.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	543,747.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	537,589.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	730,000.00	424,480.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	468,888.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	497,982.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	422,501.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	363,830.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	586,720.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	690,651.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	178,596.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	487,211.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	385,632.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	122,333.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	556,763.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	493,578.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	166,316.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	224,360.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	525,824.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	250,000.00	315,785.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	660,039.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000.00	201,160.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	507,517.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	160,000.00	159,049.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	75,504.80	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	372,023.80	

		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	470,000.00	457,098.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	350,000.00	339,220.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	367,372.60	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	130,000.00	129,421.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	394,804.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	500,004.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	565,975.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	396,314.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	435,309.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	310,241.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	547,331.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	554,245.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	420,352.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	503,208.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	414,645.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	423,794.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	693,472.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	281,163.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	442,002.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	282,247.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	413,496.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	143,548.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	325,115.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	359,331.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	491,875.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	327,841.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	373,728.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	257,985.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	506,880.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	693,843.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	473,815.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	276,306.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	275,682.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	445,306.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	250,824.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	550,128.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	416,480.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	498,883.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	500,235.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	232,521.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	212,832.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	542,880.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	405,554.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	310,728.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	443,992.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	400,622.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	236,775.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	349,326.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	402,164.40	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	450,416.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	206,871.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	319,575.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	219,453.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	343,031.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	166,913.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	406,934.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	60,404.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	283,825.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	311,620.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	557,507.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	266,380.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	353,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	460,985.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	369,200.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	410,738.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	341,624.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	343,587.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	347,461.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	598,221.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	276,063.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	306,967.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	381,724.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	291,858.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	122,208.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	288,420.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	145,128.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	279,737.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	217,614.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	298,893.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	279,921.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	129,436.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	332,797.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	162,334.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	199,968.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000.00	79,569.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000.00	69,025.60	
		DEUTSCHLAND REP	320,000.00	371,577.60	
		DEUTSCHLAND REP	270,000.00	319,747.50	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	339,189.00	
		DEUTSCHLAND REP	440,000.00	544,979.60	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	110,991.10	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	99,522.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	107,713.10	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	85,463.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	124,764.90	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	131,544.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	127,370.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	83,983.00	

		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	78,799.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	112,950.50	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	56,345.60	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	93,612.60	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	51,667.20	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	97,478.40	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	51,695.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	104,152.10	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	97,770.20	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	95,963.00	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	72,892.80	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	65,618.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	98,173.90	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	76,076.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	1,123,686.30	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	714,594.00	
		FRANCE (GOVT OF)	620,000.00	653,213.40	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	690,095.70	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	797,032.00	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	817,599.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,210,000.00	1,209,104.60	
		FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	925,069.60	
		FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	757,965.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,210,000.00	1,116,406.50	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	962,688.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,070,000.00	1,001,605.60	
		FRANCE (GOVT OF)	320,000.00	246,038.40	
		FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	800,346.40	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	762,330.10	
		FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	564,735.60	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	779,785.00	
		FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	545,564.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,093,656.00	
		FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	718,003.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,086,540.00	
		FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	843,073.50	
		FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	622,820.00	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	974,800.00	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	504,879.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,014,093.00	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	935,510.40	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	782,622.90	
		FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	396,057.10	
		FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	869,424.80	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	959,871.60	
		FRANCE (GOVT OF)	360,000.00	456,505.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	883,872.00	
		FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	341,776.50	
		FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	92,490.30	

		FRANCE (GOVT OF)	340,000.00	212,224.60	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	785,931.30	
		FRANCE (GOVT OF)	860,000.00	777,113.20	
		FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	631,754.50	
		FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	340,453.60	
		FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	577,074.20	
		FRANCE (GOVT OF)	580,000.00	548,825.00	
		FRANCE (GOVT OF)	120,000.00	95,144.40	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	921,435.20	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	622,200.00	
		FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	525,716.80	
		FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	514,731.00	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	92,881.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	172,165.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	187,946.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	207,939.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	239,307.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	120,971.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	165,684.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	95,642.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	127,621.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	192,517.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	128,431.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	82,281.10	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	244,577.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	136,168.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	133,328.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	150,894.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	53,360.80	
		IRISH GOVERNMENT BOND	100,000.00	80,134.00	
		ITALIAN GOVT	200,000.00	227,952.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	463,041.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	319,446.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	357,786.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	397,782.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	374,776.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	297,926.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	312,016.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	339,197.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	445,257.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	250,000.00	217,507.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	248,628.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	241,941.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	466,939.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	299,682.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	150,301.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	227,682.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	117,369.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	309,474.00	

		NETHERLANDS GOVERNMENT	260,000.00	224,850.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	157,845.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	232,733.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	93,924.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	173,102.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	99,782.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	168,812.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	226,738.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	280,627.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	310,698.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	141,958.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	275,922.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	40,000.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	97,333.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	233,050.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	210,422.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	357,191.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	228,670.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,356.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	206,322.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	105,772.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	66,909.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	41,905.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	224,288.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	34,927.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	160,486.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	92,341.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	231,033.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	111,697.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	194,966.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	67,019.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	108,212.50	
	ユーロ　小計		141,880,000.00 (20,237,763,200)	131,816,345.60 (18,802,283,536)	
国債証券　合計			60,928,221,572 (60,928,221,572)	55,773,160,347 (55,773,160,347)	
合計				55,773,160,347 (55,773,160,347)	

（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	141銘柄	50.34	50.82
イギリス・ポンド	国債証券	55銘柄	4.63	4.67
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	0.37	0.37

オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.58	1.60
オフショア・人民元	国債証券	27銘柄	3.46	3.49
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.04	2.06
シンガポール・ドル	国債証券	21銘柄	0.47	0.47
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.33	0.34
ニュージーランド・ドル	国債証券	11銘柄	0.22	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.43	0.44
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.54	0.55
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.84	0.84
ユーロ	国債証券	359銘柄	33.40	33.71

（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。

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	883
コール・ローン	85,124
親投資信託受益証券	101,766,612
未収入金	3,638
流動資産合計	101,856,257
資産合計	101,856,257
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	8,346
未払委託者報酬	78,570
その他未払費用	3,445
流動負債合計	90,361
負債合計	90,361
純資産の部	
元本等	
元本	105,141,177
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,375,281
（分配準備積立金）	－
元本等合計	101,765,896
純資産合計	101,765,896
負債純資産合計	101,856,257

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	△4,076,830
営業収益合計	△4,076,830
営業費用	
受託者報酬	11,246
委託者報酬	103,819
その他費用	4,338
営業費用合計	119,403
営業利益又は営業損失（△）	△4,196,233
経常利益又は経常損失（△）	△4,196,233
当期純利益又は当期純損失（△）	△4,196,233
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（△）	△131,833
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	689,119
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	393,822
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	295,297
剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,375,281

（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1期 自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 2022年12月20日現在
１．　期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	220,837,749円
期中一部解約元本額	116,696,572円
２．　受益権の総数	105,141,177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3,375,281円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は0円（1万口当たり0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1期 自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。
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	第1期 2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△4,008,479
合計	△4,008,479

（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1期 2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9679円 (9,679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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	15,338,605	33,674,373	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	11,040,421	16,452,435	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	16,336,852	46,718,495	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	5,253,880	4,921,309	
親投資信託受益証券　合計		47,969,758	101,766,612	
合計			101,766,612	

（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、「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ国内債券パッシブ　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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	54,749,994
コール・ローン	5,279,738,972
株式	171,861,245,710
派生商品評価勘定	1,089,000
未収配当金	23,374,145
前払金	31,200,000
差入委託証拠金	210,600,000
流動資産合計	177,461,997,821
資産合計	177,461,997,821
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	108,043,000
未払解約金	174,542,052
その他未払費用	8,271
流動負債合計	282,593,323
負債合計	282,593,323
純資産の部	
元本等	
元本	80,706,172,215
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	96,473,232,283
元本等合計	177,179,404,498
純資産合計	177,179,404,498
負債純資産合計	177,461,997,821

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,360,059,200円
	同期中追加設定元本額	51,967,064,786円
	同期中一部解約元本額	24,620,951,771円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,608,108,766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）	3,301,108,142円
	ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,478,197円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,223,059,163円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,578,112,418円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	5,806,173,111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）	3,786,589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）	13,802,145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）	13,300,503円
	ＤＣニッセイ国内株式インデックス	1,693,878,579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	23,184,020,438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）	2,873,318,982円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	282,717,737円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	241,820,425円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	325,367,777円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	607,219,681円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	54,739,098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）	120,639,202円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	8,837,283円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	12,210,650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）	5,246,639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）	8,626,829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）	28,750,290円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	206,222,621円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	137,166,509円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	298,502,600円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	240,808,726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）	25,762,055,921円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）	20,956,359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）	73,536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）	157,515円
	ＦＷニッセイ国内株インデックス	26,567,179円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	15,338,605円
	計	80,706,172,215円
２．	受益権の総数	80,706,172,215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　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,067,553,485
合計	1,067,553,485

（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12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,439,400,000	－	5,332,600,000	△106,800,000
合計	5,439,400,000	－	5,332,600,000	△106,800,000

（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12月20日現在
1口当たり純資産額	2.1954円
（1万口当たり純資産額）	(21,954円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年12月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	3,705.00	12,226,500	
ニッスイ	87,500	534.00	46,725,000	
マルハニチロ	13,500	2,437.00	32,899,500	
雪国まいたけ	7,500	993.00	7,447,500	
カネコ種苗	3,400	1,410.00	4,794,000	
サカタのタネ	11,100	4,340.00	48,174,000	
ホクト	7,800	1,869.00	14,578,200	
ショーボンドホールディングス	11,900	5,730.00	68,187,000	
ミライト・ワン	30,400	1,511.00	45,934,400	

タマホーム	6,200	2,480.00	15,376,000	
ファーストコーポレーション	1,300	702.00	912,600	
住石ホールディングス	14,000	393.00	5,502,000	
日鉄鉱業	3,500	2,999.00	10,496,500	
三井松島ホールディングス	4,000	3,070.00	12,280,000	
ＩＮＰＥＸ	323,800	1,408.00	455,910,400	
石油資源開発	10,100	3,825.00	38,632,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,000	2,096.00	8,384,000	
安藤・間	50,700	821.00	41,624,700	
東急建設	24,900	634.00	15,786,600	
コムシスホールディングス	29,600	2,358.00	69,796,800	
ビーアールホールディングス	14,000	329.00	4,606,000	
高松コンストラクショングループ	5,700	1,885.00	10,744,500	
東建コーポレーション	2,800	7,290.00	20,412,000	
ソネック	4,800	958.00	4,598,400	
ヤマウラ	4,900	997.00	4,885,300	
オリエンタル白石	31,500	281.00	8,851,500	
大成建設	61,000	4,175.00	254,675,000	
大林組	219,000	1,004.00	219,876,000	
清水建設	184,100	708.00	130,342,800	
飛島建設	6,800	998.00	6,786,400	
長谷工コーポレーション	63,200	1,489.00	94,104,800	
松井建設	8,700	560.00	4,872,000	
錢高組	1,500	2,610.00	3,915,000	
鹿島建設	135,800	1,503.00	204,107,400	
不動テトラ	4,200	1,446.00	6,073,200	
鉄建建設	4,400	1,754.00	7,717,600	
西松建設	10,400	3,910.00	40,664,000	
三井住友建設	49,400	414.00	20,451,600	
大豊建設	2,500	4,020.00	10,050,000	
佐田建設	10,800	443.00	4,784,400	
ナカノフドー建設	15,100	314.00	4,741,400	
奥村組	9,900	2,934.00	29,046,600	
東鉄工業	8,400	2,576.00	21,638,400	
淺沼組	4,900	2,947.00	14,440,300	
戸田建設	75,300	714.00	53,764,200	
熊谷組	10,600	2,562.00	27,157,200	
植木組	3,500	1,297.00	4,539,500	
矢作建設工業	8,300	749.00	6,216,700	
ピーエス三菱	7,900	601.00	4,747,900	
日本ハウスホールディングス	12,100	368.00	4,452,800	
大東建託	22,500	13,750.00	309,375,000	
新日本建設	8,600	729.00	6,269,400	
東亜道路工業	1,200	5,870.00	7,044,000	
日本道路	1,200	5,790.00	6,948,000	
東亜建設工業	5,300	2,307.00	12,227,100	
日本国土開発	18,400	564.00	10,377,600	
若築建設	2,700	2,864.00	7,732,800	
東洋建設	19,800	841.00	16,651,800	
五洋建設	86,800	622.00	53,989,600	

世紀東急工業	8,100	768.00	6,220,800	
福田組	2,300	4,600.00	10,580,000	
住友林業	47,000	2,385.00	112,095,000	
日本基礎技術	8,100	480.00	3,888,000	
巴コーポレーション	10,600	395.00	4,187,000	
大和ハウス工業	171,200	3,083.00	527,809,600	
ライト工業	11,700	1,911.00	22,358,700	
積水ハウス	191,900	2,385.00	457,681,500	
日特建設	5,800	897.00	5,202,600	
北陸電気工事	7,200	655.00	4,716,000	
ユアテック	13,500	709.00	9,571,500	
日本リーテック	6,600	763.00	5,035,800	
四電工	2,900	1,700.00	4,930,000	
中電工	9,500	2,059.00	19,560,500	
関電工	33,600	865.00	29,064,000	
きんでん	43,100	1,425.00	61,417,500	
東京エネシス	6,000	902.00	5,412,000	
トーエネック	2,000	3,385.00	6,770,000	
住友電設	5,800	2,362.00	13,699,600	
日本電設工業	10,100	1,516.00	15,311,600	
エクシオグループ	30,000	2,155.00	64,650,000	
新日本空調	3,400	1,848.00	6,283,200	
日本工営	4,600	3,250.00	14,950,000	
九電工	14,900	3,210.00	47,829,000	
三機工業	13,600	1,543.00	20,984,800	
日揮ホールディングス	60,600	1,692.00	102,535,200	
中外炉工業	3,100	1,598.00	4,953,800	
ヤマト	6,200	679.00	4,209,800	
太平電業	3,800	3,115.00	11,837,000	
高砂熱学工業	14,800	1,761.00	26,062,800	
三晃金属工業	1,700	2,962.00	5,035,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	20,900	1,600.00	33,440,000	
朝日工業社	2,500	2,090.00	5,225,000	
明星工業	10,500	737.00	7,738,500	
大氣社	7,400	3,415.00	25,271,000	
ダイダン	4,000	2,186.00	8,744,000	
日比谷総合設備	5,300	1,880.00	9,964,000	
ニップン	16,600	1,596.00	26,493,600	
日清製粉グループ本社	56,900	1,540.00	87,626,000	
日東富士製粉	1,100	4,360.00	4,796,000	
昭和産業	5,400	2,416.00	13,046,400	
中部飼料	8,500	1,022.00	8,687,000	
フィード・ワン	9,000	676.00	6,084,000	
日本甜菜製糖	3,600	1,613.00	5,806,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	6,100	1,993.00	12,157,300	
塩水港精糖	23,200	194.00	4,500,800	
日新製糖	3,200	1,902.00	6,086,400	
ＬＩＦＵＬＬ	28,900	223.00	6,444,700	
ＭＩＸＩ	14,600	2,380.00	34,748,000	
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,484.00	14,407,200	

日本M&Aセンターホールディングス	110,100	1,611.00	177,371,100	
メンバーズ	2,300	1,991.00	4,579,300	
ＵＴグループ	9,400	2,207.00	20,745,800	
アイティメディア	2,900	1,622.00	4,703,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,100	1,283.00	5,260,300	
夢真ビーネックスグループ	23,400	1,782.00	41,698,800	
コシダカホールディングス	19,200	1,057.00	20,294,400	
アルトナー	1,300	975.00	1,267,500	
パソナグループ	7,800	1,845.00	14,391,000	
ＣＤＳ	2,700	1,788.00	4,827,600	
リンクアンドモチベーション	18,500	641.00	11,858,500	
エス・エム・エス	24,400	3,210.00	78,324,000	
サニーサイドアップグループ	7,000	559.00	3,913,000	
パーソルホールディングス	71,900	2,872.00	206,496,800	
クックパッド	23,900	194.00	4,636,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,700	636.00	4,897,200	
森永製菓	12,700	3,865.00	49,085,500	
中村屋	1,600	3,090.00	4,944,000	
江崎グリコ	17,600	3,675.00	64,680,000	
名糖産業	3,000	1,602.00	4,806,000	
井村屋グループ	3,400	2,224.00	7,561,600	
不二家	4,200	2,584.00	10,852,800	
山崎製パン	41,200	1,609.00	66,290,800	
モロゾフ	2,000	3,475.00	6,950,000	
亀田製菓	3,900	4,400.00	17,160,000	
寿スピリッツ	6,500	7,290.00	47,385,000	
カルビー	28,100	3,060.00	85,986,000	
森永乳業	11,200	4,800.00	53,760,000	
六甲バター	4,500	1,333.00	5,998,500	
ヤクルト本社	43,900	8,830.00	387,637,000	
明治ホールディングス	38,100	6,660.00	253,746,000	
雪印メグミルク	14,900	1,758.00	26,194,200	
プリマハム	8,300	2,095.00	17,388,500	
日本ハム	24,000	3,635.00	87,240,000	
林兼産業	7,000	434.00	3,038,000	
丸大食品	6,200	1,406.00	8,717,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,800	2,901.00	19,726,800	
柿安本店	2,400	2,108.00	5,059,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	47,800	687.00	32,838,600	
学情	3,200	1,362.00	4,358,400	
スタジオアリス	3,200	2,036.00	6,515,200	
クロスキャット	3,600	1,394.00	5,018,400	
シミックホールディングス	3,500	1,677.00	5,869,500	
システナ	105,300	404.00	42,541,200	
ＮＪＳ	2,300	2,011.00	4,625,300	
デジタルアーツ	4,000	5,700.00	22,800,000	
日鉄ソリューションズ	10,700	3,160.00	33,812,000	
綜合警備保障	23,800	3,455.00	82,229,000	
キューブシステム	4,900	1,054.00	5,164,600	
いちご	70,800	292.00	20,673,600	

日本駐車場開発	73,200	290.00	21,228,000	
コア	3,300	1,422.00	4,692,600	
カカクコム	47,900	2,057.00	98,530,300	
アイロムグループ	2,300	2,404.00	5,529,200	
セントケア・ホールディング	5,800	821.00	4,761,800	
ルネサンス	5,100	861.00	4,391,100	
ディップ	11,200	3,730.00	41,776,000	
ＳＢＳホールディングス	5,600	2,900.00	16,240,000	
デジタルホールディングス	5,000	1,212.00	6,060,000	
新日本科学	6,800	2,218.00	15,082,400	
ベネフィット・ワン	29,700	1,892.00	56,192,400	
エムスリー	126,800	3,614.00	458,255,200	
アウトソーシング	38,200	919.00	35,105,800	
ウェルネット	7,700	593.00	4,566,100	
ワールドホールディングス	2,900	2,733.00	7,925,700	
ディー・エヌ・エー	27,400	1,750.00	47,950,000	
博報堂ＤＹホールディングス	81,900	1,282.00	104,995,800	
ぐるなび	11,800	385.00	4,543,000	
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	850.00	4,760,000	
ファンコミュニケーションズ	12,600	427.00	5,380,200	
ライク	2,400	1,955.00	4,692,000	
ビジネス・ブレークスルー	11,700	382.00	4,469,400	
エスプール	18,400	898.00	16,523,200	
ＷＤＢホールディングス	3,300	2,114.00	6,976,200	
手間いらず	1,100	4,715.00	5,186,500	
アドウェイズ	8,800	494.00	4,347,200	
バリューコマース	4,800	1,802.00	8,649,600	
インフォマート	66,600	383.00	25,507,800	
サッポロホールディングス	20,200	3,425.00	69,185,000	
アサヒグループホールディングス	142,100	4,168.00	592,272,800	
キリンホールディングス	277,500	2,059.50	571,511,250	
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	272.00	5,004,800	
養命酒製造	2,700	1,794.00	4,843,800	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	48,200	1,444.00	69,600,800	
サントリー食品インターナショナル	43,300	4,555.00	197,231,500	
ダイドーグループホールディングス	3,500	4,805.00	16,817,500	
伊藤園	22,900	4,905.00	112,324,500	
キーコーヒー	6,900	2,054.00	14,172,600	
日清オイリオグループ	8,700	3,210.00	27,927,000	
不二製油グループ本社	14,300	2,045.00	29,243,500	
Ｊ－オイルミルズ	6,300	1,502.00	9,462,600	
ローソン	16,400	4,920.00	80,688,000	
サンエー	5,000	4,270.00	21,350,000	
カワチ薬品	5,200	2,156.00	11,211,200	
エービーシー・マート	9,600	7,130.00	68,448,000	
ハードオフコーポレーション	2,800	1,328.00	3,718,400	
高千穂交易	2,400	2,131.00	5,114,400	
アスクル	15,900	1,609.00	25,583,100	

ゲオホールディングス	6,900	1,932.00	13,330,800	
アダストリア	8,000	1,923.00	15,384,000	
伊藤忠食品	1,500	4,905.00	7,357,500	
くら寿司	7,700	3,115.00	23,985,500	
キャンドゥ	2,300	2,163.00	4,974,900	
エレマテック	5,900	1,512.00	8,920,800	
パルグループホールディングス	6,500	2,197.00	14,280,500	
エディオン	26,200	1,265.00	33,143,000	
あらた	5,100	3,955.00	20,170,500	
サーラコーポレーション	13,900	707.00	9,827,300	
トーメンデバイス	1,000	5,540.00	5,540,000	
ハローズ	3,000	2,913.00	8,739,000	
ＪＰホールディングス	18,500	284.00	5,254,000	
フジオフードグループ本社	5,500	1,388.00	7,634,000	
あみやき亭	1,700	2,889.00	4,911,300	
東京エレクトロン　デバイス	2,400	6,900.00	16,560,000	
円谷フィールズホールディングス	5,700	2,570.00	14,649,000	
双日	70,100	2,486.00	174,268,600	
アルフレッサ　ホールディングス	66,300	1,666.00	110,455,800	
大黒天物産	2,400	5,050.00	12,120,000	
ハニーズホールディングス	5,900	1,272.00	7,504,800	
ファーマライズホールディングス	7,000	654.00	4,578,000	
キッコーマン	40,700	7,290.00	296,703,000	
味の素	150,500	4,367.00	657,233,500	
ブルドックソース	2,900	1,729.00	5,014,100	
キユーピー	33,000	2,438.00	80,454,000	
ハウス食品グループ本社	18,800	2,754.00	51,775,200	
カゴメ	28,600	3,055.00	87,373,000	
アリアケジャパン	5,400	4,475.00	24,165,000	
エバラ食品工業	1,700	3,005.00	5,108,500	
ニチレイ	28,200	2,800.00	78,960,000	
横浜冷凍	18,000	1,059.00	19,062,000	
東洋水産	31,100	5,200.00	161,720,000	
イートアンドホールディングス	2,600	2,267.00	5,894,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,000	568.00	5,680,000	
日清食品ホールディングス	21,900	10,490.00	229,731,000	
永谷園ホールディングス	3,000	2,001.00	6,003,000	
一正蒲鉾	6,100	719.00	4,385,900	
フジッコ	6,300	1,893.00	11,925,900	
ロック・フィールド	7,500	1,496.00	11,220,000	
日本たばこ産業	404,800	2,832.50	1,146,596,000	
ケンコーマヨネーズ	4,200	1,485.00	6,237,000	
わらべや日洋ホールディングス	4,500	1,878.00	8,451,000	
なとり	3,900	2,025.00	7,897,500	
ファーマフーズ	9,500	1,438.00	13,661,000	
北の達人コーポレーション	26,400	267.00	7,048,800	
ユーグレナ	39,600	987.00	39,085,200	
紀文食品	5,400	950.00	5,130,000	
ピックルスホールディングス	4,600	1,069.00	4,917,400	
ＳＲＥホールディングス	3,000	3,790.00	11,370,000	

ＡＤワークスグループ	20,200	148.00	2,989,600	
片倉工業	5,800	1,742.00	10,103,600	
グンゼ	4,700	3,985.00	18,729,500	
ヒューリック	143,500	1,093.00	156,845,500	
アルペン	5,400	1,991.00	10,751,400	
ラクーンホールディングス	6,200	1,075.00	6,665,000	
クオールホールディングス	9,100	1,160.00	10,556,000	
アルコニックス	8,700	1,299.00	11,301,300	
神戸物産	51,100	3,630.00	185,493,000	
ソリトンシステムズ	4,700	1,009.00	4,742,300	
ジンズホールディングス	3,900	4,440.00	17,316,000	
ビックカメラ	43,900	1,256.00	55,138,400	
ＤＣＭホールディングス	40,300	1,166.00	46,989,800	
ハイパー	4,500	533.00	2,398,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	93,700	1,877.00	175,874,900	
東京一番フーズ	8,200	485.00	3,977,000	
あい　ホールディングス	10,600	2,117.00	22,440,200	
ディーブイエックス	4,700	1,013.00	4,761,100	
アークランドサービスホールディングス	5,400	2,210.00	11,934,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	82,100	1,135.00	93,183,500	
ドトール・日レスホールディングス	11,700	1,692.00	19,796,400	
マツキヨココカラ＆カンパニー	40,100	5,990.00	240,199,000	
ブロンコビリー	3,500	2,497.00	8,739,500	
ＺＯＺＯ	43,700	3,175.00	138,747,500	
トレジャー・ファクトリー	700	2,433.00	1,703,100	
物語コーポレーション	3,700	6,250.00	23,125,000	
三越伊勢丹ホールディングス	111,200	1,311.00	145,783,200	
東洋紡	27,000	1,003.00	27,081,000	
ユニチカ	18,900	243.00	4,592,700	
富士紡ホールディングス	2,500	3,355.00	8,387,500	
日清紡ホールディングス	51,300	988.00	50,684,400	
倉敷紡績	4,700	2,170.00	10,199,000	
ダイワボウホールディングス	27,000	1,937.00	52,299,000	
日東紡績	7,500	1,922.00	14,415,000	
トヨタ紡織	26,300	1,782.00	46,866,600	
マクニカホールディングス	16,200	3,385.00	54,837,000	
Ｈａｍｅｅ	5,800	691.00	4,007,800	
ラクト・ジャパン	2,500	2,099.00	5,247,500	
ウエルシアホールディングス	34,300	3,005.00	103,071,500	
クリエイトＳＤホールディングス	10,900	3,230.00	35,207,000	
グリムス	2,700	1,908.00	5,151,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,700	840.00	8,148,000	
八洲電機	5,300	1,007.00	5,337,100	
メディアスホールディングス	6,900	700.00	4,830,000	
レスターホールディングス	6,300	2,054.00	12,940,200	
ジューテックホールディングス	4,500	1,125.00	5,062,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,700	324.00	4,114,800	
ＯＣＨＩホールディングス	3,900	1,206.00	4,703,400	

ＴＯＫＡＩホールディングス	32,600	856.00	27,905,600	
ミサワ	8,000	613.00	4,904,000	
ティーライフ	3,400	1,289.00	4,382,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	6,600	725.00	4,785,000	
三洋貿易	6,800	1,081.00	7,350,800	
シュッピン	4,900	1,217.00	5,963,300	
オイシックス・ラ・大地	8,900	1,960.00	17,444,000	
ウイン・パートナーズ	5,000	974.00	4,870,000	
ネクステージ	15,100	2,549.00	38,489,900	
ジョイフル本田	21,300	1,851.00	39,426,300	
鳥貴族ホールディングス	2,400	2,080.00	4,992,000	
ホットランド	5,000	1,444.00	7,220,000	
すかいらーくホールディングス	90,300	1,584.00	143,035,200	
ＳＦＰホールディングス	3,600	1,732.00	6,235,200	
綿半ホールディングス	5,100	1,313.00	6,696,300	
日本毛織	18,200	975.00	17,745,000	
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	1,128.00	24,252,000	
三栄建築設計	3,300	1,499.00	4,946,700	
野村不動産ホールディングス	38,400	2,982.00	114,508,800	
三重交通グループホールディングス	13,200	481.00	6,349,200	
サムティ	9,800	2,157.00	21,138,600	
ディア・ライフ	9,300	614.00	5,710,200	
コーセーアールイー	7,200	767.00	5,522,400	
地主	4,700	1,920.00	9,024,000	
プレサンスコーポレーション	8,100	1,480.00	11,988,000	
ハウスコム	4,000	1,058.00	4,232,000	
ＪＰＭＣ	4,800	1,010.00	4,848,000	
サンセイランディック	5,700	842.00	4,799,400	
エストラスト	8,700	585.00	5,089,500	
フージャースホールディングス	9,500	727.00	6,906,500	
オープンハウスグループ	22,500	5,170.00	116,325,000	
東急不動産ホールディングス	184,900	664.00	122,773,600	
飯田グループホールディングス	53,900	2,047.00	110,333,300	
ムゲンエステート	10,100	519.00	5,241,900	
帝国繊維	7,000	1,626.00	11,382,000	
日本コークス工業	56,500	86.00	4,859,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,400	1,543.00	5,246,200	
ＢＥＥＮＯＳ	3,700	2,303.00	8,521,100	
あさひ	5,500	1,347.00	7,408,500	
日本調剤	4,500	1,174.00	5,283,000	
コスモス薬品	7,500	13,670.00	102,525,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,700	2,634.00	62,425,800	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	3,090.00	8,034,000	
セブン&アイ・ホールディングス	227,700	5,585.00	1,271,704,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	49,700	911.00	45,276,700	
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	9,140.00	148,068,000	
サンマルクホールディングス	5,300	1,672.00	8,861,600	

フェリシモ	4,400	1,001.00	4,404,400	
トリドールホールディングス	16,400	2,706.00	44,378,400	
帝人	60,100	1,310.00	78,731,000	
東レ	419,100	754.60	316,252,860	
クラレ	99,400	1,098.00	109,141,200	
旭化成	390,600	965.40	377,085,240	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,000	256.00	3,584,000	
稲葉製作所	3,800	1,369.00	5,202,200	
宮地エンジニアリンググループ	1,800	3,350.00	6,030,000	
トーカロ	17,700	1,187.00	21,009,900	
アルファ	4,700	918.00	4,314,600	
ＳＵＭＣＯ	122,700	1,904.00	233,620,800	
川田テクノロジーズ	1,500	3,305.00	4,957,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,100	7,800.00	16,380,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,600	825.00	4,620,000	
シーアールイー	3,400	1,211.00	4,117,400	
ケイアイスター不動産	3,000	4,535.00	13,605,000	
グッドコムアセット	7,000	819.00	5,733,000	
ジェイ・エス・ビー	1,500	3,785.00	5,677,500	
ロードスターキャピタル	3,100	1,567.00	4,857,700	
日本フエルト	11,500	405.00	4,657,500	
イチカワ	3,500	1,308.00	4,578,000	
芦森工業	4,100	1,135.00	4,653,500	
アツギ	10,200	393.00	4,008,600	
ＪＭホールディングス	5,600	1,694.00	9,486,400	
コメダホールディングス	16,200	2,457.00	39,803,400	
アレンザホールディングス	5,100	985.00	5,023,500	
バロックジャパンリミテッド	6,100	808.00	4,928,800	
クスリのアオキホールディングス	6,600	8,210.00	54,186,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	37,900	2,666.00	101,041,400	
アセンテック	9,400	449.00	4,220,600	
セーレン	12,100	2,486.00	30,080,600	
ソトー	5,800	827.00	4,796,600	
東海染工	1,600	1,125.00	1,800,000	
小松マテーレ	9,100	765.00	6,961,500	
ワコールホールディングス	12,000	2,301.00	27,612,000	
ホギメディカル	8,400	3,400.00	28,560,000	
ＴＳＩホールディングス	22,400	434.00	9,721,600	
マツオカコーポレーション	5,300	1,063.00	5,633,900	
ワールド	8,000	1,235.00	9,880,000	
ＴＩＳ	70,400	3,540.00	249,216,000	
グリー	33,600	686.00	23,049,600	
コーエーテクモホールディングス	39,200	2,259.00	88,552,800	
三菱総合研究所	3,100	4,730.00	14,663,000	
ＡＧＳ	6,400	670.00	4,288,000	
ファインデックス	8,000	498.00	3,984,000	
ブレインパッド	6,200	784.00	4,860,800	
ＫＬａｂ	12,300	406.00	4,993,800	
ポールトゥウィンホールディングス	10,700	811.00	8,677,700	

ネクソン	161,800	2,871.00	464,527,800	
アイスタイル	20,000	553.00	11,060,000	
エムアップホールディングス	7,700	1,256.00	9,671,200	
エイチーム	6,400	769.00	4,921,600	
エニグモ	8,900	606.00	5,393,400	
コロプラ	24,300	635.00	15,430,500	
ブロードリーフ	36,600	418.00	15,298,800	
クロス・マーケティンググループ	5,600	693.00	3,880,800	
デジタルハーツホールディングス	3,900	1,793.00	6,992,700	
システム情報	5,500	860.00	4,730,000	
メディアドゥ	2,500	1,713.00	4,282,500	
じげん	18,300	364.00	6,661,200	
ブイキューブ	7,500	745.00	5,587,500	
サイバーリンクス	3,700	940.00	3,478,000	
フィックスターズ	7,100	1,222.00	8,676,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,000	1,562.00	4,686,000	
オプティム	5,400	1,041.00	5,621,400	
セレス	4,800	870.00	4,176,000	
ＳＨＩＦＴ	4,600	24,810.00	114,126,000	
特種東海製紙	3,100	2,765.00	8,571,500	
ティーガイア	6,500	1,683.00	10,939,500	
テクマトリックス	11,400	1,666.00	18,992,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,200	2,106.00	40,435,200	
GMOペイメントゲートウェイ	14,300	11,370.00	162,591,000	
インターネットイニシアティブ	34,900	2,409.00	84,074,100	
さくらインターネット	9,200	496.00	4,563,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	3,740.00	7,106,000	
ＳＲＡホールディングス	3,200	3,000.00	9,600,000	
朝日ネット	8,300	562.00	4,664,600	
ｅＢＡＳＥ	8,800	561.00	4,936,800	
アバントグループ	7,900	1,346.00	10,633,400	
アドソル日進	3,400	1,382.00	4,698,800	
フリービット	4,500	992.00	4,464,000	
コムチュア	8,300	2,494.00	20,700,200	
サイバーコム	600	1,416.00	849,600	
アステリア	6,100	716.00	4,367,600	
アイル	3,500	1,827.00	6,394,500	
王子ホールディングス	260,600	534.00	139,160,400	
日本製紙	32,600	952.00	31,035,200	
三菱製紙	8,100	280.00	2,268,000	
北越コーポレーション	39,500	770.00	30,415,000	
大王製紙	27,600	1,042.00	28,759,200	
阿波製紙	14,800	300.00	4,440,000	
マークラインズ	3,400	2,511.00	8,537,400	
メディカル・データ・ビジョン	9,300	914.00	8,500,200	
ｇｕｍｉ	10,200	712.00	7,262,400	
テラスカイ	2,700	2,571.00	6,941,700	

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,300	1,889.00	6,233,700	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,100	2,396.00	5,031,600	
ラクス	29,600	1,589.00	47,034,400	
ランドコンピュータ	5,500	904.00	4,972,000	
ダブルスタンダード	2,500	2,045.00	5,112,500	
オープンドア	4,400	1,718.00	7,559,200	
アカツキ	3,000	2,167.00	6,501,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	2,038.00	4,687,400	
カナミックネットワーク	9,000	569.00	5,121,000	
ノムラシステムコーポレーション	39,000	118.00	4,602,000	
レンゴー	57,000	908.00	51,756,000	
トーモク	3,600	1,598.00	5,752,800	
ザ・パック	4,600	2,388.00	10,984,800	
チェンジ	15,300	2,347.00	35,909,100	
シンクロ・フード	200	417.00	83,400	
オークネット	3,300	1,787.00	5,897,100	
キャピタル・アセット・プランニング	7,600	573.00	4,354,800	
マクロミル	14,200	1,039.00	14,753,800	
ビーグリー	3,500	1,184.00	4,144,000	
オロ	3,100	1,783.00	5,527,300	
ユーザーローカル	3,100	1,378.00	4,271,800	
マネーフォワード	15,100	4,120.00	62,212,000	
昭和電工	60,400	2,131.00	128,712,400	
住友化学	464,000	472.00	219,008,000	
住友精化	2,600	4,140.00	10,764,000	
日産化学	29,700	6,190.00	183,843,000	
ラサ工業	2,400	1,895.00	4,548,000	
クレハ	5,300	8,200.00	43,460,000	
多木化学	2,400	4,690.00	11,256,000	
テイカ	4,200	1,181.00	4,960,200	
石原産業	11,300	1,061.00	11,989,300	
片倉コープアグリ	3,900	1,532.00	5,974,800	
日本曹達	6,700	4,235.00	28,374,500	
東ソー	83,500	1,588.00	132,598,000	
トクヤマ	20,200	1,838.00	37,127,600	
セントラル硝子	10,000	3,045.00	30,450,000	
東亞合成	32,200	1,113.00	35,838,600	
大阪ソーダ	3,700	3,995.00	14,781,500	
関東電化工業	12,100	928.00	11,228,800	
デンカ	22,700	3,080.00	69,916,000	
イビデン	36,200	4,835.00	175,027,000	
信越化学工業	107,000	16,920.00	1,810,440,000	
日本カーバイド工業	3,500	1,259.00	4,406,500	
電算システムホールディングス	3,000	2,168.00	6,504,000	
堺化学工業	4,800	1,790.00	8,592,000	
第一稀元素化学工業	5,700	1,044.00	5,950,800	
エア・ウォーター	59,000	1,527.00	90,093,000	
日本酸素ホールディングス	60,700	2,014.00	122,249,800	
日本化学工業	2,600	1,749.00	4,547,400	

日本パーカライジング	31,000	946.00	29,326,000	
高圧ガス工業	9,100	654.00	5,951,400	
四国化成工業	7,400	1,305.00	9,657,000	
ステラ　ケミファ	3,700	2,501.00	9,253,700	
保土谷化学工業	1,800	2,855.00	5,139,000	
日本触媒	9,500	5,300.00	50,350,000	
大日精化工業	4,300	1,695.00	7,288,500	
カネカ	14,300	3,295.00	47,118,500	
協和キリン	75,700	3,040.00	230,128,000	
三菱瓦斯化学	46,700	1,860.00	86,862,000	
三井化学	52,600	3,065.00	161,219,000	
ＪＳＲ	58,400	2,731.00	159,490,400	
東京応化工業	10,900	6,450.00	70,305,000	
大阪有機化学工業	4,700	1,961.00	9,216,700	
三菱ケミカルグループ	422,100	695.70	293,654,970	
ＫＨネオケム	10,400	2,653.00	27,591,200	
ダイセル	92,000	977.00	89,884,000	
住友ベークライト	9,300	4,035.00	37,525,500	
積水化学工業	129,900	1,892.00	245,770,800	
日本ゼオン	37,500	1,326.00	49,725,000	
アイカ工業	15,800	3,215.00	50,797,000	
ＵＢＥ	32,200	1,946.00	62,661,200	
積水樹脂	9,100	1,773.00	16,134,300	
タキロンシーアイ	13,700	506.00	6,932,200	
旭有機材	4,200	2,718.00	11,415,600	
ニチバン	3,900	1,794.00	6,996,600	
リケンテクノス	13,500	481.00	6,493,500	
大倉工業	2,900	1,980.00	5,742,000	
積水化成品工業	12,500	391.00	4,887,500	
群栄化学工業	2,000	2,332.00	4,664,000	
ダイキョーニシカワ	13,800	560.00	7,728,000	
森六ホールディングス	3,200	1,699.00	5,436,800	
恵和	2,000	3,150.00	6,300,000	
日本化薬	47,800	1,168.00	55,830,400	
カーリットホールディングス	7,200	772.00	5,558,400	
ＣＬホールディングス	5,700	786.00	4,480,200	
プレステージ・インターナショナル	27,000	691.00	18,657,000	
プロトコーポレーション	7,800	1,221.00	9,523,800	
アミューズ	3,500	1,725.00	6,037,500	
野村総合研究所	128,500	3,115.00	400,277,500	
ドリームインキュベータ	2,100	2,225.00	4,672,500	
サイバネットシステム	5,200	902.00	4,690,400	
クイック	4,900	1,993.00	9,765,700	
ＴＡＣ	22,800	209.00	4,765,200	
ＣＥホールディングス	9,700	547.00	5,305,900	
電通グループ	67,300	4,105.00	276,266,500	
インテージホールディングス	8,500	1,392.00	11,832,000	
ぴあ	2,200	3,080.00	6,776,000	
イオンファンタジー	2,800	2,735.00	7,658,000	
ソースネクスト	31,800	276.00	8,776,800	

シーティーエス	7,100	848.00	6,020,800	
インフォコム	8,100	1,966.00	15,924,600	
メディカルシステムネットワーク	11,800	402.00	4,743,600	
日本精化	3,600	2,279.00	8,204,400	
扶桑化学工業	5,800	3,475.00	20,155,000	
トリケミカル研究所	8,300	2,065.00	17,139,500	
シンプレクス・ホールディングス	10,500	2,100.00	22,050,000	
ＨＥＲＯＺ	4,400	971.00	4,272,400	
ラクスル	8,800	3,300.00	29,040,000	
メルカリ	28,200	2,668.00	75,237,600	
ＩＰＳ	2,000	2,769.00	5,538,000	
ＦＩＧ	12,000	419.00	5,028,000	
ＡＤＥＫＡ	21,800	2,178.00	47,480,400	
日油	19,300	5,410.00	104,413,000	
ミヨシ油脂	3,300	984.00	3,247,200	
新日本理化	5,800	242.00	1,403,600	
ハリマ化成グループ	5,800	825.00	4,785,000	
イーソル	7,600	813.00	6,178,800	
アルテリア・ネットワークス	5,800	1,234.00	7,157,200	
ウイングアーク１ｓｔ	6,400	2,100.00	13,440,000	
サーバーワークス	1,900	2,440.00	4,636,000	
トビラシステムズ	4,900	852.00	4,174,800	
Ｓａｎｓａｎ	23,400	1,457.00	34,093,800	
ギフティ	6,700	2,110.00	14,137,000	
花王	152,300	5,301.00	807,342,300	
第一工業製薬	2,600	1,869.00	4,859,400	
石原ケミカル	3,900	1,230.00	4,797,000	
日華化学	5,500	864.00	4,752,000	
三洋化成工業	3,800	4,030.00	15,314,000	
ベース	2,100	3,420.00	7,182,000	
ＪＭＤＣ	10,300	4,325.00	44,547,500	
武田薬品工業	554,200	4,072.00	2,256,702,400	
アステラス製薬	600,200	2,071.50	1,243,314,300	
住友ファーマ	46,500	1,009.00	46,918,500	
塩野義製薬	80,000	6,675.00	534,000,000	
わかもと製薬	5,400	223.00	1,204,200	
日本新薬	14,800	7,470.00	110,556,000	
中外製薬	196,000	3,452.00	676,592,000	
科研製薬	10,700	3,885.00	41,569,500	
エーザイ	76,200	9,038.00	688,695,600	
理研ビタミン	5,300	1,783.00	9,449,900	
ロート製薬	30,300	4,485.00	135,895,500	
小野薬品工業	120,800	3,357.00	405,525,600	
久光製薬	13,900	3,785.00	52,611,500	
有機合成薬品工業	15,800	288.00	4,550,400	
持田製薬	7,500	3,400.00	25,500,000	
参天製薬	121,600	1,098.00	133,516,800	
扶桑薬品工業	2,400	1,998.00	4,795,200	
ツムラ	19,700	2,960.00	58,312,000	
テルモ	195,100	3,785.00	738,453,500	

Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	18,800	2,744.00	51,587,200	
キッセイ薬品工業	9,700	2,518.00	24,424,600	
生化学工業	11,900	927.00	11,031,300	
栄研化学	10,200	1,785.00	18,207,000	
鳥居薬品	3,400	2,856.00	9,710,400	
ＪＣＲファーマ	21,200	1,707.00	36,188,400	
東和薬品	9,600	2,095.00	20,112,000	
富士製薬工業	4,500	980.00	4,410,000	
ゼリア新薬工業	8,700	2,256.00	19,627,200	
第一三共	545,600	4,317.00	2,355,355,200	
キョーリン製薬ホールディングス	13,600	1,719.00	23,378,400	
大幸薬品	11,400	420.00	4,788,000	
ダイト	4,700	2,473.00	11,623,100	
大塚ホールディングス	143,300	4,450.00	637,685,000	
大正製薬ホールディングス	13,900	5,730.00	79,647,000	
ペプチドリーム	30,400	1,578.00	47,971,200	
大日本塗料	7,600	754.00	5,730,400	
日本ペイントホールディングス	276,800	1,075.00	297,560,000	
関西ペイント	57,300	1,665.00	95,404,500	
中国塗料	11,600	979.00	11,356,400	
藤倉化成	12,300	407.00	5,006,100	
太陽ホールディングス	9,500	2,344.00	22,268,000	
ＤＩＣ	24,400	2,402.00	58,608,800	
サカタインクス	13,900	1,089.00	15,137,100	
東洋インキＳＣホールディングス	12,200	1,871.00	22,826,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,600	1,089.00	6,098,400	
アルプス技研	5,600	2,069.00	11,586,400	
日本空調サービス	6,900	693.00	4,781,700	
オリエンタルランド	67,900	18,540.00	1,258,866,000	
フォーカスシステムズ	4,800	976.00	4,684,800	
ダスキン	14,300	2,958.00	42,299,400	
パーク２４	47,900	2,122.00	101,643,800	
明光ネットワークジャパン	8,400	618.00	5,191,200	
ファルコホールディングス	2,900	1,717.00	4,979,300	
クレスコ	4,800	1,722.00	8,265,600	
フジ・メディア・ホールディングス	60,200	1,054.00	63,450,800	
秀英予備校	11,100	432.00	4,795,200	
ラウンドワン	53,700	495.00	26,581,500	
リゾートトラスト	25,300	2,313.00	58,518,900	
オービック	20,900	19,880.00	415,492,000	
ジャストシステム	9,000	2,864.00	25,776,000	
ＴＤＣソフト	5,300	1,469.00	7,785,700	
Ｚホールディングス	891,300	340.60	303,576,780	
ビー・エム・エル	8,000	3,360.00	26,880,000	
トレンドマイクロ	36,200	6,180.00	223,716,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,600	994.00	10,536,400	
ＩＤホールディングス	5,300	896.00	4,748,800	
リソー教育	29,200	348.00	10,161,600	
日本オラクル	12,000	7,890.00	94,680,000	
早稲田アカデミー	4,300	1,098.00	4,721,400	

アルファシステムズ	2,000	3,970.00	7,940,000	
フューチャー	15,600	1,618.00	25,240,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,800	1,459.00	5,544,200	
ＳＢテクノロジー	2,700	1,893.00	5,111,100	
トーセ	6,200	738.00	4,575,600	
ユー・エス・エス	66,000	2,148.00	141,768,000	
オービックビジネスコンサルタント	12,300	4,235.00	52,090,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	33,600	3,085.00	103,656,000	
アイティフォー	8,200	833.00	6,830,600	
東京個別指導学院	9,300	526.00	4,891,800	
東計電算	900	5,510.00	4,959,000	
サイバーエージェント	153,600	1,126.00	172,953,600	
楽天グループ	296,900	582.00	172,795,800	
エックスネット	4,800	995.00	4,776,000	
クリーク・アンド・リバー社	3,800	2,005.00	7,619,000	
モーニングスター	10,700	459.00	4,911,300	
テー・オー・ダブリュー	15,700	294.00	4,615,800	
大塚商会	35,500	4,190.00	148,745,000	
サイボウズ	8,600	2,326.00	20,003,600	
山田コンサルティンググループ	4,200	1,126.00	4,729,200	
セントラルスポーツ	2,400	2,354.00	5,649,600	
電通国際情報サービス	7,600	3,980.00	30,248,000	
ＡＣＣＥＳＳ	7,400	842.00	6,230,800	
デジタルガレージ	11,100	4,085.00	45,343,500	
イーエムシステムズ	10,400	799.00	8,309,600	
ウェザーニューズ	2,200	7,040.00	15,488,000	
ＣＩＪ	6,000	904.00	5,424,000	
日本エンタープライズ	30,300	132.00	3,999,600	
WOWOW	4,000	1,204.00	4,816,000	
スカラ	6,600	728.00	4,804,800	
フルキャストホールディングス	6,100	2,859.00	17,439,900	
エン・ジャパン	11,600	2,254.00	26,146,400	
あすか製薬ホールディングス	6,500	1,240.00	8,060,000	
サワイグループホールディングス	14,300	4,065.00	58,129,500	
富士フイルムホールディングス	120,200	6,822.00	820,004,400	
コニカミノルタ	140,900	529.00	74,536,100	
資生堂	130,800	6,074.00	794,479,200	
ライオン	75,100	1,482.00	111,298,200	
高砂香料工業	4,200	2,591.00	10,882,200	
マンダム	13,500	1,407.00	18,994,500	
ミルボン	9,300	5,560.00	51,708,000	
ファンケル	27,400	2,458.00	67,349,200	
コーセー	12,700	13,980.00	177,546,000	
コタ	5,200	1,674.00	8,704,800	
シーボン	2,900	1,580.00	4,582,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	32,100	1,817.00	58,325,700	
ノエビアホールディングス	5,600	5,780.00	32,368,000	
アジュバンホールディングス	5,000	940.00	4,700,000	
新日本製薬	3,600	1,332.00	4,795,200	
エステー	4,800	1,509.00	7,243,200	

アグロ　カネショウ	3,600	1,674.00	6,026,400	
コニシ	10,500	1,640.00	17,220,000	
長谷川香料	13,000	2,963.00	38,519,000	
星光ＰＭＣ	8,900	528.00	4,699,200	
小林製薬	19,200	8,340.00	160,128,000	
荒川化学工業	5,300	983.00	5,209,900	
メック	5,200	2,252.00	11,710,400	
日本高純度化学	2,100	2,487.00	5,222,700	
タカラバイオ	16,900	1,712.00	28,932,800	
ＪＣＵ	7,100	3,280.00	23,288,000	
新田ゼラチン	500	906.00	453,000	
ＯＡＴアグリオ	2,800	1,570.00	4,396,000	
デクセリアルズ	18,100	2,751.00	49,793,100	
アース製薬	5,700	5,130.00	29,241,000	
北興化学工業	6,300	824.00	5,191,200	
大成ラミック	2,000	2,960.00	5,920,000	
クミアイ化学工業	24,900	914.00	22,758,600	
日本農薬	11,500	710.00	8,165,000	
ニチレキ	7,400	1,249.00	9,242,600	
ユシロ化学工業	6,000	781.00	4,686,000	
富士石油	15,800	256.00	4,044,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	900	1,132.00	1,018,800	
出光興産	69,600	3,035.00	211,236,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,131,500	444.80	503,291,200	
コスモエネルギーホールディングス	23,800	3,570.00	84,966,000	
テスホールディングス	6,600	1,017.00	6,712,200	
インフロニア・ホールディングス	64,200	1,009.00	64,777,800	
横浜ゴム	35,600	2,114.00	75,258,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	36,000	1,546.00	55,656,000	
ブリヂストン	200,000	4,839.00	967,800,000	
住友ゴム工業	61,400	1,176.00	72,206,400	
藤倉コンポジット	2,600	825.00	2,145,000	
オカモト	3,500	3,735.00	13,072,500	
アキレス	4,100	1,258.00	5,157,800	
フコク	4,800	1,065.00	5,112,000	
ニッタ	6,400	2,881.00	18,438,400	
住友理工	12,100	597.00	7,223,700	
三ツ星ベルト	9,100	3,425.00	31,167,500	
バンドー化学	9,900	974.00	9,642,600	
ＡＧＣ	63,700	4,510.00	287,287,000	
日本板硝子	31,900	602.00	19,203,800	
有沢製作所	10,200	1,293.00	13,188,600	
日本電気硝子	25,600	2,465.00	63,104,000	
オハラ	3,900	1,056.00	4,118,400	
住友大阪セメント	8,800	3,110.00	27,368,000	
太平洋セメント	39,900	2,029.00	80,957,100	
日本ヒューム	7,800	649.00	5,062,200	
日本コンクリート工業	20,300	220.00	4,466,000	
三谷セキサン	2,600	3,775.00	9,815,000	
アジアパイルホールディングス	9,800	526.00	5,154,800	

東海カーボン	52,500	1,096.00	57,540,000	
日本カーボン	3,600	4,325.00	15,570,000	
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	3,975.00	12,322,500	
ＴＯＴＯ	41,300	4,585.00	189,360,500	
日本碍子	74,100	1,710.00	126,711,000	
日本特殊陶業	47,700	2,513.00	119,870,100	
ＭＡＲＵＷＡ	2,300	16,150.00	37,145,000	
品川リフラクトリーズ	1,800	3,770.00	6,786,000	
黒崎播磨	1,300	4,835.00	6,285,500	
ヨータイ	4,200	1,385.00	5,817,000	
ニッカトー	5,200	464.00	2,412,800	
フジミインコーポレーテッド	5,000	6,560.00	32,800,000	
クニミネ工業	3,100	822.00	2,548,200	
ニチアス	15,800	2,366.00	37,382,800	
日本製鉄	288,500	2,198.00	634,123,000	
神戸製鋼所	129,600	624.00	80,870,400	
中山製鋼所	13,300	750.00	9,975,000	
合同製鐵	3,200	2,025.00	6,480,000	
ＪＦＥホールディングス	172,200	1,535.00	264,327,000	
東京製鐵	18,100	1,204.00	21,792,400	
共英製鋼	7,300	1,234.00	9,008,200	
大和工業	10,600	4,495.00	47,647,000	
東京鐵鋼	3,400	1,373.00	4,668,200	
大阪製鐵	4,400	1,052.00	4,628,800	
淀川製鋼所	7,300	2,496.00	18,220,800	
丸一鋼管	19,600	2,745.00	53,802,000	
大同特殊鋼	8,100	4,290.00	34,749,000	
日本高周波鋼業	15,200	312.00	4,742,400	
日本冶金工業	4,700	4,150.00	19,505,000	
山陽特殊製鋼	6,400	2,129.00	13,625,600	
愛知製鋼	3,700	2,122.00	7,851,400	
大平洋金属	4,600	1,910.00	8,786,000	
新日本電工	41,200	365.00	15,038,000	
栗本鐵工所	3,100	1,750.00	5,425,000	
日本製鋼所	17,400	2,723.00	47,380,200	
三菱製鋼	5,000	990.00	4,950,000	
日亜鋼業	18,500	243.00	4,495,500	
日本精線	1,200	4,220.00	5,064,000	
エンビプロ・ホールディングス	300	724.00	217,200	
大紀アルミニウム工業所	9,200	1,239.00	11,398,800	
日本軽金属ホールディングス	17,400	1,497.00	26,047,800	
三井金属鉱業	18,700	3,075.00	57,502,500	
東邦亜鉛	3,800	2,066.00	7,850,800	
三菱マテリアル	43,000	2,085.00	89,655,000	
住友金属鉱山	74,700	4,588.00	342,723,600	
ＤＯＷＡホールディングス	14,500	4,210.00	61,045,000	
古河機械金属	9,400	1,301.00	12,229,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,500	4,075.00	38,712,500	
東邦チタニウム	11,700	3,015.00	35,275,500	

ＵＡＣＪ	9,000	2,156.00	19,404,000	
ＣＫサンエツ	1,600	3,980.00	6,368,000	
古河電気工業	21,500	2,600.00	55,900,000	
住友電気工業	222,500	1,537.50	342,093,750	
フジクラ	69,100	1,063.00	73,453,300	
昭和電線ホールディングス	7,200	1,751.00	12,607,200	
東京特殊電線	1,200	5,630.00	6,756,000	
タツタ電線	13,200	419.00	5,530,800	
平河ヒューテック	4,300	1,117.00	4,803,100	
いよぎんホールディングス	73,200	712.00	52,118,400	
しずおかフィナンシャルグループ	139,000	1,011.00	140,529,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	51,800	964.00	49,935,200	
リョービ	6,900	1,202.00	8,293,800	
アーレスティ	7,800	459.00	3,580,200	
アサヒホールディングス	26,100	1,959.00	51,129,900	
東洋製罐グループホールディングス	42,600	1,606.00	68,415,600	
ホッカンホールディングス	3,700	1,332.00	4,928,400	
コロナ	5,700	867.00	4,941,900	
横河ブリッジホールディングス	8,500	1,865.00	15,852,500	
三和ホールディングス	59,300	1,223.00	72,523,900	
文化シヤッター	18,500	1,087.00	20,109,500	
三協立山	8,800	535.00	4,708,000	
アルインコ	5,000	994.00	4,970,000	
ＬＩＸＩＬ	93,900	2,019.00	189,584,100	
日本フイルコン	9,800	450.00	4,410,000	
ノーリツ	9,500	1,474.00	14,003,000	
長府製作所	6,500	1,942.00	12,623,000	
リンナイ	11,700	9,730.00	113,841,000	
ユニプレス	11,200	779.00	8,724,800	
ダイニチ工業	7,200	656.00	4,723,200	
日東精工	9,300	505.00	4,696,500	
三洋工業	2,900	1,755.00	5,089,500	
岡部	10,400	711.00	7,394,400	
ジーテクト	7,200	1,450.00	10,440,000	
東プレ	11,400	1,159.00	13,212,600	
高周波熱錬	10,500	677.00	7,108,500	
東京製綱	5,400	827.00	4,465,800	
サンコール	2,500	628.00	1,570,000	
モリテックスチール	7,200	224.00	1,612,800	
パイオラックス	8,900	1,669.00	14,854,100	
エイチワン	7,900	623.00	4,921,700	
日本発条	57,000	854.00	48,678,000	
三浦工業	26,300	3,070.00	80,741,000	
タクマ	19,400	1,244.00	24,133,600	
テクノプロ・ホールディングス	43,000	3,495.00	150,285,000	
インターワークス	12,900	363.00	4,682,700	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,300	1,776.00	5,860,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,600	3,805.00	17,503,000	
三機サービス	4,800	900.00	4,320,000	

イー・ガーディアン	2,400	2,626.00	6,302,400	
リブセンス	1,800	283.00	509,400	
ジャパンマテリアル	19,600	2,278.00	44,648,800	
ベクトル	10,100	1,292.00	13,049,200	
ウチヤマホールディングス	15,900	269.00	4,277,100	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,176.00	6,232,800	
キャリアリンク	2,400	2,969.00	7,125,600	
ＩＢＪ	5,000	857.00	4,285,000	
アサンテ	3,200	1,582.00	5,062,400	
バリューＨＲ	5,600	1,566.00	8,769,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,900	4,530.00	26,727,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,075.00	5,052,500	
シグマクシス・ホールディングス	9,700	1,367.00	13,259,900	
ウィルグループ	5,300	1,195.00	6,333,500	
メドピア	5,000	1,501.00	7,505,000	
リクルートホールディングス	475,200	4,091.00	1,944,043,200	
エラン	8,500	933.00	7,930,500	
ツガミ	14,000	1,188.00	16,632,000	
オークマ	6,300	4,875.00	30,712,500	
芝浦機械	7,000	2,558.00	17,906,000	
アマダ	100,600	1,050.00	105,630,000	
アイダエンジニアリング	13,000	801.00	10,413,000	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	4,000	1,070.00	4,280,000	
ＦＵＪＩ	27,400	1,978.00	54,197,200	
牧野フライス製作所	7,000	4,485.00	31,395,000	
オーエスジー	30,100	1,873.00	56,377,300	
ダイジェット工業	5,300	822.00	4,356,600	
旭ダイヤモンド工業	18,200	683.00	12,430,600	
DMG森精機	38,200	1,788.00	68,301,600	
ソディック	17,400	726.00	12,632,400	
ディスコ	10,100	39,150.00	395,415,000	
日東工器	3,100	1,505.00	4,665,500	
日進工具	5,300	1,047.00	5,549,100	
パンチ工業	10,500	404.00	4,242,000	
日本郵政	841,300	1,099.00	924,588,700	
ベルシステム２４ホールディングス	8,600	1,354.00	11,644,400	
鎌倉新書	7,300	930.00	6,789,000	
ＳＭＮ	8,300	474.00	3,934,200	
エアトリ	4,100	2,372.00	9,725,200	
アトラエ	5,000	1,265.00	6,325,000	
ストライク	3,200	4,290.00	13,728,000	
ソラスト	17,700	716.00	12,673,200	
インソース	8,000	2,925.00	23,400,000	
豊田自動織機	45,700	7,370.00	336,809,000	
東洋機械金属	7,200	543.00	3,909,600	
エンシュウ	5,600	667.00	3,735,200	
島精機製作所	10,000	1,917.00	19,170,000	
オプトラン	9,300	2,374.00	22,078,200	
ＮＣホールディングス	2,200	2,004.00	4,408,800	

イワキ	4,200	1,224.00	5,140,800	
フリュー	6,600	1,140.00	7,524,000	
ヤマシンフィルタ	15,000	473.00	7,095,000	
日阪製作所	6,100	818.00	4,989,800	
やまびこ	10,300	1,128.00	11,618,400	
野村マイクロ・サイエンス	2,100	4,475.00	9,397,500	
平田機工	3,000	5,510.00	16,530,000	
ペガサスミシン製造	7,000	860.00	6,020,000	
マルマエ	3,000	1,578.00	4,734,000	
タツモ	3,500	1,654.00	5,789,000	
ナブテスコ	39,600	3,315.00	131,274,000	
三井海洋開発	7,900	1,346.00	10,633,400	
レオン自動機	6,600	1,080.00	7,128,000	
ＳＭＣ	20,500	58,320.00	1,195,560,000	
ホソカワミクロン	4,800	2,732.00	13,113,600	
ユニオンツール	2,800	3,300.00	9,240,000	
オイレス工業	8,800	1,463.00	12,874,400	
日精エー・エス・ビー機械	2,900	4,480.00	12,992,000	
サトーホールディングス	9,000	1,912.00	17,208,000	
技研製作所	6,600	3,015.00	19,899,000	
日本エアーテック	4,300	1,193.00	5,129,900	
カワタ	4,900	820.00	4,018,000	
日精樹脂工業	5,000	948.00	4,740,000	
小松製作所	295,500	3,014.00	890,637,000	
住友重機械工業	37,300	2,794.00	104,216,200	
日立建機	25,100	3,025.00	75,927,500	
日工	9,300	607.00	5,645,100	
巴工業	2,700	2,393.00	6,461,100	
井関農機	5,900	1,215.00	7,168,500	
ＴＯＷＡ	6,400	1,791.00	11,462,400	
北川鉄工所	3,800	1,167.00	4,434,600	
シンニッタン	14,800	218.00	3,226,400	
ローツェ	3,300	7,610.00	25,113,000	
タカキタ	9,600	444.00	4,262,400	
クボタ	333,700	1,900.50	634,196,850	
荏原実業	3,100	2,295.00	7,114,500	
三菱化工機	2,300	2,037.00	4,685,100	
月島機械	8,500	962.00	8,177,000	
帝国電機製作所	4,800	2,252.00	10,809,600	
新東工業	12,700	653.00	8,293,100	
澁谷工業	5,900	2,357.00	13,906,300	
アイチコーポレーション	8,900	776.00	6,906,400	
小森コーポレーション	14,600	813.00	11,869,800	
鶴見製作所	4,800	2,008.00	9,638,400	
荏原製作所	25,800	4,895.00	126,291,000	
石井鐵工所	1,700	2,409.00	4,095,300	
酉島製作所	5,400	1,439.00	7,770,600	
北越工業	6,300	1,266.00	7,975,800	
ダイキン工業	75,300	20,705.00	1,559,086,500	
オルガノ	8,700	3,035.00	26,404,500	

トーヨーカネツ	2,400	2,504.00	6,009,600	
栗田工業	35,300	5,650.00	199,445,000	
椿本チエイン	8,900	2,974.00	26,468,600	
大同工業	3,900	732.00	2,854,800	
日機装	15,600	990.00	15,444,000	
木村化工機	6,700	699.00	4,683,300	
レイズネクスト	8,900	1,248.00	11,107,200	
アネスト岩田	10,700	871.00	9,319,700	
ダイフク	32,500	6,450.00	209,625,000	
サムコ	2,100	3,700.00	7,770,000	
加藤製作所	6,000	712.00	4,272,000	
タダノ	33,300	940.00	31,302,000	
フジテック	23,100	3,140.00	72,534,000	
ＣＫＤ	17,400	1,947.00	33,877,800	
キトー	5,400	2,719.00	14,682,600	
平和	21,000	2,446.00	51,366,000	
理想科学工業	5,600	2,032.00	11,379,200	
ＳＡＮＫＹＯ	12,400	5,310.00	65,844,000	
日本金銭機械	6,900	1,060.00	7,314,000	
マースグループホールディングス	3,700	2,260.00	8,362,000	
フクシマガリレイ	4,600	4,090.00	18,814,000	
ダイコク電機	3,500	1,968.00	6,888,000	
竹内製作所	11,400	2,944.00	33,561,600	
アマノ	17,900	2,418.00	43,282,200	
ＪＵＫＩ	9,800	670.00	6,566,000	
ジャノメ	7,600	588.00	4,468,800	
ブラザー工業	84,300	2,030.00	171,129,000	
マックス	7,800	1,932.00	15,069,600	
モリタホールディングス	11,000	1,130.00	12,430,000	
グローリー	16,300	2,126.00	34,653,800	
新晃工業	6,400	1,418.00	9,075,200	
大和冷機工業	9,700	1,119.00	10,854,300	
セガサミーホールディングス	50,700	1,884.00	95,518,800	
リケン	2,500	2,234.00	5,585,000	
ＴＰＲ	7,400	1,207.00	8,931,800	
ツバキ・ナカシマ	15,500	1,012.00	15,686,000	
ホシザキ	40,600	4,500.00	182,700,000	
大豊工業	6,700	646.00	4,328,200	
日本精工	115,900	707.00	81,941,300	
ＮＴＮ	124,300	274.00	34,058,200	
ジェイテクト	56,100	934.00	52,397,400	
不二越	4,700	3,665.00	17,225,500	
ミネベアミツミ	109,700	2,118.00	232,344,600	
日本トムソン	15,400	549.00	8,454,600	
ＴＨＫ	36,400	2,581.00	93,948,400	
ユーシン精機	7,100	668.00	4,742,800	
前澤給装工業	5,300	939.00	4,976,700	
イーグル工業	7,000	1,055.00	7,385,000	
日本ピラー工業	5,800	2,755.00	15,979,000	
キッツ	23,200	801.00	18,583,200	

日立製作所	316,700	6,890.00	2,182,063,000	
東芝	121,400	4,365.00	529,911,000	
三菱電機	651,800	1,331.00	867,545,800	
富士電機	38,300	5,250.00	201,075,000	
東洋電機製造	5,300	846.00	4,483,800	
安川電機	74,700	4,280.00	319,716,000	
シンフォニア　テクノロジー	7,000	1,452.00	10,164,000	
明電舎	9,600	1,920.00	18,432,000	
オリジン	1,600	1,220.00	1,952,000	
山洋電気	2,700	5,730.00	15,471,000	
デンヨー	4,800	1,480.00	7,104,000	
ＰＨＣホールディングス	8,800	1,481.00	13,032,800	
ベイカレント・コンサルティング	50,800	4,520.00	229,616,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,900	1,804.00	3,427,600	
アイモバイル	4,000	1,128.00	4,512,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	22,800	1,594.00	36,343,200	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	10,800	335.00	3,618,000	
ウェルビー	5,700	716.00	4,081,200	
ミダックホールディングス	3,900	2,567.00	10,011,300	
キュービーネットホールディングス	3,600	1,319.00	4,748,400	
ＲＰＡホールディングス	17,300	267.00	4,619,100	
三櫻工業	9,500	619.00	5,880,500	
マキタ	78,500	3,145.00	246,882,500	
東芝テック	9,400	3,485.00	32,759,000	
芝浦メカトロニクス	1,200	10,410.00	12,492,000	
マブチモーター	15,700	3,865.00	60,680,500	
日本電産	153,200	7,359.00	1,127,398,800	
トレックス・セミコンダクター	3,000	2,702.00	8,106,000	
東光高岳	3,800	1,793.00	6,813,400	
ダブル・スコープ	20,600	1,439.00	29,643,400	
ダイヘン	5,700	3,925.00	22,372,500	
ヤーマン	12,300	1,341.00	16,494,300	
ＪＶＣケンウッド	57,400	387.00	22,213,800	
Ｉ－ＰＥＸ	3,600	1,228.00	4,420,800	
日新電機	15,100	1,266.00	19,116,600	
大崎電気工業	15,000	535.00	8,025,000	
オムロン	57,800	6,417.00	370,902,600	
日東工業	8,500	2,312.00	19,652,000	
ＩＤＥＣ	9,300	3,090.00	28,737,000	
不二電機工業	4,100	1,116.00	4,575,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	20,700	2,052.00	42,476,400	
サクサホールディングス	3,800	1,235.00	4,693,000	
メルコホールディングス	1,700	3,010.00	5,117,000	
日本電気	89,200	4,645.00	414,334,000	
富士通	62,800	17,460.00	1,096,488,000	
沖電気工業	28,500	705.00	20,092,500	
岩崎通信機	6,000	782.00	4,692,000	
電気興業	3,000	2,017.00	6,051,000	

サンケン電気	5,900	6,610.00	38,999,000	
アイホン	3,800	1,830.00	6,954,000	
ルネサスエレクトロニクス	411,300	1,218.00	500,963,400	
セイコーエプソン	84,000	1,985.00	166,740,000	
ワコム	50,000	602.00	30,100,000	
アルバック	15,000	5,830.00	87,450,000	
ＥＩＺＯ	4,600	3,340.00	15,364,000	
ジャパンディスプレイ	242,200	41.00	9,930,200	
日本信号	14,400	1,010.00	14,544,000	
京三製作所	13,200	402.00	5,306,400	
能美防災	8,500	1,552.00	13,192,000	
ホーチキ	4,700	1,387.00	6,518,900	
星和電機	10,400	445.00	4,628,000	
エレコム	15,100	1,353.00	20,430,300	
パナソニック　ホールディングス	745,000	1,189.50	886,177,500	
シャープ	75,900	956.00	72,560,400	
アンリツ	44,400	1,351.00	59,984,400	
富士通ゼネラル	17,900	3,080.00	55,132,000	
ソニーグループ	441,700	10,350.00	4,571,595,000	
ＴＤＫ	99,900	4,535.00	453,046,500	
帝国通信工業	3,200	1,363.00	4,361,600	
タムラ製作所	27,100	751.00	20,352,100	
アルプスアルパイン	56,300	1,239.00	69,755,700	
池上通信機	8,000	531.00	4,248,000	
日本電波工業	7,600	1,719.00	13,064,400	
メイコー	6,900	2,654.00	18,312,600	
ローランド　ディー．ジー．	3,500	2,917.00	10,209,500	
フォスター電機	6,000	827.00	4,962,000	
ＳＭＫ	1,800	2,336.00	4,204,800	
ヨコオ	5,000	2,218.00	11,090,000	
ホシデン	15,100	1,553.00	23,450,300	
ヒロセ電機	10,400	17,290.00	179,816,000	
日本航空電子工業	12,900	2,128.00	27,451,200	
ＴＯＡ	7,300	773.00	5,642,900	
マクセル	13,700	1,361.00	18,645,700	
古野電気	8,200	995.00	8,159,000	
スミダコーポレーション	5,800	1,416.00	8,212,800	
アイコム	2,400	2,593.00	6,223,200	
リオン	2,600	1,889.00	4,911,400	
横河電機	69,000	2,307.00	159,183,000	
新電元工業	2,400	3,015.00	7,236,000	
アズビル	43,600	3,480.00	151,728,000	
東亜ディーケーケー	5,400	820.00	4,428,000	
日本光電工業	28,800	3,100.00	89,280,000	
共和電業	11,800	355.00	4,189,000	
日本電子材料	4,100	1,404.00	5,756,400	
堀場製作所	13,900	6,000.00	83,400,000	
アドバンテスト	49,200	9,110.00	448,212,000	
小野測器	11,300	387.00	4,373,100	
エスペック	5,000	1,879.00	9,395,000	

キーエンス	62,500	53,370.00	3,335,625,000	
日置電機	3,300	6,290.00	20,757,000	
シスメックス	53,900	8,289.00	446,777,100	
日本マイクロニクス	10,300	1,367.00	14,080,100	
メガチップス	5,100	2,488.00	12,688,800	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,900	3,435.00	9,961,500	
澤藤電機	3,300	1,133.00	3,738,900	
デンソー	128,800	6,905.00	889,364,000	
原田工業	5,500	832.00	4,576,000	
コーセル	8,300	973.00	8,075,900	
イリソ電子工業	5,700	4,205.00	23,968,500	
オプテックスグループ	11,500	1,928.00	22,172,000	
千代田インテグレ	2,500	2,320.00	5,800,000	
レーザーテック	30,800	23,230.00	715,484,000	
スタンレー電気	44,400	2,548.00	113,131,200	
岩崎電気	2,000	2,324.00	4,648,000	
ウシオ電機	32,600	1,692.00	55,159,200	
岡谷電機産業	100	251.00	25,100	
日本セラミック	6,400	2,511.00	16,070,400	
遠藤照明	6,300	714.00	4,498,200	
古河電池	4,600	1,116.00	5,133,600	
山一電機	5,400	1,675.00	9,045,000	
図研	5,400	3,030.00	16,362,000	
日本電子	15,600	3,780.00	58,968,000	
カシオ計算機	46,500	1,293.00	60,124,500	
ファナック	61,300	20,090.00	1,231,517,000	
日本シイエムケイ	13,300	500.00	6,650,000	
エンプラス	1,800	4,035.00	7,263,000	
大真空	7,600	710.00	5,396,000	
ローム	28,900	10,090.00	291,601,000	
浜松ホトニクス	50,100	6,730.00	337,173,000	
三井ハイテック	6,500	6,660.00	43,290,000	
新光電気工業	22,100	3,470.00	76,687,000	
京セラ	97,000	6,723.00	652,131,000	
太陽誘電	30,400	4,000.00	121,600,000	
村田製作所	189,400	6,946.00	1,315,572,400	
双葉電子工業	11,900	539.00	6,414,100	
日東電工	45,500	7,890.00	358,995,000	
北陸電気工業	4,300	1,239.00	5,327,700	
東海理化電機製作所	17,600	1,418.00	24,956,800	
ニチコン	12,800	1,273.00	16,294,400	
日本ケミコン	6,200	1,640.00	10,168,000	
ＫＯＡ	9,500	1,962.00	18,639,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	28,500	386.00	11,001,000	
日立造船	51,700	830.00	42,911,000	
三菱重工業	110,300	5,394.00	594,958,200	
川崎重工業	47,100	3,105.00	146,245,500	
ＩＨＩ	39,700	3,855.00	153,043,500	
名村造船所	16,000	421.00	6,736,000	
マネジメントソリューションズ	3,500	3,725.00	13,037,500	

プロレド・パートナーズ	9,400	465.00	4,371,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	11,700	353.00	4,130,100	
カーブスホールディングス	19,700	889.00	17,513,300	
フォーラムエンジニアリング	5,700	840.00	4,788,000	
日本車輌製造	2,500	1,926.00	4,815,000	
三菱ロジスネクスト	10,000	799.00	7,990,000	
フルサト・マルカホールディングス	6,600	3,390.00	22,374,000	
ヤマエグループホールディングス	3,700	1,388.00	5,135,600	
ＦＰＧ	25,000	1,119.00	27,975,000	
島根銀行	9,900	464.00	4,593,600	
じもとホールディングス	8,400	409.00	3,435,600	
全国保証	16,100	4,990.00	80,339,000	
めぶきフィナンシャルグループ	305,200	323.00	98,579,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,000	1,189.00	5,945,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	2,444.00	19,307,600	
九州フィナンシャルグループ	108,200	428.00	46,309,600	
かんぽ生命保険	74,700	2,311.00	172,631,700	
ゆうちょ銀行	175,100	1,118.00	195,761,800	
富山第一銀行	15,300	591.00	9,042,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	339,000	526.00	178,314,000	
ジェイリース	2,100	2,826.00	5,934,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	38,900	893.00	34,737,700	
イントラスト	4,200	782.00	3,284,400	
アルヒ	12,600	1,001.00	12,612,600	
プレミアグループ	10,300	1,700.00	17,510,000	
日産自動車	887,100	428.00	379,678,800	
いすゞ自動車	181,500	1,652.00	299,838,000	
トヨタ自動車	3,428,900	1,845.00	6,326,320,500	
日野自動車	80,500	540.00	43,470,000	
三菱自動車工業	243,600	530.00	129,108,000	
エフテック	9,000	507.00	4,563,000	
武蔵精密工業	15,300	1,620.00	24,786,000	
日産車体	11,000	819.00	9,009,000	
新明和工業	19,600	1,052.00	20,619,200	
極東開発工業	11,000	1,370.00	15,070,000	
トピー工業	5,100	1,600.00	8,160,000	
ティラド	1,700	2,566.00	4,362,200	
曙ブレーキ工業	38,200	155.00	5,921,000	
タチエス	9,900	1,071.00	10,602,900	
ＮＯＫ	24,300	1,186.00	28,819,800	
フタバ産業	16,700	343.00	5,728,100	
ＫＹＢ	6,000	3,320.00	19,920,000	
大同メタル工業	12,200	480.00	5,856,000	
プレス工業	27,900	418.00	11,662,200	
ミクニ	13,600	323.00	4,392,800	
太平洋工業	14,300	1,039.00	14,857,700	
アイシン	48,200	3,575.00	172,315,000	

マツダ	206,600	999.00	206,393,400	
今仙電機製作所	2,500	651.00	1,627,500	
本田技研工業	507,600	3,120.00	1,583,712,000	
スズキ	114,700	4,470.00	512,709,000	
ＳＵＢＡＲＵ	197,600	2,127.00	420,295,200	
ヤマハ発動機	98,100	3,130.00	307,053,000	
小糸製作所	75,100	2,005.00	150,575,500	
エクセディ	10,200	1,595.00	16,269,000	
ミツバ	11,700	476.00	5,569,200	
豊田合成	18,200	2,058.00	37,455,600	
愛三工業	10,300	692.00	7,127,600	
盟和産業	4,800	912.00	4,377,600	
ヨロズ	5,900	703.00	4,147,700	
エフ・シー・シー	11,100	1,347.00	14,951,700	
シマノ	25,500	21,270.00	542,385,000	
テイ・エス　テック	28,600	1,563.00	44,701,800	
三十三フィナンシャルグループ	5,500	1,500.00	8,250,000	
第四北越フィナンシャルグループ	9,700	2,658.00	25,782,600	
ひろぎんホールディングス	80,200	642.00	51,488,400	
マーキュリアホールディングス	5,000	575.00	2,875,000	
おきなわフィナンシャルグループ	5,900	2,163.00	12,761,700	
ダイレクトマーケティングミックス	7,300	1,455.00	10,621,500	
ポピンズ	3,200	1,535.00	4,912,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,000	2,266.00	11,330,000	
十六フィナンシャルグループ	8,000	2,732.00	21,856,000	
北國フィナンシャルホールディングス	5,200	4,630.00	24,076,000	
ネットプロテクションズホールディングス	20,300	489.00	9,926,700	
プロクレアホールディングス	7,500	2,145.00	16,087,500	
あいちフィナンシャルグループ	8,600	2,208.00	18,988,800	
ジャムコ	3,400	1,556.00	5,290,400	
小野建	6,100	1,438.00	8,771,800	
はるやまホールディングス	11,000	432.00	4,752,000	
南陽	2,700	1,883.00	5,084,100	
ノジマ	21,600	1,347.00	29,095,200	
佐鳥電機	4,100	1,313.00	5,383,300	
カッパ・クリエイト	10,400	1,376.00	14,310,400	
伯東	3,800	4,085.00	15,523,000	
コンドーテック	5,100	972.00	4,957,200	
中山福	14,500	321.00	4,654,500	
ライトオン	6,600	597.00	3,940,200	
ナガイレーベン	8,300	2,020.00	16,766,000	
三菱食品	6,100	3,125.00	19,062,500	
良品計画	85,200	1,460.00	124,392,000	
松田産業	5,000	2,270.00	11,350,000	
第一興商	12,800	3,890.00	49,792,000	
メディパルホールディングス	68,500	1,752.00	120,012,000	
アドヴァングループ	6,300	843.00	5,310,900	
ＳＰＫ	3,400	1,383.00	4,702,200	
萩原電気ホールディングス	2,500	2,427.00	6,067,500	

アルビス	2,200	2,345.00	5,159,000	
アズワン	9,700	5,530.00	53,641,000	
スズデン	2,300	2,215.00	5,094,500	
シモジマ	4,700	915.00	4,300,500	
ドウシシャ	7,000	1,555.00	10,885,000	
小津産業	2,600	1,466.00	3,811,600	
コナカ	14,200	332.00	4,714,400	
高速	3,400	1,686.00	5,732,400	
ハウス　オブ　ローゼ	2,900	1,637.00	4,747,300	
Ｇ－７ホールディングス	8,200	1,505.00	12,341,000	
イオン北海道	9,800	1,124.00	11,015,200	
コジマ	12,700	602.00	7,645,400	
ヒマラヤ	4,900	926.00	4,537,400	
コーナン商事	8,900	3,295.00	29,325,500	
ネットワンシステムズ	23,300	3,335.00	77,705,500	
エコス	2,700	1,801.00	4,862,700	
ワタミ	8,000	996.00	7,968,000	
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	2,266.00	335,821,200	
丸文	5,900	935.00	5,516,500	
西松屋チェーン	14,600	1,434.00	20,936,400	
ゼンショーホールディングス	36,200	3,345.00	121,089,000	
ハピネット	5,600	1,884.00	10,550,400	
橋本総業ホールディングス	4,900	996.00	4,880,400	
日本ライフライン	19,400	911.00	17,673,400	
サイゼリヤ	11,000	2,940.00	32,340,000	
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	3,825.00	21,802,500	
魚力	2,300	2,097.00	4,823,100	
ＩＤＯＭ	20,000	683.00	13,660,000	
日本エム・ディ・エム	4,800	983.00	4,718,400	
フジ・コーポレーション	3,900	1,288.00	5,023,200	
ユナイテッドアローズ	7,100	1,753.00	12,446,300	
進和	4,400	1,951.00	8,584,400	
ダイトロン	2,600	2,358.00	6,130,800	
ハイデイ日高	9,800	1,933.00	18,943,400	
シークス	9,400	1,309.00	12,304,600	
コロワイド	30,400	1,742.00	52,956,800	
ピーシーデポコーポレーション	18,300	270.00	4,941,000	
田中商事	8,300	564.00	4,681,200	
オーハシテクニカ	3,400	1,385.00	4,709,000	
壱番屋	5,200	4,580.00	23,816,000	
白銅	2,400	2,417.00	5,800,800	
スギホールディングス	13,300	6,120.00	81,396,000	
薬王堂ホールディングス	3,700	2,644.00	9,782,800	
島津製作所	76,100	3,830.00	291,463,000	
ＪＭＳ	9,600	509.00	4,886,400	
長野計器	4,500	1,091.00	4,909,500	
ブイ・テクノロジー	3,100	2,575.00	7,982,500	
スター精密	11,900	1,673.00	19,908,700	

東京計器	4,800	1,322.00	6,345,600	
愛知時計電機	3,600	1,324.00	4,766,400	
インターアクション	3,800	1,504.00	5,715,200	
オーバル	6,800	462.00	3,141,600	
東京精密	13,700	4,430.00	60,691,000	
マニー	27,500	2,090.00	57,475,000	
ニコン	97,100	1,209.00	117,393,900	
トプコン	32,900	1,496.00	49,218,400	
オリンパス	390,400	2,443.50	953,942,400	
理研計器	3,900	4,380.00	17,082,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	10,700	8,810.00	94,267,000	
キヤノン電子	6,900	1,531.00	10,563,900	
タムロン	4,700	3,320.00	15,604,000	
ＨＯＹＡ	134,900	13,125.00	1,770,562,500	
シード	2,600	484.00	1,258,400	
ノーリツ鋼機	5,900	2,727.00	16,089,300	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	9,100	1,016.00	9,245,600	
朝日インテック	82,500	2,267.00	187,027,500	
キヤノン	342,600	2,989.00	1,024,031,400	
リコー	163,700	1,009.00	165,173,300	
シチズン時計	68,700	581.00	39,914,700	
リズム	1,200	1,670.00	2,004,000	
メニコン	21,400	2,836.00	60,690,400	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	25,700	120.00	3,084,000	
スノーピーク	10,700	2,158.00	23,090,600	
パラマウントベッドホールディングス	14,400	2,546.00	36,662,400	
トランザクション	4,800	1,155.00	5,544,000	
粧美堂	2,200	354.00	778,800	
ニホンフラッシュ	5,900	872.00	5,144,800	
前田工繊	6,800	3,005.00	20,434,000	
永大産業	18,700	220.00	4,114,000	
アートネイチャー	6,400	742.00	4,748,800	
バンダイナムコホールディングス	57,000	8,363.00	476,691,000	
アイフィスジャパン	7,000	609.00	4,263,000	
ＳＨＯＥＩ	6,600	5,260.00	34,716,000	
フランスベッドホールディングス	7,700	928.00	7,145,600	
マーベラス	10,200	657.00	6,701,400	
パイロットコーポレーション	9,800	4,685.00	45,913,000	
エイベックス	10,600	1,577.00	16,716,200	
フジシールインターナショナル	12,600	1,697.00	21,382,200	
タカラトミー	28,800	1,242.00	35,769,600	
広済堂ホールディングス	4,200	2,019.00	8,479,800	
レック	8,900	854.00	7,600,600	
プロネクサス	5,200	936.00	4,867,200	
大建工業	3,800	2,131.00	8,097,800	
きもと	5,500	224.00	1,232,000	
凸版印刷	81,700	2,029.00	165,769,300	
大日本印刷	74,100	2,687.00	199,106,700	
共同印刷	1,900	2,732.00	5,190,800	
ＮＩＳＳＨＡ	11,900	1,842.00	21,919,800	

藤森工業	4,900	3,120.00	15,288,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,300	2,101.00	9,034,300	
前澤化成工業	4,000	1,362.00	5,448,000	
未来工業	3,300	1,433.00	4,728,900	
アシックス	57,600	2,849.00	164,102,400	
ツツミ	2,500	1,911.00	4,777,500	
ＪＳＰ	4,400	1,479.00	6,507,600	
ニチハ	7,800	2,637.00	20,568,600	
ローランド	4,600	3,755.00	17,273,000	
エフピコ	11,800	3,520.00	41,536,000	
小松ウオール工業	2,700	1,804.00	4,870,800	
ヤマハ	39,400	5,040.00	198,576,000	
河合楽器製作所	1,800	2,533.00	4,559,400	
ピジョン	39,800	2,159.00	85,928,200	
天馬	5,300	2,049.00	10,859,700	
兼松サステック	3,000	1,570.00	4,710,000	
キングジム	5,500	880.00	4,840,000	
象印マホービン	18,600	1,622.00	30,169,200	
リンテック	12,500	2,174.00	27,175,000	
信越ポリマー	11,600	1,164.00	13,502,400	
東リ	23,200	221.00	5,127,200	
イトーキ	12,800	567.00	7,257,600	
任天堂	394,200	5,541.00	2,184,262,200	
三菱鉛筆	8,900	1,382.00	12,299,800	
松風	2,800	2,312.00	6,473,600	
タカラスタンダード	12,100	1,358.00	16,431,800	
コクヨ	30,100	1,861.00	56,016,100	
ナカバヤシ	9,300	483.00	4,491,900	
ニフコ	22,600	3,290.00	74,354,000	
グローブライド	5,000	2,562.00	12,810,000	
オカムラ	18,800	1,351.00	25,398,800	
バルカー	5,200	2,638.00	13,717,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,400	1,713.00	4,111,200	
伊藤忠商事	407,100	4,187.00	1,704,527,700	
丸紅	521,600	1,532.00	799,091,200	
スクロール	9,800	708.00	6,938,400	
ヨンドシーホールディングス	5,700	1,706.00	9,724,200	
長瀬産業	31,100	2,004.00	62,324,400	
蝶理	3,500	2,077.00	7,269,500	
豊田通商	57,900	5,110.00	295,869,000	
オンワードホールディングス	40,600	306.00	12,423,600	
三共生興	10,200	463.00	4,722,600	
兼松	25,700	1,501.00	38,575,700	
美津濃	6,200	2,765.00	17,143,000	
三井物産	483,400	3,926.00	1,897,828,400	
日本紙パルプ商事	3,500	4,900.00	17,150,000	
東京エレクトロン	44,100	41,590.00	1,834,119,000	
カメイ	7,000	1,183.00	8,281,000	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,390.00	4,063,000	
スターゼン	5,000	2,058.00	10,290,000	

セイコーグループ	9,700	2,946.00	28,576,200	
山善	17,800	998.00	17,764,400	
椿本興業	1,300	3,805.00	4,946,500	
住友商事	409,200	2,230.50	912,720,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	23,000	3,300.00	75,900,000	
内田洋行	2,900	4,320.00	12,528,000	
三菱商事	413,100	4,330.00	1,788,723,000	
第一実業	2,300	4,320.00	9,936,000	
キヤノンマーケティングジャパン	15,300	3,015.00	46,129,500	
西華産業	2,900	1,563.00	4,532,700	
佐藤商事	4,600	1,189.00	5,469,400	
菱洋エレクトロ	5,600	2,327.00	13,031,200	
東京産業	6,200	751.00	4,656,200	
ユアサ商事	5,900	3,520.00	20,768,000	
神鋼商事	1,700	4,540.00	7,718,000	
阪和興業	11,900	3,685.00	43,851,500	
正栄食品工業	4,400	3,780.00	16,632,000	
カナデン	5,300	1,098.00	5,819,400	
菱電商事	5,300	1,655.00	8,771,500	
ニプロ	52,100	1,018.00	53,037,800	
岩谷産業	15,000	5,730.00	85,950,000	
ナイス	2,900	1,360.00	3,944,000	
極東貿易	3,900	1,340.00	5,226,000	
アステナホールディングス	11,700	430.00	5,031,000	
兼松エレクトロニクス	4,000	4,215.00	16,860,000	
三愛オブリ	18,200	1,246.00	22,677,200	
稲畑産業	13,500	2,341.00	31,603,500	
ＧＳＩクレオス	3,800	1,414.00	5,373,200	
明和産業	8,800	670.00	5,896,000	
クワザワホールディングス	10,600	405.00	4,293,000	
ゴールドウイン	11,100	9,330.00	103,563,000	
ユニ・チャーム	130,500	5,207.00	679,513,500	
デサント	10,800	2,986.00	32,248,800	
ワキタ	12,100	1,181.00	14,290,100	
ヤマトインターナショナル	17,500	242.00	4,235,000	
東邦ホールディングス	16,400	2,132.00	34,964,800	
サンゲツ	16,600	2,097.00	34,810,200	
ミツウロコグループホールディングス	8,500	1,121.00	9,528,500	
シナネンホールディングス	2,100	3,685.00	7,738,500	
伊藤忠エネクス	16,400	1,013.00	16,613,200	
サンリオ	18,700	4,420.00	82,654,000	
サンワ　テクノス	3,400	1,525.00	5,185,000	
リョーサン	7,000	2,875.00	20,125,000	
新光商事	8,900	1,205.00	10,724,500	
トーホー	2,900	1,686.00	4,889,400	
三信電気	2,700	2,271.00	6,131,700	
東陽テクニカ	7,300	1,335.00	9,745,500	
モスフードサービス	9,700	3,070.00	29,779,000	
加賀電子	5,400	4,080.00	22,032,000	
三益半導体工業	5,800	2,439.00	14,146,200	

都築電気	3,600	1,260.00	4,536,000	
立花エレテック	4,800	1,762.00	8,457,600	
木曽路	10,000	2,086.00	20,860,000	
ＳＲＳホールディングス	10,900	861.00	9,384,900	
千趣会	12,200	397.00	4,843,400	
リテールパートナーズ	9,800	1,264.00	12,387,200	
ケーヨー	10,600	890.00	9,434,000	
上新電機	5,900	1,912.00	11,280,800	
日本瓦斯	35,400	2,146.00	75,968,400	
ロイヤルホールディングス	12,700	2,386.00	30,302,200	
東天紅	5,400	789.00	4,260,600	
いなげや	6,400	1,173.00	7,507,200	
チヨダ	6,600	753.00	4,969,800	
ライフコーポレーション	5,800	2,555.00	14,819,000	
リンガーハット	8,500	2,202.00	18,717,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	9,300	654.00	6,082,200	
ＡＯＫＩホールディングス	12,300	654.00	8,044,200	
オークワ	10,600	912.00	9,667,200	
コメリ	10,200	2,643.00	26,958,600	
青山商事	14,100	873.00	12,309,300	
しまむら	7,800	12,620.00	98,436,000	
高島屋	49,800	1,682.00	83,763,600	
松屋	11,200	998.00	11,177,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	32,200	1,165.00	37,513,000	
近鉄百貨店	2,100	2,457.00	5,159,700	
丸井グループ	48,700	2,178.00	106,068,600	
クレディセゾン	39,000	1,699.00	66,261,000	
アクシアル　リテイリング	4,500	3,305.00	14,872,500	
イオン	224,000	2,786.00	624,064,000	
イズミ	10,000	2,907.00	29,070,000	
平和堂	11,000	2,074.00	22,814,000	
フジ	10,100	1,801.00	18,190,100	
ヤオコー	7,500	6,790.00	50,925,000	
ゼビオホールディングス	9,000	914.00	8,226,000	
ケーズホールディングス	52,500	1,112.00	58,380,000	
ＰＡＬＴＡＣ	10,400	4,330.00	45,032,000	
三谷産業	16,100	309.00	4,974,900	
日産東京販売ホールディングス	4,800	287.00	1,377,600	
新生銀行	18,100	2,258.00	40,869,800	
あおぞら銀行	38,700	2,627.00	101,664,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,032,100	818.40	3,299,870,640	
りそなホールディングス	784,900	692.50	543,543,250	
三井住友トラスト・ホールディングス	113,900	4,439.00	505,602,100	
三井住友フィナンシャルグループ	449,400	4,974.00	2,235,315,600	
千葉銀行	171,400	914.00	156,659,600	
群馬銀行	119,300	476.00	56,786,800	
武蔵野銀行	7,900	1,963.00	15,507,700	
千葉興業銀行	11,400	431.00	4,913,400	
筑波銀行	27,000	218.00	5,886,000	
七十七銀行	19,700	2,030.00	39,991,000	

秋田銀行	4,100	1,839.00	7,539,900	
山形銀行	6,800	1,180.00	8,024,000	
岩手銀行	4,200	1,955.00	8,211,000	
東邦銀行	48,600	215.00	10,449,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	49,100	2,849.00	139,885,900	
スルガ銀行	54,200	428.00	23,197,600	
八十二銀行	126,200	526.00	66,381,200	
山梨中央銀行	6,300	1,084.00	6,829,200	
大垣共立銀行	11,700	1,800.00	21,060,000	
福井銀行	5,500	1,455.00	8,002,500	
清水銀行	3,400	1,523.00	5,178,200	
富山銀行	1,100	1,726.00	1,898,600	
滋賀銀行	10,200	2,653.00	27,060,600	
南都銀行	9,300	2,396.00	22,282,800	
百五銀行	57,900	354.00	20,496,600	
京都銀行	19,500	5,620.00	109,590,000	
紀陽銀行	22,000	1,454.00	31,988,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	39,100	914.00	35,737,400	
山陰合同銀行	38,500	747.00	28,759,500	
百十四銀行	5,600	1,790.00	10,024,000	
四国銀行	9,800	933.00	9,143,400	
阿波銀行	9,100	2,040.00	18,564,000	
大分銀行	3,700	1,942.00	7,185,400	
宮崎銀行	4,000	2,342.00	9,368,000	
佐賀銀行	3,600	1,614.00	5,810,400	
琉球銀行	14,100	840.00	11,844,000	
セブン銀行	220,300	264.00	58,159,200	
みずほフィナンシャルグループ	889,400	1,767.00	1,571,569,800	
山口フィナンシャルグループ	67,900	831.00	56,424,900	
芙蓉総合リース	5,700	8,460.00	48,222,000	
みずほリース	9,200	3,275.00	30,130,000	
東京センチュリー	11,500	4,495.00	51,692,500	
ＳＢＩホールディングス	89,000	2,605.00	231,845,000	
日本証券金融	24,700	1,076.00	26,577,200	
アイフル	101,900	399.00	40,658,100	
長野銀行	3,700	1,286.00	4,758,200	
名古屋銀行	4,100	3,220.00	13,202,000	
北洋銀行	93,200	242.00	22,554,400	
大光銀行	3,600	1,175.00	4,230,000	
愛媛銀行	8,300	876.00	7,270,800	
京葉銀行	28,600	561.00	16,044,600	
栃木銀行	28,200	302.00	8,516,400	
北日本銀行	2,600	1,968.00	5,116,800	
東和銀行	11,300	544.00	6,147,200	
リコーリース	5,800	3,640.00	21,112,000	
イオンフィナンシャルサービス	35,300	1,414.00	49,914,200	
アコム	109,800	314.00	34,477,200	
ジャックス	6,600	4,135.00	27,291,000	
オリエントコーポレーション	16,100	1,145.00	18,434,500	
オリックス	411,400	2,139.50	880,190,300	

三菱ＨＣキャピタル	239,800	647.00	155,150,600	
ジャフコ　グループ	20,500	2,310.00	47,355,000	
九州リースサービス	3,400	667.00	2,267,800	
トモニホールディングス	49,700	352.00	17,494,400	
大和証券グループ本社	439,800	585.00	257,283,000	
野村ホールディングス	1,132,600	476.20	539,344,120	
岡三証券グループ	54,000	384.00	20,736,000	
丸三証券	20,500	400.00	8,200,000	
東洋証券	20,400	277.00	5,650,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	66,900	351.00	23,481,900	
光世証券	5,100	365.00	1,861,500	
水戸証券	22,100	211.00	4,663,100	
いちよし証券	11,300	614.00	6,938,200	
松井証券	36,300	772.00	28,023,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	105,600	5,761.00	608,361,600	
日本取引所グループ	172,800	1,825.00	315,360,000	
マネックスグループ	68,700	402.00	27,617,400	
極東証券	7,900	583.00	4,605,700	
岩井コスモホールディングス	7,000	1,265.00	8,855,000	
アイザワ証券グループ	8,900	706.00	6,283,400	
フィデアホールディングス	6,400	1,365.00	8,736,000	
池田泉州ホールディングス	78,700	237.00	18,651,900	
アニコム　ホールディングス	20,900	590.00	12,331,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	138,700	4,108.00	569,779,600	
スパークス・グループ	6,900	1,678.00	11,578,200	
第一生命ホールディングス	313,100	2,885.50	903,450,050	
東京海上ホールディングス	619,300	2,891.50	1,790,705,950	
イー・ギャランティ	9,900	2,212.00	21,898,800	
アサックス	8,000	616.00	4,928,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,000	2,055.00	6,165,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	165,100	1,789.00	295,363,900	
アドバンスクリエイト	2,900	1,034.00	2,998,600	
三井不動産	267,300	2,441.50	652,612,950	
三菱地所	389,900	1,712.50	667,703,750	
平和不動産	10,000	3,855.00	38,550,000	
東京建物	58,600	1,742.00	102,081,200	
京阪神ビルディング	7,900	1,235.00	9,756,500	
住友不動産	111,200	3,187.00	354,394,400	
テーオーシー	11,100	665.00	7,381,500	
東京楽天地	1,100	4,085.00	4,493,500	
レオパレス２１	69,200	282.00	19,514,400	
スターツコーポレーション	8,800	2,613.00	22,994,400	
フジ住宅	8,600	643.00	5,529,800	
空港施設	9,100	510.00	4,641,000	
ゴールドクレスト	5,800	1,689.00	9,796,200	
リログループ	35,700	2,070.00	73,899,000	
エスリード	2,900	1,812.00	5,254,800	
日神グループホールディングス	11,300	436.00	4,926,800	

日本エスコン	13,800	818.00	11,288,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	31,100	368.00	11,444,800	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,800	783.00	4,541,400	
イオンモール	31,900	1,685.00	53,751,500	
ファースト住建	4,300	1,000.00	4,300,000	
カチタス	16,500	2,937.00	48,460,500	
東祥	4,500	1,104.00	4,968,000	
トーセイ	10,200	1,352.00	13,790,400	
穴吹興産	2,300	1,930.00	4,439,000	
サンフロンティア不動産	10,200	1,095.00	11,169,000	
ＦＪネクストホールディングス	6,500	948.00	6,162,000	
グランディハウス	8,700	540.00	4,698,000	
東武鉄道	68,600	3,130.00	214,718,000	
相鉄ホールディングス	20,600	2,155.00	44,393,000	
東急	175,100	1,659.00	290,490,900	
京浜急行電鉄	70,800	1,338.00	94,730,400	
小田急電鉄	94,700	1,701.00	161,084,700	
京王電鉄	33,000	4,865.00	160,545,000	
京成電鉄	40,300	3,760.00	151,528,000	
富士急行	7,700	4,785.00	36,844,500	
東日本旅客鉄道	105,900	7,537.00	798,168,300	
西日本旅客鉄道	79,800	5,647.00	450,630,600	
東海旅客鉄道	48,100	16,010.00	770,081,000	
西武ホールディングス	75,500	1,398.00	105,549,000	
鴻池運輸	10,600	1,549.00	16,419,400	
西日本鉄道	16,700	2,534.00	42,317,800	
ハマキョウレックス	4,900	3,230.00	15,827,000	
サカイ引越センター	3,000	4,440.00	13,320,000	
近鉄グループホールディングス	62,300	4,420.00	275,366,000	
阪急阪神ホールディングス	83,100	3,970.00	329,907,000	
南海電気鉄道	29,800	2,825.00	84,185,000	
京阪ホールディングス	25,800	3,410.00	87,978,000	
神戸電鉄	1,700	3,165.00	5,380,500	
名古屋鉄道	68,900	2,182.00	150,339,800	
山陽電気鉄道	4,700	2,104.00	9,888,800	
アルプス物流	5,000	1,117.00	5,585,000	
トランコム	1,800	7,570.00	13,626,000	
ヤマトホールディングス	79,800	2,205.00	175,959,000	
山九	15,900	4,885.00	77,671,500	
日新	4,700	2,044.00	9,606,800	
丸全昭和運輸	3,900	3,035.00	11,836,500	
センコーグループホールディングス	33,000	966.00	31,878,000	
トナミホールディングス	1,400	3,610.00	5,054,000	
ニッコンホールディングス	20,000	2,352.00	47,040,000	
日本石油輸送	1,300	2,190.00	2,847,000	
福山通運	5,200	3,195.00	16,614,000	
セイノーホールディングス	38,800	1,190.00	46,172,000	
神奈川中央交通	1,800	3,250.00	5,850,000	
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	1,517.00	22,755,000	

C&Fロジホールディングス	6,000	1,170.00	7,020,000	
日本郵船	166,800	3,143.00	524,252,400	
商船三井	109,900	3,325.00	365,417,500	
川崎汽船	53,100	2,725.00	144,697,500	
ＮＳユナイテッド海運	3,400	3,780.00	12,852,000	
明治海運	6,200	708.00	4,389,600	
飯野海運	22,900	923.00	21,136,700	
共栄タンカー	600	923.00	553,800	
九州旅客鉄道	44,100	2,894.00	127,625,400	
ＳＧホールディングス	119,600	1,974.00	236,090,400	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	23,300	7,820.00	182,206,000	
日本航空	153,100	2,652.00	406,021,200	
ＡＮＡホールディングス	169,600	2,819.50	478,187,200	
パスコ	1,200	1,328.00	1,593,600	
ＴＲＥホールディングス	13,500	1,474.00	19,899,000	
人・夢・技術グループ	2,900	1,801.00	5,222,900	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,700	3,500.00	5,950,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,300	3,425.00	11,302,500	
ＫＰＰグループホールディングス	15,400	785.00	12,089,000	
ナルミヤ・インターナショナル	5,600	864.00	4,838,400	
ブックオフグループホールディングス	3,900	1,315.00	5,128,500	
ギフトホールディングス	1,400	3,885.00	5,439,000	
三菱倉庫	13,400	3,120.00	41,808,000	
三井倉庫ホールディングス	5,800	3,600.00	20,880,000	
住友倉庫	17,100	1,966.00	33,618,600	
澁澤倉庫	2,500	2,048.00	5,120,000	
ヤマタネ	2,900	1,645.00	4,770,500	
東陽倉庫	16,500	248.00	4,092,000	
乾汽船	8,000	1,938.00	15,504,000	
日本トランスシティ	12,500	506.00	6,325,000	
中央倉庫	5,200	932.00	4,846,400	
安田倉庫	5,200	914.00	4,752,800	
東洋埠頭	3,800	1,279.00	4,860,200	
上組	31,000	2,728.00	84,568,000	
キユーソー流通システム	4,200	957.00	4,019,400	
東海運	13,300	277.00	3,684,100	
エーアイテイー	3,900	1,408.00	5,491,200	
日本コンセプト	2,700	1,581.00	4,268,700	
ＴＢＳホールディングス	32,100	1,505.00	48,310,500	
日本テレビホールディングス	55,400	1,027.00	56,895,800	
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	1,312.00	19,942,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	55,600	471.00	26,187,600	
テレビ東京ホールディングス	4,500	1,769.00	7,960,500	
日本ＢＳ放送	4,800	896.00	4,300,800	
ビジョン	8,200	1,280.00	10,496,000	
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,600	2,024.00	11,334,400	

コネクシオ	4,400	1,206.00	5,306,400	
日本通信	57,800	211.00	12,195,800	
日本電信電話	802,500	3,727.00	2,990,917,500	
ＫＤＤＩ	484,000	3,989.00	1,930,676,000	
ソフトバンク	1,006,100	1,484.00	1,493,052,400	
光通信	7,400	17,290.00	127,946,000	
エムティーアイ	9,400	508.00	4,775,200	
GMOインターネットグループ	23,300	2,373.00	55,290,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	16,400	274.00	4,493,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	33,100	2,465.00	81,591,500	
学研ホールディングス	10,400	922.00	9,588,800	
ゼンリン	10,700	815.00	8,720,500	
インプレスホールディングス	22,700	206.00	4,676,200	
東京電力ホールディングス	562,900	499.00	280,887,100	
中部電力	230,100	1,305.00	300,280,500	
関西電力	241,100	1,174.00	283,051,400	
中国電力	99,400	630.00	62,622,000	
北陸電力	58,900	531.00	31,275,900	
東北電力	152,700	663.00	101,240,100	
四国電力	53,300	726.00	38,695,800	
九州電力	143,900	695.00	100,010,500	
北海道電力	60,300	439.00	26,471,700	
沖縄電力	14,600	1,003.00	14,643,800	
電源開発	47,000	2,105.00	98,935,000	
エフオン	7,600	499.00	3,792,400	
イーレックス	11,100	2,328.00	25,840,800	
レノバ	16,600	2,516.00	41,765,600	
東京瓦斯	132,000	2,574.00	339,768,000	
大阪瓦斯	126,500	2,101.00	265,776,500	
東邦瓦斯	24,600	2,526.00	62,139,600	
北海道瓦斯	3,700	1,615.00	5,975,500	
広島ガス	7,900	337.00	2,662,300	
西部ガスホールディングス	5,900	1,663.00	9,811,700	
静岡ガス	14,200	1,081.00	15,350,200	
メタウォーター	7,800	1,683.00	13,127,400	
アイネット	3,800	1,257.00	4,776,600	
松竹	3,600	11,680.00	42,048,000	
東宝	39,200	5,070.00	198,744,000	
エイチ・アイ・エス	16,800	1,919.00	32,239,200	
東映	1,700	18,420.00	31,314,000	
ラックランド	2,000	2,936.00	5,872,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	196,500	1,917.00	376,690,500	
共立メンテナンス	11,000	5,610.00	61,710,000	
イチネンホールディングス	6,800	1,240.00	8,432,000	
建設技術研究所	3,300	3,320.00	10,956,000	
スペース	5,600	906.00	5,073,600	
アインホールディングス	9,100	5,970.00	54,327,000	
燦ホールディングス	2,800	1,719.00	4,813,200	
ピー・シー・エー	4,300	1,241.00	5,336,300	

東京テアトル	4,000	1,118.00	4,472,000	
タナベコンサルティンググループ	7,000	634.00	4,438,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,700	1,797.00	4,851,900	
ナガワ	1,700	7,000.00	11,900,000	
東京都競馬	5,400	3,680.00	19,872,000	
カナモト	11,800	2,283.00	26,939,400	
ＤＴＳ	13,800	3,070.00	42,366,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	6,020.00	189,630,000	
シーイーシー	8,800	1,543.00	13,578,400	
カプコン	62,200	4,185.00	260,307,000	
西尾レントオール	6,000	3,160.00	18,960,000	
アイ・エス・ビー	3,600	1,274.00	4,586,400	
日本空港ビルデング	21,800	6,230.00	135,814,000	
トランス・コスモス	8,000	3,235.00	25,880,000	
乃村工藝社	28,000	924.00	25,872,000	
ジャステック	3,800	1,173.00	4,457,400	
ＳＣＳＫ	51,100	2,014.00	102,915,400	
藤田観光	2,900	2,759.00	8,001,100	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,800	1,568.00	5,958,400	
日本管財	6,700	2,508.00	16,803,600	
トーカイ	5,700	1,904.00	10,852,800	
セコム	65,400	7,784.00	509,073,600	
ＮＳＷ	2,400	2,080.00	4,992,000	
セントラル警備保障	3,500	2,297.00	8,039,500	
アイネス	4,400	1,337.00	5,882,800	
丹青社	12,400	685.00	8,494,000	
メイテック	25,600	2,376.00	60,825,600	
ＴＫＣ	11,200	3,580.00	40,096,000	
富士ソフト	7,100	7,510.00	53,321,000	
応用地質	6,200	2,193.00	13,596,600	
船井総研ホールディングス	13,500	2,706.00	36,531,000	
ＮＳＤ	22,300	2,331.00	51,981,300	
進学会ホールディングス	14,600	300.00	4,380,000	
丸紅建材リース	2,500	1,719.00	4,297,500	
コナミグループ	26,800	5,760.00	154,368,000	
学究社	2,900	1,782.00	5,167,800	
ベネッセホールディングス	24,000	1,982.00	47,568,000	
イオンディライト	7,100	2,988.00	21,214,800	
ナック	5,200	919.00	4,778,800	
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,711.00	11,928,400	
ダイセキ	13,100	4,625.00	60,587,500	
ステップ	2,600	1,772.00	4,607,200	
日鉄物産	4,500	5,020.00	22,590,000	
泉州電業	3,300	3,195.00	10,543,500	
元気寿司	2,100	3,075.00	6,457,500	
トラスコ中山	13,900	2,076.00	28,856,400	
ヤマダホールディングス	270,900	469.00	127,052,100	
オートバックスセブン	23,000	1,424.00	32,752,000	
モリト	6,400	741.00	4,742,400	

アークランズ	9,700	1,493.00	14,482,100	
ニトリホールディングス	26,700	15,935.00	425,464,500	
グルメ杵屋	5,400	989.00	5,340,600	
愛眼	27,500	169.00	4,647,500	
吉野家ホールディングス	25,900	2,310.00	59,829,000	
加藤産業	8,000	3,410.00	27,280,000	
イノテック	4,200	1,266.00	5,317,200	
イエローハット	11,700	1,759.00	20,580,300	
松屋フーズホールディングス	3,100	3,935.00	12,198,500	
ＪＢＣＣホールディングス	4,600	1,874.00	8,620,400	
ＪＫホールディングス	5,200	997.00	5,184,400	
サガミホールディングス	10,600	1,191.00	12,624,600	
日伝	3,900	1,711.00	6,672,900	
関西フードマーケット	6,000	1,233.00	7,398,000	
ミロク情報サービス	5,700	1,408.00	8,025,600	
北沢産業	23,800	191.00	4,545,800	
杉本商事	2,900	1,950.00	5,655,000	
因幡電機産業	17,100	2,708.00	46,306,800	
王将フードサービス	4,400	5,980.00	26,312,000	
プレナス	7,300	2,635.00	19,235,500	
ミニストップ	4,800	1,421.00	6,820,800	
アークス	12,100	2,131.00	25,785,100	
バローホールディングス	12,600	1,770.00	22,302,000	
東テク	2,200	3,105.00	6,831,000	
ミスミグループ本社	99,700	3,070.00	306,079,000	
ベルク	3,300	5,640.00	18,612,000	
大　庄	4,100	1,031.00	4,227,100	
ファーストリテイリング	9,900	79,200.00	784,080,000	
ソフトバンクグループ	362,100	5,726.00	2,073,384,600	
蔵王産業	2,600	1,700.00	4,420,000	
スズケン	24,100	3,650.00	87,965,000	
サンドラッグ	25,100	3,715.00	93,246,500	
サックスバー　ホールディングス	6,500	722.00	4,693,000	
ジェコス	5,900	788.00	4,649,200	
ヤマザワ	3,400	1,279.00	4,348,600	
やまや	1,900	2,457.00	4,668,300	
ベルーナ	15,900	673.00	10,700,700	
合計	73,178,800		171,861,245,710	

（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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	230,536,471
金銭信託	1,121,358
コール・ローン	108,136,604
国債証券	55,773,160,347
未収利息	331,827,654
前払費用	30,554,406
流動資産合計	56,475,336,840
資産合計	56,475,336,840
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	729,261
未払金	125,883,033
未払解約金	46,645,582
その他未払費用	317
流動負債合計	173,258,193
負債合計	173,258,193
純資産の部	
元本等	
元本	37,781,398,788
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,520,679,859
元本等合計	56,302,078,647
純資産合計	56,302,078,647
負債純資産合計	56,475,336,840

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,052,212,551円
	同期中追加設定元本額	11,683,437,323円
	同期中一部解約元本額	5,954,251,086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）	3,304,092,083円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,611,763,630円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,146,778,695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）	873,087,023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）	2,813,851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）	6,837,757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）	5,311,051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	14,507,090,467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）	4,270,011,413円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	3,346,998,828円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	204,765,084円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,797,172,356円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	237,750,190円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	458,411,028円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	72,883,582円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	179,287,503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）	19,477,010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）	42,690,164円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	148,970,707円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	99,611,331円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	218,749,571円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	200,892,569円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	14,912,474円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	11,040,421円
	計	37,781,398,788円
２．	受益権の総数	37,781,398,788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　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	137,640,011
合計	137,640,011

（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22日から2022年12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	37,065,637	－	36,336,376	△729,261
アメリカ・ドル	31,216,237	－	30,556,276	△659,961
オフショア・人民元	5,849,400	－	5,780,100	△69,300
合計	37,065,637	－	36,336,376	△729,261

（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12月20日現在
1口当たり純資産額	1.4902円
（1万口当たり純資産額）	(14,902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12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	132,472.80	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	129,098.40	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	190,473.10	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	105,941.00	
		US TREASURY N/B	460,000.00	387,674.20	
		US TREASURY N/B	170,000.00	187,916.30	
		US TREASURY N/B	650,000.00	557,908.00	
		US TREASURY N/B	450,000.00	434,317.50	
		US TREASURY N/B	460,000.00	452,147.80	
		US TREASURY N/B	4,550,000.00	4,454,177.00	
		US TREASURY N/B	6,530,000.00	6,346,572.30	
		US TREASURY N/B	5,680,000.00	5,492,730.40	
		US TREASURY N/B	610,000.00	542,540.10	
		US TREASURY N/B	6,140,000.00	5,912,574.40	
		US TREASURY N/B	5,760,000.00	5,498,496.00	
		US TREASURY N/B	4,830,000.00	4,607,916.60	
		US TREASURY N/B	390,000.00	349,108.50	
		US TREASURY N/B	490,000.00	472,712.80	
		US TREASURY N/B	450,000.00	417,109.50	
		US TREASURY N/B	510,000.00	443,995.80	
		US TREASURY N/B	670,000.00	533,407.10	
		US TREASURY N/B	330,000.00	286,829.40	
		US TREASURY N/B	450,000.00	382,585.50	
		US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,474,560.00	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,578,730.40	
		US TREASURY N/B	280,000.00	243,457.20	
		US TREASURY N/B	3,570,000.00	3,323,848.50	
		US TREASURY N/B	540,000.00	427,987.80	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	2,992,142.80	
		US TREASURY N/B	580,000.00	458,739.40	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,345,669.60	
		US TREASURY N/B	680,000.00	511,298.80	
		US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,470,908.80	
		US TREASURY N/B	310,000.00	263,233.40	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,635,443.00	
		US TREASURY N/B	3,460,000.00	3,251,708.00	
		US TREASURY N/B	610,000.00	529,101.80	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,967,983.50	
		US TREASURY N/B	3,910,000.00	3,684,080.20	
		US TREASURY N/B	470,000.00	407,687.40	
		US TREASURY N/B	2,090,000.00	2,013,255.20	
		US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,995,439.00	
		US TREASURY N/B	690,000.00	572,154.90	
		US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,914,579.00	
		US TREASURY N/B	4,160,000.00	3,881,113.60	
		US TREASURY N/B	160,000.00	174,486.40	

		US TREASURY N/B	670,000.00	555,858.80	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,423,509.20	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,812,640.00	
		US TREASURY N/B	150,000.00	165,855.00	
		US TREASURY N/B	770,000.00	670,254.20	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,389,725.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,436,475.00	
		US TREASURY N/B	840,000.00	749,103.60	
		US TREASURY N/B	160,000.00	156,931.20	
		US TREASURY N/B	240,000.00	257,652.00	
		US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,789,193.60	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,172,525.60	
		US TREASURY N/B	930,000.00	811,090.20	
		US TREASURY N/B	260,000.00	287,380.60	
		US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,701,735.00	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,200,034.80	
		US TREASURY N/B	920,000.00	861,239.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	304,718.40	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,827,477.00	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,041,140.00	
		US TREASURY N/B	980,000.00	858,989.60	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,447,955.60	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,466,837.50	
		US TREASURY N/B	290,000.00	324,933.40	
		US TREASURY N/B	970,000.00	831,163.90	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,897,177.10	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,001,554.00	
		US TREASURY N/B	900,000.00	676,791.00	
		US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,781,023.30	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,009,366.00	
		US TREASURY N/B	270,000.00	274,954.50	
		US TREASURY N/B	850,000.00	657,186.00	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,967,736.60	
		US TREASURY N/B	1,950,000.00	1,693,828.50	
		US TREASURY N/B	260,000.00	277,274.40	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	771,643.70	
		US TREASURY N/B	130,000.00	150,707.70	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,812,285.00	
		US TREASURY N/B	840,000.00	552,165.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	317,755.20	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	1,919,856.00	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,759,862.10	
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	845,661.60	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	671,704.20	
		US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,459,040.40	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	1,862,554.80	
		US TREASURY N/B	1,370,000.00	878,882.40	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	783,656.00	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,598,996.80	

	US TREASURY N/B	1,120,000.00	961,228.80	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,832,952.00	
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,059,921.00	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,029,892.70	
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,088,236.40	
	US TREASURY N/B	4,350,000.00	4,124,322.00	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,013,932.00	
	US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,883,553.30	
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,192,461.50	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,223,686.50	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,493,535.00	
	US TREASURY N/B	1,190,000.00	936,006.40	
	US TREASURY N/B	2,380,000.00	1,973,615.00	
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,091,587.50	
	US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,126,035.40	
	US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,986,941.70	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,214,167.20	
	US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,708,344.60	
	US TREASURY N/B	2,320,000.00	1,933,302.40	
	US TREASURY N/B	1,430,000.00	974,573.60	
	US TREASURY N/B	280,000.00	253,234.80	
	US TREASURY N/B	1,310,000.00	979,172.60	
	US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,701,962.00	
	US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,341,278.40	
	US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,900,832.40	
	US TREASURY N/B	1,290,000.00	963,759.00	
	US TREASURY N/B	290,000.00	261,756.90	
	US TREASURY N/B	1,070,000.00	853,111.00	
	US TREASURY N/B	270,000.00	238,158.90	
	US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,055,106.30	
	US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,019,282.60	
	US TREASURY N/B	940,000.00	862,741.40	
	US TREASURY N/B	2,040,000.00	1,902,300.00	
	US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,121,168.70	
	US TREASURY N/B	820,000.00	766,314.60	
	US TREASURY N/B	320,000.00	270,262.40	
	US TREASURY N/B	2,070,000.00	2,040,875.10	
	US TREASURY N/B	760,000.00	794,078.40	
	US TREASURY N/B	460,000.00	491,408.80	
	US TREASURY N/B	330,000.00	338,250.00	
	US TREASURY NOTES	150,000.00	174,498.00	
	WI TREASURY SEC.	270,000.00	293,106.60	
	WI TREASURY SEC.	1,230,000.00	713,633.70	
	WI TREASURY SEC.	1,660,000.00	1,341,678.40	
	WI TREASURY SEC.	260,000.00	281,489.00	
	WI TREASURY SEC.	260,000.00	258,151.40	
アメリカ・ドル　小計		233,080,000.00 (31,358,583,200)	210,668,301.30 (28,343,313,252)	

イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	335,871.20	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	312,480.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	354,883.20	
	UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	236,203.20	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	376,840.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	256,802.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	288,744.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	229,323.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	299,075.20	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	225,622.80	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	338,892.40	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	237,500.00	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	347,800.20	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	331,206.40	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	272,247.00	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	393,188.40	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	245,203.20	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	147,807.40	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	299,537.50	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	151,162.90	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	313,669.80	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	282,325.50	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	260,479.60	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	393,516.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	157,856.40	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	276,850.60	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	262,749.80	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	327,071.50	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	334,134.40	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	358,805.40	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	400,695.20	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	319,862.20	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	261,330.30	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	127,995.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	271,566.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	262,216.60	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	92,140.00	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	303,820.00	
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	644,540.00	
	UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	433,393.80	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	185,551.60	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	435,752.10	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	228,509.40	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	202,644.00	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	334,648.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	228,168.00	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	446,145.60	
	UNITED KINGDOM GILT	210,000.00	123,870.60	

	UNITED KINGDOM GILT	680,000.00	546,536.40	
	UNITED KINGDOM GILT	210,000.00	94,416.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	276,114.80	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	350,580.80	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	424,996.00	
	UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	183,150.00	
	UNITED KINGDOM GILT	120,000.00	118,738.80	
イギリス・ポンド　小計		18,530,000.00 (3,028,357,900)	15,945,230.20 (2,605,928,972)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	420,000.00	399,210.00	
	ISRAEL FIXED BOND	310,000.00	305,071.00	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	453,200.00	
	ISRAEL FIXED BOND	680,000.00	653,786.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	321,305.50	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	364,173.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	428,950.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	517,861.50	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	554,554.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	292,762.50	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	365,137.50	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	303,798.00	
	ISRAEL FIXED BOND	250,000.00	236,462.50	
	ISRAEL FIXED BOND	160,000.00	135,728.00	
イスラエル・シュケル　小計		5,430,000.00 (211,297,590)	5,331,999.50 (207,484,097)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	397,240.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	308,180.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	476,524.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	392,304.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	190,474.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	440,836.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	249,375.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	194,779.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	274,702.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	370,747.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	239,677.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	290,394.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	354,996.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	460,051.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	237,958.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	444,163.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	508,102.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	347,739.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	539,145.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	358,332.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	254,064.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	517,728.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	460,958.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	451,570.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	360,684.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	476,820.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	304,341.00	
オーストラリア・ドル　小計		10,760,000.00 (969,583,600)	9,901,889.00 (892,259,218)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,306,608.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	729,381.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,217,976.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,355,382.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,011,610.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,404,488.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,604,480.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,439,366.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,333,520.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	3,807,862.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,159,584.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,564,588.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,995,240.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,599,460.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,634,943.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,464,530.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,475,295.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,466,615.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,057,893.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,195,226.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,766,784.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	983,540.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,415,685.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	8,236,754.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,236,771.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,971,720.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,579,920.00	
オフショア・人民元　小計		101,070,000.00 (1,947,426,867)	101,015,222.50 (1,946,371,409)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	140,000.00	132,687.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	226,405.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	210,337.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	134,801.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	225,866.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	223,895.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	160,995.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	187,310.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	165,904.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	134,253.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	212,637.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	203,761.80	

		CANADIAN GOVERNMENT	840,000.00	680,828.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	125,760.70	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	127,452.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	173,617.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	598,832.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	142,822.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	527,626.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	500,166.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	336,244.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	391,681.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	760,000.00	682,138.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	342,460.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	275,618.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	467,821.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	640,000.00	570,572.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	316,244.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	310,000.00	299,084.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	239,075.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	309,961.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	463,240.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	96,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	326,894.70	
		CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	324,713.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	227,518.30	
		CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	337,907.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	286,554.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	164,312.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	80,220.00	
	カナダ・ドル　小計		12,460,000.00 (1,228,057,600)	11,634,826.90 (1,146,728,539)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	135,176.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	120,535.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	139,339.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	167,926.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	143,570.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	156,352.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	157,093.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	108,452.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	177,696.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	65,590.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	120,260.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	209,787.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	215,667.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	178,844.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	102,905.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	108,566.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	85,740.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	94,350.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	55,017.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	49,038.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	50,191.50	
シンガポール・ドル　小計		2,710,000.00 (268,777,800)	2,642,099.50 (262,043,428)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,610,000.00	1,606,989.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,770,000.00	1,683,836.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	1,098,579.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,350,000.00	1,255,918.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,430,000.00	1,311,038.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	890,000.00	1,089,965.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	915,021.20	
スウェーデン・クローナ　小計		9,190,000.00 (118,918,600)	8,961,348.60 (115,959,851)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	980,830.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,450,000.00	1,324,125.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,232,630.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,210,000.00	733,550.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,600,000.00	1,293,184.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,340,000.00	3,053,161.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,270,000.00	1,211,275.20	
デンマーク・クローネ　小計		10,270,000.00 (196,875,900)	9,828,756.90 (188,417,270)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	324,846.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	232,280.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	98,983.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	113,169.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	30,000.00	24,190.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	93,794.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	66,067.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	73,933.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	320,000.00	279,532.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	99,427.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	70,000.00	69,760.60	
ニュージーランド・ドル　小計		1,690,000.00 (144,309,100)	1,475,983.80 (126,034,257)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,430,000.00	1,427,683.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	1,215,787.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	980,000.00	936,693.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	940,000.00	898,085.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	850,368.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	827,949.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,074,468.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	800,000.00	698,184.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	770,000.00	720,435.10	
ノルウェー・クローネ　小計		9,150,000.00	8,649,654.70	

		(124,257,000)	(117,462,311)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	810,000.00	739,781.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	970,000.00	833,870.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	557,038.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	780,000.00	641,472.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	833,650.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000.00	778,407.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	850,000.00	783,564.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	171,243.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	583,402.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	519,418.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	690,000.00	536,820.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	680,000.00	448,630.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	640,000.00	562,636.80	
ポーランド・ズロチ　小計		9,580,000.00 (291,770,396)	7,989,934.20 (243,343,034)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	446,337.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	434,225.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	403,276.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	170,428.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	777,307.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	613,196.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	684,678.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	367,700.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	386,224.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	321,686.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	372,290.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	217,116.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	569,953.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	120,000.00	120,975.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	401,656.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	160,713.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	191,885.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	199,268.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	438,675.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	253,521.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	350,060.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	454,906.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	580,000.00	536,123.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	217,029.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	140,000.00	135,326.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	312,048.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	164,753.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	336,226.00	
マレーシア・リンギット　小計		10,020,000.00 (304,125,036)	10,037,591.10 (304,658,958)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,573,731.20	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,010,000.00	8,460,660.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,370,000.00	4,745,361.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,870,000.00	8,108,510.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	4,759,282.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	5,271,544.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,789,573.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,580,000.00	6,379,770.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,760,000.00	4,642,428.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,020,000.00	6,698,413.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,140,000.00	6,060,671.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,710,000.00	4,514,487.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,220,000.00	2,852,115.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,278,025.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,089,960.00	
メキシコ・ペソ　小計		73,230,000.00 (498,117,783)	69,224,535.80 (470,872,215)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	310,000.00	310,520.80	
	BELGIUM KINGDOM	410,000.00	495,005.30	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	224,244.00	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	208,097.50	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	201,322.00	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	322,721.40	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	266,720.00	
	BELGIUM KINGDOM	480,000.00	461,572.80	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	155,428.20	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	333,826.50	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	176,014.40	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	138,075.20	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	297,446.40	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	251,001.40	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	130,371.00	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	123,009.00	
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	483,151.20	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	320,547.50	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	189,945.80	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	351,908.70	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	175,713.10	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	223,970.40	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	116,053.20	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	177,290.00	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	430,554.20	
	BELGIUM KINGDOM	290,000.00	228,035.70	
	BELGIUM KINGDOM	110,000.00	52,690.00	
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	270,599.20	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	152,196.00	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	86,511.60	
	BONOS Y OBLIG DE	450,000.00	358,645.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	340,000.00	427,281.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	518,073.30	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	500,750.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	609,512.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	500,728.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	424,311.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	532,166.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	488,400.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	463,270.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	572,268.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	526,489.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	357,103.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	300,207.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	512,098.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	474,095.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	366,740.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	459,012.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	463,025.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	312,951.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	475,724.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	632,949.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	442,886.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	457,300.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	396,459.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	356,125.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	410,510.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	297,189.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	409,723.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	398,965.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	435,192.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	410,701.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	248,894.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	472,608.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	536,410.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	255,292.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	413,293.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	375,278.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	394,735.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	66,844.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	336,839.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	270,000.00	188,198.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	160,000.00	103,734.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	392,088.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	383,659.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	411,677.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	146,157.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	216,980.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	403,864.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	97,550.00	
		BUNDESOBLIGATION	470,000.00	450,668.90	
		BUNDESOBLIGATION	500,000.00	474,585.00	

		BUNDESOBLIGATION	520,000.00	488,482.80	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	94,269.00	
		BUNDESOBLIGATION	590,000.00	548,747.20	
		BUNDESOBLIGATION	520,000.00	505,310.00	
		BUNDESOBLIGATION	510,000.00	468,914.40	
		BUNDESOBLIGATION	460,000.00	418,250.40	
		BUNDESOBLIGATION	570,000.00	545,997.30	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	95,914.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	556,959.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	504,696.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	701,532.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	509,308.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	596,830.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	619,123.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	654,444.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	641,396.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	619,046.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	591,225.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	629,809.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	484,568.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	599,354.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	601,064.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	569,451.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	548,292.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	543,747.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	537,589.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	730,000.00	424,480.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	468,888.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	497,982.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	422,501.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	363,830.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	586,720.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	690,651.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	178,596.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	487,211.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	385,632.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	122,333.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	556,763.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	493,578.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	166,316.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	224,360.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	525,824.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	250,000.00	315,785.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	660,039.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000.00	201,160.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	507,517.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	160,000.00	159,049.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	75,504.80	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	372,023.80	

		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	470,000.00	457,098.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	350,000.00	339,220.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	367,372.60	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	130,000.00	129,421.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	394,804.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	500,004.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	565,975.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	396,314.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	435,309.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	310,241.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	547,331.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	554,245.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	420,352.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	503,208.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	414,645.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	423,794.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	693,472.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	281,163.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	442,002.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	282,247.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	413,496.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	143,548.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	325,115.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	359,331.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	491,875.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	327,841.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	373,728.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	257,985.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	506,880.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	693,843.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	473,815.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	276,306.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	275,682.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	445,306.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	250,824.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	550,128.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	416,480.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	498,883.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	500,235.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	232,521.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	212,832.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	542,880.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	405,554.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	310,728.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	443,992.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	400,622.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	236,775.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	349,326.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	402,164.40	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	450,416.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	206,871.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	319,575.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	219,453.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	343,031.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	166,913.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	406,934.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	60,404.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	283,825.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	311,620.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	557,507.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	266,380.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	353,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	460,985.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	369,200.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	410,738.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	341,624.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	343,587.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	347,461.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	598,221.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	276,063.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	306,967.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	381,724.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	291,858.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	122,208.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	288,420.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	145,128.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	279,737.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	217,614.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	298,893.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	279,921.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	129,436.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	332,797.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	162,334.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	199,968.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000.00	79,569.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000.00	69,025.60	
		DEUTSCHLAND REP	320,000.00	371,577.60	
		DEUTSCHLAND REP	270,000.00	319,747.50	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	339,189.00	
		DEUTSCHLAND REP	440,000.00	544,979.60	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	110,991.10	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	99,522.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	107,713.10	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	85,463.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	124,764.90	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	131,544.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	127,370.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	83,983.00	

		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	78,799.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	112,950.50	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	56,345.60	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	93,612.60	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	51,667.20	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	97,478.40	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	51,695.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	104,152.10	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	97,770.20	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	95,963.00	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	72,892.80	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	65,618.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	98,173.90	
		FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	76,076.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	1,123,686.30	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	714,594.00	
		FRANCE (GOVT OF)	620,000.00	653,213.40	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	690,095.70	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	797,032.00	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	817,599.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,210,000.00	1,209,104.60	
		FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	925,069.60	
		FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	757,965.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,210,000.00	1,116,406.50	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	962,688.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,070,000.00	1,001,605.60	
		FRANCE (GOVT OF)	320,000.00	246,038.40	
		FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	800,346.40	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	762,330.10	
		FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	564,735.60	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	779,785.00	
		FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	545,564.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,093,656.00	
		FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	718,003.50	
		FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,086,540.00	
		FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	843,073.50	
		FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	622,820.00	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	974,800.00	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	504,879.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,014,093.00	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	935,510.40	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	782,622.90	
		FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	396,057.10	
		FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	869,424.80	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	959,871.60	
		FRANCE (GOVT OF)	360,000.00	456,505.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	883,872.00	
		FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	341,776.50	
		FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	92,490.30	

		FRANCE (GOVT OF)	340,000.00	212,224.60	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	785,931.30	
		FRANCE (GOVT OF)	860,000.00	777,113.20	
		FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	631,754.50	
		FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	340,453.60	
		FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	577,074.20	
		FRANCE (GOVT OF)	580,000.00	548,825.00	
		FRANCE (GOVT OF)	120,000.00	95,144.40	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	921,435.20	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	622,200.00	
		FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	525,716.80	
		FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	514,731.00	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	92,881.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	172,165.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	187,946.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	207,939.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	239,307.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	120,971.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	165,684.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	95,642.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	127,621.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	192,517.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	128,431.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	82,281.10	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	244,577.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	136,168.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	133,328.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	150,894.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	53,360.80	
		IRISH GOVERNMENT BOND	100,000.00	80,134.00	
		ITALIAN GOVT	200,000.00	227,952.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	463,041.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	319,446.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	357,786.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	397,782.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	374,776.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	297,926.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	312,016.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	339,197.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	445,257.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	250,000.00	217,507.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	248,628.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	241,941.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	466,939.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	299,682.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	150,301.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	227,682.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	117,369.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	309,474.00	

		NETHERLANDS GOVERNMENT	260,000.00	224,850.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	157,845.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	232,733.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	93,924.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	173,102.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	99,782.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	168,812.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	226,738.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	280,627.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	310,698.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	141,958.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	275,922.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	40,000.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	97,333.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	233,050.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	210,422.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	357,191.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	228,670.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,356.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	206,322.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	105,772.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	66,909.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	41,905.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	224,288.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	34,927.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	160,486.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	92,341.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	231,033.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	111,697.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	194,966.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	67,019.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	108,212.50	
	ユーロ　小計		141,880,000.00 (20,237,763,200)	131,816,345.60 (18,802,283,536)	
国債証券　合計			60,928,221,572 (60,928,221,572)	55,773,160,347 (55,773,160,347)	
合計				55,773,160,347 (55,773,160,347)	

（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　141銘柄	50.34	50.82
イギリス・ポンド	国債証券　55銘柄	4.63	4.67
イスラエル・シュケル	国債証券　14銘柄	0.37	0.37

オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.58	1.60
オフショア・人民元	国債証券	27銘柄	3.46	3.49
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.04	2.06
シンガポール・ドル	国債証券	21銘柄	0.47	0.47
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.33	0.34
ニュージーランド・ドル	国債証券	11銘柄	0.22	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.43	0.44
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.54	0.55
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.84	0.84
ユーロ	国債証券	359銘柄	33.40	33.71

（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12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,645,398,186
金銭信託	76,269,701
コール・ローン	7,354,961,729
株式	530,189,806,408
投資証券	12,197,642,364
未収入金	239,883,549
未収配当金	501,379,945
差入委託証拠金	8,370,560,104
流動資産合計	561,575,901,986
資産合計	561,575,901,986
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	736,111,178
未払金	240,076,711
未払解約金	429,566,863
その他未払費用	7,184
流動負債合計	1,405,761,936
負債合計	1,405,761,936
純資産の部	
元本等	
元本	195,884,516,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	364,285,624,016
元本等合計	560,170,140,050
純資産合計	560,170,140,050
負債純資産合計	561,575,901,986

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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12月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	178,309,560,203円
同期中追加設定元本額	48,532,675,399円
同期中一部解約元本額	30,957,719,568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）	822,037,069円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,723,708,985円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,205,462,590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）	2,052,486,227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）	1,400,421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）	6,805,644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）	7,400,537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）	644,238,465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	144,408,213,043円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	33,931,490,127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）	2,125,403,981円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	299,775,264円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	178,834,346円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	342,211,221円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	625,220,647円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	16,868,522円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	89,243,784円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	6,511,907円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	8,993,093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）	3,864,532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）	21,172,042円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	219,121,500円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	144,812,171円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	312,177,684円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	221,778,338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）	195,601,380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）	200,716,746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）	196,996,913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）	193,061,557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）	193,026,421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）	173,795,704円
ニッセイ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	30,375,295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）	1,240,569,742円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	24,803,284円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	16,336,852円
計	195,884,516,034円
２．　受益権の総数	195,884,516,034口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△17,743,652,091
投資証券	△319,002,480
合計	△18,062,654,571

（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22日から2022年12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	6,148,256,650	－	6,063,483,440	△84,773,210
アメリカ・ドル	4,181,301,375	－	4,135,747,080	△45,554,295
イギリス・ポンド	631,246,864	－	613,568,960	△17,677,904
ユーロ	1,335,708,411	－	1,314,167,400	△21,541,011
合計	6,148,256,650	－	6,063,483,440	△84,773,210

（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12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	17,450,622,936	－	16,799,284,968	△651,337,968
合計	17,450,622,936	－	16,799,284,968	△651,337,968

（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12月20日現在
1口当たり純資産額	2.8597円
（1万口当たり純資産額）	(28,597円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年12月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	47,950	122.130	5,856,133.50	
	ABBOTT LABORATORIES	151,725	106.590	16,172,367.75	
	ABBVIE INC	153,215	161.490	24,742,690.35	
	ABIOMED INC	3,919	381.300	1,494,314.70	
	ACCENTURE PLC	54,780	255.400	13,990,812.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	67,807	75.990	5,152,653.93	
	ADOBE INC	40,521	328.760	13,321,683.96	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,201	140.900	732,820.90	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	139,863	64.590	9,033,751.17	
	AERCAP HOLDINGS NV	11,689	56.710	662,883.19	
	AES CORP	57,973	28.200	1,634,838.60	
	AFFIRM HOLDINGS INC	16,953	9.480	160,714.44	
	AFLAC INC	51,828	68.920	3,571,985.76	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,637	146.950	3,767,357.15	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,245	313.720	6,037,541.40	
	AIRBNB INC-CLASS A	32,834	85.930	2,821,425.62	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,783	84.070	1,158,736.81	
	ALBEMARLE CORP	10,145	233.340	2,367,234.30	
	ALCOA CORP	15,506	42.320	656,213.92	

ALIGN TECHNOLOGY INC	6,404	198.760	1,272,859.04	
ALLEGION PLC	7,696	104.570	804,770.72	
ALLIANT ENERGY CORP	21,750	54.290	1,180,807.50	
ALLSTATE CORP	23,372	130.990	3,061,498.28	
ALLY FINANCIAL INC	26,275	23.470	616,674.25	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,426	234.070	2,440,413.82	
ALPHABET INC-CL A	519,306	88.440	45,927,422.64	
ALPHABET INC-CL C	480,673	89.150	42,851,997.95	
ALTRIA GROUP INC	156,093	46.380	7,239,593.34	
AMAZON.COM INC	794,408	84.920	67,461,127.36	
AMCOR PLC	130,583	12.020	1,569,607.66	
AMEREN CORPORATION	22,427	87.300	1,957,877.10	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	44,573	94.000	4,189,862.00	
AMERICAN EXPRESS CO	55,231	145.010	8,009,047.31	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,190	132.430	819,741.70	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	65,497	61.470	4,026,100.59	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,725	151.480	2,382,023.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,324	306.570	2,858,458.68	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,547	167.220	2,265,329.34	
AMETEK INC	19,974	136.980	2,736,038.52	
AMGEN INC	46,359	265.700	12,317,586.30	
AMPHENOL CORP-CL A	51,767	75.950	3,931,703.65	
ANALOG DEVICES INC	44,658	165.140	7,374,822.12	
ANSYS INC	7,525	235.400	1,771,385.00	
AON PLC	18,262	297.060	5,424,909.72	
APA CORP	28,083	43.840	1,231,158.72	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,759	62.330	2,166,528.47	
APPLE INC	1,392,345	132.370	184,304,707.65	
APPLIED MATERIALS INC	74,513	103.990	7,748,606.87	
APTIV PLC	23,479	93.110	2,186,129.69	
ARAMARK	20,450	41.000	838,450.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,857	60.540	1,928,622.78	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,540	92.650	4,497,231.00	
ARES MANAGEMENT CORP - A	13,435	66.570	894,367.95	
ARISTA NETWORKS INC	21,080	122.550	2,583,354.00	
ARROW ELECTRONICS INC	5,441	101.900	554,437.90	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,206	185.090	3,369,748.54	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,522	199.970	504,324.34	
ASSURANT INC	4,620	122.950	568,029.00	
AT&T INC	617,490	17.860	11,028,371.40	
ATMOS ENERGY CORP	12,200	113.480	1,384,456.00	
AUTODESK INC	18,832	188.540	3,550,585.28	

AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	36,046	245.060	8,833,432.76	
AUTOZONE INC	1,687	2,379.170	4,013,659.79	
AVANTOR INC	58,540	20.300	1,188,362.00	
AVERY DENNISON CORP	7,039	176.480	1,242,242.72	
BAKER HUGHES COMPANY	87,862	28.260	2,482,980.12	
BALL CORP	27,275	50.610	1,380,387.75	
BANK OF AMERICA CORP	626,260	32.060	20,077,895.60	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,493	44.170	2,936,995.81	
BATH & BODY WORKS INC	19,588	40.340	790,179.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,813	49.950	2,188,459.35	
BECTON DICKINSON & CO	24,735	248.460	6,145,658.10	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	16,763	37.100	621,907.30	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	112,814	300.030	33,847,584.42	
BEST BUY CO INC	17,499	79.800	1,396,420.20	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,176	106.170	868,045.92	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,929	401.820	775,110.78	
BIO-TECHNE CORP	13,528	80.790	1,092,927.12	
BIOGEN INC	12,559	284.380	3,571,528.42	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,097	106.610	1,716,101.17	
BLACK KNIGHT INC	13,576	58.300	791,480.80	
BLACKROCK INC	13,045	692.470	9,033,271.15	
BLACKSTONE INC	60,708	73.480	4,460,823.84	
BLOCK INC	45,897	60.440	2,774,014.68	
BOEING CO	48,904	185.680	9,080,494.72	
BOOKING HOLDINGS INC	3,440	1,931.440	6,644,153.60	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,456	103.630	1,187,185.28	
BORGWARNER INC	20,661	40.620	839,249.82	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,111	45.800	5,684,283.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	185,152	73.160	13,545,720.32	
BROADCOM INC	35,004	549.630	19,239,248.52	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,219	133.210	1,361,272.99	
BROWN & BROWN INC	20,664	55.410	1,144,992.24	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	26,904	65.460	1,761,135.84	
BUNGE LIMITED	13,075	96.190	1,257,684.25	
BURLINGTON STORES INC	5,673	187.640	1,064,481.72	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,041	93.510	1,032,443.91	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	23,672	160.950	3,810,008.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,562	45.040	836,032.48	

CAMPBELL SOUP CO	18,259	56.830	1,037,658.97	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,131	87.870	2,911,220.97	
CARDINAL HEALTH INC	23,767	79.340	1,885,673.78	
CARLISLE COS INC	4,473	237.310	1,061,487.63	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,733	28.510	477,057.83	
CARMAX INC	13,777	58.090	800,305.93	
CARNIVAL CORP	86,118	8.090	696,694.62	
CARRIER GLOBAL CORP	72,912	41.500	3,025,848.00	
CATALENT INC	14,762	43.880	647,756.56	
CATERPILLAR INC	45,753	232.290	10,627,964.37	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,222	123.260	1,136,703.72	
CBRE GROUP INC	27,754	75.010	2,081,827.54	
CDW CORP/DE	11,769	178.330	2,098,765.77	
CELANESE CORP-SERIES A	9,288	100.980	937,902.24	
CENTENE CORP	49,528	81.420	4,032,569.76	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,691	29.980	1,639,636.18	
CENTURYLINK INC	80,597	5.290	426,358.13	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,984	63.140	756,669.76	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,227	92.720	1,597,287.44	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,393	216.530	951,216.29	
CHARLES SCHWAB CORP	126,018	78.260	9,862,168.68	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,737	306.160	2,981,079.92	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,698	127.480	1,108,821.04	
CHENIERE ENERGY INC	19,494	152.270	2,968,351.38	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,793	95.940	843,600.42	
CHEVRON CORP	161,135	169.880	27,373,613.80	
CHEWY INC - CLASS A	8,092	40.600	328,535.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,406	1,414.980	3,404,441.88	
CHUBB LTD	36,168	211.960	7,666,169.28	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,065	79.890	1,682,882.85	
CIGNA CORP	26,462	330.780	8,753,100.36	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,041	100.940	1,316,358.54	
CINTAS CORP	7,866	443.510	3,488,649.66	
CISCO SYSTEMS INC	358,677	47.400	17,001,289.80	
CITIGROUP INC	167,719	43.930	7,367,895.67	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,704	38.200	1,631,292.80	
CLARIVATE PLC	26,630	8.050	214,371.50	
CLEVELAND-CLIFFS INC	44,732	14.320	640,562.24	
CLOROX CO	10,708	144.810	1,550,625.48	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,058	45.070	994,154.06	
CME GROUP INC	31,188	170.680	5,323,167.84	
CMS ENERGY CORP	25,322	61.580	1,559,328.76	

COCA-COLA CO	356,149	62.840	22,380,403.16	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	17,858	53.980	963,974.84	
COGNEX CORP	14,983	46.780	700,904.74	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	44,709	54.980	2,458,100.82	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	10,682	35.170	375,685.94	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,735	77.980	5,359,955.30	
COMCAST CORP	381,403	33.980	12,960,073.94	
CONAGRA BRANDS INC	41,731	38.130	1,591,203.03	
CONOCOPHILLIPS	110,259	110.440	12,177,003.96	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,770	94.850	2,918,534.50	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,840	230.290	3,187,213.60	
CONSTELLATION ENERGY	28,303	87.730	2,483,022.19	
COOPER COS INC/THE	4,275	316.260	1,352,011.50	
COPART INC	36,971	60.310	2,229,721.01	
CORNING INC	69,858	31.750	2,217,991.50	
CORTEVA INC	62,439	58.300	3,640,193.70	
COSTAR GROUP INC	34,315	77.160	2,647,745.40	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,350	458.630	17,588,460.50	
COTERRA ENERGY INC	68,845	24.310	1,673,621.95	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,589	108.090	1,901,195.01	
CROWN HOLDINGS INC	10,550	80.000	844,000.00	
CSX CORP	187,633	31.180	5,850,396.94	
CUMMINS INC	12,244	237.190	2,904,154.36	
CVS HEALTH CORP	113,758	95.050	10,812,697.90	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,562	127.630	454,618.06	
DANAHER CORP	59,861	258.720	15,487,237.92	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,613	138.450	1,469,369.85	
DARLING INTERNATIONAL INC	13,818	59.660	824,381.88	
DATADOG INC - CLASS A	21,419	76.050	1,628,914.95	
DAVITA INC	4,747	72.270	343,065.69	
DEERE & CO	25,161	432.670	10,886,409.87	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,897	39.000	892,983.00	
DELTA AIR LINES INC	13,508	32.920	444,683.36	
DENTSPLY SIRONA INC	18,860	30.600	577,116.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	53,714	59.260	3,183,091.64	
DEXCOM INC	34,000	112.230	3,815,820.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	14,599	133.580	1,950,134.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,656	95.170	2,251,341.52	
DISH NETWORK CORP	21,069	13.870	292,227.03	
DOCUSIGN INC	17,270	54.220	936,379.40	
DOLLAR GENERAL CORP	19,555	242.440	4,740,914.20	

DOLLAR TREE INC	19,410	139.420	2,706,142.20	
DOMINION ENERGY INC	72,232	59.250	4,279,746.00	
DOMINO'S PIZZA INC	3,099	356.330	1,104,266.67	
DOORDASH INC - A	20,238	51.440	1,041,042.72	
DOVER CORP	12,407	132.380	1,642,438.66	
DOW INC	62,201	49.330	3,068,375.33	
DR HORTON INC	28,468	88.090	2,507,746.12	
DROPBOX INC-CLASS A	23,795	22.380	532,532.10	
DTE ENERGY COMPANY	16,897	115.180	1,946,196.46	
DUKE ENERGY CORP	66,817	100.230	6,697,067.91	
DUPONT DE NEMOURS INC	43,419	67.560	2,933,387.64	
DYNATRACE INC	17,404	37.170	646,906.68	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,618	80.710	856,978.78	
EATON CORP PLC	34,524	154.500	5,333,958.00	
EBAY INC	47,480	41.340	1,962,823.20	
ECOLAB INC	22,282	141.210	3,146,441.22	
EDISON INTERNATIONAL	33,226	64.950	2,158,028.70	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,570	73.430	3,933,645.10	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	37,212	11.850	440,962.20	
ELECTRONIC ARTS INC	24,079	120.790	2,908,502.41	
ELEVANCE HEALTH, INC	20,786	502.890	10,453,071.54	
ELI LILLY & CO	69,983	357.780	25,038,517.74	
EMERSON ELECTRIC CO	51,344	94.580	4,856,115.52	
ENPHASE ENERGY INC	11,740	305.010	3,580,817.40	
ENTEGRIS INC	12,899	64.410	830,824.59	
ENTERGY CORP	17,719	113.140	2,004,727.66	
EOG RESOURCES INC	50,716	125.530	6,366,379.48	
EPAM SYSTEMS INC	4,958	328.570	1,629,050.06	
EQT CORP	28,840	36.110	1,041,412.40	
EQUIFAX INC	10,591	191.170	2,024,681.47	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,262	28.480	918,821.76	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,205	271.400	598,437.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	21,888	46.610	1,020,199.68	
ESTEE LAUDER COS INC	20,010	236.240	4,727,162.40	
ETSY INC	10,948	125.910	1,378,462.68	
EVEREST RE GROUP LTD	3,398	322.380	1,095,447.24	
EVERGY INC	19,983	61.690	1,232,751.27	
EVERSOURCE ENERGY	30,105	82.830	2,493,597.15	
EXACT SCIENCES CORP	15,510	50.000	775,500.00	
EXELON CORP	85,794	41.770	3,583,615.38	
EXPEDIA GROUP INC	13,067	85.260	1,114,092.42	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	14,443	108.010	1,559,988.43	
EXXON MOBIL CORP	361,124	105.170	37,979,411.08	
F5 INC	5,122	141.720	725,889.84	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,290	419.900	1,381,471.00	

FAIR ISAAC CORP	2,186	585.650	1,280,230.90	
FASTENAL CO	49,701	47.750	2,373,222.75	
FEDEX CORP	21,570	168.780	3,640,584.60	
FERGUSON PLC	17,974	125.390	2,253,759.86	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	22,501	36.400	819,036.40	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,735	67.350	3,551,702.25	
FIFTH THIRD BANCORP	59,195	31.650	1,873,521.75	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,032	730.180	753,545.76	
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	46,867	24.420	1,144,492.14	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,816	119.480	1,889,695.68	
FIRST SOLAR INC	8,305	156.770	1,301,974.85	
FIRSTENERGY CORP	47,198	41.010	1,935,589.98	
FISERV INC	52,756	98.670	5,205,434.52	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,182	178.960	1,106,330.72	
FMC CORP	10,988	122.760	1,348,886.88	
FORD MOTOR CO	341,915	11.690	3,996,986.35	
FORTINET INC	57,967	49.980	2,897,190.66	
FORTIVE CORP	29,370	63.610	1,868,225.70	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	11,199	55.150	617,624.85	
FOX CORP - CLASS A	24,948	29.490	735,716.52	
FOX CORP- CLASS B	14,236	27.630	393,340.68	
FRANKLIN RESOURCES INC	25,769	25.780	664,324.82	
FREEPORT-MCMORAN INC	123,377	37.360	4,609,364.72	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,206	64.710	336,880.26	
GARMIN LTD	13,350	90.300	1,205,505.00	
GARTNER INC	6,849	339.060	2,322,221.94	
GEN DIGITAL INC	51,905	21.580	1,120,109.90	
GENERAC HOLDINGS INC	5,484	91.730	503,047.32	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,222	244.300	4,940,234.60	
GENERAL ELECTRIC CO	95,145	78.060	7,427,018.70	
GENERAL MILLS INC	51,512	87.120	4,487,725.44	
GENERAL MOTORS CO	119,890	35.420	4,246,503.80	
GENUINE PARTS CO	12,250	175.870	2,154,407.50	
GILEAD SCIENCES INC	108,578	86.420	9,383,310.76	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,060	93.130	2,240,707.80	
GLOBE LIFE INC	8,067	117.860	950,776.62	
GODADDY INC - CLASS A	13,664	73.130	999,248.32	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,547	344.610	10,182,191.67	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	116,128	3.010	349,545.28	
HALLIBURTON CO	78,561	36.060	2,832,909.66	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	27,769	73.660	2,045,464.54	
HASBRO INC	11,434	55.910	639,274.94	

HCA HEALTHCARE INC	19,866	238.670	4,741,418.22	
HEICO CORP	3,780	149.440	564,883.20	
HEICO CORP-CLASS A	6,314	115.450	728,951.30	
HENRY SCHEIN INC	11,755	80.690	948,510.95	
HERSHEY CO/THE	12,724	234.890	2,988,740.36	
HESS CORP	24,230	133.630	3,237,854.90	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,179	15.480	1,736,530.92	
HF SINCLAIR CORP	14,020	49.730	697,214.60	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,817	129.900	3,093,828.30	
HOLOGIC INC	21,645	73.310	1,586,794.95	
HOME DEPOT INC	88,695	317.330	28,145,584.35	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,408	209.410	12,231,219.28	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,900	4.580	452,962.00	
HORIZON PHARMA PLC	18,919	112.970	2,137,279.43	
HORMEL FOODS CORP	26,129	45.490	1,188,608.21	
HOWMET AEROSPACE INC	32,526	37.580	1,222,327.08	
HP INC	89,353	26.560	2,373,215.68	
HUBBELL INC	4,661	236.780	1,103,631.58	
HUBSPOT INC	3,946	287.520	1,134,553.92	
HUMANA INC	10,964	504.840	5,535,065.76	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	124,783	13.690	1,708,279.27	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,451	229.570	792,246.07	
IDEX CORP	6,584	226.270	1,489,761.68	
IDEXX LABORATORIES INC	7,187	402.170	2,890,395.79	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	26,868	217.290	5,838,147.72	
ILLUMINA INC	13,624	191.590	2,610,222.16	
INCYTE CORP	16,454	80.590	1,326,027.86	
INGERSOLL-RAND INC	35,073	51.070	1,791,178.11	
INSULET CORP	6,030	294.290	1,774,568.70	
INTEL CORP	355,616	26.790	9,526,952.64	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,408	100.280	4,854,354.24	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	78,327	138.870	10,877,270.49	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	22,219	101.660	2,258,783.54	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,900	34.920	1,044,108.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,786	32.170	1,086,895.62	
INTUIT INC	23,201	383.520	8,898,047.52	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,905	261.010	8,066,514.05	
INVESCO LTD	28,975	18.100	524,447.50	
IQVIA HOLDINGS INC	16,175	199.840	3,232,412.00	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,330	175.370	1,110,092.10	
JACOBS SOLUTIONS INC	11,041	118.520	1,308,579.32	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	13,800	50.400	695,520.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,457	156.380	853,365.66	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,525	179.530	1,350,963.25	
JM SMUCKER CO	9,210	155.820	1,435,102.20	
JOHNSON & JOHNSON	227,838	175.480	39,981,012.24	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	59,776	63.460	3,793,384.96	
JPMORGAN CHASE & CO	254,026	130.060	33,038,621.56	
JUNIPER NETWORKS INC	27,993	31.670	886,538.31	
KELLOGG CO	22,064	71.510	1,577,796.64	
KEURIG DR PEPPER INC	67,675	36.320	2,457,956.00	
KEYCORP	80,202	16.650	1,335,363.30	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,508	171.380	2,657,761.04	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,343	135.660	3,980,671.38	
KINDER MORGAN INC	176,915	17.510	3,097,781.65	
KKR & CO INC -A	48,359	46.000	2,224,514.00	
KLA CORPORATION	12,300	383.660	4,719,018.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,997	52.360	732,882.92	
KRAFT HEINZ CO/THE	63,728	40.110	2,556,130.08	
KROGER CO	58,650	44.400	2,604,060.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,553	205.550	3,402,469.15	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,795	229.010	1,785,132.95	
LAM RESEARCH CORP	11,873	438.690	5,208,566.37	
LAMB WESTON HOLDING INC	12,532	87.110	1,091,662.52	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,734	46.360	1,378,468.24	
LEAR CORP	5,240	123.430	646,773.20	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,265	104.450	1,176,629.25	
LENNAR CORP-CL A	22,069	90.100	1,988,416.90	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,785	244.880	681,990.80	
LIBERTY BROADBAND-C	10,907	69.560	758,690.92	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,828	18.410	217,753.48	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	27,120	18.750	508,500.00	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	6,171	38.590	238,138.89	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	14,710	38.500	566,335.00	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	17,030	58.400	994,552.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,990	29.240	409,067.60	
LINDE PLC	43,225	327.050	14,136,736.25	
LIVE NATION INC	14,885	68.390	1,017,985.15	

LKQ CORP	22,500	52.730	1,186,425.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,663	481.790	9,955,226.77	
LOEWS CORP	17,755	54.950	975,637.25	
LOWE'S COS INC	53,747	203.170	10,919,777.99	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,896	209.150	1,442,298.40	
LUCID GROUP INC	36,879	7.230	266,635.17	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,064	316.920	3,189,482.88	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,538	80.300	1,809,801.40	
M&T BANK CORP	15,245	140.650	2,144,209.25	
MARATHON OIL CORP	58,205	27.030	1,573,281.15	
MARATHON PETROLEUM CORP	43,062	111.070	4,782,896.34	
MARKEL CORP	1,180	1,260.230	1,487,071.40	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,261	271.480	885,296.28	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	23,916	151.370	3,620,164.92	
MARSH & MCLENNAN COS INC	43,227	163.730	7,077,556.71	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,431	340.850	1,851,156.35	
MARVELL TECHNOLOGY INC	73,917	38.400	2,838,412.80	
MASCO CORP	19,574	46.960	919,195.04	
MASIMO CORPORATION	4,282	138.720	593,999.04	
MASTERBRAND INC	11,199	8.470	94,855.53	
MASTERCARD INC-CLASS A	74,768	341.260	25,515,327.68	
MATCH GROUP INC	24,520	40.370	989,872.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,782	82.840	1,804,420.88	
MCDONALD'S CORP	63,770	265.830	16,951,979.10	
MCKESSON CORP	12,475	375.540	4,684,861.50	
MEDTRONIC PLC	115,182	77.120	8,882,835.84	
MERCADOLIBRE INC	3,932	884.270	3,476,949.64	
MERCK & CO INC	219,517	109.440	24,023,940.48	
META PLATFORMS INC-A	197,515	114.480	22,611,517.20	
METLIFE INC	58,456	71.160	4,159,728.96	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,947	1,397.930	2,721,769.71	
MGM MIRAGE	26,980	34.220	923,255.60	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47,979	71.480	3,429,538.92	
MICRON TECHNOLOGY INC	95,456	51.720	4,936,984.32	
MICROSOFT CORP	613,809	240.450	147,590,374.05	
MODERNA INC	28,760	189.890	5,461,236.40	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,370	95.420	416,985.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,033	331.650	1,669,194.45	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	16,482	51.690	851,954.58	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	118,767	65.700	7,802,991.90	
MONGODB INC	5,904	193.360	1,141,597.44	

MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,849	359.010	1,381,829.49	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,211	100.420	3,435,468.62	
MOODY'S CORP	14,289	278.320	3,976,914.48	
MORGAN STANLEY	111,513	85.550	9,539,937.15	
MOSAIC CO/THE	29,712	44.540	1,323,372.48	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,472	254.590	3,684,426.48	
MSCI INC	6,958	461.940	3,214,178.52	
NASDAQ INC	29,867	60.460	1,805,758.82	
NETAPP INC	19,006	59.190	1,124,965.14	
NETFLIX INC	38,507	288.300	11,101,568.10	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,349	117.930	984,597.57	
NEWELL BRANDS INC	34,081	12.760	434,873.56	
NEWMONT CORP	68,598	45.600	3,128,068.80	
NEWS CORP - CLASS A	33,206	17.430	578,780.58	
NEXTERA ENERGY INC	170,225	83.520	14,217,192.00	
NIKE INC	109,503	103.050	11,284,284.15	
NISOURCE INC	35,501	27.050	960,302.05	
NORDSON CORP	4,476	233.400	1,044,698.40	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,636	247.000	5,097,092.00	
NORTHERN TRUST CORP	17,159	87.230	1,496,779.57	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,711	532.520	6,768,861.72	
NOVOCURE LTD	8,210	73.770	605,651.70	
NRG ENERGY INC	20,367	31.540	642,375.18	
NUCOR CORP	22,628	131.760	2,981,465.28	
NVIDIA CORP	215,722	162.540	35,063,453.88	
NVR INC	270	4,685.200	1,265,004.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	22,776	160.270	3,650,309.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,481	816.430	4,474,852.83	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,694	62.410	5,036,112.54	
OKTA INC	13,151	65.350	859,417.85	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,360	290.190	2,425,988.40	
OMNICOM GROUP	17,773	77.310	1,374,030.63	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	37,507	64.150	2,406,074.05	
ONEOK INC	38,684	63.370	2,451,405.08	
ORACLE CORP	138,527	80.500	11,151,423.50	
OTIS WORLDWIDE CORP	36,512	77.870	2,843,189.44	
OVINTIV INC	21,854	49.300	1,077,402.20	
OWENS CORNING	8,288	87.660	726,526.08	
PACCAR INC	30,246	99.110	2,997,681.06	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,124	128.610	1,044,827.64	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	144,893	6.350	920,070.55	
PALO ALTO NETWORKS INC	25,900	150.520	3,898,468.00	

PARAMOUNT GLOBAL	52,492	16.920	888,164.64	
PARKER HANNIFIN CORP	11,131	282.700	3,146,733.70	
PAYCHEX INC	28,065	115.520	3,242,068.80	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,418	309.590	1,367,768.62	
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,583	195.610	700,870.63	
PAYPAL HOLDINGS INC	95,143	68.950	6,560,109.85	
PENTAIR PLC	14,033	43.830	615,066.39	
PEPSICO INC	119,578	181.340	21,684,274.52	
PERKINELMER INC	10,907	138.320	1,508,656.24	
PFIZER INC	486,199	51.360	24,971,180.64	
PG&E CORP	129,371	15.840	2,049,236.64	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	134,276	100.610	13,509,508.36	
PHILLIPS 66	41,596	100.610	4,184,973.56	
PINTEREST INC- CLASS A	50,517	24.170	1,220,995.89	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,641	218.070	4,283,112.87	
PLUG POWER INC	45,174	12.910	583,196.34	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,526	150.160	5,334,584.16	
POOL CORP	3,419	308.140	1,053,530.66	
PPG INDUSTRIES INC	20,386	125.630	2,561,093.18	
PPL CORPORATION	64,234	29.110	1,869,851.74	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,413	84.310	1,805,330.03	
PROCTER & GAMBLE CO	206,721	150.400	31,090,838.40	
PROGRESSIVE CORP	50,704	127.070	6,442,957.28	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,161	97.120	3,123,476.32	
PTC INC	9,680	122.500	1,185,800.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,420	59.360	2,577,411.20	
PULTE GROUP INC	19,953	45.080	899,481.24	
QORVO INC	8,924	93.020	830,110.48	
QUALCOMM INC	97,280	112.610	10,954,700.80	
QUANTA SERVICES INC	12,404	142.360	1,765,833.44	
QUEST DIAGNOSTICS	10,064	151.450	1,524,192.80	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,773	105.150	1,763,680.95	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	127,937	97.540	12,478,974.98	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,275	721.100	6,688,202.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	80,215	20.600	1,652,429.00	
REPLIGEN CORP	4,571	162.420	742,421.82	
REPUBLIC SERVICES INC	19,149	129.650	2,482,667.85	
RESMED INC	12,675	209.150	2,650,976.25	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,827	22.030	613,028.81	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	9,346	72.070	673,566.22	

ROBLOX CORP -CLASS A	30,803	27.190	837,533.57	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,005	250.660	2,507,853.30	
ROKU INC	10,521	44.500	468,184.50	
ROLLINS INC	19,158	36.940	707,696.52	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,203	423.350	3,896,090.05	
ROSS STORES INC	30,323	114.920	3,484,719.16	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,868	51.470	1,022,605.96	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,468	39.570	1,205,618.76	
RPM INTERNATIONAL INC	11,293	98.110	1,107,956.23	
S&P GLOBAL INC	29,509	335.660	9,904,990.94	
SALESFORCE INC	86,648	129.010	11,178,458.48	
SCHLUMBERGER LTD	122,583	49.830	6,108,310.89	
SEA LTD-ADR	31,347	53.020	1,662,017.94	
SEAGATE TECHNOLOGY	17,111	50.990	872,489.89	
SEAGEN INC	12,035	127.630	1,536,027.05	
SEALED AIR CORP	12,600	49.990	629,874.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,791	57.850	566,409.35	
SEMPRA ENERGY	27,284	157.280	4,291,227.52	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,548	40.440	547,881.12	
SERVICENOW INC	17,500	382.300	6,690,250.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,340	238.110	5,081,267.40	
SIGNATURE BANK	5,396	114.000	615,144.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,736	5.900	405,542.40	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,881	91.680	1,272,610.08	
SMITH (A.O.) CORP	11,153	56.060	625,237.18	
SNAP INC - A	96,598	8.190	791,137.62	
SNAP-ON INC	4,596	224.130	1,030,101.48	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,316	138.100	2,667,539.60	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,824	309.580	1,493,413.92	
SOUTHERN CO	94,524	68.910	6,513,648.84	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,500	36.350	454,375.00	
SPLUNK INC	14,119	82.800	1,169,053.20	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	20,117	49.940	1,004,642.98	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,833	74.790	959,780.07	
STARBUCKS CORP	99,434	98.300	9,774,362.20	
STATE STREET CORP	31,723	77.560	2,460,435.88	
STEEL DYNAMICS INC	15,726	101.540	1,596,818.04	
STERIS PLC	8,662	180.500	1,563,491.00	
STRYKER CORP	29,495	239.030	7,050,189.85	
SVB FINANCIAL GROUP	5,085	210.390	1,069,833.15	
SYNCHRONY FINANCIAL	41,473	32.380	1,342,895.74	
SYNOPSYS INC	13,231	323.390	4,278,773.09	
SYSCO CORP	43,867	77.910	3,417,677.97	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,362	109.530	2,120,719.86	

T-MOBILE US INC	54,511	141.620	7,719,847.82	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	14,453	98.590	1,424,921.27	
TARGA RESOURCES CORP	18,506	69.040	1,277,654.24	
TARGET CORP	39,825	144.650	5,760,686.25	
TE CONNECTIVITY LTD	27,738	115.540	3,204,848.52	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,079	390.280	1,591,952.12	
TELEFLEX INC	4,057	243.350	987,270.95	
TERADYNE INC	13,535	88.400	1,196,494.00	
TESLA, INC.	230,761	149.870	34,584,151.07	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,352	8.570	825,736.64	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,186	167.610	13,272,365.46	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	535	2,474.870	1,324,055.45	
TEXTRON INC	18,177	69.280	1,259,302.56	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,943	530.170	17,995,560.31	
TJX COS INC	100,655	78.090	7,860,148.95	
TOAST INC-CLASS A	21,340	17.770	379,211.80	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,602	211.460	2,030,438.92	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	38,404	44.130	1,694,768.52	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,319	61.700	574,982.30	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,133	168.810	3,398,651.73	
TRANSDIGM GROUP INC	4,473	602.050	2,692,969.65	
TRANSUNION	16,664	56.390	939,682.96	
TRAVELERS COS INC/THE	20,489	183.510	3,759,936.39	
TRIMBLE INC	21,443	49.560	1,062,715.08	
TRUIST FINANCIAL CORP	115,093	41.120	4,732,624.16	
TWILIO INC - A	15,187	46.310	703,309.97	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,599	320.050	1,151,859.95	
TYSON FOODS INC-CL A	24,939	60.810	1,516,540.59	
U-HAUL HOLDING CO	8,001	52.600	420,852.60	
UBER TECHNOLOGIES INC	129,370	24.950	3,227,781.50	
UGI CORP	18,108	36.790	666,193.32	
ULTA BEAUTY INC	4,422	440.510	1,947,935.22	
UNION PACIFIC CORP	54,473	206.390	11,242,682.47	
UNITED PARCEL SERVICE INC	63,614	178.430	11,350,646.02	
UNITED RENTALS INC	6,037	351.250	2,120,496.25	
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,043	523.600	42,434,114.80	
UNITY SOFTWARE INC	21,436	27.920	598,493.12	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,660	134.500	761,270.00	
US BANCORP	122,271	41.950	5,129,268.45	
VAIL RESORTS INC	3,527	245.900	867,289.30	
VALERO ENERGY CORP	34,050	119.710	4,076,125.50	

VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,133	167.280	2,029,608.24	
VERISIGN INC	8,350	200.490	1,674,091.50	
VERISK ANALYTICS INC	13,583	173.220	2,352,847.26	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	364,222	37.030	13,487,140.66	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,222	291.590	6,479,712.98	
VF CORP	28,817	26.050	750,682.85	
VIATRIS INC	104,937	10.910	1,144,862.67	
VISA INC-CLASS A SHARES	141,683	204.820	29,019,512.06	
VISTRA CORP	32,814	23.860	782,942.04	
VMWARE INC-CLASS A	18,346	120.820	2,216,563.72	
VULCAN MATERIALS CO	11,594	175.420	2,033,819.48	
WABTEC CORP	15,043	99.460	1,496,176.78	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,438	39.320	2,494,382.16	
WALMART INC	130,526	142.800	18,639,112.80	
WALT DISNEY CO	157,993	85.780	13,552,639.54	
WARNER BROS DISCOVERY INC	199,903	9.250	1,849,102.75	
WASTE CONNECTIONS INC	22,307	133.310	2,973,746.17	
WASTE MANAGEMENT INC	35,815	157.590	5,644,085.85	
WATERS CORP	5,178	337.300	1,746,539.40	
WEBSTER FINANCIAL CORP	15,146	45.360	687,022.56	
WEC ENERGY GROUP INC	27,401	94.240	2,582,270.24	
WELLS FARGO & CO	328,462	41.820	13,736,280.84	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,389	228.230	1,458,161.47	
WESTERN DIGITAL CORP	27,205	31.560	858,589.80	
WESTERN UNION CO	33,570	13.490	452,859.30	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,245	103.210	334,916.45	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	22,068	34.800	767,966.40	
WEYERHAEUSER CO	64,090	30.830	1,975,894.70	
WHIRLPOOL CORP	4,725	139.570	659,468.25	
WILLIAMS COS INC	105,773	32.070	3,392,140.11	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,511	239.310	2,276,077.41	
WIX.COM LTD	5,002	78.740	393,857.48	
WOLFSPEED INC	10,756	75.550	812,615.80	
WORKDAY INC-CLASS A	17,407	170.040	2,959,886.28	
WR BERKLEY CORP	18,218	71.530	1,303,133.54	
WW GRAINGER INC	3,969	561.270	2,227,680.63	
WYNN RESORTS LTD	9,363	81.560	763,646.28	
XCEL ENERGY INC	47,492	69.400	3,295,944.80	
XYLEM INC	15,602	108.480	1,692,504.96	
YUM! BRANDS INC	24,635	128.380	3,162,641.30	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,470	243.710	1,089,383.70	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	13,877	34.380	477,091.26	

	ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,594	16.290	123,706.26	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,210	124.960	2,275,521.60	
	ZOETIS INC	40,565	143.190	5,808,502.35	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,522	69.090	1,348,774.98	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	22,805	27.940	637,171.70	
	ZSCALER INC	7,382	112.270	828,777.14	
アメリカ・ドル　小計		29,565,583		2,856,025,288.85 (384,249,642,362)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	82,542	12.875	1,062,728.25	
	ABRDN PLC	183,576	1.866	342,552.81	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,515	20.390	316,350.85	
	ANGLO AMERICAN PLC	109,713	31.130	3,415,365.69	
	ANTOFAGASTA PLC	33,802	14.710	497,227.42	
	ASHTEAD GROUP PLC	38,100	47.550	1,811,655.00	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,056	15.620	485,094.72	
	ASTRAZENECA PLC	134,304	111.080	14,918,488.32	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	80,922	5.218	422,250.99	
	AVEVA GROUP PLC	10,550	32.090	338,549.50	
	AVIVA PLC	244,297	4.384	1,070,998.04	
	BAE SYSTEMS PLC	270,960	8.438	2,286,360.48	
	BARCLAYS PLC	1,383,830	1.553	2,149,087.99	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	88,577	3.937	348,727.64	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	9,414	37.380	351,895.32	
	BP PLC	1,632,335	4.666	7,616,475.11	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	185,314	33.320	6,174,662.48	
	BT GROUP PLC	602,147	1.126	678,017.52	
	BUNZL PLC	29,376	28.320	831,928.32	
	BURBERRY GROUP PLC	34,109	20.330	693,435.97	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,262	19.610	338,507.82	
	COMPASS GROUP PLC	153,287	19.035	2,917,818.04	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,043	66.460	800,377.78	
	DCC PLC	8,615	40.450	348,476.75	
	DIAGEO PLC	197,419	36.360	7,178,154.84	
	ENTAIN PLC	50,978	13.095	667,556.91	
	EXPERIAN PLC	79,603	28.330	2,255,152.99	
	GLENCORE PLC	845,252	5.368	4,537,312.73	
	GSK PLC	352,189	14.208	5,003,901.31	
	HALEON PLC	438,200	3.138	1,375,071.60	
	HALMA PLC	32,845	20.620	677,263.90	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,489	8.508	259,400.41	

HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,215	15.155	215,428.32	
HSBC HOLDINGS PLC	1,730,928	4.957	8,580,210.09	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,193	20.620	1,612,339.66	
INFORMA PLC	127,322	6.050	770,298.10	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,206	47.620	771,729.72	
INTERTEK GROUP PLC	14,127	39.370	556,179.99	
JD SPORTS FASHION PLC	218,145	1.156	252,175.62	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,955	21.150	337,448.25	
KINGFISHER PLC	166,908	2.272	379,214.97	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	518,094	2.471	1,280,210.27	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,905,568	0.450	2,657,505.60	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	28,615	71.340	2,041,394.10	
M&G PLC	224,948	1.827	410,979.99	
MELROSE INDUSTRIES PLC	356,390	1.280	456,179.20	
MONDI PLC/WI	41,966	14.095	591,510.77	
NATIONAL GRID PLC	317,946	9.964	3,168,013.94	
NATWEST GROUP PLC	459,510	2.593	1,191,509.43	
NEXT PLC	11,073	55.300	612,336.90	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	49,999	6.340	316,993.66	
PEARSON PLC	57,553	9.242	531,904.82	
PERSIMMON PLC	27,565	12.090	333,260.85	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	69,831	5.984	417,868.70	
PRUDENTIAL PLC	237,619	10.550	2,506,880.45	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,116	57.480	3,570,427.68	
RELX PLC	166,408	22.970	3,822,391.76	
RENTOKIL INITIAL PLC	217,379	5.148	1,119,067.09	
RIO TINTO PLC	97,199	56.090	5,451,891.91	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	732,590	0.888	650,539.92	
SAGE GROUP PLC	88,652	7.712	683,684.22	
SAINSBURY (J) PLC	147,359	2.201	324,337.15	
SCHRODERS PLC	62,921	4.392	276,349.03	
SEVERN TRENT PLC	22,097	26.850	593,304.45	
SHELL PLC-NEW	629,031	22.870	14,385,938.97	
SMITH & NEPHEW PLC	75,547	10.785	814,774.39	
SMITHS GROUP PLC	31,514	15.810	498,236.34	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,373	107.350	684,141.55	
SSE PLC	92,492	16.890	1,562,189.88	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,186	10.915	525,950.19	
STANDARD CHARTERED PLC	216,639	6.172	1,337,095.90	
TAYLOR WIMPEY PLC	306,756	0.997	305,835.73	
TESCO PLC	644,589	2.237	1,441,945.59	

	UNILEVER PLC	220,703	41.735	9,211,039.70	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	59,742	10.215	610,264.53	
	VODAFONE GROUP PLC	2,310,016	0.842	1,945,033.47	
	WHITBREAD PLC	17,286	26.000	449,436.00	
	WPP PLC	94,644	8.000	757,152.00	
イギリス・ポンド　小計		24,462,294		153,183,453.10 (25,034,771,740)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	3,677	244.300	898,291.10	
	BANK HAPOALIM BM	109,931	31.050	3,413,357.55	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	133,756	29.220	3,908,350.32	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	182,644	5.988	1,093,672.27	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,315	584.300	1,352,654.50	
	ICL GROUP LTD	61,345	26.130	1,602,944.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	106,584	18.690	1,992,054.96	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,561	113.600	1,540,529.60	
	NICE LTD	5,507	682.500	3,758,527.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	9,593	157.300	1,508,978.90	
イスラエル・シュケル　小計		628,913		21,069,361.55 (819,872,066)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	22,702	28.010	635,883.02	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	53,546	32.300	1,729,535.80	
	ASX LTD	18,240	67.200	1,225,728.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	199,691	3.780	754,831.98	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	264,885	23.720	6,283,072.20	
	BHP GROUP LIMITED	440,595	45.990	20,262,964.05	
	BLUESCOPE STEEL LTD	43,320	17.160	743,371.20	
	BRAMBLES LTD	129,201	12.200	1,576,252.20	
	COCHLEAR LTD	6,100	203.380	1,240,618.00	
	COLES GROUP LTD	121,996	16.920	2,064,172.32	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	148,481	105.630	15,684,048.03	
	COMPUTERSHARE LIMITED	49,525	26.400	1,307,460.00	
	CSL LIMITED	42,104	288.410	12,143,214.64	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	124,139	6.470	803,179.33	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,328	20.230	3,000,675.44	
	IDP EDUCATION LTD	19,296	27.810	536,621.76	
	IGO LTD	60,822	14.070	855,765.54	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	230,642	4.640	1,070,178.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	39,829	28.800	1,147,075.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	211,437	4.560	964,152.72	
	MACQUARIE GROUP LTD	32,565	168.770	5,495,995.05	

	MEDIBANK PRIVATE LTD	259,889	2.930	761,474.77	
	MINERAL RESOURCES LTD	15,141	81.720	1,237,322.52	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	279,354	30.260	8,453,252.04	
	NEWCREST MINING LIMITED	81,175	20.590	1,671,393.25	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	105,140	11.020	1,158,642.80	
	ORICA LTD	43,294	15.260	660,666.44	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	157,823	7.100	1,120,543.30	
	PILBARA MINERALS LTD	222,508	4.030	896,707.24	
	QANTAS AIRWAYS LTD	86,875	6.220	540,362.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	134,717	13.030	1,755,362.51	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	17,167	65.550	1,125,296.85	
	REA GROUP LTD	5,177	118.020	610,989.54	
	REECE LTD	22,550	14.080	317,504.00	
	RIO TINTO LTD	32,799	114.630	3,759,749.37	
	SANTOS LTD	287,585	7.220	2,076,363.70	
	SEEK LTD	32,128	21.510	691,073.28	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,805	30.760	1,285,921.80	
	SOUTH32 LTD	412,048	4.130	1,701,758.24	
	SUNCORP GROUP LTD	118,360	11.780	1,394,280.80	
	TELSTRA GROUP LTD	406,709	4.050	1,647,171.45	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	68,685	13.720	942,358.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	21,479	27.500	590,672.50	
	WESFARMERS LIMITED	100,852	46.950	4,735,001.40	
	WESTPAC BANKING CORP	308,010	23.250	7,161,232.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,321	54.800	729,990.80	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	166,040	35.750	5,935,930.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	108,114	34.410	3,720,202.74	
	XERO LTD	12,494	73.200	914,560.80	
オーストラリア・ドル　小計		5,968,683		137,120,580.70 (12,355,935,527)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	39,411	68.640	2,705,171.04	
	AIR CANADA	16,023	18.850	302,033.55	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	60,911	9.100	554,290.10	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	70,803	61.310	4,340,931.93	
	ALTAGAS LTD	25,227	22.670	571,896.09	
	ARC RESOURCES LTD	56,706	17.400	986,684.40	
	BANK OF MONTREAL	58,221	120.090	6,991,759.89	
	BANK OF NOVA SCOTIA	103,936	64.480	6,701,793.28	
	BARRICK GOLD CORP	152,743	22.580	3,448,936.94	
	BCE INC	7,610	59.670	454,088.70	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	30,525	38.220	1,166,665.50	

BROOKFIELD CORPORATION-A	122,100	42.850	5,231,985.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,480	39.810	457,018.80	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,159	102.670	324,334.53	
CAE INC	27,579	26.650	734,980.35	
CAMECO CORP	37,352	29.220	1,091,425.44	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	78,496	54.350	4,266,257.60	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	51,450	163.620	8,418,249.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	97,117	72.590	7,049,723.03	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	81,537	101.620	8,285,789.94	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,863	141.310	687,190.53	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	12,119	36.750	445,373.25	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,082	58.000	758,756.00	
CENOVUS ENERGY INC	120,292	24.360	2,930,313.12	
CGI INC	18,444	116.260	2,144,299.44	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,750	2,121.710	3,712,992.50	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	7,444	93.500	696,014.00	
DOLLARAMA INC	24,071	80.130	1,928,809.23	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	34,784	18.330	637,590.72	
EMERA INC	23,870	51.680	1,233,601.60	
EMPIRE CO LTD 'A'	13,980	35.550	496,989.00	
ENBRIDGE INC	176,421	51.760	9,131,550.96	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,006	796.230	1,597,237.38	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,767	27.530	1,397,615.51	
FIRSTSERVICE CORP	3,531	164.270	580,037.37	
FORTIS INC	42,819	54.340	2,326,784.46	
FRANCO-NEVADA CORP	16,576	180.040	2,984,343.04	
GEORGE WESTON LTD	6,211	173.180	1,075,620.98	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	16,515	38.210	631,038.15	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,827	36.690	580,692.63	
GREAT-WEST LIFECO INC	25,321	30.230	765,453.83	
HYDRO ONE LTD	30,015	35.960	1,079,339.40	
IA FINANCIAL CORP INC	9,215	77.090	710,384.35	
IGM FINANCIAL INC	7,496	36.950	276,977.20	
IMPERIAL OIL LTD	19,347	63.990	1,238,014.53	
INTACT FINANCIAL CORP	15,308	196.050	3,001,133.40	
IVANHOE MINES LTD-CL A	52,346	11.390	596,220.94	
KEYERA CORP	19,692	28.430	559,843.56	

	KINROSS GOLD CORP	110,406	5.510	608,337.06	
	LOBLAW COS LTD	14,106	122.810	1,732,357.86	
	LUNDIN MINING CORP	56,400	8.400	473,760.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,924	77.920	1,864,158.08	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	166,111	23.910	3,971,714.01	
	METRO INC	20,826	76.540	1,594,022.04	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,264	91.230	2,669,754.72	
	NORTHLAND POWER INC	20,930	38.740	810,828.20	
	NUTRIEN LTD	46,657	99.490	4,641,904.93	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,669	34.890	197,791.41	
	ONEX CORPORATION	6,234	64.060	399,350.04	
	OPEN TEXT CORP	23,585	39.090	921,937.65	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,452	21.420	395,241.84	
	PARKLAND CORP	14,201	28.860	409,840.86	
	PEMBINA PIPELINE CORP	48,566	44.390	2,155,844.74	
	POWER CORP OF CANADA	48,260	32.330	1,560,245.80	
	QUEBECOR INC -CL B	13,982	27.510	384,644.82	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	25,390	88.560	2,248,538.40	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,700	74.450	722,165.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	31,334	59.640	1,868,759.76	
	ROYAL BANK OF CANADA	120,849	126.760	15,318,819.24	
	SAPUTO INC	22,011	33.800	743,971.80	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,019	36.230	1,522,348.37	
	SHOPIFY INC - CLASS A	102,785	48.470	4,981,988.95	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	51,246	61.910	3,172,639.86	
	SUNCOR ENERGY INC	118,343	40.600	4,804,725.80	
	TC ENERGY CORP	88,028	54.310	4,780,800.68	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	41,121	49.860	2,050,293.06	
	TFI INTERNATIONAL INC	7,172	139.980	1,003,936.56	
	THOMSON REUTERS CORP	14,937	152.600	2,279,386.20	
	TMX GROUP LTD	5,015	133.480	669,402.20	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,268	97.310	707,249.08	
	TORONTO-DOMINION BANK	157,794	86.610	13,666,538.34	
	TOURMALINE OIL CORP	27,512	71.000	1,953,352.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,073	98.170	498,016.41	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	38,946	52.290	2,036,486.34	
	WSP GLOBAL INC	10,791	155.160	1,674,331.56	
カナダ・ドル　小計		3,511,405		199,783,715.86 (19,690,683,035)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,700	3.650	816,505.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	35,600	8.180	291,208.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	156,900	34.110	5,351,859.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	537,900	0.945	508,315.50	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,600	28.480	244,928.00	
	KEPPEL CORP LTD	131,000	7.310	957,610.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	294,200	12.210	3,592,182.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	116,600	5.580	650,628.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	75,200	8.980	675,296.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	140,900	3.380	476,242.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	725,000	2.600	1,885,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,300	30.960	3,167,208.00	
	UOL Group Limited	43,700	6.720	293,664.00	
	VENTURE CORP LTD	24,400	17.140	418,216.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	166,600	4.140	689,724.00	
シンガポール・ドル　小計		2,782,600		20,018,585.50 (1,985,443,310)	
スイス・フラン	ABB LTD	136,187	28.180	3,837,749.66	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,880	30.020	416,677.60	
	ALCON INC	43,303	62.580	2,709,901.74	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	2,850	83.150	236,977.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,028	139.200	560,697.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,806	89.150	250,154.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	314	1,830.000	574,620.00	
	BKW AG	1,866	126.200	235,489.20	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	88	9,430.000	829,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	94,400.000	944,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	45,260	118.100	5,345,206.00	
	CLARIANT AG	18,938	14.790	280,093.02	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	233,333	2.779	648,432.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	599	625.000	374,375.00	
	GEBERIT AG-REG	3,093	432.600	1,338,031.80	
	GIVAUDAN-REG	800	2,857.000	2,285,600.00	
	HOLCIM LTD	48,238	47.290	2,281,175.02	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,564	53.160	986,862.24	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,736	212.900	1,008,294.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,910	54.920	818,857.20	
	LONZA GROUP AG	6,444	444.600	2,865,002.40	
	NESTLE SA	238,287	107.920	25,715,933.04	
	NOVARTIS AG	187,443	84.140	15,771,454.02	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,947	820.600	1,597,708.20	
	ROCHE HOLDING AG	60,827	300.300	18,266,348.10	

	ROCHE HOLDING AG-BR	2,333	368.800	860,410.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,349	164.600	386,645.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,258	173.150	564,122.70	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	551	2,133.000	1,175,283.00	
	SIG GROUP AG	26,690	20.520	547,678.80	
	SIKA AG-BEARER	12,643	225.200	2,847,203.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,612	216.200	997,114.40	
	STRAUMANN HOLDING AG	9,584	102.450	981,880.80	
	SWATCH GROUP AG	2,209	254.400	561,969.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,674	471.700	1,261,325.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,784	78.950	535,596.80	
	SWISS RE AG	26,289	84.520	2,221,946.28	
	SWISSCOM AG	2,266	498.300	1,129,147.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	5,497	51.400	282,545.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,247	46.740	291,984.78	
	UBS GROUP AG	289,804	16.755	4,855,666.02	
	VAT GROUP AG	2,279	261.200	595,274.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,045	438.500	5,720,232.50	
スイス・フラン　小計		1,507,865		115,995,510.32 (16,782,230,433)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	25,007	300.000	7,502,100.00	
	ASSA ABLOY AB	87,389	229.600	20,064,514.40	
	ATLAS COPCO AB	136,387	114.660	15,638,133.42	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	231,129	126.520	29,242,441.08	
	BIOVITRUM	14,788	220.200	3,256,317.60	
	BOLIDEN AB	23,572	393.350	9,272,046.20	
	ELECTROLUX AB	19,243	140.000	2,694,020.00	
	EMBRACER GROUP AB	56,592	47.360	2,680,197.12	
	EPIROC AB-A	56,197	192.300	10,806,683.10	
	EPIROC AB-B	34,671	169.850	5,888,869.35	
	EQT AB	25,492	215.900	5,503,722.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	53,123	276.000	14,661,948.00	
	EVOLUTION AB	15,802	991.500	15,667,683.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	52,398	47.100	2,467,945.80	
	GETINGE AB-B SHS	19,459	213.800	4,160,334.20	
	HENNES & MAURITZ AB	63,441	111.960	7,102,854.36	
	HEXAGON AB-B SHS	168,612	112.850	19,027,864.20	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,192	413.900	3,390,668.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,535	72.880	2,589,790.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,203	254.000	1,575,562.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	19,406	254.000	4,929,124.00	
	INDUTRADE AB	22,907	213.300	4,886,063.10	

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	12,510	194.700	2,435,697.00	
	INVESTOR AB	156,284	188.920	29,525,173.28	
	INVESTOR AB-A SHS	45,421	195.550	8,882,076.55	
	KINNEVIK AB - B	20,469	142.250	2,911,715.25	
	LIFCO AB-B SHS	19,843	172.900	3,430,854.70	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,644	444.200	2,951,264.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	130,987	98.400	12,889,120.80	
	NORDEA BANK ABP	291,969	107.580	31,410,025.02	
	SAGAX AB-B	16,055	227.600	3,654,118.00	
	SANDVIK AB	92,194	188.600	17,387,788.40	
	SECURITAS AB	42,368	83.540	3,539,422.72	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	140,249	117.950	16,542,369.55	
	SKANSKA AB-B SHS	29,799	163.250	4,864,686.75	
	SKF AB	33,157	160.100	5,308,435.70	
	SVENSKA CELLULOSA AB	52,716	133.200	7,021,771.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	127,467	103.350	13,173,714.45	
	SWEDBANK AB - A SHARES	78,448	173.000	13,571,504.00	
	TELE2 AB	51,329	85.260	4,376,310.54	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	252,909	61.260	15,493,205.34	
	TELIA CO AB	239,772	26.330	6,313,196.76	
	VOLVO AB	127,289	190.000	24,184,910.00	
	VOLVO AB-A SHS	20,628	200.200	4,129,725.60	
	VOLVO CAR AB-B	51,142	46.850	2,396,002.70	
スウェーデン・クローナ　小計		3,215,194		429,401,972.44 (5,556,461,523)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	427	14,825.000	6,330,275.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	289	14,590.000	4,216,510.00	
	CARLSBERG AS-B	8,366	911.400	7,624,772.40	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,180	512.200	4,701,996.00	
	COLOPLAST-B	10,262	817.200	8,386,106.40	
	DANSKE BANK A/S	59,915	130.200	7,800,933.00	
	DEMANT A/S	7,621	180.650	1,376,733.65	
	DSV A/S	16,519	1,088.500	17,980,931.50	
	GENMAB A/S	5,694	3,034.000	17,275,596.00	
	NOVO-NORDISK A/S	143,343	916.000	131,302,188.00	
	NOVOZYMES A/S	17,610	358.300	6,309,663.00	
	ORSTED A/S	16,298	628.000	10,235,144.00	
	PANDORA A/S	7,628	492.800	3,759,078.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	745	1,540.500	1,147,672.50	
	TRYGVESTA AS	31,778	162.750	5,171,869.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	87,499	196.840	17,223,303.16	
デンマーク・クローネ　小計		423,174		250,842,772.51 (4,808,655,949)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	119,484	8.030	959,456.52	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	50,109	22.000	1,102,398.00	
	MERCURY NZ LTD	63,181	5.595	353,497.69	
	MERIDIAN ENERGY LTD	115,394	5.180	597,740.92	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	171,855	5.270	905,675.85	
ニュージーランド・ドル　小計		520,023		3,918,768.98 (334,623,683)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	25,762	67.400	1,736,358.80	
	AKER BP ASA	27,436	300.000	8,230,800.00	
	DNB BANK ASA	81,592	186.900	15,249,544.80	
	EQUINOR ASA	82,310	361.650	29,767,411.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,901	192.500	3,445,942.50	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,758	407.800	3,163,712.40	
	MOWI ASA	35,722	160.150	5,720,878.30	
	NORSK HYDRO ASA	116,182	70.000	8,132,740.00	
	ORKLA ASA	66,435	70.540	4,686,324.90	
	SALMAR ASA	5,605	359.200	2,013,316.00	
	TELENOR ASA	64,219	89.700	5,760,444.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,430	425.100	6,134,193.00	
ノルウェー・クローネ　小計		545,352		94,041,666.50 (1,277,085,831)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	34,811	12.610	438,966.71	
	ACCIONA SA	2,098	174.300	365,681.40	
	ACCOR	14,774	23.940	353,689.56	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,392	26.130	506,712.96	
	ADIDAS AG	14,992	121.180	1,816,730.56	
	ADP	2,931	124.750	365,642.25	
	ADYEN NV	1,877	1,335.000	2,505,795.00	
	AEGON NV	152,383	4.683	713,609.58	
	AENA SME SA	6,983	121.100	845,641.30	
	AGEAS	13,949	41.300	576,093.70	
	AIB GROUP PLC	90,821	3.362	305,340.20	
	AIR LIQUIDE	45,410	133.100	6,044,071.00	
	AIRBUS SE	51,181	110.940	5,678,020.14	
	AKZO NOBEL NV	15,734	63.080	992,500.72	
	ALLIANZ SE	35,405	199.320	7,056,924.60	
	ALSTOM RGPT	27,802	23.080	641,670.16	
	AMADEUS IT GROUP SA	38,948	50.600	1,970,768.80	
	AMPLIFON SPA	10,778	26.910	290,035.98	
	AMUNDI SA	5,243	52.050	272,898.15	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	75,355	56.220	4,236,458.10	
	ARCELORMITTAL	44,398	24.040	1,067,327.92	
	ARGENX SE	4,794	355.700	1,705,225.80	
	ARKEMA	4,977	84.620	421,153.74	
	AROUNDTOWN SA	89,248	2.339	208,751.07	

ASM INTERNATIONAL NV	4,044	247.950	1,002,709.80	
ASML HOLDING NV	35,220	537.300	18,923,706.00	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	95,722	16.685	1,597,121.57	
AXA SA	161,386	26.260	4,237,996.36	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	521,830	5.404	2,819,969.32	
BANCO SANTANDER SA	1,445,600	2.717	3,927,695.20	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	92,221	8.362	771,152.00	
BASF SE	79,496	45.520	3,618,657.92	
BAYER AG	85,159	48.805	4,156,184.99	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,567	83.620	2,388,772.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,058	79.800	403,628.40	
BECHTLE AG	7,010	33.330	233,643.30	
BEIERSDORF AG	8,805	106.450	937,292.25	
BIOMERIEUX	3,620	95.620	346,144.40	
BNP PARIBAS	96,040	52.200	5,013,288.00	
BOLLORE SE	77,796	5.210	405,317.16	
BOUYGUES	20,197	27.930	564,102.21	
BRENNTAG SE	13,373	57.000	762,261.00	
BUREAU VERITAS SA	25,663	24.470	627,973.61	
CAIXABANK	382,469	3.532	1,350,880.50	
CAPGEMINI SA	14,144	157.500	2,227,680.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,449	116.050	400,256.45	
CARREFOUR SA	51,124	15.730	804,180.52	
CELLNEX TELECOM SAU	47,215	31.340	1,479,718.10	
CIE DE SAINT-GOBAIN	42,647	44.625	1,903,122.37	
CNH INDUSTRIAL NV	88,555	14.970	1,325,668.35	
COMMERZBANK AG	91,224	8.224	750,226.17	
CONTINENTAL AG	9,490	55.680	528,403.20	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,614	37.260	209,177.64	
COVESTRO AG	16,429	36.110	593,251.19	
CREDIT AGRICOLE SA	105,284	9.449	994,828.51	
CRH PLC	65,298	37.015	2,417,005.47	
D'IETEREN GROUP	2,134	175.700	374,943.80	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,044	30.150	1,177,176.60	
DANONE	55,667	49.560	2,758,856.52	
DASSAULT AVIATION SA	2,152	160.200	344,750.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	57,677	34.090	1,966,208.93	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	45,202	9.852	445,330.10	
DELIVERY HERO SE	14,856	42.650	633,608.40	
DEUTSCHE BANK AG	178,686	9.938	1,775,781.46	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,529	164.600	2,720,673.40	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	51,350	8.061	413,932.35	

DEUTSCHE POST AG	86,645	34.815	3,016,545.67	
DEUTSCHE TELEKOM AG	282,096	18.946	5,344,590.81	
DIASORIN ITALIA SPA	2,185	128.150	280,007.75	
DR ING HC F PORSCHE AG	9,882	96.880	957,368.16	
E.ON SE	194,610	9.086	1,768,226.46	
EDENRED	21,784	50.840	1,107,498.56	
EDF	50,931	12.000	611,172.00	
EDP RENOVAVEIS SA	24,431	21.530	525,999.43	
EIFFAGE	7,321	92.300	675,728.30	
ELIA GROUP SA/NV	2,925	135.200	395,460.00	
ELISA OYJ	12,591	49.390	621,869.49	
ENAGAS SA	21,440	15.970	342,396.80	
ENDESA SA	27,553	17.495	482,039.73	
ENEL SPA	705,639	5.046	3,560,654.39	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	241,615	4.634	1,119,643.91	
ENGIE	158,369	13.954	2,209,881.02	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	215,808	12.990	2,803,345.92	
ERSTE GROUP BANK AG	29,954	28.560	855,486.24	
ESSILORLUXOTTICA	25,195	171.750	4,327,241.25	
EURAZEO	3,790	57.700	218,683.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,611	63.740	740,085.14	
EURONEXT NV	7,553	69.100	521,912.30	
EVONIK INDUSTRIES AG	18,165	17.700	321,520.50	
EXOR NV	9,607	69.280	665,572.96	
FERRARI NV	10,947	204.900	2,243,040.30	
FERROVIAL S.A.	43,166	24.500	1,057,567.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	189,117	13.474	2,548,162.45	
FINECOBANK SPA	52,629	14.875	782,856.37	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	14,470	131.050	1,896,293.50	
FORTUM OYJ	38,628	15.155	585,407.34	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	17,912	29.520	528,762.24	
FRESENIUS SE & CO KGAA	36,578	25.790	943,346.62	
GALP ENERGIA SGPS SA	44,181	11.940	527,521.14	
GEA GROUP AG	13,100	39.060	511,686.00	
GETLINK SE - REGR	41,031	15.005	615,670.15	
GRIFOLS SA	25,819	10.170	262,579.23	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,088	74.460	676,692.48	
HANNOVER RUECK SE	5,246	182.700	958,444.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,368	52.340	647,341.12	
HEINEKEN HOLDING NV	8,734	72.400	632,341.60	
HEINEKEN NV	22,461	88.280	1,982,857.08	
HELLOFRESH SE	14,078	21.080	296,764.24	
HENKEL AG & CO KGAA	9,898	61.450	608,232.10	
HENKEL KGAA-VORZUG	14,813	66.200	980,620.60	

HERMES INTERNATIONAL	2,744	1,478.500	4,057,004.00	
IBERDROLA SA	523,141	10.780	5,639,459.98	
IMCD NV	4,883	137.600	671,900.80	
INDITEX SA	94,278	24.510	2,310,753.78	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	113,082	29.415	3,326,307.03	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	31,685	9.368	296,825.08	
ING GROEP NV-CVA	325,629	11.262	3,667,233.79	
INTESA SANPAOLO	1,446,399	2.034	2,941,975.56	
IPSEN	3,227	98.500	317,859.50	
JDE PEET'S BV	8,818	27.700	244,258.60	
JERONIMO MARTINS	24,242	20.320	492,597.44	
JUST EAT TAKEAWAY	16,138	20.410	329,376.58	
KBC GROEP NV	21,483	57.400	1,233,124.20	
KERING	6,487	485.850	3,151,708.95	
KERRY GROUP PLC-A	13,786	86.360	1,190,558.96	
KESKO OYJ-B SHS	23,193	20.500	475,456.50	
KINGSPAN GROUP PLC	13,302	50.320	669,356.64	
KNORR-BREMSE AG	6,275	52.400	328,810.00	
KONE OYJ	29,479	47.870	1,411,159.73	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,850	27.280	2,451,108.00	
KONINKLIJKE DSM NV	15,109	116.350	1,757,932.15	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,073	12.768	984,068.06	
L'OREAL SA	20,905	335.050	7,004,220.25	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,994	37.870	340,602.78	
LEG IMMOBILIEN SE	6,379	59.840	381,719.36	
LEGRAND SA	23,118	76.640	1,771,763.52	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,980	687.300	16,481,454.00	
MEDIOBANCA SPA	53,448	8.936	477,611.32	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	69,330	62.630	4,342,137.90	
MERCK KGAA	11,163	179.350	2,002,084.05	
MICHELIN (C.G.D.E.)	58,637	25.900	1,518,698.30	
MONCLER SPA	17,756	48.530	861,698.68	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,633	203.900	944,668.70	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	12,132	299.400	3,632,320.80	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,630	25.540	322,570.20	
NEMETSCHEK SE	4,922	47.830	235,419.26	
NESTE OYJ	36,498	45.390	1,656,644.22	
NEXI SPA	51,110	7.530	384,858.30	
NN GROUP NV	23,933	41.170	985,321.61	
NOKIA OYJ	467,723	4.368	2,043,014.06	
OCI NV	9,276	34.560	320,578.56	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	5,930	80.250	475,882.50	

OMV AG	12,645	46.660	590,015.70	
ORANGE S.A.	175,603	9.225	1,619,937.67	
ORION OYJ-CLASS B	9,203	51.740	476,163.22	
PERNOD-RICARD	17,883	183.150	3,275,271.45	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	13,136	51.780	680,182.08	
POSTE ITALIANE SPA	47,608	9.056	431,138.04	
PROSUS	71,877	63.950	4,596,534.15	
PRYSMIAN SPA	22,163	35.260	781,467.38	
PUBLICIS GROUPE	19,656	59.420	1,167,959.52	
PUMA AG	9,180	51.640	474,055.20	
QIAGEN NV	19,772	46.350	916,432.20	
RANDSTAD NV	10,159	56.240	571,342.16	
RATIONAL AG	443	562.500	249,187.50	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	9,073	39.220	355,843.06	
RED ELECTRICA DE ESPANA	34,554	16.695	576,879.03	
REMY COINTREAU	2,004	159.800	320,239.20	
RENAULT SA	16,705	32.920	549,928.60	
REPSOL SA	118,514	14.220	1,685,269.08	
RHEINMETALL AG	3,761	185.750	698,605.75	
ROYAL KPN NV	293,053	2.916	854,542.54	
RWE AG	55,671	41.570	2,314,243.47	
SAFRAN SA	29,732	116.580	3,466,156.56	
SAMPO OYJ	41,351	48.740	2,015,447.74	
SANOFI	98,865	88.760	8,775,257.40	
SAP SE	90,435	98.890	8,943,117.15	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,101	339.500	713,289.50	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,396	297.300	712,330.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,964	131.960	6,197,369.44	
SCOUT24 SE	7,104	47.500	337,440.00	
SEB SA	2,189	76.800	168,115.20	
SIEMENS AG	66,262	128.020	8,482,861.24	
SIEMENS ENERGY AG	37,861	16.910	640,229.51	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	20,802	17.985	374,123.97	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,392	47.340	1,154,717.28	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	21,253	35.210	748,318.13	
SNAM SPA	175,890	4.666	820,702.74	
SOCIETE GENERALE	69,368	22.390	1,553,149.52	
SODEXO	7,670	92.160	706,867.20	
SOFINA	1,346	206.800	278,352.80	
SOLVAY SA	6,398	93.640	599,108.72	
STMICROELECTRONICS NV	59,158	34.650	2,049,824.70	
STORA ENSO OYJ	47,336	13.200	624,835.20	
SYMRISE AG	11,556	104.650	1,209,335.40	
TELECOM ITALIA SPA	894,546	0.211	188,749.20	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	97,121	2.287	222,115.72	

	TELEFONICA SA	454,676	3.290	1,495,884.04	
	TELEPERFORMANCE	5,096	214.900	1,095,130.40	
	TENARIS SA	40,485	15.710	636,019.35	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	122,299	7.184	878,596.01	
	THALES SA	9,222	119.600	1,102,951.20	
	TOTALENERGIES SE	215,376	56.650	12,201,050.40	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	8,188	25.870	211,823.56	
	UCB SA	10,897	74.200	808,557.40	
	UMICORE	18,090	34.800	629,532.00	
	UNICREDIT SPA	165,966	12.686	2,105,444.67	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,592	18.710	160,756.32	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	62,839	22.325	1,402,880.67	
	UPM-KYMMENE OYJ	46,167	35.130	1,621,846.71	
	VALEO SA	18,169	17.340	315,050.46	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,659	24.170	1,393,618.03	
	VINCI SA	46,836	92.860	4,349,190.96	
	VIVENDI SA	61,751	8.732	539,209.73	
	VOESTALPINE AG	9,763	24.260	236,850.38	
	VOLKSWAGEN AG	2,612	156.300	408,255.60	
	VOLKSWAGEN AG	16,069	121.980	1,960,096.62	
	VONOVIA SE	62,167	21.480	1,335,347.16	
	WARTSILA OYJ	40,996	8.074	331,001.70	
	WENDEL	2,406	86.750	208,720.50	
	WOLTERS KLUWER NV	22,684	100.750	2,285,413.00	
	WORLDLINE SA	20,803	37.330	776,575.99	
	ZALANDO SE	19,313	31.640	611,063.32	
ユーロ　小計		15,979,974		369,872,123.41 (52,758,559,683)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,034,675	83.550	86,447,096.25	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	323,039	26.200	8,463,621.80	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	150,300	24.750	3,719,925.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	173,909	46.350	8,060,682.15	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	234,909	45.250	10,629,632.25	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	57,000	39.850	2,271,450.00	
	CLP HOLDINGS LTD	144,643	55.900	8,085,543.70	
	ESR GROUP LIMITED	176,600	16.620	2,935,092.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,810	50.150	9,518,971.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	180,157	15.100	2,720,370.70	
	HANG SENG BANK LTD	67,212	127.000	8,535,924.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	132,641	26.600	3,528,250.60	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,005,437	7.330	7,369,853.21	

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,411	329.600	34,413,865.60	
	MTR CORP	146,255	40.150	5,872,138.25	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	141,917	21.900	3,107,982.30	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	122,587	41.750	5,118,007.25	
	SANDS CHINA LTD	212,180	24.900	5,283,282.00	
	SINO LAND CO	314,000	9.830	3,086,620.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	122,000	18.560	2,264,320.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	127,023	105.100	13,350,117.30	
	SWIRE PACIFIC LTD	43,366	65.500	2,840,473.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	109,400	19.480	2,131,112.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	88.100	10,483,900.00	
	WH GROUP LTD	721,500	4.490	3,239,535.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	146,733	45.200	6,632,331.60	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	155,000	14.380	2,228,900.00	
香港・ドル　小計		6,455,704		262,338,997.46 (4,535,841,266)	
合計		95,566,764		530,189,806,408 (530,189,806,408)	

（２）株式以外の有価証券

2022年12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,390.00	1,929,632.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	27,257.00	826,159.67	
		AMERICAN TOWER REIT INC	40,331.00	8,454,184.22	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	40,542.00	866,787.96	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,012.00	1,948,586.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,945.00	861,101.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,676.00	957,743.64	
		CROWN CASTLE INC	37,544.00	5,001,236.24	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,829.00	2,467,754.31	
		EQUINIX INC	7,897.00	5,197,726.43	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,264.00	969,111.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	30,680.00	1,830,062.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,624.00	1,172,997.68	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,551.00	1,694,647.21	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,199.00	1,148,132.28	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	32,979.00	609,451.92	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,297.00	1,152,795.30	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	61,710.00	1,035,493.80	
	INVITATION HOMES INC	52,919.00	1,574,340.25	
	IRON MOUNTAIN INC	25,168.00	1,263,685.28	
	KIMCO REALTY CORP	52,844.00	1,108,667.12	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	51,724.00	565,343.32	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,889.00	1,535,860.59	
	PROLOGIS INC	79,896.00	8,953,944.72	
	PUBLIC STORAGE	13,643.00	3,880,478.49	
	REALTY INCOME CORP	53,482.00	3,398,246.28	
	REGENCY CENTERS CORP	13,193.00	822,319.69	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,364.00	2,598,135.44	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,303.00	3,272,392.86	
	SUN COMMUNITIES INC	10,703.00	1,503,450.41	
	UDR INC	28,141.00	1,082,021.45	
	VENTAS INC	34,549.00	1,539,157.95	
	VICI PROPERTIES INC	83,705.00	2,768,961.40	
	WELLTOWER INC	40,211.00	2,561,440.70	
	WP CAREY INC	16,667.00	1,333,693.34	
アメリカ・ドル　小計		1,056,128.00	77,885,744.25 (10,478,748,033)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	74,543.00	289,599.55	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	60,949.00	375,202.04	
	SEGRO PLC	102,295.00	782,352.16	
イギリス・ポンド　小計		237,787.00	1,447,153.75 (236,508,337)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	106,401.00	854,400.03	
	GOODMAN GROUP	150,506.00	2,695,562.46	
	GPT GROUP	186,828.00	810,833.52	
	MIRVAC GROUP	378,070.00	827,973.30	
	SCENTRE GROUP	483,270.00	1,396,650.30	
	STOCKLAND	227,957.00	875,354.88	
	VICINITY CENTRES	367,764.00	731,850.36	
オーストラリア・ドル　小計		1,900,796.00	8,192,624.85 (738,237,425)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,538.00	313,128.52	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,208.00	270,631.92	
カナダ・ドル　小計		20,746.00	583,760.44 (57,535,429)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	295,300.00	794,357.00	

		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	459,290.00	923,172.90	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	288,400.00	458,556.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	204,700.00	335,708.00	
	シンガポール・ドル　小計		1,247,690.00	2,511,793.90 (249,119,719)	
	ユーロ	COVIVIO	3,886.00	212,369.90	
		GECINA SA	3,853.00	364,301.15	
		KLEPIERRE	18,422.00	401,599.60	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,139.00	507,761.12	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,308.00	349,468.08	
	ユーロ　小計		49,608.00	1,835,499.85 (261,815,699)	
	香港・ドル	LINK REIT	183,571.00	10,160,654.85	
	香港・ドル　小計		183,571.00	10,160,654.85 (175,677,722)	
投資証券　合計			4,696,326	12,197,642,364 (12,197,642,364)	
合計				12,197,642,364 (12,197,642,364)	

（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	603銘柄	68.60	－	72.78
	投資証券	35銘柄	－	1.87	
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	4.47	－	4.66
	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	－	0.15
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.21	－	2.41
	投資証券	7銘柄	－	0.13	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.52	－	3.64
	投資証券	2銘柄	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.35	－	0.41
	投資証券	4銘柄	－	0.04	
スイス・フラン	株式	43銘柄	3.00	－	3.09
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	0.99	－	1.02
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.86	－	0.89
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.06	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.23	－	0.24
ユーロ	株式	223銘柄	9.42	－	9.78
	投資証券	5銘柄	－	0.05	
香港・ドル	株式	27銘柄	0.81	－	0.87
	投資証券	1銘柄	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,294,684
コール・ローン	607,019,013
国債証券	51,735,766,020
地方債証券	4,285,705,876
特殊債券	5,709,732,634
社債券	5,512,607,800
未収利息	99,217,260
前払費用	1,290,646
流動資産合計	67,957,633,933
資産合計	67,957,633,933
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,914,433
その他未払費用	794
流動負債合計	20,915,227
負債合計	20,915,227
純資産の部	
元本等	
元本	72,528,911,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△4,592,192,685
元本等合計	67,936,718,706
純資産合計	67,936,718,706
負債純資産合計	67,957,633,933

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2022年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,069,157,952円
	同期中追加設定元本額	8,278,560,971円
	同期中一部解約元本額	15,818,807,532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）	53,825,077,005円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	4,183,836,858円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	163,671,078円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	6,885,363,681円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	315,885,656円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	1,586,926,947円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	2,408,722,017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）	284,914,361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）	31,245,699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）	95,646,654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）	68,483,210円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	84,945,031円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	104,413,935円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	383,964,185円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	2,085,538,471円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	15,022,723円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	5,253,880円
	計	72,528,911,391円
２．	受益権の総数	72,528,911,391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4,592,192,685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　2022年1月11日 至　2022年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△2,538,914,040
地方債証券	△121,800,334
特殊債券	△128,950,942
社債券	△56,065,000
合計	△2,845,730,316

（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12月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9367円 (9,367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12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第４３２回　利付国債（２年）	111,000,000	111,074,370	
	第４３３回　利付国債（２年）	114,000,000	114,069,540	
	第４３４回　利付国債（２年）	114,000,000	114,067,260	
	第４３５回　利付国債（２年）	102,000,000	102,058,140	
	第４３６回　利付国債（２年）	95,000,000	95,051,300	
	第４３７回　利付国債（２年）	106,000,000	106,045,580	
	第４３８回　利付国債（２年）	92,000,000	92,027,600	
	第４３９回　利付国債（２年）	200,000,000	200,048,000	
	第４４０回　利付国債（２年）	175,000,000	175,028,000	
	第４４１回　利付国債（２年）	400,000,000	400,032,000	
	第４４２回　利付国債（２年）	200,000,000	200,018,000	
	第１３９回　利付国債（５年）	53,000,000	53,088,510	
	第１４０回　利付国債（５年）	296,000,000	296,529,840	
	第１４１回　利付国債（５年）	377,000,000	377,689,910	
	第１４２回　利付国債（５年）	405,000,000	405,724,950	
	第１４３回　利付国債（５年）	377,000,000	377,716,300	
	第１４４回　利付国債（５年）	497,000,000	498,053,640	

第１４５回　利付国債（５年）	290,000,000	290,635,100	
第１４６回　利付国債（５年）	80,000,000	80,179,200	
第１４９回　利付国債（５年）	456,000,000	454,891,920	
第１５０回　利付国債（５年）	200,000,000	199,282,000	
第１５３回　利付国債（５年）	408,000,000	405,445,920	
第１回　利付国債（４０年）	95,000,000	114,534,850	
第２回　利付国債（４０年）	115,000,000	133,552,950	
第３回　利付国債（４０年）	118,000,000	137,429,880	
第４回　利付国債（４０年）	157,000,000	181,502,990	
第５回　利付国債（４０年）	159,000,000	176,594,940	
第６回　利付国債（４０年）	167,000,000	180,521,990	
第７回　利付国債（４０年）	183,000,000	188,976,780	
第８回　利付国債（４０年）	184,000,000	175,984,960	
第９回　利付国債（４０年）	232,000,000	161,755,040	
第１０回　利付国債（４０年）	211,000,000	173,338,610	
第１１回　利付国債（４０年）	174,000,000	137,665,320	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	74,708,800	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	118,869,100	
第１４回　利付国債（４０年）	236,000,000	176,596,440	
第１５回　利付国債（４０年）	106,000,000	86,497,060	
第３３３回　利付国債（１０年）	89,000,000	89,703,100	
第３３４回　利付国債（１０年）	387,000,000	390,587,490	
第３３５回　利付国債（１０年）	152,000,000	153,340,640	
第３３６回　利付国債（１０年）	205,000,000	207,004,900	
第３３７回　利付国債（１０年）	348,000,000	350,014,920	
第３３８回　利付国債（１０年）	519,000,000	523,478,970	
第３３９回　利付国債（１０年）	387,000,000	390,715,200	
第３４０回　利付国債（１０年）	470,000,000	474,902,100	
第３４１回　利付国債（１０年）	493,000,000	497,057,390	
第３４２回　利付国債（１０年）	423,000,000	423,888,300	
第３４３回　利付国債（１０年）	341,000,000	341,593,340	
第３４４回　利付国債（１０年）	334,000,000	334,374,080	
第３４５回　利付国債（１０年）	472,000,000	472,089,680	
第３４６回　利付国債（１０年）	328,000,000	327,721,200	
第３４７回　利付国債（１０年）	272,000,000	271,450,560	

第３４８回　利付国債（１０年）	338,000,000	336,884,600	
第３４９回　利付国債（１０年）	494,000,000	491,312,640	
第３５０回　利付国債（１０年）	637,000,000	632,216,130	
第３５１回　利付国債（１０年）	564,000,000	559,256,760	
第３５２回　利付国債（１０年）	370,000,000	366,540,500	
第３５３回　利付国債（１０年）	353,000,000	349,251,140	
第３５４回　利付国債（１０年）	333,000,000	329,017,320	
第３５５回　利付国債（１０年）	339,000,000	334,464,180	
第３５６回　利付国債（１０年）	380,000,000	374,353,200	
第３５７回　利付国債（１０年）	384,000,000	377,698,560	
第３５８回　利付国債（１０年）	384,000,000	376,285,440	
第３５９回　利付国債（１０年）	337,000,000	329,521,970	
第３６０回　利付国債（１０年）	297,000,000	289,975,950	
第３６１回　利付国債（１０年）	467,000,000	455,259,620	
第３６２回　利付国債（１０年）	466,000,000	453,753,520	
第３６３回　利付国債（１０年）	480,000,000	466,824,000	
第３６４回　利付国債（１０年）	598,000,000	581,112,480	
第３６５回　利付国債（１０年）	566,000,000	550,055,780	
第３６６回　利付国債（１０年）	244,000,000	240,720,640	
第３６７回　利付国債（１０年）	189,000,000	185,626,350	
第３６８回　利付国債（１０年）	381,000,000	373,498,110	
第１回　利付国債（３０年）	6,000,000	6,992,100	
第２回　利付国債（３０年）	66,000,000	75,486,180	
第３回　利付国債（３０年）	81,000,000	92,276,010	
第４回　利付国債（３０年）	40,000,000	47,726,800	
第５回　利付国債（３０年）	52,000,000	59,592,000	
第６回　利付国債（３０年）	39,000,000	45,714,240	
第７回　利付国債（３０年）	31,000,000	36,358,350	
第８回　利付国債（３０年）	63,000,000	71,144,010	
第９回　利付国債（３０年）	80,000,000	87,228,800	

第１０回　利付国債（３０年）	21,000,000	22,260,210	
第１１回　利付国債（３０年）	25,000,000	28,005,500	
第１２回　利付国債（３０年）	73,000,000	84,826,730	
第１３回　利付国債（３０年）	14,000,000	16,130,100	
第１４回　利付国債（３０年）	35,000,000	41,856,150	
第１５回　利付国債（３０年）	74,000,000	89,408,280	
第１６回　利付国債（３０年）	53,000,000	64,121,520	
第１７回　利付国債（３０年）	54,000,000	64,769,220	
第１８回　利付国債（３０年）	63,000,000	74,873,610	
第１９回　利付国債（３０年）	52,000,000	61,844,120	
第２０回　利付国債（３０年）	59,000,000	71,638,390	
第２１回　利付国債（３０年）	60,000,000	71,479,200	
第２２回　利付国債（３０年）	72,000,000	87,600,960	
第２３回　利付国債（３０年）	73,000,000	88,928,600	
第２４回　利付国債（３０年）	43,000,000	52,443,660	
第２５回　利付国債（３０年）	51,000,000	60,859,320	
第２６回　利付国債（３０年）	108,000,000	130,345,200	
第２７回　利付国債（３０年）	132,000,000	161,175,960	
第２８回　利付国債（３０年）	177,000,000	216,120,540	
第２９回　利付国債（３０年）	209,000,000	252,413,480	
第３０回　利付国債（３０年）	226,000,000	269,312,900	
第３１回　利付国債（３０年）	193,000,000	227,037,480	
第３２回　利付国債（３０年）	242,000,000	288,057,440	
第３３回　利付国債（３０年）	273,000,000	311,798,760	
第３４回　利付国債（３０年）	252,000,000	295,691,760	
第３５回　利付国債（３０年）	281,000,000	320,803,650	
第３６回　利付国債（３０年）	271,000,000	309,243,520	
第３７回　利付国債（３０年）	289,000,000	323,879,410	
第３８回　利付国債（３０年）	191,000,000	210,522,110	
第３９回　利付国債（３０年）	175,000,000	195,956,250	
第４０回　利付国債（３０年）	145,000,000	159,584,100	
第４１回　利付国債（３０年）	150,000,000	162,169,500	
第４２回　利付国債（３０年）	163,000,000	176,051,410	
第４３回　利付国債（３０年）	156,000,000	168,320,880	
第４４回　利付国債（３０年）	165,000,000	177,846,900	
第４５回　利付国債（３０年）	180,000,000	186,957,000	
第４６回　利付国債（３０年）	216,000,000	224,033,040	
第４７回　利付国債（３０年）	201,000,000	212,048,970	
第４８回　利付国債（３０年）	223,000,000	226,318,240	
第４９回　利付国債（３０年）	220,000,000	222,906,200	
第５０回　利付国債（３０年）	222,000,000	197,946,300	
第５１回　利付国債（３０年）	155,000,000	122,260,900	
第５２回　利付国債（３０年）	202,000,000	166,627,780	
第５３回　利付国債（３０年）	187,000,000	157,440,910	
第５４回　利付国債（３０年）	223,000,000	196,117,350	
第５５回　利付国債（３０年）	184,000,000	161,360,640	
第５６回　利付国債（３０年）	188,000,000	164,248,080	
第５７回　利付国債（３０年）	191,000,000	166,389,650	
第５８回　利付国債（３０年）	234,000,000	203,076,900	
第５９回　利付国債（３０年）	181,000,000	152,744,090	

第６０回　利付国債（３０年）	184,000,000	162,437,040	
第６１回　利付国債（３０年）	164,000,000	137,404,120	
第６２回　利付国債（３０年）	160,000,000	126,766,400	
第６３回　利付国債（３０年）	132,000,000	101,393,160	
第６４回　利付国債（３０年）	134,000,000	102,534,120	
第６５回　利付国債（３０年）	122,000,000	93,691,120	
第６６回　利付国債（３０年）	125,000,000	95,812,500	
第６７回　利付国債（３０年）	192,000,000	153,431,040	
第６８回　利付国債（３０年）	159,000,000	126,500,400	
第６９回　利付国債（３０年）	198,000,000	161,512,560	
第７０回　利付国債（３０年）	190,000,000	154,481,400	
第７１回　利付国債（３０年）	155,000,000	125,726,700	
第７２回　利付国債（３０年）	153,000,000	123,812,190	
第７３回　利付国債（３０年）	81,000,000	65,457,720	
第７４回　利付国債（３０年）	191,000,000	167,168,930	
第７５回　利付国債（３０年）	191,000,000	180,966,770	
第７６回　利付国債（３０年）	129,000,000	124,552,080	
第６９回　利付国債（２０年）	32,000,000	32,849,920	
第７０回　利付国債（２０年）	234,000,000	242,473,140	
第７２回　利付国債（２０年）	136,000,000	141,003,440	
第７３回　利付国債（２０年）	105,000,000	109,171,650	
第７４回　利付国債（２０年）	64,000,000	66,670,720	
第７５回　利付国債（２０年）	50,000,000	52,338,000	
第７６回　利付国債（２０年）	71,000,000	74,001,880	
第７７回　利付国債（２０年）	52,000,000	54,315,040	
第７８回　利付国債（２０年）	77,000,000	80,620,540	
第７９回　利付国債（２０年）	64,000,000	67,169,280	
第８０回　利付国債（２０年）	77,000,000	81,004,770	
第８１回　利付国債（２０年）	121,000,000	127,578,770	
第８２回　利付国債（２０年）	135,000,000	142,711,200	
第８３回　利付国債（２０年）	106,000,000	112,586,840	
第８４回　利付国債（２０年）	152,000,000	160,990,800	
第８５回　利付国債（２０年）	115,000,000	122,693,500	
第８６回　利付国債（２０年）	122,000,000	130,952,360	
第８７回　利付国債（２０年）	101,000,000	108,084,140	
第８８回　利付国債（２０年）	158,000,000	170,406,160	
第８９回　利付国債（２０年）	103,000,000	110,728,090	
第９０回　利付国債（２０年）	260,000,000	280,701,200	
第９１回　利付国債（２０年）	185,000,000	200,421,600	
第９２回　利付国債（２０年）	336,000,000	362,826,240	
第９３回　利付国債（２０年）	219,000,000	236,432,400	
第９４回　利付国債（２０年）	267,000,000	289,382,610	
第９５回　利付国債（２０年）	229,000,000	251,098,500	
第９６回　利付国債（２０年）	134,000,000	145,733,040	
第９７回　利付国債（２０年）	196,000,000	214,788,560	
第９８回　利付国債（２０年）	139,000,000	151,669,850	
第９９回　利付国債（２０年）	257,000,000	281,158,000	
第１００回　利付国債（２０年）	189,000,000	208,236,420	

第１０１回　利付国債（２０年）	118,000,000	131,232,520	
第１０２回　利付国債（２０年）	119,000,000	132,906,340	
第１０３回　利付国債（２０年）	112,000,000	124,481,280	
第１０４回　利付国債（２０年）	98,000,000	107,857,820	
第１０５回　利付国債（２０年）	88,000,000	97,196,880	
第１０６回　利付国債（２０年）	53,000,000	58,839,540	
第１０７回　利付国債（２０年）	74,000,000	82,015,680	
第１０８回　利付国債（２０年）	99,000,000	108,555,480	
第１０９回　利付国債（２０年）	79,000,000	86,853,390	
第１１０回　利付国債（２０年）	103,000,000	114,503,040	
第１１１回　利付国債（２０年）	79,000,000	88,591,390	
第１１２回　利付国債（２０年）	126,000,000	140,495,040	
第１１３回　利付国債（２０年）	300,000,000	335,493,000	
第１１４回　利付国債（２０年）	201,000,000	225,485,820	
第１１５回　利付国債（２０年）	120,000,000	135,439,200	
第１１６回　利付国債（２０年）	138,000,000	155,924,820	
第１１７回　利付国債（２０年）	210,000,000	235,794,300	
第１１８回　利付国債（２０年）	134,000,000	149,766,440	
第１１９回　利付国債（２０年）	121,000,000	133,473,890	
第１２０回　利付国債（２０年）	150,000,000	163,278,000	
第１２１回　利付国債（２０年）	206,000,000	229,393,360	
第１２２回　利付国債（２０年）	149,000,000	164,799,960	
第１２３回　利付国債（２０年）	201,000,000	227,566,170	
第１２４回　利付国債（２０年）	128,000,000	143,925,760	
第１２５回　利付国債（２０年）	133,000,000	152,105,450	

第１２６回　利付国債（２０年）	123,000,000	138,705,870	
第１２７回　利付国債（２０年）	119,000,000	133,245,490	
第１２８回　利付国債（２０年）	232,000,000	260,378,240	
第１２９回　利付国債（２０年）	122,000,000	135,921,420	
第１３０回　利付国債（２０年）	189,000,000	211,184,820	
第１３１回　利付国債（２０年）	124,000,000	137,508,560	
第１３２回　利付国債（２０年）	131,000,000	145,789,900	
第１３３回　利付国債（２０年）	156,000,000	174,966,480	
第１３４回　利付国債（２０年）	157,000,000	176,592,030	
第１３５回　利付国債（２０年）	114,000,000	127,210,320	
第１３６回　利付国債（２０年）	118,000,000	130,622,460	
第１３７回　利付国債（２０年）	101,000,000	112,959,410	
第１３８回　利付国債（２０年）	110,000,000	121,013,200	
第１３９回　利付国債（２０年）	114,000,000	126,456,780	
第１４０回　利付国債（２０年）	104,000,000	116,411,360	
第１４１回　利付国債（２０年）	173,000,000	193,687,340	
第１４２回　利付国債（２０年）	119,000,000	134,368,850	
第１４３回　利付国債（２０年）	173,000,000	192,010,970	
第１４４回　利付国債（２０年）	123,000,000	135,314,760	
第１４５回　利付国債（２０年）	246,000,000	275,574,120	
第１４６回　利付国債（２０年）	194,000,000	217,301,340	
第１４７回　利付国債（２０年）	214,000,000	237,424,440	
第１４８回　利付国債（２０年）	184,000,000	202,079,840	
第１４９回　利付国債（２０年）	199,000,000	218,376,630	
第１５０回　利付国債（２０年）	216,000,000	234,448,560	

第１５１回　利付国債（２０年）	216,000,000	229,221,360	
第１５２回　利付国債（２０年）	198,000,000	209,874,060	
第１５３回　利付国債（２０年）	234,000,000	250,419,780	
第１５４回　利付国債（２０年）	220,000,000	232,465,200	
第１５５回　利付国債（２０年）	211,000,000	217,503,020	
第１５６回　利付国債（２０年）	180,000,000	171,583,200	
第１５７回　利付国債（２０年）	182,000,000	168,288,120	
第１５８回　利付国債（２０年）	192,000,000	184,295,040	
第１５９回　利付国債（２０年）	197,000,000	190,958,010	
第１６０回　利付国債（２０年）	180,000,000	176,344,200	
第１６１回　利付国債（２０年）	184,000,000	177,147,840	
第１６２回　利付国債（２０年）	244,000,000	234,010,640	
第１６３回　利付国債（２０年）	260,000,000	248,378,000	
第１６４回　利付国債（２０年）	324,000,000	303,775,920	
第１６５回　利付国債（２０年）	246,000,000	229,803,360	
第１６６回　利付国債（２０年）	234,000,000	224,600,220	
第１６７回　利付国債（２０年）	255,000,000	236,275,350	
第１６８回　利付国債（２０年）	222,000,000	201,553,800	
第１６９回　利付国債（２０年）	248,000,000	220,452,160	
第１７０回　利付国債（２０年）	219,000,000	193,810,620	
第１７１回　利付国債（２０年）	234,000,000	206,158,680	
第１７２回　利付国債（２０年）	217,000,000	193,718,070	
第１７３回　利付国債（２０年）	277,000,000	246,380,420	
第１７４回　利付国債（２０年）	277,000,000	245,291,810	
第１７５回　利付国債（２０年）	264,000,000	237,172,320	

	第１７６回　利付国債（２０年）	261,000,000	233,480,160	
	第１７７回　利付国債（２０年）	254,000,000	222,399,860	
	第１７８回　利付国債（２０年）	264,000,000	234,817,440	
	第１７９回　利付国債（２０年）	274,000,000	243,010,600	
	第１８０回　利付国債（２０年）	258,000,000	241,299,660	
	第１８１回　利付国債（２０年）	253,000,000	240,436,020	
	第１８２回　利付国債（２０年）	175,000,000	171,657,500	
国債証券　合計		51,261,000,000	51,735,766,020	
地方債証券	第７３０回　東京都公募公債	300,000,000	302,045,400	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	95,230,000	
	平成２７年度第１回　北海道公募公債	300,000,000	301,825,500	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	103,530,000	
	第４４８回　大阪府公募公債	38,000,000	36,719,856	
	第４５５回　大阪府公募公債	180,000,000	174,127,320	
	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	110,561,800	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	109,966,700	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	107,322,900	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債	100,000,000	94,440,800	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	109,803,400	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	108,300,300	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債	100,000,000	103,272,800	
	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	195,561,800	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債	100,000,000	110,407,400	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債	100,000,000	109,972,400	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	293,435,400	
	第１３３回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,312,700	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	92,617,300	

	第１回　名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	119,723,400	
	第１回　京都市公募公債	300,000,000	311,781,600	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	110,711,300	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	111,042,000	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	104,031,600	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	111,601,200	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	113,204,100	
	平成２６年度第２回　北九州市公募公債	150,000,000	150,862,500	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	197,331,400	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債	100,000,000	93,963,000	
地方債証券　合計		4,168,000,000	4,285,705,876	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	310,585,500	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,219,200	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,790,600	
	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	109,291,600	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	108,969,000	
	第２１８回　政保道路機構債券	500,000,000	504,255,000	
	第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	106,755,800	
	第２４９回　政保道路機構債券	179,000,000	180,725,023	
	第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	92,130,800	
	第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,615,700	
	第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	94,864,200	
	第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,548,600	
	第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	219,173,000	
	第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	107,523,800	
	第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	107,208,200	
	第７２回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,971,400	
	第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,636,925	
	第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	135,750,876	
	第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,466,300	

	第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	191,775,000	
	第１６回　公営企業債券	200,000,000	211,026,200	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	103,059,800	
	第４６回　福祉医療機構債券	200,000,000	198,602,000	
	第５９回　一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,058,400	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,939,600	
	第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,404,000	21,324,220	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,546,000	52,729,587	
	第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,698,000	61,538,983	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,854,000	50,866,784	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,712,000	56,982,548	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,128,000	59,367,416	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,744,000	29,775,909	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,968,000	265,910,486	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,350,000	164,178,305	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,055,000	117,509,367	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,181,000	101,008,612	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	206,451,000	202,053,593	
	い第８４５号　利付商工債券	200,000,000	199,938,000	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	199,085,800	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	99,527,100	
	第３５３回　利付しんきん中金債券	100,000,000	99,993,400	
特殊債券　合計		5,573,091,000	5,709,732,634	
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	98,977,700	
	第１３回　クレディ・アグリコル・エス・エー	100,000,000	99,564,100	
	第5回　スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	200,547,400	
	第２５回　首都高速道路債券	400,000,000	398,521,600	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	191,783,200	
	第６０回　中日本高速道路債券	100,000,000	100,543,600	
	第２５回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,007,600	
	第２６回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,594,000	

	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	98,601,900	
	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	100,867,600	
	第５回　電通グループ	400,000,000	397,186,800	
	第１回　オリックス銀行	200,000,000	199,271,800	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	101,884,600	
	第１回　三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	100,493,900	
	第２９回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	100,000,000	104,960,200	
	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	100,491,200	
	第８回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後特約付	100,000,000	104,219,900	
	第１６回　ＮＴＴファイナンス	200,000,000	198,926,600	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,737,000	
	第９６回　トヨタファイナンス	100,000,000	99,148,300	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,133,700	
	第４０回　三菱ＵＦＪリース	300,000,000	297,403,500	
	第６回　三井住友海上火災保険	100,000,000	99,803,600	
	第６６回　三井不動産	100,000,000	99,904,100	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	97,545,800	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	221,279,600	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	99,481,000	
	第３回　東日本旅客鉄道サステナビリティボンド	100,000,000	95,430,000	
	第２７回　ＫＤＤＩ	200,000,000	199,174,800	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,388,800	
	第３８１回　中国電力	200,000,000	202,259,200	
	第３０６回　北陸電力	100,000,000	101,070,300	
	第４２９回　九州電力	200,000,000	202,271,000	
	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,329,500	
	第３３１回　北海道電力	100,000,000	100,096,100	
	第３５２回　北海道電力	100,000,000	100,208,600	
	第１３回　電源開発	100,000,000	104,499,200	
社債券　合計		5,500,000,000	5,512,607,800	
合計			67,243,812,330	

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。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,548,017,578円
Ⅱ　負債総額	9,795,607円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,538,221,971円
Ⅳ　発行済数量	2,413,913,383口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0515円

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	3,424,515,260円
Ⅱ　負債総額	3,467,416円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,421,047,844円
Ⅳ　発行済数量	2,847,745,085口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2013円

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	5,342,000,373円
Ⅱ　負債総額	950,972円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,341,049,401円
Ⅳ　発行済数量	4,034,309,200口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3239円

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,252,249,844円
Ⅱ　負債総額	252,563円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,251,997,281円
Ⅳ　発行済数量	1,633,595,941口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3786円

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,387,495,559円
Ⅱ　負債総額	2,096,678円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,385,398,881円
Ⅳ　発行済数量	1,733,306,993口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3762円

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	**980,016,946円**
Ⅱ　負債総額	**425,585円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**979,591,361円**
Ⅳ　発行済数量	**695,415,405口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4086円**

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	**1,960,130,768円**
Ⅱ　負債総額	**7,973,223円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**1,952,157,545円**
Ⅳ　発行済数量	**1,162,350,960口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.6795円**

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	**1,409,399,362円**
Ⅱ　負債総額	**2,259,878円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**1,407,139,484円**
Ⅳ　発行済数量	**981,575,459口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4336円**

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	**96,308,611円**
Ⅱ　負債総額	**17,646円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**96,290,965円**
Ⅳ　発行済数量	**100,304,728口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**0.9600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12月30日現在

Ⅰ　資産総額	**180,468,626,138円**
Ⅱ　負債総額	**3,623,825,673円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**176,844,800,465円**
Ⅳ　発行済数量	**81,014,042,984口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.1829円**

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	562,558,067,243円
Ⅱ　負債総額	1,207,318,997円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	561,350,748,246円
Ⅳ　発行済数量	196,999,073,427口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8495円

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	69,094,227,708円
Ⅱ　負債総額	1,441,264,191円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	67,652,963,517円
Ⅳ　発行済数量	72,667,389,785口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9310円

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	55,501,186,215円
Ⅱ　負債総額	372,208,552円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	55,128,977,663円
Ⅳ　発行済数量	38,000,742,366口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4507円

ニッセイマネーマーケット　マザーファンド

2022年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	697,833,704円
Ⅱ　負債総額	2,429,261円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	695,404,443円
Ⅳ　発行済数量	693,496,704口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0028円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2022年12月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

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12月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	417	71,885
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	143	23,194
単位型公社債投資信託	0	0
合計	560	95,079

○　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
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

2022年3月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

３【資本関係】

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

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

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

第３【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2021年12月24日	**有価証券届出書**
2022年1月7日	**有価証券届出書の訂正届出書**
2022年3月18日	**有価証券報告書**
	有価証券届出書の訂正届出書
2022年9月20日	**半期報告書**
	有価証券届出書の訂正届出書
2022年10月7日	**半期報告書**
	有価証券届出書の訂正届出書

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3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の監査報告書

2023年3月16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ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５の2022年1月11日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。