

目論見書補完書面

この書面は、金融商品取引法第37条の3の規定に基づき、お客様が当投資信託（ファンド）をご購入するにあたり、ご理解していただく必要のある重要事項の情報を、あらかじめ提供するものです。お取引にあたっては、この書面及び目論見書の内容をよくお読みいただき、ご不明な点は、お取引開始前にご確認ください。

※この書面は、投資信託説明書（目論見書）の一部ではなく、マネックス証券の責任の下で作成しているものです。

手数料等の諸経費について

- ・当ファンドの手数料など諸経費の詳細は目論見書をご覧ください。
- ・お客様にご負担いただくお申込手数料、信託報酬など諸経費の種類ごとの金額及びその合計額等については、実際のお申込み金額、保有期間等に応じて異なる場合があります。

当社における申込手数料は、購入金額（購入口数×1口あたりの購入価額）に、ファンドごとの申込手数料率を乗じて計算します。

＜口数指定でご購入する場合（例）＞

申込手数料率3.0%（税抜）のファンドを購入価額10,000円（1万口あたり）で100万口ご購入いただく場合は、

申込手数料（税抜）=100万口×10,000円÷10,000口×3.0% =30,000円となり、合計1,030,000円（税抜）お支払いいただくことになります。

＜金額指定でご購入する場合（例）＞

100万円の金額指定でご購入いただく場合、お支払いいただく100万円の中から申込手数料（税込）をいただきますので、100万円全額がファンドの購入金額となるものではありません。

クーリング・オフの適用について

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定の適用はなく、クーリング・オフの対象とはなりませんので、ご注意ください。

1. 当ファンドに係る金融商品取引契約の概要

当社は、ファンドの販売会社として、募集の取扱い及び販売等に関する事務を行います。

2. 当社が行う金融商品取引業の内容及び方法の概要

当社が行う金融商品取引業は、主に金融商品取引法第 28 条第 1 項の規定に基づく第一種金融商品取引業であり、当社においてファンドのお取引や保護預けを行われる場合は、以下によります。

- ・お取引にあたっては、保護預り口座、振替決済口座又は外国証券取引口座の開設が必要となります。
- ・お取引のご注文をいただいたときは、原則として、あらかじめ当該ご注文に係る代金又は有価証券の全部（前受金等）をお預けいただいた上で、ご注文をお受けいたします。
- ・ご注文いただいたお取引が成立した場合（法令に定める場合を除きます。）には、契約締結時交付書面（取引報告書）をお客様にお渡しいたします（郵送又は電磁的方法による場合を含みます）。万一、記載内容が相違しているときは、速やかに当社お問合せ窓口へ直接ご連絡ください。

3. 当社の概要

- ・商号等 : マネックス証券株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 165 号
- ・本店所在地 : 〒107-6025 東京都港区赤坂一丁目 12 番 32 号
- ・設立 : 1999 年 5 月
- ・資本金 : 12,200 百万円
- ・主な事業 : 金融商品取引業
- ・加入協会 : 日本証券業協会、一般社団法人 金融先物取引業協会、
一般社団法人 日本投資顧問業協会
- ・指定紛争
解決機関 : 特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター
- ・連絡先 : ご不明な点がございましたら、下記までお問合せください。
お客様ダイヤル : 0120-846-365（通話料無料）
03-6737-1666（携帯電話・PHS・一部 IP 電話）
ログイン ID と暗証番号をご用意ください。
当社ウェブサイト : ログイン後の「ヘルプ・お問合せ」の入力
フォームからお問合せいただけます。

以 上

（平成 29 年 2 月）

KTM_TOUSHIN_1.2

当資料は全ての投資信託の「目論見書補完書面」「投資信託説明書（交付目論見書）」に添付しているものです
申込手数料や解約手数料がかからない投資信託につきましては、以下の説明は該当しません。

申込手数料に関するご説明

■投資信託の申込手数料は購入時に負担いただくものですが、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率はしだいに減っていきます。

例えば、申込手数料が3%（税抜き）の場合

【保有期間】 【1年あたりのご負担率（税抜き）】



※投資信託によっては、申込手数料をいただかず、解約時に保有期間に応じた解約手数料をお支払いいただく場合があります。その場合も、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率はしだいに減っていきます。

※上記の図の手数料率や保有期間は例示です。実際にお買付いただく投資信託の手数料率や残存期間については、当社ウェブサイトや「投資信託説明書（交付目論見書）」にてご確認ください。

※投資信託をご購入いただいた場合には、上記の申込手数料のほか、信託報酬やその他費用等をご負担いただきます。また、投資信託の種類に応じて、信託財産留保額等をご負担いただく場合があります。実際の手数料率等の詳細は、当社ウェブサイトや「投資信託説明書（交付目論見書）」にてご確認ください。



投資信託説明書(交付目論見書)

使用開始日 2021.08.21

ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)

愛称:ファンドパック3

追加型投信／内外／株式／インデックス型



本書は金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。

ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)を含む詳細な情報は、下記の委託会社のホームページで閲覧またはダウンロードすることができます。また、本書には約款の主な内容が含まれてありますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に添付されています。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

委託会社 [ファンドの運用の指図を行います]

ニッセイアセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者登録番号 関東財務局長(金商)第369号

受託会社 [ファンドの財産の保管および管理を行います]

三菱UFJ信託銀行株式会社

お問合せ ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター **0120-762-506**

9:00~17:00(土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>



●委託会社の情報 (2021年5月末現在)

委託会社名 ニッセイアセットマネジメント株式会社	資 本 金 100億円
設立年月日 1995年4月4日	運用する 投資信託財産の 9兆5,747億円 合計純資産総額

●商品分類等

商品分類				属性区分					
単位型 ・ 追加型	投資 対象 地域	投資対象 資産 (収益の源泉)	補足分類	投資対象 資産	決算 頻度	投資対象 地域	投資 形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス
追加型	内外	株式	インデックス型	その他資産 (※)	年1回	グローバル (日本含む)	ファミリー ファンド	なし	その他 (合成ベンチ マーク)

※投資信託証券(株式(一般))

・属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、為替変動リスクに対する対円でのヘッジの有無を記載しております。

商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会ホームページ

<https://www.toushin.or.jp/>にてご確認いただけます。

- 本書により行う「ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2021年8月20日に関東財務局長に提出しており、2021年8月21日にその届出の効力が生じております。
- ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更に際しては、事前に受益者(既にファンドをお持ちの投資者)の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
- 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
- 基準価額(便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されます)については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊(ファンド掲載名:Fパック3)および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- 投資信託説明書(請求目論見書)は、投資者のご請求により販売会社から交付されます。ご請求された場合には、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。

1. ファンドの目的・特色

ファンドの目的

投資対象の異なる3つのマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内外の株式市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ファンドの特色

① 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

- 投資対象とするマザーファンドは、各投資対象資産の指標の動きに連動する投資成果をめざします。
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ*を行いません。

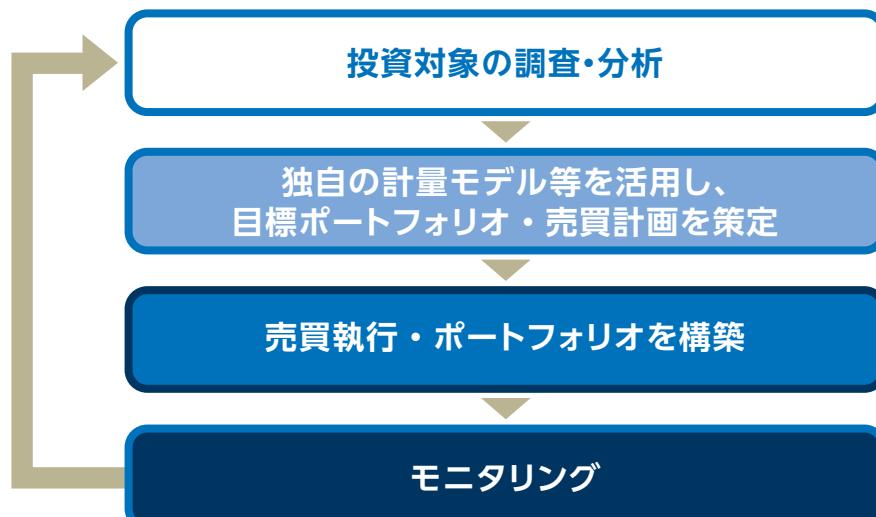
*為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド	マザーファンドの概要
国内株式	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	「TOPIX(東証株価指数)(配当込み)」の動きに連動する投資成果をめざします。
先進国株式	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)」の動きに連動する投資成果をめざします。
新興国株式	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド*	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)」の動きに連動する投資成果をめざします。

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

〈各マザーファンドの運用プロセス〉

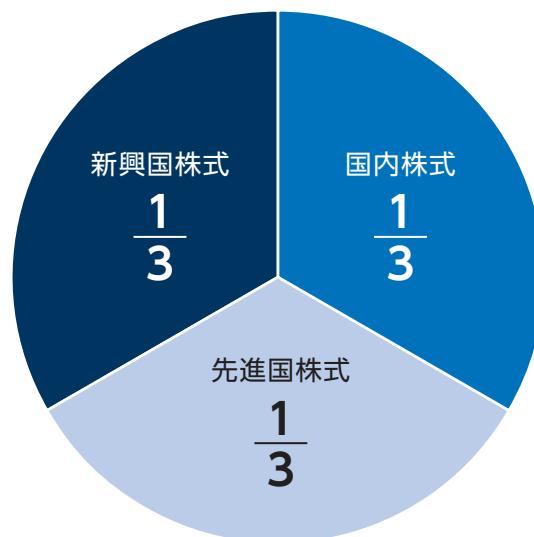


2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

- ファンドは、各投資対象資産の指数を基本投資割合で組合せた合成ベンチマーク※の動きに連動する投資成果をめざします。

※各投資対象資産の指数の騰落率を基本投資割合で加重平均し、委託会社が独自に指数化したもの（以下「ベンチマーク」といいます）。各投資対象資産の指数は、国内株式:TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、先進国株式:MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、新興国株式:MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）。

【基本投資割合】



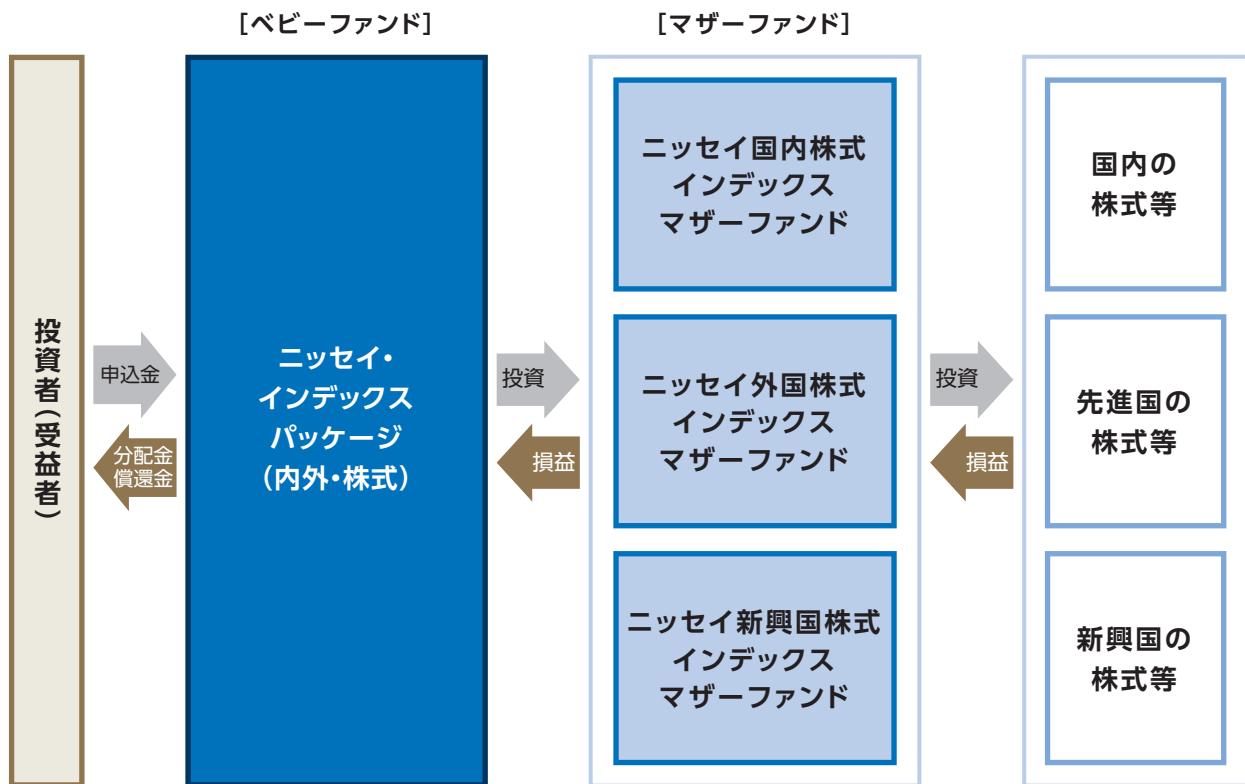
〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

1. ファンドの目的・特色

● ファンドの仕組み

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。

● 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合には、制限を設けません。
同一銘柄の株式	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。
投資信託証券	投資信託証券(マザーファンドおよび上場投資信託証券等を除きます)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

●収益分配方針

- 分配対象額は、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。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

!**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。**

〈各指数について〉

●TOPIX(東証株価指数)

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

●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

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。

2. 投資リスク

基準価額の変動要因

- ファンド(マザーファンドを含みます)は、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替変動リスクもあります)に投資しますので、基準価額は変動します。また、ベンチマークの動きに連動することを目標に運用しますので、ベンチマークの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
- ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果(損益)はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンのリスクを十分にご認識ください。

● 主な変動要因

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。
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、ファンの資産価値が減少する可能性があります。特に、新興国の経済状況は先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があり、ファンの資産価値が大きく減少したり、運用方針にそった運用が困難になる可能性があります。
流動性リスク	市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

・基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 新興国の株式投資に関しては、以下の事項が顕在化する可能性が高いことにご留意ください。

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

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

○ **ストックコネクト^{*}を通じた取引に関しては、以下の事項にご留意ください。**

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

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

○ **分配金に関しては、以下の事項にご留意ください。**

- ・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、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。
- ・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、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。

○ 委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2020年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に7.7%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

○ 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。

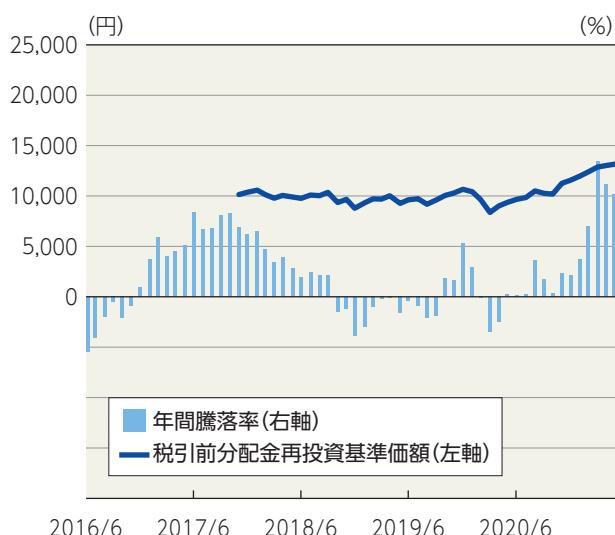
リスクの管理体制

運用リスク管理担当部門が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、および投資制限等遵守状況・売買執行状況の事後チェックを行います。運用リスク管理担当部門は、そのモニタリング結果を運用担当部門に連絡するとともに社内で定期的に開催される会議で報告します。運用担当部門はその連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行う等の投資リスクを適正に管理する体制をとっています。

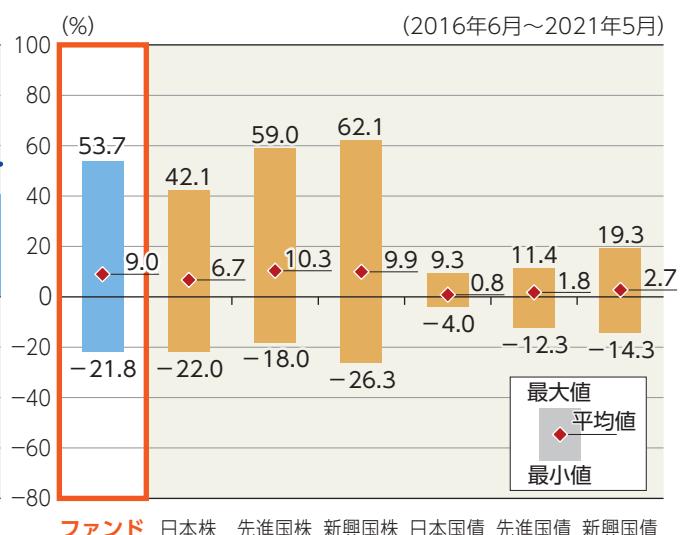
2.投資リスク

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

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

3. 運用実績

2021年5月末現在

● 基準価額・純資産の推移



基準価額	13,173円
純資産額	44百万円

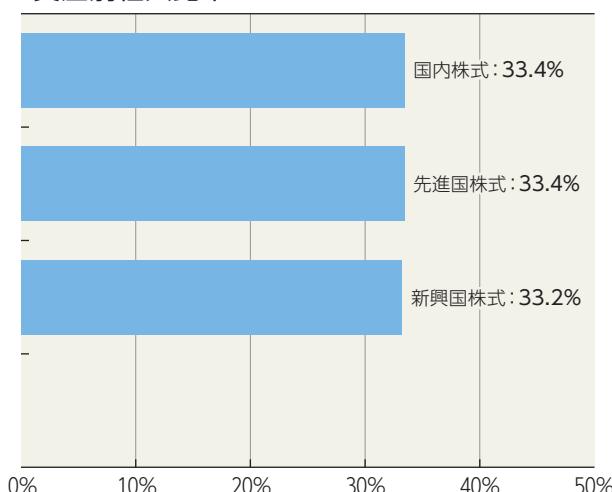
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
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。

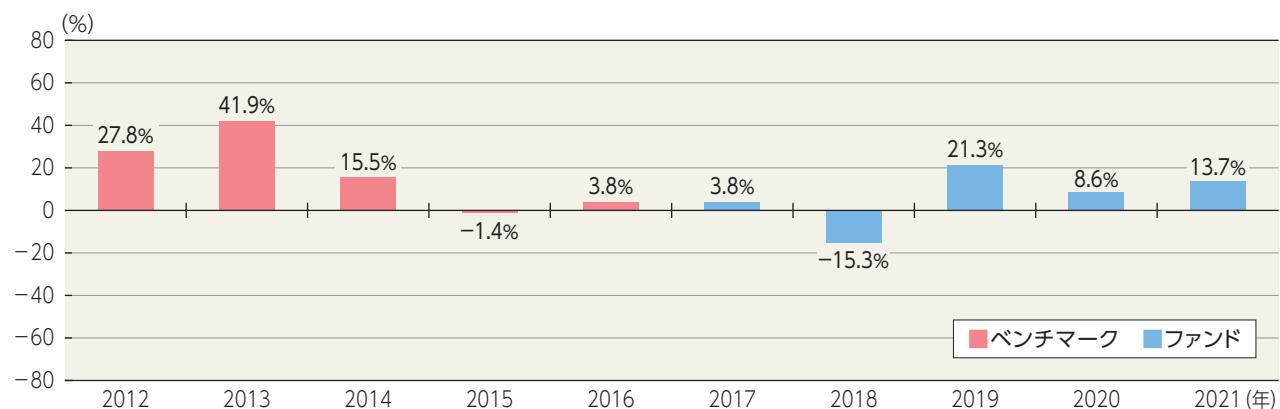
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

● 資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

● 年間收益率の推移



・ファンド收益率は分配金(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、2021年は年始から上記作成基準日までの收益率です。

・2016年以前はベンチマークの收益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

銘柄		比率
1	トヨタ自動車	3.5%
2	ソニーグループ	2.6%
3	ソフトバンクグループ	2.4%
4	キーエンス	2.0%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%

・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	3.9%
2	マイクロソフト	情報技術	3.4%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.6%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.5%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.3%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

3.ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

銘柄		業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	6.2%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	5.3%
3	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	4.8%
4	サムスン電子	情報技術	4.1%
5	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	2.9%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。「その他」にはETFを含みます。

組入上位業種

業種		比率
1	電気機器	17.8%
2	情報・通信業	9.0%
3	輸送用機器	7.6%
4	化学	7.4%
5	機械	5.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

国・地域		比率
1	アメリカ	71.4%
2	イギリス	4.7%
3	フランス	3.8%
4	カナダ	3.7%
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。

組入上位国・地域

国・地域		比率
1	中国	37.6%
2	台湾	13.5%
3	韓国	13.1%
4	インド	10.0%
5	ブラジル	5.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

4.手続・手数料等

お申込みメモ

購入時	購入単位	販売会社が定める単位とします。
	購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額とします。 ●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。
	購入代金	販売会社が定める日までに、販売会社にお支払いください。
換金時	換金単位	販売会社が定める単位とします。
	換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
	換金代金	換金申込受付日から起算して、原則として8営業日目からお支払いします。
申込について	申込締切時間	原則として毎営業日の午後3時までに販売会社の手続きが完了したものと 当日受付分とします。
	申込不可日	次のいずれかの休業日と同日の場合は、購入・換金の申込みの受け付けを行いません。 ・ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、香港取引決済所、香港の銀行
	購入の申込期間	2021年8月21日(土)～2022年2月18日(金) ●期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。
	換金制限	ありません。
	購入・換金申込受付の中止および取消し	金融商品取引所の取引の停止(個別銘柄の売買停止等を含みます)、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情(投資対象国・地域における非常事態の発生による市場の閉鎖、流動性の著しい低下あるいは資金の受渡しに関する障害等)があるときには、購入・換金の申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた購入・換金の申込みの受け付けを取消すことがあります。
決算・分配	決算日	11月20日(該当日が休業日の場合は翌営業日)
	収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づき収益分配を行います。 分配金受取コース: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:税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。 ●販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。
その他	信託期間	無期限(設定日:2017年11月17日)
	繰上償還	受益権の口数が30億口を下回っている場合等には、委託会社はあらかじめ受益者に書面により通知する等の手続きを経て、ファンドを繰上償還させることができます。
	信託金の限度額	5,000億円とします。
	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。
	運用報告書	委託会社は決算後および償還後に交付運用報告書を作成し、販売会社から受益者へお届けします。
	課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。 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。 配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

ファンドの費用・税金

●ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用				
購入時	購入時手数料	ありません。	-	
換金時	換金時手数料	ありません。	-	
換金時	信託財産留保額	ありません。		
投資者が信託財産で間接的に負担する費用				
毎日	運用管理費用 (信託報酬)	ファンドの純資産総額に 年率0.3564%(税抜 0.324%) をかけた額とし、ファンドからご負担 いただきます。	▶運用管理費用(信託報酬) =保有期間中の日々の純資産総額 ×信託報酬率(年率)	
		信託報酬率 (年率・税抜) の配分	支払先 年率 役務の内容	
			委託会社 0.150% 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	
毎日	監査費用		販売会社 0.150% 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価	
			受託会社 0.024% 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	
・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。				
随時	その他の費用・ 手数料	ファンドの純資産総額に年率0.011%(税抜 0.01%)をかけた額を上限とし、ファンドから ご負担いただきます。	▶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	
		組入有価証券の売買委託手数料、信託事務の 諸費用および借入金の利息等はファンドから ご負担いただきます。これらの費用は運用状況 等により変動するため、事前に料率・上限額等 を記載することはできません。	▶売買委託手数料:有価証券等の 売買・取引の際に仲介人に支払う 手数料 ▶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 ▶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 (立替金も含む)に発生する利息	

! 当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の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。

●税金 税金は表に記載の時期に適用されます。

以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

分配時		換金(解約)時および償還時	
所得税 および 地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%	所得税 および 地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益 (譲渡益)に対して20.315%

- ・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。
- ・外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記の表における税金と異なる場合があります。
- ・法人の場合は上記とは異なります。
- ・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、また少額投資非課税制度および外国税額控除の適用対象外です。
- ・上記は2021年5月末現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
- ・税金の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



 ふくろう教授の投資信託説明書(交付目論見書)
かんたんガイド
https://www.nam.co.jp/news/ipdf/mokuromi_guide.pdf



ユニバーサルデザイン(UD)の考えに基づいた見やすいデザインの文字を採用しています。

投資信託説明書

(請求目論見書)

2021.08.21

ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)

追加型投信／内外／株式／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

(愛称) **ファンドパック3**

ニッセイアセットマネジメント株式会社

[本書は金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。]

「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）」は、主に国内外の株式を投資対象としますので、組入株式の価格の下落、組入株式の発行会社の倒産または財務状況の悪化等の影響により、ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、これらに加え、為替の変動により損失を被ることがあります。

- 本書は、金融商品取引法（昭和 23 年法律第 25 号）第 13 条第 2 項第 2 号に規定する詳細情報を記載した投資信託説明書（請求目論見書）です。
- この投資信託説明書（請求目論見書）により行う「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法第 5 条の規定により有価証券届出書を 2021 年 8 月 20 日に関東財務局長に提出しており、2021 年 8 月 21 日にその届出の効力が生じております。
- なお、有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所について、該当事項はありません。

目 次

第一部 証券情報	1
(1) ファンドの名称	(2) 内国投資信託受益証券の形態等
(3) 発行（売出）価額の総額	(4) 発行（売出）価格
(5) 申込手数料	(6) 申込単位
(8) 申込取扱場所	(9) 払込期日
(11) 振替機関に関する事項	(12) その他
第二部 ファンド情報	3
第 1 ファンドの状況	3
1 ファンドの性格	
(1) ファンドの目的及び基本的性格	
(2) ファンドの沿革	(3) ファンドの仕組み
2 投資方針	
(1) 投資方針	(2) 投資対象
(4) 分配方針	(5) 投資制限
3 投資リスク	
4 手数料等及び税金	
(1) 申込手数料	(2) 換金（解約）手数料
(4) その他の手数料等	(3) 信託報酬等
(5) 課税上の取扱い	
5 運用状況	
(1) 投資状況	(2) 投資資産
(3) 運用実績	(4) 設定及び解約の実績
第 2 管理及び運営	47
1 申込（販売）手続等	
2 換金（解約）手続等	
3 資産管理等の概要	
(1) 資産の評価	(2) 保管
(3) 信託期間	(4) 計算期間
(5) その他	
4 受益者の権利等	
第 3 ファンドの経理状況	53
1 財務諸表	
(1) 貸借対照表	(2) 損益及び剰余金計算書
(3) 注記表	(4) 附属明細表
2 ファンドの現況	
第 4 内国投資信託受益証券事務の概要	195
第三部 委託会社等の情報	委託-1
第 1 委託会社等の概況	委託-1
1 委託会社等の概況	2 事業の内容及び営業の概況
3 委託会社等の経理状況	4 利害関係人との取引制限
5 その他	

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）

上記ファンドの愛称として「ファンドパック3」ということがあります。

（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

① 契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年8月21日（土）～2022年2月18日（金）

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

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

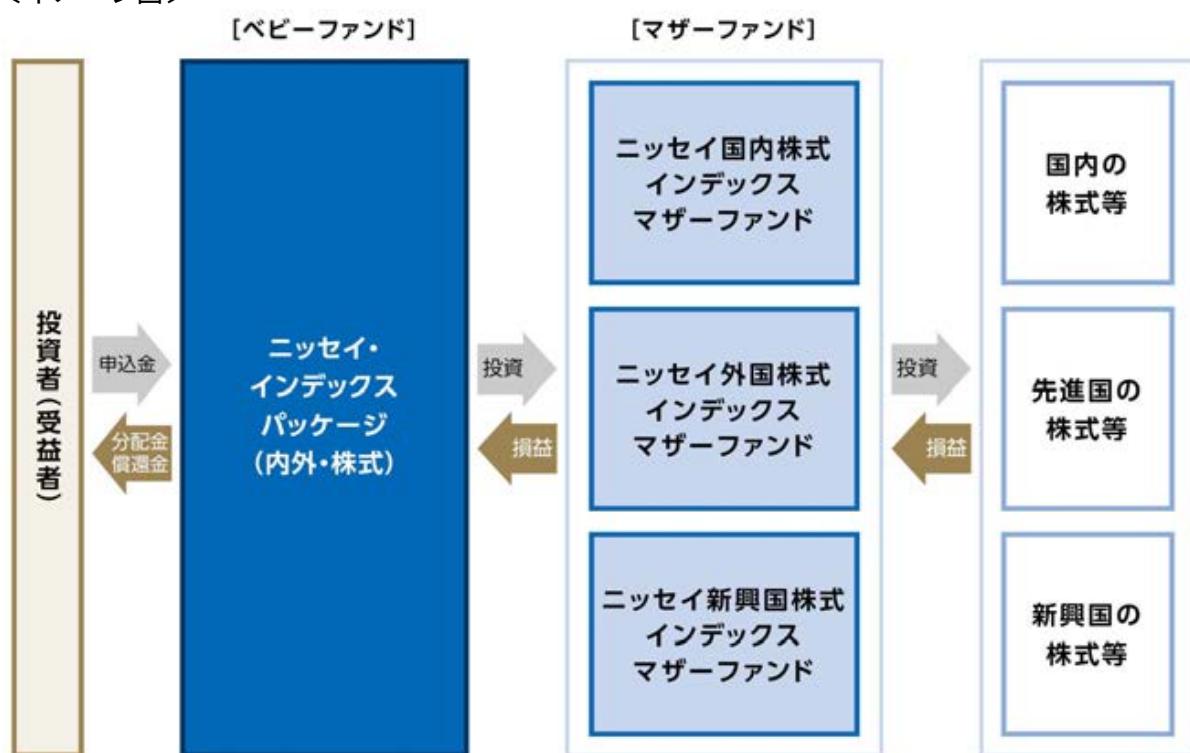
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



③ ファンドの特色

1 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

- 投資対象とするマザーファンドは、各投資対象資産の指数の動きに連動する投資成果をめざします。
- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ[※]を行いません。

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

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド	マザーファンドの概要
国内株式	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	「TOPIX(東証株価指数)(配当込み)」の動きに連動する投資成果をめざします。
先進国株式	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)」の動きに連動する投資成果をめざします。
新興国株式	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド [※]	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)」の動きに連動する投資成果をめざします。

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

〈各マザーファンドの運用プロセス〉



2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

- ファンドは、各投資対象資産の指標を基本投資割合で組合せた合成ベンチマーク[※]の動きに連動する投資成果をめざします。

※各投資対象資産の指標の騰落率を基本投資割合で加重平均し、委託会社が独自に指標化したもの(以下「ベンチマーク」ということがあります)。各投資対象資産の指標は、国内株式:TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、先進国株式:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、新興国株式:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)。

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

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

〈各指標について〉

● TOPIX(東証株価指数)

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

● 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.が公表している指標であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。同指標に関する著作権、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.は同指標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」とは同指標をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

● MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)はMSCI Inc.が公表している指標であり、世界の新興国の株式により構成されています。同指標に関する著作権、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.は同指標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」とは同指標をもとに、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はなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

④ 信託金の上限

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

⑤ ファンドの分類

追加型投信／内外／株式／インデックス型に属します。

○ 課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	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、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
その他の指数 (合成ベンチマーク)	目論見書または約款において、合成ベンチマークの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

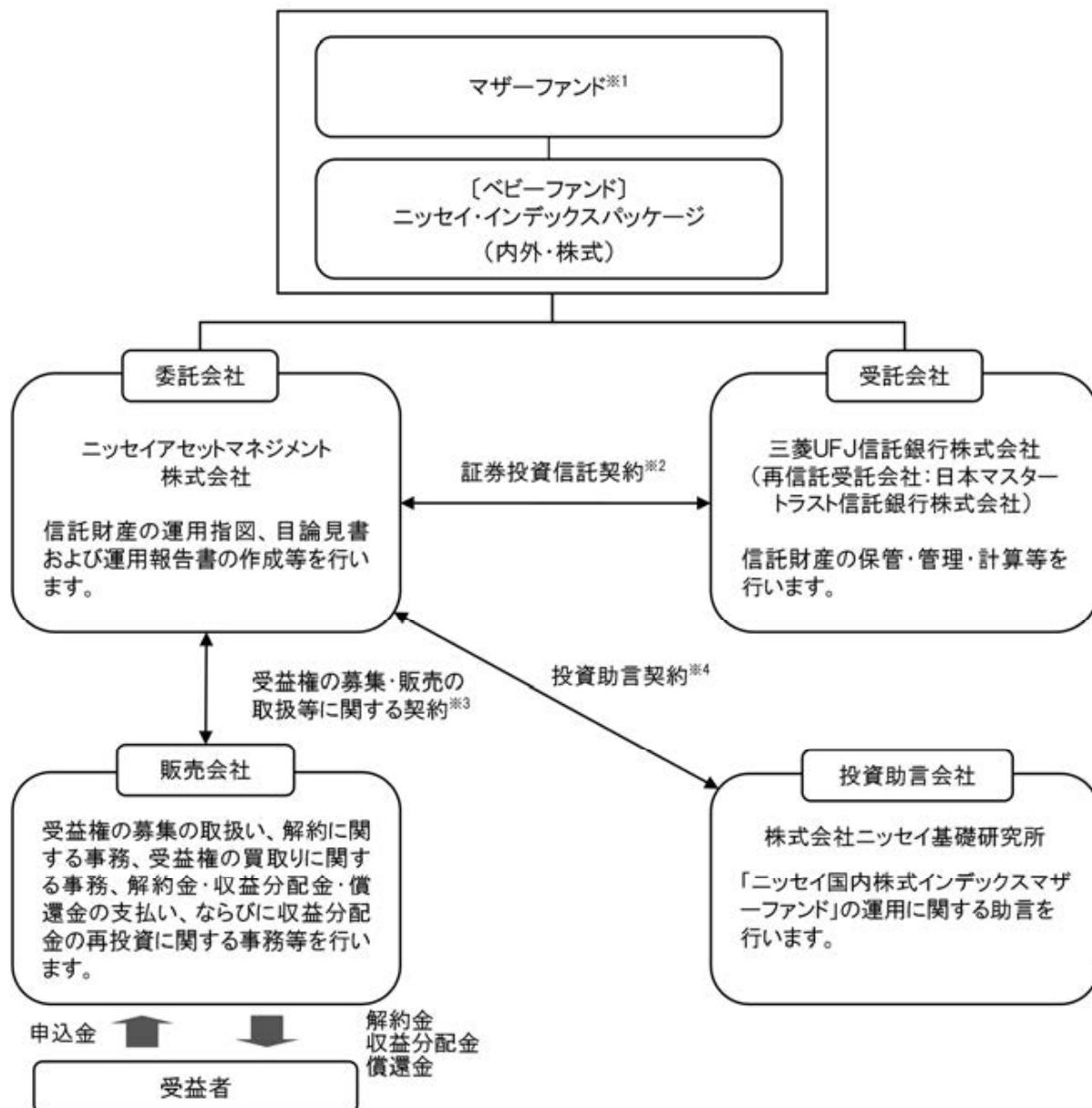
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年11月17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、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド
- ※2 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- ※3 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- ※4 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（2021年5月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
 2. 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
 3. 資本金の額 : 100億円
 4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 大関 洋
 5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
 6. 設立年月日 : 1995年4月4日
 7. 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。
8. 大株主の状況
- | 名 称 | 住 所 | 保 有 株 数 | 比 率 |
|------------|-------------------|----------|------|
| 日本生命保険相互会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号 | 108,448株 | 100% |

2 【投資方針】

（1）【投資方針】

- ① 複数のマザーファンド※への投資を通じ、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）を3分の1ずつ組合せた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。
※ ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド
- ② 各マザーファンドへの基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の3分の1とします。
- ③ 各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。
- ④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

- ① 国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
- ② 株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することができます。
- 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、M S C I 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、M S C I 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トジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ取引等エクスポートジャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の株式等（D R（預託証書）を含みます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

- ① 主として新興国の株式等（D R（預託証書）を含みます）に投資することにより、M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
- ② 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- ③ 株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。
- ④ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ⑦ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- ⑧ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑨ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポートジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ取引等エクスポート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、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

b 約款に定める投資対象

① 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

② 有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

③ 金融商品

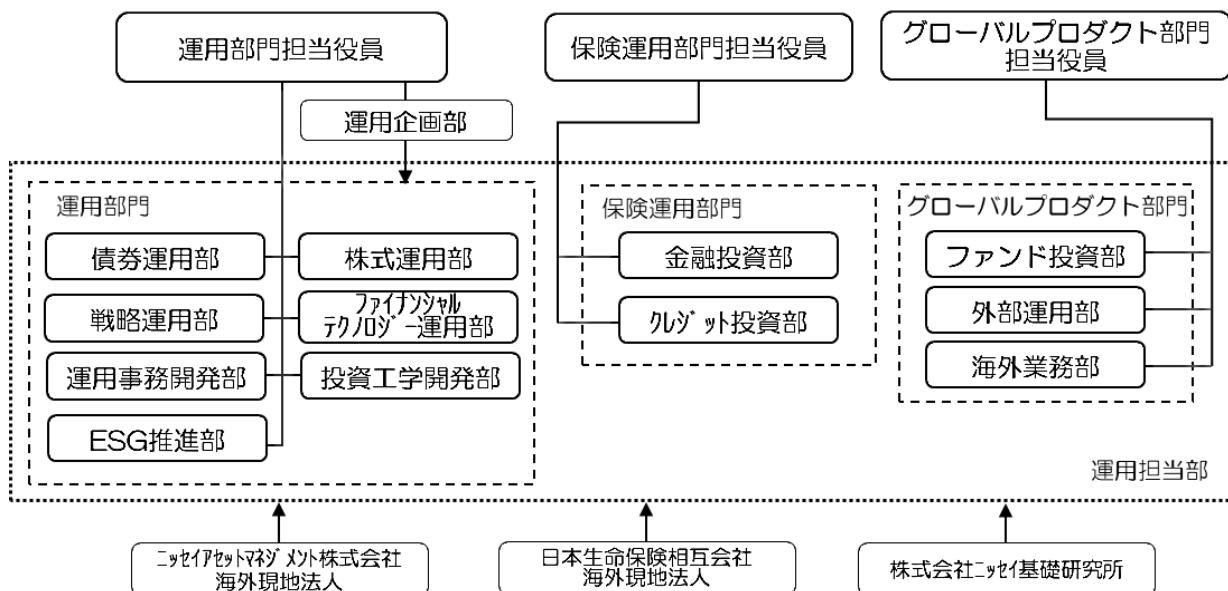
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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

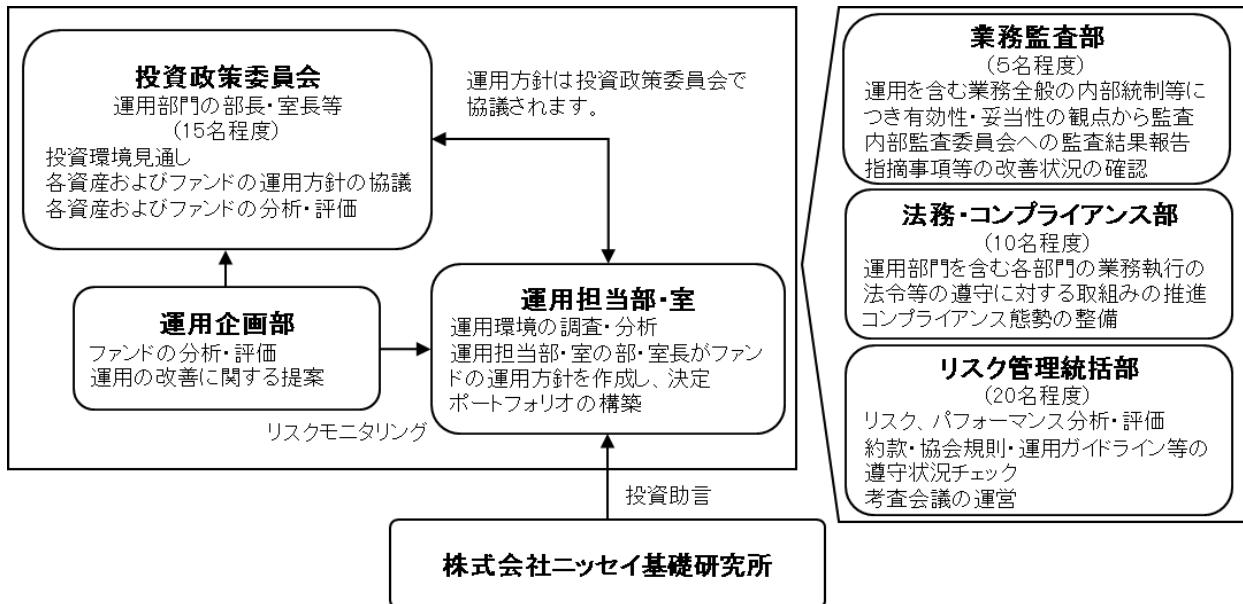
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー／アナリストサービス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する規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織



＜受託会社に対する管理体制等＞

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

- 上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（4）【分配方針】

- ① 原則として以下の方針に基づき分配を行います。
 1. 分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
 2. 分配対象額についての分配方針
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。
 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11月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。
- ③ 支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

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

＜分配金再投資コースの場合＞

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

- 将来の分配金の支払いおよび水準について、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 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。
- ③ 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。
- 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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。
- 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トジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ取引等エクスポートジャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

b 約款に定めるその他の投資制限

① 投資する株式等の範囲

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

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

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

② 信用取引の範囲

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

③ 先物取引等

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

④ スワップ取引

1. 異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑤ 金利先渡取引および為替先渡取引

1. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑥ 有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
 - i. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ii. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦ 有価証券の空売り

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借り入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
2. 前記1. の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

⑧ 有価証券の借入れ

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

2. 前記1. は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨ 外国為替予約等

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

⑩ 資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

- ① デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。
- ② 信用リスク集中回避（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）
信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを内容とした運用を行わないものとします。
- ③ 同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）
委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

3 【投資リスク】

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

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

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

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・株式投資リスク

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

- ・為替変動リスク

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

- ・カントリーリスク

外国の資産に投資するため、各国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受け、ファンドの資産価値が減少する可能性があります。特に、新興国の経済状況は先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があり、ファンドの資産価値が大きく減少したり、運用方針にそった運用が困難になる可能性があります。

- ・流動性リスク

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

- ・新興国の株式投資に関する留意点

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

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

- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

※ ストックコネクトとは、ファンドを含む外国の投資家が、上海証券取引所および深セン証券取引所の中国A株を香港の証券会社を通じて売買することができる制度です。なお、中

国A株とは、主な投資家として中国居住者を想定しているのですが、一定の条件のもとでファンドを含む外国の投資家にも投資が認められています。

・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戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

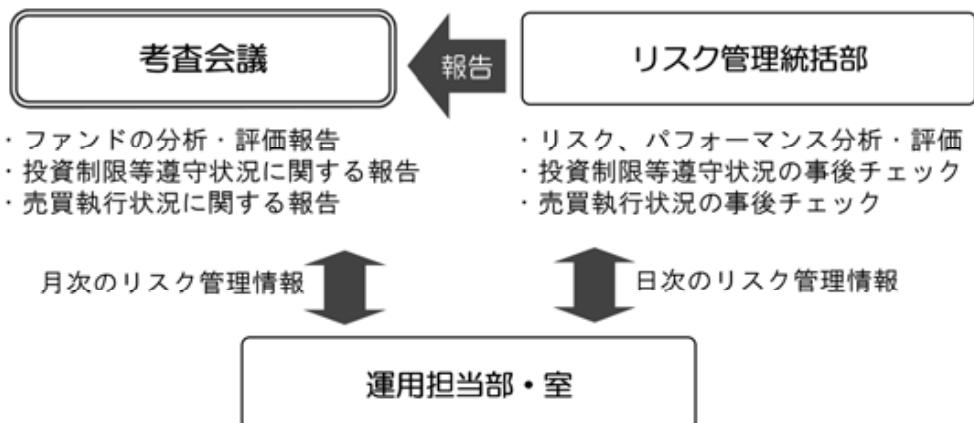
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

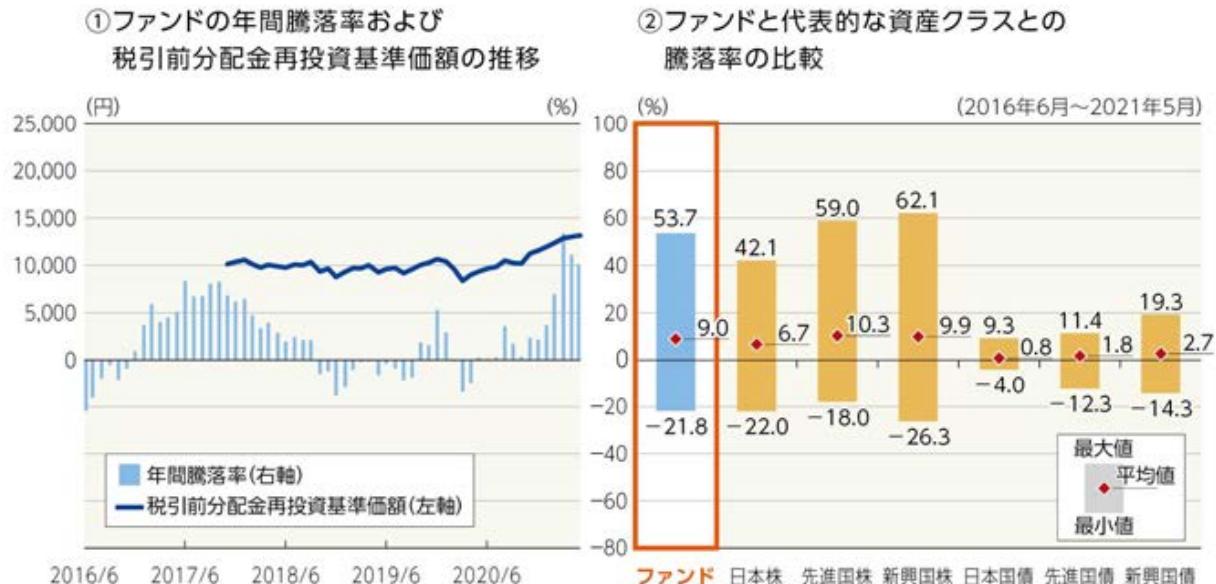
委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2020年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に7.7%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

(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・室に日々連絡とともに、月次の検討会議で報告します。
 - ・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、月次の検討会議で報告します。
 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。

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



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

- ・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標>

- 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。
- ・海外の指標は、「為替ヘッジなし(対円)」の指標を採用しています。

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.3564%（税抜0.324%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.150%	0.150%	0.024%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4) 【その他の手数料等】

- ① 証券取引の手数料等

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

- ② 監査費用

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

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.0044% (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】

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：N I S A（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）
<p>分配前の基準価額</p> <p>分配金</p> <p>全額が普通分配金（課税）</p> <p>分配金落ち後の基準価額</p> <p>分配後の受益者の個別元本（変更なし）</p> <p>分配前の個別元本の基準価額</p>	<p>分配前の個別元本の基準価額</p> <p>分配金</p> <p>普通分配金（課税）</p> <p>元本払戻金（特別分配金）（非課税）</p> <p>分配金落ち後の基準価額</p> <p>分配後の受益者の個別元本</p>

収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額以上の場合、収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

- 投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】

2021年5月31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	44,173,909	100.00
内　日本	44,173,909	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	△1,335	△0.00
純資産総額	44,172,574	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	144,006,409,190	97.34
内　日本	144,006,409,190	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,935,720,760	2.66
純資産総額	147,942,129,950	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引（買建）	4,454,835,000	3.01
内　日本	4,454,835,000	3.01

(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。

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	388,180,835,711	95.18
内 アメリカ	268,219,856,869	65.77
内 イギリス	17,620,440,464	4.32
内 カナダ	14,730,597,822	3.61
内 フランス	13,762,756,514	3.37
内 スイス	13,541,858,312	3.32
内 ドイツ	11,938,707,263	2.93
内 オーストラリア	8,429,368,289	2.07
内 オランダ	7,945,019,935	1.95
内 アイルランド	5,738,262,569	1.41
内 スウェーデン	4,949,352,485	1.21
内 香港	3,658,384,251	0.90
内 スペイン	3,310,456,198	0.81
内 デンマーク	3,227,712,302	0.79
内 イタリア	2,733,060,901	0.67
内 フィンランド	1,339,627,803	0.33
内 ベルギー	1,232,208,372	0.30
内 シンガポール	1,202,111,006	0.29
内 ノルウェー	818,091,003	0.20
内 ジャージー	769,727,294	0.19
内 バミューダ	690,926,717	0.17
内 イスラエル	550,115,868	0.13
内 ケイマン諸島	371,238,389	0.09
内 オランダ領キュラソー	327,151,850	0.08
内 ニュージーランド	305,893,623	0.08
内 オーストリア	260,039,241	0.06
内 ポルトガル	252,945,907	0.06
内 ルクセンブルグ	209,463,736	0.05
内 パプアニューギニア	45,460,728	0.01
投資証券	8,698,836,163	2.13
内 アメリカ	7,308,014,893	1.79
内 オーストラリア	578,158,253	0.14
内 イギリス	230,715,861	0.06
内 フランス	216,080,870	0.05
内 シンガポール	166,277,312	0.04
内 香港	150,682,476	0.04
内 カナダ	48,906,498	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,962,747,462	2.69
純資産総額	407,842,419,336	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31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）	10,086,107,085	2.47
内 アメリカ	7,472,337,868	1.83
内 ドイツ	1,870,626,729	0.46
内 イギリス	743,142,488	0.18

(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。

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	3,121,536,475	89.35
内 台湾	439,643,883	12.58
内 韓国	431,247,553	12.34
内 香港	428,523,400	12.27
内 中国	346,914,657	9.93
内 インド	328,501,040	9.40
内 ケイマン諸島	325,019,590	9.30
内 ブラジル	165,190,954	4.73
内 アメリカ	134,376,179	3.85
内 南アフリカ	124,807,537	3.57
内 ロシア	82,439,549	2.36
内 メキシコ	56,603,610	1.62
内 タイ	55,492,479	1.59
内 マレーシア	41,545,130	1.19
内 インドネシア	39,403,961	1.13
内 ポーランド	23,711,898	0.68
内 フィリピン	18,804,906	0.54
内 バミューダ	15,595,860	0.45
内 チリ	14,273,892	0.41
内 イギリス	11,688,235	0.33
内 オランダ	9,539,438	0.27
内 ハンガリー	7,766,175	0.22
内 トルコ	7,176,686	0.21
内 コロンビア	4,468,028	0.13
内 ギリシャ	4,073,797	0.12
内 チェコ	3,092,291	0.09
内 イギリス領バージン諸島	961,804	0.03
内 ペルー	673,943	0.02
新株予約権証券	7,724	0.00
内 タイ	7,724	0.00
投資信託受益証券	160,582,602	4.60
内 アメリカ	160,582,602	4.60
投資証券	2,194,069	0.06
内 メキシコ	1,141,848	0.03
内 南アフリカ	1,052,221	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	209,394,157	5.99
純資産総額	3,493,715,027	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31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）	231,527,195	6.63
内 アメリカ	231,527,195	6.63

(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。

(2) 【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2021年5月31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 (%)	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	5,672,156	2.1178 12,012,673	2.6030 14,764,622	— —	33.42
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	6,898,835	1.9369 13,362,659	2.1378 14,748,329	— —	33.39
3	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	11,722,202	1.0677 12,516,929	1.2507 14,660,958	— —	33.19

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31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 (%)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	552,800	8,082.53 4,468,022,900	9,115.00 5,038,772,000	— —	3.41
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	341,800	11,959.46 4,087,745,200	10,785.00 3,686,313,000	— —	2.49
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	424,800	10,484.37 4,453,763,200	8,256.00 3,507,148,800	— —	2.37
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	53,600	56,670.98 3,037,565,000	53,870.00 2,887,432,000	— —	1.95
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,681,400	564.75 2,079,095,860	620.00 2,282,468,000	— —	1.54
6	任天堂 日本	株式 その他製品	31,200	67,992.44 2,121,364,200	67,700.00 2,112,240,000	— —	1.43

7	リクルートホールディングス	株式 サービス 業	373,500	5,475.33 2,045,039,300	5,555.00 2,074,792,500	— —	1.40
8	信越化学工業	株式 化学	98,800	18,747.03 1,852,207,100	18,855.00 1,862,874,000	— —	1.26
9	日本電信電話	株式 情報・通 信業	626,200	2,821.51 1,766,830,350	2,931.50 1,835,705,300	— —	1.24
10	武田薬品工業	株式 医薬品	454,000	3,688.03 1,674,367,400	3,719.00 1,688,426,000	— —	1.14
11	日本電産	株式 電気機器	131,300	14,603.05 1,917,381,600	12,530.00 1,645,189,000	— —	1.11
12	KDDI	株式 情報・通 信業	429,400	3,397.54 1,458,907,100	3,717.00 1,596,079,800	— —	1.08
13	東京エレクトロン	株式 電気機器	32,000	46,363.15 1,483,621,100	48,660.00 1,557,120,000	— —	1.05
14	HOYA	株式 精密機器	107,400	13,088.33 1,405,686,900	14,350.00 1,541,190,000	— —	1.04
15	日立製作所	株式 電気機器	262,300	4,952.06 1,298,927,200	5,736.00 1,504,552,800	— —	1.02
16	ダイキン工業	株式 機械	69,500	22,104.76 1,536,281,300	21,605.00 1,501,547,500	— —	1.01
17	三井住友フィナンシャルグループ	株式 銀行業	372,400	3,768.60 1,403,429,200	3,951.00 1,471,352,400	— —	0.99
18	本田技研工業	株式 輸送用機 器	429,600	2,988.93 1,284,044,700	3,353.00 1,440,448,800	— —	0.97
19	村田製作所	株式 電気機器	160,300	9,846.57 1,578,406,400	8,279.00 1,327,123,700	— —	0.90
20	ファナック	株式 電気機器	47,900	27,551.26 1,319,705,500	26,300.00 1,259,770,000	— —	0.85
21	みずほフィナンシャルグループ	株式 銀行業	731,300	1,590.56 1,163,178,150	1,673.00 1,223,464,900	— —	0.83
22	伊藤忠商事	株式 卸売業	375,900	3,252.26 1,222,526,200	3,249.00 1,221,299,100	— —	0.83
23	第一三共	株式 医薬品	428,800	3,257.90 1,396,990,860	2,530.00 1,084,864,000	— —	0.73
24	SMC	株式 機械	16,000	65,860.63 1,053,770,200	65,520.00 1,048,320,000	— —	0.71
25	三井物産	株式 卸売業	428,700	2,215.11 949,618,850	2,414.00 1,034,881,800	— —	0.70
26	セブン&アイ・ホールディングス	株式 小売業	210,200	4,216.62 886,335,400	4,736.00 995,507,200	— —	0.67

27	三菱商事 日本	株式 卸売業	327, 200	2, 983. 19 976, 100, 000	2, 984. 00 976, 364, 800	—	0. 66
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	545, 600	1, 603. 98 875, 135, 300	1, 692. 00 923, 155, 200	—	0. 62
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	177, 200	5, 347. 54 947, 585, 700	5, 179. 00 917, 718, 800	—	0. 62
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス 業	55, 500	17, 987. 69 998, 316, 800	16, 310. 00 905, 205, 000	—	0. 61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	17. 32
		情報・通信業	8. 78
		輸送用機器	7. 44
		化学	7. 18
		機械	5. 48
		サービス業	5. 47
		銀行業	5. 04
		医薬品	4. 95
		卸売業	4. 60
		小売業	4. 40
		食料品	3. 30
		陸運業	3. 23
		精密機器	2. 64
		その他製品	2. 49
		建設業	2. 26
		不動産業	1. 95
		保険業	1. 90
		電気・ガス業	1. 19
		その他金融業	1. 09
		鉄鋼	0. 82
		証券、商品先物取引業	0. 80
		ガラス・土石製品	0. 77
		非鉄金属	0. 74
		ゴム製品	0. 65
		金属製品	0. 60
		繊維製品	0. 47
		空運業	0. 46
		石油・石炭製品	0. 40
		海運業	0. 27
		パルプ・紙	0. 23
		倉庫・運輸関連業	0. 17
		鉱業	0. 17
		水産・農林業	0. 09
小計			97. 34
合 計 (対純資産総額比)			97. 34

(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。

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	1,141,162	13,685.97 15,617,913,918	13,677.19 15,607,893,602	— —	3.83
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	487,025	26,690.54 12,998,961,173	27,404.87 13,346,860,123	— —	3.27
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	29,095	354,766.75 10,321,938,701	353,764.16 10,292,768,328	— —	2.52
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	163,491	34,433.88 5,629,629,481	36,081.40 5,898,984,952	— —	1.45
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	20,049	253,404.00 5,080,496,988	264,692.82 5,306,826,460	— —	1.30
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	20,426	249,446.18 5,095,187,865	258,687.85 5,283,958,146	— —	1.30
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	207,372	17,684.21 3,667,210,456	18,026.98 3,738,291,394	— —	0.92
8	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	52,197	61,973.11 3,234,810,619	68,624.14 3,581,974,611	— —	0.88
9	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	178,676	18,667.17 3,335,375,289	18,576.87 3,319,242,610	—	0.81
10	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	42,077	61,816.52 2,601,053,750	71,319.85 3,000,925,446	— —	0.74
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	93,167	31,416.55 2,926,985,795	31,768.93 2,959,816,311	— —	0.73
	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式		44,950.23	45,212.33	—	

12	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	64,475	2,898,166,277	2,915,065,569	—	0.71
13	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	115,305	24,653.93 2,842,721,522	24,948.44 2,876,680,796	— —	0.71
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	195,795	13,332.16 2,610,371,579	13,546.63 2,652,364,222	— —	0.65
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	73,187	34,516.72 2,526,175,829	35,003.56 2,561,805,662	— —	0.63
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	167,417	14,993.52 2,510,170,888	14,801.13 2,477,961,785	— —	0.61
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	527,935	4,606.67 2,432,026,742	4,652.72 2,456,337,111	— —	0.60
18	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	123,401	18,587.80 2,293,753,337	19,608.62 2,419,723,810	— —	0.59
19	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	60,283	39,622.11 2,388,540,115	39,577.26 2,385,836,012	— —	0.58
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	75,613	26,865.56 2,031,385,751	28,539.79 2,157,979,534	— —	0.53
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	28,508	68,073.65 1,940,643,899	73,864.60 2,105,732,073	— —	0.52
22	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア・娯楽	310,577	5,956.00 1,849,798,444	6,293.63 1,954,659,333	— —	0.48
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	287,751	6,473.60 1,862,785,702	6,406.69 1,843,531,799	— —	0.45
24	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	47,688	37,124.67 1,770,401,605	38,474.79 1,834,786,071	— —	0.45
	ADOBE INC	株式		52,754.83	55,382.70	—	

25	アメリカ	ソフトウエア・サービス	32,508	1,714,954,110	1,800,380,837	—	0.44
26	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信 サービス	281,936	6,246.98 1,761,248,625	6,200.34 1,748,099,734	— —	0.43
27	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	276,169	6,076.32 1,678,091,677	6,269.49 1,731,439,115	— —	0.42
28	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	278,541	5,946.79 1,656,426,281	6,068.63 1,690,362,380	— —	0.41
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロ ジー・ハ ードウェ アおよび 機器	286,863	5,759.48 1,652,182,433	5,806.30 1,665,613,784	— —	0.41
30	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・ 娯楽	30,106	53,547.60 1,612,104,096	55,188.42 1,661,502,741	— —	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31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	11.26
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.20
		メディア・娯楽	7.07
		資本財	6.55
		銀行	6.38
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.33
		小売	5.31
		ヘルスケア機器・サービス	5.03
		各種金融	4.67
		素材	4.50
		半導体・半導体製造装置	4.36
		食品・飲料・タバコ	3.92
		エネルギー	3.21
		保険	3.16
		公益事業	2.92
		運輸	2.08
		耐久消費財・アパレル	1.98
		自動車・自動車部品	1.91
		消費者サービス	1.89
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		電気通信サービス	1.71
		食品・生活必需品小売	1.32
		商業・専門サービス	1.19
		不動産	0.49
		小計	95.18
投資証券	外国		2.13
	小計		2.13
合 計 (対純資産総額比)			97.31

(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。株式（外国）の業種はGICS分類（産業グループ）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&P及びMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式	87,000	2,004.28	2,336.99	—	5.82
		半導体・ 半導体製 造装置		174,372,583	203,318,130	—	
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式	20,400	8,251.47	8,505.21	—	4.97
		メディア・娯楽		168,330,174	173,506,284	—	
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式	53,600	2,955.90	2,932.63	—	4.50
		小売		158,436,620	157,189,289	—	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式		6,632.84	7,881.83	—	

4	韓国	テクノロジー・ハイテクノロジー・アンドウェアおよび機器	17,111	113,494,633	134,866,164	—	3.86
5	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券	22,700	3,459.12 78,522,066	4,230.15 96,024,414	— —	2.75
6	MEITUAN-B 香港	株式小売	13,000	4,194.14 54,523,901	3,749.92 48,749,064	— —	1.40
7	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式小売	1,569	24,563.35 38,539,898	24,134.37 37,866,828	— —	1.08
8	VALE SA ブラジル	株式素材	14,367	1,579.45 22,692,090	2,344.33 33,681,111	— —	0.96
9	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式エネルギー	10,209	3,018.31 30,814,014	3,184.09 32,506,436	— —	0.93
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式銀行	351,000	84.96 29,824,387	90.49 31,764,096	— —	0.91
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式保険	22,500	1,257.65 28,297,251	1,199.77 26,995,027	— —	0.77
12	JD.COM INC-ADR ケイマン諸島	株式小売	3,150	9,461.86 29,804,868	8,115.65 25,564,311	— —	0.73
13	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券	15,504	1,324.80 20,539,744	1,631.03 25,287,544	— —	0.72
14	SK HYNIX INC 韓国	株式半導体・半導体製造装置	1,998	10,369.77 20,718,802	12,300.00 24,575,400	— —	0.70
15	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式ソフトウェア・サービス	11,447	1,687.21 19,313,493	2,135.67 24,447,083	— —	0.70
16	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式銀行	6,278	3,604.02 22,626,058	3,862.85 24,250,984	— —	0.69
17	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券	10,346	1,989.78 20,586,264	2,124.29 21,977,956	— —	0.63
18	PINDUODUO INC-ADR アメリカ	株式小売	1,600	15,225.66 24,361,066	13,706.82 21,930,926	— —	0.63
	XIAOMI CORP-CLASS B	株式		361.97	404.40	—	

19		香港	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	52,600	19,040,020	21,271,650	—	0.61
20	BAIDU INC - SPON ADR	ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	963	17,323.15 16,682,201	21,542.59 20,745,519	— —	0.59
21	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	香港	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	12,500	1,213.12 15,164,047	1,627.51 20,343,925	— —	0.58
22	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	46,200	347.51 16,054,994	439.67 20,312,800	— —	0.58
23	NIO INC - ADR	アメリカ	株式 自動車・自動車部品	4,700	5,180.76 24,349,596	4,238.93 19,922,976	— —	0.57
24	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,689	5,872.87 15,792,149	7,104.47 19,103,946	— —	0.55
25	MEDIATEK INC	台湾	株式 半導体・半導体製造装置	5,000	2,903.41 14,517,065	3,806.52 19,032,605	— —	0.54
26	NETEASE. COM INC -ADR	ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	1,390	9,956.21 13,839,132	12,943.99 17,992,155	— —	0.51
27	ICICI BANK LTD	インド	株式 銀行	17,828	748.46 13,343,547	977.43 17,425,729	— —	0.50
28	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	アメリカ	投資信託受益証券	5,000	2,931.48 14,657,445	3,458.53 17,292,688	— —	0.49
29	SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	ロシア	株式 銀行	9,037	1,452.94 13,130,243	1,852.19 16,738,330	— —	0.48
	PJSC GAZPROM ADR		株式		541.02	779.73	—	

30	ロシア	エネルギー	20,067	10,856,686	15,646,942	—	0.45
----	-----	-------	--------	------------	------------	---	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2021年5月31日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	銀行	10.40
		小売	9.76
		メディア・娯楽	8.31
		半導体・半導体製造装置	8.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.11
		素材	7.44
		エネルギー	4.34
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.37
		食品・飲料・タバコ	3.25
		自動車・自動車部品	3.22
		保険	2.58
		資本財	2.42
		各種金融	2.41
		ソフトウェア・サービス	2.35
		電気通信サービス	1.84
		公益事業	1.80
		不動産	1.80
		耐久消費財・アパレル	1.64
		運輸	1.52
		ヘルスケア機器・サービス	1.11
		消費者サービス	1.10
		食品・生活必需品小売	1.06
		家庭用品・パーソナル用品	0.92
		商業・専門サービス	0.30
		その他	0.00
		小計	89.35
新株予約権証券	外国		0.00
	小計		0.00
投資信託受益証券	外国		4.60
	小計		4.60
投資証券	外国		0.06
	小計		0.06
合 計 (対純資産総額比)			94.01

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ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。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31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 0306月	買建	231	4,415,307,050	4,454,835,000	3.01

(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

2021年5月31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 202106	買建	324	7,326,093,644	7,472,337,868	1.83
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 202106	買建	344	1,814,847,252	1,870,626,729	0.46
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 202106	買建	68	735,321,254	743,142,488	0.18

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

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	NYSE LIFFE US	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202106	買建	31	226,342,077	231,527,195	6.63

(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。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2021年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2018年11月20日)	121,351,918	121,351,918	0.9470	0.9470
第2計算期間末 (2019年11月20日)	139,875,285	139,875,285	1.0199	1.0199
第3計算期間末 (2020年11月20日)	36,139,717	36,139,717	1.1045	1.1045
2020年5月末日	31,828,848	—	0.9372	—
6月末日	33,544,434	—	0.9675	—
7月末日	35,022,075	—	0.9851	—
8月末日	37,898,244	—	1.0513	—
9月末日	37,599,171	—	1.0269	—
10月末日	38,165,389	—	1.0194	—
11月末日	36,669,761	—	1.1265	—
12月末日	38,496,056	—	1.1584	—
2021年1月末日	36,791,303	—	1.1966	—
2月末日	38,613,128	—	1.2362	—
3月末日	41,153,378	—	1.2871	—
4月末日	42,549,018	—	1.3032	—
5月末日	44,172,574	—	1.3173	—

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2020年11月21日～2021年5月20日	—

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△5.3
第2計算期間	7.7
第3計算期間	8.3
2020年11月21日～2021年5月20日	16.4

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	136,816,640	8,674,292	128,142,348
第2計算期間	14,163,842	5,160,659	137,145,531
第3計算期間	10,635,133	115,061,239	32,719,425
2020年11月21日～ 2021年5月20日	4,774,901	4,315,369	33,178,957

(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。

3. 運用実績

2021年5月末現在

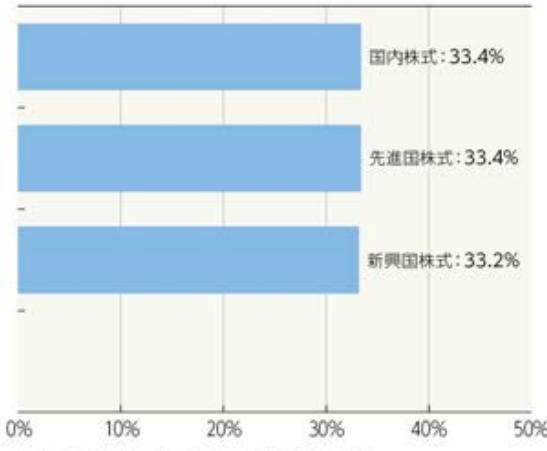
● 基準価額・純資産の推移



基準価額	13,173円
純資産総額	44百万円
● 分配の推移 1万口当り(税引前)	
2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
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。

● 資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

● 年間收益率の推移



- ・ファンド收益率は分配金(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、2021年は年始から上記作成基準日までの收益率です。
- ・2016年以前はベンチマークの收益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.5%
2	ソニーグループ	2.6%
3	ソフトバンクグループ	2.4%
4	キーエンス	2.0%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6%

・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	3.9%
2	マイクロソフト	情報技術	3.4%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.6%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.5%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.3%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

3.ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	6.2%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	5.3%
3	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	4.8%
4	サムスン電子	情報技術	4.1%
5	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	2.9%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。「その他」にはETFを含みます。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.8%
2	情報・通信業	9.0%
3	輸送用機器	7.6%
4	化学	7.4%
5	機械	5.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	71.4%
2	イギリス	4.7%
3	フランス	3.8%
4	カナダ	3.7%
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。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	37.6%
2	台湾	13.5%
3	韓国	13.1%
4	インド	10.0%
5	ブラジル	5.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

① 申込受付

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

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

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

② 取扱コース

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

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

③ 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 申込手数料

ありません。

⑦ その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

① 換金受付

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

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

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

② 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

③ 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○ 換金手数料はありません。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

⑥ 支払開始日

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

⑦ その他

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

2. 換金請求の受け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けたものとして前記④の規定に準じて算出した価額とします。

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
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。

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限です。

(4) 【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

(5) 【その他】

① 繰上償還

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

i. 受益権の口数が30億口を下回っている場合

ii. この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

iii. やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1. により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知り得る受益者に対し、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、これ行使することができます。

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できます。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

⑦ 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2019年11月21日から2020年11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。

独立監査人の監査報告書

2020年12月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）の2019年11月21日から2020年11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、ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）の2020年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

1 【財務諸表】

【ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (2019年11月20日現在)	第3期 (2020年11月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5, 511	290
コール・ローン	221, 641	63, 563
親投資信託受益証券	139, 876, 692	36, 140, 078
未収入金	140, 939	3, 470, 823
流動資産合計	140, 244, 783	39, 674, 754
資産合計	140, 244, 783	39, 674, 754
負債の部		
流動負債		
未払解約金	131, 139	3, 468, 163
未払受託者報酬	17, 092	4, 771
未払委託者報酬	214, 202	60, 181
その他未払費用	7, 065	1, 922
流動負債合計	369, 498	3, 535, 037
負債合計	369, 498	3, 535, 037
純資産の部		
元本等		
元本	137, 145, 531	32, 719, 425
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2, 729, 754	3, 420, 292
純資産合計	139, 875, 285	36, 139, 717
負債純資産合計	140, 244, 783	39, 674, 754

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 (自2018年11月21日 至2019年11月20日)	第3期 (自2019年11月21日 至2020年11月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	10,699,134	3,990,001
営業収益合計	10,699,134	3,990,001
営業費用		
支払利息	3	—
受託者報酬	33,116	9,039
委託者報酬	414,953	113,950
その他費用	13,674	3,614
営業費用合計	461,746	126,603
営業利益又は営業損失（△）	10,237,388	3,863,398
経常利益又は経常損失（△）	10,237,388	3,863,398
当期純利益又は当期純損失（△）	10,237,388	3,863,398
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（△）	252,123	829,463
期首剰余金又は期首次損金（△）	△6,790,430	2,729,754
剰余金増加額又は欠損金減少額	278,028	—
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	278,028	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	743,109	2,343,397
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	2,243,746
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	743,109	99,651
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,729,754	3,420,292

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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2期 2019年11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
1. 受益権総口数	137,145,531口	32,719,425口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0199円 (10,199円)	1.1045円 (11,045円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期 自2018年11月21日 至2019年11月20日	第3期 自2019年11月21日 至2020年11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(2,474,426円)、収益調整金(255,331円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は2,729,757円(1口当たり0.019904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(3,033,934円)、収益調整金(157,601円)及び分配準備積立金(432,736円)より分配対象収益は3,624,271円(1口当たり0.110768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)

I 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自2018年11月21日 至2019年11月20日	第3期 自2019年11月21日 至2020年11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そのリスク	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、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います。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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2019年11月20日現在	第3期 2020年11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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 2019年11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	10,352,275	3,214,019
合計	10,352,275	3,214,019

（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。

（その他の注記）

元本額の変動

項目	第2期 2019年11月20日現在	第3期 2020年11月20日現在
期首元本額	128,142,348円	137,145,531円
期中追加設定元本額	14,163,842円	10,635,133円
期中一部解約元本額	5,160,659円	115,061,239円

(4) 【附属明細表】 (2020年11月20日現在)

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

種類	銘柄	券面総額又は口数	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	6,311,072	11,982,201	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	5,819,342	12,062,914	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	11,629,773	12,094,963	
親投資信託受益証券	合計	23,760,187	36,140,078	
	合計	23,760,187	36,140,078	

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。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等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。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

(参考)

開示対象ファンド（ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式））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」受益証券及び「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンド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。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりでありますが、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」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	26,133,173	19,351,449
コール・ローン	1,051,065,921	4,241,017,814
株式	66,020,728,200	148,120,912,010
派生商品評価勘定	32,833,040	330,767,300
未取配当金	614,918,502	1,221,977,076
差入委託証拠金	44,640,000	254,340,000
流動資産合計	67,790,318,836	154,188,365,649
資産合計	67,790,318,836	154,188,365,649
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,164,100	—
前受金	29,905,000	304,250,000
未払解約金	222,978,912	478,191,630
その他未払費用	6,068	6,807
流動負債合計	260,054,080	782,448,437
負債合計	260,054,080	782,448,437
純資産の部		
元本等		
元本	37,206,074,017	80,797,703,529
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,324,190,739	72,608,213,683
純資産合計	67,530,264,756	153,405,917,212
負債純資産合計	67,790,318,836	154,188,365,649

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、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	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
1. 受益権総口数	37,206,074,017口	80,797,703,529口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,8150円 (18,150円)	1,8986円 (18,986円)

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	自 2019年11月21日 至 2020年11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そのリスク	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、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。	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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によって了場合、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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11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 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	3,259,262,001	18,923,389,638
合計	3,259,262,001	18,923,389,638

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	2019年11月20日 現在			2020年11月20日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引						
先物取引						
賃 建	1,547,375,000	－	1,573,095,000	25,720,000	5,098,120,000	－
合計	1,547,375,000	－	1,573,095,000	25,720,000	5,098,120,000	－

(注) 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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	33,015,590,469円	37,206,074,017円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	14,648,507,258円	60,753,324,319円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,458,023,710円	17,161,694,807円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,469,503,110円	5,997,522,254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）	4,561,011,771円	4,004,514,028円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	4,059,132円	3,951,454円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,460,555,576円	1,860,653,914円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,163,139,062円	6,246,777,830円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,451,105,833円	4,205,316,361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）	8,469,605円	6,322,700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）	37,232,083円	27,161,997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）	44,296,788円	29,811,890円
DCニッセイ国内株式インデックス	313,570,047円	427,035,413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	14,584,098,618円	17,240,662,075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）	626,761,958円	1,074,533,103円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	83,670,627円	144,747,105円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	75,262,010円	145,261,593円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	55,166,663円	145,236,565円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	111,903,417円	322,269,421円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,041,324円	79,701,863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）	41,445,869円	57,705,245円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	25,474,150円	6,311,072円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	3,591,265円	6,106,383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）	1,026,689円	1,725,042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）	2,865,527円	4,955,125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）	16,706,927円	19,701,162円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,863,187円	38,732,745円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,563,574円	30,720,016円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	9,335,459円	104,343,668円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	10,353,746円	157,314,590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）	－円	38,402,506,248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）	－円	5,934,694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）	－円	56,157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）	－円	111,816円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第1 有価証券明細表

① 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,000	2,832.00	8,496,000	
日本水産	83,200	428.00	35,609,600	
マルハニチロ	12,100	2,297.00	27,793,700	
雪国まいたけ	5,100	1,712.00	8,731,200	
カネコ種苗	2,500	1,547.00	3,867,500	
サカタのタネ	10,000	3,505.00	35,050,000	
ホクト	6,400	2,134.00	13,657,600	
ヒノキヤグループ	2,100	2,164.00	4,544,400	
ショーボンドホールディングス	13,000	5,400.00	70,200,000	
ミライ・ホールディングス	24,700	1,636.00	40,409,200	
タマホーム	4,500	1,435.00	6,457,500	
ファーストコーポレーション	5,100	748.00	3,814,800	
スペースバリューホールディングス	10,100	616.00	6,221,600	
住石ホールディングス	29,400	121.00	3,557,400	
日鉄鉱業	1,900	5,090.00	9,671,000	
三井松島ホールディングス	1,000	750.00	750,000	
国際石油開発帝石	305,900	576.00	176,198,400	
石油資源開発	10,900	1,840.00	20,056,000	
K&Oエナジーグループ	4,000	1,466.00	5,864,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	700.00	3,710,000	
安藤・間	49,500	724.00	35,838,000	
東急建設	24,400	504.00	12,297,600	
コムシスホールディングス	29,500	3,155.00	93,072,500	
ビーアールホールディングス	9,100	639.00	5,814,900	
高松コンストラクショングループ	5,200	2,101.00	10,925,200	
東建コーポレーション	2,600	8,100.00	21,060,000	
ソネック	4,400	856.00	3,766,400	
ヤマウラ	4,100	902.00	3,698,200	
大成建設	64,100	3,550.00	227,555,000	
大林組	192,100	956.00	183,647,600	
清水建設	195,000	798.00	155,610,000	
飛島建設	5,500	1,078.00	5,929,000	
長谷工コーポレーション	74,400	1,171.00	87,122,400	
松井建設	7,600	761.00	5,783,600	
錢高組	800	4,705.00	3,764,000	
鹿島建設	150,800	1,351.00	203,730,800	
不動テトラ	5,000	1,668.00	8,340,000	
大末建設	4,500	882.00	3,969,000	
鉄建建設	4,200	1,904.00	7,996,800	
西松建設	14,800	1,984.00	29,363,200	
三井住友建設	46,400	433.00	20,091,200	
大豊建設	4,300	3,445.00	14,813,500	
前田建設工業	48,100	846.00	40,692,600	
佐田建設	8,300	456.00	3,784,800	
ナカノフドー建設	8,800	416.00	3,660,800	
奥村組	9,100	2,533.00	23,050,300	
東鉄工業	8,200	2,854.00	23,402,800	
淺沼組	2,200	4,025.00	8,855,000	

戸田建設	79,800	631.00	50,353,800	
熊谷組	8,900	2,473.00	22,009,700	
北野建設	1,400	2,671.00	3,739,400	
植木組	1,300	2,810.00	3,653,000	
矢作建設工業	8,500	872.00	7,412,000	
ピーエス三菱	6,400	574.00	3,673,600	
日本ハウスホールディングス	14,600	237.00	3,460,200	
大東建託	21,000	10,130.00	212,730,000	
新日本建設	8,100	885.00	7,168,500	
N I P P O	15,900	2,739.00	43,550,100	
東亜道路工業	1,200	3,625.00	4,350,000	
前田道路	17,000	1,770.00	30,090,000	
日本道路	1,900	8,000.00	15,200,000	
東亜建設工業	6,000	1,998.00	11,988,000	
日本国土開発	18,700	568.00	10,621,600	
若築建設	3,500	1,170.00	4,095,000	
東洋建設	21,500	395.00	8,492,500	
五洋建設	76,200	782.00	59,588,400	
世紀東急工業	9,200	812.00	7,470,400	
福田組	2,200	5,330.00	11,726,000	
住友林業	48,700	1,851.00	90,143,700	
日本基礎技術	8,600	487.00	4,188,200	
巴コーポレーション	10,300	386.00	3,975,800	
大和ハウス工業	190,100	3,340.00	634,934,000	
ライト工業	11,000	1,675.00	18,425,000	
積水ハウス	208,300	1,903.00	396,394,900	
日特建設	5,000	810.00	4,050,000	
北陸電気工事	3,300	1,148.00	3,788,400	
ユアテック	11,000	683.00	7,513,000	
日本リーテック	4,000	2,411.00	9,644,000	
四電工	1,600	2,370.00	3,792,000	
中電工	7,700	2,172.00	16,724,400	
関電工	27,300	811.00	22,140,300	
きんでん	45,600	1,733.00	79,024,800	
東京エネシス	6,400	809.00	5,177,600	
トーエネック	1,900	3,595.00	6,830,500	
住友電設	5,400	2,784.00	15,033,600	
日本電設工業	10,500	2,185.00	22,942,500	
協和エクシオ	29,100	2,750.00	80,025,000	
新日本空調	5,100	2,171.00	11,072,100	
日本工営	3,900	2,792.00	10,888,800	
九電工	13,500	3,035.00	40,972,500	
三機工業	13,600	1,144.00	15,558,400	
日揮ホールディングス	59,100	945.00	55,849,500	
中外炉工業	2,600	1,640.00	4,264,000	
ヤマト	6,100	741.00	4,520,100	
太平電業	4,600	2,493.00	11,467,800	
高砂熱学工業	14,700	1,481.00	21,770,700	
三晃金属工業	800	2,673.00	2,138,400	
NECネットエスアイ	17,000	1,868.00	31,756,000	
朝日工業社	1,300	3,025.00	3,932,500	
明星工業	12,400	830.00	10,292,000	
大氣社	9,300	2,845.00	26,458,500	
ダイダン	4,600	2,714.00	12,484,400	
日比谷総合設備	6,200	1,846.00	11,445,200	
日本製粉	18,000	1,682.00	30,276,000	

日清製粉グループ本社	69,500	1,730.00	120,235,000	
昭和産業	5,600	3,285.00	18,396,000	
鳥越製粉	5,400	1,081.00	5,837,400	
中部飼料	7,500	1,445.00	10,837,500	
フィード・ワン	8,300	889.00	7,378,700	
日本甜菜製糖	3,200	1,663.00	5,321,600	
三井製糖	5,400	1,837.00	9,919,800	
塩水港精糖	16,800	225.00	3,780,000	
日新製糖	2,900	1,858.00	5,388,200	
L I F U L L	20,400	383.00	7,813,200	
ミクシイ	11,200	2,802.00	31,382,400	
ジェイエイシリクルートメント	3,900	1,722.00	6,715,800	
日本M&Aセンター	44,800	6,620.00	296,576,000	
メンバーズ	2,100	2,184.00	4,586,400	
UTグループ	9,200	3,115.00	28,658,000	
アイティメディア	2,300	2,335.00	5,370,500	
タケエイ	6,400	1,240.00	7,936,000	
ビーネックスグループ	7,300	1,125.00	8,212,500	
コシダカホールディングス	14,100	401.00	5,654,100	
アルトナー	4,300	896.00	3,852,800	
パソナグループ	6,300	1,808.00	11,390,400	
C D S	2,800	1,282.00	3,589,600	
リンクアンドモチベーション	10,800	600.00	6,480,000	
G C A	7,600	733.00	5,570,800	
エス・エム・エス	18,200	3,425.00	62,335,000	
サニーサイドアップグループ	5,700	657.00	3,744,900	
パーソルホールディングス	58,500	1,862.00	108,927,000	
リニカル	4,900	745.00	3,650,500	
クックパッド	18,400	312.00	5,740,800	
アイ・ケイ・ケイ	5,800	669.00	3,880,200	
森永製菓	14,400	3,905.00	56,232,000	
中村屋	1,600	4,180.00	6,688,000	
江崎グリコ	16,900	4,435.00	74,951,500	
名糖産業	3,000	1,474.00	4,422,000	
井村屋グループ	3,500	2,523.00	8,830,500	
不二家	3,900	2,427.00	9,465,300	
山崎製パン	46,100	1,833.00	84,501,300	
モロゾフ	1,000	6,140.00	6,140,000	
亀田製菓	3,500	5,010.00	17,535,000	
寿スピリッツ	5,900	5,620.00	33,158,000	
カルビー	28,000	2,998.00	83,944,000	
森永乳業	11,400	5,180.00	59,052,000	
六甲バター	4,100	1,872.00	7,675,200	
ヤクルト本社	42,300	5,080.00	214,884,000	
明治ホールディングス	40,700	7,610.00	309,727,000	
雪印メグミルク	14,800	2,442.00	36,141,600	
ブリマハム	9,600	2,898.00	27,820,800	
日本ハム	23,500	4,440.00	104,340,000	
林兼産業	6,500	602.00	3,913,000	
丸大食品	6,600	1,732.00	11,431,200	
S F o o d s	4,900	3,250.00	15,925,000	
柿安本店	2,100	2,509.00	5,268,900	
伊藤ハム米久ホールディングス	39,600	696.00	27,561,600	
学情	3,500	1,020.00	3,570,000	
スタジオアリス	2,900	2,046.00	5,933,400	
クロスキャット	2,600	1,310.00	3,406,000	

シミックホールディングス	2,900	1,320.00	3,828,000	
システナ	21,400	1,940.00	41,516,000	
N J S	2,000	1,931.00	3,862,000	
デジタルアーツ	3,000	8,910.00	26,730,000	
日鉄ソリューションズ	9,000	3,005.00	27,045,000	
綜合警備保障	23,300	5,500.00	128,150,000	
キューブシステム	3,200	1,399.00	4,476,800	
いちご	76,900	330.00	25,377,000	
日本駐車場開発	59,600	126.00	7,509,600	
コア	2,700	1,390.00	3,753,000	
カカクコム	43,200	2,850.00	123,120,000	
アイロムグループ	2,100	1,849.00	3,882,900	
セントケア・ホールディングス	5,500	903.00	4,966,500	
ルネサンス	4,500	863.00	3,883,500	
ディップ	8,000	2,420.00	19,360,000	
S B S ホールディングス	4,500	2,442.00	10,989,000	
デジタルホールディングス	4,100	1,702.00	6,978,200	
新日本科学	6,300	687.00	4,328,100	
ツクイホールディングス	13,800	605.00	8,349,000	
ベネフィット・ワン	21,300	3,145.00	66,988,500	
エムスリー	129,100	8,242.00	1,064,042,200	
ツカダ・グローバルホールディングス	14,800	267.00	3,951,600	
アウトソーシング	33,500	1,387.00	46,464,500	
ウェルネット	6,700	518.00	3,470,600	
ワールドホールディングス	2,000	1,950.00	3,900,000	
ディー・エヌ・エー	24,800	1,831.00	45,408,800	
博報堂D Y ホールディングス	81,400	1,472.00	119,820,800	
ぐるなび	10,200	519.00	5,293,800	
タカミヤ	6,800	535.00	3,638,000	
ジャパンベストレスキューシステム	4,600	867.00	3,988,200	
ファンコミュニケーションズ	16,100	445.00	7,164,500	
ライク	1,900	2,126.00	4,039,400	
ビジネス・ブレークスルー	9,600	412.00	3,955,200	
エスプール	15,000	704.00	10,560,000	
W D B ホールディングス	2,700	3,035.00	8,194,500	
バリューコマース	3,900	3,230.00	12,597,000	
インフォマート	59,200	1,064.00	62,988,800	
サッポロホールディングス	21,000	2,026.00	42,546,000	
アサヒグループホールディングス	134,300	4,012.00	538,811,600	
キリンホールディングス	260,700	2,232.00	581,882,400	
宝ホールディングス	45,600	1,201.00	54,765,600	
オエノンホールディングス	17,500	434.00	7,595,000	
養命酒製造	2,100	1,872.00	3,931,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	47,100	1,756.00	82,707,600	
サントリー食品インターナショナル	41,100	3,945.00	162,139,500	
ダイドーグループホールディングス	3,200	5,890.00	18,848,000	
伊藤園	18,700	7,990.00	149,413,000	
キーコーヒー	6,000	2,215.00	13,290,000	
ジャパンフーズ	2,900	1,242.00	3,601,800	
日清オイリオグループ	7,900	3,015.00	23,818,500	
不二製油グループ本社	15,000	3,015.00	45,225,000	
かどや製油	1,000	3,855.00	3,855,000	
J-オイルミルズ	3,200	3,705.00	11,856,000	
ローソン	15,300	4,880.00	74,664,000	
サンエー	5,000	4,215.00	21,075,000	

カワチ薬品	4,700	3,200.00	15,040,000	
エービーシー・マート	9,400	5,890.00	55,366,000	
ハードオフコーポレーション	5,600	665.00	3,724,000	
高千穂交易	3,900	1,049.00	4,091,100	
アスクル	6,300	3,960.00	24,948,000	
ゲオホールディングス	10,900	1,336.00	14,562,400	
アダストリア	8,400	1,796.00	15,086,400	
ジーフット	8,100	444.00	3,596,400	
伊藤忠食品	1,500	5,470.00	8,205,000	
くら寿司	3,500	5,670.00	19,845,000	
キャンドゥ	2,900	1,976.00	5,730,400	
エレマテック	5,600	938.00	5,252,800	
パルグループホールディングス	6,200	1,150.00	7,130,000	
エディオン	27,700	1,005.00	27,838,500	
あらた	4,800	4,825.00	23,160,000	
サーラコーポレーション	12,200	594.00	7,246,800	
トーメンデバイス	900	3,445.00	3,100,500	
ハローズ	2,300	3,535.00	8,130,500	
J P ホールディングス	18,400	283.00	5,207,200	
フジオフードグループ本社	5,100	1,424.00	7,262,400	
あみやき亭	1,300	2,927.00	3,805,100	
東京エレクトロン デバイス	2,200	3,010.00	6,622,000	
双日	333,200	233.00	77,635,600	
アルフレッサ ホールディングス	67,000	2,122.00	142,174,000	
大黒天物産	1,400	5,770.00	8,078,000	
ハニーズホールディングス	5,300	987.00	5,231,100	
キッコーマン	44,200	6,570.00	290,394,000	
味の素	135,800	2,285.50	310,370,900	
キューピー	34,200	2,343.00	80,130,600	
ハウス食品グループ本社	23,000	3,800.00	87,400,000	
カゴメ	25,100	4,025.00	101,027,500	
アリアケジャパン	5,600	7,130.00	39,928,000	
ピエトロ	2,200	1,716.00	3,775,200	
エバラ食品工業	1,500	2,361.00	3,541,500	
ニチレイ	29,300	2,996.00	87,782,800	
横浜冷凍	15,800	892.00	14,093,600	
東洋水産	31,600	5,420.00	171,272,000	
イートアンドホールディングス	2,100	1,884.00	3,956,400	
大冷	1,700	2,066.00	3,512,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,200	849.00	3,565,800	
日清食品ホールディングス	26,100	8,750.00	228,375,000	
永谷園ホールディングス	3,000	2,383.00	7,149,000	
一正蒲鉾	700	1,144.00	800,800	
フジッコ	6,700	2,044.00	13,694,800	
ロック・フィールド	6,600	1,544.00	10,190,400	
日本たばこ産業	329,700	2,153.50	710,008,950	
ケンコーマヨネーズ	3,400	1,692.00	5,752,800	
わらべや日洋ホールディングス	4,000	1,469.00	5,876,000	
なとり	3,400	2,056.00	6,990,400	
ピックルスコーポレーション	1,300	3,005.00	3,906,500	
北の達人コーポレーション	21,500	531.00	11,416,500	
ユーベレナ	26,600	815.00	21,679,000	
スター・マイカ・ホールディングス	3,100	1,495.00	4,634,500	
ADワークスグループ	23,900	154.00	3,680,600	
片倉工業	8,000	1,307.00	10,456,000	

グンゼ	4,400	3,680.00	16,192,000	
ヒューリック	128,200	1,059.00	135,763,800	
ラサ商事	4,100	896.00	3,673,600	
アルペン	4,600	2,378.00	10,938,800	
ラクーンホールディングス	2,900	2,092.00	6,066,800	
クオールホールディングス	8,900	1,129.00	10,048,100	
アルコニックス	6,400	1,372.00	8,780,800	
神戸物産	41,600	3,240.00	134,784,000	
ソリトンシステムズ	3,000	2,053.00	6,159,000	
ジンズホールディングス	3,200	7,170.00	22,944,000	
ビックカメラ	35,800	1,149.00	41,134,200	
DCMホールディングス	36,900	1,216.00	44,870,400	
MonotaRO	42,900	5,560.00	238,524,000	
東京一番フーズ	6,500	569.00	3,698,500	
あい ホールディングス	8,600	1,942.00	16,701,200	
ディープイエックス	3,600	1,066.00	3,837,600	
きちりホールディングス	5,800	659.00	3,822,200	
アークランドサービスホールディングス	5,000	1,993.00	9,965,000	
J. フロント リテイリング	72,000	857.00	61,704,000	
ドトール・日レスホールディングス	8,700	1,527.00	13,284,900	
マツモトキヨシホールディングス	24,900	4,790.00	119,271,000	
プロンコビリー	3,200	2,360.00	7,552,000	
ZOZO	41,500	2,471.00	102,546,500	
トレジャー・ファクトリー	5,400	694.00	3,747,600	
物語コーポレーション	1,600	12,340.00	19,744,000	
ココカラファイン	6,300	7,240.00	45,612,000	
三越伊勢丹ホールディングス	105,500	590.00	62,245,000	
東洋紡	23,700	1,367.00	32,397,900	
ユニチカ	17,600	391.00	6,881,600	
富士紡ホールディングス	2,900	3,485.00	10,106,500	
日清紡ホールディングス	37,400	756.00	28,274,400	
倉敷紡績	6,000	1,899.00	11,394,000	
ダイワボウホールディングス	5,100	6,060.00	30,906,000	
シキボウ	3,900	1,083.00	4,223,700	
日東紡績	9,100	4,250.00	38,675,000	
トヨタ紡織	17,800	1,433.00	25,507,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	14,400	2,046.00	29,462,400	
Hamee	2,200	1,615.00	3,553,000	
ラクト・ジャパン	2,600	2,961.00	7,698,600	
ウエルシアホールディングス	35,900	4,170.00	149,703,000	
クリエイトSDホールディングス	10,200	3,675.00	37,485,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,400	920.00	10,488,000	
八洲電機	4,700	931.00	4,375,700	
メディアスホールディングス	4,300	906.00	3,895,800	
レスターホールディングス	6,300	2,195.00	13,828,500	
ジユーテックホールディングス	3,900	1,006.00	3,923,400	
丸善CHIホールディングス	9,900	361.00	3,573,900	
OCHIホールディングス	2,200	1,279.00	2,813,800	
TOKAIホールディングス	31,900	1,048.00	33,431,200	
黒谷	7,300	602.00	4,394,600	
ミサワ	4,900	806.00	3,949,400	
ティーライフ	3,100	1,148.00	3,558,800	
Cominix	5,100	724.00	3,692,400	
三洋貿易	6,100	970.00	5,917,000	

チムニー	2,900	1,278.00	3,706,200	
シュッピン	4,200	777.00	3,263,400	
ビューティガレージ	200	2,950.00	590,000	
オイシックス・ラ・大地	6,000	3,185.00	19,110,000	
ワイン・パートナーズ	4,400	1,058.00	4,655,200	
ネクステージ	10,100	1,330.00	13,433,000	
ジョイフル本田	17,700	1,486.00	26,302,200	
鳥貴族	2,300	1,365.00	3,139,500	
キリン堂ホールディングス	2,400	3,520.00	8,448,000	
ホットランド	4,500	1,244.00	5,598,000	
すかいらーくホールディングス	67,600	1,577.00	106,605,200	
S F Pホールディングス	3,400	1,275.00	4,335,000	
綿半ホールディングス	4,500	1,450.00	6,525,000	
日本毛織	19,700	1,041.00	20,507,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,500	1,122.00	19,635,000	
三栄建築設計	2,400	1,752.00	4,204,800	
野村不動産ホールディングス	36,700	2,008.00	73,693,600	
三重交通グループホールディングス	12,200	519.00	6,331,800	
サムティ	8,600	1,825.00	15,695,000	
ディア・ライフ	9,600	421.00	4,041,600	
コーチー・アール・イー	6,700	578.00	3,872,600	
日本商業開発	3,800	1,753.00	6,661,400	
プレサンスコーポレーション	9,900	1,790.00	17,721,000	
日本管理センター	3,300	1,272.00	4,197,600	
サンセイランディック	5,000	753.00	3,765,000	
エストラスト	4,700	750.00	3,525,000	
フージャースホールディングス	12,000	678.00	8,136,000	
オーブンハウス	19,000	4,045.00	76,855,000	
東急不動産ホールディングス	164,300	492.00	80,835,600	
飯田グループホールディングス	50,400	2,142.00	107,956,800	
イーグラント	4,700	768.00	3,609,600	
ムゲンエステート	7,400	514.00	3,803,600	
帝国繊維	6,800	2,689.00	18,285,200	
日本コードクス工業	54,500	72.00	3,924,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,300	1,045.00	4,493,500	
B E E N O S	2,800	2,471.00	6,918,800	
あさひ	4,500	1,585.00	7,132,500	
日本調剤	3,700	1,560.00	5,772,000	
コスモス薬品	5,300	17,470.00	92,591,000	
シップヘルスケアホールディングス	9,700	5,010.00	48,597,000	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	3,350.00	8,710,000	
オンリー	7,500	484.00	3,630,000	
セブン&アイ・ホールディングス	236,000	3,306.00	780,216,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,400	571.00	18,500,400	
明治電機工業	2,900	1,361.00	3,946,900	
ツルハホールディングス	13,200	15,330.00	202,356,000	
サンマルクホールディングス	4,800	1,498.00	7,190,400	
フェリシモ	2,700	1,306.00	3,526,200	
トリドールホールディングス	14,900	1,408.00	20,979,200	
帝人	48,900	1,847.00	90,318,300	
東レ	434,400	559.30	242,959,920	
クラレ	94,500	1,113.00	105,178,500	
旭化成	397,700	989.70	393,603,690	
サカイオーベックス	1,900	1,977.00	3,756,300	

TOKYO BASE	10,200	459.00	4,681,800	
稻葉製作所	3,400	1,388.00	4,719,200	
宮地エンジニアリンググループ	2,200	2,099.00	4,617,800	
トーカロ	16,800	1,168.00	19,622,400	
アルファ	3,900	971.00	3,786,900	
SUMCO	77,500	1,782.00	138,105,000	
川田テクノロジーズ	1,200	4,255.00	5,106,000	
RS Technologies	2,000	3,485.00	6,970,000	
ハウスドウ	3,000	1,205.00	3,615,000	
ケイアイスター不動産	1,900	2,366.00	4,495,400	
グッドコムアセット	2,900	1,426.00	4,135,400	
日本フエルト	7,600	463.00	3,518,800	
イチカワ	300	1,317.00	395,100	
芦森工業	4,000	946.00	3,784,000	
アツギ	6,400	544.00	3,481,600	
JMホールディングス	4,600	2,387.00	10,980,200	
コメダホールディングス	13,200	1,805.00	23,826,000	
アレンザホールディングス	3,000	1,494.00	4,482,000	
バロックジャパンリミテッド	5,600	667.00	3,735,200	
クスリのアオキホールディングス	5,400	8,910.00	48,114,000	
スシローグローバルホールディングス	33,100	3,255.00	107,740,500	
アセンテック	1,700	1,997.00	3,394,900	
セーレン	14,800	1,597.00	23,635,600	
ソト一	3,900	926.00	3,611,400	
東海染工	3,300	1,146.00	3,781,800	
小松マテーレ	9,800	932.00	9,133,600	
ワコールホールディングス	15,000	2,056.00	30,840,000	
ホギメディカル	6,800	3,215.00	21,862,000	
クラウディアホールディングス	12,500	303.00	3,787,500	
TSIホールディングス	18,200	223.00	4,058,600	
マツオカコーポレーション	1,700	2,833.00	4,816,100	
ワールド	8,500	1,298.00	11,033,000	
TIS	60,100	2,016.00	121,161,600	
電算システム	2,300	3,270.00	7,521,000	
グリー	36,900	581.00	21,438,900	
コーニーテクモホールディングス	12,300	5,250.00	64,575,000	
三菱総合研究所	2,600	4,270.00	11,102,000	
電算	1,600	2,403.00	3,844,800	
AGS	4,100	892.00	3,657,200	
ファインデックス	5,100	1,264.00	6,446,400	
ブレインパッド	1,600	4,000.00	6,400,000	
KLlab	10,900	1,002.00	10,921,800	
ポールトゥワイン・ピットクルーホールディングス	7,300	919.00	6,708,700	
イーブックイニシアティブジャパン	1,100	2,975.00	3,272,500	
ネクソン	151,600	2,728.00	413,564,800	
アイスタイル	16,800	461.00	7,744,800	
エムアップホールディングス	1,700	2,624.00	4,460,800	
エイチーム	4,400	924.00	4,065,600	
エニグモ	5,700	1,305.00	7,438,500	
テクノスジャパン	4,700	722.00	3,393,400	
コロプラ	19,700	923.00	18,183,100	
プロードリーフ	29,800	627.00	18,684,600	
クロス・マーケティンググループ	11,000	364.00	4,004,000	
デジタルハーツホールディングス	3,600	1,111.00	3,999,600	
システム情報	4,500	1,110.00	4,995,000	

メディアドウ	1,900	7,010.00	13,319,000	
じげん	14,900	323.00	4,812,700	
ブイキューブ	3,200	2,664.00	8,524,800	
サイバーリンクス	1,100	5,430.00	5,973,000	
フィックスターズ	6,400	951.00	6,086,400	
CARTA HOLDINGS	2,800	1,320.00	3,696,000	
オプティム	3,100	3,040.00	9,424,000	
セレス	2,000	2,218.00	4,436,000	
S H I F T	2,400	14,530.00	34,872,000	
特種東海製紙	3,700	5,210.00	19,277,000	
ティーガイア	5,300	1,801.00	9,545,300	
セック	1,200	2,981.00	3,577,200	
テクマトリックス	8,500	2,120.00	18,020,000	
プロシップ	2,600	1,434.00	3,728,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	14,500	2,533.00	36,728,500	
GMOペイメントゲートウェイ	12,700	13,140.00	166,878,000	
ザッパラス	8,300	478.00	3,967,400	
インターネットイニシアティブ	8,900	4,965.00	44,188,500	
さくらインターネット	6,400	723.00	4,627,200	
ヴィンクス	3,000	1,226.00	3,678,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,300	9,910.00	12,883,000	
S R Aホールディングス	3,200	2,441.00	7,811,200	
朝日ネット	4,300	891.00	3,831,300	
e B A S E	7,200	939.00	6,760,800	
アバント	5,700	1,047.00	5,967,900	
アドソル日進	2,100	2,760.00	5,796,000	
フリービット	4,200	904.00	3,796,800	
コムチュア	6,700	3,010.00	20,167,000	
サイバーコム	2,100	1,734.00	3,641,400	
アステリア	3,900	963.00	3,755,700	
アイル	3,300	1,359.00	4,484,700	
王子ホールディングス	250,800	496.00	124,396,800	
日本製紙	26,500	1,208.00	32,012,000	
三菱製紙	11,200	311.00	3,483,200	
北越コーポレーション	35,800	369.00	13,210,200	
中越パルプ工業	400	1,237.00	494,800	
大王製紙	28,900	1,800.00	52,020,000	
阿波製紙	8,500	454.00	3,859,000	
マークライズ	2,500	2,352.00	5,880,000	
メディカル・データ・ビジョン	6,900	2,547.00	17,574,300	
g u m i	7,700	832.00	6,406,400	
モバイルファクトリー	3,600	1,014.00	3,650,400	
テラスカイ	2,200	4,480.00	9,856,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,700	1,434.00	3,871,800	
P C I ホールディングス	3,300	1,255.00	4,141,500	
P R T I M E S	1,000	3,190.00	3,190,000	
ランドコンピュータ	3,300	1,125.00	3,712,500	
ダブルスタンダード	800	4,375.00	3,500,000	
オープンドア	3,000	1,254.00	3,762,000	
アカツキ	2,100	4,920.00	10,332,000	
L I N E	13,900	5,380.00	74,782,000	
カナミックネットワーク	5,500	765.00	4,207,500	
レンゴー	56,700	851.00	48,251,700	

トーモク	3,700	1,674.00	6,193,800	
ザ・パック	4,500	2,990.00	13,455,000	
チェンジ	4,200	8,410.00	35,322,000	
シンクロ・フード	12,200	310.00	3,782,000	
オークネット	3,200	1,360.00	4,352,000	
AOI TYO HOLDINGS	9,100	424.00	3,858,400	
マクロミル	12,300	643.00	7,908,900	
オロ	1,900	3,335.00	6,336,500	
ユーヤーローカル	800	3,765.00	3,012,000	
テモナ	2,900	1,241.00	3,598,900	
昭和電工	45,600	1,928.00	87,916,800	
住友化学	440,800	385.00	169,708,000	
住友精化	2,700	3,650.00	9,855,000	
日産化学	33,100	6,300.00	208,530,000	
ラサ工業	2,100	1,960.00	4,116,000	
クレハ	5,100	4,975.00	25,372,500	
多木化学	2,300	6,750.00	15,525,000	
ティカ	4,400	1,472.00	6,476,800	
石原産業	10,800	611.00	6,598,800	
片倉コーポアグリ	3,000	1,278.00	3,834,000	
日本曹達	8,900	2,773.00	24,679,700	
東ソー	92,700	1,696.00	157,219,200	
トクヤマ	17,300	2,227.00	38,527,100	
セントラル硝子	12,300	2,281.00	28,056,300	
東亞合成	37,700	1,182.00	44,561,400	
大阪ソーダ	6,100	2,523.00	15,390,300	
関東電化工業	14,200	698.00	9,911,600	
デンカ	21,900	3,215.00	70,408,500	
イビデン	37,500	4,415.00	165,562,500	
信越化学工業	103,000	15,160.00	1,561,480,000	
日本カーバイド工業	3,000	1,237.00	3,711,000	
堺化学工業	3,900	2,078.00	8,104,200	
第一稀元素化学工業	6,500	732.00	4,758,000	
エア・ウォーター	55,800	1,773.00	98,933,400	
日本酸素ホールディングス	57,700	1,778.00	102,590,600	
日本化学工業	1,900	2,332.00	4,430,800	
日本バーカライジング	30,300	1,089.00	32,996,700	
高圧ガス工業	9,500	780.00	7,410,000	
四国化成工業	8,800	1,143.00	10,058,400	
ステラ ケミファ	3,300	3,185.00	10,510,500	
保土谷化学工業	2,200	4,515.00	9,933,000	
日本触媒	9,300	5,320.00	49,476,000	
大日精化工業	5,300	2,290.00	12,137,000	
カネカ	15,500	3,240.00	50,220,000	
協和キリン	61,600	2,748.00	169,276,800	
三菱瓦斯化学	55,800	1,937.00	108,084,600	
三井化学	55,700	2,944.00	163,980,800	
J S R	55,900	2,832.00	158,308,800	
東京応化工業	10,300	6,220.00	64,066,000	
大阪有機化学工業	5,500	2,577.00	14,173,500	
三菱ケミカルホールディングス	401,100	584.60	234,483,060	
KHネオケム	9,900	2,884.00	28,551,600	
ダイセル	74,900	791.00	59,245,900	
住友ベークライト	9,400	3,065.00	28,811,000	
積水化学工業	126,900	1,738.00	220,552,200	
日本ゼオン	54,100	1,249.00	67,570,900	

アイカ工業	18,000	3,900.00	70,200,000	
宇部興産	30,300	1,822.00	55,206,600	
積水樹脂	10,800	2,237.00	24,159,600	
タキロンシーアイ	13,000	662.00	8,606,000	
旭有機材	3,400	1,425.00	4,845,000	
ニチバン	3,200	1,736.00	5,555,200	
リケンテクノス	14,600	428.00	6,248,800	
大倉工業	2,800	1,898.00	5,314,400	
積水化成品工業	8,000	554.00	4,432,000	
群栄化学工業	1,500	2,539.00	3,808,500	
タイガースポリマー	8,500	441.00	3,748,500	
ダイキヨーニシカワ	12,600	672.00	8,467,200	
森六ホールディングス	3,200	1,986.00	6,355,200	
日本化薬	37,100	941.00	34,911,100	
カーリットホールディングス	7,000	553.00	3,871,000	
E P S ホールディングス	7,900	978.00	7,726,200	
プレステージ・インターナショナル	21,900	927.00	20,301,300	
プロトコールレーション	5,400	1,076.00	5,810,400	
ハイマックス	3,100	1,168.00	3,620,800	
アミューズ	3,200	2,582.00	8,262,400	
野村総合研究所	85,200	3,395.00	289,254,000	
ドリームインキュベータ	2,500	1,514.00	3,785,000	
サイバネットシステム	4,300	885.00	3,805,500	
クイック	3,600	1,103.00	3,970,800	
T A C	16,800	219.00	3,679,200	
C E ホールディングス	5,900	637.00	3,758,300	
ケネディクス	50,300	655.00	32,946,500	
電通グループ	65,800	3,345.00	220,101,000	
インテージホールディングス	7,500	1,018.00	7,635,000	
東邦システムサイエンス	4,000	932.00	3,728,000	
ぴあ	1,700	2,768.00	4,705,600	
イオンファンタジー	2,300	2,190.00	5,037,000	
ソースネクスト	28,500	322.00	9,177,000	
シーティーエス	6,600	924.00	6,098,400	
ネクシーズグループ	3,700	907.00	3,355,900	
インフォコム	6,600	3,615.00	23,859,000	
メディカルシステムネットワーク	8,000	690.00	5,520,000	
日本精化	4,800	1,448.00	6,950,400	
扶桑化学工業	6,100	3,295.00	20,099,500	
トリケミカル研究所	1,300	13,670.00	17,771,000	
H E R O Z	1,200	2,984.00	3,580,800	
ラクスル	4,800	4,950.00	23,760,000	
F I G	14,400	274.00	3,945,600	
A D E K A	27,600	1,663.00	45,898,800	
日油	22,600	4,670.00	105,542,000	
ミヨシ油脂	3,300	1,232.00	4,065,600	
新日本理化	23,400	163.00	3,814,200	
ハリマ化成グループ	5,000	1,041.00	5,205,000	
イーソル	3,300	1,461.00	4,821,300	
アルテリア・ネットワークス	6,700	1,625.00	10,887,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,519.00	3,949,400	
花王	146,700	7,830.00	1,148,661,000	
第一工業製薬	2,200	4,415.00	9,713,000	
日華化学	4,000	976.00	3,904,000	
ニイタカ	1,200	3,200.00	3,840,000	

三洋化成工業	3,600	4,500.00	16,200,000	
武田薬品工業	509,700	3,649.00	1,859,895,300	
アステラス製薬	531,100	1,585.50	842,059,050	
大日本住友製薬	45,400	1,358.00	61,653,200	
塩野義製薬	77,000	5,557.00	427,889,000	
わかもと製薬	8,300	268.00	2,224,400	
あすか製薬	7,000	1,597.00	11,179,000	
日本新薬	16,000	7,620.00	121,920,000	
ビオフェルミン製薬	1,500	2,477.00	3,715,500	
中外製薬	191,600	4,431.00	848,979,600	
科研製薬	10,500	3,875.00	40,687,500	
エーザイ	73,300	7,742.00	567,488,600	
理研ビタミン	5,800	1,411.00	8,183,800	
ロート製薬	31,400	3,340.00	104,876,000	
小野薬品工業	140,700	3,171.00	446,159,700	
久光製薬	16,200	5,900.00	95,580,000	
有機合成薬品工業	12,100	307.00	3,714,700	
持田製薬	8,500	4,090.00	34,765,000	
参天製薬	114,200	1,646.00	187,973,200	
扶桑薬品工業	2,200	2,829.00	6,223,800	
ツムラ	19,000	3,280.00	62,320,000	
日医工	17,400	1,020.00	17,748,000	
テルモ	173,300	4,064.00	704,291,200	
H. U. グループホールディングス	16,400	2,855.00	46,822,000	
キッセイ薬品工業	10,800	2,079.00	22,453,200	
生化学工業	11,900	985.00	11,721,500	
栄研化学	10,800	1,967.00	21,243,600	
日本製薬	3,500	988.00	3,458,000	
鳥居薬品	3,800	3,220.00	12,236,000	
J C R ファーマ	17,300	2,736.00	47,332,800	
東和薬品	7,800	1,892.00	14,757,600	
富士製薬工業	4,200	1,204.00	5,056,800	
沢井製薬	12,600	4,700.00	59,220,000	
ゼリア新薬工業	11,100	1,868.00	20,734,800	
第一三共	525,900	3,536.00	1,859,582,400	
キヨーリン製薬ホールディングス	13,500	1,868.00	25,218,000	
大幸薬品	7,500	1,731.00	12,982,500	
ダイト	3,900	3,725.00	14,527,500	
大塚ホールディングス	127,300	4,325.00	550,572,500	
大正製薬ホールディングス	13,000	6,560.00	85,280,000	
ペプチドリーム	31,100	4,800.00	149,280,000	
大日本塗料	6,800	968.00	6,582,400	
日本ペイントホールディングス	49,500	12,210.00	604,395,000	
関西ペイント	67,400	3,005.00	202,537,000	
中国塗料	17,100	959.00	16,398,900	
日本特殊塗料	4,500	1,153.00	5,188,500	
藤倉化成	8,100	535.00	4,333,500	
太陽ホールディングス	4,400	5,780.00	25,432,000	
D I C	25,300	2,565.00	64,894,500	
サカタインクス	13,100	1,165.00	15,261,500	
東洋インキS Cホールディングス	12,700	2,000.00	25,400,000	
T & K TOKA	4,600	877.00	4,034,200	
アルプス技研	5,200	2,007.00	10,436,400	
日本空調サービス	6,100	760.00	4,636,000	
オリエンタルランド	62,300	17,290.00	1,077,167,000	
フォーカスシステムズ	4,000	890.00	3,560,000	

ダスキン	14,500	2,918.00	42,311,000	
パーク 2 4	32,400	1,562.00	50,608,800	
明光ネットワークジャパン	7,400	588.00	4,351,200	
ファルコホールディングス	3,200	1,563.00	5,001,600	
クレスコ	3,700	1,264.00	4,676,800	
フジ・メディア・ホールディングス	57,900	1,058.00	61,258,200	
秀英予備校	8,400	417.00	3,502,800	
ラウンドワン	16,300	866.00	14,115,800	
リゾートトラスト	26,800	1,675.00	44,890,000	
オービック	20,800	21,420.00	445,536,000	
ジャストシステム	9,800	6,850.00	67,130,000	
T D C ソフト	5,300	1,016.00	5,384,800	
Z ホールディングス	825,500	611.00	504,380,500	
ビー・エム・エル	7,500	3,325.00	24,937,500	
トレンドマイクロ	32,100	5,480.00	175,908,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,200	1,210.00	12,342,000	
I D ホールディングス	2,600	1,219.00	3,169,400	
リソー教育	26,700	319.00	8,517,300	
日本オラクル	12,200	11,500.00	140,300,000	
早稲田アカデミー	3,800	939.00	3,568,200	
アルファシステムズ	1,900	3,280.00	6,232,000	
フューチャー	7,300	1,794.00	13,096,200	
C A C H o l d i n g s	3,900	1,417.00	5,526,300	
S B テクノロジー	2,200	3,485.00	7,667,000	
トーセ	4,400	869.00	3,823,600	
ユー・エス・エス	65,500	2,200.00	144,100,000	
オービックビジネスコンサルタント	6,100	6,930.00	42,273,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	27,400	3,670.00	100,558,000	
アイテイフォー	7,300	886.00	6,467,800	
東京個別指導学院	6,200	600.00	3,720,000	
東計電算	900	4,335.00	3,901,500	
サイバーエージェント	36,100	6,420.00	231,762,000	
楽天	272,800	1,128.00	307,718,400	
クリーク・アンド・リバー社	3,600	1,039.00	3,740,400	
テー・オー・ダブリュー	12,700	287.00	3,644,900	
大塚商会	32,500	4,930.00	160,225,000	
サイボウズ	7,000	2,835.00	19,845,000	
ソフトブレーン	4,700	866.00	4,070,200	
山田コンサルティンググループ	3,800	955.00	3,629,000	
セントラルスポーツ	2,200	2,194.00	4,826,800	
電通国際情報サービス	3,700	6,430.00	23,791,000	
A C C E S S	5,600	792.00	4,435,200	
デジタルガレージ	10,800	3,990.00	43,092,000	
イーエムシステムズ	8,500	824.00	7,004,000	
ウェザーニューズ	2,000	5,540.00	11,080,000	
C I J	4,100	920.00	3,772,000	
ビジネスエンジニアリング	1,000	3,300.00	3,300,000	
日本エンタープライズ	15,500	227.00	3,518,500	
WOWOW	2,900	2,825.00	8,192,500	
スカラ	4,000	797.00	3,188,000	
フルキャストホールディングス	5,100	1,687.00	8,603,700	
エン・ジャパン	10,400	3,620.00	37,648,000	
富士フィルムホールディングス	117,500	5,679.00	667,282,500	
コニカミノルタ	133,800	306.00	40,942,800	
資生堂	121,700	7,171.00	872,710,700	
ライオン	79,600	2,530.00	201,388,000	

高砂香料工業	3,800	2,473.00	9,397,400	
マンダム	13,800	1,707.00	23,556,600	
ミルボン	8,200	6,050.00	49,610,000	
ファンケル	24,800	3,925.00	97,340,000	
コーワー	11,500	15,310.00	176,065,000	
コタ	3,500	1,352.00	4,732,000	
シーボン	1,900	1,963.00	3,729,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	26,100	2,045.00	53,374,500	
ノエビアホールディングス	5,200	4,505.00	23,426,000	
アジュバンコスマジヤパン	3,700	1,016.00	3,759,200	
エステー	3,900	1,960.00	7,644,000	
アグロ カネショウ	2,300	1,724.00	3,965,200	
コニシ	10,100	1,585.00	16,008,500	
長谷川香料	10,600	2,129.00	22,567,400	
星光PMC	5,800	659.00	3,822,200	
小林製薬	17,200	11,640.00	200,208,000	
荒川化学工業	5,500	1,126.00	6,193,000	
メック	4,200	2,021.00	8,488,200	
日本高純度化学	1,700	2,686.00	4,566,200	
タカラバイオ	16,000	2,937.00	46,992,000	
J C U	7,400	3,465.00	25,641,000	
新田ゼラチン	5,300	708.00	3,752,400	
O A Tアグリオ	200	1,400.00	280,000	
デクセリアルズ	15,800	1,196.00	18,896,800	
アース製薬	4,500	6,200.00	27,900,000	
北興化学工業	5,700	1,062.00	6,053,400	
大成ラミック	2,000	2,873.00	5,746,000	
クミアイ化学工業	25,300	1,072.00	27,121,600	
日本農薬	10,900	534.00	5,820,600	
ニチレキ	7,200	1,682.00	12,110,400	
ユシロ化学工業	3,400	1,216.00	4,134,400	
ビーピー・カストロール	3,000	1,297.00	3,891,000	
富士石油	2,800	192.00	537,600	
MORESCO	3,700	1,007.00	3,725,900	
出光興産	68,000	2,209.00	150,212,000	
ENEOSホールディングス	921,500	374.60	345,193,900	
コスモエネルギーホールディングス	17,700	1,769.00	31,311,300	
横浜ゴム	35,500	1,616.00	57,368,000	
TOYO TIRE	32,200	1,798.00	57,895,600	
ブリヂストン	162,900	3,745.00	610,060,500	
住友ゴム工業	55,000	1,018.00	55,990,000	
オカモト	3,700	4,255.00	15,743,500	
アキレス	4,200	1,492.00	6,266,400	
フコク	5,500	717.00	3,943,500	
ニッタ	6,900	2,300.00	15,870,000	
住友理工	11,900	533.00	6,342,700	
三ツ星ベルト	8,100	1,688.00	13,672,800	
バンドー化学	10,800	573.00	6,188,400	
AGC	56,200	3,510.00	197,262,000	
日本板硝子	29,300	407.00	11,925,100	
有沢製作所	9,700	935.00	9,069,500	
日本山村硝子	4,400	855.00	3,762,000	
日本電気硝子	22,700	2,204.00	50,030,800	
オハラ	3,000	1,254.00	3,762,000	
住友大阪セメント	11,600	3,275.00	37,990,000	
太平洋セメント	38,700	2,927.00	113,274,900	

日本ヒューム	6,100	784.00	4,782,400	
日本コンクリート工業	13,200	312.00	4,118,400	
三谷セキサン	2,900	4,550.00	13,195,000	
アジアパイルホールディングス	8,700	456.00	3,967,200	
東海カーボン	59,900	1,185.00	70,981,500	
日本カーボン	3,400	3,775.00	12,835,000	
東洋炭素	3,600	1,766.00	6,357,600	
ノリタケカンパニーリミテド	3,400	2,973.00	10,108,200	
TOTO	43,800	5,790.00	253,602,000	
日本碍子	73,500	1,621.00	119,143,500	
日本特殊陶業	46,600	1,846.00	86,023,600	
MARUWA	2,400	10,130.00	24,312,000	
品川リフラクトリーズ	1,700	2,333.00	3,966,100	
黒崎播磨	1,300	2,938.00	3,819,400	
ヨータイ	4,900	806.00	3,949,400	
イソライト工業	7,900	435.00	3,436,500	
ニッカトー	5,300	633.00	3,354,900	
フジミインコーポレーテッド	5,500	3,575.00	19,662,500	
クニミネ工業	3,500	1,067.00	3,734,500	
ニチアス	16,800	2,341.00	39,328,800	
日本製鉄	271,100	1,217.00	329,928,700	
神戸製鋼所	110,900	483.00	53,564,700	
中山製鋼所	10,400	384.00	3,993,600	
合同製鐵	3,300	1,865.00	6,154,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	163,600	915.00	149,694,000	
東京製鐵	29,500	686.00	20,237,000	
共英製鋼	6,800	1,370.00	9,316,000	
大和工業	12,900	2,566.00	33,101,400	
東京鐵鋼	2,500	2,083.00	5,207,500	
大阪製鐵	900	1,126.00	1,013,400	
淀川製鋼所	8,200	2,077.00	17,031,400	
丸一鋼管	19,700	2,329.00	45,881,300	
モリ工業	1,800	2,428.00	4,370,400	
大同特殊鋼	9,900	4,380.00	43,362,000	
日本高周波鋼業	10,900	339.00	3,695,100	
日本冶金工業	5,000	1,555.00	7,775,000	
山陽特殊製鋼	4,100	1,215.00	4,981,500	
愛知製鋼	3,400	2,663.00	9,054,200	
日立金属	65,300	1,535.00	100,235,500	
大太平洋金属	4,100	1,787.00	7,326,700	
新日本電工	39,100	223.00	8,719,300	
栗本鐵工所	3,000	1,704.00	5,112,000	
日本製鋼所	18,400	2,538.00	46,699,200	
三菱製鋼	7,000	524.00	3,668,000	
日亜鋼業	12,300	315.00	3,874,500	
日本精線	1,100	3,180.00	3,498,000	
大紀アルミニウム工業所	9,900	650.00	6,435,000	
日本軽金属ホールディングス	15,300	1,788.00	27,356,400	
三井金属鉱業	16,300	2,890.00	47,107,000	
東邦亜鉛	3,100	1,937.00	6,004,700	
三菱マテリアル	40,000	1,977.00	79,080,000	
住友金属鉱山	77,400	3,659.00	283,206,600	
DOWAホールディングス	15,300	3,490.00	53,397,000	
古河機械金属	10,800	1,145.00	12,366,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,300	838.00	5,279,400	

東邦チタニウム	10,800	694.00	7,495,200	
U A C J	9,200	1,748.00	16,081,600	
CKサンエツ	1,300	3,670.00	4,771,000	
古河電気工業	18,800	2,413.00	45,364,400	
住友電気工業	226,500	1,265.00	286,522,500	
フジクラ	73,200	409.00	29,938,800	
昭和電線ホールディングス	7,000	1,497.00	10,479,000	
東京特殊電線	1,600	2,381.00	3,809,600	
タツタ電線	12,000	581.00	6,972,000	
カナレ電気	2,200	1,787.00	3,931,400	
リヨービ	7,500	1,217.00	9,127,500	
アーレスティ	11,700	325.00	3,802,500	
アサヒホールディングス	10,600	3,300.00	34,980,000	
東洋製罐グループホールディングス	38,600	1,051.00	40,568,600	
ホッカソホールディングス	3,300	1,401.00	4,623,300	
コロナ	3,900	930.00	3,627,000	
横河ブリッジホールディングス	11,300	1,946.00	21,989,800	
OSJBホールディングス	30,300	237.00	7,181,100	
三和ホールディングス	57,100	1,246.00	71,146,600	
文化シヤッター	17,900	924.00	16,539,600	
三協立山	7,800	810.00	6,318,000	
アルインコ	4,400	890.00	3,916,000	
LIXILグループ	89,400	2,399.00	214,470,600	
日本ファイルコン	6,900	572.00	3,946,800	
ノーリツ	12,600	1,697.00	21,382,200	
長府製作所	6,200	2,104.00	13,044,800	
リンナイ	11,800	11,850.00	139,830,000	
ユニプレス	11,900	895.00	10,650,500	
ダイニチ工業	5,100	965.00	4,921,500	
日東精工	8,100	453.00	3,669,300	
三洋工業	2,000	1,922.00	3,844,000	
岡部	12,300	827.00	10,172,100	
ジーテクト	7,500	1,414.00	10,605,000	
東プレ	11,300	1,244.00	14,057,200	
高周波熱練	11,700	464.00	5,428,800	
東京製綱	7,600	563.00	4,278,800	
サンコール	9,000	425.00	3,825,000	
モリテックスチール	12,400	300.00	3,720,000	
パイオラックス	9,000	1,647.00	14,823,000	
エイチワン	500	666.00	333,000	
日本発条	65,000	658.00	42,770,000	
三浦工業	26,200	5,290.00	138,598,000	
タクマ	20,500	1,831.00	37,535,500	
テクノプロ・ホールディングス	11,700	7,940.00	92,898,000	
インターワークス	11,100	323.00	3,585,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,400	14,070.00	33,768,000	
Keepér技研	4,300	1,804.00	7,757,200	
三機サービス	3,800	972.00	3,693,600	
Gunosy	4,800	752.00	3,609,600	
イー・ガーディアン	2,600	2,963.00	7,703,800	
リブセンス	13,500	254.00	3,429,000	
ジャパンマテリアル	18,000	1,391.00	25,038,000	
ベクトル	7,300	889.00	6,489,700	
ウチヤマホールディングス	12,100	303.00	3,666,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,000	1,174.00	5,870,000	

I B J	4,800	819.00	3,931,200	
アサンテ	2,400	1,528.00	3,667,200	
N・フィールド	5,500	806.00	4,433,000	
バリューHR	2,300	1,660.00	3,818,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	4,700	6,120.00	28,764,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,200	2,068.00	4,549,600	
E R I ホールディングス	5,800	688.00	3,990,400	
アビスト	1,300	2,898.00	3,767,400	
シグマクシス	4,000	1,531.00	6,124,000	
ウィルグループ	4,600	920.00	4,232,000	
メドピア	2,800	5,500.00	15,400,000	
リクルートホールディングス	419,300	4,505.00	1,888,946,500	
エラン	4,000	3,010.00	12,040,000	
ツガミ	12,600	1,602.00	20,185,200	
オークマ	7,100	5,880.00	41,748,000	
芝浦機械	6,800	2,248.00	15,286,400	
アマダ	75,100	1,017.00	76,376,700	
アイダエンジニアリング	15,800	884.00	13,967,200	
滝澤鉄工所	3,700	993.00	3,674,100	
F U J I	26,000	2,400.00	62,400,000	
牧野フライス製作所	7,100	4,130.00	29,323,000	
オーエスジー	29,900	1,863.00	55,703,700	
ダイジェット工業	2,700	1,459.00	3,939,300	
旭ダイヤモンド工業	15,900	443.00	7,043,700	
DMG森精機	38,300	1,539.00	58,943,700	
ソディック	13,200	835.00	11,022,000	
ディスコ	8,200	30,550.00	250,510,000	
日東工具	3,300	1,727.00	5,699,100	
日進工具	2,400	2,540.00	6,096,000	
日本郵政	479,800	824.00	395,355,200	
ベルシステム24ホールディングス	9,800	1,616.00	15,836,800	
鎌倉新書	4,400	1,107.00	4,870,800	
一蔵	9,700	360.00	3,492,000	
L I T A L I C O	2,000	3,465.00	6,930,000	
エアトリ	3,100	1,296.00	4,017,600	
ハイアス・アンド・カンパニー	22,700	160.00	3,632,000	
アトラエ	1,800	2,935.00	5,283,000	
ストライク	2,200	5,880.00	12,936,000	
ソラスト	16,100	1,531.00	24,649,100	
セラク	1,800	1,984.00	3,571,200	
インソース	2,400	3,430.00	8,232,000	
豊田自動織機	49,600	7,460.00	370,016,000	
豊和工業	4,600	842.00	3,873,200	
東洋機械金属	9,100	402.00	3,658,200	
エンシュウ	4,000	903.00	3,612,000	
島精機製作所	9,500	1,751.00	16,634,500	
オプトラン	7,600	2,134.00	16,218,400	
N C ホールディングス	6,100	580.00	3,538,000	
イワキ	4,400	815.00	3,586,000	
フリュー	5,900	1,053.00	6,212,700	
ヤマシンフィルタ	13,200	1,055.00	13,926,000	
日阪製作所	7,500	826.00	6,195,000	
やまびこ	11,800	1,372.00	16,189,600	
平田機工	2,900	7,440.00	21,576,000	
ペガサスミシン製造	13,000	293.00	3,809,000	

タツモ	2,600	1,491.00	3,876,600	
ナブテスコ	35,700	4,030.00	143,871,000	
三井海洋開発	6,400	1,718.00	10,995,200	
レオン自動機	5,900	1,181.00	6,967,900	
SMC	19,200	60,250.00	1,156,800,000	
ホソカワミクロン	2,100	6,410.00	13,461,000	
ユニオンツール	2,300	3,175.00	7,302,500	
オイレス工業	7,800	1,591.00	12,409,800	
日精エー・エス・ビー機械	1,800	5,310.00	9,558,000	
サトーホールディングス	8,600	2,131.00	18,326,600	
技研製作所	5,300	4,100.00	21,730,000	
カワタ	4,300	804.00	3,457,200	
日精樹脂工業	5,100	880.00	4,488,000	
オカダアイヨン	3,700	1,010.00	3,737,000	
小松製作所	277,500	2,518.50	698,883,750	
住友重機械工業	35,100	2,340.00	82,134,000	
日立建機	24,500	2,896.00	70,952,000	
日工	8,400	668.00	5,611,200	
巴工業	2,400	1,964.00	4,713,600	
井関農機	6,100	1,395.00	8,509,500	
TOWA	6,200	1,726.00	10,701,200	
丸山製作所	2,900	1,438.00	4,170,200	
北川鉄工所	2,800	1,330.00	3,724,000	
シンニッタン	18,600	185.00	3,441,000	
ローツェ	2,700	5,340.00	14,418,000	
タカキタ	5,600	702.00	3,931,200	
クボタ	325,000	2,167.00	704,275,000	
荏原実業	1,500	3,785.00	5,677,500	
三菱化工機	2,100	2,283.00	4,794,300	
月島機械	11,300	1,356.00	15,322,800	
帝国電機製作所	5,000	1,193.00	5,965,000	
新東工業	14,500	737.00	10,686,500	
澁谷工業	5,400	3,535.00	19,089,000	
アイチコーポレーション	10,600	919.00	9,741,400	
小森コーポレーション	15,500	722.00	11,191,000	
鶴見製作所	4,700	1,759.00	8,267,300	
荏原製作所	25,400	3,225.00	81,915,000	
石井鐵工所	1,400	2,799.00	3,918,600	
西島製作所	6,200	819.00	5,077,800	
北越工業	6,300	1,066.00	6,715,800	
ダイキン工業	78,000	23,215.00	1,810,770,000	
オルガノ	2,200	5,560.00	12,232,000	
トヨーカネツ	2,700	1,958.00	5,286,600	
栗田工業	33,100	3,625.00	119,987,500	
椿本チエイン	8,700	2,565.00	22,315,500	
大同工業	6,100	678.00	4,135,800	
日機装	19,800	996.00	19,720,800	
木村化工機	8,500	483.00	4,105,500	
レイズネクスト	10,300	1,143.00	11,772,900	
アネスト岩田	9,500	910.00	8,645,000	
ダイフク	31,300	11,440.00	358,072,000	
サムコ	1,500	3,270.00	4,905,000	
加藤製作所	3,600	1,035.00	3,726,000	
タダノ	29,600	835.00	24,716,000	
フジテック	22,300	2,157.00	48,101,100	
CKD	16,800	2,176.00	36,556,800	

キトー	4,600	1,593.00	7,327,800	
平和	17,100	1,548.00	26,470,800	
理想科学工業	5,400	1,224.00	6,609,600	
SANKYO	13,600	2,647.00	35,999,200	
日本金錢機械	7,000	575.00	4,025,000	
マースグループホールディングス	3,900	1,636.00	6,380,400	
フクシマガリレイ	3,800	4,455.00	16,929,000	
ダイコク電機	3,900	906.00	3,533,400	
竹内製作所	10,300	2,472.00	25,461,600	
アマノ	16,000	2,496.00	39,936,000	
JUKI	8,500	539.00	4,581,500	
蛇の目ミシン工業	6,300	765.00	4,819,500	
プラザー工業	74,800	1,913.00	143,092,400	
マックス	9,300	1,439.00	13,382,700	
モリタホールディングス	10,700	1,807.00	19,334,900	
グローリー	15,700	2,191.00	34,398,700	
新晃工業	5,700	1,661.00	9,467,700	
大和冷機工業	9,800	1,000.00	9,800,000	
セガサミーホールディングス	60,800	1,500.00	91,200,000	
日本ピストンリング	3,800	1,015.00	3,857,000	
リケン	2,800	2,333.00	6,532,400	
TPR	8,200	1,377.00	11,291,400	
ツバキ・ナカシマ	11,700	919.00	10,752,300	
ホシザキ	19,300	10,180.00	196,474,000	
大豊工業	6,700	611.00	4,093,700	
日本精工	115,300	887.00	102,271,100	
NTN	141,800	226.00	32,046,800	
ジェイテクト	58,800	865.00	50,862,000	
不二越	5,700	4,470.00	25,479,000	
ミネベアミツミ	113,700	2,057.00	233,880,900	
日本トムソン	18,200	347.00	6,315,400	
THK	38,200	2,988.00	114,141,600	
ユーシン精機	5,300	722.00	3,826,600	
前澤給装工業	2,200	2,178.00	4,791,600	
イーグル工業	7,600	899.00	6,832,400	
日本ピラー工業	6,200	1,459.00	9,045,800	
キッツ	24,800	551.00	13,664,800	
日立製作所	294,300	3,962.00	1,166,016,600	
三菱電機	612,600	1,484.00	909,098,400	
富士電機	36,900	3,415.00	126,013,500	
東洋電機製造	3,200	1,112.00	3,558,400	
安川電機	65,900	4,725.00	311,377,500	
シンフォニア テクノロジー	7,900	1,271.00	10,040,900	
明電舎	11,300	1,661.00	18,769,300	
オリジン	2,700	1,326.00	3,580,200	
山洋電気	3,000	4,890.00	14,670,000	
デシヨー	5,200	2,101.00	10,925,200	
ベイカレント・コンサルティング	3,500	15,190.00	53,165,000	
キャリアインデックス	7,900	796.00	6,288,400	
MS-Japan	4,600	783.00	3,601,800	
グレイステクノロジー	2,700	6,250.00	16,875,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,700	4,465.00	29,915,500	
グリーンズ	7,900	475.00	3,752,500	
ミダック	1,400	3,430.00	4,802,000	
日総工産	4,700	742.00	3,487,400	

キュー・ビーネットホールディングス	2,400	1,553.00	3,727,200	
R P Aホールディングス	5,000	689.00	3,445,000	
三櫻工業	7,800	626.00	4,882,800	
マキタ	79,900	5,330.00	425,867,000	
東芝テック	7,700	4,010.00	30,877,000	
芝浦メカトロニクス	1,200	3,890.00	4,668,000	
マブチモーター	17,000	4,475.00	76,075,000	
日本電産	147,500	11,460.00	1,690,350,000	
トレックス・セミコンダクター	3,500	1,247.00	4,364,500	
東光高岳	3,500	1,143.00	4,000,500	
ダブル・スコープ	9,700	643.00	6,237,100	
ダイヘン	6,700	4,235.00	28,374,500	
ヤーマン	10,000	2,141.00	21,410,000	
J V Cケンウッド	49,900	151.00	7,534,900	
ミマキエンジニアリング	9,000	479.00	4,311,000	
I - P E X	2,800	1,887.00	5,283,600	
日新電機	14,400	1,145.00	16,488,000	
大崎電気工業	12,200	569.00	6,941,800	
オムロン	54,900	8,440.00	463,356,000	
日東工業	9,000	1,923.00	17,307,000	
I D E C	8,800	1,803.00	15,866,400	
不二電機工業	2,900	1,306.00	3,787,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20,500	2,407.00	49,343,500	
サクサホールディングス	2,600	1,412.00	3,671,200	
メルコホールディングス	2,100	3,045.00	6,394,500	
日本電気	74,300	5,480.00	407,164,000	
富士通	59,100	13,505.00	798,145,500	
沖電気工業	24,900	912.00	22,708,800	
電気興業	2,900	2,873.00	8,331,700	
サンケン電気	6,700	3,640.00	24,388,000	
アイホン	3,500	1,601.00	5,603,500	
ルネサスエレクトロニクス	262,200	922.00	241,748,400	
セイコーエプソン	76,000	1,464.00	111,264,000	
ワコム	41,200	788.00	32,465,600	
アルバック	11,300	3,965.00	44,804,500	
E I Z O	4,800	3,495.00	16,776,000	
ジャパンディスプレイ	177,000	50.00	8,850,000	
日本信号	15,600	925.00	14,430,000	
京三製作所	14,300	421.00	6,020,300	
能美防災	8,100	2,414.00	19,553,400	
ホーチキ	4,400	1,298.00	5,711,200	
エレコム	7,000	4,620.00	32,340,000	
パナソニック	699,900	1,083.50	758,341,650	
シャープ	70,900	1,325.00	93,942,500	
アンリツ	39,400	2,337.00	92,077,800	
富士通ゼネラル	16,600	3,115.00	51,709,000	
ソニー	383,700	9,235.00	3,543,469,500	
T D K	29,600	13,600.00	402,560,000	
帝国通信工業	3,300	1,161.00	3,831,300	
タムラ製作所	20,500	520.00	10,660,000	
アルプスアルパイン	54,200	1,370.00	74,254,000	
池上通信機	4,600	797.00	3,666,200	
鈴木	5,300	896.00	4,748,800	
日本トリム	1,000	3,965.00	3,965,000	
ローランド ディー. ジー.	3,600	1,580.00	5,688,000	

フォスター電機	6,400	1,121.00	7,174,400	
SMK	1,600	2,796.00	4,473,600	
ヨコオ	4,000	2,335.00	9,340,000	
ホシデン	16,700	837.00	13,977,900	
ヒロセ電機	9,400	14,420.00	135,548,000	
日本航空電子工業	14,000	1,459.00	20,426,000	
T O A	6,600	902.00	5,953,200	
マクセルホールディングス	13,200	1,139.00	15,034,800	
古野電気	7,900	1,134.00	8,958,600	
ユニデンホールディングス	1,900	2,305.00	4,379,500	
スミダコーポレーション	5,200	923.00	4,799,600	
アイコム	3,400	2,808.00	9,547,200	
リオン	2,600	2,890.00	7,514,000	
横河電機	56,200	1,833.00	103,014,600	
新電元工業	2,200	2,339.00	5,145,800	
アズビル	38,700	4,595.00	177,826,500	
日本光電工業	25,300	3,395.00	85,893,500	
共和電業	8,800	422.00	3,713,600	
日本電子材料	2,400	1,465.00	3,516,000	
堀場製作所	12,100	5,500.00	66,550,000	
アドバンテスト	45,500	7,000.00	318,500,000	
小野測器	7,300	528.00	3,854,400	
エスペック	5,400	1,752.00	9,460,800	
キーエンス	55,500	51,800.00	2,874,900,000	
日置電機	2,900	3,795.00	11,005,500	
システムズ	43,800	10,165.00	445,227,000	
日本マイクロニクス	10,700	978.00	10,464,600	
メガチップス	5,700	2,652.00	15,116,400	
O B A R A G R O U P	3,600	3,445.00	12,402,000	
I M A G I C A G R O U P	9,600	405.00	3,888,000	
澤藤電機	1,900	1,877.00	3,566,300	
デンソー	134,900	5,141.00	693,520,900	
原田工業	4,300	870.00	3,741,000	
コーチル	8,200	1,035.00	8,487,000	
イリソ電子工業	5,100	4,520.00	23,052,000	
オプテックスグループ	10,000	1,714.00	17,140,000	
千代田インテグレ	2,600	1,527.00	3,970,200	
レーザーテック	26,900	10,190.00	274,111,000	
スタンレー電気	42,900	3,010.00	129,129,000	
岩崎電気	2,700	1,341.00	3,620,700	
ウシオ電機	33,800	1,312.00	44,345,600	
岡谷電機産業	10,300	339.00	3,491,700	
エノモト	3,400	1,270.00	4,318,000	
日本セラミック	6,200	2,863.00	17,750,600	
遠藤照明	6,100	552.00	3,367,200	
古河電池	4,400	1,296.00	5,702,400	
双信電機	9,100	419.00	3,812,900	
山一電機	4,400	1,348.00	5,931,200	
図研	4,000	2,675.00	10,700,000	
日本電子	12,100	3,790.00	45,859,000	
カシオ計算機	54,200	2,005.00	108,671,000	
ファナック	57,600	24,520.00	1,412,352,000	
日本シイエムケイ	14,400	411.00	5,918,400	
エンプラス	3,100	2,663.00	8,255,300	
大真空	2,200	1,996.00	4,391,200	
ローム	25,500	8,750.00	223,125,000	

浜松ホトニクス	43,900	5,660.00	248,474,000	
三井ハイテック	6,800	2,486.00	16,904,800	
新光電気工業	20,600	1,959.00	40,355,400	
京セラ	86,200	5,964.00	514,096,800	
協栄産業	2,800	1,301.00	3,642,800	
太陽誘電	27,200	4,310.00	117,232,000	
村田製作所	179,900	8,282.00	1,489,931,800	
双葉電子工業	9,700	884.00	8,574,800	
日東电工	42,300	8,310.00	351,513,000	
北陸電気工業	3,800	930.00	3,534,000	
東海理化電機製作所	16,100	1,659.00	26,709,900	
ニチコン	20,800	1,030.00	21,424,000	
日本ケミコン	4,700	1,417.00	6,659,900	
K O A	9,200	1,381.00	12,705,200	
三井E & Sホールディングス	22,100	365.00	8,066,500	
日立造船	48,600	425.00	20,655,000	
三菱重工業	102,700	2,603.00	267,328,100	
川崎重工業	47,700	1,588.00	75,747,600	
I H I	44,100	1,524.00	67,208,400	
スプリックス	4,000	862.00	3,448,000	
マネジメントソリューションズ	2,900	1,425.00	4,132,500	
プロレド・パートナーズ	800	4,900.00	3,920,000	
カーブスホールディングス	16,100	699.00	11,253,900	
日本車輌製造	2,200	2,461.00	5,414,200	
三菱ロジスネクスト	8,100	1,002.00	8,116,200	
近畿車輛	2,800	1,294.00	3,623,200	
F P G	18,700	493.00	9,219,100	
島根銀行	6,100	648.00	3,952,800	
じもとホールディングス	4,100	1,029.00	4,218,900	
全国保証	17,000	4,745.00	80,665,000	
めぶきフィナンシャルグループ	313,900	226.00	70,941,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8,200	1,165.00	9,553,000	
九州フィナンシャルグループ	132,200	537.00	70,991,400	
かんぽ生命保険	21,400	1,800.00	38,520,000	
ゆうちょ銀行	171,200	904.00	154,764,800	
富山第一銀行	14,400	294.00	4,233,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	345,100	388.00	133,898,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	40,200	717.00	28,823,400	
イントラスト	4,000	847.00	3,388,000	
日本モーゲージサービス	3,600	1,153.00	4,150,800	
アルヒ	9,600	2,155.00	20,688,000	
プレミアグループ	3,300	2,121.00	6,999,300	
日産自動車	722,500	485.80	350,990,500	
いすゞ自動車	177,500	1,003.00	178,032,500	
トヨタ自動車	683,500	7,352.00	5,025,092,000	
日野自動車	76,500	928.00	70,992,000	
三菱自動車工業	226,700	193.00	43,753,100	
エフテック	7,100	580.00	4,118,000	
武藏精密工業	13,600	1,432.00	19,475,200	
日産車体	12,000	919.00	11,028,000	
新明和工業	16,500	874.00	14,421,000	
極東開発工業	11,400	1,399.00	15,948,600	
トピー工業	5,000	1,086.00	5,430,000	
ティラド	3,000	1,357.00	4,071,000	

曙ブレーキ工業	33,600	140.00	4,704,000	
タチエス	10,100	1,158.00	11,695,800	
NOK	32,900	1,211.00	39,841,900	
フタバ産業	17,000	503.00	8,551,000	
K Y B	6,900	2,559.00	17,657,100	
市光工業	9,200	530.00	4,876,000	
大同メタル工業	11,700	500.00	5,850,000	
プレス工業	30,400	307.00	9,332,800	
ミクニ	13,900	281.00	3,905,900	
太平洋工業	12,800	1,060.00	13,568,000	
河西工業	10,200	361.00	3,682,200	
アイシン精機	50,400	3,190.00	160,776,000	
マツダ	180,200	636.00	114,607,200	
今仙電機製作所	6,100	862.00	5,258,200	
本田技研工業	482,300	2,977.00	1,435,807,100	
スズキ	121,400	5,445.00	661,023,000	
S U B A R U	190,200	2,156.50	410,166,300	
安永	1,100	1,105.00	1,215,500	
ヤマハ発動機	86,600	1,965.00	170,169,000	
小糸製作所	36,700	6,560.00	240,752,000	
T B K	8,700	461.00	4,010,700	
エクセディ	8,300	1,289.00	10,698,700	
ミツバ	11,300	479.00	5,412,700	
豊田合成	19,800	2,861.00	56,647,800	
愛三工業	9,600	479.00	4,598,400	
ヨロズ	5,700	1,225.00	6,982,500	
エフ・シー・シー	10,000	2,087.00	20,870,000	
シマノ	22,900	23,445.00	536,890,500	
ティ・エス テック	14,200	3,175.00	45,085,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	35,500	541.00	19,205,500	
三十三フィナンシャルグループ	5,600	1,361.00	7,621,600	
第四北越フィナンシャルグループ	10,500	2,132.00	22,386,000	
ひろぎんホールディングス	89,100	589.00	52,479,900	
ジャムコ	6,100	680.00	4,148,000	
小野建	5,400	1,239.00	6,690,600	
ノジマ	10,700	2,980.00	31,886,000	
佐鳥電機	4,700	828.00	3,891,600	
カッパ・クリエイト	8,500	1,431.00	12,163,500	
伯東	3,700	1,067.00	3,947,900	
コンドーテック	4,700	1,039.00	4,883,300	
中山福	7,500	517.00	3,877,500	
ライトオン	5,800	644.00	3,735,200	
ナガイレーベン	8,000	2,679.00	21,432,000	
三菱食品	6,600	2,775.00	18,315,000	
良品計画	80,100	2,271.00	181,907,100	
松田産業	4,400	1,636.00	7,198,400	
第一興商	9,000	3,535.00	31,815,000	
メディパルホールディングス	65,100	1,994.00	129,809,400	
アドヴァン	9,200	1,342.00	12,346,400	
S P K	3,000	1,294.00	3,882,000	
萩原電気ホールディングス	2,200	2,463.00	5,418,600	
アルビス	2,300	2,486.00	5,717,800	
アズワン	3,900	15,000.00	58,500,000	
スズデン	3,200	1,199.00	3,836,800	
シモジマ	3,700	1,414.00	5,231,800	
ドウシシャ	5,700	1,940.00	11,058,000	

小津産業	2,000	1,854.00	3,708,000	
コナカ	14,800	244.00	3,611,200	
高速	3,600	1,534.00	5,522,400	
G-7ホールディングス	3,600	2,283.00	8,218,800	
イオン北海道	8,000	916.00	7,328,000	
コジマ	10,400	711.00	7,394,400	
ヒマラヤ	4,400	919.00	4,043,600	
コーナン商事	8,600	3,310.00	28,466,000	
ネットワンシステムズ	22,900	3,600.00	82,440,000	
エコス	2,200	2,298.00	5,055,600	
ワタミ	7,100	971.00	6,894,100	
マルシェ	6,800	524.00	3,563,200	
システムソフト	38,200	92.00	3,514,400	
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	132,600	2,459.00	326,063,400	
丸文	7,400	483.00	3,574,200	
西松屋チェーン	13,200	1,795.00	23,694,000	
ゼンショーホールディングス	28,900	2,734.00	79,012,600	
ハピネット	5,000	1,473.00	7,365,000	
幸楽苑ホールディングス	3,800	1,819.00	6,912,200	
橋本総業ホールディングス	1,600	2,383.00	3,812,800	
日本ライフライン	17,900	1,389.00	24,863,100	
サイゼリヤ	8,900	1,834.00	16,322,600	
VTホールディングス	25,000	372.00	9,300,000	
マルカ	2,000	2,188.00	4,376,000	
アルゴグラフィックス	5,100	3,265.00	16,651,500	
I DOM	16,300	616.00	10,040,800	
日本エム・ディ・エム	3,500	2,154.00	7,539,000	
ユナイテッドアローズ	6,400	1,447.00	9,260,800	
進和	3,600	2,014.00	7,250,400	
ダイトロン	2,500	1,397.00	3,492,500	
ハイデイ日高	8,700	1,722.00	14,981,400	
シークス	7,700	1,600.00	12,320,000	
京都きもの友禅	15,600	229.00	3,572,400	
コロワイド	20,000	1,517.00	30,340,000	
ピーシーデポコーポレーション	8,000	610.00	4,880,000	
田中商事	5,300	705.00	3,736,500	
オーハシテクニカ	3,100	1,390.00	4,309,000	
壱番屋	4,300	5,320.00	22,876,000	
白銅	2,800	1,377.00	3,855,600	
スギホールディングス	12,000	6,910.00	82,920,000	
ダイコー通産	2,700	1,416.00	3,823,200	
薬王堂ホールディングス	2,600	2,522.00	6,557,200	
島津製作所	73,200	3,555.00	260,226,000	
J M S	5,200	1,021.00	5,309,200	
長野計器	1,900	788.00	1,497,200	
ブイ・テクノロジー	2,900	5,350.00	15,515,000	
スター精密	9,400	1,504.00	14,137,600	
東京計器	4,200	924.00	3,880,800	
愛知時計電機	800	4,390.00	3,512,000	
インターアクション	3,300	1,729.00	5,705,700	
オーパル	16,600	232.00	3,851,200	
東京精密	11,100	4,350.00	48,285,000	
マニー	24,400	2,530.00	61,732,000	
ニコン	93,500	692.00	64,702,000	
トプコン	30,900	1,353.00	41,807,700	

オリンパス	338,900	2,066.50	700,336,850	
理研計器	5,400	2,937.00	15,859,800	
S C R E E N ホールディングス	10,600	6,270.00	66,462,000	
キヤノン電子	5,600	1,442.00	8,075,200	
タムロン	4,900	1,633.00	8,001,700	
HOYA	121,500	12,545.00	1,524,217,500	
ノーリツ鋼機	4,100	2,242.00	9,192,200	
エー・アンド・デイ	5,800	869.00	5,040,200	
朝日インテック	69,400	3,275.00	227,285,000	
キヤノン	304,400	1,909.00	581,099,600	
リコー	155,800	670.00	104,386,000	
シチズン時計	71,700	284.00	20,362,800	
リズム	6,000	638.00	3,828,000	
大研医器	7,000	517.00	3,619,000	
メニコン	8,700	6,930.00	60,291,000	
スノーピーク	3,600	1,608.00	5,788,800	
パラマウントベッドホールディングス	6,500	4,435.00	28,827,500	
トランザクション	4,000	959.00	3,836,000	
粧美堂	10,400	386.00	4,014,400	
ニホンフラッシュ	5,700	1,298.00	7,398,600	
前田工織	6,700	2,812.00	18,840,400	
永大産業	5,800	290.00	1,682,000	
アートネイチャー	6,500	664.00	4,316,000	
バンダイナムコホールディングス	63,300	9,094.00	575,650,200	
共立印刷	28,700	123.00	3,530,100	
S H O E I	5,400	3,500.00	18,900,000	
フランスベッドホールディングス	8,700	880.00	7,656,000	
マーべラス	9,200	835.00	7,682,000	
パイロットコーポレーション	10,800	3,100.00	33,480,000	
萩原工業	3,400	1,618.00	5,501,200	
エイベックス	10,300	1,011.00	10,413,300	
トップパン・フォームズ	13,100	1,005.00	13,165,500	
フジシールインターナショナル	13,700	2,026.00	27,756,200	
タカラトミー	27,500	941.00	25,877,500	
廣済堂	6,100	659.00	4,019,900	
レック	6,500	1,497.00	9,730,500	
三光合成	13,000	290.00	3,770,000	
プロネクサス	5,300	1,107.00	5,867,100	
ホクシン	31,700	115.00	3,645,500	
大建工業	4,100	1,926.00	7,896,600	
凸版印刷	86,500	1,500.00	129,750,000	
大日本印刷	80,200	2,021.00	162,084,200	
共同印刷	1,900	2,920.00	5,548,000	
N I S S H A	12,600	1,327.00	16,720,200	
藤森工業	5,500	4,330.00	23,815,000	
T A K A R A & C O M P A N Y	3,000	2,041.00	6,123,000	
前澤化成工業	3,900	994.00	3,876,600	
未来工業	3,300	1,874.00	6,184,200	
アシックス	54,200	1,772.00	96,042,400	
ツツミ	1,900	2,185.00	4,151,500	
ウェーブロックホールディングス	5,100	729.00	3,717,900	
J S P	3,600	1,518.00	5,464,800	
ニチハ	8,500	3,185.00	27,072,500	
エフピコ	12,900	4,245.00	54,760,500	
小松ウオール工業	2,200	1,722.00	3,788,400	

ヤマハ	36,400	5,650.00	205,660,000	
河合楽器製作所	1,900	2,592.00	4,924,800	
ビジョン	39,300	4,650.00	182,745,000	
天馬	4,100	1,929.00	7,908,900	
オリバー	1,500	2,431.00	3,646,500	
キングジム	5,100	911.00	4,646,100	
象印マホービン	16,600	1,951.00	32,386,600	
リンテック	14,600	2,169.00	31,667,400	
信越ポリマー	11,000	938.00	10,318,000	
東リ	15,300	267.00	4,085,100	
イトーキ	12,200	334.00	4,074,800	
任天堂	37,600	54,550.00	2,051,080,000	
三菱鉛筆	10,100	1,447.00	14,614,700	
松風	2,800	1,657.00	4,639,600	
タカラスタンダード	12,700	1,429.00	18,148,300	
コクヨ	29,400	1,433.00	42,130,200	
ナカバヤシ	6,000	612.00	3,672,000	
ニフコ	22,500	3,640.00	81,900,000	
立川ブラインド工業	2,900	1,235.00	3,581,500	
グローブライド	2,700	3,980.00	10,746,000	
オカムラ	21,400	950.00	20,330,000	
バルカー	5,000	1,872.00	9,360,000	
MUTOHホールディングス	2,500	1,478.00	3,695,000	
伊藤忠商事	422,000	2,764.50	1,166,619,000	
丸紅	628,000	608.50	382,138,000	
スクロール	9,300	701.00	6,519,300	
高島	2,000	1,668.00	3,336,000	
ヨンドシーホールディングス	6,100	1,922.00	11,724,200	
三陽商会	7,200	536.00	3,859,200	
長瀬産業	33,900	1,406.00	47,663,400	
蝶理	3,800	1,542.00	5,859,600	
豊田通商	67,300	3,415.00	229,829,500	
オンワードホールディングス	36,000	203.00	7,308,000	
三共生興	9,100	422.00	3,840,200	
兼松	22,500	1,256.00	28,260,000	
美津濃	5,600	1,867.00	10,455,200	
三井物産	522,400	1,842.50	962,522,000	
日本紙パルプ商事	3,400	3,785.00	12,869,000	
東京エレクトロン	38,900	32,140.00	1,250,246,000	
カメイ	7,900	1,175.00	9,282,500	
東都水産	900	4,545.00	4,090,500	
OUGホールディングス	1,300	2,860.00	3,718,000	
スターゼン	2,200	4,375.00	9,625,000	
セイコーホールディングス	8,700	1,423.00	12,380,100	
山善	23,600	1,001.00	23,623,600	
椿本興業	1,100	3,430.00	3,773,000	
住友商事	380,700	1,325.00	504,427,500	
日本ユニシス	18,800	3,575.00	67,210,000	
内田洋行	2,400	5,250.00	12,600,000	
三菱商事	395,600	2,509.50	992,758,200	
第一実業	3,000	3,810.00	11,430,000	
キヤノンマーケティングジャパン	15,000	2,219.00	33,285,000	
西華産業	3,400	1,266.00	4,304,400	
佐藤商事	5,000	1,000.00	5,000,000	
菱洋エレクトロ	6,100	2,942.00	17,946,200	
東京産業	6,900	591.00	4,077,900	

ユアサ商事	5,700	3,055.00	17,413,500	
神鋼商事	2,100	1,827.00	3,836,700	
阪和興業	11,300	2,455.00	27,741,500	
正栄食品工業	3,900	3,820.00	14,898,000	
カナデン	4,900	1,296.00	6,350,400	
菱電商事	4,300	1,520.00	6,536,000	
ニプロ	42,400	1,160.00	49,184,000	
フルサト工業	3,300	1,251.00	4,128,300	
岩谷産業	14,100	5,170.00	72,897,000	
昭光通商	6,100	597.00	3,641,700	
イワキ	7,900	527.00	4,163,300	
兼松エレクトロニクス	3,300	4,180.00	13,794,000	
三愛石油	14,900	1,157.00	17,239,300	
稻畑産業	13,300	1,381.00	18,367,300	
明和産業	9,000	397.00	3,573,000	
ヤマエ久野	4,400	1,255.00	5,522,000	
ゴールドワイン	10,800	6,680.00	72,144,000	
ユニ・チャーム	129,900	5,097.00	662,100,300	
デサント	11,700	1,818.00	21,270,600	
ワキタ	12,900	1,150.00	14,835,000	
ヤマトイインターナショナル	11,200	336.00	3,763,200	
東邦ホールディングス	19,400	2,009.00	38,974,600	
サンゲツ	16,300	1,526.00	24,873,800	
ミツウロコグループホールディングス	8,900	1,247.00	11,098,300	
シナネンホールディングス	2,500	2,960.00	7,400,000	
伊藤忠エネクス	13,300	964.00	12,821,200	
サンリオ	16,900	1,635.00	27,631,500	
サンワ テクノス	4,300	877.00	3,771,100	
リヨーサン	6,700	1,937.00	12,977,900	
新光商事	9,000	818.00	7,362,000	
トーホー	2,700	2,041.00	5,510,700	
三信電気	3,200	2,053.00	6,569,600	
東陽テクニカ	6,400	1,092.00	6,988,800	
モスフードサービス	7,900	2,803.00	22,143,700	
加賀電子	6,000	2,054.00	12,324,000	
三益半導体工業	4,700	2,524.00	11,862,800	
都築電気	2,300	1,521.00	3,498,300	
ソーダニッカ	6,600	550.00	3,630,000	
立花エレテック	4,500	1,706.00	7,677,000	
木曽路	7,900	2,430.00	19,197,000	
S R S ホールディングス	7,100	904.00	6,418,400	
千趣会	10,900	316.00	3,444,400	
リテールパートナーズ	8,000	1,521.00	12,168,000	
ケーヨー	12,400	754.00	9,349,600	
上新電機	7,100	2,561.00	18,183,100	
日本瓦斯	9,500	5,560.00	52,820,000	
ロイヤルホールディングス	10,500	1,859.00	19,519,500	
東天紅	3,800	950.00	3,610,000	
いなげや	7,500	1,984.00	14,880,000	
島忠	11,300	5,490.00	62,037,000	
チヨダ	6,300	940.00	5,922,000	
ライフコーポレーション	4,600	3,430.00	15,778,000	
リンガーハット	7,400	2,281.00	16,879,400	
M r M a x HD	8,300	817.00	6,781,100	
テンアライド	10,600	358.00	3,794,800	

AOKI ホールディングス	12,100	461.00	5,578,100	
オーカワ	9,500	1,403.00	13,328,500	
コメリ	9,300	2,938.00	27,323,400	
青山商事	12,500	498.00	6,225,000	
しまむら	7,100	11,060.00	78,526,000	
はせがわ	12,900	286.00	3,689,400	
高島屋	43,900	866.00	38,017,400	
松屋	12,200	726.00	8,857,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	28,600	683.00	19,533,800	
近鉄百貨店	2,300	3,330.00	7,659,000	
丸井グループ	55,300	1,938.00	107,171,400	
クレディセゾン	42,300	1,163.00	49,194,900	
アクシアル リテイリング	5,000	4,685.00	23,425,000	
イオン	232,200	3,045.00	707,049,000	
イズミ	12,300	3,560.00	43,788,000	
フォーバル	3,700	909.00	3,363,300	
平和堂	12,200	2,117.00	25,827,400	
フジ	7,300	1,965.00	14,344,500	
ヤオコー	6,800	7,130.00	48,484,000	
ゼビオホールディングス	7,300	822.00	6,000,600	
ケーズホールディングス	58,200	1,302.00	75,776,400	
PALTAC	9,700	5,940.00	57,618,000	
三谷産業	8,600	421.00	3,620,600	
新生銀行	44,400	1,308.00	58,075,200	
あおぞら銀行	36,000	1,850.00	66,600,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,133,000	464.10	1,918,125,300	
りそなホールディングス	656,900	383.20	251,724,080	
三井住友トラスト・ホールディングス	114,300	3,205.00	366,331,500	
三井住友フィナンシャルグループ	417,900	3,153.00	1,317,638,700	
千葉銀行	201,600	615.00	123,984,000	
群馬銀行	116,100	352.00	40,867,200	
武蔵野銀行	9,100	1,642.00	14,942,200	
千葉興業銀行	16,600	276.00	4,581,600	
筑波銀行	25,100	203.00	5,095,300	
七十七銀行	20,500	1,560.00	31,980,000	
青森銀行	4,700	2,497.00	11,735,900	
秋田銀行	3,900	1,450.00	5,655,000	
山形銀行	6,800	1,313.00	8,928,400	
岩手銀行	4,000	2,424.00	9,696,000	
東邦銀行	54,000	242.00	13,068,000	
みちのく銀行	3,900	1,239.00	4,832,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	50,900	1,915.00	97,473,500	
静岡銀行	147,100	783.00	115,179,300	
十六銀行	7,600	2,116.00	16,081,600	
スルガ銀行	61,800	358.00	22,124,400	
八十二銀行	145,800	398.00	58,028,400	
山梨中央銀行	7,000	791.00	5,537,000	
大垣共立銀行	12,000	2,509.00	30,108,000	
福井銀行	5,200	1,980.00	10,296,000	
北國銀行	6,100	2,945.00	17,964,500	
清水銀行	2,500	1,810.00	4,525,000	
富山銀行	1,300	3,325.00	4,322,500	
滋賀銀行	12,200	2,440.00	29,768,000	
南都銀行	10,100	1,944.00	19,634,400	
百五銀行	54,400	340.00	18,496,000	

京都銀行	21,700	5,250.00	113,925,000	
紀陽銀行	21,400	1,671.00	35,759,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	40,300	1,096.00	44,168,800	
山陰合同銀行	35,800	575.00	20,585,000	
中国銀行	52,000	951.00	49,452,000	
鳥取銀行	3,400	1,180.00	4,012,000	
伊予銀行	86,200	714.00	61,546,800	
百十四銀行	6,500	1,691.00	10,991,500	
四国銀行	9,200	756.00	6,955,200	
阿波銀行	9,900	2,716.00	26,888,400	
大分銀行	3,500	2,429.00	8,501,500	
宮崎銀行	4,100	2,458.00	10,077,800	
佐賀銀行	3,700	1,377.00	5,094,900	
沖縄銀行	5,600	3,165.00	17,724,000	
琉球銀行	13,900	897.00	12,468,300	
セブン銀行	201,900	230.00	46,437,000	
みずほフィナンシャルグループ	821,000	1,414.50	1,161,304,500	
山口フィナンシャルグループ	75,400	725.00	54,665,000	
芙蓉総合リース	6,300	6,340.00	39,942,000	
みずほリース	9,300	2,722.00	25,314,600	
東京センチュリー	12,200	6,480.00	79,056,000	
S B I ホールディングス	69,400	2,643.00	183,424,200	
日本証券金融	26,700	502.00	13,403,400	
アイフル	92,200	264.00	24,340,800	
長野銀行	2,700	1,436.00	3,877,200	
名古屋銀行	4,600	2,894.00	13,312,400	
北洋銀行	91,100	246.00	22,410,600	
愛知銀行	2,200	3,100.00	6,820,000	
中京銀行	2,500	2,186.00	5,465,000	
大光銀行	3,000	1,329.00	3,987,000	
愛媛銀行	8,500	1,137.00	9,664,500	
京葉銀行	25,800	481.00	12,409,800	
栃木銀行	29,200	188.00	5,489,600	
北日本銀行	1,900	2,001.00	3,801,900	
東和銀行	10,600	690.00	7,314,000	
リコーリース	4,800	2,941.00	14,116,800	
イオンフィナンシャルサービス	37,000	1,171.00	43,327,000	
アコム	121,400	501.00	60,821,400	
ジャックス	6,700	1,801.00	12,066,700	
オリエントコーポレーション	163,500	119.00	19,456,500	
日立キャピタル	14,200	2,375.00	33,725,000	
オリックス	374,800	1,525.00	571,570,000	
三菱UFJリース	153,300	478.00	73,277,400	
ジャフコ グループ	9,300	4,550.00	42,315,000	
九州リースサービス	6,100	604.00	3,684,400	
トモニホールディングス	46,700	343.00	16,018,100	
大和証券グループ本社	484,800	472.40	229,019,520	
野村ホールディングス	1,063,100	509.00	541,117,900	
岡三証券グループ	51,500	364.00	18,746,000	
丸三証券	18,000	493.00	8,874,000	
東洋証券	30,600	128.00	3,916,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	69,400	293.00	20,334,200	
光世証券	5,300	676.00	3,582,800	
水戸証券	17,500	232.00	4,060,000	
いちよし証券	11,300	446.00	5,039,800	

松井証券	34,600	864.00	29,894,400	
S O M P O ホールディングス	113,600	4,007.00	455,195,200	
日本取引所グループ	173,400	2,410.50	417,980,700	
マネックスグループ	44,300	324.00	14,353,200	
極東証券	8,200	717.00	5,879,400	
岩井コスモホールディングス	5,800	1,276.00	7,400,800	
藍澤證券	10,900	704.00	7,673,600	
フィデアホールディングス	58,700	110.00	6,457,000	
池田泉州ホールディングス	69,500	162.00	11,259,000	
アニコム ホールディングス	20,100	1,041.00	20,924,100	
MS & AD インシュアラ NS グループ ホールディングス	158,000	3,169.00	500,702,000	
スパークス・グループ	27,900	237.00	6,612,300	
第一生命ホールディングス	341,900	1,643.50	561,912,650	
東京海上ホールディングス	213,600	5,453.00	1,164,760,800	
イー・ギャランティ	6,900	2,014.00	13,896,600	
アサックス	5,100	710.00	3,621,000	
NEC キャピタルソリューション	2,500	1,833.00	4,582,500	
T & D ホールディングス	180,600	1,223.00	220,873,800	
アドバンスクリエイト	1,200	1,876.00	2,251,200	
三井不動産	293,700	2,178.50	639,825,450	
三菱地所	423,300	1,796.00	760,246,800	
平和不動産	11,100	3,100.00	34,410,000	
東京建物	59,700	1,333.00	79,580,100	
ダイビル	15,600	1,260.00	19,656,000	
京阪神ビルディング	9,700	2,080.00	20,176,000	
住友不動産	135,800	3,378.00	458,732,400	
テーオーシー	11,900	626.00	7,449,400	
東京楽天地	1,000	4,195.00	4,195,000	
レオパレス 2 1	79,100	158.00	12,497,800	
スタートコーポレーション	8,200	2,748.00	22,533,600	
フジ住宅	7,000	615.00	4,305,000	
空港施設	8,200	467.00	3,829,400	
ゴールドクレスト	4,800	1,411.00	6,772,800	
リログループ	32,000	2,781.00	88,992,000	
エスリード	2,800	1,348.00	3,774,400	
日神グループホールディングス	9,100	400.00	3,640,000	
日本エスコン	10,900	884.00	9,635,600	
タカラレーベン	27,600	295.00	8,142,000	
AVANTIA	4,200	866.00	3,637,200	
イオンモール	30,300	1,716.00	51,994,800	
毎日コムネット	5,200	717.00	3,728,400	
ファースト住建	3,700	1,017.00	3,762,900	
カチタス	15,000	3,065.00	45,975,000	
東祥	3,600	1,327.00	4,777,200	
トーセイ	8,300	1,092.00	9,063,600	
穴吹興産	2,300	1,620.00	3,726,000	
サンフロンティア不動産	8,300	934.00	7,752,200	
エフ・ジェー・ネクスト	5,300	992.00	5,257,600	
グランディハウス	10,200	376.00	3,835,200	
東武鉄道	63,800	3,445.00	219,791,000	
相鉄ホールディングス	19,600	2,724.00	53,390,400	
東急	154,500	1,371.00	211,819,500	
京浜急行電鉄	78,700	1,807.00	142,210,900	
小田急電鉄	91,100	3,150.00	286,965,000	
京王電鉄	31,800	7,730.00	245,814,000	

京成電鉄	42,600	3,670.00	156,342,000	
富士急行	8,400	5,040.00	42,336,000	
新京成電鉄	500	2,207.00	1,103,500	
東日本旅客鉄道	107,800	6,505.00	701,239,000	
西日本旅客鉄道	54,600	5,070.00	276,822,000	
東海旅客鉄道	50,900	14,355.00	730,669,500	
西武ホールディングス	80,000	1,148.00	91,840,000	
鴻池運輸	9,700	1,063.00	10,311,100	
西日本鉄道	17,000	3,155.00	53,635,000	
ハマキヨウレックス	4,700	3,035.00	14,264,500	
サカイ引越センター	3,200	5,140.00	16,448,000	
近鉄グループホールディングス	58,000	4,735.00	274,630,000	
阪急阪神ホールディングス	77,400	3,680.00	284,832,000	
南海電気鉄道	27,500	2,815.00	77,412,500	
京阪ホールディングス	25,800	4,645.00	119,841,000	
神戸電鉄	1,400	3,620.00	5,068,000	
名古屋鉄道	47,700	3,070.00	146,439,000	
山陽電気鉄道	4,100	2,102.00	8,618,200	
トランコム	1,600	8,350.00	13,360,000	
日本通運	20,100	7,120.00	143,112,000	
ヤマトホールディングス	101,700	2,659.00	270,420,300	
山九	16,100	4,095.00	65,929,500	
日新	5,000	1,309.00	6,545,000	
丸全昭和運輸	4,700	3,235.00	15,204,500	
センコーホールディングス	32,000	1,010.00	32,320,000	
トナミホールディングス	1,400	5,980.00	8,372,000	
ニッコンホールディングス	20,800	2,052.00	42,681,600	
日本石油輸送	1,400	2,602.00	3,642,800	
福山通運	7,400	4,910.00	36,334,000	
セイノーホールディングス	43,400	1,581.00	68,615,400	
エスライン	3,800	928.00	3,526,400	
神奈川中央交通	1,400	3,925.00	5,495,000	
日立物流	10,600	3,255.00	34,503,000	
丸和運輸機関	6,100	4,305.00	26,260,500	
C & F ロジホールディングス	5,900	1,827.00	10,779,300	
日本郵船	48,600	2,120.00	103,032,000	
商船三井	36,800	2,605.00	95,864,000	
川崎汽船	17,900	1,567.00	28,049,300	
N S ユナイテッド海運	3,200	1,339.00	4,284,800	
飯野海運	27,500	389.00	10,697,500	
九州旅客鉄道	50,900	2,338.00	119,004,200	
S G ホールディングス	121,800	2,723.00	331,661,400	
日本航空	102,600	1,916.00	196,581,600	
ANAホールディングス	106,000	2,532.00	268,392,000	
パスク	1,200	1,295.00	1,554,000	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	2,000	2,110.00	4,220,000	
Genky Drug Stores	2,600	4,060.00	10,556,000	
国際紙パルプ商事	14,300	255.00	3,646,500	
ブックオフグループホールディングス	4,400	864.00	3,801,600	
三菱倉庫	18,400	3,045.00	56,028,000	
三井倉庫ホールディングス	6,600	2,033.00	13,417,800	
住友倉庫	20,900	1,397.00	29,197,300	
澁澤倉庫	3,200	2,197.00	7,030,400	
ヤマタネ	3,000	1,354.00	4,062,000	
東陽倉庫	11,200	331.00	3,707,200	

乾汽船	4,000	948.00	3,792,000	
日本トランシスティ	12,800	568.00	7,270,400	
ケイヒン	2,700	1,385.00	3,739,500	
中央倉庫	3,500	1,192.00	4,172,000	
安田倉庫	4,800	993.00	4,766,400	
東洋埠頭	2,600	1,459.00	3,793,400	
宇徳	7,500	480.00	3,600,000	
上組	32,400	1,902.00	61,624,800	
キユーソー流通システム	900	1,768.00	1,591,200	
近鉄エクスプレス	12,300	2,216.00	27,256,800	
東海運	12,000	307.00	3,684,000	
エーアイティー	4,100	1,034.00	4,239,400	
内外トランスライン	3,000	1,222.00	3,666,000	
T B S ホールディングス	36,600	1,795.00	65,697,000	
日本テレビホールディングス	50,200	1,157.00	58,081,400	
朝日放送グループホールディングス	6,000	715.00	4,290,000	
テレビ朝日ホールディングス	16,500	1,731.00	28,561,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	39,500	490.00	19,355,000	
テレビ東京ホールディングス	4,900	2,451.00	12,009,900	
日本B S 放送	3,500	1,077.00	3,769,500	
ビジョン	7,500	1,071.00	8,032,500	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	2,700	1,415.00	3,820,500	
コネクシオ	3,400	1,226.00	4,168,400	
日本通信	46,900	205.00	9,614,500	
日本電信電話	803,500	2,491.50	2,001,920,250	
K D D I	438,200	3,042.00	1,333,004,400	
ソフトバンク	546,300	1,279.00	698,717,700	
光通信	6,200	23,970.00	148,614,000	
ＮＴＴ ドコモ	429,800	3,876.00	1,665,904,800	
エムティーアイ	5,800	807.00	4,680,600	
G M O インターネット	21,500	2,720.00	58,480,000	
ファイバーゲート	2,000	2,284.00	4,568,000	
アイドママークティングコミュニケーション	9,000	375.00	3,375,000	
K A D O K A W A	16,200	3,155.00	51,111,000	
学研ホールディングス	8,100	1,521.00	12,320,100	
ゼンリン	12,000	1,320.00	15,840,000	
インプレスホールディングス	19,500	167.00	3,256,500	
東京電力ホールディングス	489,000	289.00	141,321,000	
中部電力	187,400	1,305.50	244,650,700	
関西電力	232,100	995.40	231,032,340	
中国電力	88,400	1,400.00	123,760,000	
北陸電力	56,000	789.00	44,184,000	
東北電力	153,000	946.00	144,738,000	
四国電力	55,200	782.00	43,166,400	
九州電力	126,300	946.00	119,479,800	
北海道電力	57,300	412.00	23,607,600	
沖縄電力	11,900	1,568.00	18,659,200	
電源開発	48,700	1,463.00	71,248,100	
エフオン	3,400	1,113.00	3,784,200	
イーレックス	8,700	1,694.00	14,737,800	
レノバ	10,300	2,378.00	24,493,400	
東京瓦斯	117,800	2,567.50	302,451,500	
大阪瓦斯	118,900	2,199.00	261,461,100	
東邦瓦斯	30,100	6,880.00	207,088,000	
北海道瓦斯	3,300	1,560.00	5,148,000	

広島ガス	12,600	374.00	4,712,400	
西部瓦斯	6,900	3,155.00	21,769,500	
静岡ガス	17,400	990.00	17,226,000	
メタウォーター	5,900	2,497.00	14,732,300	
アイネット	3,100	1,510.00	4,681,000	
松竹	4,000	13,200.00	52,800,000	
東宝	35,500	4,565.00	162,057,500	
エイチ・アイ・エス	9,100	1,614.00	14,687,400	
東映	2,200	17,040.00	37,488,000	
ラックランド	1,700	2,314.00	3,933,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	160,000	1,380.00	220,800,000	
共立メンテナンス	9,700	3,560.00	34,532,000	
イチネンホールディングス	6,600	1,284.00	8,474,400	
建設技術研究所	3,800	2,090.00	7,942,000	
スペース	4,800	826.00	3,964,800	
AINホールディングス	7,400	7,250.00	53,650,000	
燐ホールディングス	3,100	1,190.00	3,689,000	
ピー・シー・エー	1,000	4,430.00	4,430,000	
東京アトラル	3,000	1,335.00	4,005,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	1,484.00	3,413,200	
ナガワ	1,900	9,110.00	17,309,000	
よみうりランド	1,300	6,050.00	7,865,000	
東京都競馬	3,800	5,200.00	19,760,000	
カナモト	10,300	2,298.00	23,669,400	
東京ドーム	23,700	910.00	21,567,000	
D T S	13,400	2,169.00	29,064,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	25,600	5,360.00	137,216,000	
シーイーシー	6,400	1,512.00	9,676,800	
カプコン	28,300	5,370.00	151,971,000	
西尾レントオール	5,400	2,133.00	11,518,200	
アイ・エス・ピー	1,400	2,573.00	3,602,200	
日本空港ビルディング	19,300	5,840.00	112,712,000	
トランス・コスマス	5,600	2,776.00	15,545,600	
乃村工藝社	25,100	766.00	19,226,600	
ジャステック	3,800	1,529.00	5,810,200	
S C S K	13,900	5,680.00	78,952,000	
K N T - C T ホールディングス	3,600	856.00	3,081,600	
日本管財	6,300	2,073.00	13,059,900	
トーカイ	5,700	2,045.00	11,656,500	
セコム	62,200	10,165.00	632,263,000	
日本システムウエア	2,000	2,088.00	4,176,000	
セントラル警備保障	2,800	3,485.00	9,758,000	
アイネス	5,900	1,439.00	8,490,100	
丹青社	11,100	758.00	8,413,800	
メイテック	7,200	5,150.00	37,080,000	
T K C	5,100	6,620.00	33,762,000	
富士ソフト	6,400	5,090.00	32,576,000	
応用地質	6,800	1,268.00	8,622,400	
船井総研ホールディングス	12,100	2,493.00	30,165,300	
N S D	19,300	1,965.00	37,924,500	
進学会ホールディングス	8,400	429.00	3,603,600	
丸紅建材リース	2,200	1,727.00	3,799,400	
コナミホールディングス	21,800	5,190.00	113,142,000	
学究社	3,500	1,200.00	4,200,000	
ベネッセホールディングス	19,500	2,308.00	45,006,000	

イオンディライト	7,200	2,652.00	19,094,400	
ナック	4,100	934.00	3,829,400	
福井コンピュータホールディングス	2,400	3,380.00	8,112,000	
ダイセキ	9,800	3,030.00	29,694,000	
ステップ	2,500	1,602.00	4,005,000	
日鉄物産	4,300	3,315.00	14,254,500	
泉州電業	1,700	2,901.00	4,931,700	
元気寿司	1,600	2,334.00	3,734,400	
トラスコ中山	13,800	2,747.00	37,908,600	
ヤマダホールディングス	183,800	493.00	90,613,400	
オートバックスセブン	22,400	1,335.00	29,904,000	
モリト	5,400	640.00	3,456,000	
アークランドサカモト	9,400	1,811.00	17,023,400	
ニトリホールディングス	26,100	21,085.00	550,318,500	
グルメ杵屋	4,300	1,010.00	4,343,000	
愛眼	16,400	227.00	3,722,800	
吉野家ホールディングス	19,800	1,948.00	38,570,400	
加藤産業	8,700	3,575.00	31,102,500	
イノテック	3,800	892.00	3,389,600	
イエローハット	11,400	1,621.00	18,479,400	
松屋フーズホールディングス	2,900	3,455.00	10,019,500	
J B C C ホールディングス	4,100	1,462.00	5,994,200	
J K ホールディングス	5,500	824.00	4,532,000	
サガミホールディングス	8,100	1,267.00	10,262,700	
日伝	5,500	2,375.00	13,062,500	
関西スーパー マーケット	5,000	1,239.00	6,195,000	
ミロク情報サービス	5,300	2,063.00	10,933,900	
北沢産業	12,700	276.00	3,505,200	
杉本商事	3,300	2,279.00	7,520,700	
因幡電機産業	17,200	2,501.00	43,017,200	
王将フードサービス	4,400	5,960.00	26,224,000	
プレナス	6,800	1,715.00	11,662,000	
ミニストップ	4,500	1,402.00	6,309,000	
アーツ	12,300	2,232.00	27,453,600	
バローホールディングス	13,300	2,581.00	34,327,300	
東テク	2,000	2,529.00	5,058,000	
ミスミグループ本社	75,600	3,255.00	246,078,000	
ベルク	3,000	6,270.00	18,810,000	
大 庄	3,300	1,024.00	3,379,200	
タキヒヨー	2,100	1,917.00	4,025,700	
ファーストリテイリング	8,100	81,130.00	657,153,000	
ソフトバンク グループ	476,900	6,749.00	3,218,598,100	
蔵王産業	2,600	1,353.00	3,517,800	
スズケン	25,600	3,935.00	100,736,000	
サンドラッグ	22,700	4,190.00	95,113,000	
サックスパー ホールディングス	6,600	552.00	3,643,200	
ジェコス	4,200	939.00	3,943,800	
やまや	1,700	2,147.00	3,649,900	
ベルーナ	12,900	916.00	11,816,400	
合計	65,082,900		148,120,912,010	

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。

第4 不動産等明細表
該当事項はありません。

第5 商品明細表
該当事項はありません。

第6 商品投資等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。

第7 その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

第8 借入金明細表
該当事項はありません。

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	785, 869, 477	900, 689, 151
金銭信託	98, 970, 113	18, 805, 944
コール・ローン	3, 980, 538, 915	4, 121, 466, 201
株式	199, 297, 460, 924	285, 514, 371, 822
投資証券	5, 434, 364, 911	6, 689, 318, 591
派生商品評価勘定	212, 899, 978	541, 982, 561
未収入金	48, 299, 571	1, 302, 477
未収配当金	290, 269, 135	314, 895, 056
差入委託証拠金	1, 858, 544, 563	4, 508, 205, 897
流動資産合計	212, 007, 217, 587	302, 611, 037, 700
資産合計	212, 007, 217, 587	302, 611, 037, 700
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8, 913, 084	39, 308, 980
未払金	3, 148, 485	282, 483
未払解約金	951, 945, 848	1, 647, 606, 579
その他未払費用	23, 905	6, 093
流動負債合計	964, 031, 322	1, 687, 204, 135
負債合計	964, 031, 322	1, 687, 204, 135
純資産の部		
元本等		
元本	110, 982, 930, 759	145, 169, 780, 539
剩余金		
期末剩余金又は期末欠損金 (△)	100, 060, 255, 506	155, 754, 053, 026
純資産合計	211, 043, 186, 265	300, 923, 833, 565
負債純資産合計	212, 007, 217, 587	302, 611, 037, 700

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、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、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本となる重要な事項	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	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
1. 受益権総口数	110,982,930,759口	145,169,780,539口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9016円 (19,016円)	2.0729円 (20,729円)

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	自 2019年11月21日 至 2020年11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そのリスク	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。	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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によって了場合、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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。</p> <p>(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。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	14,047,876,149	47,693,053,356
投資証券	257,545,307	827,754,816
合計	14,305,421,456	48,520,808,172

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	2019年11月20日 現在			2020年11月20日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売 建	280,684,290	—	281,182,580	△498,290	1,029,325,674	—
アメリカ・ドル	210,740,750	—	210,896,350	△155,600	764,144,472	—
イギリス・ポンド	21,234,187	—	21,311,920	△77,733	80,589,892	—
ユーロ	48,709,353	—	48,974,310	△264,957	184,591,310	—
買 建	3,217,946,194	—	3,211,968,970	△5,977,224	3,299,950,340	—
アメリカ・ドル	2,243,779,726	—	2,236,585,610	△7,194,116	2,319,701,352	—
イギリス・ポンド	266,133,660	—	266,399,000	265,340	339,662,469	—
ユーロ	708,032,808	—	708,984,360	951,552	640,586,519	—
合計	3,498,630,484	—	3,493,151,550	△6,475,514	4,329,276,014	—
					4,280,681,490	△30,023,436

(注) 1. 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。

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2019年11月20日 現在			2020年11月20日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
うち 1年超	うち 1年超		うち 1年超	うち 1年超	うち 1年超	
市場取引						
先物取引						
買 建	5,816,144,283	－	6,026,606,691	210,462,408	7,785,858,218	－
合計	5,816,144,283	－	6,026,606,691	210,462,408	7,785,858,218	－
					8,318,555,236	532,697,018
合計						

(注) 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。

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	88, 596, 175, 879円	110, 982, 930, 759円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	43, 121, 658, 246円	65, 821, 989, 117円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	20, 734, 903, 366円	31, 635, 139, 337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）	705, 419, 292円	854, 059, 755円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3, 284, 755, 401円	3, 771, 468, 504円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2, 471, 314, 789円	2, 859, 153, 135円
ニッセイ外国株式インデックスＳＡ（適格機関投資家限定）	1, 485, 332, 737円	1, 680, 106, 235円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	4, 090, 937円	2, 902, 320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）	23, 976, 047円	16, 628, 124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）	32, 048, 288円	20, 292, 993円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	11, 371, 888, 952円	11, 039, 104, 952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	75, 325, 693, 121円	101, 174, 107, 029円
DCニッセイ外国株式インデックス	15, 291, 138, 731円	20, 965, 866, 221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）	605, 358, 530円	986, 387, 028円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	59, 931, 201円	98, 693, 841円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	72, 703, 499円	133, 359, 257円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	39, 305, 684円	98, 739, 969円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	79, 667, 845円	218, 778, 176円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	22, 747, 558円	48, 776, 845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）	40, 031, 114円	52, 991, 843円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	24, 696, 756円	5, 819, 342円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	3, 481, 454円	5, 624, 058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）	995, 057円	1, 588, 705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）	16, 196, 854円	18, 159, 475円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	4, 212, 091円	26, 453, 761円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3, 974, 678円	20, 935, 466円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	6, 685, 873円	70, 913, 550円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	7, 284, 270円	104, 875, 929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）	－円	263, 829, 859円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06（適格機関投資家限定）	－円	303, 405, 272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）	－円	49, 172, 147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）	－円	277, 586, 748円
計	110, 982, 930, 759円	145, 169, 780, 539円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第1 有価証券明細表

① 株式

通 貨	銘 柄	株 式 数	評価額		備 考
			単 価	金 額	
アメリカ・ドル	3M CO	36,346	171.61	6,237,337.06	
	ABBOTT LABORATORIES	111,742	111.00	12,403,362.00	
	ABBVIE INC	111,613	99.67	11,124,467.71	
	ABIOMED INC	2,829	270.61	765,555.69	
	ACCENTURE PLC	40,187	243.20	9,773,478.40	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	48,603	75.93	3,690,425.79	
	ADOBE INC	30,412	466.41	14,184,460.92	
	ADVANCE AUTO PARTS	4,356	146.08	636,324.48	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	73,971	85.54	6,327,479.34	
	AERCAP HOLDINGS NV	8,154	39.00	318,006.00	
	AES CORP	42,419	20.88	885,708.72	
	AFLAC INC	42,785	43.72	1,870,560.20	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,542	108.68	2,123,824.56	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,943	270.36	3,769,629.48	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,202	101.50	1,035,503.00	
	ALBEMARLE CORP	6,701	125.80	842,985.80	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,885	122.05	1,694,664.25	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,716	441.35	2,081,406.60	
	ALLEGHANY CORP	881	600.07	528,661.67	
	ALLEGION PLC	5,889	114.13	672,111.57	
	ALLIANT ENERGY CORP	15,799	52.47	828,973.53	
	ALLSTATE CORP	19,682	100.37	1,975,482.34	
	ALLY FINANCIAL INC	23,695	29.89	708,243.55	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,285	123.81	901,955.85	
	ALPHABET INC-CL A	18,796	1,758.57	33,054,081.72	
	ALPHABET INC-CL C	19,253	1,763.92	33,960,751.76	
	ALTICE USA INC- A	19,643	31.85	625,629.55	
	ALTRIA GROUP INC	117,553	40.06	4,709,173.18	
	AMAZON.COM INC	26,776	3,117.02	83,461,327.52	
	AMCOR PLC	100,109	11.92	1,193,299.28	
	AMERCO	667	404.43	269,754.81	
	AMEREN CORPORATION	15,594	78.35	1,221,789.90	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	31,351	82.45	2,584,889.95	
	AMERICAN EXPRESS CO	43,306	114.14	4,942,946.84	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,794	89.02	426,761.88	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	54,399	38.54	2,096,537.46	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,444	156.65	1,792,702.60	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,668	183.63	1,408,074.84	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	9,637	101.90	982,010.30	

AMETEK INC	14, 476	118. 18	1, 710, 773. 68	
AMGEN INC	37, 156	224. 67	8, 347, 838. 52	
AMPHENOL CORP-CL A	18, 719	127. 20	2, 381, 056. 80	
ANALOG DEVICES INC	23, 320	136. 17	3, 175, 484. 40	
ANSYS INC	5, 393	324. 12	1, 747, 979. 16	
ANTHEM INC	15, 907	311. 85	4, 960, 597. 95	
AON PLC	14, 594	202. 92	2, 961, 414. 48	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10, 924	44. 70	488, 302. 80	
APPLE INC	1, 094, 972	118. 64	129, 907, 478. 08	
APPLIED MATERIALS INC	57, 755	77. 25	4, 461, 573. 75	
APTIV PLC	16, 978	115. 36	1, 958, 582. 08	
ARAMARK	14, 465	35. 26	510, 035. 90	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25, 436	34. 87	886, 953. 32	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	35, 012	48. 92	1, 712, 787. 04	
ARISTA NETWORKS INC	3, 578	272. 87	976, 328. 86	
ARROW ELECTRONICS INC	4, 945	88. 44	437, 335. 80	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11, 981	116. 04	1, 390, 275. 24	
ASSURANT INC	3, 756	134. 92	506, 759. 52	
AT&T INC	450, 444	28. 28	12, 738, 556. 32	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	7, 741	43. 02	333, 017. 82	
ATMOS ENERGY CORP	7, 691	95. 10	731, 414. 10	
AUTODESK INC	13, 840	256. 88	3, 555, 219. 20	
AUTOLIV INC	5, 302	89. 82	476, 225. 64	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	27, 179	173. 63	4, 719, 089. 77	
AUTOZONE INC	1, 473	1, 133. 76	1, 670, 028. 48	
AVALARA INC	5, 019	164. 05	823, 366. 95	
AVANTOR INC	29, 209	26. 59	776, 667. 31	
AVERY DENNISON CORP	5, 268	147. 03	774, 554. 04	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	13, 553	28. 24	382, 736. 72	
BAKER HUGHES COMPANY	41, 719	18. 31	763, 874. 89	
BALL CORP	20, 658	97. 91	2, 022, 624. 78	
BANK OF AMERICA CORP	492, 828	26. 98	13, 296, 499. 44	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	50, 256	38. 49	1, 934, 353. 44	
BAXTER INTERNATIONAL INC	32, 117	78. 88	2, 533, 388. 96	
BECTON DICKINSON & CO	18, 310	232. 90	4, 264, 399. 00	
BEIGENE LTD-ADR	2, 563	281. 91	722, 535. 33	
BERKSHIRE HATHAWAY INC -CL B	87, 794	229. 53	20, 151, 356. 82	
BEST BUY CO INC	14, 646	118. 83	1, 740, 384. 18	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1, 384	574. 38	794, 941. 92	
BIOGEN INC	10, 272	244. 01	2, 506, 470. 72	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11, 395	75. 13	856, 106. 35	
BLACK KNIGHT INC	9, 466	93. 88	888, 668. 08	
BLACKROCK INC	9, 612	673. 48	6, 473, 489. 76	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	42, 376	58. 64	2, 484, 928. 64	
BOEING CO	33, 898	205. 67	6, 971, 801. 66	

BOOKING HOLDINGS INC	2, 582	2, 010. 97	5, 192, 324. 54	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8, 729	88. 15	769, 461. 35	
BORGWARNER INC	13, 088	37. 71	493, 548. 48	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	90, 246	34. 21	3, 087, 315. 66	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142, 980	62. 09	8, 877, 628. 20	
BROADCOM INC	25, 279	384. 33	9, 715, 478. 07	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7, 261	146. 60	1, 064, 462. 60	
BROWN & BROWN INC	15, 082	47. 44	715, 490. 08	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	19, 510	80. 14	1, 563, 531. 40	
BUNGE LIMITED	9, 163	58. 53	536, 310. 39	
BURLINGTON STORES INC	4, 179	233. 09	974, 083. 11	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8, 693	93. 77	815, 142. 61	
CABLE ONE INC	307	1, 984. 50	609, 241. 50	
CABOT OIL & GAS CORP	24, 903	17. 18	427, 833. 54	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	17, 501	112. 60	1, 970, 612. 60	
CAMPBELL SOUP CO	11, 474	49. 32	565, 897. 68	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	28, 824	84. 99	2, 449, 751. 76	
CARDINAL HEALTH INC	18, 572	52. 29	971, 129. 88	
CARLYLE GROUP INC/THE	8, 940	27. 80	248, 532. 00	
CARMAX INC	10, 323	94. 53	975, 833. 19	
CARNIVAL CORP	30, 180	18. 19	548, 974. 20	
CARRIER GLOBAL CORP	52, 006	39. 13	2, 034, 994. 78	
CATALENT INC	9, 848	104. 16	1, 025, 767. 68	
CATERPILLAR INC	34, 206	172. 90	5, 914, 217. 40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6, 928	89. 91	622, 896. 48	
CBRE GROUP INC	21, 251	58. 47	1, 242, 545. 97	
CDK GLOBAL INC	7, 736	47. 78	369, 626. 08	
CDW CORP/DE	9, 021	132. 78	1, 197, 808. 38	
CELANESE CORP-SERIES A	7, 484	133. 55	999, 488. 20	
CENTENE CORP	36, 599	63. 61	2, 328, 062. 39	
CENTERPOINT ENERGY INC	32, 178	23. 43	753, 930. 54	
CENTURYLINK INC	59, 786	9. 82	587, 098. 52	
CERNER CORP	19, 081	72. 87	1, 390, 432. 47	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13, 583	32. 15	436, 693. 45	
CHARLES SCHWAB CORP	91, 554	47. 08	4, 310, 362. 32	
CHARTER COMMUNICATIONS -CL A	9, 145	650. 54	5, 949, 188. 30	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7, 175	119. 18	855, 116. 50	
CHENIERE ENERGY INC	14, 355	55. 27	793, 400. 85	
CHEVRON CORP	117, 889	85. 73	10, 106, 623. 97	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1, 671	1, 310. 46	2, 189, 778. 66	
CHUBB LTD	28, 492	147. 37	4, 198, 866. 04	
CHURCH & DWIGHT CO INC	15, 552	86. 20	1, 340, 582. 40	
CIGNA CORP	23, 286	204. 74	4, 767, 575. 64	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9, 701	78. 35	760, 073. 35	

CINTAS CORP	5, 588	367. 89	2, 055, 769. 32	
CISCO SYSTEMS INC	266, 577	41. 17	10, 974, 975. 09	
CITIGROUP INC	131, 459	52. 14	6, 854, 272. 26	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	26, 926	32. 81	883, 442. 06	
CITRIX SYSTEMS INC	7, 372	120. 77	890, 316. 44	
CLOROX CO	7, 963	202. 47	1, 612, 268. 61	
CME GROUP INC	22, 659	165. 93	3, 759, 807. 87	
CMS ENERGY CORP	18, 219	60. 58	1, 103, 707. 02	
COCA-COLA CO	257, 822	53. 13	13, 698, 082. 86	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	13, 082	42. 53	556, 377. 46	
COGNEX CORP	10, 798	71. 36	770, 545. 28	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	34, 058	76. 20	2, 595, 219. 60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	51, 465	85. 38	4, 394, 081. 70	
COMCAST CORP	287, 665	49. 48	14, 233, 664. 20	
COMERICA INC	8, 864	50. 93	451, 443. 52	
CONAGRA BRANDS INC	30, 743	36. 19	1, 112, 589. 17	
CONCHO RESOURCES INC	12, 328	57. 24	705, 654. 72	
CONOCOPHILLIPS	67, 449	39. 47	2, 662, 212. 03	
CONSOLIDATED EDISON INC	21, 105	77. 10	1, 627, 195. 50	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10, 607	204. 21	2, 166, 055. 47	
COOPER COS INC/THE	3, 362	332. 23	1, 116, 957. 26	
COPART INC	13, 310	113. 83	1, 515, 077. 30	
CORNING INC	48, 086	36. 33	1, 746, 964. 38	
CORTEVA INC	47, 165	36. 96	1, 743, 218. 40	
COSTAR GROUP INC	2, 484	894. 75	2, 222, 559. 00	
COSTCO WHOLESALE CORP	27, 867	383. 54	10, 688, 109. 18	
COUPA SOFTWARE INC	4, 217	314. 05	1, 324, 348. 85	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9, 011	143. 76	1, 295, 421. 36	
CROWN HOLDINGS INC	8, 567	96. 23	824, 402. 41	
CSX CORP	48, 820	91. 70	4, 476, 794. 00	
CUMMINS INC	9, 292	233. 14	2, 166, 336. 88	
CVS HEALTH CORP	82, 553	66. 06	5, 453, 451. 18	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2, 483	108. 31	268, 933. 73	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	22, 800	4. 35	99, 180. 00	
DANAHER CORP	40, 283	225. 83	9, 097, 109. 89	
DARDEN RESTAURANTS INC	8, 192	109. 80	899, 481. 60	
DATADOG INC - CLASS A	8, 334	88. 89	740, 809. 26	
DAVITA INC	5, 355	107. 63	576, 358. 65	
DEERE & CO	18, 800	255. 59	4, 805, 092. 00	
DELL TECHNOLOGIES -C	15, 243	68. 50	1, 044, 145. 50	
DELTA AIR LINES INC	10, 116	37. 91	383, 497. 56	
DENTSPLY SIRONA INC	13, 850	48. 87	676, 849. 50	
DEXCOM INC	5, 835	330. 64	1, 929, 284. 40	
DIAMONDBACK ENERGY INC	9, 880	39. 44	389, 667. 20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19, 502	76. 76	1, 496, 973. 52	
DISCOVERY INC-A	9, 654	25. 02	241, 591. 35	
DISCOVERY INC-C	20, 779	22. 52	468, 046. 97	
DISH NETWORK CORP	15, 412	33. 96	523, 391. 52	

DOCUSIGN INC	10, 992	219. 70	2, 414, 942. 40	
DOLLAR GENERAL CORP	15, 898	211. 21	3, 357, 816. 58	
DOLLAR TREE INC	14, 974	94. 55	1, 415, 791. 70	
DOMINION ENERGY INC	53, 075	79. 76	4, 233, 262. 00	
DOMINO'S PIZZA INC	2, 466	385. 04	949, 508. 64	
DOVER CORP	9, 112	124. 68	1, 136, 084. 16	
DOW INC	46, 937	55. 34	2, 597, 493. 58	
DR HORTON INC	21, 814	75. 10	1, 638, 231. 40	
DROPBOX INC-CLASS A	15, 701	18. 92	297, 062. 92	
DTE ENERGY COMPANY	12, 245	129. 66	1, 587, 686. 70	
DUKE ENERGY CORP	46, 526	91. 70	4, 266, 434. 20	
DUPONT DE NEMOURS INC	46, 403	62. 05	2, 879, 306. 15	
DYNATRACE INC	11, 562	35. 96	415, 769. 52	
EAST WEST BANCORP INC	8, 750	43. 37	379, 487. 50	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8, 584	96. 51	828, 441. 84	
EATON CORP PLC	25, 283	118. 12	2, 986, 427. 96	
EBAY INC	44, 257	49. 78	2, 203, 113. 46	
ECOLAB INC	16, 100	210. 93	3, 395, 973. 00	
EDISON INTERNATIONAL	23, 974	63. 62	1, 525, 225. 88	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39, 066	85. 24	3, 329, 985. 84	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	25, 252	29. 50	744, 934. 00	
ELECTRONIC ARTS INC	18, 177	120. 14	2, 183, 784. 78	
ELI LILLY & CO	54, 422	143. 41	7, 804, 659. 02	
EMERSON ELECTRIC CO	37, 733	77. 24	2, 914, 496. 92	
ENTERGY CORP	12, 743	108. 97	1, 388, 604. 71	
EOG RESOURCES INC	36, 515	45. 46	1, 659, 971. 90	
EPAM SYSTEMS INC	3, 512	334. 58	1, 175, 044. 96	
EQUIFAX INC	7, 697	173. 61	1, 336, 276. 17	
EQUITABLE HOLDINGS INC	25, 577	24. 72	632, 263. 44	
ERIE INDEMNITY COMPANY -CL A	1, 600	241. 37	386, 192. 00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	14, 808	43. 06	637, 632. 48	
ESTEE LAUDER COS INC	14, 198	241. 92	3, 434, 780. 16	
EVEREST RE GROUP LTD	2, 498	233. 83	584, 107. 34	
EVERGY INC	14, 447	53. 69	775, 659. 43	
EVERSOURCE ENERGY	21, 301	88. 19	1, 878, 535. 19	
EXACT SCIENCES CORP	9, 512	113. 18	1, 076, 568. 16	
EXELON CORP	61, 616	42. 35	2, 609, 437. 60	
EXPEDIA GROUP INC	8, 581	123. 96	1, 063, 700. 76	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	10, 580	90. 28	955, 162. 40	
EXXON MOBIL CORP	267, 050	37. 40	9, 987, 670. 00	
F5 NETWORKS INC	3, 798	160. 20	608, 439. 60	
FACEBOOK INC-A	151, 844	272. 94	41, 444, 301. 36	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2, 372	317. 96	754, 201. 12	
FAIR ISAAC CORP	1, 837	479. 30	880, 474. 10	
FASTENAL CO	35, 993	47. 98	1, 726, 944. 14	
FEDEX CORP	15, 780	279. 85	4, 416, 033. 00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17, 437	35. 70	622, 500. 90	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39, 076	147. 70	5, 771, 525. 20	
FIFTH THIRD BANCORP	45, 054	25. 88	1, 165, 997. 52	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10, 825	132. 24	1, 431, 498. 00	
FIRSTENERGY CORP	34, 636	29. 04	1, 005, 829. 44	
FISERV INC	35, 996	113. 02	4, 068, 267. 92	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5, 288	260. 28	1, 376, 360. 64	
FLIR SYSTEMS INC	8, 212	37. 59	308, 689. 08	
FMC CORP	8, 198	115. 32	945, 393. 36	
FORD MOTOR CO	247, 521	8. 82	2, 183, 135. 22	
FORTINET INC	8, 671	117. 03	1, 014, 767. 13	
FORTIVE CORP	19, 172	71. 33	1, 367, 538. 76	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8, 731	85. 11	743, 095. 41	
FOX CORP - CLASS A	20, 885	27. 71	578, 723. 35	
FOX CORP- CLASS B	11, 551	27. 27	314, 995. 77	
FRANKLIN RESOURCES INC	18, 382	20. 85	383, 264. 70	
FREEPORT-MCMORAN INC	91, 594	21. 11	1, 933, 549. 34	
GARMIN LTD	9, 018	114. 29	1, 030, 667. 22	
GARTNER INC	5, 701	152. 27	868, 091. 27	
GENERAL DYNAMICS CORP	15, 417	149. 99	2, 312, 395. 83	
GENERAL ELECTRIC CO	552, 846	9. 66	5, 340, 492. 36	
GENERAL MILLS INC	38, 250	62. 00	2, 371, 500. 00	
GENERAL MOTORS CO	81, 419	42. 82	3, 486, 361. 58	
GENUINE PARTS CO	9, 171	98. 00	898, 758. 00	
GILEAD SCIENCES INC	79, 223	60. 63	4, 803, 290. 49	
GLOBAL PAYMENTS INC	18, 927	190. 55	3, 606, 539. 85	
GLOBE LIFE INC	6, 277	93. 35	585, 957. 95	
GODADDY INC - CLASS A	10, 513	76. 34	802, 562. 42	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20, 613	224. 57	4, 629, 061. 41	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5, 258	118. 22	621, 600. 76	
HALLIBURTON CO	55, 394	16. 00	886, 304. 00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	22, 409	46. 24	1, 036, 192. 16	
HASBRO INC	8, 277	91. 75	759, 414. 75	
HCA HEALTHCARE INC	17, 061	150. 85	2, 573, 651. 85	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10, 149	55. 80	566, 314. 20	
HEICO CORP	2, 741	133. 17	365, 018. 97	
HEICO CORP-CLASS A	4, 562	117. 43	535, 715. 66	
HENRY SCHEIN INC	8, 898	63. 50	565, 023. 00	
HERSHEY CO/THE	9, 328	149. 40	1, 393, 603. 20	
HESS CORP	17, 454	47. 07	821, 559. 78	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	80, 614	10. 49	845, 640. 86	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17, 490	102. 80	1, 797, 972. 00	
HOLOGIC INC	16, 281	70. 01	1, 139, 832. 81	
HOME DEPOT INC	67, 942	270. 93	18, 407, 526. 06	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44, 343	202. 72	8, 989, 212. 96	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	77, 700	4. 22	327, 894. 00	
HORMEL FOODS CORP	18, 530	49. 99	926, 314. 70	
HOWMET AEROSPACE INC	24, 766	23. 57	583, 734. 62	
HP INC	90, 276	20. 50	1, 850, 658. 00	

HUMANA INC	8, 340	407. 17	3, 395, 797. 80	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	64, 517	11. 95	770, 978. 15	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2, 544	162. 21	412, 662. 24	
IAC/INTERACTIVECORP	5, 008	139. 13	696, 763. 04	
IDEX CORP	4, 754	196. 07	932, 116. 78	
IDEXX LABORATORIES INC	5, 364	457. 19	2, 452, 367. 16	
IHS MARKIT LTD	24, 063	92. 45	2, 224, 624. 35	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	19, 979	206. 89	4, 133, 455. 31	
ILLUMINA INC	9, 287	299. 00	2, 776, 813. 00	
INCYTE CORP	11, 653	81. 69	951, 933. 57	
INGERSOLL-RAND INC	22, 380	44. 20	989, 196. 00	
INGREDION INC	4, 177	76. 16	318, 120. 32	
INSULET CORP	4, 152	264. 24	1, 097, 124. 48	
INTEL CORP	267, 302	45. 62	12, 194, 317. 24	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34, 551	100. 90	3, 486, 195. 90	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	56, 130	117. 18	6, 577, 313. 40	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	5, 425	111. 95	607, 328. 75	
INTERNATIONAL PAPER CO	23, 617	49. 23	1, 162, 664. 91	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	25, 165	21. 59	543, 312. 35	
INTUIT INC	16, 445	361. 44	5, 943, 880. 80	
INTUITIVE SURGICAL INC	7, 359	733. 95	5, 401, 138. 05	
INVESCO LTD	24, 471	15. 96	390, 557. 16	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	8, 396	50. 45	423, 578. 20	
IPG PHOTONICS CORP	2, 332	201. 00	468, 732. 00	
IQVIA HOLDINGS INC	12, 128	169. 55	2, 056, 302. 40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4, 819	161. 52	778, 364. 88	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8, 248	105. 15	867, 277. 20	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	14, 000	51. 22	717, 080. 00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	14, 200	24. 47	347, 474. 00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3, 442	143. 66	494, 477. 72	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5, 528	133. 78	739, 535. 84	
JM SMUCKER CO	7, 164	117. 05	838, 546. 20	
JOHNSON & JOHNSON	166, 372	147. 14	24, 479, 976. 08	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	47, 246	45. 71	2, 159, 614. 66	
JONES LANG LASALLE INC	3, 271	134. 23	439, 066. 33	
JPMORGAN CHASE & CO	192, 382	115. 56	22, 231, 663. 92	
JUNIPER NETWORKS INC	20, 803	21. 94	456, 417. 82	
KANSAS CITY SOUTHERN	6, 108	189. 06	1, 154, 778. 48	
KELLOGG CO	16, 246	65. 21	1, 059, 401. 66	
KEURIG DR PEPPER INC	22, 502	29. 76	669, 659. 52	
KEYCORP	61, 968	15. 62	967, 940. 16	

KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11, 762	117. 96	1, 387, 445. 52	
KIMBERLY-CLARK CORP	21, 548	141. 74	3, 054, 213. 52	
KINDER MORGAN INC	128, 852	14. 40	1, 855, 468. 80	
KKR & CO INC -A	31, 833	38. 47	1, 224, 615. 51	
KLA CORPORATION	9, 795	243. 75	2, 387, 531. 25	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	8, 402	42. 09	353, 640. 18	
KRAFT HEINZ CO/THE	42, 412	31. 88	1, 352, 094. 56	
KROGER CO	49, 467	32. 76	1, 620, 538. 92	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13, 640	195. 76	2, 670, 166. 40	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	6, 138	198. 77	1, 220, 050. 26	
LAM RESEARCH CORP	9, 162	437. 68	4, 010, 024. 16	
LAMB WESTON HOLDING INC	9, 299	71. 60	665, 808. 40	
LAS VEGAS SANDS CORP	21, 734	58. 56	1, 272, 743. 04	
LEAR CORP	3, 599	140. 07	504, 111. 93	
LEIDOS HOLDINGS INC	8, 563	100. 34	859, 211. 42	
LENNAR CORP-CL A	17, 389	76. 30	1, 326, 780. 70	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2, 200	298. 51	656, 722. 00	
LIBERTY BROADBAND-A	1, 510	157. 14	237, 281. 40	
LIBERTY BROADBAND-C	6, 927	157. 90	1, 093, 773. 30	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12, 531	23. 06	288, 964. 86	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	22, 563	22. 34	504, 057. 42	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	5, 379	42. 86	230, 543. 94	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11, 223	42. 94	481, 915. 62	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	13, 015	41. 13	535, 306. 95	
LINCOLN NATIONAL CORP	11, 994	44. 62	535, 172. 28	
LINDE PLC	33, 208	253. 07	8, 403, 948. 56	
LIVE NATION INC	10, 350	66. 91	692, 518. 50	
LKQ CORP	18, 204	35. 33	643, 147. 32	
LOCKHEED MARTIN CORP	15, 940	376. 46	6, 000, 772. 40	
LOEWS CORP	15, 974	42. 82	684, 006. 68	
LOWE'S COS INC	47, 694	149. 60	7, 135, 022. 40	
LULULEMON ATHLETICA INC	7, 821	344. 60	2, 695, 116. 60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16, 920	82. 23	1, 391, 331. 60	
M&T BANK CORP	8, 003	120. 46	964, 041. 38	
MARATHON PETROLEUM CORP	41, 217	39. 08	1, 610, 760. 36	
MARKEL CORP	868	1, 008. 32	875, 221. 76	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2, 385	534. 22	1, 274, 114. 70	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	17, 417	121. 11	2, 109, 372. 87	
MARSH & MCLENNAN COS INC	32, 285	114. 48	3, 695, 986. 80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3, 929	269. 55	1, 059, 061. 95	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	42,027	44.18	1,856,752.86	
MASCO CORP	16,654	55.24	919,966.96	
MASIMO CORPORATION	3,234	246.47	797,083.98	
MASTERCARD INC-CLASS A	56,450	333.88	18,847,526.00	
MATCH GROUP INC	15,543	132.31	2,056,494.33	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	16,845	81.18	1,367,477.10	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,824	183.24	1,433,669.76	
MCDONALD'S CORP	46,993	215.11	10,108,664.23	
MCKESSON CORP	10,206	171.94	1,754,819.64	
MEDTRONIC PLC	84,694	111.00	9,401,034.00	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	13,643	18.77	256,079.11	
MERCADOLIBRE INC	2,826	1,370.30	3,872,467.80	
MERCK & CO INC	159,425	80.39	12,816,175.75	
METLIFE INC	48,382	45.51	2,201,864.82	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,511	1,147.34	1,733,630.74	
MGM MIRAGE	29,412	27.24	801,182.88	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,547	127.51	1,982,397.97	
MICRON TECHNOLOGY INC	70,126	61.83	4,335,890.58	
MICROSOFT CORP	454,990	212.42	96,648,975.80	
MODERNA INC	17,199	92.77	1,595,551.23	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,847	126.98	488,492.06	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,731	209.18	780,450.58	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	11,954	44.04	526,454.16	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	90,114	57.60	5,190,566.40	
MONGODB INC	3,046	255.11	777,065.06	
MONSTER BEVERAGE CORP	24,819	83.73	2,078,094.87	
MOODY'S CORP	10,662	274.12	2,922,667.44	
MORGAN STANLEY	89,000	58.63	5,218,070.00	
MOSAIC CO/THE	22,875	19.58	447,892.50	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,766	169.16	1,821,176.56	
MSCI INC	5,372	400.79	2,153,043.88	
NASDAQ INC	7,195	124.76	897,648.20	
NATIONAL-OILWELL INC	24,508	12.31	301,693.48	
NETAPP INC	13,950	51.98	725,121.00	
NETFLIX INC	27,780	484.67	13,464,132.60	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,561	87.45	486,309.45	
NEWELL BRANDS INC	25,641	20.39	522,819.99	
NEWMONT CORP	50,624	61.41	3,108,819.84	
NEWS CORP - CLASS A	24,616	17.55	432,010.80	
NEXTERA ENERGY INC	123,704	75.13	9,293,881.52	
NIELSEN HOLDINGS PLC	22,710	16.07	364,949.70	
NIKE INC	78,376	131.91	10,338,578.16	
NISOURCE INC	24,747	23.60	584,029.20	
NORDSON CORP	3,459	202.31	699,790.29	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,342	242.10	3,956,398.20	
NORTHERN TRUST CORP	12,483	93.36	1,165,412.88	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,999	309.48	3,094,490.52	

NORTONLIFELOCK INC	35, 280	18. 67	658, 677. 60	
NRG ENERGY INC	15, 209	30. 97	471, 022. 73	
NUCOR CORP	18, 900	52. 83	998, 487. 00	
NVIDIA CORP	38, 840	537. 61	20, 880, 772. 40	
NVR INC	221	4, 215. 53	931, 632. 13	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17, 632	151. 35	2, 668, 603. 20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4, 684	451. 39	2, 114, 310. 76	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56, 976	13. 36	761, 199. 36	
OGE ENERGY CORP	12, 879	33. 48	431, 188. 92	
OKTA INC	7, 352	232. 45	1, 708, 972. 40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6, 086	205. 53	1, 250, 855. 58	
OMNICOM GROUP	13, 690	59. 39	813, 049. 10	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	26, 010	27. 85	724, 378. 50	
ONEOK INC	27, 896	33. 30	928, 936. 80	
ORACLE CORP	129, 452	56. 45	7, 307, 565. 40	
OTIS WORLDWIDE CORP	26, 016	66. 16	1, 721, 218. 56	
OWENS CORNING	6, 863	72. 45	497, 224. 35	
PACCAR INC	21, 866	90. 04	1, 968, 814. 64	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5, 977	129. 80	775, 814. 60	
PALO ALTO NETWORKS INC	6, 104	287. 52	1, 755, 022. 08	
PARKER HANNIFIN CORP	8, 106	268. 84	2, 179, 217. 04	
PAYCHEX INC	20, 411	92. 08	1, 879, 444. 88	
PAYCOM SOFTWARE INC	3, 148	392. 64	1, 236, 030. 72	
PAYPAL HOLDINGS INC	70, 445	190. 90	13, 447, 950. 50	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12, 373	105. 26	1, 302, 381. 98	
PENTAIR PLC	10, 412	53. 27	554, 647. 24	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	26, 387	12. 86	339, 336. 82	
PEPSICO INC	87, 656	143. 32	12, 562, 857. 92	
PERKINELMER INC	7, 052	130. 81	922, 472. 12	
PERRIGO CO PLC	8, 594	48. 81	419, 473. 14	
PFIZER INC	350, 810	36. 19	12, 695, 813. 90	
PG&E CORP	67, 604	12. 29	830, 853. 16	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	98, 410	77. 51	7, 627, 759. 10	
PHILLIPS 66	27, 531	61. 45	1, 691, 779. 95	
PINNACLE WEST CAPITAL	7, 146	83. 55	597, 048. 30	
PINTEREST INC- CLASS A	25, 474	65. 95	1, 680, 010. 30	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10, 295	96. 63	994, 805. 85	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26, 804	130. 30	3, 492, 561. 20	
PPG INDUSTRIES INC	14, 903	143. 22	2, 134, 407. 66	
PPL CORPORATION	48, 797	29. 23	1, 426, 336. 31	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17, 234	48. 93	843, 259. 62	
PROCTER & GAMBLE CO	156, 371	139. 53	21, 818, 445. 63	
PROGRESSIVE CORP	36, 912	94. 27	3, 479, 694. 24	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25, 000	75. 79	1, 894, 750. 00	
PTC INC	6, 935	100. 21	694, 956. 35	

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32, 010	57. 62	1, 844, 416. 20	
PULTE GROUP INC	16, 959	43. 63	739, 921. 17	
QORVO INC	7, 216	146. 86	1, 059, 741. 76	
QUALCOMM INC	71, 053	147. 53	10, 482, 449. 09	
QUEST DIAGNOSTICS	8, 441	122. 81	1, 036, 639. 21	
RALPH LAUREN CORP	3, 028	80. 59	244, 026. 52	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7, 691	89. 20	686, 037. 20	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	95, 680	71. 11	6, 803, 804. 80	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6, 360	514. 71	3, 273, 555. 60	
REGIONS FINANCIAL CORP	60, 341	15. 46	932, 871. 86	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4, 256	117. 44	499, 824. 64	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3, 129	176. 38	551, 893. 02	
REPUBLIC SERVICES INC	14, 198	99. 91	1, 418, 522. 18	
RESMED INC	9, 125	211. 76	1, 932, 310. 00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4, 627	296. 90	1, 373, 756. 30	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	7, 152	62. 32	445, 712. 64	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7, 333	250. 14	1, 834, 276. 62	
ROKU INC	6, 445	255. 67	1, 647, 793. 15	
ROLLINS INC	9, 294	58. 70	545, 557. 80	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6, 593	409. 48	2, 699, 701. 64	
ROSS STORES INC	22, 449	110. 20	2, 473, 879. 80	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11, 237	74. 44	836, 482. 28	
RPM INTERNATIONAL INC	8, 224	89. 17	733, 334. 08	
S&P GLOBAL INC	15, 212	338. 63	5, 151, 239. 56	
SALESFORCE. COM INC	56, 811	264. 65	15, 035, 031. 15	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4, 713	134. 42	633, 521. 46	
SCHLUMBERGER LTD	87, 829	20. 46	1, 796, 981. 34	
SEAGATE TECHNOLOGY	14, 590	55. 92	815, 872. 80	
SEAGEN INC	7, 667	174. 37	1, 336, 894. 79	
SEALED AIR CORP	9, 881	44. 80	442, 668. 80	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7, 626	54. 29	414, 015. 54	
SEMPRA ENERGY	18, 512	130. 25	2, 411, 188. 00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10, 000	47. 90	479, 000. 00	
SERVICENOW INC	12, 038	514. 33	6, 191, 504. 54	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5, 173	728. 73	3, 769, 720. 29	
SIGNATURE BANK	3, 316	106. 02	351, 562. 32	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	70, 495	6. 41	451, 872. 95	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10, 502	139. 36	1, 463, 558. 72	
SLACK TECHNOLOGIES INC - CL A	24, 218	27. 73	671, 565. 14	
SMITH (A. O.) CORP	8, 533	56. 60	482, 967. 80	
SNAP INC - A	56, 425	42. 29	2, 386, 213. 25	
SNAP-ON INC	3, 219	171. 72	552, 766. 68	

SOUTHERN CO	66, 936	61. 07	4, 087, 781. 52	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9, 108	46. 08	419, 696. 64	
SPLUNK INC	10, 048	199. 28	2, 002, 365. 44	
SQUARE INC - A	22, 937	191. 66	4, 396, 105. 42	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14, 655	68. 59	1, 005, 186. 45	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9, 746	186. 51	1, 817, 726. 46	
STARBUCKS CORP	73, 788	97. 76	7, 213, 514. 88	
STATE STREET CORP	22, 158	69. 27	1, 534, 884. 66	
STEEL DYNAMICS INC	13, 138	35. 82	470, 603. 16	
STERIS PLC	5, 354	194. 73	1, 042, 584. 42	
STRYKER CORP	21, 356	233. 57	4, 988, 120. 92	
SVB FINANCIAL GROUP	3, 216	354. 67	1, 140, 618. 72	
SYNCHRONY FINANCIAL	33, 284	30. 05	1, 000, 184. 20	
SYNOPSYS INC	9, 481	221. 28	2, 097, 955. 68	
SYSCO CORP	30, 509	71. 99	2, 196, 342. 91	
T ROWE PRICE GROUP INC	14, 218	139. 53	1, 983, 837. 54	
T-MOBILE US INC	35, 224	129. 19	4, 550, 588. 56	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7, 184	165. 58	1, 189, 526. 72	
TARGET CORP	31, 566	171. 37	5, 409, 465. 42	
TE CONNECTIVITY LTD	20, 829	111. 34	2, 319, 100. 86	
TELADOC HEALTH INC	4, 474	191. 19	855, 384. 06	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2, 316	390. 82	905, 139. 12	
TELEFLEX INC	2, 942	372. 27	1, 095, 218. 34	
TERADYNE INC	10, 390	106. 47	1, 106, 223. 30	
TESLA, INC.	46, 861	499. 27	23, 396, 291. 47	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	69, 203	9. 35	647, 048. 05	
TEXAS INSTRUMENTS INC	57, 948	157. 27	9, 113, 481. 96	
TEXTRON INC	14, 266	45. 45	648, 389. 70	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24, 946	453. 10	11, 303, 032. 60	
TIFFANY & CO	6, 886	131. 53	905, 715. 58	
TJX COS INC	75, 697	61. 56	4, 659, 907. 32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7, 292	131. 25	957, 075. 00	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	2, 586	805. 92	2, 084, 109. 12	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	5, 271	58. 75	309, 671. 25	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15, 151	146. 79	2, 224, 015. 29	
TRANSDIGM GROUP INC	3, 258	590. 65	1, 924, 337. 70	
TRANSUNION	12, 070	96. 32	1, 162, 582. 40	
TRAVELERS COS INC/THE	15, 908	133. 87	2, 129, 603. 96	
TRIMBLE INC	15, 792	57. 74	911, 830. 08	
TRUIST FINANCIAL CORP	85, 307	46. 90	4, 000, 898. 30	
TWILIO INC - A	7, 731	295. 64	2, 285, 592. 84	
TWITTER INC	49, 603	43. 62	2, 163, 682. 86	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2, 502	414. 38	1, 036, 778. 76	
TYSON FOODS INC-CL A	18, 581	62. 34	1, 158, 339. 54	
UBER TECHNOLOGIES INC	60, 567	49. 26	2, 983, 530. 42	
UGI CORP	13, 314	36. 04	479, 836. 56	
ULTA BEAUTY INC	3, 375	274. 86	927, 652. 50	
UNION PACIFIC CORP	43, 123	204. 55	8, 820, 809. 65	

UNITED PARCEL SERVICE INC	44, 557	166. 48	7, 417, 849. 36	
UNITED RENTALS INC	4, 537	217. 00	984, 529. 00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	59, 883	337. 00	20, 180, 571. 00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4, 872	133. 95	652, 604. 40	
US BANCORP	85, 691	43. 24	3, 705, 278. 84	
VAIL RESORTS INC	2, 550	276. 07	703, 978. 50	
VALERO ENERGY CORP	25, 733	51. 21	1, 317, 786. 93	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5, 720	173. 68	993, 449. 60	
VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	8, 512	272. 57	2, 320, 115. 84	
VERISIGN INC	6, 582	197. 44	1, 299, 550. 08	
VERISK ANALYTICS INC	9, 751	205. 72	2, 005, 975. 72	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	261, 741	60. 21	15, 759, 425. 61	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16, 336	211. 97	3, 462, 741. 92	
VF CORP	20, 961	84. 96	1, 780, 846. 56	
VIACOMCBS INC	35, 692	33. 43	1, 193, 183. 56	
VIATRIS INC	75, 930	18. 11	1, 375, 092. 30	
VISA INC-CLASS A SHARES	106, 547	207. 57	22, 115, 960. 79	
VISTRA CORP	27, 816	18. 53	515, 430. 48	
VMWARE INC-CLASS A	5, 296	148. 68	787, 409. 28	
VOYA FINANCIAL INC	8, 017	57. 54	461, 298. 18	
VULCAN MATERIALS CO	8, 369	140. 11	1, 172, 580. 59	
WABTEC CORP	11, 465	72. 35	829, 492. 75	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46, 865	37. 85	1, 773, 840. 25	
WALMART INC	89, 437	152. 12	13, 605, 156. 44	
WALT DISNEY CO	114, 123	141. 72	16, 173, 511. 56	
WASTE CONNECTIONS INC	16, 705	106. 00	1, 770, 730. 00	
WASTE MANAGEMENT INC	26, 742	120. 58	3, 224, 550. 36	
WATERS CORP	3, 907	226. 35	884, 349. 45	
WAYFAIR INC- CLASS A	4, 067	248. 55	1, 010, 852. 85	
WEC ENERGY GROUP INC	19, 942	95. 55	1, 905, 458. 10	
WELLS FARGO & CO	245, 927	26. 16	6, 433, 450. 32	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4, 631	281. 22	1, 302, 329. 82	
WESTERN DIGITAL CORP	18, 965	42. 61	808, 098. 65	
WESTERN UNION CO	25, 987	21. 53	559, 500. 11	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	16, 277	42. 59	693, 237. 43	
WEYERHAEUSER CO	47, 038	29. 02	1, 365, 042. 76	
WHIRLPOOL CORP	3, 927	192. 56	756, 183. 12	
WILLIAMS COS INC	76, 781	20. 16	1, 547, 904. 96	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8, 130	204. 49	1, 662, 503. 70	
WIX. COM LTD	3, 272	257. 34	842, 016. 48	
WORKDAY INC-CLASS A	10, 998	230. 80	2, 538, 338. 40	
WR BERKLEY CORP	8, 977	66. 86	600, 202. 22	
WW GRAINGER INC	2, 855	422. 86	1, 207, 265. 30	
WYNN RESORTS LTD	6, 163	98. 75	608, 596. 25	
XCEL ENERGY INC	33, 219	69. 35	2, 303, 737. 65	
XILINX INC	15, 349	132. 96	2, 040, 803. 04	

XPO LOGISTICS INC	5, 878	105. 93	622, 656. 54	
XYLEM INC	11, 384	94. 37	1, 074, 308. 08	
YUM! BRANDS INC	18, 969	105. 27	1, 996, 866. 63	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3, 343	358. 39	1, 198, 097. 77	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	8, 852	109. 49	969, 205. 48	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13, 064	146. 53	1, 914, 267. 92	
ZIONS BANCORP, N. A.	10, 041	38. 39	385, 473. 99	
ZOETIS INC	30, 041	166. 31	4, 996, 118. 71	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10, 049	414. 29	4, 163, 200. 21	
ZSCALER INC	4, 534	138. 54	628, 140. 36	
アメリカ・ドル 小計	19, 709, 428		1, 971, 641, 084. 84 (204, 814, 075, 893)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	61, 215	11. 06	677, 037. 90
	ADMIRAL GROUP PLC	12, 159	29. 39	357, 353. 01
	ANGLO AMERICAN PLC	77, 023	21. 20	1, 632, 887. 60
	ANTOFAGASTA PLC	24, 544	10. 97	269, 247. 68
	ASHTEAD GROUP PLC	28, 431	31. 33	890, 743. 23
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22, 343	19. 99	446, 748. 28
	ASTRAZENECA PLC	82, 913	81. 25	6, 736, 681. 25
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	61, 161	5. 57	341, 156. 05
	AVEVA GROUP PLC	4, 142	41. 94	173, 715. 48
	AVIVA PLC	244, 856	3. 15	771, 296. 40
	BAE SYSTEMS PLC	202, 982	5. 07	1, 030, 742. 59
	BARCLAYS PLC	1, 088, 864	1. 38	1, 512, 432. 09
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64, 664	6. 52	421, 867. 93
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	7, 978	47. 69	380, 470. 82
	BHP GROUP PLC	132, 699	16. 21	2, 151, 581. 58
	BP PLC	1, 283, 052	2. 43	3, 126, 797. 72
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	144, 954	27. 80	4, 029, 721. 20
	BT GROUP PLC	563, 923	1. 28	721, 821. 44
	BUNZL PLC	21, 257	23. 80	505, 916. 60
	BURBERRY GROUP PLC	25, 664	16. 03	411, 393. 92
	COCA-COLA HBC AG-CDI	12, 686	22. 27	282, 517. 22
	COMPASS GROUP PLC	112, 450	13. 50	1, 518, 075. 00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8, 129	62. 48	507, 899. 92
	DCC PLC	6, 238	55. 14	343, 963. 32
	DIAGEO PLC	147, 861	29. 79	4, 405, 518. 49
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	85, 202	3. 03	258, 673. 27
	EVRAZ PLC	31, 897	3. 77	120, 538. 76
	EXPERIAN PLC	57, 486	29. 33	1, 686, 064. 38
	FERGUSON PLC	14, 179	80. 68	1, 143, 961. 72
	GLAXOSMITHKLINE PLC	317, 349	13. 95	4, 427, 018. 55
	GLENCORE PLC	629, 934	1. 90	1, 199, 394. 33
	GVC HOLDINGS PLC	36, 765	9. 70	356, 694. 03
	HALMA PLC	23, 984	24. 23	581, 132. 32

HARGREAVES LANSDOWN PLC	20, 840	14. 68	306, 035. 40	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10, 859	25. 96	281, 899. 64	
HSBC HOLDINGS PLC	1, 286, 017	3. 83	4, 935, 733. 24	
IMPERIAL BRANDS PLC	59, 899	15. 05	901, 479. 95	
INFORMA PLC	96, 302	5. 82	561, 055. 45	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	11, 028	44. 82	494, 274. 96	
INTERTEK GROUP PLC	10, 225	60. 32	616, 772. 00	
JD SPORTS FASHION PLC	27, 610	8. 01	221, 321. 76	
JOHNSON MATTHEY PLC	12, 138	24. 08	292, 283. 04	
KINGFISHER PLC	132, 143	2. 91	384, 932. 55	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	379, 127	2. 58	978, 147. 66	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4, 452, 768	0. 35	1, 585, 185. 40	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20, 027	80. 92	1, 620, 584. 84	
M&G PLC	165, 075	1. 93	318, 594. 75	
MELROSE INDUSTRIES PLC	308, 256	1. 58	487, 352. 73	
MONDI PLC/WI	30, 471	16. 85	513, 436. 35	
MORRISON WM SUPERMARKETS	149, 850	1. 86	279, 020. 70	
NATIONAL GRID PLC	222, 087	9. 33	2, 072, 071. 71	
NATWEST GROUP PLC	303, 159	1. 56	474, 140. 67	
NEXT PLC	8, 396	66. 74	560, 349. 04	
NMC HEALTH PLC	4, 758	0. 00	4. 75	
OCADO GROUP PLC	28, 932	23. 30	674, 115. 60	
PEARSON PLC	47, 506	6. 39	303, 563. 34	
PERSIMMON PLC	20, 159	28. 95	583, 603. 05	
PRUDENTIAL PLC	164, 797	12. 78	2, 106, 929. 64	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	44, 988	67. 28	3, 026, 792. 64	
RELX PLC	122, 192	17. 76	2, 170, 740. 88	
RENTOKIL INITIAL PLC	117, 631	5. 15	606, 505. 43	
RIO TINTO PLC	70, 706	47. 16	3, 334, 494. 96	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	123, 768	0. 98	121, 911. 48	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	259, 074	12. 26	3, 176, 247. 24	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	233, 596	11. 82	2, 761, 571. 91	
RSA INSURANCE GROUP PLC	64, 276	6. 76	434, 634. 31	
SAGE GROUP PLC	68, 645	6. 79	466, 648. 71	
SAINSBURY (J) PLC	110, 620	2. 22	245, 576. 40	
SCHRODERS PLC	7, 825	29. 75	232, 793. 75	
SEVERN TRENT PLC	15, 258	24. 52	374, 126. 16	
SMITH & NEPHEW PLC	55, 102	14. 49	798, 703. 49	
SMITHS GROUP PLC	25, 239	15. 30	386, 282. 89	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4, 675	115. 00	537, 625. 00	
SSE PLC	66, 218	13. 63	902, 551. 34	
ST JAMES'S PLACE PLC	33, 903	10. 85	367, 847. 55	
STANDARD CHARTERED PLC	168, 190	4. 38	737, 681. 34	

	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	145, 189	2. 70	392, 155. 48	
	TAYLOR WIMPEY PLC	230, 069	1. 67	385, 365. 57	
	TESCO PLC	620, 495	2. 36	1, 464, 988. 69	
	UNILEVER PLC	73, 876	44. 63	3, 297, 085. 88	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	43, 648	9. 17	400, 252. 16	
	VODAFONE GROUP PLC	1, 698, 190	1. 21	2, 064, 999. 04	
	WHITBREAD PLC	12, 668	30. 57	387, 260. 76	
	WPP PLC	78, 141	7. 40	578, 868. 52	
イギリス・ポンド	小計	18, 105, 595		94, 627, 663. 88 (13, 028, 336, 763)	
イスラエル・シユケル	AZRIELI GROUP	2, 769	189. 90	525, 833. 10	
	BANK HAPOALIM BM	71, 938	22. 28	1, 602, 778. 64	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	90, 902	18. 70	1, 699, 867. 40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1, 690	390. 00	659, 100. 00	
	ICL GROUP LTD	44, 037	13. 85	609, 912. 45	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	73, 010	11. 24	820, 632. 40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9, 152	72. 44	662, 970. 88	
	NICE LTD	3, 947	784. 00	3, 094, 448. 00	
イスラエル・シユケル	小計	297, 445		9, 675, 542. 87 (300, 328, 850)	
オーストラリア・ドル	AFTERPAY LTD	13, 654	97. 89	1, 336, 590. 06	
	AGL ENERGY LTD	44, 431	12. 97	576, 270. 07	
	AMP LTD	231, 650	1. 74	403, 071. 00	
	AMPOL LTD	16, 965	28. 45	482, 654. 25	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	37, 340	34. 59	1, 291, 590. 60	
	ASX LTD	13, 236	81. 84	1, 083, 234. 24	
	AURIZON HOLDINGS LTD	141, 081	4. 04	569, 967. 24	
	AUSNET SERVICES	151, 629	1. 87	284, 304. 37	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	183, 943	22. 45	4, 129, 520. 35	
	BHP GROUP LIMITED	187, 576	36. 51	6, 848, 399. 76	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34, 136	17. 72	604, 889. 92	
	BRAMBLES LTD	101, 538	10. 89	1, 105, 748. 82	
	CIMIC GROUP LIMITED	7, 870	23. 20	182, 584. 00	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38, 232	12. 60	481, 723. 20	
	COCHLEAR LTD	4, 452	233. 50	1, 039, 542. 00	
	COLES GROUP LTD	87, 281	18. 04	1, 574, 549. 24	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	113, 585	78. 87	8, 958, 448. 95	
	COMPUTERSHARE LIMITED	35, 518	13. 52	480, 203. 36	
	CROWN RESORTS LTD	28, 937	9. 46	273, 744. 02	
	CSL LIMITED	28, 907	310. 27	8, 968, 974. 89	
	EVOLUTION MINING LTD	107, 782	5. 53	596, 034. 46	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	107, 989	16. 95	1, 830, 413. 55	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	156, 261	5. 46	853, 185. 06	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	29, 022	40. 25	1, 168, 135. 50	
	MACQUARIE GROUP LTD	21, 927	138. 01	3, 026, 145. 27	

MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8, 504	62. 29	529, 714. 16	
MEDIBANK PRIVATE LTD	189, 642	2. 92	553, 754. 64	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	206, 863	22. 70	4, 695, 790. 10	
NEWCREST MINING LIMITED	52, 144	28. 31	1, 476, 196. 64	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	48, 530	14. 14	686, 214. 20	
OIL SEARCH LTD	131, 899	3. 73	491, 983. 27	
ORICA LTD	30, 090	16. 97	510, 627. 30	
ORIGIN ENERGY LIMITED	119, 384	4. 76	568, 267. 84	
QANTAS AIRWAYS LTD	64, 209	5. 25	337, 097. 25	
QBE INSURANCE GROUP LTD	97, 044	10. 00	970, 440. 00	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	12, 781	65. 90	842, 267. 90	
REA GROUP LTD	3, 801	140. 55	534, 230. 55	
RIO TINTO LTD	23, 948	98. 92	2, 368, 936. 16	
SANTOS LTD	117, 855	6. 00	707, 130. 00	
SEEK LTD	23, 866	25. 43	606, 912. 38	
SONIC HEALTHCARE LTD	30, 419	34. 25	1, 041, 850. 75	
SOUTH32 LTD	324, 968	2. 30	747, 426. 40	
SUNCORP GROUP LTD	90, 302	9. 43	851, 547. 86	
TABCORP HOLDINGS LTD	158, 296	4. 10	649, 013. 60	
TELSTRA CORP LTD	288, 842	3. 10	895, 410. 20	
TPG TELECOM LTD	28, 524	7. 69	219, 349. 56	
TREASURY WINE ESTATES LTD	47, 547	9. 89	470, 239. 83	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8, 016	29. 21	234, 147. 36	
WESFARMERS LIMITED	74, 444	49. 45	3, 681, 255. 80	
WESTPAC BANKING CORP	233, 732	19. 90	4, 651, 266. 80	
WISETECH GLOBAL LTD	9, 640	30. 70	295, 948. 00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	64, 843	21. 78	1, 412, 280. 54	
WOOLWORTHS GROUP LTD	81, 354	38. 17	3, 105, 282. 18	
オーストラリア・ドル 小計	4, 496, 429		82, 284, 505. 45 (6, 220, 708, 612)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	15, 208	88. 20	1, 341, 345. 60
	AIR CANADA	9, 182	21. 68	199, 065. 76
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	38, 315	20. 14	771, 664. 10
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	54, 234	43. 24	2, 345, 078. 16
	ALTAGAS LTD	17, 820	18. 03	321, 294. 60
	ATCO LTD -CL 'I'	4, 950	37. 73	186, 763. 50
	B2GOLD CORP	64, 506	7. 42	478, 634. 52
	BANK OF MONTREAL	40, 464	92. 27	3, 733, 613. 28
	BANK OF NOVA SCOTIA	76, 634	62. 99	4, 827, 175. 66
	BARRICK GOLD CORP	112, 247	31. 56	3, 542, 515. 32
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	20, 409	25. 64	523, 286. 76
	BCE INC	10, 656	56. 75	604, 728. 00
	BLACKBERRY LTD	34, 328	7. 01	240, 639. 28
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	84, 700	53. 32	4, 516, 204. 00
	CAE INC	16, 878	31. 00	523, 218. 00

CAMECO CORP	24, 609	12. 91	317, 702. 19	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	28, 190	109. 44	3, 085, 113. 60	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	45, 584	142. 90	6, 513, 953. 60	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	74, 525	27. 93	2, 081, 483. 25	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8, 734	441. 35	3, 854, 750. 90	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3, 642	160. 88	585, 924. 96	
CANADIAN UTILITIES LTD -A	8, 568	31. 20	267, 321. 60	
CANOPY GROWTH CORP	14, 548	31. 21	454, 043. 08	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9, 608	58. 59	562, 932. 72	
CENOVUS ENERGY INC	65, 598	6. 04	396, 211. 92	
CGI INC	14, 410	91. 46	1, 317, 938. 60	
CI FINANCIAL CORP	12, 964	17. 26	223, 758. 64	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1, 274	1, 551. 77	1, 976, 954. 98	
CRONOS GROUP INC	12, 474	9. 41	117, 380. 34	
DOLLARAMA INC	18, 762	49. 99	937, 912. 38	
EMERA INC	16, 065	54. 90	881, 968. 50	
EMPIRE CO LTD 'A'	10, 682	35. 89	383, 376. 98	
ENBRIDGE INC	128, 450	38. 07	4, 890, 091. 50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1, 703	438. 70	747, 106. 10	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	37, 006	16. 79	621, 330. 74	
FORTIS INC	30, 001	53. 03	1, 590, 953. 03	
FRANCO-NEVADA CORP	11, 985	166. 81	1, 999, 217. 85	
GEORGE WESTON LTD	4, 919	97. 29	478, 569. 51	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12, 629	33. 78	426, 607. 62	
GREAT-WEST LIFECO INC	18, 228	30. 16	549, 756. 48	
HYDRO ONE LTD	21, 626	28. 47	615, 692. 22	
IA FINANCIAL CORP INC	6, 654	57. 65	383, 603. 10	
IGM FINANCIAL INC	5, 434	34. 15	185, 571. 10	
IMPERIAL OIL LTD	15, 961	22. 59	360, 558. 99	
INTACT FINANCIAL CORP	9, 078	147. 81	1, 341, 819. 18	
INTER PIPELINE LTD	27, 062	12. 31	333, 133. 22	
KEYERA CORP	13, 759	21. 99	302, 560. 41	
KINROSS GOLD CORP	78, 465	9. 81	769, 741. 65	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	16, 627	52. 85	878, 736. 95	
LOBLAW COS LTD	11, 249	64. 28	723, 085. 72	
LUNDIN MINING CORP	41, 115	8. 81	362, 223. 15	
MAGNA INTERNATIONAL INC	18, 137	79. 26	1, 437, 538. 62	
MANULIFE FINANCIAL CORP	122, 597	21. 75	2, 666, 484. 75	
METRO INC	16, 112	60. 34	972, 198. 08	
NATIONAL BANK OF CANADA	21, 277	70. 47	1, 499, 390. 19	
NUTRIEN LTD	36, 041	58. 53	2, 109, 479. 73	
ONEX CORPORATION	5, 311	69. 55	369, 380. 05	
OPEN TEXT CORP	17, 423	55. 65	969, 589. 95	

PAN AMERICAN SILVER CORP	13, 322	39. 64	528, 084. 08	
PARKLAND CORP	9, 584	40. 25	385, 756. 00	
PEMBINA PIPELINE CORP	34, 762	31. 49	1, 094, 655. 38	
POWER CORP OF CANADA	35, 742	29. 24	1, 045, 096. 08	
QUEBECOR INC -CL B	11, 707	32. 49	380, 360. 43	
RESTAURANT BRANDS INTERN	18, 094	77. 84	1, 408, 436. 96	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6, 927	84. 79	587, 340. 33	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	22, 880	59. 76	1, 367, 308. 80	
ROYAL BANK OF CANADA	90, 065	103. 97	9, 364, 058. 05	
SAPUTO INC	15, 585	34. 09	531, 292. 65	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30, 251	23. 08	698, 193. 08	
SHOPIFY INC - CLASS A	6, 794	1, 262. 00	8, 574, 028. 00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	37, 039	58. 87	2, 180, 485. 93	
SUNCOR ENERGY INC	96, 252	20. 14	1, 938, 515. 28	
TC ENERGY CORP	59, 528	55. 46	3, 301, 422. 88	
TECK RESOURCES LTD-CL B	29, 576	19. 38	573, 182. 88	
THOMSON REUTERS CORP	11, 068	105. 20	1, 164, 353. 60	
TMX GROUP LTD	3, 652	126. 46	461, 831. 92	
TORONTO-DOMINION BANK	114, 324	68. 41	7, 820, 904. 84	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28, 342	53. 49	1, 516, 013. 58	
WSP GLOBAL INC	7, 204	94. 11	677, 968. 44	
YAMANA GOLD INC	59, 685	6. 90	411, 826. 50	
カナダ・ドル 小計	2, 442, 000		121, 709, 490. 36 (9, 667, 384, 819)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	175, 100	2. 98	521, 798. 00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29, 700	7. 58	225, 126. 00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	113, 400	24. 42	2, 769, 228. 00
	GENTING SINGAPORE LTD	376, 000	0. 82	308, 320. 00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6, 100	20. 60	125, 660. 00
	KEPPEL CORP LTD	94, 300	5. 07	478, 101. 00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	209, 300	9. 79	2, 049, 047. 00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	87, 400	4. 06	354, 844. 00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	50, 600	9. 08	459, 448. 00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	99, 500	3. 91	389, 045. 00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	522, 900	2. 39	1, 249, 731. 00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	74, 400	22. 41	1, 667, 304. 00
	UOL Group Limited	29, 800	7. 41	220, 818. 00
	VENTURE CORP LTD	17, 500	18. 92	331, 100. 00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	119, 100	4. 25	506, 175. 00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	158, 000	0. 92	145, 360. 00
シンガポール・ドル 小計	2, 163, 100		11, 801, 105. 00 (911, 753, 372)	

スイス・フラン	ABB LTD	116, 599	24. 54	2, 861, 339. 46	
	ADECCO GROUP AG-REG	9, 843	52. 14	513, 214. 02	
	ALCON INC	31, 058	57. 40	1, 782, 729. 20	
	BALOISE HOLDING AG	2, 953	157. 90	466, 278. 70	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2, 080	97. 10	201, 968. 00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	190	1, 988. 00	377, 720. 00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	68	7, 905. 00	537, 540. 00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	84, 000. 00	504, 000. 00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	33, 006	75. 14	2, 480, 070. 84	
	CLARIANT AG	12, 709	17. 94	228, 063. 00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	152, 491	11. 10	1, 692, 650. 10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	510	819. 50	417, 945. 00	
	GEBERIT AG-REG	2, 338	556. 00	1, 299, 928. 00	
	GIVAUDAN-REG	584	3, 646. 00	2, 129, 264. 00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14, 202	49. 51	703, 141. 02	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3, 442	192. 00	660, 864. 00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	32, 996	46. 28	1, 527, 054. 88	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10, 274	74. 90	769, 522. 60	
	LONZA GROUP AG	4, 712	583. 20	2, 748, 038. 40	
	NESTLE SA	187, 878	104. 12	19, 561, 857. 36	
	NOVARTIS AG	140, 231	79. 10	11, 092, 272. 10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1, 181	946. 60	1, 117, 934. 60	
	ROCHE HOLDING AG	44, 343	305. 65	13, 553, 437. 95	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1, 390	246. 00	341, 940. 00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2, 471	251. 20	620, 715. 20	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	382	2, 642. 00	1, 009, 244. 00	
	SIKA AG-BEARER	8, 965	235. 60	2, 112, 154. 00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3, 454	223. 40	771, 623. 60	
	STRAUMANN HOLDING AG	654	1, 047. 50	685, 065. 00	
	SWATCH GROUP AG	1, 720	232. 40	399, 728. 00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2, 028	399. 00	809, 172. 00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5, 045	84. 45	426, 050. 25	
	SWISS RE AG	18, 706	81. 26	1, 520, 049. 56	
	SWISSCOM AG	1, 683	478. 80	805, 820. 40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	4, 216	112. 85	475, 775. 60	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	3, 716	45. 30	168, 334. 80	
	UBS GROUP AG	231, 231	13. 10	3, 029, 126. 10	
	VIFOR PHARMA AG	2, 873	124. 50	357, 688. 50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9, 510	365. 80	3, 478, 758. 00	
スイス・フラン	小計	1, 101, 738		84, 238, 078. 24 (9, 610, 722, 346)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	19, 932	204. 80	4, 082, 073. 60	

ASSA ABLOY AB	63, 600	216. 50	13, 769, 400. 00	
ATLAS COPCO AB	24, 527	386. 30	9, 474, 780. 10	
ATLAS COPCO AB-A SHS	42, 579	440. 60	18, 760, 307. 40	
BOLIDEN AB	16, 985	275. 60	4, 681, 066. 00	
ELECTROLUX AB	14, 442	205. 50	2, 967, 831. 00	
EPIROC AB-A	41, 814	144. 50	6, 042, 123. 00	
EPIROC AB-B	24, 666	137. 70	3, 396, 508. 20	
EQT AB	15, 060	195. 90	2, 950, 254. 00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	38, 582	270. 50	10, 436, 431. 00	
EVOLUTION GAMING GROUP	7, 992	649. 80	5, 193, 201. 60	
HENNES & MAURITZ AB	50, 726	173. 00	8, 775, 598. 00	
HEXAGON AB-B SHS	17, 833	707. 40	12, 615, 064. 20	
HUSQVARNA AB-B SHS	26, 592	91. 38	2, 429, 976. 96	
ICA GRUPPEN AB	6, 371	413. 00	2, 631, 223. 00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9, 865	258. 60	2, 551, 089. 00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9, 399	229. 00	2, 152, 371. 00	
INVESTOR AB	28, 490	598. 00	17, 037, 020. 00	
KINNEVIK AB - B	14, 898	399. 40	5, 950, 261. 20	
LUNDBERGS AB-B SHS	4, 769	446. 40	2, 128, 881. 60	
LUNDIN ENERGY AB	11, 665	207. 80	2, 423, 987. 00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	19, 979	238. 80	4, 770, 985. 20	
NORDEA BANK ABP	204, 714	73. 71	15, 089, 468. 94	
SANDVIK AB	71, 236	187. 25	13, 338, 941. 00	
SECURITAS AB	20, 137	144. 80	2, 915, 837. 60	
SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A	103, 169	91. 24	9, 413, 139. 56	
SKANSKA AB-B SHS	21, 687	205. 30	4, 452, 341. 10	
SKF AB	24, 115	201. 80	4, 866, 407. 00	
SVENSKA CELLULOSA AB	37, 914	134. 55	5, 101, 328. 70	
SVENSKA HANDELSBANKEN	98, 738	85. 26	8, 418, 401. 88	
SWEDBANK AB - A SHARES	56, 965	155. 60	8, 863, 754. 00	
SWEDISH MATCH AB	10, 266	708. 00	7, 268, 328. 00	
TELE2 AB	32, 843	107. 75	3, 538, 833. 25	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	184, 131	104. 35	19, 214, 069. 85	
TELIA CO AB	161, 080	36. 25	5, 839, 150. 00	
VOLVO AB	94, 159	199. 85	18, 817, 676. 15	
スウェーデン・クローナ 小計	1, 631, 920		272, 358, 110. 09 (3, 290, 085, 969)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	210	10, 520. 00	2, 209, 200. 00
	A P MOLLER - MAERSK A/S	414	11, 385. 00	4, 713, 390. 00
	AMBU A/S-B	10, 275	199. 00	2, 044, 725. 00
	CARLSBERG AS-B	6, 509	946. 40	6, 160, 117. 60
	CHR HANSEN HOLDING A/S	6, 672	647. 80	4, 322, 121. 60
	COLOPLAST-B	7, 471	935. 20	6, 986, 879. 20
	DANSKE BANK A/S	43, 324	102. 55	4, 442, 876. 20
	DEMANT A/S	6, 793	215. 00	1, 460, 495. 00
	DSV PANALPINA A/S	13, 167	1, 005. 00	13, 232, 835. 00
	GENMAB A/S	4, 118	2, 275. 00	9, 368, 450. 00
	GN STORE NORD A/S	8, 092	465. 10	3, 763, 589. 20
	H LUNDBECK A/S	4, 415	191. 75	846, 576. 25
	NOVO-NORDISK A/S	108, 604	421. 95	45, 825, 457. 80

NOVOZYMES A/S	13, 070	370. 80	4, 846, 356. 00	
ORSTED A/S	11, 988	1, 102. 50	13, 216, 770. 00	
PANDORA A/S	6, 298	610. 00	3, 841, 780. 00	
TRYGVESTA AS	7, 838	180. 00	1, 410, 840. 00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12, 437	1, 192. 00	14, 824, 904. 00	
デンマーク・クローネ 小計	271, 695		143, 517, 362. 85 (2, 375, 212, 355)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	46, 911	14. 54	682, 085. 94
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82, 703	7. 72	638, 467. 16
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36, 340	33. 44	1, 215, 209. 60
	MERCURY NZ LTD	46, 488	5. 88	273, 349. 44
	MERIDIAN ENERGY LTD	82, 903	5. 97	494, 930. 91
	RYMAN HEALTHCARE LTD	25, 957	15. 51	402, 593. 07
	SPARK NEW ZEALAND LTD	123, 265	4. 53	559, 006. 77
ニュージーランド・ドル 小計	444, 567		4, 265, 642. 89 (306, 145, 190)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	15, 212	134. 50	2, 046, 014. 00
	DNB ASA	60, 129	157. 10	9, 446, 265. 90
	EQUINOR ASA	62, 823	136. 65	8, 584, 762. 95
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12, 951	195. 60	2, 533, 215. 60
	MOWI ASA	28, 024	176. 25	4, 939, 230. 00
	NORSK HYDRO ASA	84, 406	34. 30	2, 895, 125. 80
	ORKLA ASA	47, 790	86. 00	4, 109, 940. 00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6, 303	308. 00	1, 941, 324. 00
	TELENOR ASA	47, 792	151. 75	7, 252, 436. 00
	YARA INTERNATIONAL ASA	11, 144	360. 50	4, 017, 412. 00
ノルウェー・クローネ 小計	376, 574		47, 765, 726. 25 (550, 738, 824)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	27, 207	9. 06	246, 604. 24
	ACCOR	12, 077	29. 38	354, 822. 26
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	17, 044	25. 53	435, 133. 32
	ADIDAS AG	12, 025	282. 00	3, 391, 050. 00
	ADP	2, 050	113. 40	232, 470. 00
	ADYEN NV	1, 144	1, 592. 00	1, 821, 248. 00
	AEGON NV	111, 337	2. 99	333, 008. 96
	AENA SME SA	4, 385	143. 00	627, 055. 00
	AGEAS	10, 945	40. 90	447, 650. 50
	AIR LIQUIDE	29, 910	138. 85	4, 153, 003. 50
	AIRBUS SE	37, 204	89. 33	3, 323, 433. 32
	AKZO NOBEL NV	12, 221	87. 00	1, 063, 227. 00
	ALLIANZ SE	26, 300	194. 84	5, 124, 292. 00
	ALSTOM RGPT	12, 195	43. 50	530, 482. 50
	ALSTOM SA - RIGHTS	12, 195	4. 30	52, 438. 50
	ALTICE NV - A-W/I	40, 475	4. 32	174, 852. 00
	AMADEUS IT GROUP SA	28, 452	59. 50	1, 692, 894. 00
	AMUNDI SA	3, 835	68. 50	262, 697. 50
	ANDRITZ AG	4, 653	33. 88	157, 643. 64
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	48, 215	55. 17	2, 660, 021. 55
	ARCELORMITTAL	45, 299	13. 74	622, 680. 05

ARGENX SE	2, 844	222. 60	633, 074. 40	
ARKEMA	4, 345	91. 68	398, 349. 60	
AROUNDTOWN SA	74, 088	5. 52	409, 262. 11	
ASML HOLDING NV	26, 886	355. 45	9, 556, 628. 70	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	69, 699	14. 07	980, 664. 93	
ATLANTIA SPA	31, 644	14. 64	463, 426. 38	
ATOS SE	6, 165	69. 80	430, 317. 00	
AXA SA	121, 931	18. 93	2, 308, 397. 69	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	417, 805	3. 57	1, 492, 399. 46	
BANCO SANTANDER SA	1, 048, 964	2. 32	2, 437, 792. 33	
BANCO SANTANDER SA - RIGHTS	1, 048, 964	0. 10	104, 896. 40	
BANKINTER SA	42, 563	4. 22	179, 700. 98	
BASF SE	57, 984	57. 78	3, 350, 315. 52	
BAYER AG	62, 087	46. 39	2, 880, 526. 36	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20, 961	74. 00	1, 551, 114. 00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3, 585	55. 05	197, 354. 25	
BEIERSDORF AG	6, 349	97. 10	616, 487. 90	
BIOMERIEUX	2, 606	119. 40	311, 156. 40	
BNP PARIBAS	70, 779	40. 80	2, 888, 137. 09	
BOLLORE	58, 512	3. 40	198, 940. 80	
BOUYGUES	14, 421	33. 58	484, 257. 18	
BRENNTAG AG	9, 695	63. 24	613, 111. 80	
BUREAU VERITAS SA	18, 926	21. 42	405, 394. 92	
CAIXABANK	221, 578	2. 18	485, 034. 24	
CAPGEMINI SA	10, 163	116. 65	1, 185, 513. 95	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2, 543	116. 90	297, 276. 70	
CARREFOUR SA	37, 949	14. 13	536, 409. 11	
CELLNEX TELECOM SAU	20, 167	51. 82	1, 045, 053. 94	
CIE DE SAINT-GOBAIN	32, 752	39. 41	1, 290, 756. 32	
CNH INDUSTRIAL NV	65, 093	8. 89	578, 676. 77	
CNP ASSURANCES	10, 739	12. 68	136, 170. 52	
COLRUYT NV	3, 400	49. 75	169, 150. 00	
COMMERZBANK AG	62, 289	4. 93	307, 333. 92	
CONTINENTAL AG	6, 957	110. 50	768, 748. 50	
COVESTRO AG	10, 884	46. 19	502, 731. 96	
CREDIT AGRICOLE SA	72, 159	8. 87	640, 194. 64	
CRH PLC	49, 375	33. 21	1, 639, 743. 75	
DAIMLER AG	54, 060	55. 07	2, 977, 084. 20	
DANONE	39, 020	52. 90	2, 064, 158. 00	
DASSAULT AVIATION SA	153	909. 50	139, 153. 50	
DASSAULT SYSTEMES SA	8, 371	155. 90	1, 305, 038. 90	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	36, 437	9. 57	348, 993. 58	
DELIVERY HERO SE	8, 155	99. 50	811, 422. 50	
DEUTSCHE BANK AG	124, 082	8. 99	1, 115, 621. 26	
DEUTSCHE BOERSE AG	11, 984	134. 80	1, 615, 443. 20	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	18, 971	9. 47	179, 807. 13	
DEUTSCHE POST AG	62, 890	39. 10	2, 458, 999. 00	
DEUTSCHE TELEKOM AG	211, 324	14. 85	3, 138, 161. 40	
DEUTSCHE WOHNEN SE	21, 667	42. 48	920, 414. 16	

DIASORIN SPA	1, 573	172. 60	271, 499. 80	
E. ON SE	142, 589	9. 05	1, 290, 430. 45	
EDENRED	15, 592	45. 23	705, 226. 16	
EDF	39, 509	11. 90	470, 354. 64	
EIFFAGE	5, 427	82. 84	449, 572. 68	
ELIA GROUP SA/NV	1, 983	93. 40	185, 212. 20	
ELISA OYJ	9, 187	45. 26	415, 803. 62	
ENAGAS SA	15, 518	20. 01	310, 515. 18	
ENDESA SA	20, 189	24. 69	498, 466. 41	
ENEL SPA	513, 685	8. 16	4, 193, 724. 34	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	176, 575	4. 44	785, 582. 17	
ENGIE	115, 583	12. 05	1, 393, 353. 06	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	159, 886	8. 07	1, 291, 399. 22	
ERSTE GROUP BANK AG	17, 761	23. 74	421, 646. 14	
ESSILORLUXOTTICA	18, 012	114. 15	2, 056, 069. 80	
EURAZEO	2, 583	51. 75	133, 670. 25	
EUROFINS SCIENTIFIC	8, 360	72. 44	605, 598. 40	
EVONIK INDUSTRIES AG	13, 038	23. 63	308, 087. 94	
EXOR NV	6, 823	56. 86	387, 955. 78	
FAURECIA	4, 849	40. 25	195, 172. 25	
FERRARI NV	7, 961	179. 95	1, 432, 581. 95	
FERROVIAL S. A.	31, 350	23. 08	723, 558. 00	
FERROVIAL SA-RTS	31, 350	0. 23	7, 461. 30	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	69, 100	12. 94	894, 154. 00	
FINECOBANK SPA	38, 343	12. 46	477, 753. 78	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	9, 708	142. 20	1, 380, 477. 60	
FORTUM OYJ	28, 061	17. 58	493, 312. 38	
FRAPORT AG	3, 074	45. 86	140, 973. 64	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO. KGAA	13, 435	71. 24	957, 109. 40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26, 322	37. 64	990, 760. 08	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	4, 215	48. 48	204, 343. 20	
GALAPAGOS NV	2, 705	104. 00	281, 320. 00	
GALP ENERGIA SGPS SA	31, 316	8. 82	276, 207. 12	
GEA GROUP AG	9, 630	28. 60	275, 418. 00	
GETLINK SE - REGR	29, 368	14. 49	425, 542. 32	
GRIFOLS SA	18, 825	25. 20	474, 390. 00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7, 205	80. 70	581, 443. 50	
HANNOVER RUECK SE	3, 787	144. 80	548, 357. 60	
HEIDELBERGCEMENT AG	9, 307	58. 38	543, 342. 66	
HEINEKEN HOLDING NV	7, 345	79. 30	582, 458. 50	
HEINEKEN NV	16, 411	90. 20	1, 480, 272. 20	
HENKEL AG & CO KGAA	6, 683	78. 15	522, 276. 45	
HENKEL KGAA-VORZUG	11, 098	87. 12	966, 857. 76	
HERMES INTERNATIONAL	2, 002	848. 40	1, 698, 496. 80	
HOCHTIEF AG	1, 687	76. 85	129, 645. 95	
IBERDROLA SA	374, 452	11. 36	4, 253, 774. 72	
ILIAD SA	954	173. 70	165, 709. 80	
INDITEX SA	68, 590	26. 97	1, 849, 872. 30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	78, 977	27. 06	2, 137, 117. 62	

INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15, 629	10. 41	162, 697. 89	
ING GROEP NV-CVA	246, 213	7. 69	1, 894, 855. 24	
INTESA SANPAOLO	1, 038, 673	1. 85	1, 925, 699. 74	
IPSEN	2, 378	83. 50	198, 563. 00	
JC DECAUX SA	5, 690	19. 50	110, 955. 00	
JERONIMO MARTINS	15, 498	13. 91	215, 654. 67	
JUST EAT TAKEAWAY	8, 000	90. 00	720, 000. 00	
KBC GROEP NV	15, 741	56. 76	893, 459. 16	
KERING	4, 788	612. 00	2, 930, 256. 00	
KERRY GROUP PLC-A	10, 028	119. 80	1, 201, 354. 40	
KINGSPAN GROUP PLC	9, 717	74. 90	727, 803. 30	
KION GROUP AG	4, 094	66. 70	273, 069. 80	
KNORR-BREMSE AG	3, 070	106. 76	327, 753. 20	
KONE OYJ	21, 470	70. 40	1, 511, 488. 00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	69, 409	23. 52	1, 632, 499. 68	
KONINKLIJKE DSM NV	10, 888	141. 75	1, 543, 374. 00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	57, 699	43. 57	2, 514, 233. 92	
L'OREAL SA	15, 893	310. 80	4, 939, 544. 40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5, 372	34. 51	185, 387. 72	
LANXESS	5, 168	53. 82	278, 141. 76	
LEG IMMOBILIEN AG	4, 382	118. 12	517, 601. 84	
LEGRAND SA	16, 872	71. 80	1, 211, 409. 60	
LEONARDO SPA	24, 549	5. 68	139, 585. 61	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	17, 554	488. 65	8, 577, 762. 10	
MAPFRE SA	64, 900	1. 58	102, 542. 00	
MEDIOBANCA SPA	39, 557	7. 56	299, 130. 03	
MERCK KGAA	8, 130	128. 45	1, 044, 298. 50	
METRO AG	11, 489	8. 05	92, 486. 45	
MICHELIN (C. G. D. E.)	10, 696	106. 95	1, 143, 937. 20	
MONCLER SPA	12, 195	40. 60	495, 117. 00	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3, 353	196. 00	657, 188. 00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	8, 822	236. 10	2, 082, 874. 20	
NATIXIS	59, 796	2. 52	150, 745. 71	
NATURGY ENERGY GROUP SA	18, 750	19. 07	357, 656. 25	
NEMETSCHEK SE	3, 641	63. 90	232, 659. 90	
NESTE OYJ	26, 600	53. 90	1, 433, 740. 00	
NEXI SPA	23, 761	15. 31	363, 780. 91	
NN GROUP NV	18, 106	34. 48	624, 294. 88	
NOKIA OYJ	356, 618	3. 25	1, 159, 365. 11	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	4, 337	56. 00	242, 872. 00	
OMV AG	8, 988	28. 22	253, 641. 36	
ORANGE S. A.	127, 734	10. 38	1, 326, 517. 59	
ORION OYJ-CLASS B	6, 599	39. 58	261, 188. 42	
ORPEA	3, 304	106. 75	352, 702. 00	
PERNOD-RICARD	13, 413	160. 90	2, 158, 151. 70	
PEUGEOT SA	36, 663	19. 56	717, 311. 59	
PIRELLI & C SPA	25, 272	4. 19	105, 940. 22	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	9, 375	56. 52	529, 875. 00	

POSTE ITALIANE SPA	34, 740	8. 71	302, 863. 32	
PROSUS	30, 789	87. 74	2, 701, 426. 86	
PROXIMUS	10, 039	17. 29	173, 574. 31	
PRYSMIAN SPA	15, 169	25. 40	385, 292. 60	
PUBLICIS GROUPE	13, 740	38. 10	523, 494. 00	
PUMA AG	5, 269	83. 96	442, 385. 24	
QIAGEN NV	14, 403	40. 00	576, 120. 00	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	9, 281	15. 78	146, 454. 18	
RANDSTAD NV	7, 482	49. 56	370, 807. 92	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6, 582	45. 79	301, 389. 78	
RED ELECTRICA DE ESPANA	27, 284	16. 52	450, 731. 68	
REMY COINTREAU	1, 425	152. 70	217, 597. 50	
RENAULT SA	12, 357	31. 14	384, 858. 76	
REPSOL SA	94, 157	7. 74	729, 340. 12	
ROYAL KPN NV	231, 330	2. 59	599, 838. 69	
RWE AG	40, 448	34. 06	1, 377, 658. 88	
SAFRAN SA	20, 246	120. 25	2, 434, 581. 50	
SAMPO OYJ	29, 791	36. 57	1, 089, 456. 87	
SANOFI	71, 418	85. 64	6, 116, 237. 52	
SAP SE	65, 929	99. 42	6, 554, 661. 18	
SARTORIUS AG-VORZUG	2, 245	370. 20	831, 099. 00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1, 751	304. 80	533, 704. 80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34, 908	118. 75	4, 145, 325. 00	
SCOR REGROUPE	9, 908	28. 94	286, 737. 52	
SCOUT24 AG	6, 739	64. 70	436, 013. 30	
SEB SA	1, 427	147. 40	210, 339. 80	
SIEMENS AG	48, 296	109. 80	5, 302, 900. 80	
SIEMENS ENERGY AG	24, 148	24. 19	584, 140. 12	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15, 094	27. 51	415, 235. 94	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	9, 400	37. 27	350, 385. 00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14, 247	36. 08	514, 031. 76	
SNAM SPA	128, 271	4. 67	599, 410. 38	
SOCIETE GENERALE	50, 883	16. 18	823, 592. 23	
SODEXO	5, 558	70. 54	392, 061. 32	
SOFINA	915	258. 00	236, 070. 00	
SOLVAY SA	4, 728	89. 10	421, 264. 80	
STMICROELECTRONICS NV	40, 253	30. 40	1, 223, 691. 20	
STORA ENSO OYJ	36, 391	13. 65	496, 737. 15	
SUEZ	22, 345	16. 13	360, 536. 57	
SYMRISE AG	8, 102	105. 20	852, 330. 40	
TEAMVIEWER AG	8, 201	38. 35	314, 508. 35	
TELECOM ITALIA SPA	864, 217	0. 36	311, 118. 12	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	70, 034	2. 32	163, 039. 15	
TELEFONICA SA	310, 536	3. 46	1, 075, 696. 70	
TELENET GROUP HOLDING NV	3, 012	34. 14	102, 829. 68	
TELEPERFORMANCE	3, 726	276. 30	1, 029, 493. 80	
TENARIS SA	28, 322	6. 26	177, 465. 65	
TERNA SPA	89, 202	6. 32	563, 935. 04	

THALES SA	6, 704	78. 70	527, 604. 80	
THYSSENKRUPP AG	26, 157	4. 73	123, 905. 70	
TOTAL SE	156, 046	34. 11	5, 322, 729. 06	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5, 745	80. 30	461, 323. 50	
UCB SA	7, 966	90. 94	724, 428. 04	
UMICORE	12, 393	35. 66	441, 934. 38	
UNICREDIT SPA	133, 655	8. 40	1, 122, 835. 65	
UNILEVER NV	92, 379	49. 55	4, 577, 379. 45	
UNIPER SE	12, 727	28. 08	357, 374. 16	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6, 714	32. 97	221, 360. 58	
UPM-KYMMENE OYJ	33, 644	26. 50	891, 566. 00	
VALEO SA	14, 502	31. 06	450, 432. 12	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	34, 286	18. 35	629, 319. 53	
VINCI SA	32, 701	86. 80	2, 838, 446. 80	
VIVENDI SA	52, 447	25. 50	1, 337, 398. 50	
VOESTALPINE AG	7, 372	25. 79	190, 123. 88	
VOLKSWAGEN AG	2, 214	161. 70	358, 003. 80	
VOLKSWAGEN AG	11, 639	152. 52	1, 775, 180. 28	
VONOVIA SE	32, 705	57. 96	1, 895, 581. 80	
VOPAK	4, 375	44. 23	193, 506. 25	
WARTSILA OYJ	28, 440	7. 80	221, 832. 00	
WENDEL	1, 805	93. 25	168, 316. 25	
WOLTERS KLUWER NV	17, 283	71. 14	1, 229, 512. 62	
WORLDLINE SA	8, 692	73. 66	640, 252. 72	
ZALANDO SE	9, 554	79. 18	756, 485. 72	
ユーロ 小計	13, 023, 873		255, 430, 298. 44 (31, 504, 773, 010)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	764, 275	88. 20	67, 409, 055. 00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	19, 500	87. 50	1, 706, 250. 00
	BANK OF EAST ASIA	86, 000	16. 04	1, 379, 440. 00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	238, 039	24. 60	5, 855, 759. 40
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	109, 100	27. 00	2, 945, 700. 00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	163, 909	43. 70	7, 162, 823. 30
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	170, 909	58. 05	9, 921, 267. 45
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	43, 500	40. 05	1, 742, 175. 00
	CLP HOLDINGS LTD	104, 643	73. 50	7, 691, 260. 50
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	135, 810	61. 30	8, 325, 153. 00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	131, 157	21. 15	2, 773, 970. 55
	HANG SENG BANK LTD	48, 812	132. 60	6, 472, 471. 20
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	99, 641	31. 35	3, 123, 745. 35
	HONG KONG & CHINA GAS	684, 750	12. 14	8, 312, 865. 00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	76, 111	370. 40	28, 191, 514. 40
	KERRY PROPERTIES LTD	45, 000	20. 75	933, 750. 00
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	46, 000	34. 55	1, 589, 300. 00
	MTR CORP	105, 755	42. 85	4, 531, 601. 75
	NEW WORLD DEVELOPMENT	100, 917	40. 35	4, 072, 000. 95
	PCCW LTD	333, 000	4. 75	1, 581, 750. 00

POWER ASSETS HOLDINGS LTD	88,587	41.20	3,649,784.40	
SANDS CHINA LTD	155,780	34.05	5,304,309.00	
SINO LAND CO	206,000	9.97	2,053,820.00	
SJM HOLDINGS LTD	127,000	9.38	1,191,260.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	83,023	106.60	8,850,251.80	
SWIRE PACIFIC LTD	32,866	46.60	1,531,555.60	
SWIRE PROPERTIES LTD	77,200	24.05	1,856,660.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	87,500	104.50	9,143,750.00	
WH GROUP LTD	604,500	6.72	4,062,240.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	106,733	39.05	4,167,923.65	
WYNN MACAU LTD	103,303	13.84	1,429,713.52	
香港・ドル 小計	5,179,320		218,963,120.82 (2,934,105,819)	
合計	69,243,684		285,514,371,822 (285,514,371,822)	

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	36,361.00	548,687.49	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,974.00	1,305,662.76	
		AMERICAN TOWER REIT INC	28,006.00	6,677,470.58	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	91,976.00	721,091.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,841.00	1,505,622.30	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,294.00	905,421.48	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,093.00	596,200.05	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,346.00	4,428,499.14	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,946.00	2,423,278.00	
		DUKE REALTY CORP	23,190.00	897,221.10	
		EQUINIX INC	5,591.00	4,084,728.69	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,892.00	661,362.24	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,424.00	1,402,160.64	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,096.00	1,040,998.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,161.00	919,091.82	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,500.00	408,555.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	33,843.00	1,035,595.80	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	44,490.00	642,880.50	
		INVITATION HOMES INC	34,301.00	963,172.08	
		IRON MOUNTAIN INC	18,437.00	475,490.23	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,466.00	643,551.18	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,158.00	902,910.12	

	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,649.00	427,344.37	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,366.00	495,770.66	
	PROLOGIS INC	46,617.00	4,661,233.83	
	PUBLIC STORAGE	9,898.00	2,264,563.42	
	REALTY INCOME CORP	21,571.00	1,318,203.81	
	REGENCY CENTERS CORP	10,662.00	509,217.12	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,050.00	2,099,208.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	19,312.00	1,557,126.56	
	SUN COMMUNITIES INC	6,197.00	866,960.30	
	UDR INC	18,617.00	722,339.60	
	VENTAS INC	23,527.00	1,143,882.74	
	VEREIT	67,671.00	498,058.56	
	VICI PROPERTIES INC	29,584.00	765,338.08	
	VORNADO REALTY TRUST	10,233.00	407,682.72	
	WELLTOWER INC	26,369.00	1,719,258.80	
	WP CAREY INC	10,869.00	761,156.07	
	アメリカ・ドル 小計	816,578.00	53,406,996.08 (5,547,918,753)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	56,005.00	268,880.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,529.00	304,355.71	
	SEGRO PLC	74,921.00	680,732.20	
	イギリス・ポンド 小計	175,455.00	1,253,967.91 (172,646,302)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	76,844.00	754,608.08	
	GOODMAN GROUP	107,643.00	2,010,771.24	
	GPT GROUP	133,044.00	610,671.96	
	MIRVAC GROUP	272,106.00	734,686.20	
	SCENTRE GROUP	337,233.00	937,507.74	
	STOCKLAND	155,645.00	700,402.50	
	VICINITY CENTRES	259,546.00	434,739.55	
	オーストラリア・ドル 小計	1,342,061.00	6,183,387.27 (467,464,078)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,229.00	260,195.04	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,901.00	105,861.34	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,861.00	169,905.03	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,851.00	118,898.01	
	カナダ・ドル 小計	26,842.00	654,859.42 (52,015,484)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	193,700.00	575,289.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	284,296.00	562,906.08	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	136,900.00	273,800.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	166,900.00	330,462.00	

	SUNTEC REIT	121,300.00	184,376.00	
シンガポール・ドル 小計		903,096.00	1,926,833.08 (148,867,124)	
ユーロ	COVIVIO	3,260.00	235,535.00	
	GECINA SA	2,838.00	367,521.00	
	ICADE	2,015.00	129,967.50	
	KLEPIERRE	12,326.00	221,683.11	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,720.00	491,808.00	
ユーロ 小計		29,159.00	1,446,514.61 (178,413,112)	
香港・ドル	LINK REIT	131,371.00	9,104,010.30	
香港・ドル 小計		131,371.00	9,104,010.30 (121,993,738)	
投資証券 合計			6,689,318,591 (6,689,318,591)	
合計			6,689,318,591 (6,689,318,591)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注) 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 590銘柄 投資証券 38銘柄	68.06% -%	-% 1.84%	71.99%
イギリス・ポンド	株式 84銘柄 投資証券 3銘柄	4.33% -%	-% 0.06%	4.52%
イスラエル・シユケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄 投資証券 7銘柄	2.07% -%	-% 0.16%	2.29%
カナダ・ドル	株式 80銘柄 投資証券 4銘柄	3.21% -%	-% 0.02%	3.33%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 5銘柄	0.30% -%	-% 0.05%	0.36%
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.19%	-%	3.29%
スウェーデン・クローナ	株式 36銘柄	1.09%	-%	1.13%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.79%	-%	0.81%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.10%	-%	0.10%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.18%	-%	0.19%
ユーロ	株式 240銘柄 投資証券 5銘柄	10.47% -%	-% 0.06%	10.84%
香港・ドル	株式 31銘柄 投資証券 1銘柄	0.98% -%	-% 0.04%	1.05%

(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。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等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。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	71,199,703	7,652,697
金銭信託	2,081,042	302,967
コール・ローン	83,698,699	66,397,624
株式	1,850,663,620	2,171,408,735
投資信託受益証券	84,830,276	92,267,409
投資証券	5,384,789	1,651,711
派生商品評価勘定	5,466,152	5,251,134
未収入金	1,096,470	—
未取配当金	1,291,471	1,048,398
差入委託証拠金	69,546,063	61,368,460
流動資産合計	2,175,258,285	2,407,349,135
資産合計	2,175,258,285	2,407,349,135
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	409,423	68,995
未払金	17,248	—
未払解約金	14,311,923	53,866,791
その他未払費用	658	131
流動負債合計	14,739,252	53,935,917
負債合計	14,739,252	53,935,917
純資産の部		
元本等		
元本	2,309,692,542	2,262,953,958
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△149,173,509	90,459,260
純資産合計	2,160,519,033	2,353,413,218
負債純資産合計	2,175,258,285	2,407,349,135

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
1. 受益権総口数	2,309,692,542口	2,262,953,958口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	149,173,509円	————
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9354円 (9,354円)	1.0400円 (10,400円)

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	自 2019年11月21日 至 2020年11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そのリスク	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。	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
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によって了場合、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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月20日現在	2020年11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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。</p> <p>(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。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	149,505,319	304,236,158
投資信託受益証券	△5,124,959	955,618
投資証券	337,833	△1,061,289
合計	144,718,193	304,130,487

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	2019年11月20日 現在			2020年11月20日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売 建	36,863,086	—	36,870,106	△7,020	—	—
アメリカ・ドル	36,859,164	—	36,866,200	△7,036	—	—
ブラジル・レアル	3,922	—	3,906	16	—	—
買 建	74,649,899	—	74,386,870	△263,029	9,512,722	—
アメリカ・ドル	74,649,899	—	74,386,870	△263,029	9,512,722	—
合計	111,512,985	—	111,256,976	△270,049	9,512,722	—
					9,449,440	△63,282

(注) 1. 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。

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2019年11月20日 現在			2020年11月20日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引						
先物取引						
買 建	178,059,035	—	183,385,812	5,326,777	76,010,554	—
合計	178,059,035	—	183,385,812	5,326,777	76,010,554	—
					81,255,974	5,245,420

(注) 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。

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年11月20日現在	2020年11月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	1,844,866,571円	2,309,692,542円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	1,061,417,332円	1,517,287,525円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	596,591,361円	1,564,026,109円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ新興国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	787,226,995円	一円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	1,413,724,632円	2,004,009,065円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	49,901,389円	11,629,773円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	7,015,043円	11,202,847円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	2,005,205円	3,164,605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）	32,645,881円	36,171,367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）	一円	72,576,677円
DCニッセイ新興国株式インデックス	17,173,397円	124,199,624円
計	2,309,692,542円	2,262,953,958円

附属明細表（2020年11月20日現在）

第1 有価証券明細表

① 株式

通 貨	銘 柄	株 式 数	評価額		備 考
			単 價	金 額	
アメリカ・ドル	51JOB INC-ADR	100	71.00	7,100.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	5,767	259.89	1,498,785.63	
	AUTOHOME INC-ADR	234	99.84	23,362.56	
	BAIDU INC - SPON ADR	863	136.48	117,782.24	
	BAOZUN INC-SPN ADR	100	40.78	4,078.00	
	BEST INC - ADR	800	3.01	2,408.00	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	400	58.46	23,384.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	11.43	6,092.19	
	CREDICORP LTD	182	133.59	24,313.38	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	200	87.90	17,580.00	
	GLOBANT SA	100	187.63	18,763.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	300	71.35	21,405.00	
	HUAZHU GROUP LIMITED ADR	400	53.56	21,424.00	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	200	30.41	6,082.00	
	HYUA INC-ADR	200	20.99	4,198.00	

INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	2, 100	0. 64	1, 352. 40	
IQIYI INC-ADR	900	22. 60	20, 340. 00	
JD. COM INC-ADR	2, 650	86. 04	228, 006. 00	
JOYY INC	134	86. 11	11, 538. 74	
KE HOLDINGS INC	300	59. 35	17, 805. 00	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	1, 286	64. 42	82, 844. 12	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1, 208	15. 21	18, 373. 68	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	870	7. 08	6, 159. 60	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC	1, 682	8. 37	14, 078. 34	
MOMO INC-SPON ADR	466	15. 24	7, 101. 84	
NETEASE. COM INC -ADR	1, 490	89. 22	132, 937. 80	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	433	180. 67	78, 230. 11	
NIO INC - ADR	2, 800	48. 45	135, 660. 00	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	100	31. 75	3, 175. 00	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	308	163. 10	50, 234. 80	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	396	25. 00	9, 900. 00	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	556	13. 28	7, 383. 68	
PINDUODUO INC-ADR	800	137. 66	110, 128. 00	
PJSC GAZPROM ADR	18, 326	4. 77	87, 451. 67	
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	2, 128	27. 03	57, 519. 84	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	193	101. 80	19, 647. 40	
ROSNEFT OJSC-GDR	4, 582	5. 90	27, 052. 12	
SBERBANK PAO - SPONSORED ADR	8, 282	13. 00	107, 707. 41	
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1, 099	14. 34	15, 759. 66	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	2, 280	0. 82	1, 883. 28	
SINA CORP	234	43. 33	10, 139. 22	
SOUTHERN COPPER CORP	234	56. 05	13, 115. 70	
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	3, 070	4. 77	14, 656. 18	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	1, 224	74. 75	91, 494. 00	
TATNEFT-SPONSORED ADR	740	39. 96	29, 570. 40	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1, 500	16. 40	24, 600. 00	
TRIP. COM GROUP LTD	1, 427	33. 68	48, 061. 36	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1, 415	23. 32	32, 997. 80	
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6, 620	0. 91	6, 057. 30	
WEIBO CORP-SPON ADR	134	45. 41	6, 084. 94	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	35. 54	14, 997. 88	
YANDEX NV-A	900	62. 53	56, 277. 00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	1, 091	60. 25	65, 732. 75	

	ZAI LAB LTD-ADR	200	103.63	20,726.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC -ADR	1,200	29.99	35,988.00	
アメリカ・ドル	小計	86,159		3,519,527.02 (365,608,467)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	717	16.78	12,034.84	
イギリス・ポンド	小計	717		12,034.84 (1,656,957)	
インド・ルピー	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	1,512	381.90	577,432.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,593	258.70	670,809.10	
	ASIAN PAINTS LTD	922	2,161.70	1,993,087.40	
	AUROBINDO PHARMA LTD	802	830.15	665,780.30	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	432	2,392.20	1,033,430.40	
	AXIS BANK LTD	6,840	611.50	4,182,660.00	
	BAJAJ AUTO LTD	269	3,034.25	816,213.25	
	BAJAJ FINANCE LTD	564	4,536.55	2,558,614.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	119	7,823.40	930,984.60	
	BANDHAN BANK LTD	1,335	352.60	470,721.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	919	636.80	585,219.20	
	BHARAT FORGE LTD	429	510.00	218,790.00	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	2,261	383.70	867,545.70	
	BHARTI AIRTEL LTD	3,760	468.55	1,761,748.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	733	185.90	136,264.70	
	BIOCON LTD	1,590	422.75	672,172.50	
	BOSCH LTD	15	11,927.55	178,913.25	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	163	3,511.35	572,350.05	
	CIPLA LIMITED	1,072	742.10	795,531.20	
	COAL INDIA LTD	3,906	122.05	476,727.30	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	277	1,516.80	420,153.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	611	408.25	249,440.75	
	DABUR INDIA LTD	1,654	507.30	839,074.20	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	245	3,435.05	841,587.25	
	DLF LTD	2,165	184.90	400,308.50	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	348	4,707.70	1,638,279.60	
	EICHER MOTORS LTD	350	2,551.25	892,937.50	
	GAIL INDIA LTD	4,264	93.65	399,323.60	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	1,109	684.90	759,554.10	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	864	836.75	722,952.00	
	HAVELLS INDIA LTD	799	827.80	661,412.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	3,436	804.55	2,764,433.80	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	153	2,424.75	370,986.75	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	2,013	646.05	1,300,498.65	
	HERO MOTOCORP LTD	409	2,988.50	1,222,296.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	3,542	213.85	757,456.70	

HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1, 930	213. 35	411, 765. 50	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	2, 526	2, 130. 75	5, 382, 274. 50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	5, 049	2, 324. 60	11, 736, 905. 40	
ICICI BANK LTD	15, 758	478. 75	7, 544, 142. 50	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	863	1, 296. 45	1, 118, 836. 35	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	1, 143	441. 30	504, 405. 90	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	5, 990	84. 70	507, 353. 00	
INFO EDGE INDIA LTD	218	3, 834. 20	835, 855. 60	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	10, 512	1, 096. 75	11, 529, 036. 00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	203	1, 687. 95	342, 653. 85	
ITC LTD	10, 481	187. 90	1, 969, 379. 90	
JSW STEEL LTD	2, 559	331. 20	847, 540. 80	
JUBILANT FOODWORKS LTD	195	2, 510. 35	489, 518. 25	
LARSEN & TOUBRO LTD	1, 377	1, 134. 25	1, 561, 862. 25	
LIC HOUSING FINANCE LTD	589	328. 85	193, 692. 65	
LUPIN LTD	907	884. 40	802, 150. 80	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	2, 407	703. 90	1, 694, 287. 30	
MARICO LTD	1, 422	367. 35	522, 371. 70	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	362	6, 963. 30	2, 520, 714. 60	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2, 044	136. 75	279, 517. 00	
NESTLE INDIA LTD	62	16, 934. 15	1, 049, 917. 30	
NTPC LTD	10, 161	89. 80	912, 457. 80	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	7, 934	72. 15	572, 438. 10	
PAGE INDUSTRIES LTD	14	21, 913. 45	306, 788. 30	
PETRONET LNG LTD	1, 873	253. 85	475, 461. 05	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	443	1, 558. 40	690, 371. 20	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	268	1, 393. 05	373, 337. 40	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	5, 845	189. 80	1, 109, 381. 00	
REC LTD	1, 368	114. 40	156, 499. 20	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	8, 808	1, 973. 15	17, 379, 505. 20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	1, 140	846. 75	965, 295. 00	
SHREE CEMENT LTD	26	23, 661. 65	615, 202. 90	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	328	911. 80	299, 070. 40	
STATE BANK OF INDIA	5, 790	239. 75	1, 388, 152. 50	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	2, 759	507. 35	1, 399, 778. 65	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	2, 775	2, 636. 90	7, 317, 397. 50	

TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	2,022	515.60	1,042,543.20	
TATA MOTORS LTD	4,240	167.95	712,108.00	
TATA STEEL LTD	1,159	523.60	606,852.40	
TECH MAHINDRA LTD	1,520	822.90	1,250,808.00	
TITAN CO LTD	952	1,292.45	1,230,412.40	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	257	2,634.60	677,092.20	
ULTRATECH CEMENT LTD	335	4,778.00	1,600,630.00	
UNITED SPIRITS LTD	1,082	572.05	618,958.10	
UPL LTD	1,612	416.50	671,398.00	
VEDANTA LTD	5,757	112.10	645,359.70	
WIPRO LTD	3,890	342.60	1,332,714.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	3,076	186.35	573,212.60	
インド・ルピー 小計	194,506		131,173,096.60 (184,954,066)	
インドネシア・ルピア	ACE HARDWARE INDONESIA	34,300	1,690.00	57,967,000.00
	ADARO ENERGY TBK PT	27,100	1,240.00	33,604,000.00
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	64,800	5,725.00	370,980,000.00
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	30,100	33,075.00	995,557,500.00
	BANK MANDIRI TBK	60,400	6,325.00	382,030,000.00
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	23,200	5,750.00	133,400,000.00
	BANK RAKYAT INDONESIA	179,400	4,040.00	724,776,000.00
	BARITO PACIFIC TBK PT	88,500	960.00	84,960,000.00
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	22,600	6,400.00	144,640,000.00
	GUDANG GARAM TBK PT	1,100	44,925.00	49,417,500.00
	HM SAMPOERNA TBK PT	19,900	1,560.00	31,044,000.00
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	8,875.00	53,250,000.00
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	7,500	14,100.00	105,750,000.00
	INDOFOOD CBP SUKSES MAK MUR T	9,600	10,350.00	99,360,000.00
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	7,275.00	75,660,000.00
	KALBE FARMA TBK PT	56,900	1,495.00	85,065,500.00
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	21,500	1,355.00	29,132,500.00
	SEMENT INDONESIA PERSERO TBK	9,400	11,150.00	104,810,000.00
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	158,100	3,170.00	501,177,000.00
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	23,500	7,775.00	182,712,500.00
	UNITED TRACTORS TBK PT	5,000	21,500.00	107,500,000.00
インドネシア・ルピア 小計	859,300		4,352,793,500.00 (32,210,671)	
オフショア・人民元	AECC AVIATION POWER CO -A	1,000	41.00	41,000.00
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,000	3.23	25,840.00

AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	1, 430	62. 53	89, 417. 90	
AISINO CORP-A	1, 800	13. 94	25, 092. 00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1, 000	56. 79	56, 790. 00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	9, 200	4. 56	41, 952. 00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	8, 600	4. 80	41, 280. 00	
BANK OF CHINA LTD-A	4, 500	3. 24	14, 580. 00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3, 700	4. 61	17, 057. 00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	1, 700	36. 15	61, 455. 00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4, 500	7. 94	35, 730. 00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	5, 700	6. 29	35, 853. 00	
BBMG CORPORATION-A	14, 100	3. 08	43, 428. 00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	11, 000	5. 39	59, 290. 00	
BYD CO LTD -A	600	161. 62	96, 972. 00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	356. 00	35, 600. 00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6, 800	4. 99	33, 932. 00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	9, 700	4. 33	42, 001. 00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1, 430	14. 54	20, 792. 20	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1, 000	43. 21	43, 210. 00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	5, 400	44. 87	242, 298. 00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2, 700	22. 36	60, 372. 00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1, 900	14. 90	28, 310. 00	
CHINA MINSHENG BANKING -A	3, 500	5. 21	18, 235. 00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	11, 300	4. 57	51, 641. 00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10, 600	4. 68	49, 608. 00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	1, 500	34. 10	51, 150. 00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	8, 400	4. 12	34, 608. 00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	3, 900	8. 49	33, 111. 00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8, 800	5. 62	49, 456. 00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	2, 000	17. 62	35, 240. 00	
CHINA SHIPBUILDING INDSTR-A	7, 800	4. 32	33, 696. 00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4, 700	6. 25	29, 375. 00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	10, 800	5. 31	57, 348. 00	

CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	500	183.31	91,655.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	9,200	4.82	44,344.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	2,200	30.91	68,002.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	4,500	19.84	89,280.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	400	120.00	48,000.00	
CITIC SECURITIES CO-A	2,800	29.33	82,124.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	600	242.10	145,260.00	
CRRC CORP LTD-A	8,100	5.56	45,036.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	3,900	6.60	25,740.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	3,480	25.83	89,888.40	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	9.47	55,873.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	720	163.01	117,367.20	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	2,600	14.34	37,284.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	16.83	62,271.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	212.00	29,680.00	
GOERTEK INC -A	1,000	40.07	40,070.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	800	67.90	54,320.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	18.29	60,357.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,000	29.10	58,200.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,900	13.13	38,077.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	2,200	48.10	105,820.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	51.77	41,416.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	2,800	24.70	69,160.00	
HENGTON OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,400	14.99	35,976.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	2,900	8.19	23,751.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	2,100	18.82	39,522.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	4,100	12.41	50,881.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	6.37	39,494.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	32.99	46,186.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	6,100	5.09	31,049.00	
HUNDSEN TECHNOLOGIES INC-A	650	92.20	59,930.00	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	40.89	49,068.00	
IND & COMM BK OF CHINA -A	11,300	5.04	56,952.00	

INDUSTRIAL BANK CO LTD-A	4,700	19.33	90,851.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.19	38,556.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	5.73	12,033.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	1,200	39.08	46,896.00	
JIANGSU HENGRI MEDICINE C-A	1,320	87.30	115,236.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	400	177.00	70,800.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	5,000	11.10	55,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	17.17	34,340.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	1,720.19	344,038.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,000	64.83	64,830.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,689	52.04	87,895.56	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	400	191.66	76,664.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	2.71	55,555.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	850	75.19	63,911.50	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	1,800	23.50	42,300.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	60.55	54,495.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	26.30	47,340.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	2,900	9.50	27,550.00	
PETROCHINA CO LTD-A	6,900	4.24	29,256.00	
PING AN BANK CO LTD-A	4,400	18.85	82,940.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	3,000	85.42	256,260.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	16.99	45,873.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	4.06	40,600.00	
S F HOLDING CO LTD-A	1,000	80.79	80,790.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	2,100	26.01	54,621.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,200	26.94	32,328.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	27.89	83,670.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	24.20	11,132.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	5.16	32,508.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	700	52.28	36,596.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	6,700	9.74	65,258.00	

SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5, 600	7. 93	44, 408. 00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	200	259. 93	51, 986. 00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	110. 69	15, 496. 60	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11, 000	5. 29	58, 190. 00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	100	176. 61	17, 661. 00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	152. 60	45, 780. 00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	200	343. 83	68, 766. 00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	2, 100	13. 91	29, 211. 00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	1, 900	16. 97	32, 243. 00	
SUNING. COM CO LTD-A	4, 400	9. 04	39, 776. 00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4, 000	6. 89	27, 560. 00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	22. 28	21, 834. 40	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	900	89. 49	80, 541. 00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	3, 400	17. 77	60, 418. 00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1, 800	19. 76	35, 568. 00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD -A	100	205. 20	20, 520. 00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	106. 80	21, 360. 00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5, 100	4. 71	24, 021. 00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD -A	700	264. 70	185, 290. 00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	560	106. 96	59, 897. 60	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2, 600	5. 10	13, 260. 00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1, 690	45. 45	76, 810. 50	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	96. 30	48, 150. 00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	218. 68	65, 604. 00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	700	32. 70	22, 890. 00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2, 000	16. 09	32, 180. 00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	7, 100	8. 38	59, 498. 00	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY S-A	9, 400	7. 71	72, 474. 00	
ZTE CORP-A	700	36. 30	25, 410. 00	
オフショア・人民元 小計	480, 339		7, 105, 180. 86 (112, 332, 909)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	764	27, 100. 00	20, 704, 400. 00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1, 664	27, 150. 00	45, 177, 600. 00

	ECOPETROL SA	18, 083	2, 145. 00	38, 788, 035. 00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	662	21, 300. 00	14, 100, 600. 00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1, 462	22, 700. 00	33, 187, 400. 00	
	コロンビア・ペソ 小計	22, 635		151, 958, 035. 00 (4, 330, 804)	
タイ・バーツ	ADVANCED INFO SERVICE- FOR RG	3, 800	176. 50	670, 700. 00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	13, 700	67. 00	917, 900. 00	
	B GRIMM POWER PCL- FOREIGN	3, 100	47. 75	148, 025. 00	
	BANGKOK BANK PCL- FOREIGN REG	1, 600	118. 00	188, 800. 00	
	BANGKOK COMMERCIAL- FOREIGN	9, 000	21. 30	191, 700. 00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	29, 600	22. 60	668, 960. 00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	23, 600	9. 15	215, 940. 00	
	BERLI JUCKER PUB CO- FORGN	6, 000	34. 00	204, 000. 00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	20, 200	10. 30	208, 060. 00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL- FOREIGN	1, 300	107. 50	139, 750. 00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO -FOREI	7, 200	53. 50	385, 200. 00	
	CENTRAL RETAIL CORP- FOREIGN	6, 700	33. 75	226, 125. 00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD- FORGN	10, 200	28. 25	288, 150. 00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	18, 500	62. 25	1, 151, 625. 00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO -FOR R	1, 000	190. 50	190, 500. 00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL- FOREIGN	4, 200	43. 75	183, 750. 00	
	GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	2, 400	66. 25	159, 000. 00	
	GULF ENERGY DEVELOPM- FOREIGN	7, 500	36. 00	270, 000. 00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	18, 400	15. 00	276, 000. 00	
	INDORAMA VENTURES- FOREIGN	5, 100	30. 25	154, 275. 00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6, 300	54. 00	340, 200. 00	
	IRPC PCL - FOREIGN	70, 100	2. 90	203, 290. 00	
	KASIKORN BANK PCL- FOREIGN	5, 500	97. 50	536, 250. 00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO -FOREI	11, 400	10. 30	117, 420. 00	
	LAND & HOUSES PUB CO- FOR REG	21, 300	7. 70	164, 010. 00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	7, 100	24. 40	173, 240. 00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL- FOREIG	2, 100	54. 75	114, 975. 00	
	OSOTSPA PCL-FOREIGN	3, 200	36. 75	117, 600. 00	

PTT EXPLORATION & PROD-FOR	4,800	92.25	442,800.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	7,200	53.75	387,000.00	
PTT PCL/FOREIGN	35,100	37.75	1,325,025.00	
RATCH GROUP PCL-FOREIGN	2,300	52.50	120,750.00	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	2,500	358.00	895,000.00	
SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	2,800	84.25	235,900.00	
SRISAWADCORP PCL - FOREIGN	2,400	54.50	130,800.00	
THAI OIL PCL-FRGN	2,400	48.50	116,400.00	
THAI UNION GROUP PCL-F	9,800	15.30	149,940.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	27,100	1.00	27,100.00	
TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	2,200	35.25	77,550.00	
TRUE CORP PCL-FOREIGN	36,400	3.10	112,840.00	
タイ・バーツ 小計	455,100		12,626,550.00 (43,182,801)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	571	468.00	267,228.00
	KOMERCNI BANKA AS	188	568.00	106,784.00
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	64.50	72,498.00
チェコ・コルナ 小計	1,883		446,510.00 (2,089,666)	
チリ・ペソ	AGUAS ANDINAS SA-A	4,650	207.99	967,153.50
	BANCO DE CHILE	178,957	69.99	12,525,200.43
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	162	26,956.00	4,366,872.00
	BANCO SANTANDER CHILE	219,753	33.99	7,469,404.47
	CENCOSUD SA	4,383	1,310.00	5,741,730.00
	CENCOSUD SHOPPING SA	3,859	1,204.00	4,646,236.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	5,328.00	1,454,544.00
	COLBUN SA	13,714	130.39	1,788,168.46
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	470	1,666.00	783,020.00
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	269	4,700.00	1,264,300.00
	EMPRESAS CMPC SA	3,736	1,664.10	6,217,077.60
	EMPRESAS COPEC SA	1,242	6,450.00	8,010,900.00
	ENEL CHILE SA	90,486	53.67	4,856,383.62
	ENERSIS SA	99,456	114.06	11,343,951.36
	FALABELLA SA	2,406	2,728.00	6,563,568.00
チリ・ペソ 小計	624,130		88,642,795.44 (12,152,927)	
トルコ・リラ	AKBANK T. A. S.	9,369	6.47	60,617.43
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	403	21.54	8,680.62
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,100	18.27	38,367.00
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,292	70.00	90,440.00

EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8, 135	11. 45	93, 145. 75	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	117. 00	18, 369. 00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	6, 512	10. 92	71, 111. 04	
KOC HOLDING AS	2, 509	19. 15	48, 047. 35	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	396	90. 00	35, 640. 00	
TURK HAVA YOLLARI AO	997	11. 71	11, 674. 87	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	3, 509	16. 00	56, 144. 00	
TURKIYE GARANTI BANKASI	7, 135	9. 52	67, 925. 20	
TURKIYE IS BANKASI-C	3, 028	6. 91	20, 923. 48	
トルコ・リラ 小計	45, 542		621, 085. 74 (8, 552, 351)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	968	1, 979. 00	1, 915, 672. 00
	OTP BANK RT	665	11, 940. 00	7, 940, 100. 00
	RICHTER GEDEON NYRT	410	6, 920. 00	2, 837, 200. 00
ハンガリー・フォリント 小計	2, 043		12, 692, 972. 00 (4, 357, 497)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6, 310	47. 50	299, 725. 00
	ABOITIZ POWER CORP	2, 800	26. 85	75, 180. 00
	AYALA CORPORATION	1, 175	850. 00	998, 750. 00
	AYALA LAND INC	23, 000	39. 25	902, 750. 00
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	4, 840	86. 70	419, 628. 00
	BDO UNIBANK INC	6, 370	99. 00	630, 630. 00
	GLOBE TELECOM INC	65	2, 006. 00	130, 390. 00
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	190	560. 00	106, 400. 00
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2, 800	128. 00	358, 400. 00
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	9, 607	72. 15	693, 145. 05
	JOLLIBEE FOODS CORP	1, 380	193. 80	267, 444. 00
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1, 370	300. 00	411, 000. 00
	MEGAWORLD CORP	22, 900	3. 82	87, 478. 00
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	28, 100	4. 15	116, 615. 00
	METROPOLITAN BANK & TRUST	5, 537	45. 65	252, 764. 05
	PLDT INC	265	1, 370. 00	363, 050. 00
	ROBINSONS LAND CO	3, 400	16. 46	55, 964. 00
	SM INVESTMENTS CORP	735	1, 005. 00	738, 675. 00
	SM PRIME HOLDINGS INC	32, 900	38. 00	1, 250, 200. 00
	UNIVERSAL ROBINA CORP	2, 810	148. 00	415, 880. 00
フィリピン・ペソ 小計	156, 554		8, 574, 068. 10 (18, 434, 246)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	15, 100	14. 73	222, 423. 00
	ATACADAQ SA	1, 900	20. 29	38, 551. 00
	B2W CIA DIGITAL	600	74. 63	44, 778. 00
	BANCO BRADESCO S. A.	4, 342	22. 29	96, 783. 18

BANCO BRADESCO SA-PREF	13, 728	24. 64	338, 257. 92	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	600	82. 36	49, 416. 00	
BANCO DO BRASIL SA	2, 800	34. 62	96, 936. 00	
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	1, 300	39. 13	50, 869. 00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	2, 200	28. 07	61, 754. 00	
BM&FBOVESPA SA	6, 700	55. 32	370, 644. 00	
BRASKEM SA-PREF A	500	23. 26	11, 630. 00	
BRF SA	1, 600	20. 79	33, 264. 00	
CCR SA	3, 800	12. 70	48, 260. 00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	700	32. 59	22, 813. 00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	700	31. 39	21, 973. 00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	500	69. 82	34, 910. 00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3, 019	11. 95	36, 077. 05	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	300	68. 24	20, 472. 00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	1, 000	44. 36	44, 360. 00	
CIELO SA	3, 900	3. 77	14, 703. 00	
COGNA EDUCACAO	6, 100	4. 98	30, 378. 00	
COSAN SA	600	80. 01	48, 006. 00	
CPFL ENERGIA SA	600	30. 77	18, 462. 00	
ENERGISA SA-UNITS	600	46. 80	28, 080. 00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	44. 01	29, 706. 75	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	2, 500	21. 12	52, 800. 00	
GERDAU SA-PREF	3, 100	21. 24	65, 844. 00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	700	71. 37	49, 959. 00	
HYPERA S. A	1, 100	31. 16	34, 276. 00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	2, 400	6. 68	16, 032. 00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	15, 150	28. 81	436, 471. 50	
ITAUSA SA	13, 930	10. 72	149, 329. 60	
JBS SA	3, 500	21. 84	76, 440. 00	
KLABIN SA - UNIT	1, 900	23. 35	44, 365. 00	
LOCALIZA RENT A CAR	1, 995	65. 48	130, 632. 60	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	2, 300	24. 26	55, 798. 00	
LOJAS RENNER S. A.	2, 420	46. 94	113, 594. 80	
MAGAZINE LUIZA SA	9, 200	24. 64	226, 688. 00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1, 200	22. 00	26, 400. 00	
NATURA &CO HOLDING SA	2, 200	48. 87	107, 514. 00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	1, 600	70. 39	112, 624. 00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	12, 300	24. 45	300, 735. 00	

PETROBRAS – PETROLEO BRAS-PR	15, 100	23. 82	359, 682. 00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	2, 600	21. 01	54, 626. 00	
PORTO SEGURO SA	200	50. 80	10, 160. 00	
RAIA DROGASIL SA	4, 000	25. 86	103, 440. 00	
RUMO SA	3, 400	18. 60	63, 240. 00	
SUL AMERICA SA – UNITS	700	41. 66	29, 162. 00	
SUZANO S. A.	1, 522	50. 21	76, 419. 62	
TELEF BRASIL	1, 400	46. 39	64, 946. 00	
TIM SA	3, 500	13. 90	48, 650. 00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	2, 200	20. 69	45, 518. 00	
VALE SA	11, 367	67. 72	769, 773. 24	
VIA VAREJO SA	3, 800	17. 94	68, 172. 00	
WEG SA	2, 760	80. 93	223, 366. 80	
ブラジル・レアル 小計	203, 908		5, 730, 166. 06 (112, 139, 350)	
ポーランド・ズ ロチ	BANK PEKAO SA	648	55. 84	36, 184. 32
	CD PROJEKT SA	218	368. 00	80, 224. 00
	CYFROWY POLSAT SA	1, 022	26. 86	27, 450. 92
	DINO POLSKA SA	96	268. 00	25, 728. 00
	GRUPA LOTOS SA	296	33. 32	9, 862. 72
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	426	135. 95	57, 914. 70
	LPP SA	4	7, 005. 00	28, 020. 00
	MBANK SA	66	167. 00	11, 022. 00
	ORANGE POLSKA SA	1, 329	6. 45	8, 572. 05
	PGE SA	1, 780	6. 01	10, 697. 80
	PKO BANK POLSKI SA	2, 716	26. 76	72, 680. 16
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	855	50. 28	42, 989. 40
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	5, 402	4. 94	26, 696. 68
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	1, 940	26. 25	50, 925. 00
	SANTANDER BANK POLSKA S. A.	157	171. 20	26, 878. 40
ポーランド・ズロチ 小計	16, 955		515, 846. 15 (14, 232, 195)	
マレーシア・リ ンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9, 700	3. 27	31, 719. 00
	AXIATA GROUP BERHAD	8, 700	3. 33	28, 971. 00
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	600	21. 90	13, 140. 00
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	18, 300	3. 64	66, 612. 00
	DIALOG GROUP BHD	14, 900	3. 63	54, 087. 00
	DIGI. COM BHD	9, 600	4. 11	39, 456. 00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	300	31. 84	9, 552. 00
	GAMUDA BHD	3, 100	3. 62	11, 222. 00
	GENTING BHD	6, 700	4. 09	27, 403. 00
	GENTING MALAYSIA BHD	11, 300	2. 51	28, 363. 00
	GENTING PLANTATIONS BHD	500	9. 86	4, 930. 00
	HAP SENG CONSOLIDATED	1, 100	8. 32	9, 152. 00

HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,700	14.10	66,270.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	2,200	16.80	36,960.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.24	30,856.00	
IHH HEALTHCARE BHD	6,300	5.43	34,209.00	
IOI CORPORATION BHD	5,400	4.52	24,408.00	
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	3,800	6.10	23,180.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,100	23.56	25,916.00	
MALAYAN BANKING BHD	12,200	8.10	98,820.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	5.45	26,705.00	
MAXIS BHD	6,200	5.05	31,310.00	
MISC BHD	5,000	6.90	34,500.00	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	138.80	27,760.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	7,800	6.77	52,806.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	700	19.62	13,734.00	
PETRONAS GAS BHD	2,200	16.32	35,904.00	
PPB GROUP BERHAD	1,880	18.48	34,742.40	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	7,000	6.43	45,010.00	
PUBLIC BANK BHD	9,900	18.38	181,962.00	
QL RESOURCES BHD	3,000	6.35	19,050.00	
RHB BANK BHD	4,900	5.05	24,745.00	
SIME DARBY BERHAD	4,800	2.32	11,136.00	
SIME DARBY PLANTATION BHD	7,700	5.20	40,040.00	
SUPERMAX CORP BHD	4,600	7.76	35,696.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	2,200	4.70	10,340.00	
TENAGA NASIONAL BHD	6,000	11.24	67,440.00	
TOP GLOVE CORP BHD	14,400	6.94	99,936.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,800	4.20	7,560.00	
YTL CORPORATION BERHAD	8,618	0.73	6,291.14	
マレーシア・リングギット 小計	226,198		1,471,893.54 (37,356,658)	
メキシコ・ペソ	ALFA S. A. B. -A	9,600	14.90	143,040.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	101,600	14.26	1,448,816.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	101.55	182,790.00
	CEMEX SAB-CPO	47,800	9.45	451,710.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	1,600	92.23	147,568.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	6,400	152.64	976,896.00
	GRUMA S. A. B. -B	515	218.09	112,316.35
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	645	314.17	202,639.65
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	1,200	211.35	253,620.00
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	5,300	43.15	228,695.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	46.47	41,823.00

GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	8, 100	108. 66	880, 146. 00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	7, 500	19. 07	143, 025. 00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV -SER B	10, 700	65. 84	704, 488. 00	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	6, 900	32. 75	225, 975. 00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	360	307. 44	110, 678. 40	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	1, 800	74. 57	134, 226. 00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	4, 900	32. 94	161, 406. 00	
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	800	71. 88	57, 504. 00	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	3, 300	40. 16	132, 528. 00	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	430	164. 68	70, 812. 40	
WALMART DE MEXICO-SER V	16, 800	56. 52	949, 536. 00	
メキシコ・ペソ 小計	238, 950		7, 760, 238. 80 (39, 887, 627)	
ユーロ	FF GROUP	129	4. 80	619. 20
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	533	12. 85	6, 849. 05
	JUMBO SA	280	14. 66	4, 104. 80
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	544	10. 27	5, 586. 88
	OPAP SA	482	8. 53	4, 111. 46
	ユーロ 小計	1, 968		21, 271. 39 (2, 623, 613)
韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	55	165, 000. 00	9, 075, 000. 00
	AMOREPACIFIC CORP	105	188, 000. 00	19, 740, 000. 00
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	17	58, 300. 00	991, 100. 00
	AMOREPACIFIC GROUP	60	50, 800. 00	3, 048, 000. 00
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	130, 500. 00	1, 957, 500. 00
	BNK FINANCIAL GROUP INC	85	5, 980. 00	508, 300. 00
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	203	97, 700. 00	19, 833, 100. 00
	CELLTRION INC	289	294, 000. 00	84, 966, 000. 00
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	21, 050. 00	2, 778, 600. 00
	CJ CHEILJEDANG CORP	26	370, 000. 00	9, 620, 000. 00
	CJ CORP	53	79, 700. 00	4, 224, 100. 00
	CJ ENM CO LTD	28	134, 200. 00	3, 757, 600. 00
	CJ LOGISTICS	16	166, 000. 00	2, 656, 000. 00
	COWAY CO LTD	158	71, 500. 00	11, 297, 000. 00
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	89	81, 900. 00	7, 289, 100. 00
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	114	25, 000. 00	2, 850, 000. 00
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	172	365, 500. 00	62, 866, 000. 00
	DB INSURANCE CO LTD	161	45, 550. 00	7, 333, 550. 00
	DOOSAN BOBCAT INC	272	31, 450. 00	8, 554, 400. 00

DOZONE BIZON CO LTD	95	102,500.00	9,737,500.00	
E-MART CO LTD	63	158,000.00	9,954,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	150	44,550.00	6,682,500.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	188	31,250.00	5,875,000.00	
GS HOLDINGS CORP	25	36,900.00	922,500.00	
GS RETAIL CO LTD	52	34,100.00	1,773,200.00	
HANA FINANCIAL GROUP	969	35,700.00	34,593,300.00	
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	401	35,000.00	14,035,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	21	327,500.00	6,877,500.00	
HANON SYSTEMS	960	15,500.00	14,880,000.00	
HANWHA CORPORATION	18	26,150.00	470,700.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	466	49,400.00	23,020,400.00	
HLB INC	170	93,200.00	15,844,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	99	78,900.00	7,811,100.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	207	33,550.00	6,944,850.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	59	188,000.00	11,092,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	31	254,500.00	7,889,500.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	123	23,950.00	2,945,850.00	
HYUNDAI MOBIS	218	243,000.00	52,974,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	476	180,000.00	85,680,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	167	85,000.00	14,195,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	45	85,400.00	3,843,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	260	31,900.00	8,294,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	787	9,080.00	7,145,960.00	
KANGWON LAND INC	358	22,650.00	8,108,700.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	1,229	46,500.00	57,148,500.00	
KIA MOTORS CORPORATION	812	58,800.00	47,745,600.00	
KMW CO LTD	97	68,000.00	6,596,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	320	23,850.00	7,632,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	790	21,050.00	16,629,500.00	
KOREA GAS CORPORATION	54	28,550.00	1,541,700.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	139	74,000.00	10,286,000.00	
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	101	94,500.00	9,544,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	26	383,500.00	9,971,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	87	23,200.00	2,018,400.00	
KT&G CORP	371	85,300.00	31,646,300.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	35	151,000.00	5,285,000.00	
LG CHEM LTD	147	721,000.00	105,987,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	15	355,000.00	5,325,000.00	
LG CORP	307	75,400.00	23,147,800.00	
LG DISPLAY CO LTD	707	14,650.00	10,357,550.00	

LG ELECTRONICS INC	323	89, 100. 00	28, 779, 300. 00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	30	1, 532, 000. 00	45, 960, 000. 00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	4	704, 000. 00	2, 816, 000. 00	
LG INNOTEK CO LTD	42	161, 000. 00	6, 762, 000. 00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	14	10, 800. 00	151, 200. 00	
LG UPLUS CORP	815	11, 400. 00	9, 291, 000. 00	
LOTTE CHEMICAL CORP	71	281, 500. 00	19, 986, 500. 00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	57	33, 800. 00	1, 926, 600. 00	
LOTTE SHOPPING CO	22	96, 700. 00	2, 127, 400. 00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1, 040	3, 735. 00	3, 884, 400. 00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	1, 312	9, 450. 00	12, 398, 400. 00	
NAVER CORP	378	280, 500. 00	106, 029, 000. 00	
NCSOFT CORPORATION	56	828, 000. 00	46, 368, 000. 00	
NETMARBLE CORPORATION	58	129, 500. 00	7, 511, 000. 00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	92	124, 000. 00	11, 408, 000. 00	
OTTOGI CORPORATION	2	552, 000. 00	1, 104, 000. 00	
PEARL ABYSS CORP	13	210, 700. 00	2, 739, 100. 00	
POSCO	212	236, 000. 00	50, 032, 000. 00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	74	79, 700. 00	5, 897, 800. 00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	69	14, 000. 00	966, 000. 00	
S-1 CORPORATION	32	82, 600. 00	2, 643, 200. 00	
S-OIL CORPORATION	136	65, 100. 00	8, 853, 600. 00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	53	808, 000. 00	42, 824, 000. 00	
SAMSUNG C&T CORP	268	122, 500. 00	32, 830, 000. 00	
SAMSUNG CARD CO	58	34, 750. 00	2, 015, 500. 00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	172	150, 500. 00	25, 886, 000. 00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	14, 773	64, 600. 00	954, 335, 800. 00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	2, 545	58, 000. 00	147, 610, 000. 00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	349	13, 200. 00	4, 606, 800. 00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	89	206, 000. 00	18, 334, 000. 00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1, 171	5, 790. 00	6, 780, 090. 00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	225	75, 000. 00	16, 875, 000. 00	
SAMSUNG SDI CO LTD	177	518, 000. 00	91, 686, 000. 00	
SAMSUNG SDS CO LTD	113	179, 000. 00	20, 227, 000. 00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	94	38, 050. 00	3, 576, 700. 00	
SEEGENE INC	55	208, 100. 00	11, 445, 500. 00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	89	123, 000. 00	10, 947, 000. 00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1, 477	33, 250. 00	49, 110, 250. 00	

SHINSEGAE CO LTD	14	229,000.00	3,206,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	112	214,500.00	24,024,000.00	
SK HYNIX INC	1,698	98,200.00	166,743,600.00	
SK INNOVATION CO LTD	174	154,000.00	26,796,000.00	
SK TELECOM CO LTD	112	229,500.00	25,704,000.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	417	4,050.00	1,688,850.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	2,131	9,900.00	21,096,900.00	
YUHAN CORP	145	66,000.00	9,570,000.00	
韓国・ウォン 小計	45,058		3,071,350,250.00 (286,864,113)	
香港・ドル	3SBIO INC	4,000	7.32	29,280.00
	A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	1,500	34.00	51,000.00
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2,000	42.10	84,200.00
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	4,000	11.64	46,560.00
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	83,000	2.82	234,060.00
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	6.38	63,800.00
	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	2,000	15.60	31,200.00
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	12,000	20.25	243,000.00
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	40,000	1.02	40,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	2.20	52,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,000	52.90	211,600.00
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	90.22	63,154.00
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,000	111.40	334,200.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	4.47	17,880.00
	BAIC MOTOR CORP LTD-H	4,000	3.20	12,800.00
	BANK OF CHINA LTD - H	237,000	2.71	642,270.00
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	27,000	4.18	112,860.00
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	6.27	25,080.00
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,500	25.50	38,250.00
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	3.11	49,760.00
	BOC AVIATION LTD	500	68.50	34,250.00
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.20	51,200.00
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	8,000	6.91	55,280.00
	BYD CO LTD	2,000	172.30	344,600.00
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	1,000	35.25	35,250.00
	CANSINO BIOLOGICS INC-H	400	154.40	61,760.00

CGN POWER CO LTD-H	34,000	1. 66	56,440.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	4,000	8. 08	32,320.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	1. 52	42,560.00	
CHINA CITIC BANK	29,000	3. 33	96,570.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	14,000	4. 20	58,800.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	4. 19	33,520.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	4,500	36. 80	165,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	297,000	5. 95	1,767,150.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	5,500	6. 95	38,225.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	2,000	16. 16	32,320.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,000	3. 55	14,200.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	2,000	14. 90	29,800.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	3. 01	36,120.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	4. 22	63,300.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	4,000	11. 22	44,880.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	6,000	16. 68	100,080.00	
CHINA FEIHE LTD	5,000	17. 40	87,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4. 83	55,545.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	9,600	27. 30	262,080.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	6,500	6. 80	44,200.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	21,000	0. 88	18,480.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	4,000	18. 00	72,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	18,000	3. 94	70,920.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	5,000	13. 12	65,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	23,000	17. 66	406,180.00	
CHINA LITERATURE LTD	400	61. 00	24,400.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	10,000	6. 41	64,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	3,000	8. 65	25,950.00	
CHINA MENNIU DAIRY CO	9,000	41. 70	375,300.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	11,000	50. 45	554,950.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	4,000	10. 14	40,560.00	
CHINA MINSHENG BANKING -H	22,900	4. 34	99,386.00	
CHINA MOBILE LTD/HK	19,000	47. 10	894,900.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,000	3. 47	20,820.00	

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	12,000	10.90	130,800.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	4,000	5.96	23,840.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	12,000	19.00	228,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	4.90	24,500.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	8,600	27.55	236,930.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	78,000	3.54	276,120.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	26,880	8.21	220,684.80	
CHINA POWER INTERNATIONAL	10,000	1.56	15,600.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	9,000	3.93	35,370.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	4,000	2.83	11,320.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	6,500	5.39	35,035.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	13,000	0.81	10,530.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	4,000	57.35	229,400.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	6,000	10.50	63,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	2,000	36.90	73,800.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	10,000	36.30	363,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	4,000	4.12	16,480.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	6,000	8.35	50,100.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	10,000	14.48	144,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	4,000	4.89	19,560.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	4,000	5.33	21,320.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	12.94	85,404.00	
CHINA TELECOM CORP LTD -H	42,000	2.39	100,380.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	134,000	1.24	166,160.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.44	20,640.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	18,000	4.83	86,940.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	4,700	29.05	136,535.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	5,000	3.23	16,150.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	8,000	6.37	50,960.00	
CITIC LTD	19,000	6.16	117,040.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	7,000	17.00	119,000.00	

CNOOC LTD	54,000	8.86	478,440.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	5.25	31,500.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	24,000	10.74	257,760.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	4,000	44.25	177,000.00	
CRRC CORP LTD H	13,000	3.21	41,730.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	4,500	4.90	22,050.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	8,000	8.68	69,440.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2,400	102.70	246,480.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	8.02	56,140.00	
FOSUN INTERNATIONAL	7,500	11.10	83,250.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	37.35	119,520.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	20,000	22.65	453,000.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	2,000	12.30	24,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	11.18	53,664.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	20,000	0.93	18,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	6,500	13.88	90,220.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	6,000	8.74	52,440.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	8,000	13.36	106,880.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	9,600	8.87	85,152.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	3,200	10.18	32,576.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	1,400	10.94	15,316.00	
HAIDLAI INTERNATIONAL HOLDI	3,000	57.30	171,900.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	38.50	192,500.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1,000	22.35	22,350.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	6.46	64,600.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	33.80	135,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	2,000	57.45	114,900.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1,000	33.55	33,550.00	
HUANENG POWER INTL INC -H	14,000	3.14	43,960.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	12.04	65,016.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	186,000	4.60	855,600.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	3,000	54.45	163,350.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD -H	2,000	9.34	18,680.00	

JIANGXI COPPER CO LTD-H	2,000	10.80	21,600.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	7,000	3.88	27,160.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	2,000	27.95	55,900.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	12.42	31,050.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	7,000	25.40	177,800.00	
KINGSOFT CORP LTD	3,000	41.00	123,000.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	10,000	6.42	64,200.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	11.40	45,600.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	3,000	5.67	17,010.00	
LEGEND GROUP LTD	22,000	5.41	119,020.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	1,000	10.50	10,500.00	
LI NING CO LTD	6,000	47.15	282,900.00	
LOGAN GROUP CO LTD	4,000	12.88	51,520.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	5,500	49.50	272,250.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	2,500	4.30	10,750.00	
MEITUAN-B	11,000	294.00	3,234,000.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	2,200	32.20	70,840.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	10.48	31,440.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	2.42	55,660.00	
PETROCHINA CO LTD-H	64,000	2.52	161,280.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	23,000	6.38	146,740.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,100	104.00	114,400.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	17,500	88.90	1,555,750.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	600	55.10	33,060.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	26,000	4.28	111,280.00	
SEAZEN GROUP LTD	8,000	6.67	53,360.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	11,000	22.90	251,900.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	16.88	135,040.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	4,000	2.20	8,800.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	1,000	33.05	33,050.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	1,000	11.40	11,400.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	13.62	36,774.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	5,500	13.52	74,360.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	8,000	2.53	20,240.00	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2, 500	141. 30	353, 250. 00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	4, 000	30. 50	122, 000. 00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	33, 000	7. 80	257, 400. 00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	6, 000	1. 62	9, 720. 00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	3, 000	3. 35	10, 050. 00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	24, 000	1. 60	38, 400. 00	
SINOPHARM GROUP CO-H	4, 800	19. 36	92, 928. 00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	2, 000	19. 72	39, 440. 00	
SOHO CHINA LTD	4, 500	2. 54	11, 430. 00	
SSY GROUP LTD	4, 000	4. 77	19, 080. 00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	5, 500	8. 16	44, 880. 00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	8, 000	31. 15	249, 200. 00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	257	14. 14	3, 633. 98	
SUNNY OPTICAL TECH	2, 500	157. 80	394, 500. 00	
TENCENT HOLDINGS LTD	17, 700	573. 00	10, 142, 100. 00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	6, 000	14. 12	84, 720. 00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	4, 400	14. 68	64, 592. 00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	4, 000	12. 02	48, 080. 00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3, 000	18. 86	56, 580. 00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2, 000	73. 05	146, 100. 00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3, 000	7. 30	21, 900. 00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	15, 000	5. 67	85, 050. 00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	6, 000	17. 14	102, 840. 00	
WHARF HOLDINGS LTD	4, 000	17. 80	71, 200. 00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	784	123. 00	96, 432. 00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	9, 000	78. 95	710, 550. 00	
XIAOMI CORP-CLASS B	34, 400	25. 20	866, 880. 00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2, 400	12. 10	29, 040. 00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	14, 000	13. 44	188, 160. 00	
YANZHOU COAL MINING CO -H	4, 000	6. 18	24, 720. 00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1, 000	97. 05	97, 050. 00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	16, 000	1. 57	25, 120. 00	
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	13, 000	3. 07	39, 910. 00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	3, 500	10. 20	35, 700. 00	

ZHEJIANG EXPRESSWAY CO -H	2,000	5.62	11,240.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	7,000	4.81	33,670.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	700	38.65	27,055.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	61.90	123,800.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	1,700	25.85	43,945.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	7.23	130,140.00	
ZTE CORP-H	2,800	20.70	57,960.00	
香港・ドル 小計	2,713,821		38,747,992.78 (519,223,103)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	2,000	242.50	485,000.00
	ACER INC	13,000	22.70	295,100.00
	ADVANTECH CO LTD	1,099	315.00	346,185.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	10,000	72.90	729,000.00
	ASIA CEMENT CORP	7,000	44.25	309,750.00
	ASUSTEK COMPUTER INC	2,000	251.00	502,000.00
	AU OPTRONICS CORP	26,000	11.25	292,500.00
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	192.00	384,000.00
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	25,000	41.50	1,037,500.00
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	4,327	166.00	718,282.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,560	17.95	351,102.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	4,000	41.80	167,200.00
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	1,005	85.80	86,229.00
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	37,000	8.69	321,530.00
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,918	20.50	223,819.00
	CHINA STEEL CORP	37,000	22.00	814,000.00
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	12,000	110.00	1,320,000.00
	COMPAL ELECTRONICS	13,000	19.50	253,500.00
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	49,000	19.60	960,400.00
	DELTA ELECTRONICS INC	6,000	208.00	1,248,000.00
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	36,039	25.65	924,400.35
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	417.00	417,000.00
	EVA AIRWAYS CORP	3,243	12.60	40,861.80
	EVERGREEN MARINE	3,150	21.95	69,142.50
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	10,000	28.20	282,000.00
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	4,000	60.90	243,600.00

FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1, 320	193. 00	254, 760. 00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	33, 569	21. 70	728, 447. 30	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	10, 000	79. 80	798, 000. 00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	4, 000	94. 00	376, 000. 00	
FORMOSA PLASTICS CORP	11, 000	88. 10	969, 100. 00	
FORMOSA TAFFETA CO.	1, 000	31. 90	31, 900. 00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	2, 000	51. 50	103, 000. 00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	20, 000	45. 25	905, 000. 00	
GIANT MANUFACTURING	1, 000	283. 50	283, 500. 00	
GLOBALWAFERS CO LTD	1, 000	440. 00	440, 000. 00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	2, 200	43. 15	94, 930. 00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1, 060	298. 00	315, 880. 00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	38, 200	82. 90	3, 166, 780. 00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1, 000	700. 00	700, 000. 00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	24, 186	18. 55	448, 650. 30	
INNOLUX CORPORATION	28, 000	9. 52	266, 560. 00	
INVENTEC CO LTD	8, 000	23. 00	184, 000. 00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	7, 000	48. 75	341, 250. 00	
MEDIATEK INC	5, 000	733. 00	3, 665, 000. 00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	35, 000	29. 60	1, 036, 000. 00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	2, 000	123. 00	246, 000. 00	
NAN YA PLASTICS CORP	17, 000	65. 30	1, 110, 100. 00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	4, 000	67. 80	271, 200. 00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	2, 000	297. 50	595, 000. 00	
PEGATRON CORP	6, 000	65. 00	390, 000. 00	
POU CHEN	7, 000	31. 00	217, 000. 00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	2, 000	89. 50	179, 000. 00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2, 000	271. 00	542, 000. 00	
QUANTA COMPUTER INC	9, 000	76. 50	688, 500. 00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2, 000	381. 00	762, 000. 00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1, 800	41. 40	74, 520. 00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	31, 244	8. 62	269, 323. 28	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	34, 480	11. 30	389, 624. 00	
STANDARD FOODS CORP	1, 000	61. 90	61, 900. 00	
SYNTEX TECHNOLOGY INTL CORP	4, 000	43. 35	173, 400. 00	

TAISHIN FINANCIAL HOLDING	29, 170	13. 30	387, 961. 00	
TAIWAN BUSINESS BANK	19, 672	9. 85	193, 769. 20	
TAIWAN CEMENT	11, 629	42. 90	498, 884. 10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	30, 245	20. 45	618, 510. 25	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6, 000	31. 45	188, 700. 00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	5, 000	99. 50	497, 500. 00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	76, 000	490. 00	37, 240, 000. 00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	10, 000	40. 50	405, 000. 00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	15, 000	68. 40	1, 026, 000. 00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	37, 000	32. 10	1, 187, 700. 00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	2, 000	99. 00	198, 000. 00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	1, 000	189. 00	189, 000. 00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	1, 000	336. 00	336, 000. 00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	22, 000	17. 45	383, 900. 00	
WISTRON CORP	9, 146	29. 95	273, 922. 70	
WPG HOLDINGS LTD	5, 760	40. 30	232, 128. 00	
YAGEO CORPORATION	1, 000	404. 00	404, 000. 00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	31, 200	18. 95	591, 240. 00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	2, 000	119. 00	238, 000. 00	
台灣・ドル 小計	1, 014, 222		78, 990, 641. 78 (287, 525, 936)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	2, 712	107. 27	290, 916. 24
	ANGLO PLATINUM LTD	176	1, 177. 02	207, 155. 52
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	1, 292	340. 70	440, 184. 40
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	961	126. 61	121, 672. 21
	BID CORP LTD	1, 065	283. 41	301, 831. 65
	BIDVEST GROUP LTD	883	162. 30	143, 310. 90
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	226	1, 380. 00	311, 880. 00
	CLICKS GROUP LTD	796	252. 01	200, 599. 96
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	1, 109	126. 25	140, 011. 25
	EXXARO RESOURCES LTD	783	122. 97	96, 285. 51
	FIRSTRAND LTD	15, 922	47. 16	750, 881. 52
	GOLD FIELDS LTD	3, 120	146. 19	456, 112. 80
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	1, 461	69. 96	102, 211. 56
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	2, 526	169. 57	428, 333. 82
	KUMBA IRON ORE LTD	214	500. 13	107, 027. 82
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	4, 021	17. 46	70, 206. 66

MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	1, 761	16. 04	28, 246. 44	
MR PRICE GROUP LTD	673	156. 01	104, 994. 73	
MTN GROUP LTD	5, 409	66. 80	361, 321. 20	
MULTICHOICE GROUP LTD	1, 332	131. 03	174, 531. 96	
NASPERS LTD-N SHS	1, 342	3, 041. 25	4, 081, 357. 50	
NEDBANK GROUP LTD	1, 237	135. 12	167, 143. 44	
NEPI ROCKCASTLE PLC	1, 207	70. 19	84, 719. 33	
NORTHAM PLATINUM LTD	1, 216	177. 88	216, 302. 08	
OLD MUTUAL LTD	15, 106	12. 18	183, 991. 08	
PEPKOR HOLDINGS LTD	3, 649	13. 94	50, 867. 06	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	1, 888	31. 67	59, 792. 96	
REINET INVESTMENTS SCA	328	285. 03	93, 489. 84	
REMGRO LTD	1, 616	96. 52	155, 976. 32	
SANLAM LIMITED	5, 058	55. 70	281, 730. 60	
SASOL LTD	1, 791	117. 68	210, 764. 88	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	1, 476	131. 67	194, 344. 92	
SIBANYE STILLWATER LTD	7, 182	51. 36	368, 867. 52	
SPAR GROUP LIMITED/THE	596	206. 75	123, 223. 00	
STANDARD BANK GROUP LTD	4, 151	128. 91	535, 105. 41	
TIGER BRANDS LTD	508	207. 45	105, 384. 60	
VODACOM GROUP LTD	2, 030	126. 12	256, 023. 60	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	2, 935	38. 77	113, 789. 95	
南アフリカ・ランド 小計	99, 758		12, 120, 590. 24 (81, 692, 778)	
合計	7, 489, 746		2, 171, 408, 735 (2, 171, 408, 735)	

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	9, 546. 00	173, 164. 44	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	19, 200. 00	590, 016. 00	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	11, 104. 00	125, 031. 04	
		アメリカ・ドル 小計	39, 850. 00	888, 211. 48 (92, 267, 409)	
投資信託受益証券	合計			92, 267, 409 (92, 267, 409)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8, 900. 00	173, 550. 00	
	メキシコ・ペソ 小計		8, 900. 00	173, 550. 00 (892, 047)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	9, 053. 00	112, 709. 85	
	南アフリカ・ランド 小計		9, 053. 00	112, 709. 85 (759, 664)	
投資証券	合計			1, 651, 711 (1, 651, 711)	
合計				93, 919, 120 (93, 919, 120)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 55銘柄 投資信託 受益証券 3銘柄	15.54% -%	-% 3.92%	-% -%	20.21%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.07%	-%	-%	0.07%
インド・ルピー	株式 84銘柄	7.86%	-%	-%	8.16%
インドネシア・ルピア	株式 21銘柄	1.37%	-%	-%	1.42%
オフショア・人民元	株式 127銘柄	4.77%	-%	-%	4.96%
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.18%	-%	-%	0.19%
タイ・バーツ	株式 40銘柄	1.83%	-%	-%	1.91%
チエコ・コルナ	株式 3銘柄	0.09%	-%	-%	0.09%
チリ・ペソ	株式 16銘柄	0.52%	-%	-%	0.54%
トルコ・リラ	株式 13銘柄	0.36%	-%	-%	0.38%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.19%	-%	-%	0.19%
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.78%	-%	-%	0.81%
ブラジル・レアル	株式 55銘柄	4.76%	-%	-%	4.95%
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.60%	-%	-%	0.63%
マレーシア・リンギット	株式 40銘柄	1.59%	-%	-%	1.65%
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資証券 1銘柄	1.69% -%	-% 0.04%	-% 0.04%	1.80%
ユーロ	株式 5銘柄	0.11%	-%	-%	0.12%
韓国・ウォン	株式 106銘柄	12.19%	-%	-%	12.66%
香港・ドル	株式 199銘柄	22.06%	-%	-%	22.92%
台湾・ドル	株式 80銘柄	12.22%	-%	-%	12.69%
南アフリカ・ランド	株式 38銘柄 投資証券 1銘柄	3.47% -%	-% -%	-% 0.03%	3.64%

(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。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等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。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

中間財務諸表

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年11月21日から2021年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2021年6月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）の2020年11月21日から2021年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）の2021年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月21日から2021年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

【ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	290	1,617
コール・ローン	63,563	66,912
親投資信託受益証券	36,140,078	42,655,423
未収入金	3,470,823	52,724
流動資産合計	39,674,754	42,776,676
資産合計	39,674,754	42,776,676
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,468,163	49,755
未払受託者報酬	4,771	5,133
未払委託者報酬	60,181	64,728
その他未払費用	1,922	2,066
流動負債合計	3,535,037	121,682
負債合計	3,535,037	121,682
純資産の部		
元本等		
元本	32,719,425	33,178,957
剩余金		
中間剩余金又は中間欠損金（△）	3,420,292	9,476,037
（分配準備積立金）	3,466,670	3,030,107
元本等合計	36,139,717	42,654,994
純資産合計	36,139,717	42,654,994
負債純資産合計	39,674,754	42,776,676

(2) 【中間損益及び剩余金計算書】

(単位：円)

	第3期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日	第4期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△2,876,123	5,910,797
営業収益合計	△2,876,123	5,910,797
営業費用		
受託者報酬	4,268	5,133
委託者報酬	53,769	64,728
その他費用	1,692	2,066
営業費用合計	59,729	71,927
営業利益又は営業損失 (△)	△2,935,852	5,838,870
経常利益又は経常損失 (△)	△2,935,852	5,838,870
中間純利益又は中間純損失 (△)	△2,935,852	5,838,870
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	353,596	412,692
期首剩余金又は期首次損金 (△)	2,729,754	3,420,292
剩余金増加額又は欠損金減少額	—	1,091,079
中間一部解約に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	—	1,091,079
剩余金減少額又は欠損金増加額	2,359,273	461,512
中間一部解約に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額	2,175,208	461,512
中間追加信託に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額	184,065	—
分配金	—	—
中間剩余金又は中間欠損金 (△)	△2,918,967	9,476,037

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5月20日現在
1. 期首元本額	137,145,531円	32,719,425円
期中追加設定元本額	10,635,133円	4,774,901円
期中一部解約元本額	115,061,239円	4,315,369円
2. 受益権の総数	32,719,425口	33,178,957口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2020年11月20日現在	第4期中間計算期間 2021年5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. 1045円 (11, 045円)	1. 2856円 (12, 856円)

(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、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りでありますが、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)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	105,544,603
コール・ローン	4,366,684,331
株式	139,341,986,150
派生商品評価勘定	15,410,600
未収配当金	1,395,171,000
前払金	123,890,000
差入委託証拠金	254,790,000
流動資産合計	145,603,476,684
資産合計	145,603,476,684
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	123,074,500
未払解約金	258,864,140
その他未払費用	8,193
流動負債合計	381,946,833
負債合計	381,946,833
純資産の部	
元本等	
元本	68,907,940,433
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	76,313,589,418
元本等合計	145,221,529,851
純資産合計	145,221,529,851
負債純資産合計	145,603,476,684

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5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	80,797,703,529円
同期中追加設定元本額	10,809,785,490円
同期中一部解約元本額	22,699,548,586円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,850,286,823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）	3,794,576,317円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	3,725,959円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,897,221,475円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,408,177,450円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	4,557,064,539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）	5,519,631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）	21,918,421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）	27,772,927円
DCニッセイ国内株式インデックス	592,067,295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	18,411,879,747円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	1,425,203,297円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	178,616,676円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	161,785,055円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	176,299,369円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	373,257,849円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	62,191,481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）	65,307,596円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	6,827,373円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	7,832,608円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	2,260,490円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）	5,270,052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）	21,047,678円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	75,993,270円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	46,509,732円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	133,076,219円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	156,385,424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）	24,424,679,241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）	14,985,903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）	65,065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）	135,471円
計	68,907,940,433円
2. 受益権の総数	68,907,940,433口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年5月20日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち	1年超	
市場取引				
先物取引				
買建	5,753,110,000	—	5,645,610,000	△107,500,000
合計	5,753,110,000	—	5,645,610,000	△107,500,000

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1075円 (21,075円)

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,617,354,235
金銭信託	96,452,773
コール・ローン	3,990,529,137
株式	371,823,893,621
投資証券	8,353,804,242
派生商品評価勘定	49,203,073
未収入金	100,709,167
未収配当金	410,052,494
差入委託証拠金	7,003,104,372
流動資産合計	393,445,103,114
資産合計	393,445,103,114
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101,638,353
未払金	57,095,003
未払解約金	636,067,348
その他未払費用	10,898
流動負債合計	794,811,602
負債合計	794,811,602
純資産の部	
元本等	
元本	155,354,575,597
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	237,295,715,915
元本等合計	392,650,291,512
純資産合計	392,650,291,512
負債純資産合計	393,445,103,114

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	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本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	145, 169, 780, 539円
同期中追加設定元本額	25, 631, 068, 968円
同期中一部解約元本額	15, 446, 273, 910円
元本の内訳	
ファンド名	
D C ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	779, 730, 464円
D C ニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3, 417, 710, 986円
D C ニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2, 737, 839, 538円
ニッセイ外国株式インデックス S A（適格機関投資家限定）	1, 715, 446, 785円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型） S A（適格機関投資家限定）	2, 268, 221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）	12,010,470円
ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	16,660,209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）	10,958,485,657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	109,462,750,904円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	23,058,697,237円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	1,172,126,166円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2055	108,884,067円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	133,017,924円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2045	107,128,655円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2035	226,189,165円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2025	32,315,978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)	53,693,214円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	5,612,863円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	6,440,136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）	1,859,586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)	17,301,375円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2060	46,308,978円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2050	28,293,038円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2040	80,836,646円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド2030	92,991,462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）	241,180,939円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06（適格機関投資家限定）	249,289,545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）	108,875,056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）	243,120,436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）	237,509,897円
計	155,354,575,597円
2. 受益権の総数	155,354,575,597口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月20日現在		
	契約額等（円）	時価（円）	
		うち 1年超	評価損益（円）
市場取引以外の取引			
為替予約取引			
買建	4,749,219,991	—	4,746,401,960
アメリカ・ドル	3,287,518,514	—	3,282,497,880
イギリス・ポンド	499,585,813	—	499,389,020
ユーロ	962,115,664	—	964,515,060
合計	4,749,219,991	—	4,746,401,960
			△2,818,031
△5,020,634			
△196,793			
2,399,396			

(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	2021年5月20日現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
うち 1年超			
市場取引			
先物取引			
買建	12,573,394,576	—	12,523,777,330
合計	12,573,394,576	—	12,523,777,330
			△49,617,246
			△49,617,246

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,5274円 (25,274円)

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	35,726,976
金銭信託	6,924,151
コール・ローン	286,472,071
株式	2,779,581,425
投資信託受益証券	146,360,890
投資証券	2,120,800
派生商品評価勘定	904,720
未収入金	1,897,159
未収配当金	3,043,824
差入委託証拠金	126,113,382
流動資産合計	3,389,145,398
資産合計	3,389,145,398
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,013,182
未払金	149,228
未払解約金	33,032,461
その他未払費用	601
流動負債合計	38,195,472
負債合計	38,195,472
純資産の部	
元本等	
元本	2,759,971,456
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	590,978,470
元本等合計	3,350,949,926
純資産合計	3,350,949,926
負債純資産合計	3,389,145,398

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5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	2, 262, 953, 958円
同期中追加設定元本額	1, 028, 256, 913円
同期中一部解約元本額	531, 239, 415円
元本の内訳	
ファンド名	
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	2, 246, 883, 242円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)	11, 597, 716円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート)	13, 281, 570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, 835, 183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)	35, 654, 637円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP型バケット)	173, 740, 405円
D Cニッセイ新興国株式インデックス	274, 978, 703円
計	2, 759, 971, 456円
2. 受益権の総数	2, 759, 971, 456口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月20日現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超	
市場取引以外の取引			
為替予約取引			
売建	28,881,647	—	28,834,080
アメリカ・ドル	28,881,647	—	28,834,080
買建	287,588,647	—	286,811,720
アメリカ・ドル	287,588,647	—	286,811,720
合計	316,470,294	—	315,645,800
			△729,360

(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	2021年5月20日現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超	
市場取引			
先物取引			
買建	415,965,551	—	412,586,448
合計	415,965,551	—	412,586,448
			△3,379,103

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2141円 (12,141円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年5月31日現在

I 資産総額	44, 177, 412円
II 負債総額	4, 838円
III 純資産総額 (I - II)	44, 172, 574円
IV 発行済数量	33, 533, 247口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1. 3173円

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	151, 216, 161, 166円
II 負債総額	3, 274, 031, 216円
III 純資産総額 (I - II)	147, 942, 129, 950円
IV 発行済数量	69, 202, 671, 260口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2. 1378円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	408, 728, 746, 456円
II 負債総額	886, 327, 120円
III 純資産総額 (I - II)	407, 842, 419, 336円
IV 発行済数量	156, 682, 034, 974口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2. 6030円

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	3, 918, 271, 272円
II 負債総額	424, 556, 245円
III 純資産総額 (I - II)	3, 493, 715, 027円
IV 発行済数量	2, 793, 311, 688口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1. 2507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、解約請求の受け付け、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年5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2年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

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

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

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

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、運用部門を中心に構成される協議機関において市場動向・ファンダメンタルズ等の投資環境分析を踏まえ協議され、運用担当部（室）の部（室）長が決定します。

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年5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	409	69,356
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	136	26,390
単位型公社債投資信託	0	0
合計	545	95,747

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

3 【委託会社等の経理状況】

1. 財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2021年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 横口誠之印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 牧野あや子印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

負債の部

流動負債

預り金	45, 856	47, 039
未払収益分配金	5, 643	5, 643
未払手数料	※2	1, 633, 415
未払運用委託報酬	※2	810, 981
未払投資助言報酬	※2	852, 782
その他未払金	※2	3, 591, 122
未払費用	※2	146, 706
未払法人税等		686, 983
未払消費税等		527, 890
賞与引当金		975, 373
その他		16, 476
流動負債合計		9, 293, 232
		13, 109, 013

固定負債

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

純資産の部

株主資本

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

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	512, 183	1, 242, 655
繰延ヘッジ損益	△ 63, 949	△ 97, 204
評価・換算差額等合計	448, 234	1, 145, 450
純資産合計	68, 155, 196	75, 152, 647
負債・純資産合計	79, 421, 875	90, 445, 083

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

受取配当金	※1	200,028	※1	74,260
金融派生商品収益		14,042		40,753
その他営業外収益		13,606		14,644
営業外収益計		241,504		134,653
営業外費用				
為替差損		27,288		32,651
金融派生商品費用		9,593		24,611
控除対象外消費税		5,453		3,018
その他営業外費用		8,493		4,203
営業外費用計		50,829		64,485
経常利益		13,163,659		17,142,888
特別利益				
投資有価証券売却益		4,459		3,376
投資有価証券償還益		1,744		20,904
特別利益計		6,204		24,280
特別損失				
投資有価証券売却損		72,045		49,202
投資有価証券償還損		4,115		105,236
固定資産除却損	※2	8,422	※2	870
事故損失賠償金	※3	4,351	※3	12,614
特別損失計		88,934		167,924
税引前当期純利益		13,080,929		16,999,244
法人税、住民税及び事業税		4,134,957		5,395,622
法人税等調整額		△ 106,970		△ 196,661
法人税等合計		4,027,986		5,198,960
当期純利益		9,052,942		11,800,283

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本											株主資本合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金								
		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				
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068			
当期変動額													
剩余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	-	△5,500,048	△5,500,048	△5,500,048		
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	-	9,052,942	9,052,942	9,052,942		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	3,552,893	3,552,893	3,552,893		
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962			

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

当事業年度(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>② その他有価証券 時価のあるもの …決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの …移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>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。</p> <p>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。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. ヘッジ会計の方法	<p>① ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>② ヘッジ手段とヘッジ対象</p>

	<p>ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>③ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>④ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8. 連結納税	日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（2020年3月31日 企業会計基準委員会 実務対応報告第39号）に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

（未適用の会計基準等）

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

（1） 概要

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

（2） 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3） 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

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

（1） 概要

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

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

（2） 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3） 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表に与える影響はありません。

(貸借対照表関係)

※ 1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

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

(損益計算書関係)

※ 1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

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

※ 2. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
建物付属設備	4,181千円	一千円
器具備品	4,240	870
計	8,422	870

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

①配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

①配当金支払額

2020年6月29日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2021年3月31日）

(単位：千円)

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

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

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

資産

①現金・預金

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

②有価証券

決算日の市場価格等によっております。

③投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

負債

①その他未払金

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

デリバティブ取引

①デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度 (2020年3月31日)

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

当事業年度 (2021年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

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

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2021年3月31日）

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2020年3月31日）

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

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

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

(2) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用

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

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下
であるため、注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

1 関連当事者との取引

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

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

当事業年度（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1株当たり情報)

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

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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的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。

追加型証券投資信託

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）

約 款

ニッセイ アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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. 運用方法

(1) 投資対象

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 マザーファンドおよびニッセイ新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

(2) 投資態度

- ① 上記各マザーファンドへの投資を通じ、TOPIX（東証株価指数）、MSCI KOKUSAI指数（円換算ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）を3分の1ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。
- ② 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およびニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の3分の1とします。
- ③ 上記各マザーファンドの合計組入れ比率は、原則として高位を保つことを基本とします。
- ④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 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 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。
- ③ 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。
- 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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。
- 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。

3. 収益分配方針

毎期、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

委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

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。

**追加型証券投資信託
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）
約　　款**

（信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、ニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三
菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けま
す。
- ③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部につい
て、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可
を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条
第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条に
おいて同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることが
ない場合に行うものとします。

（信託の目的および金額）

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受け
ます。

（信託金の限度額）

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第49条第1項、第50条第1項、第51条第1項、または
第53条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込の勧誘の種類）

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場
合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者と
し、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属し
ます。

（受益権の分割および再分割）

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権
については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議のうえ、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。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口
数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28
条に規定する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控除した金額（以下「純資産総額」
といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外
国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。

以下同じ。) の円換算については、原則としてわが国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。

- ③ 第30条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国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。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)

の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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。
- ③ 委託者は、第7条の規定により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、委託者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。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、第2条の規定による受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位および価額等)

第12条 取扱販売会社(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、最低申込単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって取得申込に応じます。ただし、別に定める「自動けいぞく(累積)投資約款」にしたがって契約(以下「別に定める契約」といいます。)を結んだ受益権の取得申込者に対しては、1口単位をもって取得申込に応じることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、取扱販売会社は、当該取得申込の代金(第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引き換えに、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。

- ③ 第1項の場合の取得申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、香港取引決済所、香港の銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の取得申込の受付は行いません

ん。ただし、第45条第2項に規定する収益分配金の再投資にかかる取得申込に限ってこれを受付けるものとします。

- ④ 第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ⑤ 別に定める契約を結んだ受益者が、第45条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（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。）における取引の停止、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、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受けた取得申込の受付を取り消すことができます。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第13条 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第15条 この信託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、約款第23条、第24条および第25条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

（運用の指図範囲等）

第16条 委託者は、信託金を、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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」および「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、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。) に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
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、前各号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、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前号の有価証券の性質を有するもの

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

② 委託者は、信託金を、前項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。以下本条において同じ。) により運用することを指図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前号の権利の性質を有するもの

③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の80を超えることとなる指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の80を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

⑦ 前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価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当該新株引受権証券、当該新株予約権証券、当該投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）および当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

⑨ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポートジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ取引等エクスポート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100分の10、合計で100分の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。

（利害関係人等との取引等）

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第22条から第28条まで、第30条、第34条、第35条および第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第22条から第28条まで、第30条、第34条および第35条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができる、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の株式等への投資制限）

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

② 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

③ 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価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当該株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第21条 委託者は、信託財産に属する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。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価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当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信用取引の指図範囲）

第22条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の信用取引の指図は、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、前項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、委託者は、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ための指図をするものとします。

(先物取引等の運用指図)

第23条 委託者は、わが国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の指図をすることができます。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 委託者は、わが国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の指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国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の指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図・範囲)

第24条 委託者は、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。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める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 スワップ取引の指図にあたっては、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。以下本項において同じ。）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、委託者は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項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受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 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 委託者は、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の指図を行うものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第25条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める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 委託者は、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の指図を行うものとします。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

- 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第28条の規定により借り入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。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き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、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、前項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、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。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、担保の提供の指図をするものとします。

- ② 前項の指図は、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、前項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、委託者は速やかに、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ための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第29条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

② 前項の予約取引の指図は、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の指図については、この限りではありません。

③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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の指図をするものとします。

(信託業務の委託等)

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。

(一部解約の請求ならびに有価証券売却等の指図)

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資するとの指図ができます。

(資金の借入れ)

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入っ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。）の指図をすることができます。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 一部解約に伴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、資金借入額は借入指図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弁さ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弁します。

(損益の帰属)

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第39条 この信託の計算期間は、原則として毎年11月21日から翌年11月20日までとします。ただし、第1計算期間は、信託契約締結日から平成30年11月20日までとします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことができない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および会計監査費用)

第41条 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者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産にかかる会計監査費用および当該会計監査費用にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の32.4の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 每計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日

において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が取扱販売会社に交付されます。この場合、取扱販売会社は、受益者に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をすることと引き換えに、当該償還にかかる受益権の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。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、8営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、取扱販売会社の営業所等において行うものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金および償還金の時効）

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（一部解約）

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に最低単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 前項の場合の一部解約請求申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、香港取引決済所、香港の銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付は行いません。
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の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者が行うことと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の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。
- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤ 信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、取扱販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止、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、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行つた当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第48条 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、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託契約の解約)

第49条 委託者は、信託期間中において、受益権の口数が30億口を下回っている場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

- ② 委託者は、前項の事項について、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 前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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 第2項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 第2項から前項までの規定は、委託者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、第2項から前項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。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第50条 委託者は、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、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第54条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第51条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第54条第2項に規定する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者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第52条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することができ、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することができます。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることができます、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることができます。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第53条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第54条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第54条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託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、この信託約款は本条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 委託者は、前項の事項（前項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、この信託約款にかかる知っ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 前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これ行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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 第2項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 第2項から前項までの規定は、委託者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、この信託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 前各項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。

(反対者の買取請求の不適用)

第55条 この信託は、委託者が第47条第1項の一部解約の請求を受けた場合にこの信託契約の一部を解約する委託者指図型投資信託に該当するため、第49条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合に、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者であっても、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買

取るべき旨を請求することはできません。

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第56条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、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

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第57条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することとし、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第59条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

附則第1条 第12条第1項の「自動けいぞく（累積）投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「自動けいぞく（累積）投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく（累積）投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとします。

附則第2条 第25条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ② 第25条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじ

め元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

附則第3条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年11月17日（信託契約締結日）

委託者 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
ニッセイアセットマネジメント株式会社
代表取締役社長 赤林 富二

受託者 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
三菱UFJ信託銀行株式会社
取締役社長 池谷 幹男