

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年2月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 啓介
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド
（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】

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。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

（７）【申込期間】

継続申込期間：2019年2月21日（木）～ 2019年8月20日（火）

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

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

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經由して、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。

(1 0) 【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

(午前9時~午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(1 1) 【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

(1 2) 【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】

基本方針

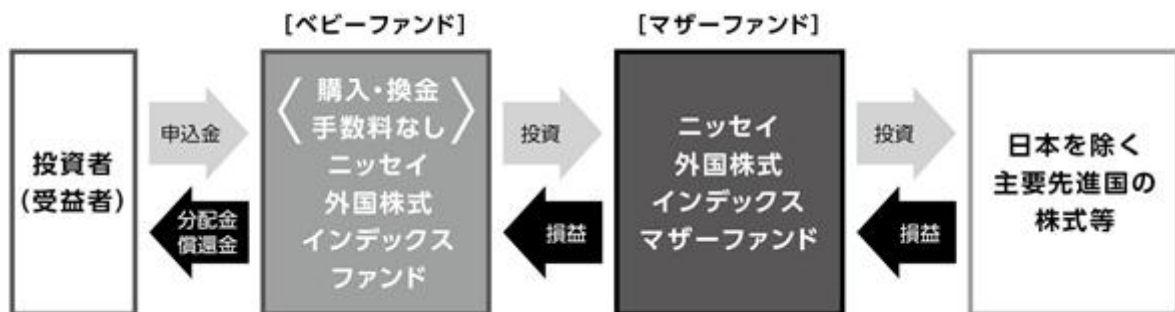
ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

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>



ファンドの特色

日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

- ・当社独自の計量モデル等を活用し、ポートフォリオを構築します。
- ・原則として、対円での為替ヘッジ は行いません。
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。

購入時および換金時の手数料は無料です。

- ・購入時の購入時手数料および換金時の換金時手数料、信託財産留保額はありませぬ。
保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

<MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）について>

同指数は、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指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

3,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの分類

追加型投信 / 海外 / 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せん）。

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	年1回	グローバル (日本除く) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回 (隔月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ		
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	日々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマー ジング		なし	その他 (MSCI コクサイ・ インデックス)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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。
海外	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海外の資産を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 （日本除く）	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除く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 （MSCIコクサイ・ インデックス）	目論見書または約款において、MSCIコクサイ・インデックス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。

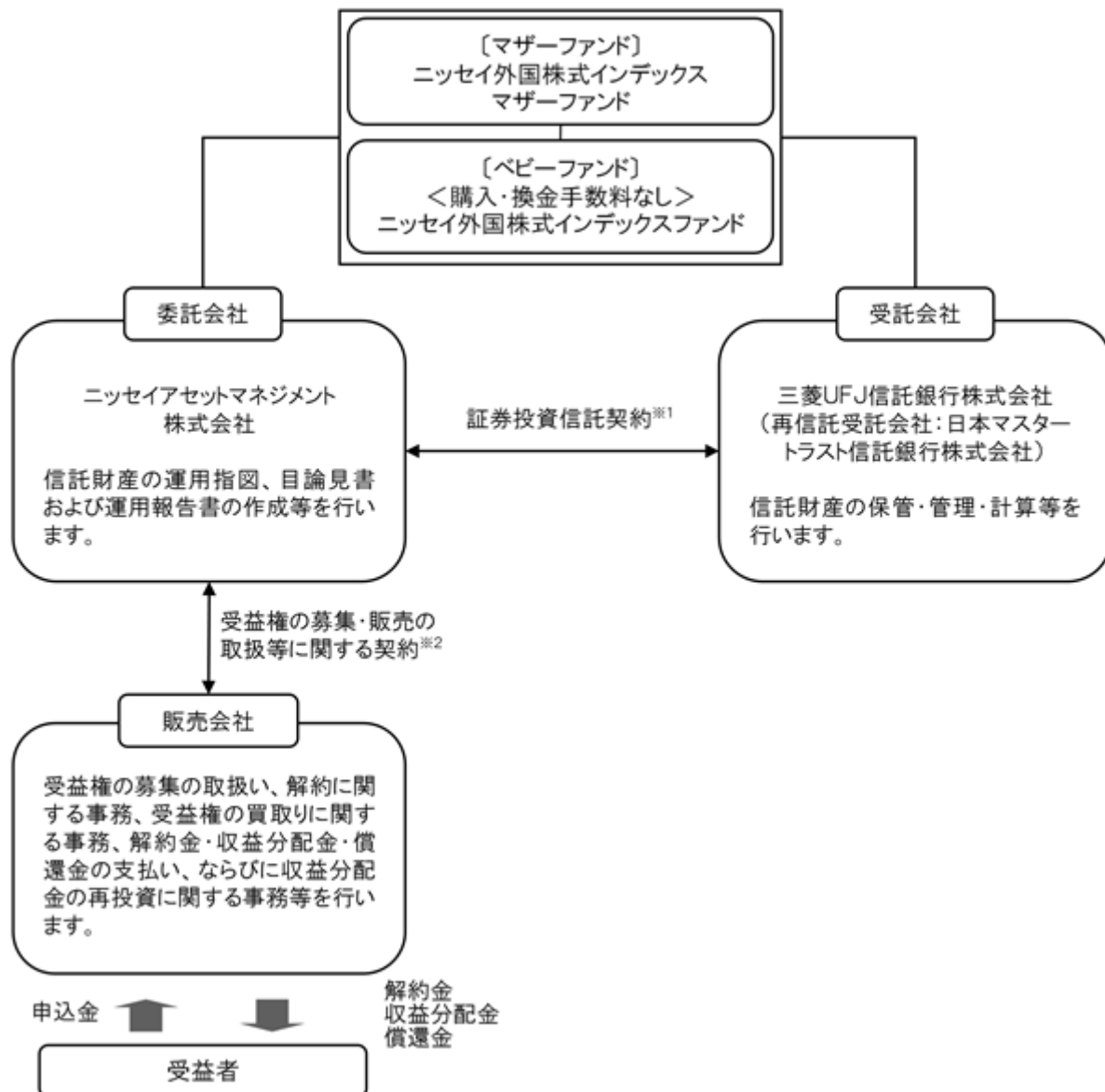
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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】

2013年12月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

委託会社の概況（2018年11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 西 啓介
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】

主として、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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

株式への投資割合には、制限を設けません。

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。

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。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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。

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。

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

（2）【投資対象】

a 主な投資対象

ニッセイ外国株式インデックス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。

b 約款に定める投資対象

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 先物取引等、スワップ取引および 金利先渡し取引および為替先渡し取引」に定めるものに限りま)
 - 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
有価証券
主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「ニッセイ外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、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)
 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)
 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。

金融商品

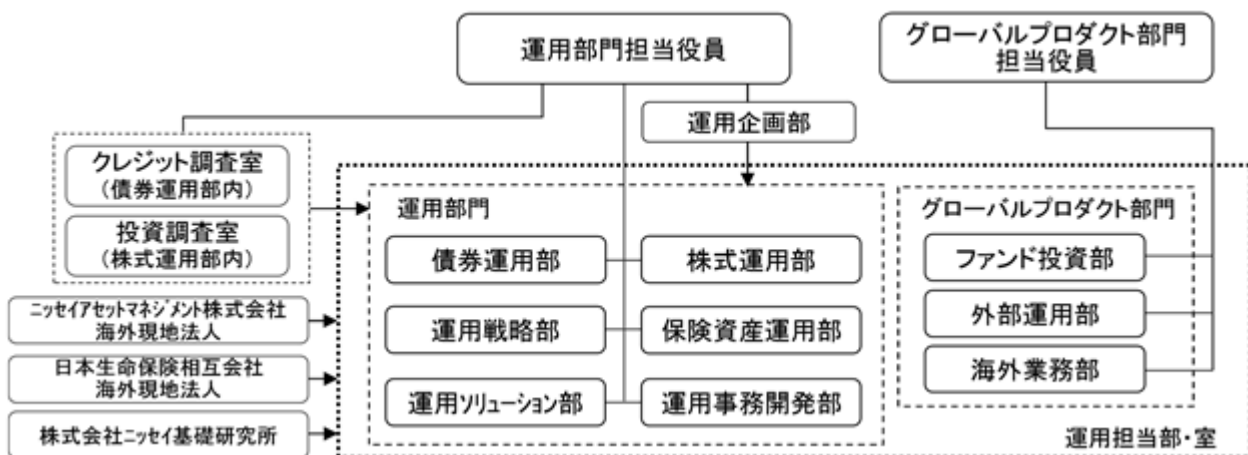
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

- 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

前記 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、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記 に掲げる金融商品により運用することができます。

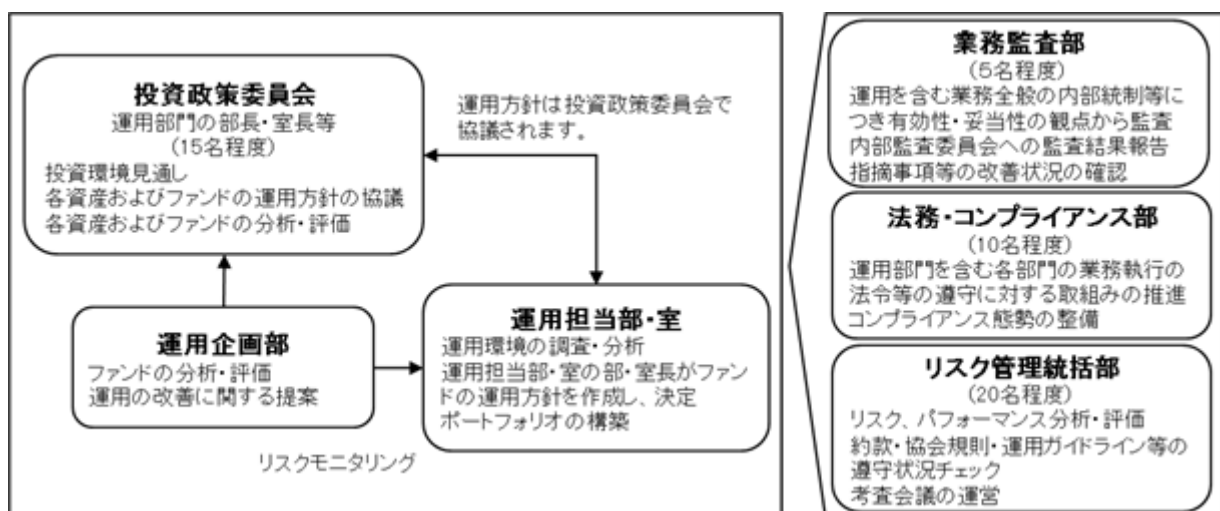
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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(ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます)および売買益(評価益を含みます。ただし、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます)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。

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。

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

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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。

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、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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。

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。

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

b 約款に定めるその他の投資制限
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号口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。

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。

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。

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るときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

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られたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

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。
 - ・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。
 - ・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られたときは、担保の受入れを行うものとします。

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

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られたときは、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。

外国為替予約等

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

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
- 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。
- 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。
- 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、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、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。

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざしますが、当該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のずれ、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担することなどから基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

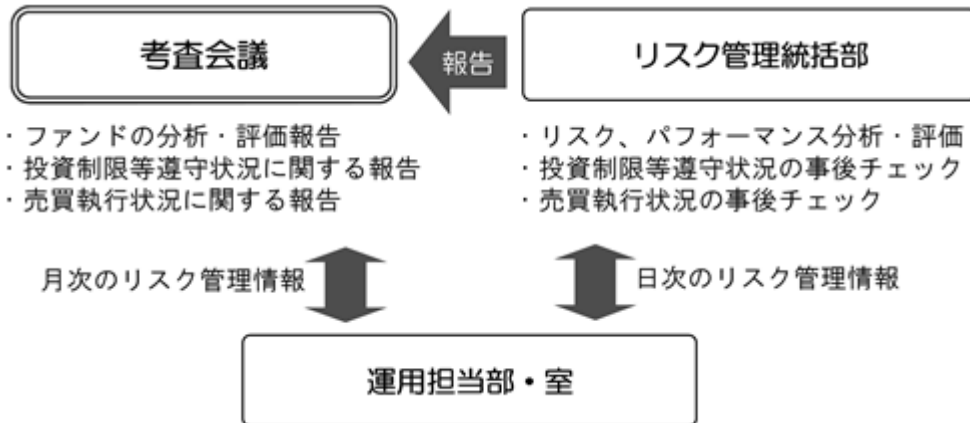
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2018年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に13.6%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・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
 - ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

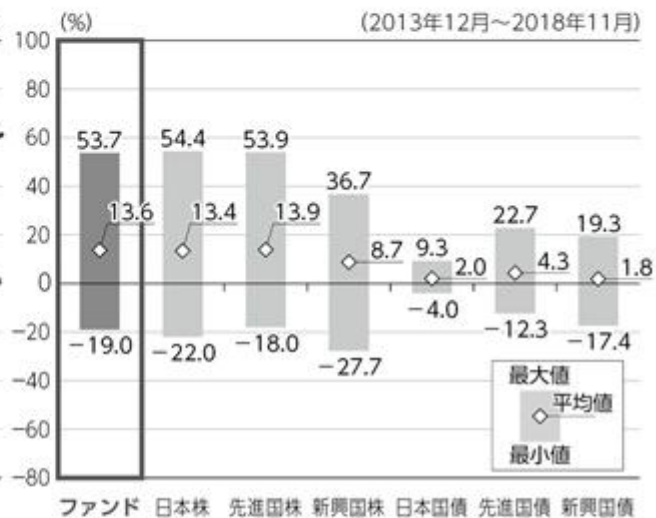
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

(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 (MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)) 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注意ください。

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

❶ 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。

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】

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0.11772%（税抜0.109%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。

なお、2019年2月21日現在の信託報酬率は年0.11772%（税抜0.109%）であり、その配分は次の通りとします。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.04425%	0.04475%	0.02000%

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

(4)【その他の手数料等】

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。

監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.00108%（税抜0.001%）の率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

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。

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。

信託財産留保額

ありません。

上記の、およびの費用は、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・收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收受
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收受
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收受
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收受
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。

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

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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>分配前の受益者の個別元本</p> <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>分配後の受益者の個別元本(変更なし)</p>	<p>分配前の受益者の個別元本</p> <p>分配前の基準価額</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>分配後の受益者の個別元本</p>
<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。</p>	<p>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。</p>

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】

「<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」

(2018年11月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	105,094,778,668	100.00
内 日本	105,094,778,668	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	335,083	0.00
純資産総額	105,094,443,585	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合計の比率であります。

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

(2018年11月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	146,962,530,710	95.31
内 アメリカ	96,107,582,735	62.33
内 イギリス	9,048,591,183	5.87
内 フランス	5,616,938,394	3.64
内 カナダ	5,571,963,834	3.61
内 スイス	5,380,627,873	3.49
内 ドイツ	4,935,004,280	3.20
内 オーストラリア	3,546,553,644	2.30
内 オランダ	3,252,827,264	2.11
内 アイルランド	2,258,054,894	1.46
内 スペイン	1,731,925,335	1.12
内 香港	1,642,239,897	1.07
内 スウェーデン	1,525,963,182	0.99
内 イタリア	1,062,451,515	0.69
内 デンマーク	965,304,179	0.63
内 シンガポール	739,015,012	0.48
内 フィンランド	562,487,392	0.36
内 ベルギー	559,372,242	0.36
内 ノルウェー	419,578,560	0.27
内 ジャージー	418,075,754	0.27
内 バミューダ	354,321,061	0.23
内 オランダ領キュラソー	269,778,124	0.17
内 イスラエル	252,567,207	0.16
内 ケイマン諸島	218,241,418	0.14
内 オーストリア	144,274,998	0.09
内 ニュージーランド	129,466,848	0.08
内 ルクセンブルグ	99,147,152	0.06
内 ポルトガル	85,039,669	0.06
内 バブアニューギニア	32,895,203	0.02
内 イギリス領バージン諸島	27,792,161	0.02
内 モーリシャス	4,449,700	0.00
投資証券	3,757,443,466	2.44

内 アメリカ	2,980,370,328	1.93
内 オーストラリア	293,976,935	0.19
内 フランス	188,494,975	0.12
内 イギリス	112,397,550	0.07
内 香港	87,441,133	0.06
内 シンガポール	65,003,662	0.04
内 カナダ	29,758,883	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,466,548,594	2.25
純資産総額	154,186,522,770	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合計の比率であります。

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,982,293,457	1.93
内 アメリカ	2,226,438,839	1.44
内 ドイツ	540,923,697	0.35
内 イギリス	214,930,921	0.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

その他資産として、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

(2) 【投資資産】

「<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」

【投資有価証券の主要銘柄】

(2018年11月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円)	評価単価(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
				簿価金額(円)	評価金額(円)		
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	60,899,796,412	1.6899	1.7257	-	100.00%
				102,915,181,501	105,094,778,668	-	

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

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

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種別及び各業種の評価金額の比率であります。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2018年11月30日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面 金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 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	181,058	21,085.41 3,817,682,737	20,373.53 3,688,792,133	- -	2.39%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	273,072	11,884.58 3,245,346,071	12,503.25 3,414,290,023	- -	2.21%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	15,541	172,111.94 2,674,791,719	189,899.98 2,951,235,711	- -	1.91%
4	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	100,559	16,757.94 1,685,162,002	16,549.59 1,664,211,176	- -	1.08%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	125,930	12,574.98 1,583,568,441	12,488.50 1,572,677,837	- -	1.02%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	11,802	115,937.80 1,368,298,017	123,489.40 1,457,421,910	- -	0.95%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	158,645	8,988.68 1,426,009,402	8,970.93 1,423,194,490	- -	0.92%
8	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	90,393	14,949.75 1,351,352,959	15,736.01 1,422,426,019	- -	0.92%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	11,204	116,761.00 1,308,190,250	124,201.99 1,391,559,125	- -	0.90%
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	48,625	24,728.66 1,202,431,501	24,702.41 1,201,155,123	- -	0.78%
11	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	36,083	30,234.94 1,090,967,663	32,060.94 1,156,855,204	- -	0.75%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテク ノロジー・ライフサイ エンス	219,679	5,016.92 1,102,113,452	5,164.01 1,134,426,683	- -	0.74%
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	355,478	3,149.06 1,119,422,066	3,181.69 1,131,023,926	- -	0.73%
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	114,834	9,489.42 1,089,708,191	9,704.27 1,114,381,289	- -	0.72%
15	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	66,603	15,299.98 1,019,024,572	15,783.67 1,051,240,239	- -	0.68%
16	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	171,411	6,051.14 1,037,233,098	6,131.91 1,051,078,333	- -	0.68%
17	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	155,196	6,875.47 1,067,046,058	6,745.79 1,046,919,857	- -	0.68%
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナ ル用品	93,269	10,584.91 987,244,320	10,532.28 982,335,726	- -	0.64%

19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	71,795	13,548.94 972,746,545	13,485.90 968,220,872	- -	0.63%
20	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	176,342	5,195.37 916,162,677	5,371.66 947,250,995	- -	0.61%
21	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	272,612	3,444.38 938,981,529	3,468.77 945,630,480	- -	0.61%
22	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	172,805	5,446.13 941,119,148	5,412.51 935,310,345	- -	0.61%
23	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	99,686	8,665.56 863,835,334	8,840.44 881,268,869	- -	0.57%
24	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	42,901	19,700.77 845,182,978	19,932.14 855,108,746	- -	0.55%
25	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	151,476	5,727.44 867,571,089	5,557.76 841,867,344	- -	0.55%
26	NOVARTIS 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	81,254	9,949.23 808,415,401	10,292.00 836,266,493	- -	0.54%
27	BOEING CO アメリカ	株式 資本財	20,465	36,440.56 745,756,229	38,870.28 795,480,345	- -	0.52%
28	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	34,586	21,492.94 743,354,831	22,315.01 771,786,942	- -	0.50%
29	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア	171,612	4,334.92 743,925,520	4,472.98 767,618,313	- -	0.50%
30	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	26,333	28,096.35 739,861,264	28,953.37 762,429,355	- -	0.49%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

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	11.47
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.67
		銀行	8.47
		資本財	6.73
		エネルギー	6.39
		ヘルスケア機器・サービス	5.04
		食品・飲料・タバコ	4.84
		小売	4.66
		各種金融	4.32
		素材	4.27
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.12
		保険	3.71
		公益事業	3.28
		半導体・半導体製造装置	2.73
		電気通信サービス	2.49
		メディア	2.06
		家庭用品・パーソナル用品	1.98
		運輸	1.98
		消費者サービス	1.87
		耐久消費財・アパレル	1.66
		食品・生活必需品小売り	1.65
		自動車・自動車部品	1.21
		商業・専門サービス	1.08
不動産	0.60		
その他	0.03		
	小計		95.31
投資証券	外国	投資証券	2.44
	小計		2.44
合計(対純資産総額比)			97.75

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種別及び各業種の評価金額の比率であります。

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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	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 201812	買建	143	2,177,726,168	2,226,438,839	1.44%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 201812	買建	132	537,324,722	540,923,697	0.35%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 201812	買建	21	213,273,167	214,930,921	0.14%

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

(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取引所の発表する清算値段で評価しております。

(3) 【運用実績】

「＜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」

【純資産の推移】

2018年11月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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 (2014年11月20日)	5,755,823,102	5,755,823,102	1.2526	1.2526
第2計算期間末 (2015年11月20日)	19,029,945,526	19,029,945,526	1.2964	1.2964
第3計算期間末 (2016年11月21日)	35,666,779,975	35,666,779,975	1.1931	1.1931
第4計算期間末 (2017年11月20日)	68,498,781,112	68,498,781,112	1.4711	1.4711
第5計算期間末 (2018年11月20日)	101,893,777,237	101,893,777,237	1.4973	1.4973
2017年11月末日	70,509,821,574	-	1.4945	-
12月末日	75,723,644,630	-	1.5404	-
2018年1月末日	81,614,460,557	-	1.5575	-
2月末日	80,251,935,433	-	1.4872	-
3月末日	79,245,850,010	-	1.4239	-
4月末日	84,779,298,540	-	1.4872	-
5月末日	87,744,717,462	-	1.4939	-
6月末日	90,239,848,025	-	1.5056	-
7月末日	95,297,715,941	-	1.5648	-
8月末日	100,037,586,047	-	1.5984	-
9月末日	104,683,782,339	-	1.6387	-
10月末日	99,616,079,427	-	1.4947	-
11月末日	105,094,443,585	-	1.5290	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	25.3
第2計算期間	3.5
第3計算期間	8.0
第4計算期間	23.3
第5計算期間	1.8

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

「<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」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	6,310,970,246	1,715,745,266	4,595,224,980
第2計算期間	14,317,781,361	4,234,346,844	14,678,659,497
第3計算期間	20,482,172,909	5,266,671,510	29,894,160,896
第4計算期間	30,857,933,252	14,188,576,728	46,563,517,420
第5計算期間	33,677,588,111	12,189,939,740	68,051,165,791

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

3.運用実績

2018年11月末現在

●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

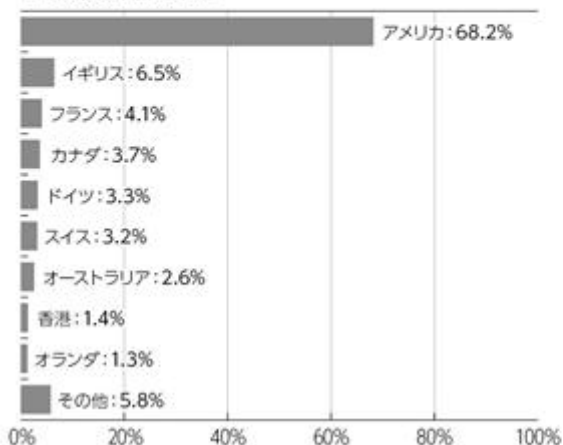
基準価額	15,290円
純資産総額	1,050億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2014年11月	0円
2015年11月	0円
2016年11月	0円
2017年11月	0円
2018年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



業種別比率



・上記グラフはすべて対組入株式等評価額比です。

・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。

・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。

❶ 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。

2018年11月末現在

3.運用実績

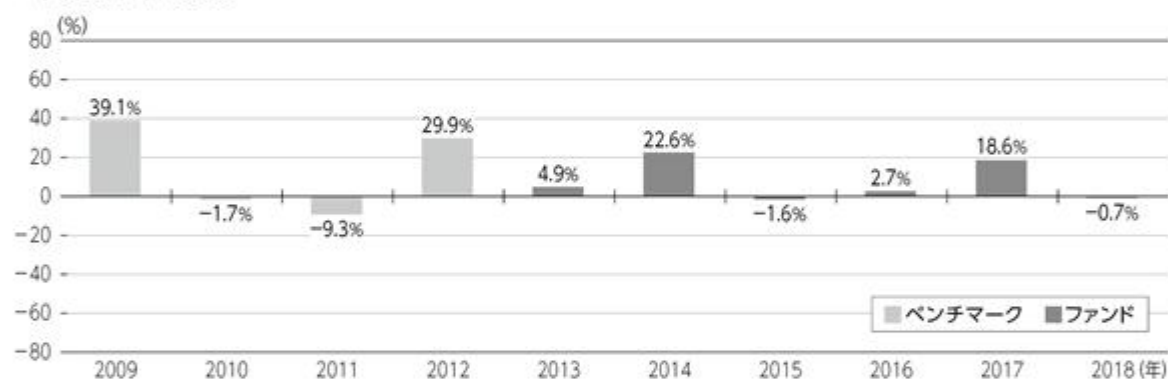
●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	2.4%
2	マイクロソフト	情報技術	2.3%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.0%
4	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	1.1%
5	JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	金融	1.0%
6	アルファベット(C)	情報技術	1.0%
7	エクソンモービル	エネルギー	0.9%
8	フェイスブック	情報技術	0.9%
9	アルファベット(A)	情報技術	0.9%
10	パークシャー・ハサウェイ	金融	0.8%

・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。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2013年はファンド設定時から年末まで、2018年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2012年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

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

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

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

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まれます）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。

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。

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。

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。

申込手数料

ありません。

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

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

換金受付

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

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

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

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。

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。

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。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として6営業日目からお支払いします。

その他

1. 受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
2. 換金請求の受付が中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記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

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

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】**

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。

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。
外国株式	金融商品取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場 で評価します。

外貨建資産（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。

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。

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。

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

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

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】

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。

．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

．やむを得ない事情が発生したとき

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

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「 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。受託会社は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「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
9. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。

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「 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發します。
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であっても、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。

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「 繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「 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。

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。

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っ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。

信託事務処理の再信託

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

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。

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。

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2017年11月21日から2018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。

1【財務諸表】

【＜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】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2017年11月20日現在)	第5期 (2018年11月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	589,573	32,383,005
コール・ローン	61,570,843	45,054,620
親投資信託受益証券	68,500,026,693	101,894,115,768
未収入金	213,987,169	88,700,799
流動資産合計	68,776,174,278	102,060,254,192
資産合計	68,776,174,278	102,060,254,192
負債の部		
流動負債		
未払解約金	212,737,786	86,970,412
未払受託者報酬	6,326,592	10,513,470
未払委託者報酬	56,939,615	66,764,497
その他未払費用	1,389,173	2,228,576
流動負債合計	277,393,166	166,476,955
負債合計	277,393,166	166,476,955
純資産の部		
元本等		
元本	46,563,517,420	68,051,165,791
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	21,935,263,692	33,842,611,446
純資産合計	68,498,781,112	101,893,777,237
負債純資産合計	68,776,174,278	102,060,254,192

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 (自2016年11月22日 至2017年11月20日)	第5期 (自2017年11月21日 至2018年11月20日)
営業収益		
受取利息	357	351
有価証券売買等損益	9,945,733,362	751,322,911
営業収益合計	9,945,733,719	751,323,262
営業費用		
支払利息	17,258	31,099
受託者報酬	10,922,129	19,010,468
委託者報酬	98,299,916	138,564,416
その他費用	2,433,102	4,055,883
営業費用合計	111,672,405	161,661,866
営業利益又は営業損失（ ）	9,834,061,314	589,661,396
経常利益又は経常損失（ ）	9,834,061,314	589,661,396
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,834,061,314	589,661,396
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,704,829,143	586,561,743
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,772,619,079	21,935,263,692
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,356,715,140	17,801,859,264
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,356,715,140	17,801,859,264
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,323,302,698	5,897,611,163
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,323,302,698	5,897,611,163
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,935,263,692	33,842,611,446

(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4期 (2017年11月20日現在)	第5期 (2018年11月20日現在)
1 . 受益権総口数	46,563,517,420口	68,051,165,791口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4711円 (14,711円)	1.4973円 (14,973円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 (自2016年11月22日 至2017年11月20日)	第5期 (自2017年11月21日 至2018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(1,089,710,217円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,594,029,991円)、収益調整金(13,450,763,727円)及び分配準備積立金(800,759,757円)より分配対象収益は21,935,263,692円(1口当たり0.471083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(1,711,720,090円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(25,289,802,410円)及び分配準備積立金(6,841,088,946円)より分配対象収益は33,842,611,446円(1口当たり0.497311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）

金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 (自2016年11月22日 至2017年11月20日)	第5期 (自2017年11月21日 至2018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た場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 (2017年11月20日現在)	第5期 (2018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4期 (2017年11月20日現在)	第5期 (2018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	8,222,840,291	147,089,947
合計	8,222,840,291	147,089,947

(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4期 (2017年11月20日現在)	第5期 (2018年11月20日現在)
期首元本額	29,894,160,896円	46,563,517,420円
期中追加設定元本額	30,857,933,252円	33,677,588,111円
期中一部解約元本額	14,188,576,728円	12,189,939,740円

(4) 【附属明細表】(2018年11月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

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	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	60,295,944,002	101,894,115,768	
親投資信託受益証券	合計	60,295,944,002	101,894,115,768	
合計		60,295,944,002	101,894,115,768	

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（＜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）は、「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、すべて同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。）における同マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ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）

	（2017年11月20日現在）	（2018年11月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	461,118,102	465,602,430
金銭信託	21,028,883	1,475,219,625
コール・ローン	2,196,108,506	2,052,479,632
株式	99,573,624,213	140,969,194,066
投資証券	2,551,322,711	3,569,453,040
派生商品評価勘定	2,973,035	15,686,337
未収入金	38,971	128,523,528
未収配当金	159,110,306	227,585,194
差入委託証拠金	1,100,195,395	1,285,508,197
流動資産合計	106,065,520,122	150,189,252,049
資産合計	106,065,520,122	150,189,252,049
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,889,176	91,327,346
未払金	-	66,447,914
未払解約金	426,007,429	313,161,773
その他未払費用	2,729	53,264
流動負債合計	451,899,334	470,990,297
負債合計	451,899,334	470,990,297
純資産の部		
元本等		
元本	63,730,699,122	88,596,175,879
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,882,921,666	61,122,085,873
純資産合計	105,613,620,788	149,718,261,752
負債純資産合計	106,065,520,122	150,189,252,049

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 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、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、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	(2017年11月20日現在)	(2018年11月20日現在)
1. 受益権総口数	63,730,699,122口	88,596,175,879口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6572円 (16,572円)	1.6899円 (16,899円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 2016年11月22日 至 2017年11月20日）	（自 2017年11月21日 至 2018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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2017年11月20日現在)	(2018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	(2017年11月20日現在)	(2018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	4,931,422,195	6,309,143,648
投資証券	89,414,770	237,194,371
合計	5,020,836,965	6,071,949,277

（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	（2017年11月20日 現在）				（2018年11月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	889,829,383	-	890,249,200	419,817	17,712,427	-	17,725,213	12,786
アメリカ・ドル	664,184,906	-	664,456,500	271,594	17,712,427	-	17,725,213	12,786
イギリス・ポンド	63,637,979	-	63,678,700	40,721	-	-	-	-
ユーロ	162,006,498	-	162,114,000	107,502	-	-	-	-
買 建	1,511,042,934	-	1,497,276,100	13,766,834	3,104,436,814	-	3,082,215,620	22,221,194
アメリカ・ドル	1,113,986,139	-	1,102,572,000	11,414,139	2,224,128,384	-	2,202,953,420	21,174,964
イギリス・ポンド	162,382,581	-	161,418,100	964,481	261,185,981	-	257,530,400	3,655,581
ユーロ	234,674,214	-	233,286,000	1,388,214	619,122,449	-	621,731,800	2,609,351
合計	2,400,872,317	-	2,387,525,300	14,186,651	3,122,149,241	-	3,099,940,833	22,233,980

（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。

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	(2017年11月20日 現在)				(2018年11月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	2,226,363,603	-	2,217,634,112	8,729,491	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028
合計	2,226,363,603	-	2,217,634,112	8,729,491	5,054,120,345	-	5,000,713,317	53,407,028

(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ではありません。

(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	(2017年11月20日現在)	(2018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	46,538,854,861円	63,730,699,122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	33,543,770,390円	39,054,087,237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	16,351,926,129円	14,188,610,480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)	310,923,879円	562,227,597円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,120,379,916円	2,650,340,512円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,784,916,437円	2,084,617,874円
ニッセイ外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	12,010,901,039円	11,709,845,155円
ニッセイ厚生年金型バランス運用DB(適格機関投資家限定)	675,877,427円	-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	41,334,797,667円	60,295,944,002円
DCニッセイ外国株式インデックス	5,220,728,386円	10,792,141,547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)	266,350,239円	406,450,400円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	419,398円	13,254,832円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	244,177円	9,183,684円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	204,051円	7,256,656円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	189,566円	10,766,461円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	90,538円	5,134,713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)	4,295,310円	14,090,128円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	200,574円	23,703,740円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	120,345円	1,668,453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)	60,173円	602,496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)	-円	8,947,629円
計	63,730,699,122円	88,596,175,879円

附属明細表(2018年11月20日現在)

第1 有価証券明細表
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	21,732	205.58	4,467,664.56	
	ABBOTT LABORATORIES	64,192	70.54	4,528,103.68	
	ABBVIE INC	55,546	89.48	4,970,256.08	
	ABIOMED INC	1,547	299.83	463,837.01	
	ACCENTURE PLC	23,526	162.77	3,829,327.02	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	26,474	49.14	1,300,932.36	
	ACUITY BRANDS INC	1,496	123.78	185,174.88	
	ADOBE INC	18,035	219.69	3,962,109.15	
	ADVANCE AUTO PARTS	2,706	177.75	480,991.50	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	33,714	19.11	644,274.54	
	AERCAP HOLDINGS NV	4,596	50.09	230,213.64	
	AES CORP	24,528	15.38	377,240.64	
	AETNA INC	11,972	207.49	2,484,070.28	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,969	110.10	216,786.90	
	AFLAC INC	28,200	45.37	1,279,434.00	
	AGCO CORP	2,287	57.35	131,159.45	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,681	62.61	731,347.41	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,006	159.89	1,280,079.34	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	6,239	68.27	425,936.53	
	ALBEMARLE CORP	4,047	99.61	403,121.67	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,143	115.06	936,933.58	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	2,787	204.43	569,746.41	
	ALKERMES PLC	5,679	34.03	193,256.37	
	ALLEGHANY CORP	550	626.45	344,547.50	
	ALLEGION PLC	3,467	89.44	310,088.48	
	ALLERGAN PLC	12,408	156.04	1,936,144.32	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,834	192.98	353,925.32	
	ALLIANT ENERGY CORP	8,586	45.38	389,632.68	
	ALLSTATE CORP	12,811	88.45	1,133,132.95	
	ALLY FINANCIAL INC	15,724	24.98	392,785.52	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,311	71.48	236,670.28	
	ALPHABET INC-CL A	10,940	1,027.42	11,239,974.80	
	ALPHABET INC-CL C	11,500	1,020.00	11,730,000.00	
	ALTRIA GROUP INC	69,297	55.68	3,858,456.96	
	AMAZON.COM INC	15,106	1,512.29	22,844,652.74	
	AMERCO	355	339.61	120,561.55	
	AMEREN CORPORATION	8,998	69.74	627,520.52	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,478	35.82	160,401.96	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	18,128	77.43	1,403,651.04	
	AMERICAN EXPRESS CO	26,785	108.25	2,899,476.25	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,699	103.28	278,752.72		

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,853	43.30	1,422,534.90	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,583	93.49	615,444.67	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,278	125.96	664,816.88	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,030	90.82	547,644.60	
AMERITRADE HOLDING CORP	10,369	52.07	539,913.83	
AMETEK INC	8,423	72.60	611,509.80	
AMGEN INC	24,230	194.91	4,722,669.30	
AMPHENOL CORP-CL A	11,029	86.16	950,258.64	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18,827	55.61	1,046,969.47	
ANALOG DEVICES INC	13,564	85.52	1,159,993.28	
ANSYS INC	3,061	149.71	458,262.31	
ANTERO RESOURCES CORP	7,464	14.14	105,540.96	
ANTHEM INC	9,343	281.79	2,632,763.97	
AON PLC	8,937	165.58	1,479,788.46	
APACHE CORP	13,940	36.53	509,228.20	
APPLE INC	180,015	185.86	33,457,587.90	
APPLIED MATERIALS INC	36,898	34.42	1,270,029.16	
APTIV PLC	9,684	72.24	699,572.16	
ARAMARK	8,985	35.83	321,932.55	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,763	28.25	417,054.75	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,377	46.31	943,658.87	
ARCONIC INC	15,899	20.34	323,385.66	
ARISTA NETWORKS INC	1,912	223.00	426,376.00	
ARROW ELECTRONICS INC	3,174	73.61	233,638.14	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,618	78.32	518,321.76	
ASSURANT INC	1,892	99.37	188,008.04	
AT&T INC	266,374	30.35	8,084,450.90	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5,666	43.69	247,547.54	
ATMOS ENERGY CORP	4,105	99.34	407,790.70	
AUTODESK INC	8,035	125.74	1,010,320.90	
AUTOLIV INC	3,169	85.18	269,935.42	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	16,123	143.44	2,312,683.12	
AUTOZONE INC	978	829.35	811,104.30	
AVERY DENNISON CORP	3,210	92.44	296,732.40	
AVNET INC	4,269	42.91	183,182.79	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	8,116	24.39	197,949.24	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,985	53.62	160,055.70	
BAKER HUGHES A GE CO	15,185	23.00	349,255.00	
BALL CORP	12,137	49.51	600,902.87	
BANK OF AMERICA CORP	352,581	27.75	9,784,122.75	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	36,947	50.12	1,851,783.64	
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,612	65.02	1,210,152.24	
BB&T CORPORATION	28,394	51.64	1,466,266.16	
BECTON DICKINSON & CO	9,788	243.40	2,382,399.20	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	46,820	217.94	10,203,950.80	

BEST BUY CO INC	9,274	62.20	576,842.80	
BIOGEN INC	7,726	319.21	2,466,216.46	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,467	93.71	606,022.57	
BLACKROCK INC	4,389	407.78	1,789,746.42	
BOEING CO	20,269	320.94	6,505,132.86	
BOOKING HOLDINGS INC	1,765	1,780.00	3,141,700.00	
BORGWARNER INC	7,643	39.41	301,210.63	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	50,484	35.29	1,781,580.36	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	3,880	39.59	153,609.20	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	59,838	53.48	3,200,136.24	
BROADCOM INC	15,038	229.13	3,445,656.94	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,302	101.16	435,190.32	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	9,695	47.48	460,318.60	
BUNGE LIMITED	5,143	58.41	300,402.63	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,238	90.57	474,405.66	
CABOT OIL & GAS CORP	16,520	25.80	426,216.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	10,298	42.77	440,445.46	
CAMPBELL SOUP CO	6,584	38.45	253,154.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,795	87.73	1,561,155.35	
CARDINAL HEALTH INC	11,366	54.57	620,242.62	
CARMAX INC	6,535	62.21	406,542.35	
CARNIVAL CORP	15,597	59.05	921,002.85	
CATERPILLAR INC	21,888	125.98	2,757,450.24	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,110	110.92	455,881.20	
CBRE GROUP INC	11,983	43.61	522,578.63	
CBS CORP-CL B	12,640	54.97	694,820.80	
CDK GLOBAL INC	4,601	49.69	228,623.69	
CDW CORP/DE	5,562	87.86	488,677.32	
CELANESE CORP-SERIES A	4,950	101.69	503,365.50	
CELGENE CORP	26,553	69.40	1,842,778.20	
CENTENE CORP	7,508	131.37	986,325.96	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,195	27.97	425,004.15	
CENTURYLINK INC	35,725	19.03	679,846.75	
CERNER CORP	10,924	56.25	614,475.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,524	45.51	387,927.24	
CHARLES SCHWAB CORP	44,448	45.97	2,043,274.56	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	6,109	323.60	1,976,872.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	4,643	111.42	517,323.06	
CHEMOURS CO/THE - W/I	6,503	29.26	190,277.78	
CHENIERE ENERGY INC	7,765	59.71	463,648.15	
CHEVRON CORP	69,961	119.42	8,354,742.62	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	915	465.87	426,271.05	
CHUBB LTD	17,007	134.33	2,284,550.31	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,917	64.82	577,999.94	
CIGNA CORP	8,905	211.19	1,880,646.95	
CIMAREX ENERGY CO	3,485	88.03	306,784.55	

CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,639	80.71	455,123.69	
CINTAS CORP	3,315	179.58	595,307.70	
CISCO SYSTEMS INC	172,317	45.75	7,883,502.75	
CIT GROUP INC	4,169	44.79	186,729.51	
CITIGROUP INC	93,344	64.62	6,031,889.28	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	17,635	35.95	633,978.25	
CITRIX SYSTEMS INC	4,961	107.09	531,273.49	
CLOROX CO	4,730	162.39	768,104.70	
CME GROUP INC	12,449	195.61	2,435,148.89	
CMS ENERGY CORP	10,503	51.66	542,584.98	
COCA-COLA CO	148,052	50.51	7,478,106.52	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,992	48.85	390,409.20	
COGNEX CORP	6,328	40.71	257,612.88	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	21,430	69.21	1,483,170.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,348	62.77	1,904,943.96	
COMCAST CORP	168,392	38.18	6,429,206.56	
COMERICA INC	6,251	80.66	504,205.66	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	7,107	18.14	128,920.98	
CONAGRA BRANDS INC	14,359	33.42	479,877.78	
CONCHO RESOURCES INC	7,308	139.03	1,016,031.24	
CONOCOPHILLIPS	42,763	66.44	2,841,173.72	
CONSOLIDATED EDISON INC	11,454	77.50	887,685.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,155	193.39	1,190,315.45	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,389	47.22	160,028.58	
COOPER COS INC/THE	1,790	256.80	459,672.00	
COPART INC	7,634	48.54	370,554.36	
CORNING INC	30,393	31.16	947,045.88	
COSTAR GROUP INC	1,326	350.09	464,219.34	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,064	228.74	3,674,479.36	
COTY INC-CL A	17,806	9.15	162,924.90	
CROWN HOLDINGS INC	4,954	49.05	242,993.70	
CSX CORP	30,620	72.08	2,207,089.60	
CUMMINS INC	5,707	145.72	831,624.04	
CVS HEALTH CORP	37,220	78.55	2,923,631.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	12,400	8.90	110,360.00	
DANAHER CORP	23,003	101.30	2,330,203.90	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,514	113.46	512,158.44	
DAVITA INC	5,125	60.45	309,806.25	
DEERE & CO	11,283	142.57	1,608,617.31	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	7,286	103.30	752,643.80	
DELTA AIR LINES INC	6,575	56.19	369,449.25	
DENTSPLY SIRONA INC	8,309	36.92	306,768.28	
DEVON ENERGY CORPORATION	19,113	29.62	566,127.06	
DIAMONDBACK ENERGY INC	3,604	113.81	410,171.24	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,769	69.98	893,574.62	
DISCOVERY INC-A	6,004	30.47	182,941.88	
DISCOVERY INC-C	11,006	27.84	306,407.04	

DISH NETWORK CORP	8,500	31.50	267,750.00
DOLLAR GENERAL CORP	9,791	110.51	1,082,003.41
DOLLAR TREE INC	8,706	84.03	731,565.18
DOMINION ENERGY INC	24,013	74.42	1,787,047.46
DOMINO'S PIZZA INC	1,472	252.07	371,047.04
DOVER CORP	5,629	86.54	487,133.66
DOWDUPONT INC	84,945	57.80	4,909,821.00
DR HORTON INC	13,124	34.96	458,815.04
DTE ENERGY COMPANY	6,709	119.21	799,779.89
DUKE ENERGY CORP	25,768	87.64	2,258,307.52
DXC TECHNOLOGY CO	10,401	59.42	618,027.42
E*TRADE FINANCIAL	9,634	51.32	494,416.88
EAST WEST BANCORP INC	5,187	52.61	272,888.07
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,198	81.82	425,300.36
EATON CORP PLC	15,948	73.48	1,171,859.04
EATON VANCE CORP	4,298	41.70	179,226.60
EBAY INC	34,597	27.96	967,332.12
ECOLAB INC	9,502	160.30	1,523,170.60
EDISON INTERNATIONAL	11,978	53.91	645,733.98
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,712	149.88	1,155,874.56
ELECTRONIC ARTS INC	11,229	83.04	932,456.16
ELI LILLY & CO	35,756	115.81	4,140,902.36
EMERSON ELECTRIC CO	23,022	68.46	1,576,086.12
ENTERGY CORP	6,677	86.76	579,296.52
EOG RESOURCES INC	21,145	105.71	2,235,237.95
EQUIFAX INC	4,396	101.52	446,281.92
ESTEE LAUDER COS INC	8,188	142.87	1,169,819.56
EVEREST RE GROUP LTD	1,484	215.81	320,262.04
EVERGY INC	10,002	59.85	598,619.70
EVERSOURCE ENERGY	11,691	67.38	787,739.58
EXELON CORP	35,477	46.10	1,635,489.70
EXPEDIA GROUP INC	4,527	113.10	512,003.70
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	6,586	73.67	485,190.62
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	20,558	96.90	1,992,070.20
EXXON MOBIL CORP	154,993	79.22	12,278,545.46
F5 NETWORKS INC	2,250	169.54	381,465.00
FACEBOOK INC-A	87,850	131.55	11,556,667.50
FASTENAL CO	10,502	57.48	603,654.96
FEDEX CORP	9,366	226.30	2,119,525.80
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,959	32.32	321,874.88
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	12,099	104.34	1,262,409.66
FIFTH THIRD BANCORP	24,948	27.37	682,826.76
FIRST DATA CORP- CLASS A	19,331	16.92	327,080.52
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,888	93.65	551,411.20
FIRSTENERGY CORP	17,645	38.54	680,038.30
FISERV INC	14,990	78.56	1,177,614.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,279	191.14	626,748.06
FLEX LTD	19,292	8.06	155,493.52
FLIR SYSTEMS INC	5,012	45.88	229,950.56
FLOWSERVE CORP	4,749	48.83	231,893.67

FLUOR CORP	5,136	43.65	224,186.40	
FMC CORP	4,919	81.90	402,866.10	
FORD MOTOR CO	136,125	9.25	1,259,156.25	
FORTINET INC	5,218	67.78	353,676.04	
FORTIVE CORP	11,447	73.76	844,330.72	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	5,302	42.76	226,713.52	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,692	32.22	376,716.24	
FREEPORT-MCMORAN INC	50,236	11.51	578,216.36	
GAP INC	8,513	25.44	216,570.72	
GARMIN LTD	4,109	64.84	266,427.56	
GARTNER INC	3,345	145.34	486,162.30	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,227	179.38	1,655,139.26	
GENERAL ELECTRIC CO	318,101	7.84	2,493,911.84	
GENERAL MILLS INC	21,698	44.23	959,702.54	
GENERAL MOTORS CO	46,443	35.68	1,657,086.24	
GENUINE PARTS CO	5,358	101.66	544,694.28	
GILEAD SCIENCES INC	47,601	68.01	3,237,344.01	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,836	104.38	609,161.68	
GODADDY INC - CLASS A	5,914	59.25	350,404.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,149	198.22	2,606,394.78	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	8,728	22.35	195,070.80	
H&R BLOCK INC	7,634	27.96	213,446.64	
HALLIBURTON CO	31,986	32.99	1,055,218.14	
HANESBRANDS INC	13,238	14.93	197,643.34	
HARLEY-DAVIDSON INC	6,102	40.19	245,239.38	
HARRIS CORP	4,331	148.10	641,421.10	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	13,020	43.83	570,666.60	
HASBRO INC	4,347	94.89	412,486.83	
HCA HEALTHCARE INC	10,246	135.16	1,384,849.36	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	6,419	37.85	242,959.15	
HELMERICH & PAYNE	3,914	64.36	251,905.04	
HENRY SCHEIN INC	5,633	86.25	485,846.25	
HERSHEY CO/THE	5,172	108.35	560,386.20	
HESS CORP	10,091	56.96	574,783.36	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	55,844	14.83	828,166.52	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,453	71.20	744,253.60	
HOLLYFRONTIER CORP	6,122	62.33	381,584.26	
HOLOGIC INC	9,994	41.57	415,450.58	
HOME DEPOT INC	42,260	173.59	7,335,913.40	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,325	147.47	4,029,617.75	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,600	6.42	286,332.00	
HORMEL FOODS CORP	10,587	45.36	480,226.32	
HP INC	60,100	23.55	1,415,355.00	
HUMANA INC	5,039	310.40	1,564,105.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	40,111	14.84	595,247.24	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,623	211.83	343,800.09	
IAC/INTERACTIVECORP	2,855	167.31	477,670.05	
IDEX CORP	2,783	134.61	374,619.63	
IDEX LABORATORIES INC	3,185	193.52	616,361.20	

IHS MARKIT LTD	14,276	50.60	722,365.60	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	11,151	133.99	1,494,122.49	
ILLUMINA INC	5,382	301.59	1,623,157.38	
INCYTE CORP	6,599	64.25	423,985.75	
INGERSOLL-RAND PLC	9,042	103.26	933,676.92	
INGREDION INC	2,630	104.32	274,361.60	
INTEL CORP	170,631	48.00	8,190,288.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,161	81.39	1,722,293.79	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	33,607	120.31	4,043,258.17	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	3,224	140.59	453,262.16	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,376	46.23	664,602.48	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14,250	23.47	334,447.50	
INTUIT INC	8,918	199.24	1,776,822.32	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,147	482.67	2,001,632.49	
INVESCO LTD	14,933	20.11	300,302.63	
IPG PHOTONICS CORP	1,371	136.13	186,634.23	
IQVIA HOLDINGS INC	5,872	115.44	677,863.68	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,806	135.27	379,567.62	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,624	72.93	337,228.32	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,200	63.69	522,258.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	8,200	35.72	292,904.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,188	143.19	313,299.72	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,350	108.51	363,508.50	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	11,331	21.26	240,897.06	
JM SMUCKER CO	4,144	111.85	463,506.40	
JOHNSON & JOHNSON	98,206	147.73	14,507,972.38	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	33,844	33.45	1,132,081.80	
JONES LANG LASALLE INC	1,697	139.08	236,018.76	
JPMORGAN CHASE & CO	124,641	110.83	13,813,962.03	
JUNIPER NETWORKS INC	12,863	28.06	360,935.78	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,885	98.98	384,537.30	
KELLOGG CO	9,528	61.69	587,782.32	
KEYCORP	38,639	18.26	705,548.14	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,820	55.57	378,987.40	
KIMBERLY-CLARK CORP	12,789	110.45	1,412,545.05	
KINDER MORGAN INC	72,624	17.42	1,265,110.08	
KLA-TENCOR CORP	5,703	92.33	526,557.99	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,125	32.22	165,127.50	
KOHL'S CORP	6,146	71.00	436,366.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	22,295	51.89	1,156,887.55	
KROGER CO	29,743	30.56	908,946.08	
L BRANDS INC	8,690	34.55	300,239.50	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,860	187.50	536,250.00	

LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	3,741	161.70	604,919.70	
LAM RESEARCH CORP	6,004	143.74	863,014.96	
LAS VEGAS SANDS CORP	14,399	50.45	726,429.55	
LEAR CORP	2,410	134.97	325,277.70	
LEGGETT & PLATT INC	4,795	37.48	179,716.60	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,251	63.91	335,591.41	
LENNAR CORP-CL A	10,564	41.47	438,089.08	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,359	216.45	294,155.55	
LIBERTY BROADBAND-C	3,951	81.70	322,796.70	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,196	23.67	170,329.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,022	23.20	464,510.40	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,244	38.76	125,737.44	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,528	38.69	252,568.32	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	7,487	29.87	223,636.69	
LINCOLN NATIONAL CORP	7,919	62.93	498,342.67	
LINDE PLC	20,598	159.50	3,285,381.00	
LIVE NATION INC	5,430	53.03	287,952.90	
LKQ CORP	11,347	27.49	311,929.03	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,420	294.59	2,775,037.80	
LOEWS CORP	9,832	48.45	476,360.40	
LOWE'S COS INC	30,108	91.35	2,750,365.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,725	126.99	473,037.75	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,168	92.78	1,128,947.04	
M&T BANK CORP	5,004	168.58	843,574.32	
MACY'S INC	11,187	33.08	370,065.96	
MANPOWER GROUP	2,379	78.07	185,728.53	
MARATHON OIL CORP	31,025	17.12	531,148.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	25,436	63.41	1,612,896.76	
MARKEL CORP	504	1,113.85	561,380.40	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	10,991	116.50	1,280,451.50	
MARSH & MCLENNAN COS INC	18,534	88.84	1,646,560.56	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,302	185.73	427,550.46	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,439	15.19	340,848.41	
MASCO CORP	11,384	30.78	350,399.52	
MASTERCARD INC-CLASS A	33,953	189.28	6,426,623.84	
MATTEL INC	12,655	13.25	167,678.75	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	10,209	52.00	530,868.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,439	149.15	662,076.85	
MCDONALD'S CORP	28,759	186.72	5,369,880.48	
MCKESSON CORP	7,393	126.19	932,922.67	
MEDTRONIC PLC	49,580	90.37	4,480,544.60	
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	9,071	16.34	148,220.14	
MERCADOLIBRE INC	1,538	335.39	515,829.82	

MERCK & CO INC	98,489	76.35	7,519,635.15
METLIFE INC	31,484	43.67	1,374,906.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	929	577.79	536,766.91
MGM MIRAGE	19,338	25.67	496,406.46
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,481	44.60	244,452.60
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,587	73.88	634,407.56
MICRON TECHNOLOGY INC	42,450	36.83	1,563,433.50
MICROSOFT CORP	267,308	104.62	27,965,762.96
MIDDLEBY CORP	2,030	115.95	235,378.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	124.36	288,266.48
MOLSON COORS BREWING CO -B	6,917	66.39	459,219.63
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,988	44.43	2,398,686.84
MONSTER BEVERAGE CORP	15,443	57.04	880,868.72
MOODY'S CORP	6,333	148.19	938,487.27
MORGAN STANLEY	48,644	44.41	2,160,280.04
MOSAIC CO/THE	13,371	34.93	467,049.03
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,985	126.29	755,845.65
MSCI INC	3,268	145.53	475,592.04
MYLAN NV	18,847	34.60	652,106.20
NASDAQ INC	4,247	88.99	377,940.53
NATIONAL-OILWELL INC	13,944	32.81	457,502.64
NEKTAR THERAPEUTICS	6,277	38.01	238,588.77
NETAPP INC	9,800	67.28	659,344.00
NETFLIX INC	15,922	270.60	4,308,493.20
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	17,454	9.59	167,383.86
NEWELL BRANDS INC	17,785	21.42	380,954.70
NEWFIELD EXPLORATION CO	7,279	19.32	140,630.28
NEWMONT MINING CORP	19,379	32.79	635,437.41
NEWS CORP - CLASS A	14,375	13.30	191,187.50
NEXTERA ENERGY INC	17,306	182.01	3,149,865.06
NIelsen HOLDINGS PLC	13,056	25.60	334,233.60
NIKE INC	46,979	72.52	3,406,917.08
NISOURCE INC	13,480	25.93	349,536.40
NOBLE ENERGY INC	17,676	24.94	440,839.44
NORDSTROM INC	4,294	51.26	220,110.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,449	170.53	1,781,867.97
NORTHERN TRUST CORP	7,799	97.60	761,182.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,064	269.26	1,632,792.64
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	7,791	49.27	383,862.57
NUCOR CORP	11,543	62.14	717,282.02
NVIDIA CORP	21,116	144.70	3,055,485.20
NVR INC	127	2,435.33	309,286.91
NXP SEMICONDUCTORS NV	12,598	81.36	1,024,973.28
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,003	354.24	1,063,782.72
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	27,960	73.36	2,051,145.60
OGE ENERGY CORP	7,375	39.51	291,386.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,326	134.31	312,405.06
OMNICOM GROUP	8,414	76.85	646,615.90

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	15,598	17.61	274,680.78	
ONEOK INC	15,045	62.28	937,002.60	
ORACLE CORP	112,105	49.55	5,554,802.75	
OWENS CORNING	4,024	48.95	196,974.80	
PACCAR INC	12,821	60.49	775,542.29	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,439	96.84	333,032.76	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,373	163.44	551,283.12	
PARKER HANNIFIN CORP	4,856	167.57	813,719.92	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,018	21.44	193,345.92	
PAYCHEX INC	11,795	68.41	806,895.95	
PAYPAL HOLDINGS INC	41,302	80.13	3,309,529.26	
PENTAIR PLC	6,139	41.99	257,776.61	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	12,025	16.07	193,241.75	
PEPSICO INC	51,946	119.01	6,182,093.46	
PERRIGO CO PLC	4,797	62.79	301,203.63	
PFIZER INC	214,121	44.18	9,459,865.78	
PG&E CORP	18,951	23.26	440,800.26	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	56,946	87.63	4,990,177.98	
PHILLIPS 66	16,202	94.90	1,537,569.80	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,149	88.87	368,721.63	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,220	157.18	977,659.60	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	5,441	20.49	111,486.09	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,143	135.30	2,319,447.90	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,192	92.49	202,738.08	
PPG INDUSTRIES INC	9,118	107.70	982,008.60	
PPL CORPORATION	25,753	31.44	809,674.32	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,392	49.02	509,415.84	
PROCTER & GAMBLE CO	92,033	93.29	8,585,758.57	
PROGRESSIVE CORP	21,278	65.01	1,383,282.78	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,300	91.65	1,402,245.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,565	54.56	1,012,906.40	
PULTE GROUP INC	9,949	25.22	250,913.78	
PVH CORP	2,818	110.90	312,516.20	
QORVO INC	4,624	63.15	292,005.60	
QUALCOMM INC	51,504	54.90	2,827,569.60	
QUEST DIAGNOSTICS	4,959	94.26	467,435.34	
QURATE RETAIL INC	16,089	22.73	365,702.97	
RALPH LAUREN CORP	2,033	113.44	230,623.52	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,772	77.91	371,786.52	
RAYTHEON CO	10,511	176.44	1,854,560.84	
RED HAT INC	6,500	173.36	1,126,840.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,908	338.99	985,782.92	
REGIONS FINANCIAL CORP	40,770	16.13	657,620.10	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,327	150.24	349,608.48	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,446	125.89	182,036.94	
REPUBLIC SERVICES INC	8,372	76.51	640,541.72	
RESMED INC	5,215	102.57	534,902.55	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	4,491	60.52	271,795.32	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,581	168.04	769,791.24	
ROCKWELL COLLINS INC.	5,994	130.40	781,617.60	
ROLLINS INC	3,528	61.37	216,513.36	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,763	294.03	1,106,434.89	
ROSS STORES INC	13,849	91.19	1,262,890.31	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,184	107.02	661,811.68	
S&P GLOBAL INC	9,213	177.28	1,633,280.64	
SABRE CORP	9,604	24.07	231,168.28	
SALESFORCE.COM INC	25,819	121.01	3,124,357.19	
SCANA CORP	4,999	43.71	218,506.29	
SCHLUMBERGER LTD	50,711	48.31	2,449,848.41	
SEAGATE TECHNOLOGY	9,978	42.06	419,674.68	
SEALED AIR CORP	5,951	36.40	216,616.40	
SEATTLE GENETICS INC	4,044	57.06	230,750.64	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,865	53.42	259,888.30	
SEMPRA ENERGY	9,229	115.24	1,063,549.96	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,240	46.30	288,912.00	
SERVICENOW INC	6,476	156.80	1,015,436.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,087	415.26	1,281,907.62	
SIGNATURE BANK	1,995	117.09	233,594.55	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	58,603	6.05	354,548.15	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,652	70.76	470,695.52	
SMITH (A.O.) CORP	5,248	45.64	239,518.72	
SNAP-ON INC	2,052	164.43	337,410.36	
SOUTHERN CO	37,247	47.04	1,752,098.88	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,455	52.39	285,787.45	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	4,140	81.81	338,693.40	
SPLUNK INC	5,312	89.27	474,202.24	
SPRINT CORP	30,183	6.19	186,832.77	
SQUARE INC - A	10,618	62.97	668,615.46	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,826	45.30	354,517.80	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,629	126.87	714,151.23	
STARBUCKS CORP	50,518	67.91	3,430,677.38	
STATE STREET CORP	13,349	71.77	958,057.73	
STEEL DYNAMICS INC	8,542	39.75	339,544.50	
STERICYCLE INC	3,122	46.19	144,205.18	
STRYKER CORP	12,308	167.72	2,064,297.76	
SUNTRUST BANKS INC	16,920	63.09	1,067,482.80	
SVB FINANCIAL GROUP	1,930	240.34	463,856.20	
SYMANTEC CORP	22,738	22.26	506,147.88	
SYNCHRONY FINANCIAL	26,222	25.53	669,447.66	
SYNOPSIS INC	5,423	85.71	464,805.33	
SYSCO CORP	18,112	66.02	1,195,754.24	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,830	94.96	838,496.80	
T-MOBILE US INC	12,562	68.00	854,216.00	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,181	106.00	443,186.00	
TAPESTRY INC	10,529	39.14	412,105.06	
TARGA RESOURCES CORP	7,984	47.25	377,244.00	
TARGET CORP	18,534	77.79	1,441,759.86	
TE CONNECTIVITY LTD	12,797	74.62	954,912.14	
TECHNIPFMC PLC	15,968	24.27	387,543.36	
TELEFLEX INC	1,664	253.07	421,108.48	
TESLA, INC.	4,668	353.47	1,649,997.96	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	35,399	22.00	778,778.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	35,828	94.62	3,390,045.36	
TEXTRON INC	9,329	55.81	520,651.49	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,726	232.88	3,429,390.88	
TIFFANY & CO	4,086	102.48	418,733.28	
TJX COS INC	45,880	48.96	2,246,284.80	
TOLL BROTHERS INC	5,272	31.07	163,801.04	
TORCHMARK CORP	3,874	86.99	336,999.26	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5,997	84.45	506,446.65	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,462	92.26	411,664.12	
TRANSDIGM GROUP INC	1,731	337.87	584,852.97	
TRANSUNION	6,720	61.30	411,936.00	
TRAVELERS COS INC/THE	9,867	130.52	1,287,840.84	
TRIMBLE INC	9,093	34.97	317,982.21	
TRIPADVISOR INC	3,873	60.87	235,749.51	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	16,082	48.54	780,620.28	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	38,714	48.91	1,893,501.74	
TWITTER INC	24,810	31.98	793,423.80	
TYSON FOODS INC-CL A	10,863	59.42	645,479.46	
UGI CORP	6,400	57.23	366,272.00	
ULTA BEAUTY INC	2,105	313.28	659,454.40	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,001	21.14	148,001.14	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	6,782	19.42	131,706.44	
UNION PACIFIC CORP	28,550	150.64	4,300,772.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,603	92.09	239,710.27	
UNITED PARCEL SERVICE INC	25,407	111.29	2,827,545.03	
UNITED RENTALS INC	3,058	112.54	344,147.32	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	27,805	127.85	3,554,869.25	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,579	116.52	183,985.08	
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,192	266.05	9,362,831.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3,187	131.10	417,815.70	
UNUM GROUP	7,993	35.41	283,032.13	
US BANCORP	56,983	55.00	3,134,065.00	
VAIL RESORTS INC	1,473	262.39	386,500.47	
VALERO ENERGY CORP	15,765	80.69	1,272,077.85	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,338	115.36	385,071.68	

VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	4,401	84.76	373,028.76	
VERISIGN INC	4,072	149.20	607,542.40	
VERISK ANALYTICS INC	5,736	122.50	702,660.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	151,593	60.62	9,189,567.66	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,335	161.07	1,503,588.45	
VF CORP	12,275	80.01	982,122.75	
VIACOM INC-CLASS B	13,021	31.42	409,119.82	
VISA INC-CLASS A SHARES	65,419	134.76	8,815,864.44	
VISTRA ENERGY CORP	12,494	23.55	294,233.70	
VMWARE INC-CLASS A	2,694	153.40	413,259.60	
VOYA FINANCIAL INC	6,143	43.43	266,790.49	
VULCAN MATERIALS CO	4,843	103.90	503,187.70	
WABCO HOLDINGS INC	1,943	117.06	227,447.58	
WABTEC CORP	3,154	87.31	275,375.74	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,849	81.92	2,527,150.08	
WALMART INC	54,037	96.78	5,229,700.86	
WALT DISNEY CO	54,532	115.42	6,294,083.44	
WASTE CONNECTIONS INC	9,579	76.67	734,421.93	
WASTE MANAGEMENT INC	15,819	92.65	1,465,630.35	
WATERS CORP	2,861	197.77	565,819.97	
WEC ENERGY GROUP INC	11,636	71.60	833,137.60	
WELLS FARGO & CO	169,472	53.32	9,036,247.04	
WESTERN DIGITAL CORP	10,950	45.11	493,954.50	
WESTERN UNION CO	16,787	18.71	314,084.77	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,395	69.69	97,217.55	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	9,352	46.07	430,846.64	
WEYERHAEUSER CO	28,002	27.09	758,574.18	
WHIRLPOOL CORP	2,360	118.60	279,896.00	
WILLIAMS COS INC	44,304	25.33	1,122,220.32	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,801	160.26	769,408.26	
WORKDAY INC-CLASS A	5,356	124.07	664,518.92	
WORLDPAY INC	10,886	78.45	854,006.70	
WR BERKLEY CORP	3,491	78.54	274,183.14	
WW GRAINGER INC	1,741	305.10	531,179.10	
WYNN RESORTS LTD	3,584	104.22	373,524.48	
XCEL ENERGY INC	18,772	51.62	969,010.64	
XEROX CORP	8,365	26.53	221,923.45	
XILINX INC	9,264	87.92	814,490.88	
XPO LOGISTICS INC	4,492	73.70	331,060.40	
XYLEM INC	6,553	69.45	455,105.85	
YUM! BRANDS INC	11,839	88.13	1,043,371.07	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8,053	26.00	209,378.00	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	4,272	27.16	116,027.52	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,438	113.50	844,213.00	
ZIONS BANCORP, N.A.	7,079	48.50	343,331.50	
ZOETIS INC	17,714	90.10	1,596,031.40	
アメリカ・ドル 小計	11,226,152		850,286,215.54 (95,801,747,905)	

イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	34,875	8.09	282,348.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,274	19.89	144,716.23	
	ANGLO AMERICAN PLC	38,261	17.24	659,619.64	
	ANTOFAGASTA PLC	13,961	8.13	113,614.61	
	ASHTREAD GROUP PLC	17,942	17.98	322,597.16	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,008	24.80	322,598.40	
	ASTRAZENECA PLC	46,388	61.74	2,863,995.12	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	34,999	4.27	149,515.72	
	AVIVA PLC	146,019	4.16	608,023.11	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	9,069	5.88	53,398.27	
	BAE SYSTEMS PLC	116,694	5.19	606,342.02	
	BARCLAYS PLC	626,439	1.66	1,039,888.74	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	36,828	4.91	181,156.93	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	4,621	33.71	155,773.91	
	BHP GROUP PLC	77,081	16.23	1,251,178.79	
	BP PLC	730,531	5.22	3,818,485.53	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,027	27.22	2,287,214.94	
	BT GROUP PLC	311,645	2.56	797,811.20	
	BUNZL PLC	12,286	22.94	281,840.84	
	BURBERRY GROUP PLC	15,322	17.82	273,038.04	
	CARNIVAL PLC	6,591	44.78	295,144.98	
	CENTRICA PLC	207,447	1.42	294,989.63	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	7,398	22.85	169,044.30	
	COMPASS GROUP PLC	58,054	15.87	921,607.25	
	CONVATEC GROUP PLC	50,407	1.61	81,356.89	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,822	48.25	232,661.50	
	DCC PLC	3,274	57.95	189,728.30	
	DIAGEO PLC	90,167	27.85	2,511,601.78	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,702	3.17	157,853.55	
	EASYJET PLC	6,165	11.75	72,438.75	
	EXPERIAN PLC	33,634	18.45	620,547.30	
	FERGUSON PLC	8,483	48.90	414,818.70	
	FRESNILLO PLC	7,896	8.94	70,606.03	
	G4S PLC	56,981	1.83	104,446.17	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	181,688	15.68	2,849,957.96	
	GLENCORE PLC	421,271	3.00	1,266,340.62	
	GVC HOLDINGS PLC	19,975	7.80	155,805.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,379	18.29	189,831.91	
	HSBC HOLDINGS PLC	733,876	6.51	4,780,468.26	
	IMPERIAL BRANDS PLC	34,962	25.60	895,202.01	
	INFORMA PLC	46,603	7.32	341,227.16	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,650	41.53	276,174.50	
	INTERTEK GROUP PLC	5,904	45.16	266,624.64	
INVESTEC PLC	24,552	5.00	122,956.41		
ITV PLC	134,853	1.46	197,020.23		
JOHNSON MATTHEY PLC	7,080	28.77	203,691.60		
KINGFISHER PLC	78,195	2.45	191,577.75		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	216,683	2.46	533,473.54		

LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,640,131	0.55	1,473,193.09	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,467	40.56	465,101.52	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	59,147	2.94	174,010.47	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	13,544	3.31	44,938.99	
MEGGITT PLC	28,054	5.14	144,253.66	
MELROSE INDUSTRIES PLC	177,330	1.70	301,992.99	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	26,080	3.34	87,107.20	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,940	14.71	234,477.40	
MONDI PLC/WI	13,406	17.63	236,347.78	
MORRISON WM SUPERMARKETS	81,342	2.44	199,206.55	
NATIONAL GRID PLC	123,917	8.25	1,023,430.50	
NEXT PLC	5,158	51.62	266,255.96	
NMC HEALTH PLC	3,828	35.30	135,128.40	
PEARSON PLC	28,848	9.42	271,748.16	
PERSIMMON PLC	11,328	21.06	238,567.68	
PRUDENTIAL PLC	94,848	15.66	1,485,793.92	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,423	64.06	219,277.38	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,515	64.67	1,585,385.05	
RELX PLC	73,429	16.18	1,188,448.36	
RIO TINTO PLC	43,265	38.89	1,682,575.85	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	61,301	7.96	488,446.36	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT	2,757,700	0.00	2,757.70	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	175,545	2.17	381,283.74	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	168,218	23.94	4,027,980.01	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	137,248	24.36	3,343,361.28	
ROYAL MAIL PLC	34,488	3.08	106,464.45	
RSA INSURANCE GROUP PLC	37,170	5.37	199,602.90	
SAGE GROUP PLC	39,754	5.50	218,965.03	
SAINSBURY (J) PLC	63,861	3.06	195,989.40	
SCHRODERS PLC	4,413	24.88	109,795.44	
SEVERN TRENT PLC	8,947	18.54	165,922.11	
SHIRE PLC	33,466	46.00	1,539,436.00	
SMITH & NEPHEW PLC	32,015	13.91	445,328.65	
SMITHS GROUP PLC	14,401	14.15	203,846.15	
SSE PLC	37,812	11.06	418,389.78	
ST JAMES'S PLACE PLC	19,419	10.08	195,840.61	
STANDARD CHARTERED PLC	102,810	5.97	614,186.94	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	85,383	2.56	219,263.54	
TAYLOR WIMPEY PLC	118,991	1.48	176,225.67	
TESCO PLC	358,121	2.05	735,580.53	
TRAVIS PERKINS PLC	9,009	10.16	91,576.48	
TUI AG-DI	15,899	12.67	201,440.33	
UNILEVER PLC	44,734	42.61	1,906,115.74	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,822	7.44	192,322.25	
	VODAFONE GROUP PLC	984,730	1.55	1,534,209.34	
	WEIR GROUP PLC/THE	8,795	15.02	132,100.90	
	WHITBREAD PLC	6,675	45.59	304,313.25	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	24,820	6.42	159,443.68	
	WPP PLC	46,555	8.56	398,697.02	
イギリス・ポンド 小計		13,828,064		64,786,480.11 (9,381,730,185)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	1,609	192.40	309,571.60	
	BANK HAPOLIM BM	38,099	26.50	1,009,623.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,987	24.30	1,263,284.10	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	79,214	4.66	369,295.66	
	ELBIT SYSTEMS LTD	834	439.20	366,292.80	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	25,236	22.82	575,885.52	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,825	66.97	323,130.25	
	NICE LTD	2,220	419.00	930,180.00	
イスラエル・シュケル 小計		204,024		5,147,263.43 (156,631,226)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	25,393	18.40	467,231.20	
	ALUMINA LTD	93,622	2.32	217,203.04	
	AMCOR LTD	45,229	13.49	610,139.21	
	AMP LTD	112,760	2.58	290,920.80	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	21,754	25.82	561,688.28	
	ASX LTD	7,806	60.98	476,009.88	
	AURIZON HOLDINGS LTD	84,614	4.14	350,301.96	
	AUSNET SERVICES	94,101	1.60	150,561.60	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	107,858	25.16	2,713,707.28	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	17,081	9.72	166,027.32	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,143	10.11	203,645.73	
	BHP GROUP LIMITED	118,818	32.40	3,849,703.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,755	12.86	266,909.30	
	BORAL LTD	45,559	5.30	241,462.70	
	BRAMBLES LTD	60,981	10.26	625,665.06	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	10,335	26.40	272,844.00	
	CHALLENGER LTD	22,237	9.67	215,031.79	
	CIMIC GROUP LIMITED	3,907	43.03	168,118.21	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	21,238	10.17	215,990.46	
	COCHLEAR LTD	2,237	156.03	349,039.11	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	65,283	68.50	4,471,885.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	18,107	19.29	349,284.03	
	CROWN RESORTS LTD	15,485	11.70	181,174.50	
	CSL LIMITED	16,663	182.30	3,037,664.90	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,369	47.92	113,522.48		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,237	46.07	103,058.59		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	60,016	4.05	243,064.80		

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,466	3.15	73,917.90	
	HEALTHSCOPE LTD	69,305	2.35	162,866.75	
	INCITEC PIVOT LTD	67,047	3.90	261,483.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	89,097	7.07	629,915.79	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,356	16.04	278,390.24	
	MACQUARIE GROUP LTD	12,195	116.23	1,417,424.85	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	109,095	2.60	283,647.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	101,773	23.58	2,399,807.34	
	NEWCREST MINING LIMITED	29,075	20.59	598,654.25	
	OIL SEARCH LTD	52,536	7.46	391,918.56	
	ORICA LTD	15,006	17.58	263,805.48	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	66,703	6.86	457,582.58	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	52,150	11.35	591,902.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	5,592	54.33	303,813.36	
	REA GROUP LTD	2,212	74.20	164,130.40	
	RIO TINTO LTD	15,493	79.44	1,230,763.92	
	SANTOS LTD	66,436	6.10	405,259.60	
	SEEK LTD	13,508	17.66	238,551.28	
	SONIC HEALTHCARE LTD	16,036	21.71	348,141.56	
	SOUTH32 LTD	190,957	3.31	632,067.67	
	SUNCORP GROUP LTD	51,044	13.42	685,010.48	
	TABCORP HOLDINGS LTD	73,524	4.51	331,593.24	
	TELSTRA CORP LTD	163,109	3.03	494,220.27	
	TPG TELECOM LTD	16,244	7.34	119,230.96	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,214	14.34	390,248.76	
	WESFARMERS LIMITED	42,140	43.86	1,848,260.40	
	WESTPAC BANKING CORP	127,428	25.12	3,200,991.36	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,936	32.55	1,137,166.80	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	49,479	28.65	1,417,573.35	
	オーストラリア・ドル 小計	2,716,744		41,670,194.88 (3,426,540,125)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,541	47.08	402,110.28	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	15,867	65.14	1,033,576.38	
	ALTAGAS LTD	9,774	15.80	154,429.20	
	ARC RESOURCES LTD	12,857	10.91	140,269.87	
	ATCO LTD -CL 'I'	3,146	40.26	126,657.96	
	AURORA CANNABIS INC	23,953	8.02	192,103.06	
	BANK OF MONTREAL	23,416	98.01	2,295,002.16	
	BANK OF NOVA SCOTIA	43,830	70.76	3,101,410.80	
	BARRICK GOLD CORP	42,617	17.26	735,569.42	
	BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	11,527	30.98	357,106.46	
	BCE INC	6,299	55.70	350,854.30	
	BLACKBERRY LTD	18,693	11.32	211,604.76	
	BOMBARDIER INC	77,085	2.07	159,565.95	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	31,146	57.59	1,793,698.14	
	CAE INC	9,766	26.31	256,943.46	
	CAMECO CORP	14,440	16.14	233,061.60	

CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	16,254	113.56	1,845,804.24	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	27,265	113.70	3,100,030.50	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	45,035	35.86	1,614,955.10	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,355	275.39	1,474,713.45	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,297	152.60	350,522.20	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,195	31.55	163,902.25	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,484	52.47	287,745.48	
CENOVUS ENERGY INC	38,238	10.60	405,322.80	
CGI GROUP INC	9,393	80.68	757,827.24	
CI FINANCIAL CORP	9,844	19.65	193,434.60	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	739	894.21	660,821.19	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	19,967	4.96	99,036.32	
DOLLARAMA INC	11,477	34.60	397,104.20	
EMERA INC	2,653	43.99	116,705.47	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,376	24.76	157,869.76	
ENBRIDGE INC	62,490	43.79	2,736,437.10	
ENCANA CORP	35,360	10.05	355,368.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,022	605.50	618,821.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	6,193	26.81	166,034.33	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,713	19.61	151,251.93	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	25,130	12.38	311,109.40	
FORTIS INC	15,988	46.02	735,767.76	
FRANCO-NEVADA CORP	6,805	88.81	604,352.05	
GEORGE WESTON LTD	2,846	94.66	269,402.36	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,892	41.20	325,150.40	
GOLDCORP INC	31,720	12.51	396,817.20	
GREAT-WEST LIFECO INC	10,769	30.74	331,039.06	
HUSKY ENERGY INC	12,837	16.87	216,560.19	
HYDRO ONE LTD	12,773	19.46	248,562.58	
IGM FINANCIAL INC	3,235	33.40	108,049.00	
IMPERIAL OIL LTD	10,601	41.52	440,153.52	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,971	48.64	193,149.44	
INTACT FINANCIAL CORP	5,120	103.21	528,435.20	
INTER PIPELINE LTD	14,100	22.78	321,198.00	
KEYERA CORP	7,560	29.52	223,171.20	
KINROSS GOLD CORP	45,418	3.40	154,421.20	
LINAMAR CORP	1,652	48.99	80,931.48	
LOBLAW COS LTD	6,960	58.79	409,178.40	
LUNDIN MINING CORP	23,557	5.39	126,972.23	
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,302	66.28	815,376.56	
MANULIFE FINANCIAL CORP	72,585	21.77	1,580,175.45	
METHANEX CORP	2,407	76.39	183,870.73	
METRO INC	8,903	43.14	384,075.42	

	NATIONAL BANK OF CANADA	12,498	60.34	754,129.32	
	NUTRIEN LTD	23,232	68.89	1,600,452.48	
	ONEX CORPORATION	3,285	83.49	274,264.65	
	OPEN TEXT CORP	9,838	42.88	421,853.44	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,492	44.81	828,626.52	
	POWER CORP OF CANADA	13,018	26.96	350,965.28	
	POWER FINANCIAL CORP	9,132	28.33	258,709.56	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,656	18.72	143,320.32	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	8,730	70.84	618,433.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	13,699	70.25	962,354.75	
	ROYAL BANK OF CANADA	52,773	94.82	5,003,935.86	
	SAPUTO INC	8,566	39.38	337,329.08	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	9,858	11.98	118,098.84	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,179	25.21	433,082.59	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,235	176.33	570,427.55	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	6,446	47.11	303,671.06	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	22,241	48.44	1,077,354.04	
	SUNCOR ENERGY INC	59,822	43.18	2,583,113.96	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	18,516	28.31	524,187.96	
	THOMSON REUTERS CORP	10,528	63.84	672,107.52	
	TORONTO-DOMINION BANK	67,578	71.71	4,846,018.38	
	TOURMALINE OIL CORP	9,422	20.01	188,534.22	
	TRANSCANADA CORP	32,806	53.22	1,745,935.32	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	35,503	2.46	87,337.38	
	VERMILION ENERGY INC	5,252	33.59	176,414.68	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,183	70.51	153,923.33	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,123	21.09	340,034.07	
	WSP GLOBAL INC	3,795	64.67	245,422.65	
	カナダ・ドル 小計	1,517,844		61,805,627.80 (5,285,617,289)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	98,600	3.14	309,604.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	15,600	8.35	130,260.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	84,300	2.15	181,245.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,100	23.20	1,510,320.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	217,100	0.94	204,074.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	223,700	0.23	52,569.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,500	34.98	122,430.00	
	KEPPEL CORP LTD	52,400	6.29	329,596.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	113,900	11.09	1,263,151.00	
	SATS LTD	28,400	4.85	137,740.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	35,700	2.69	96,033.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	20,700	9.40	194,580.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,100	7.25	203,725.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	60,400	2.67	161,268.00	

	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	54,500	3.50	190,750.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	306,000	3.08	942,480.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	48,400	24.25	1,173,700.00	
	UOL Group Limited	19,300	6.17	119,081.00	
	VENTURE CORP LTD	9,800	14.95	146,510.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	67,700	3.25	220,025.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	81,100	1.27	102,997.00	
	シンガポール・ドル 小計	1,634,300		7,792,138.50 (640,280,021)	
スイス・フラン	ABB LTD	67,443	19.87	1,340,429.62	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,905	47.53	280,664.65	
	BALOISE HOLDING AG	1,757	145.30	255,292.10	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	82	1,725.00	141,450.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	39	6,955.00	271,245.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	79,600.00	238,800.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,156	65.92	1,262,763.52	
	CLARIANT AG	7,310	20.86	152,486.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	93,867	12.32	1,156,441.44	
	DUFREY AG-REG	1,199	102.90	123,377.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	299	541.00	161,759.00	
	GEBERIT AG-REG	1,356	377.40	511,754.40	
	GIVAUDAN-REG	338	2,419.00	817,622.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,283	43.53	360,558.99	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,174	130.00	282,620.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,808	45.73	814,359.84	
	LONZA GROUP AG	2,729	299.80	818,154.20	
	NESTLE SA	114,012	83.30	9,497,199.60	
	NOVARTIS AG	79,392	87.28	6,929,333.76	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,392	70.40	97,996.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	636	671.50	427,074.00	
	ROCHE HOLDING AG	25,733	246.50	6,343,184.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	696	193.00	134,328.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,516	198.40	300,774.40	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	196	2,273.00	445,508.00	
	SIKA AG-BEARER	4,750	124.20	589,950.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,037	150.00	305,550.00	
	STRAUMANN HOLDING AG	379	631.50	239,338.50	
	SWATCH GROUP AG	1,195	305.10	364,594.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,235	381.90	471,646.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,871	81.40	233,699.40	
	SWISS RE AG	11,455	88.52	1,013,996.60	
	SWISSCOM AG	999	461.80	461,338.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,221	123.50	274,293.50	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,639	59.70	97,848.30	
	UBS GROUP AG	141,418	13.57	1,919,749.35	
	VIFOR PHARMA AG	1,662	127.75	212,320.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,531	305.20	1,688,061.20	
スイス・フラン	小計	630,713		41,037,564.07 (4,654,480,517)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	10,864	198.00	2,151,072.00	
	ASSA ABLOY AB	36,921	171.50	6,331,951.50	
	ATLAS COPCO AB	14,226	191.76	2,727,977.76	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	24,773	205.25	5,084,658.25	
	BOLIDEN AB	9,850	204.55	2,014,817.50	
	ELECTROLUX AB	8,933	189.35	1,691,463.55	
	EPIROC AB-A	24,732	78.84	1,949,870.88	
	EPIROC AB-B	14,359	75.73	1,087,407.07	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	22,336	220.40	4,922,854.40	
	HENNES & MAURITZ AB	32,208	160.52	5,170,028.16	
	HEXAGON AB-B SHS	9,568	423.30	4,050,134.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,550	67.26	1,045,893.00	
	ICA GRUPPEN AB	2,966	326.70	968,992.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,379	182.00	1,160,978.00	
	INVESTOR AB	16,811	382.20	6,425,164.20	
	KINNEVIK AB - B	8,624	235.60	2,031,814.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,863	270.20	773,582.60	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,988	241.00	1,684,108.00	
	NORDEA BANK ABP	111,966	81.24	9,096,117.84	
	SANDVIK AB	41,525	133.55	5,545,663.75	
	SECURITAS AB	11,744	153.00	1,796,832.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	60,263	93.36	5,626,153.68	
	SKANSKA AB-B SHS	12,566	142.90	1,795,681.40	
	SKF AB	13,963	138.05	1,927,592.15	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	56,588	97.00	5,489,036.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	33,608	206.10	6,926,608.80	
	SWEDISH MATCH AB	6,551	403.60	2,643,983.60	
	TELE2 AB	13,915	107.60	1,497,254.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	113,031	75.92	8,581,313.52	
	TELIA CO AB	106,630	41.05	4,377,161.50	
	VOLVO AB	57,507	125.10	7,194,125.70	
スウェーデン・クローナ	小計	908,808		113,770,291.81 (1,423,266,350)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	241	8,798.00	2,120,318.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	141	8,200.00	1,156,200.00	
	CARLSBERG AS-B	3,903	731.60	2,855,434.80	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,625	626.40	2,270,700.00	
	COLOPLAST-B	4,334	616.00	2,669,744.00	
	DANSKE BANK A/S	26,168	135.45	3,544,455.60	
	DSV A/S	7,040	505.60	3,559,424.00	
	GENMAB A/S	2,250	928.00	2,088,000.00	
	H LUNDBECK A/S	2,510	276.90	695,019.00	
	ISS A/S	6,092	221.70	1,350,596.40	
	NOVO-NORDISK A/S	66,507	295.15	19,629,541.05	
	NOVOZYMES A/S	7,982	318.50	2,542,267.00	

	ORSTED A/S	6,921	446.60	3,090,918.60	
	PANDORA A/S	4,028	343.20	1,382,409.60	
	TRYGVESTA AS	4,140	161.70	669,438.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,140	457.40	3,265,836.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,660	196.70	719,922.00	
デンマーク・クローネ 小計		156,682		53,610,224.05 (926,384,672)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	26,729	10.47	279,852.63	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	39,323	7.10	279,193.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,920	12.97	271,332.40	
	FLETCHER BUILDING LTD	31,136	5.55	172,804.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	46,726	3.24	151,625.87	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,659	11.85	173,709.15	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	71,511	4.12	294,982.87	
ニュージーランド・ドル 小計		251,004		1,623,501.02 (125,139,458)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	3,951	242.60	958,512.60	
	DNB ASA	35,795	150.00	5,369,250.00	
	EQUINOR ASA	42,813	205.30	8,789,508.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,286	134.60	980,695.60	
	MARINE HARVEST	15,267	197.75	3,019,049.25	
	NORSK HYDRO ASA	48,595	41.97	2,039,532.15	
	ORKLA ASA	29,933	71.56	2,142,005.48	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,697	278.00	1,027,766.00	
	TELENOR ASA	28,094	164.10	4,610,225.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,522	343.00	2,237,046.00	
ノルウェー・クローネ 小計		221,953		31,173,591.38 (413,985,294)	
ユーロ	1 AND 1 DRILLISCH AG	2,055	43.46	89,310.30	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	15,417	22.67	349,503.39	
	ACCOR	7,126	38.88	277,058.88	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,388	32.97	309,522.36	
	ADIDAS AG	6,901	200.80	1,385,720.80	
	ADP	1,223	175.00	214,025.00	
	AEGON NV	64,817	5.33	345,474.61	
	AENA SME SA	2,642	133.00	351,386.00	
	AGEAS	6,648	44.39	295,104.72	
	AIB GROUP PLC	30,183	3.78	114,333.20	
	AIR LIQUIDE	15,879	104.95	1,666,501.05	
	AIRBUS SE	21,398	92.57	1,980,812.86	
	AKZO NOBEL NV	9,266	73.34	679,568.44	
	ALLIANZ SE	16,106	188.66	3,038,557.96	
	ALSTOM RGPT	5,907	38.46	227,183.22	
	AMADEUS IT GROUP SA	16,061	65.86	1,057,777.46	
	AMUNDI SA	2,378	47.59	113,169.02	
	ANDRITZ AG	2,652	42.16	111,808.32	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	27,959	68.36	1,911,277.24	
	ARCELORMITTAL	24,463	21.67	530,235.52	
	ARKEMA	2,638	87.18	229,980.84	
	ASML HOLDING NV	15,021	143.96	2,162,423.16	

ASSICURAZIONI GENERALI SPA	42,909	14.46	620,464.14	
ATLANTIA SPA	19,074	18.01	343,618.11	
ATOS SE	3,564	70.90	252,687.60	
AXA	71,462	21.68	1,549,653.47	
AXEL SPRINGER SE	1,872	58.00	108,576.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	243,821	4.91	1,197,161.11	
BANCO DE SABADELL SA	204,626	1.15	235,319.90	
BANCO SANTANDER SA	590,783	4.20	2,483,060.94	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	36,124	5.90	213,131.60	
BANKIA SA	44,780	2.89	129,458.98	
BANKINTER SA	24,305	7.64	185,690.20	
BASF SE	33,620	69.02	2,320,452.40	
BAYER AG	33,389	62.30	2,080,134.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,153	74.18	901,509.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,962	65.95	129,393.90	
BEIERSDORF AG	3,658	92.02	336,609.16	
BIOMERIEUX	1,600	64.90	103,840.00	
BNP PARIBAS	41,377	45.28	1,873,757.44	
BOLLORE	37,694	3.86	145,725.00	
BOUYGUES	8,274	32.73	270,808.02	
BRENNTAG AG	5,612	42.31	237,443.72	
BUREAU VERITAS SA	10,348	19.28	199,509.44	
CAIXABANK	131,045	3.71	486,307.99	
CAPGEMINI SA	5,980	102.15	610,857.00	
CARREFOUR SA	21,570	17.35	374,347.35	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,147	38.01	81,607.47	
CIE DE SAINT-GOBAIN	18,546	31.25	579,655.23	
CNH INDUSTRIAL NV	37,349	8.47	316,495.42	
CNP ASSURANCES	7,091	20.04	142,103.64	
COLRUYT NV	2,167	56.38	122,175.46	
COMMERZBANK AG	36,749	8.12	298,475.37	
CONTINENTAL AG	4,018	135.95	546,247.10	
COVESTRO AG	7,015	55.90	392,138.50	
CREDIT AGRICOLE SA	42,796	10.88	465,706.07	
CRH PLC	31,012	23.99	743,977.88	
DAIMLER AG	33,312	50.45	1,680,590.40	
DANONE	22,782	64.71	1,474,223.22	
DASSAULT AVIATION SA	97	1,351.00	131,047.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,875	105.35	513,581.25	
DAVIDE CAMPARI -MILANO SPA	21,412	7.68	164,444.16	
DELIVERY HERO SE	3,367	32.58	109,696.86	
DEUTSCHE BANK AG	71,982	8.56	616,453.84	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,060	111.75	788,955.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	8,861	20.22	179,169.42	
DEUTSCHE POST AG	36,728	28.13	1,033,158.64	
DEUTSCHE TELEKOM AG	123,630	15.17	1,875,467.10	
DEUTSCHE WOHNEN SE	13,366	40.76	544,798.16	
E.ON SE	81,063	9.20	746,265.97	
EDENRED	8,812	32.92	290,091.04	
EDF	22,023	14.96	329,464.08	
EIFFAGE	3,104	87.74	272,344.96	
ELISA OYJ	5,500	37.49	206,195.00	

ENAGAS SA	8,280	24.32	201,369.60
ENDESA SA	11,757	20.22	237,726.54
ENEL SPA	299,975	4.56	1,368,485.95
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	94,957	3.08	292,467.56
ENGIE	68,142	12.19	830,991.69
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	93,253	14.72	1,372,684.16
ERSTE GROUP BANK AG	11,043	35.47	391,695.21
ESSILORLUXOTTICA	7,735	115.00	889,525.00
EURAZEO	1,892	65.40	123,736.80
EUROFINS SCIENTIFIC	432	383.40	165,628.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,743	18.60	125,419.80
EVONIK INDUSTRIES AG	5,908	25.87	152,839.96
EXOR NV	3,988	50.62	201,872.56
FAURECIA	2,912	39.80	115,897.60
FERRARI NV	4,508	95.26	429,432.08
FERROVIAL S.A.	17,760	17.60	312,664.80
FERROVIAL SA - RTS	17,369	0.41	7,121.29
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	39,456	14.37	567,140.54
FORTUM OYJ	16,489	18.85	310,817.65
FRAPORT AG	1,733	64.70	112,125.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	7,902	68.48	541,128.96
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,264	51.46	785,485.44
FUCHS PETROLUB AG -PFD	2,511	40.08	100,640.88
GALP ENERGIA SGPS SA	18,247	14.55	265,585.08
GEA GROUP AG	6,309	25.94	163,655.46
GETLINK SE - REGR	19,586	10.94	214,368.77
GRIFOLS SA	10,940	26.09	285,424.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,936	80.24	235,584.64
HANNOVER RUECK SE	2,157	122.40	264,016.80
HEIDELBERGCEMENT AG	5,450	59.22	322,749.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,255	77.40	329,337.00
HEINEKEN NV	9,526	80.38	765,699.88
HENKEL AG & CO KGAA	3,741	90.00	336,690.00
HENKEL KGAA-VORZUG	6,540	98.06	641,312.40
HERMES INTERNATIONAL	1,182	482.80	570,669.60
HOCHTIEF AG	697	124.50	86,776.50
HUGO BOSS AG	2,314	61.08	141,339.12
IBERDROLA SA	219,326	6.69	1,468,606.89
ILIAD SA	1,037	108.50	112,514.50
IMERYS SA	1,449	51.00	73,899.00
INDITEX SA	39,942	25.19	1,006,138.98
INFINEON TECHNOLOGIES AG	41,590	17.07	710,149.25
ING GROEP NV-CVA	142,570	10.88	1,551,731.88
INGENICO GROUP	2,234	63.40	141,635.60
INNOGY SE	5,183	39.88	206,698.04
INTESA SANPAOLO	546,299	1.92	1,052,171.87
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	23,376	7.14	166,998.14
IPSEN	1,420	120.30	170,826.00
JC DECAUX SA	3,117	28.84	89,894.28
JERONIMO MARTINS	9,131	10.63	97,108.18
K+S AG	7,023	16.45	115,563.46

KBC GROEP NV	9,171	62.00	568,602.00
KERING	2,792	382.60	1,068,219.20
KERRY GROUP PLC-A	5,886	91.70	539,746.20
KION GROUP AG	2,584	51.02	131,835.68
KONE OYJ	12,386	42.86	530,863.96
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	45,638	22.88	1,044,425.63
KONINKLIJKE DSM NV	6,656	77.66	516,904.96
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,477	32.71	1,127,915.05
L'OREAL SA	9,325	205.40	1,915,355.00
LANXESS	3,183	51.14	162,778.62
LEGRAND SA	10,018	53.04	531,354.72
LEONARDO SPA	14,843	8.32	123,553.13
LUXOTTICA GROUP SPA	6,254	52.88	330,711.52
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,226	259.25	2,651,090.50
MAPFRE SA	37,428	2.53	94,805.12
MEDIOBANCA SPA	22,845	7.40	169,053.00
MERCK KGAA	4,727	96.92	458,140.84
METRO AG	6,476	14.29	92,542.04
METSO OYJ	3,871	26.05	100,839.55
MICHELIN (C.G.D.E.)	6,363	88.94	565,925.22
MONCLER SPA	6,575	29.99	197,184.25
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	1,892	181.00	342,452.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	5,471	190.30	1,041,131.30
NATIXIS	36,808	4.92	181,242.59
NATURGY ENERGY GROUP SA	13,051	23.03	300,564.53
NESTE OYJ	4,684	70.18	328,723.12
NN GROUP NV	10,950	38.04	416,538.00
NOKIA OYJ	206,795	5.04	1,043,073.98
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,279	27.29	116,773.91
OMV AG	5,350	45.57	243,799.50
ORANGE S.A.	75,600	14.67	1,109,052.00
ORION OYJ-CLASS B	3,810	29.74	113,309.40
OSRAM LICHT AG	3,607	32.45	117,047.15
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,124	81.95	256,011.80
PERNOD-RICARD	7,892	139.85	1,103,696.20
PEUGEOT SA	21,751	19.75	429,691.00
PIRELLI & C SPA	14,843	6.29	93,392.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	5,568	57.50	320,160.00
POSTE ITALIANE SPA	18,891	6.55	123,811.61
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	8,713	17.37	151,344.81
PROXIMUS	6,079	23.40	142,248.60
PRYSMIAN SPA	8,813	16.04	141,404.58
PUBLICIS GROUPE	7,849	52.82	414,584.18
PUMA AG	303	440.00	133,320.00
QIAGEN NV	8,270	29.76	246,115.20
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	5,380	26.43	142,193.40
RANDSTAD NV	4,328	42.14	182,381.92
RECORDATI SPA	3,833	28.79	110,352.07
RED ELECTRICA DE ESPANA	16,103	19.00	306,037.51

REMY COINTREAU	889	102.80	91,389.20
RENAULT SA	7,109	59.06	419,857.54
REPSOL SA	49,327	15.61	769,994.47
REXEL SA	11,536	10.16	117,263.44
ROYAL KPN NV	129,954	2.40	312,929.23
RTL GROUP	1,488	51.35	76,408.80
RWE AG	19,081	19.30	368,263.30
SAFRAN SA	12,308	107.95	1,328,648.60
SAMPO OYJ	16,163	40.02	646,843.26
SANOFI	41,312	78.55	3,245,057.60
SAP SE	35,990	88.95	3,201,310.50
SARTORIUS AG-VORZUG	1,305	114.10	148,900.50
SCHAEFFLER AG	6,026	7.91	47,701.81
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,178	63.40	1,279,285.20
SCOR REGROUPE	6,329	42.14	266,704.06
SEB SA	879	116.90	102,755.10
SIEMENS AG	28,002	100.02	2,800,760.04
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,643	11.72	101,295.96
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,421	37.17	201,498.57
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,349	25.06	209,225.94
SNAM SPA	83,016	3.88	322,683.19
SOCIETE BIC SA	1,014	93.80	95,113.20
SOCIETE GENERALE	28,340	33.03	936,070.20
SODEXO	3,383	91.40	309,206.20
SOLVAY SA	2,732	100.85	275,522.20
STMICROELECTRONICS NV	25,249	12.21	308,290.29
STORA ENSO OYJ	20,124	12.20	245,512.80
SUEZ	14,514	13.28	192,818.49
SYMRISE AG	4,532	71.12	322,315.84
TELECOM ITALIA SPA	605,643	0.54	331,286.72
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,156	3.44	100,296.64
TELEFONICA SA	173,822	7.46	1,297,928.87
TELENET GROUP HOLDING NV	2,085	42.54	88,695.90
TELEPERFORMANCE	2,174	143.00	310,882.00
TENARIS SA	17,292	12.10	209,319.66
TERNA SPA	53,542	4.88	261,445.58
THALES SA	4,006	110.05	440,860.30
THYSSENKRUPP AG	15,991	16.09	257,375.14
TOTAL SA	87,907	49.55	4,355,791.85
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,951	67.18	198,248.18
UCB SA	4,630	75.84	351,139.20
UMICORE	7,688	40.59	312,055.92
UNICREDIT SPA	73,563	10.82	796,245.91
UNILEVER NV	56,549	48.72	2,755,067.28
UNIPER SE	7,370	25.90	190,883.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,497	38.47	172,999.59
UPM-KYMMENE OYJ	19,470	26.06	507,388.20
VALEO SA	8,965	24.72	221,614.80
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,519	18.47	378,985.93
VINCI SA	18,757	76.80	1,440,537.60
VIVENDI SA	38,660	21.64	836,602.40
VOESTALPINE AG	4,117	30.26	124,580.42

	VOLKSWAGEN AG	1,104	143.40	158,313.60	
	VOLKSWAGEN AG	6,857	146.72	1,006,059.04	
	VONOVIA SE	18,189	42.13	766,302.57	
	VOPAK	2,559	39.23	100,389.57	
	WARTSILA OYJ	16,233	14.48	235,053.84	
	WENDEL	1,106	111.30	123,097.80	
	WIRECARD AG	4,299	137.60	591,542.40	
	WOLTERS KLUWER NV	10,642	51.90	552,319.80	
	ZALANDO SE	4,095	27.23	111,506.85	
ユーロ 小計		7,165,572		131,599,563.98 (16,973,711,762)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	442,675	65.55	29,017,346.25	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,100	74.90	831,390.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,400	26.20	1,189,480.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	135,039	30.30	4,091,681.70	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	96,409	56.40	5,437,467.60	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	98,909	82.85	8,194,610.65	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	25,000	58.15	1,453,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	60,643	88.75	5,382,066.25	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	86,810	46.90	4,071,389.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	36,000	21.65	779,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,157	15.64	1,238,015.48	
	HANG SENG BANK LTD	27,912	179.50	5,010,204.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	51,038	38.90	1,985,378.20	
	HONG KONG & CHINA GAS	342,680	15.28	5,236,150.40	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	43,311	228.00	9,874,908.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	26,000	39.70	1,032,200.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	25,000	26.65	666,250.00	
	LI & FUNG LTD	221,278	1.66	367,321.48	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	35,200	12.16	428,032.00	
	MINTH GROUP LTD	26,000	27.10	704,600.00	
	MTR CORP	59,755	39.70	2,372,273.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	233,669	10.76	2,514,278.44	
	NWS HOLDINGS LTD	56,000	16.38	917,280.00	
	PCCW LTD	183,000	4.35	796,050.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	51,587	53.80	2,775,380.60	
	SANDS CHINA LTD	88,980	32.90	2,927,442.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	11.68	560,640.00	
	SINO LAND CO	126,000	13.00	1,638,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	72,000	6.96	501,120.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	59,523	110.10	6,553,482.30	
	SWIRE PACIFIC LTD	19,366	88.35	1,710,986.10	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,200	29.60	1,337,920.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	50,500	43.15	2,179,075.00	
	WH GROUP LTD	324,000	6.50	2,106,000.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	46,733	20.85	974,383.05	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	45,733	52.05	2,380,402.65	
	WHELOCK & CO LTD	33,000	46.30	1,527,900.00	

	WYNN MACAU LTD	57,703	16.76	967,102.28	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	23.65	638,550.00	
香港・ドル	小計	3,543,310		122,369,906.93 (1,759,679,262)	
合計		44,005,170		140,969,194,066 (140,969,194,066)	

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	16,781.00	294,338.74	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,876.00	473,220.84	
		AMERICAN TOWER REIT INC	16,281.00	2,706,390.63	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	41,783.00	417,412.17	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,158.00	968,414.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,767.00	724,508.21	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	8,812.00	160,907.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,519.00	325,683.45	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	15,315.00	1,719,415.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,625.00	854,228.75	
		DUKE REALTY CORP	13,464.00	383,185.44	
		EQUINIX INC	2,940.00	1,127,401.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	13,722.00	952,306.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,468.00	636,275.08	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,738.00	452,005.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,779.00	359,241.33	
		HCP INC	17,555.00	503,126.30	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	27,635.00	529,210.25	
		INVITATION HOMES INC	11,957.00	250,140.44	
		IRON MOUNTAIN INC	10,218.00	341,894.28	
		KIMCO REALTY CORP	15,934.00	247,614.36	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,680.00	248,727.20	
		MACERICH CO/THE	4,003.00	199,589.58	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,276.00	433,800.20	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,882.00	289,217.94	
		PROLOGIS INC	23,223.00	1,572,197.10	
		PUBLIC STORAGE	5,815.00	1,233,128.90	
		REALTY INCOME CORP	10,673.00	682,751.81	
		REGENCY CENTERS CORP	5,751.00	365,533.56	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,293.00	743,290.02	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	11,448.00	2,138,715.36	
		SL GREEN REALTY CORP	3,344.00	311,426.72	
		UDR INC	10,203.00	422,812.32	
VENTAS INC	13,217.00	817,603.62			
VEREIT	36,764.00	277,200.56			
VORNADO REALTY TRUST	6,451.00	460,278.85			
WELLTOWER INC	13,794.00	969,856.14			

アメリカ・ドル 小計		413,144.00	25,593,050.62 (2,883,569,013)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	35,987.00	210,595.92	
	HAMMERSON PLC	29,897.00	125,686.98	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,588.00	240,482.25	
	SEGRO PLC	38,956.00	238,566.54	
イギリス・ポンド 小計		133,428.00	815,331.69 (118,068,182)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	43,116.00	440,645.52	
	GOODMAN GROUP	65,883.00	680,571.39	
	GPT GROUP	79,388.00	419,962.52	
	MIRVAC GROUP	159,537.00	350,981.40	
	SCENTRE GROUP	214,210.00	828,992.70	
	STOCKLAND	103,871.00	374,974.31	
	VICINITY CENTRES	142,192.00	381,074.56	
オーストラリア・ドル 小計		808,197.00	3,477,202.40 (285,930,353)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	6,586.00	136,461.92	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,817.00	168,925.26	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,331.00	103,360.93	
カナダ・ドル 小計		16,734.00	408,748.11 (34,956,138)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	98,000.00	250,880.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	102,900.00	174,930.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	98,800.00	216,372.00	
	SUNTEC REIT	85,400.00	152,012.00	
シンガポール・ドル 小計		385,100.00	794,194.00 (65,258,921)	
ユーロ	COVIVIO	1,767.00	153,905.70	
	GECINA SA	1,856.00	238,867.20	
	ICADE	1,615.00	114,503.50	
	KLEPIERRE	8,367.00	243,981.72	
ユーロ 小計		13,605.00	751,258.12 (96,897,272)	
香港・ドル	LINK REIT	80,371.00	5,895,212.85	
香港・ドル 小計		80,371.00	5,895,212.85 (84,773,161)	
投資証券 合計			3,569,453,040 (3,569,453,040)	
合計			3,569,453,040 (3,569,453,040)	

(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 595銘柄	63.99%	-%	68.28%
	投資証券 37銘柄	-%	1.93%	
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	6.27%	-%	6.57%
	投資証券 4銘柄	-%	0.08%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄	2.29%	-%	2.57%
	投資証券 7銘柄	-%	0.19%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.53%	-%	3.68%
	投資証券 3銘柄	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.43%	-%	0.49%
	投資証券 4銘柄	-%	0.04%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.11%	-%	3.22%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	0.95%	-%	0.98%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.62%	-%	0.64%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.28%	-%	0.29%
ユーロ	株式 235銘柄	11.34%	-%	11.81%
	投資証券 4銘柄	-%	0.06%	
香港・ドル	株式 39銘柄	1.18%	-%	1.28%
	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「<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」

(2018年11月30日現在)

資産総額	105,347,234,755円
負債総額	252,791,170円
純資産総額(-)	105,094,443,585円
発行済数量	68,734,922,978口
1口当たり純資産額(/)	1.5290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

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。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、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。

前記の振替について、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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2018年11月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。

最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

2018年11月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	372	57,364
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	95	21,189
単位型公社債投資信託	2	81
合計	469	78,634

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．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

- (1) 委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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23期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第24期事業年度に係る中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		20,957,403		19,824,114
有価証券		6,499,770		7,102,076
前払費用		511,014		421,985
未収委託者報酬		3,687,850		4,433,940
未収運用受託報酬		1,656,206		1,806,719
未収投資助言報酬		91,351		101,471
繰延税金資産		327,435		437,736
その他		11,984		323,490
流動資産合計		33,743,017		34,451,536
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	71,578	1	82,291
車両	1	0	1	4,900
器具備品	1	92,090	1	94,283
有形固定資産合計		163,668		181,475
無形固定資産				
ソフトウェア		765,393		889,998
ソフトウェア仮勘定		166,377		44,035
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		939,784		942,047
投資その他の資産				
投資有価証券		29,600,256		34,455,496
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		171,056		14,723
差入保証金		285,884		299,871
繰延税金資産		280,043		340,843
その他		10,177		14,474
投資その他の資産合計		30,413,641		35,191,632
固定資産合計		31,517,095		36,315,155
資産合計		65,260,112		70,766,691

負債の部

流動負債

預り金	34,889	70,706
未払収益分配金	2,498	3,465
未払償還金	27,718	-
未払手数料	1,269,371	1,700,145
未払運用委託報酬	659,099	703,881
未払投資助言報酬	566,198	771,152
その他未払金	356,756	437,257
未払費用	104,560	109,199
未払法人税等	1,272,113	2,548,634
賞与引当金	746,320	864,699
その他	217,295	377,984
流動負債合計	5,256,823	7,587,128

固定負債

退職給付引当金	1,519,642	1,682,532
役員退職慰労引当金	15,750	18,200
固定負債合計	1,535,392	1,700,732

負債合計

負債合計	6,792,216	9,287,861
------	-----------	-----------

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	38,693,404	41,733,107
利益剰余金合計	39,373,211	42,412,914
株主資本合計	57,655,051	60,694,754

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	812,844	779,438
繰延ヘッジ損益	-	4,637
評価・換算差額等合計	812,844	784,076

純資産合計

純資産合計	58,467,896	61,478,830
-------	------------	------------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	65,260,112	70,766,691
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	24,865,689	26,937,202
運用受託報酬	9,257,111	11,497,098
投資助言報酬	511,448	493,070
営業収益計	34,634,249	38,927,371
営業費用		
支払手数料	11,232,556	12,354,679
広告宣伝費	25,920	31,453
公告費	-	260
調査費	5,110,928	5,782,852
支払運用委託報酬	1,719,103	1,754,925
支払投資助言報酬	2,287,929	2,906,672
委託調査費	85,290	82,637
調査費	1,018,604	1,038,617
委託計算費	204,532	216,637
営業雑経費	776,544	794,505
通信費	49,069	45,726
印刷費	191,262	179,345
協会費	26,975	32,226
その他営業雑経費	509,237	537,207
営業費用計	17,350,482	19,180,389
一般管理費		
役員報酬	80,235	83,616
給料・手当	3,191,860	3,439,572
賞与引当金繰入額	745,410	864,584
賞与	244,745	248,146
福利厚生費	611,979	662,791
退職給付費用	241,990	330,209
役員退職慰労引当金繰入額	7,350	2,450
役員退職慰労金	630	-
その他人件費	128,730	148,712
不動産賃借料	623,115	630,692
その他不動産経費	25,985	26,725
交際費	28,549	26,650
旅費交通費	146,828	152,875
固定資産減価償却費	378,339	396,898
租税公課	280,494	332,001
業務委託費	206,740	223,322
器具備品費	245,657	282,137
保険料	56,210	54,193
寄付金	-	162
諸経費	163,433	175,371
一般管理費計	7,408,286	8,081,115
営業利益	9,875,480	11,665,865

営業外収益			
受取利息		170	165
有価証券利息		50,483	33,950
受取配当金		138,431	176,877
為替差益		15,249	-
時効成立償還金		91,045	27,718
その他営業外収益		10,670	13,552
営業外収益計		306,050	252,264
営業外費用			
為替差損		-	15,293
控除対象外消費税		14,608	13,239
雑損失		-	27,789
その他営業外費用		96	657
営業外費用計		14,704	56,980
経常利益		10,166,826	11,861,150
特別利益			
投資有価証券売却益		624,481	201,537
投資有価証券償還益		195,321	31,108
固定資産売却益		-	169
特別利益計		819,803	232,815
特別損失			
投資有価証券売却損		2,615	107
投資有価証券償還損		16,134	15,469
投資有価証券評価損		129,060	-
固定資産除却損	2	1,787	5,271
事故損失賠償金	3	6,119	-
特別損失計		155,717	20,848
税引前当期純利益		10,830,912	12,073,117
法人税、住民税及び事業税		3,013,428	3,912,569
法人税等調整額		274,628	157,154
法人税等合計		3,288,057	3,755,414
当期純利益		7,542,855	8,317,703

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2016年4月1日 至2017年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	その他利益剰余金				
						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	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
遡及処理後当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,542,855	7,542,855	7,542,855
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,407,295	7,407,295	7,407,295
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,542,855
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	497,014	497,014	497,014
当期変動額合計	497,014	497,014	6,910,281
当期末残高	812,844	812,844	58,467,896

当事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,278,000	5,278,000	5,278,000
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,317,703	8,317,703	8,317,703
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,039,703	3,039,703	3,039,703
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754

	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	812,844	-	812,844	58,467,896
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,278,000
当期純利益	-	-	-	8,317,703
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	33,405	4,637	28,768	28,768
当期変動額合計	33,405	4,637	28,768	3,010,934
当期末残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 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>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>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。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5．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>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>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</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>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</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。

(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 平成30年3月30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 平成30年3月30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日以後開始する会計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

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
建物附属設備	301,414千円	313,759千円
車両	7,014	1,828
器具備品	450,664	469,335
計	759,093	784,943

(損益計算書関係)

1. 固定資産売却益の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)
車両	-	169千円

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 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)
器具備品	1,787千円	5,271千円

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2016年4月1日 至2017年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2016年6月24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	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2016年3月31日
効力発生日	2016年6月24日

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

2017年6月23日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	5,278,000千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

当事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2017年6月23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	5,278,000千円
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

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

2018年6月22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	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

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

投資有価証券は主として利付国債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（2017年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	20,957,403	20,957,403	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,499,770	6,515,850	16,079
投資有価証券			
満期保有目的の債券	15,613,017	15,730,180	117,162
その他有価証券	13,919,739	13,919,739	-

当事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	19,824,114	19,824,114	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,102,076	7,115,800	13,723
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,652,704	14,687,680	34,975
その他有価証券	19,735,292	19,735,292	-
デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	103,394	103,394	-

(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

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。

有価証券

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

デリバティブ

ヘッジ会計が適用されているもの

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は、次のとおりであります。

当事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

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		時価	当該時価の 算定方法
				うち1 年超		
原則的 処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,988,812	-	71,536	取引相手の金融機 関等より入手した TTM、割引レ ート等を基準として 算定した価格によ っております。
	新興国株価 指数先物 売建	投資 有価証券	1,022,464	-	31,858	決算日の市場価格 によっております。
合計			3,011,276	-	103,394	

(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 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

非上場株式については、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

また、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(2017年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	20,957,403	-	-	-
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	6,500,000	15,600,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	1,543,642	10,698,606	1,611,564	1,136
合計	29,001,045	26,298,606	1,611,564	1,136

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2018年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	19,824,114	-	-	-
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	7,100,000	14,650,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	2,896,071	14,413,880	2,089,902	299,797
合計	29,820,185	29,063,880	2,089,902	299,797

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2017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	22,112,787	22,246,030	133,242
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	22,112,787	22,246,030	133,242
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)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		22,112,787	22,246,030	133,242

当事業年度(2018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	15,606,746	15,660,060	53,313
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	15,606,746	15,660,060	53,313
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	6,148,033	6,143,420	4,613
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,148,033	6,143,420	4,613
合計		21,754,780	21,803,480	48,699

2. その他有価証券

前事業年度（2017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	5,850,740	5,806,313	44,426
	国債・地方債等	5,850,740	5,806,313	44,426
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	5,152,625	3,951,939	1,200,685
	小計	11,003,365	9,758,253	1,245,112
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	2,916,373	2,988,610	72,236
	小計	2,916,373	2,988,610	72,236
合計		13,919,739	12,746,863	1,172,876

当事業年度（2018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	5,824,610	5,803,679	20,930
	国債・地方債等	5,824,610	5,803,679	20,930
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	7,066,429	5,762,409	1,304,019
	小計	12,891,039	11,566,089	1,324,949
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	6,844,252	7,045,700	201,447
	小計	6,844,252	7,045,700	201,447
	合計	19,735,292	18,611,789	1,123,502

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円）については、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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、前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2016年4月1日 至2017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	1,520,915	624,481	2,615
合計	1,520,915	624,481	2,615

当事業年度（自2017年4月1日 至2018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	344,430	201,537	107
合計	344,430	201,537	107

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、その他有価証券のその他について129,060千円減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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（2017年3月31日）

デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（2018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）	評価損益（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	1,988,812	-	71,536	71,536
合計			1,988,812	-	71,536	71,536

（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。

（2）株式関連

前事業年度（2017年3月31日）

デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（2018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）	評価損益（千円）
原則的処理方法	新興国株価 指数先物 売建	投資 有価証券	1,022,464	-	31,858	31,858
合計			1,022,464	-	31,858	31,858

（注1）時価の算定方法 取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

前事業年度(自2016年4月1日 至2017年3月31日)

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、年俸制総合職および一般職を制度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せん。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 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

退職給付引当金の期首残高	1,404,058 千円
退職給付費用	167,807
退職給付の支払額	52,223
退職給付引当金の期末残高	1,519,642

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 167,807 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、50,618千円であります。

当事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

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、年俸制総合職および一般職を制度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せん。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 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

退職給付引当金の期首残高	1,519,642 千円
退職給付費用	248,707
退職給付の支払額	85,817
退職給付引当金の期末残高	1,682,532

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 248,707 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、54,955千円であります。

(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 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	230,314 千円	264,770 千円
未払事業税	63,109	138,553
その他	34,011	36,433
繰延税金資産合計	327,435	439,758
繰延税金負債		
繰延ヘッジ損益	-	2,021
繰延税金負債合計	-	2,021
繰延税金資産の純額	-	437,736
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	465,488	515,191
税務上の繰延資産償却超過額	3,415	3,662
役員退職慰労引当金	4,822	5,572
投資有価証券評価損	39,827	-
投資有価証券評価差額	22,140	61,683
その他	3,623	12,431
小計	539,318	598,542
評価性引当額	10	47
繰延税金資産合計	539,308	598,495
繰延税金負債		
特別分配金否認	34,979	9,827
投資有価証券評価差額	224,285	247,824
繰延税金負債合計	259,265	257,651
繰延税金資産(は負債)の純額	280,043	340,843

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2016年4月1日 至2017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2017年4月1日 至2018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2016年4月1日 至2017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	150,000	生命保険業	(被所有)直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,036,007	未収運用受託報酬	715,220
								投資助言報酬の受取	218,363	未収投資助言報酬	11,670

当事業年度（自2017年4月1日 至2018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	150,000	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	3,608,592	未収運用受託報酬	833,260
								投資助言報酬の受取	132,212	未収投資助言報酬	11,876

（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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
1株当たり純資産額	539,133円00銭	566,896円85銭
1株当たり当期純利益金額	69,552円73銭	76,697円61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いません。

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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当期純利益	7,542,855千円	8,317,703千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	7,542,855千円	8,317,703千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)
該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第24期中間会計期間末 (2018年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		16,832,015
有価証券		7,811,240
前払費用		391,082
未収委託者報酬		5,127,174
未収運用受託報酬		2,525,022
未収投資助言報酬		128,536
その他		107,156
流動資産合計		32,922,227
固定資産		
有形固定資産	1	187,242
無形固定資産		963,054
投資その他の資産		
投資有価証券		34,280,222
関係会社株式		66,222
長期前払費用		12,330
差入保証金		296,752
繰延税金資産		624,861
その他		87,983
投資その他の資産合計		35,368,373
固定資産合計		36,518,670
資産合計		69,440,898

負債の部

流動負債

預り金	64,326
未払収益分配金	4,755
未払手数料	2,135,600
未払運用委託報酬	677,962
未払投資助言報酬	703,959
その他未払金	240,364
未払費用	135,473
未払法人税等	1,864,808
前受投資助言報酬	46,905
賞与引当金	487,863
その他	2 322,922
流動負債合計	<u>6,684,941</u>

固定負債

退職給付引当金	1,775,803
役員退職慰労引当金	18,250
固定負債合計	<u>1,794,053</u>

負債合計

負債合計	<u>8,478,994</u>
------	------------------

純資産の部

株主資本

資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	<u>8,281,840</u>
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	41,179,702
利益剰余金合計	<u>41,859,509</u>
株主資本合計	<u>60,141,349</u>

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	855,542
繰延ヘッジ損益	34,988
評価・換算差額等合計	<u>820,554</u>

純資産合計

純資産合計	<u>60,961,903</u>
-------	-------------------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	<u>69,440,898</u>
----------	-------------------

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第24期中間会計期間	
(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	13,568,533
運用受託報酬	6,038,792
投資助言報酬	280,729
営業収益計	19,888,055
営業費用	9,556,598
一般管理費	1 4,238,947
営業利益	6,092,509
営業外収益	2 185,132
営業外費用	3 29,389
経常利益	6,248,253
特別利益	4 177,944
特別損失	5 88,650
税引前中間純利益	6,337,546
法人税、住民税及び事業税	1,753,243
法人税等調整額	137,604
法人税等合計	1,890,848
中間純利益	4,446,698

(3)中間株主資本等変動計算書

第24期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備 金	資本剰余 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	41,733,107	42,412,914	60,694,754
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,000,103	5,000,103	5,000,103
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	4,446,698	4,446,698	4,446,698
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	553,405	553,405	553,405
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,179,702	41,859,509	60,141,349

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価 差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,000,103
中間純利益	-	-	-	4,446,698
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	76,103	39,625	36,478	36,478
当中間期変動額合計	76,103	39,625	36,478	516,926
当中間期末残高	855,542	34,988	820,554	60,961,903

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第24期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>其他有価証券 時価のあるもの ...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</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。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間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。 退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。 なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間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、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6．ヘッジ会計の方法	<p>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>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</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>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</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。

(表示方法の変更)

- ・「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更
- 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

(中間貸借対照表関係)

第24期中間会計期間末 (2018年9月30日現在)	
1．有形固定資産の減価償却累計額	809,056千円
2．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第24期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1．減価償却の実施額	
有形固定資産	26,097千円
無形固定資産	161,148千円
2．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	105,286千円
金融派生商品収益	34,405千円
為替差益	29,067千円
3．営業外費用のうち主要なもの	
金融派生商品損失	19,122千円
控除対象外消費税	9,216千円
4．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	176,855千円

5. 特別損失のうち主要なもの

投資有価証券償還損	67,862千円
投資有価証券売却損	20,219千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第24期中間会計期間
 (自 2018年4月1日
 至 2018年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2018年6月22日 定時株主総会	普通株式	5,000,103	46,106	2018年3月31日	2018年6月22日

（金融商品関係）

第24期中間会計期間末（2018年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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次表には含まれておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	16,832,015	16,832,015	-
有価証券			
満期保有目的の債券	3,900,470	3,904,250	3,779
その他有価証券	3,910,770	3,910,770	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	16,550,241	16,575,020	24,778
その他有価証券	17,662,480	17,662,480	-
デリバティブ取引 ()			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	19,122	19,122	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	53,035	53,035	-

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

（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

現金・預金

短期で決済されるため、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。

有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

(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

非上場株式(中間貸借対照表計上額67,500千円)については、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格がなく、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。

(有価証券関係)

第24期中間会計期間末(2018年9月30日現在)

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	12,704,305	12,737,900	33,594
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,704,305	12,737,900	33,594
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	7,746,407	7,741,370	5,037
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	7,746,407	7,741,370	5,037
合計		20,450,712	20,479,270	28,557

2. その他有価証券

	種類	取得原価または償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,802,359	5,815,900	13,540
	国債・地方債等	5,802,359	5,815,900	13,540
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	8,608,683	9,991,177	1,382,494
	小計	14,411,042	15,807,077	1,396,034
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	5,929,000	5,766,173	162,826
	小計	5,929,000	5,766,173	162,826
	合計	20,340,042	21,573,250	1,233,208

(注) 投資信託受益証券等であります。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株価指数先物関連

第24期中間会計期間末(2018年9月30日現在)

区分	種類	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以 外の取引	新興国株価 指数先物 売建	922,671	-	19,122	19,122
	合計	922,671	-	19,122	19,122

(注1) 時価の算定方法 取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

第24期中間会計期間末（2018年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（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	1,976,118	-	53,035	53,035
合計			1,976,118	-	53,035	53,035

（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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第24期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第24期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間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]

第24期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第24期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第24期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（ 1 株当たり情報）

	第24期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
1株当たり純資産額	562,130円27銭
1株当たり中間純利益金額	41,003円04銭

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

2．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	4,446,698千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>4,446,698千円</u>
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第24期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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)。

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)。

通常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。

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

上記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】

定款の変更等

2018年3月20日に開催された臨時株主総会において、定款の「取締役会」にかかる条項に次の事項の追加が決議されました。

- ・当社は、取締役が取締役会の決議の目的である事項について提案をした場合において、当該提案につき取締役（当該事項について議決に加わることができるものに限る。）の全員が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、当該提案を可決する旨の取締役会の決議があったものとみなす。ただし、監査役が異議を述べたときは、この限りではない。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2018年3月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2018年3月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(資本金の額：2018年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
今村証券株式会社	857百万円	
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
光世証券株式会社	12,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	8,557百万円	
ほくほくTT証券株式会社	1,250百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	

GMOクリック証券株式会社	4,346百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000百万円	
株式会社大光銀行	10,000百万円	
株式会社三重銀行	15,295百万円	
信金中央金庫	690,998百万円	信用金庫法に基づき設立された、信用金庫の中央金融機関です。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2018年6月4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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小暮和敏

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野あや子

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2017年4月1日から2018年3月31日までの第23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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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2018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すべ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。

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2018年12月25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

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ外国株式インデックスファンドの2017年11月21日から2018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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、〈購入・換金手数料なし〉ニッセイ外国株式インデックスファンドの2018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すべ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。

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月27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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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