

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年9月18日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 大関 洋
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【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】</b>	DCニッセイターゲットデートファンド2025 DCニッセイターゲットデートファンド2030 DCニッセイターゲットデートファンド2035 DCニッセイターゲットデートファンド2040 DCニッセイターゲットデートファンド2045 DCニッセイターゲットデートファンド2050 DCニッセイターゲットデートファンド2055 DCニッセイターゲットデートファンド2060
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

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

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」または「DCニッセイターゲットデートファンド」ということがあります。また、下記の略称で記載することがあります。

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

### （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】

各ファンドにつき、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：2020年9月19日(土)～2021年3月19日(金)

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

**(8) 【申込取扱場所】**

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

**(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。

**(10) 【払込取扱場所】**

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

**(11) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**(12) 【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

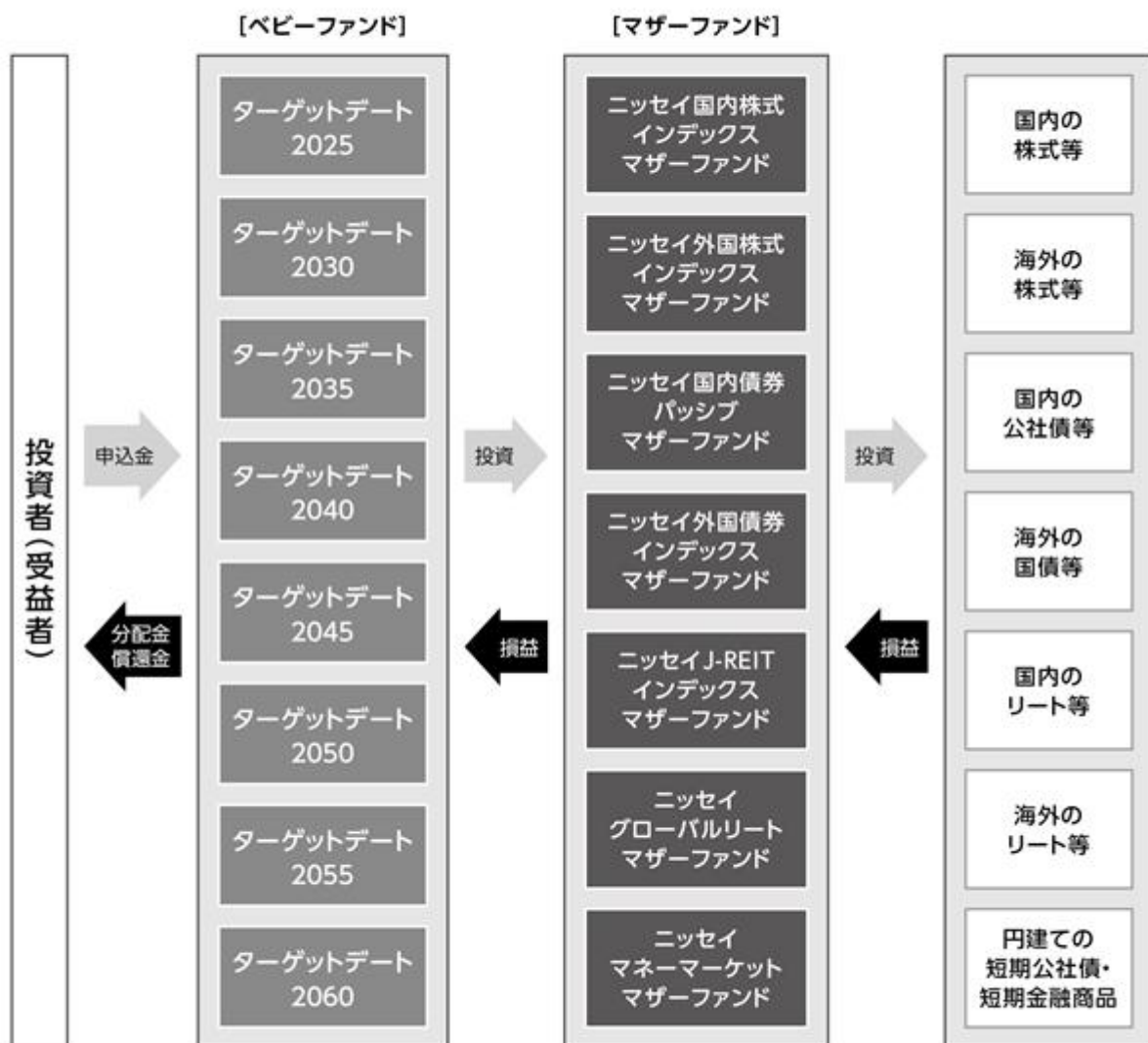
##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### 基本方針

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

###### 運用の形態

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



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

## ファンドの特色

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

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

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

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

- マザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債に実質的な投資を行います。

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

〈マザーファンドの運用プロセス〉

```

graph TD
    A[投資対象の調査・分析] --> B[独自の計量モデル等を活用し、目標ポートフォリオ・売買計画を策定]
    B --> C[売買執行・ポートフォリオを構築]
    C --> D[モニタリング]
    D --> A
  
```

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

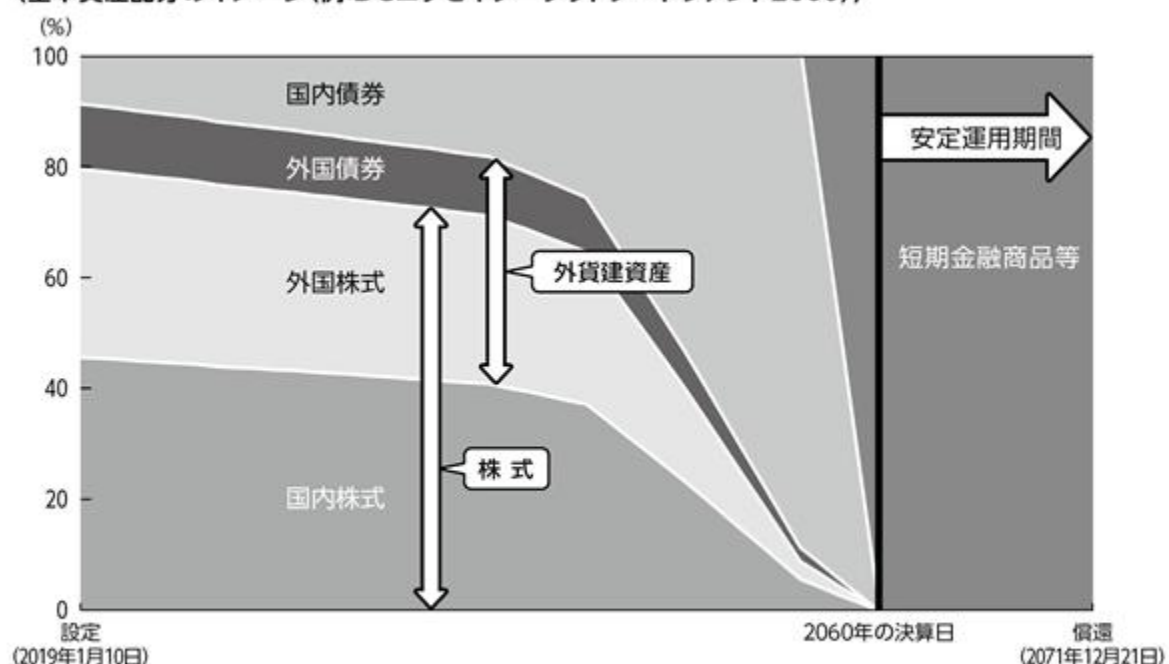
### 3 安定運用開始時期(ターゲットデート)の異なる複数のファンドから選択いただけます。各ファンドは、安定運用開始時期に近づくにしながら、リスクを低減させていく運用を行います。

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

#### 〈各ファンドの安定運用開始時期(ターゲットデート)〉

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

#### 〈基本資産配分のイメージ(例:DCニッセイターゲットデートファンド2060)〉



・上記は2020年6月末現在で計画している基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。将来の基本資産配分比率は、市況動向等により変更となる場合があります。

## 〈2020年6月末現在の基本資産配分〉

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
DCニッセイターゲットデートファンド2025	11.7%	7.8%	76.6%	3.9%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2030	26.3%	19.1%	47.3%	7.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2035	38.0%	28.1%	23.9%	10.0%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2040	41.2%	30.5%	17.6%	10.7%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2045	42.4%	31.4%	15.2%	11.0%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2050	43.5%	32.3%	12.9%	11.3%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2055	44.7%	33.2%	10.6%	11.5%	0.0%
DCニッセイターゲットデートファンド2060	45.7%	34.0%	8.5%	11.8%	0.0%

・実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。なお、2020年6月末現在においては、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、および円建ての短期金融商品等を主要投資対象とするニッセイマネーマーケットマザーファンドは組入れを行っていません。

## 〈当初設定時の基本資産配分〉

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

・各ファンドの設定日は以下の通りです。

DCニッセイターゲットデートファンド2055：2016年7月29日

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

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

## 〈各インデックスについて〉

### ●TOPIX(東証株価指数)

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

### ●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

### ●NOMURA-BPI総合

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

### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

### ●東証REIT指数

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

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

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



#### <MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

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

## ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 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)
単 位 型	国 内	株 式
追 加 型	海 外	債 券
	内 外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

## 属性区分表

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

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券・ 不動産投信・短期 金融資産)資産配 分変更型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、短期金融資産に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

## (2) 【ファンドの沿革】

「ターゲットデート2055」

2016年7月29日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

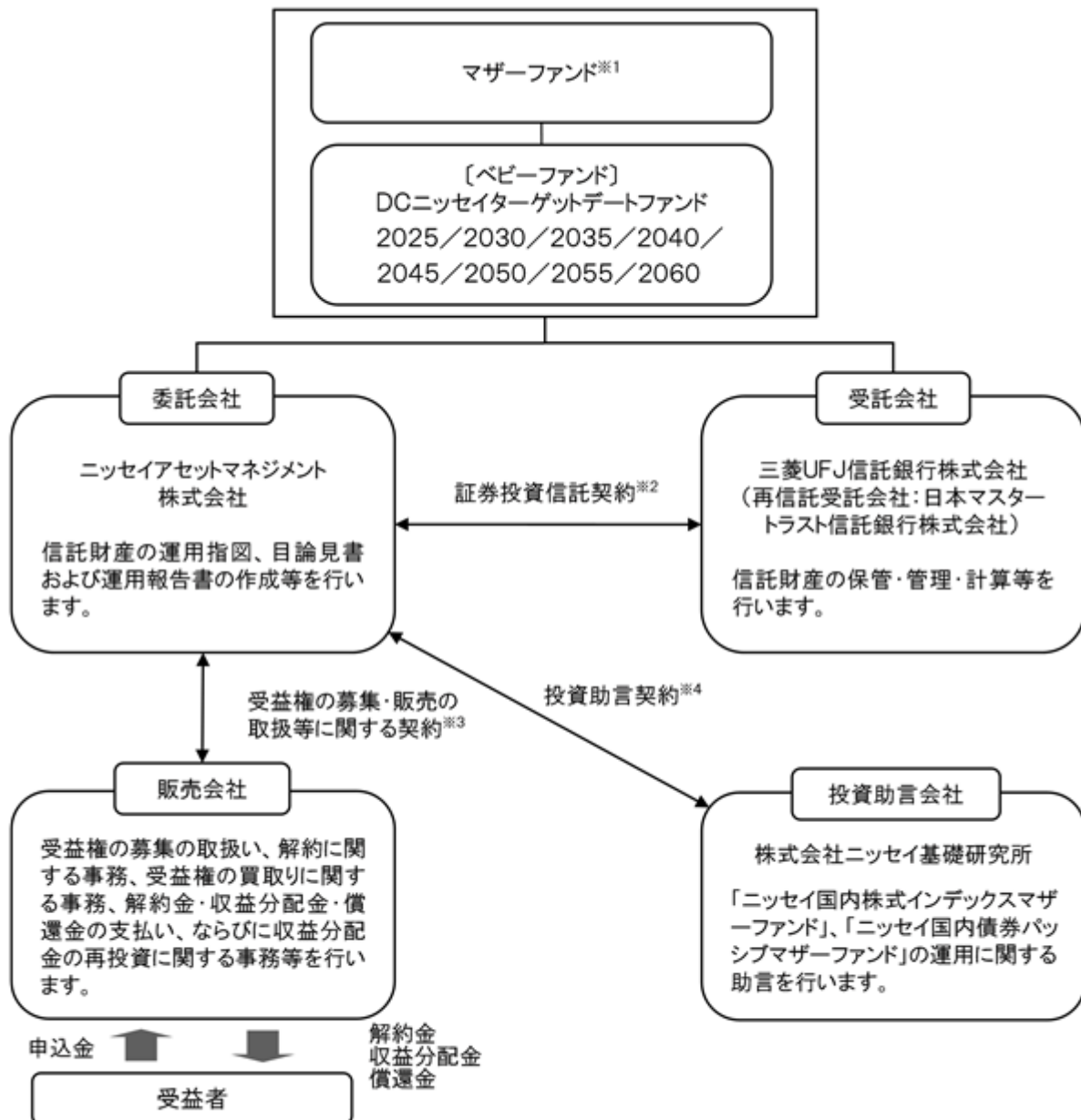
「ターゲットデート2025 / 2035 / 2045」

2017年7月31日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

「ターゲットデート2030 / 2040 / 2050 / 2060」

2019年1月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



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

## 委託会社の概況（2020年6月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 大関 洋
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 1995年4月4日
7. 沿革
  - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
  - 1995年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
  - 1998年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
  - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

## 8. 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

「ターゲットデート2025」

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

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

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

国内株式：20.6%

外国株式：14.7%

国内債券：58.7%

外国債券：6.0%

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

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

マザーファンドの組入は、原則として高位を維持します。

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。

## 「ターゲットデート2030」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

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

国内株式：29.1%

外国株式：21.2%

国内債券：41.8%

外国債券：7.9%

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

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

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2035」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

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

国内株式：40.2%

外国株式：29.8%

国内債券：19.5%

外国債券：10.5%

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

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

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2040」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

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

国内株式：41.4%

外国株式：30.7%

国内債券：17.1%

外国債券：10.8%

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

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

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2045」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

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

国内株式：43.1%

外国株式：31.9%

国内債券：13.8%

外国債券：11.2%

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

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

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2050」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

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

国内株式：43.8%

外国株式：32.4%

国内債券：12.5%

外国債券：11.3%

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

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

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

## 「ターゲットデート2055」

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

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

国内株式：45.6%

外国株式：33.8%

国内債券：8.9%

外国債券：11.7%

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

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

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

（「ターゲットデート2025」のと同規定）

「ターゲットデート2060」

(「ターゲットデート2025」のと同規定)

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

国内株式：45.7%

外国株式：34.0%

国内債券：8.5%

外国債券：11.8%

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

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

(「ターゲットデート2025」のと同規定)

(「ターゲットデート2025」のと同規定)

(「ターゲットデート2025」のと同規定)



## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

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20%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は行いません。

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）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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。

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

### (1) 基本方針

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

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

#### b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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。

## (3) 投資制限

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

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

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

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。

## ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

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

## b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ニッセイグローバルリートマザーファンド

### (1) 基本方針

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

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

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

#### b 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券をS & Pグローバルリートインデックス（除く日本、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ニッセイマネーマーケットマザーファンド

### (1) 基本方針

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

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

円建ての短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

#### b 投資態度

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

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## b 約款に定める投資対象

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取引および為替先渡取引」に定めるものに限りま

ス. 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

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

1. 株券または新株引受権証券

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

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

#### 金融商品

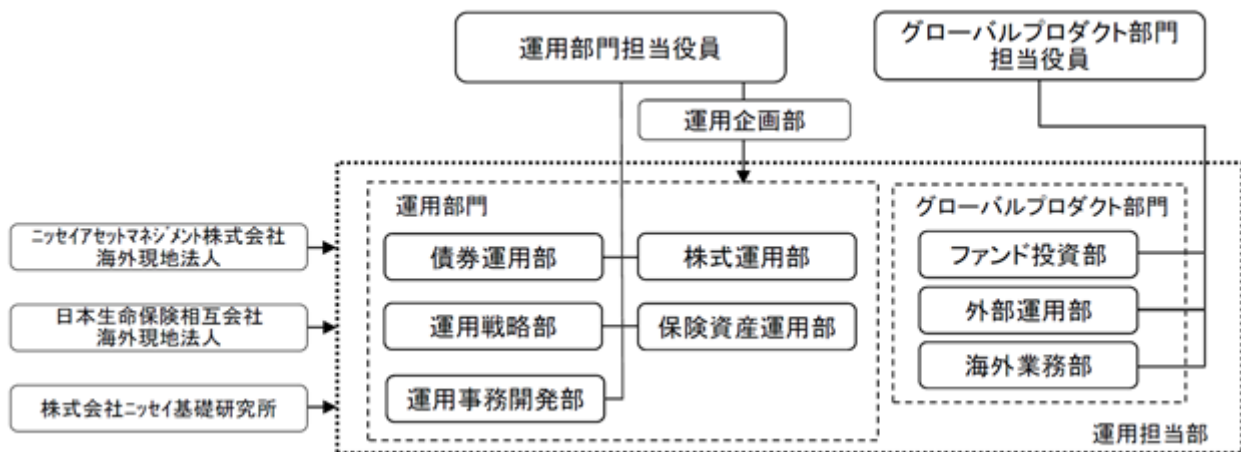
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

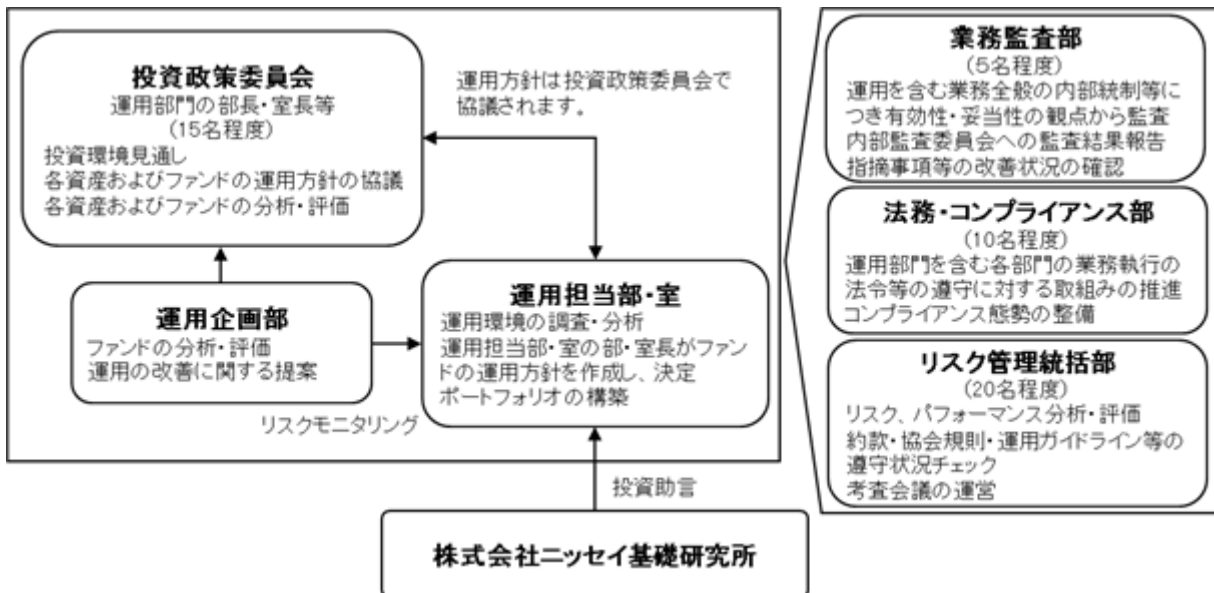
### （3）【運用体制】

#### 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・マネージャー/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



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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) 【配分方針】

原則として以下の方針に基づき配分を行います。

## 1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

## 2. 分配対象額についての配分方針

委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。

## 3. 留保益の運用方針

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

## 分配時期

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

## 支払方法

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

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。

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

## a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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。

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

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

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

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。

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

### 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の50%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の50%を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、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てします。
- 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てします。
- 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．信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
- 2．前記1．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとしてします。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てします。
- 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てします。
- 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てします。
- 2．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

## c 法令に定める投資制限

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。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

## (1) 投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

## ・株式投資リスク

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

## ・債券投資リスク

## 金利変動リスク

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

## 信用リスク

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

## ・不動産投資信託（リート）投資リスク

## 保有不動産に関するリスク

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

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

## 金利変動リスク

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

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

## 信用リスク

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

#### J - R E I Tの税制に関するリスク

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

#### リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

#### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

#### ・為替変動リスク

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

#### ・カントリーリスク

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

#### ・流動性リスク

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

#### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

#### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

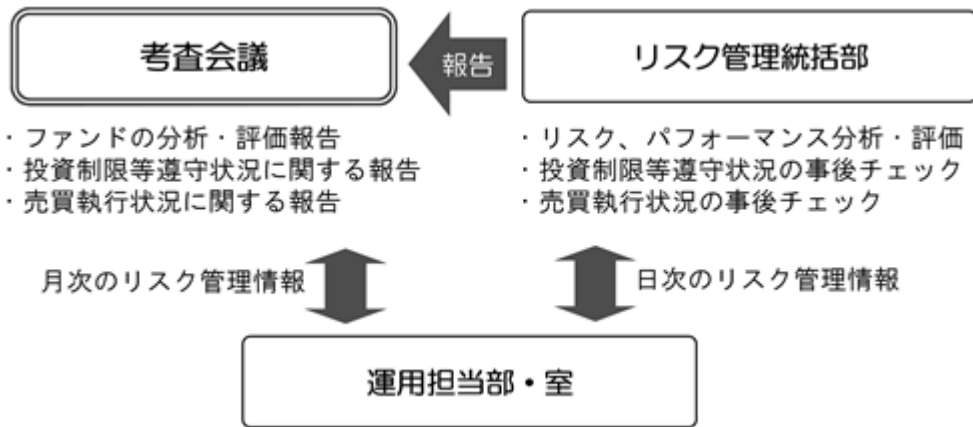
#### ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2019年12月20日現在、「ターゲットデート2030」を1百万円(受益権口数1百万口、ターゲットデート2030全体の1.5%)、「ターゲットデート2040」を1百万円(受益権口数1百万口、ターゲットデート2040全体の2.5%)、「ターゲットデート2050」を1百万円(受益権口数1百万口、ターゲットデート2050全体の4.6%)、「ターゲットデート2060」を1百万円(受益権口数1百万口、ターゲットデート2060全体の3.5%)保有しています。

また、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2019年11月末現在、各ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に10.2%保有しています。

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

## ( 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。



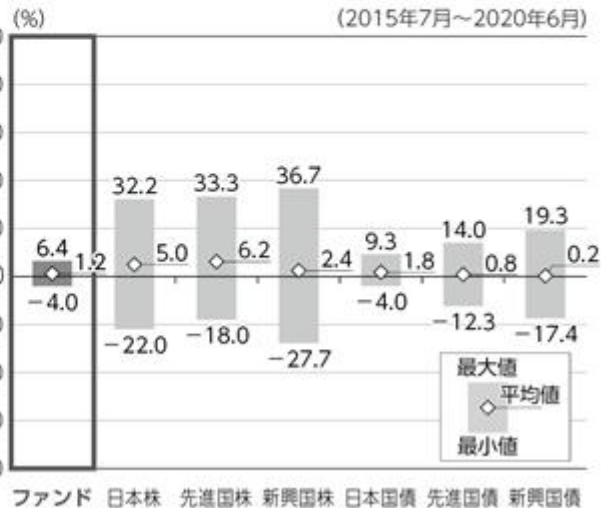
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ●DCニッセイターゲットデートファンド2025

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

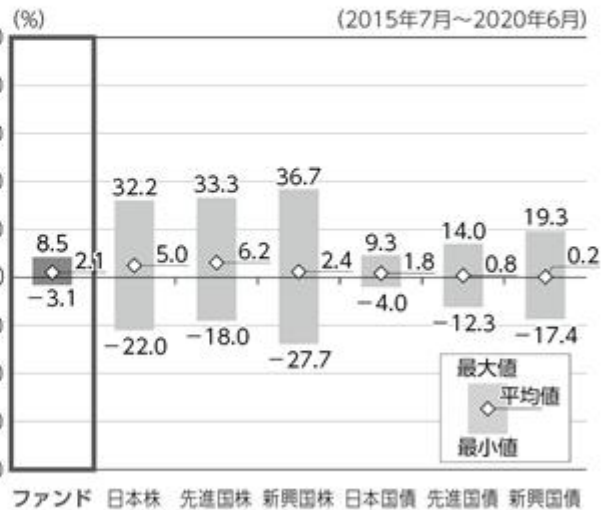


### ●DCニッセイターゲットデートファンド2030

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

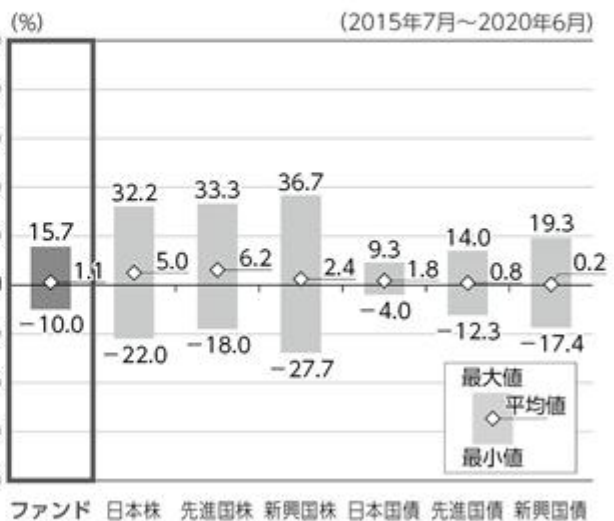


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2035

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

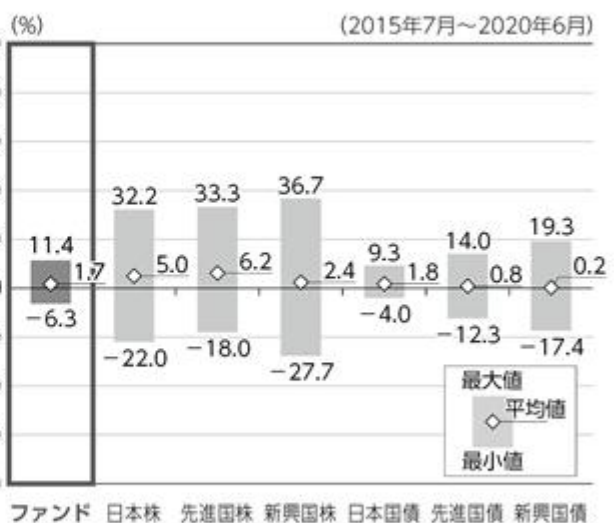


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2040

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

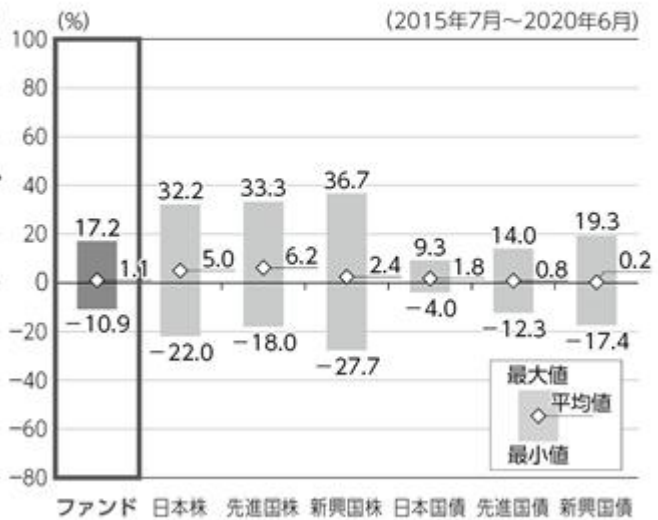


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2045

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

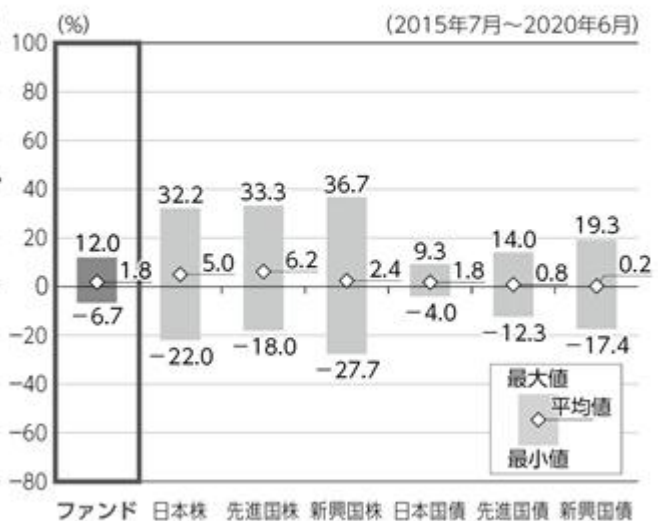


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2050

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

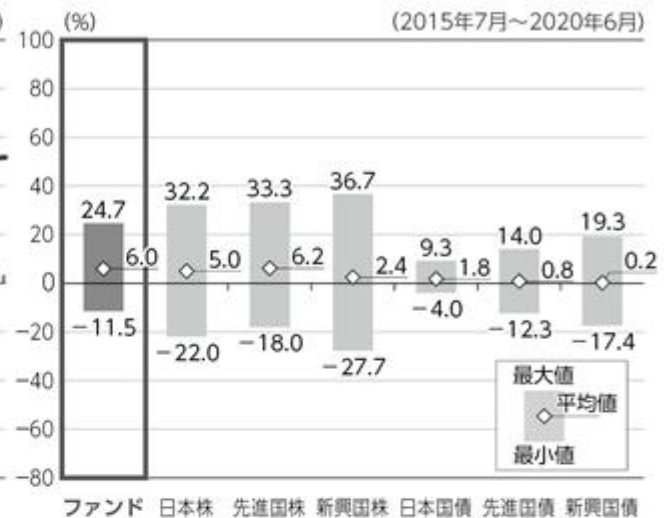


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2055

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

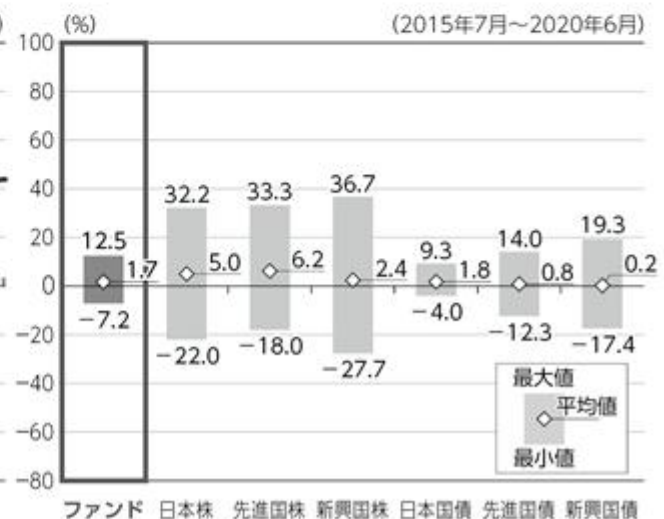


## ●DCニッセイターゲットデートファンド2060

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の高標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・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】

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

## [ターゲットデート2025]

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.31%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2030]

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

## [ターゲットデート2035]

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2040]

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

## [ターゲットデート2045]

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2050]

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

## [ターゲットデート2055]

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

\*信託報酬率を2019年1月10日に税抜0.33%から変更いたしました。

## [ターゲットデート2060]

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

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

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



## (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下記の監査報酬率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

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

## 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。

## &lt;ご参考&gt;

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

### 確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

### 確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

#### 課税対象

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

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

買 取 請 求 時： 買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

#### 個人の課税の取扱い

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

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

#### 税率（個人）

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

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

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

#### < 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

## 法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

普通分配金	元本払戻金（特別分配金）
<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>

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2025」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	846,729,435	100.00
内 日本	846,729,435	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,098	0.00
純資産総額	846,722,337	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2030」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	734,379,663	100.00
内 日本	734,379,663	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,363	0.00
純資産総額	734,373,300	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2035」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,193,468,978	100.00
内 日本	1,193,468,978	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,667	0.00
純資産総額	1,193,458,311	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2040」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	341,779,313	100.00
内 日本	341,779,313	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,049	0.00
純資産総額	341,776,264	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2045」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	454,220,350	100.00
内 日本	454,220,350	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,052	0.00
純資産総額	454,216,298	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2050」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	80,780,464	100.00
内 日本	80,780,464	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	722	0.00
純資産総額	80,779,742	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2055」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	445,146,025	100.00
内 日本	445,146,025	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,969	0.00
純資産総額	445,142,056	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。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2060」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	87,268,939	100.00
内 日本	87,268,939	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	769	0.00
純資産総額	87,268,170	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)

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	134,042,278,720	98.26
内 日本	134,042,278,720	98.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,372,769,154	1.74
純資産総額	136,415,047,874	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)	2,322,165,000	1.70
内 日本	2,322,165,000	1.70

(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、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。

(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」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	235,474,373,119	94.80
内 アメリカ	161,780,351,439	65.13
内 イギリス	11,238,666,783	4.52
内 スイス	9,294,962,597	3.74
内 フランス	8,519,264,295	3.43
内 カナダ	8,344,122,897	3.36
内 ドイツ	7,474,176,771	3.01
内 オランダ	5,095,735,394	2.05
内 オーストラリア	5,033,572,353	2.03
内 アイルランド	3,225,910,345	1.30
内 スウェーデン	2,585,767,590	1.04
内 香港	2,320,951,333	0.93
内 スペイン	2,020,596,908	0.81
内 デンマーク	1,953,184,342	0.79
内 イタリア	1,595,785,734	0.64
内 フィンランド	844,547,696	0.34
内 シンガポール	824,013,309	0.33
内 ベルギー	697,438,518	0.28
内 ノルウェー	439,128,534	0.18
内 バミューダ	428,005,198	0.17
内 イスラエル	360,681,567	0.15
内 ジャージー	316,776,988	0.13
内 ケイマン諸島	272,101,980	0.11
内 ニュージーランド	270,351,193	0.11
内 オランダ領キュラソー	159,188,262	0.06
内 オーストリア	143,096,700	0.06
内 ポルトガル	142,790,924	0.06
内 ルクセンブルグ	66,302,850	0.03
内 パプアニューギニア	26,900,619	0.01
投資証券	5,888,278,724	2.37
内 アメリカ	4,968,384,456	2.00
内 オーストラリア	349,260,834	0.14
内 シンガポール	144,245,614	0.06
内 フランス	144,037,875	0.06
内 イギリス	133,008,155	0.05
内 香港	106,850,330	0.04
内 カナダ	42,491,460	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,040,590,739	2.83
純資産総額	248,403,242,582	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）	6,707,626,825	2.70
内 アメリカ	4,958,305,233	2.00
内 ドイツ	1,256,185,627	0.51
内 イギリス	493,135,965	0.20

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

その他資産として、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。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

（2020年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	59,667,101,640	73.24
内 日本	59,667,101,640	73.24
地方債証券	7,453,404,358	9.15
内 日本	7,453,404,358	9.15
特殊債券	8,550,868,938	10.50
内 日本	8,550,868,938	10.50
社債券	5,107,087,900	6.27
内 日本	4,398,784,700	5.40
内 スウェーデン	409,061,000	0.50
内 フランス	299,242,200	0.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	689,698,004	0.85
純資産総額	81,468,160,840	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)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

(2020年6月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	29,245,146,260	99.61
内 アメリカ	13,267,477,039	45.19
内 フランス	2,946,630,805	10.04
内 イタリア	2,681,882,791	9.13
内 ドイツ	2,226,310,527	7.58
内 イギリス	1,915,258,958	6.52
内 スペイン	1,737,299,250	5.92
内 ベルギー	744,362,569	2.54
内 オーストラリア	630,922,189	2.15
内 オランダ	571,774,101	1.95
内 カナダ	570,068,225	1.94
内 オーストリア	451,907,817	1.54
内 アイルランド	229,346,458	0.78
内 メキシコ	228,562,490	0.78
内 ポーランド	177,501,892	0.60
内 フィンランド	172,565,108	0.59
内 デンマーク	151,760,629	0.52
内 マレーシア	145,187,675	0.49
内 シンガポール	135,110,992	0.46
内 イスラエル	115,263,139	0.39
内 スウェーデン	85,324,399	0.29
内 ノルウェー	60,629,207	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	114,875,716	0.39
純資産総額	29,360,021,976	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。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」

(2020年6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) 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	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	664,413,863	0.9874 656,103,051	0.9821 652,520,854	- -	77.06%
2	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	56,845,167	1.7083 97,113,276	1.6986 96,557,200	- -	11.40%
3	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	35,392,832	1.7981 63,642,604	1.8251 64,595,457	- -	7.63%
4	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	22,915,719	1.4039 32,173,292	1.4425 33,055,924	- -	3.90%

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2030」

(2020年6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 (%)	投資 比率
				簿価金額 (円)	評価金額 (円)		
1	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	358,761,753	0.9863	0.9821	-	47.98%
				353,868,066	352,339,917	-	
2	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	111,696,161	1.7047	1.6986	-	25.84%
				190,416,164	189,727,099	-	
3	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	75,725,848	1.7954	1.8251	-	18.82%
				135,961,823	138,207,245	-	
4	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	37,508,078	1.4169	1.4425	-	7.37%
				53,145,436	54,105,402	-	

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2035」

(2020年6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 (%)	投資 比率
				簿価金額 (円)	評価金額 (円)		
1	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	263,963,207	1.7304	1.6986	-	37.57%
				456,769,398	448,367,903	-	
2	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	182,222,521	1.8123	1.8251	-	27.87%
				330,244,986	332,574,323	-	
3	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	296,543,578	0.9872	0.9821	-	24.40%
				292,750,324	291,235,447	-	
4	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	84,084,094	1.4072	1.4425	-	10.16%
				118,328,506	121,291,305	-	

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2040」

(2020年6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	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	82,104,726	1.7027 139,800,737	1.6986 139,463,087	- -	40.81%
2	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	56,738,123	1.7907 101,601,598	1.8251 103,552,748	- -	30.30%
3	ニッセイ国内債券パッシブ マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	62,654,874	0.9866 61,816,189	0.9821 61,533,351	- -	18.00%
4	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	25,809,447	1.4155 36,533,362	1.4425 37,230,127	- -	10.89%

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2045」

(2020年6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	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	112,378,496	1.7408 195,638,062	1.6986 190,886,113	- -	42.03%
2	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	77,675,609	1.8292 142,085,183	1.8251 141,765,753	- -	31.21%
3	ニッセイ国内債券パッシブ マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	71,928,790	0.9872 71,015,151	0.9821 70,641,264	- -	15.55%
4	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	35,304,832	1.4045 49,587,475	1.4425 50,927,220	- -	11.21%

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2050」

(2020年6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	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	20,519,224	1.7083	1.6986	-	43.15%
				35,053,348	34,853,953	-	
2	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	14,221,303	1.7975	1.8251	-	32.13%
				25,563,225	25,955,300	-	
3	ニッセイ国内債券パッシブ マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	10,860,621	0.9874	0.9821	-	13.20%
				10,723,800	10,666,215	-	
4	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	6,450,604	1.4105	1.4425	-	11.52%
				9,098,671	9,304,996	-	

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2055」

(2020年6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	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	116,257,080	1.7573	1.6986	-	44.36%
				204,308,323	197,474,276	-	
2	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	80,586,005	1.8441	1.8251	-	33.04%
				148,612,293	147,077,517	-	
3	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	36,218,187	1.4002	1.4425	-	11.74%
				50,713,069	52,244,734	-	
4	ニッセイ国内債券パッシブ マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	49,230,729	0.9876	0.9821	-	10.86%
				48,624,148	48,349,498	-	

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

## 「DCニッセイターゲットデイトファンド2060」

(2020年6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	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	23,312,784	1.6993 39,615,478	1.6986 39,599,094	- -	45.38%
2	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	16,192,473	1.7952 29,070,193	1.8251 29,552,882	- -	33.86%
3	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	7,288,733	1.4126 10,296,641	1.4425 10,513,997	- -	12.05%
4	ニッセイ国内債券パッシブ マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	7,741,540	0.9872 7,643,119	0.9821 7,602,966	- -	8.71%

(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類及び各業種の評価金額の比率であります。

(参考情報)

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

(2020年6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)	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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	683,400	7,056.71 4,822,556,479	6,762.00 4,621,150,800	- -	3.39%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	383,600	6,800.99 2,608,862,720	7,384.00 2,832,502,400	- -	2.08%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信 業	476,800	4,628.47 2,206,854,654	5,450.00 2,598,560,000	- -	1.90%
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,500	35,619.76 1,976,896,933	45,030.00 2,499,165,000	- -	1.83%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信 業	803,300	2,618.44 2,103,393,246	2,515.50 2,020,701,150	- -	1.48%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	509,500	3,718.07 1,894,360,101	3,848.00 1,960,556,000	- -	1.44%
7	任天堂 日本	株式 その他製品	37,600	38,580.08 1,450,611,338	48,010.00 1,805,176,000	- -	1.32%
8	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	4,131,800	489.23 2,021,425,960	421.60 1,741,966,880	- -	1.28%
9	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービス業	419,200	3,726.20 1,562,025,780	3,682.00 1,543,494,400	- -	1.13%
10	第一三共 日本	株式 医薬品	175,200	7,168.62 1,255,942,986	8,806.00 1,542,811,200	- -	1.13%
11	KDDI 日本	株式 情報・通信 業	447,800	3,241.63 1,451,604,040	3,234.00 1,448,185,200	- -	1.06%
12	ダイキン工業 日本	株式 機械	78,000	14,143.25 1,103,173,620	17,335.00 1,352,130,000	- -	0.99%

13	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	482,200	2,702.32 1,303,059,218	2,755.50 1,328,702,100	- -	0.97%
14	信越化学工業 日本	株式 化学	103,000	11,838.61 1,219,376,984	12,595.00 1,297,285,000	- -	0.95%
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	417,800	3,244.38 1,355,502,897	3,032.00 1,266,769,600	- -	0.93%
16	HOYA 日本	株式 精密機器	122,300	9,671.51 1,182,825,738	10,260.00 1,254,798,000	- -	0.92%
17	花王 日本	株式 化学	146,600	8,304.01 1,217,369,151	8,540.00 1,251,964,000	- -	0.92%
18	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	429,700	3,131.01 1,345,396,214	2,882.00 1,238,395,400	- -	0.91%
19	村田製作所 日本	株式 電気機器	179,900	5,690.74 1,023,765,089	6,316.00 1,136,248,400	- -	0.83%
20	ファナック 日本	株式 電気機器	58,200	17,515.89 1,019,425,125	19,260.00 1,120,932,000	- -	0.82%
21	中外製薬 日本	株式 医薬品	191,400	3,934.54 753,072,850	5,765.00 1,103,421,000	- -	0.81%
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	8,207,600	140.21 1,150,813,450	132.20 1,085,044,720	- -	0.80%
23	日本電産 日本	株式 電気機器	147,400	6,327.62 932,691,268	7,196.00 1,060,690,400	- -	0.78%
24	S M C 日本	株式 機械	19,200	45,435.39 872,359,630	55,180.00 1,059,456,000	- -	0.78%
25	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	38,900	22,298.69 867,419,410	26,440.00 1,028,516,000	- -	0.75%
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	213,600	5,446.80 1,163,437,250	4,698.00 1,003,492,800	- -	0.74%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	294,300	3,592.33 1,057,222,994	3,403.00 1,001,502,900	- -	0.73%
28	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	421,900	2,375.77 1,002,339,584	2,321.50 979,440,850	- -	0.72%
29	三菱商事 日本	株式 卸売業	423,300	2,593.50 1,097,830,179	2,270.00 960,891,000	- -	0.70%
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	531,000	1,737.40 922,561,939	1,799.50 955,534,500	- -	0.70%

(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	国内	電気機器	14.85
		情報・通信業	9.80
		化学	7.18
		輸送用機器	7.14
		医薬品	6.77
		サービス業	5.19
		機械	5.18
		小売業	4.89
		銀行業	4.86
		卸売業	4.43
		陸運業	3.95
		食料品	3.87
		精密機器	2.60
		建設業	2.54
		その他製品	2.45
		不動産業	1.98
		保険業	1.97
		電気・ガス業	1.53
		その他金融業	1.12
		証券、商品先物取引業	0.77
		ガラス・土石製品	0.76
		非鉄金属	0.67
		ゴム製品	0.61
		鉄鋼	0.56
		金属製品	0.54
		繊維製品	0.50
		石油・石炭製品	0.41
		空運業	0.34
パルプ・紙	0.23		
鉱業	0.19		
倉庫・運輸関連業	0.18		
海運業	0.13		
水産・農林業	0.09		
	小計		98.26
合計（対純資産総額比）			98.26

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

（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」

（2020年6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	257,989	33,833.48 8,728,667,367	38,978.17 10,055,940,957	- -	4.05%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	426,043	19,816.25 8,442,575,332	21,379.92 9,108,767,642	- -	3.67%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	24,950	264,398.00 6,596,730,185	288,784.14 7,205,164,322	- -	2.90%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	141,829	23,418.36 3,321,403,206	23,771.75 3,371,524,041	- -	1.36%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	18,244	148,142.58 2,702,713,375	150,294.06 2,741,964,972	- -	1.10%
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	17,525	148,341.80 2,599,690,061	150,531.09 2,638,057,453	- -	1.06%

7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライフ サイエンス	155,325	16,042.61 2,491,819,820	14,980.16 2,326,794,843	- -	0.94%
8	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	175,378	11,937.98 2,093,659,283	11,879.04 2,083,322,698	- -	0.84%
9	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	100,565	20,418.98 2,053,435,324	20,619.28 2,073,578,013	- -	0.83%
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソ ナル用品	145,634	12,123.78 1,765,634,906	12,676.68 1,846,156,838	- -	0.74%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	181,202	9,569.92 1,734,089,049	10,019.81 1,815,611,423	- -	0.73%
12	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	55,916	31,171.06 1,742,961,155	31,218.74 1,745,627,200	- -	0.70%
13	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	64,325	25,680.44 1,651,894,356	26,516.96 1,705,704,018	- -	0.69%
14	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	52,754	31,357.30 1,654,223,397	31,560.27 1,664,930,916	- -	0.67%
15	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製 造装置	252,137	6,494.98 1,637,625,807	6,278.00 1,582,918,556	- -	0.64%
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	81,662	18,677.01 1,525,202,403	19,090.45 1,558,964,376	- -	0.63%
17	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	41,398	39,409.69 1,631,482,680	37,526.76 1,553,533,183	- -	0.63%
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	244,133	5,860.94 1,430,849,206	5,892.30 1,438,505,022	- -	0.58%
19	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製 造装置	36,092	37,917.35 1,368,513,053	39,648.31 1,430,987,165	- -	0.58%
20	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	423,209	3,122.46 1,321,455,704	3,222.50 1,363,792,441	- -	0.55%
21	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	28,404	40,226.27 1,142,587,245	45,703.30 1,298,156,760	- -	0.52%
22	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア・娯楽	106,467	12,328.41 1,312,568,883	12,015.16 1,279,218,550	- -	0.51%
23	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	25,886	48,588.89 1,257,772,224	48,185.63 1,247,333,414	- -	0.50%
24	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	249,910	4,808.01 1,201,572,170	4,972.20 1,242,602,751	- -	0.50%
25	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライフ サイエンス	149,489	8,355.10 1,248,995,561	8,201.16 1,225,984,522	- -	0.49%
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	126,622	9,382.86 1,188,076,780	9,439.15 1,195,204,228	- -	0.48%

27	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	65,713	15,715.72 1,032,727,369	18,138.02 1,191,904,299	- -	0.48%
28	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	249,512	4,739.95 1,182,675,459	4,775.03 1,191,428,982	- -	0.48%
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	462,904	2,397.53 1,109,828,407	2,520.03 1,166,535,948	- -	0.47%
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	81,942	14,191.87 1,162,910,649	14,122.55 1,157,230,745	- -	0.47%

（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	11.93
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.74
		メディア・娯楽	6.34
		資本財	6.03
		小売	5.83
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.56
		銀行	5.33
		ヘルスケア機器・サービス	5.17
		食品・飲料・タバコ	4.48
		素材	4.18
		各種金融	4.14
		半導体・半導体製造装置	3.78
		公益事業	3.40
		エネルギー	3.37
		保険	3.10
		家庭用品・パーソナル用品	2.12
		電気通信サービス	2.10
		運輸	1.75
		耐久消費財・アパレル	1.70
		食品・生活必需品小売り	1.50
消費者サービス	1.42		
商業・専門サービス	1.18		
自動車・自動車部品	1.13		
不動産	0.50		
	小計		94.80
投資証券	外国	投資証券	2.37
	小計		2.37
合計（対純資産総額比）			97.17

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



(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

(2020年6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) 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	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	102.65 1,026,585,000	102.30 1,023,022,000	0.828000 2023/5/19	1.26%
2	第350回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	808,000,000	102.95 831,836,000	101.35 818,972,640	0.100000 2028/3/20	1.01%
3	第349回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	646,000,000	103.06 665,780,520	101.39 654,985,860	0.100000 2027/12/20	0.80%
4	第351回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	640,000,000	102.82 658,048,000	101.32 648,454,400	0.100000 2028/6/20	0.80%
5	第334回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	618,000,000	103.27 638,222,730	102.91 636,002,340	0.600000 2024/6/20	0.78%
6	第348回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	621,000,000	103.08 640,126,800	101.38 629,576,010	0.100000 2027/9/20	0.77%
7	第347回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	616,000,000	103.09 635,034,400	101.36 624,426,880	0.100000 2027/6/20	0.77%
8	第352回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	616,000,000	102.64 632,305,520	101.28 623,884,800	0.100000 2028/9/20	0.77%
9	第342回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	613,000,000	102.36 627,466,800	101.20 620,405,040	0.100000 2026/3/20	0.76%
10	第131回 利付国債(5 年) 日本	国債証券	596,000,000	100.63 599,803,440	100.43 598,562,800	0.100000 2022/3/20	0.73%
11	第343回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	591,000,000	102.49 605,715,900	101.26 598,452,510	0.100000 2026/6/20	0.73%
12	第344回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	583,000,000	102.66 598,507,800	101.28 590,479,890	0.100000 2026/9/20	0.72%
13	第353回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	576,000,000	102.40 589,852,800	101.19 582,854,400	0.100000 2028/12/20	0.72%
14	第340回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	566,000,000	103.73 587,117,460	102.67 581,157,480	0.400000 2025/9/20	0.71%
15	第345回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	573,000,000	102.76 588,814,800	101.30 580,460,460	0.100000 2026/12/20	0.71%
16	第346回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	570,000,000	102.94 586,758,000	101.35 577,706,400	0.100000 2027/3/20	0.71%
17	第129回 利付国債(5 年) 日本	国債証券	575,000,000	100.52 577,990,000	100.32 576,863,000	0.100000 2021/9/20	0.71%
18	第341回 利付国債(1 0年) 日本	国債証券	552,000,000	103.37 570,635,520	102.25 564,453,120	0.300000 2025/12/20	0.69%

19	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	536,000,000	103.50 554,776,080	102.52 549,517,920	0.400000 2025/6/20	0.67%
20	第355回 利付国債（10年） 日本	国債証券	518,000,000	101.92 527,945,600	100.98 523,112,660	0.100000 2029/6/20	0.64%
21	第354回 利付国債（10年） 日本	国債証券	508,000,000	102.14 518,901,680	101.09 513,547,360	0.100000 2029/3/20	0.63%
22	第218回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	103.16 515,837,000	102.50 512,507,000	0.660000 2024/5/31	0.63%
23	第190回 政保道路機構債券 日本	特殊債券	500,000,000	102.24 511,223,000	101.65 508,265,500	0.605000 2023/5/31	0.62%
24	第338回 利付国債（10年） 日本	国債証券	491,000,000	103.30 507,237,370	102.39 502,754,540	0.400000 2025/3/20	0.62%
25	第130回 利付国債（5年） 日本	国債証券	482,000,000	100.62 485,012,500	100.38 483,846,060	0.100000 2021/12/20	0.59%
26	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	473,000,000	101.67 480,941,670	100.92 477,361,060	0.100000 2029/9/20	0.59%
27	第141回 利付国債（5年） 日本	国債証券	470,000,000	101.41 476,659,900	100.95 474,483,800	0.100000 2024/9/20	0.58%
28	第113回 利付国債（20年） 日本	国債証券	389,000,000	120.81 469,974,240	119.36 464,333,740	2.100000 2029/9/20	0.57%
29	第139回 利付国債（5年） 日本	国債証券	434,000,000	101.23 439,363,400	100.85 437,728,060	0.100000 2024/3/20	0.54%
30	第37回 利付国債（30年） 日本	国債証券	327,000,000	136.06 444,919,470	130.47 426,663,060	1.900000 2042/9/20	0.52%

（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（%）
公社債券	国内	国債証券	73.24
		地方債証券	9.15
		特殊債券	10.50
		社債券	5.40
	小計	98.28	
	外国	社債券	0.87
小計	0.87		
合計（対純資産総額比）			99.15

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

(参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

(2020年6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) 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	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	261,808,200	102.70 268,884,875	102.50 268,371,731	2.000000 2021/11/15	0.91%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	229,486,200	108.75 249,573,127	108.80 249,690,165	2.500000 2024/5/15	0.85%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	240,260,200	102.38 246,002,418	102.18 245,514,690	2.125000 2021/8/15	0.84%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	238,105,400	103.06 245,394,552	102.96 245,162,844	1.750000 2022/5/15	0.84%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	232,718,400	104.51 243,223,039	104.53 243,262,870	1.750000 2023/5/15	0.83%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	221,944,400	108.67 241,189,198	108.79 241,459,971	2.375000 2024/8/15	0.82%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	223,021,800	107.78 240,388,233	107.95 240,774,335	2.000000 2025/2/15	0.82%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	218,712,200	108.53 237,385,298	108.69 237,720,477	2.250000 2024/11/15	0.81%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	207,938,200	108.64 225,921,783	108.89 226,440,541	2.125000 2025/5/15	0.77%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	211,170,400	103.12 217,761,028	102.95 217,406,261	2.000000 2022/2/15	0.74%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	199,319,000	108.63 216,524,216	108.58 216,438,508	2.750000 2023/11/15	0.74%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	197,164,200	109.17 215,262,845	109.19 215,293,448	2.750000 2024/2/15	0.73%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	189,622,400	107.27 203,421,222	107.23 203,347,269	2.500000 2023/8/15	0.69%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	191,777,200	104.85 201,095,654	104.79 200,982,505	2.000000 2023/2/15	0.68%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	185,312,800	103.18 191,222,180	103.09 191,051,937	1.750000 2022/6/15	0.65%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	184,235,400	103.10 189,948,539	102.92 189,624,285	2.125000 2021/12/31	0.65%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	183,158,000	103.51 189,588,677	103.45 189,489,772	1.625000 2022/11/15	0.65%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	184,235,400	102.31 188,494,922	102.14 188,185,406	2.000000 2021/8/31	0.64%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	178,848,400	103.80 185,658,947	103.57 185,240,441	2.625000 2021/12/15	0.63%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	179,925,800	102.62 184,641,655	102.44 184,317,788	2.125000 2021/9/30	0.63%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	161,610,000	112.73 182,189,263	112.94 182,536,878	2.375000 2027/5/15	0.62%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	169,151,800	103.14 174,472,561	103.10 174,410,729	1.625000 2022/8/15	0.59%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	169,151,800	102.15 172,791,946	101.95 172,455,334	2.125000 2021/6/30	0.59%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	154,068,200	111.00 171,015,895	111.08 171,146,659	2.625000 2025/3/31	0.58%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	160,532,600	103.95 166,876,040	103.74 166,539,729	2.375000 2022/3/15	0.57%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	152,990,800	108.32 165,731,272	108.58 166,131,179	2.000000 2025/8/15	0.57%

27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	160,532,600	101.86 163,529,743	101.66 163,203,862	2.000000 2021/5/31	0.56%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	140,062,000	109.86 153,876,315	110.19 154,346,923	2.250000 2025/11/15	0.53%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	143,294,200	106.80 153,043,937	107.21 153,637,175	1.625000 2026/5/15	0.52%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	140,062,000	108.75 152,321,626	108.92 152,562,533	2.250000 2024/12/31	0.52%

(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 (%)
公社債券	外国	国債証券	99.61
	小計		99.61
合計(対純資産総額比)			99.61

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類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】

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2035」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2040」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2045」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2050」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2055」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2060」  
該当事項はありません。

#### (参考情報)

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

#### (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」  
該当事項はありません。

#### (参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」  
該当事項はありません。

#### (参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」  
該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2035」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2040」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2045」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2050」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2055」  
該当事項はありません。

「DCニッセイターゲットデートファンド2060」  
該当事項はありません。

## (参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

(2020年6月30日現在)

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	大阪取引所	TOPIX先物 0209月	買建	149	2,377,031,950	2,322,165,000	1.70%

(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あります。

(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。

## (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」

(2020年6月30日現在)

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 202009	買建	302	4,976,426,832	4,958,305,233	2.00%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 202009	買建	322	1,239,343,883	1,256,185,627	0.51%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 202009	買建	60	489,690,042	493,135,965	0.20%

(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あります。

(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。

## (参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年12月20日)	1,042,745	1,042,745	1.0427	1.0427
第2計算期間末 (2018年12月20日)	75,725,362	75,725,362	1.0070	1.0070
第3計算期間末 (2019年12月20日)	457,912,286	457,912,286	1.0627	1.0627
2019年6月末日	276,731,318	-	1.0400	-
7月末日	321,059,284	-	1.0451	-
8月末日	342,438,140	-	1.0452	-
9月末日	373,959,817	-	1.0495	-
10月末日	409,679,293	-	1.0585	-
11月末日	441,453,475	-	1.0632	-
12月末日	466,296,969	-	1.0664	-
2020年1月末日	489,733,412	-	1.0675	-
2月末日	495,084,490	-	1.0552	-
3月末日	490,371,182	-	1.0273	-
4月末日	508,217,709	-	1.0414	-
5月末日	527,577,510	-	1.0502	-
6月末日	846,722,337	-	1.0494	-

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年12月20日)	73,587,808	73,587,808	1.1045	1.1045
2019年6月末日	34,681,011	-	1.0460	-
7月末日	39,735,390	-	1.0554	-
8月末日	44,632,038	-	1.0406	-
9月末日	43,960,366	-	1.0611	-
10月末日	55,097,203	-	1.0843	-
11月末日	65,378,650	-	1.0977	-
12月末日	74,450,720	-	1.1082	-
2020年1月末日	85,094,841	-	1.1048	-
2月末日	79,657,140	-	1.0636	-
3月末日	81,325,375	-	1.0136	-
4月末日	89,157,301	-	1.0436	-
5月末日	106,538,300	-	1.0697	-
6月末日	734,373,300	-	1.0728	-

## 「DCニッセイターゲットデットファンド2035」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年12月20日)	1,082,306	1,082,306	1.0823	1.0823
第2計算期間末 (2018年12月20日)	70,055,216	70,055,216	0.9897	0.9897
第3計算期間末 (2019年12月20日)	564,969,332	564,969,332	1.1252	1.1252
2019年6月末日	325,475,283	-	1.0432	-
7月末日	407,673,037	-	1.0554	-
8月末日	423,034,104	-	1.0304	-
9月末日	450,142,837	-	1.0616	-
10月末日	501,613,019	-	1.0941	-
11月末日	537,897,341	-	1.1135	-
12月末日	575,368,869	-	1.1289	-
2020年1月末日	608,505,423	-	1.1218	-
2月末日	573,694,273	-	1.0568	-
3月末日	555,291,902	-	0.9882	-
4月末日	595,048,672	-	1.0294	-
5月末日	645,110,150	-	1.0688	-
6月末日	1,193,458,311	-	1.0753	-

## 「DCニッセイターゲットデットファンド2040」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年12月20日)	46,572,387	46,572,387	1.1461	1.1461
2019年6月末日	18,717,770	-	1.0566	-
7月末日	24,199,190	-	1.0697	-
8月末日	30,987,065	-	1.0416	-
9月末日	31,979,613	-	1.0761	-
10月末日	38,058,925	-	1.1117	-
11月末日	42,956,423	-	1.1329	-
12月末日	46,957,426	-	1.1499	-
2020年1月末日	53,392,576	-	1.1417	-
2月末日	49,729,187	-	1.0691	-
3月末日	48,860,847	-	0.9942	-
4月末日	66,125,193	-	1.0388	-
5月末日	78,923,466	-	1.0823	-
6月末日	341,776,264	-	1.0894	-

## 「DCニッセイターゲットデットファンド2045」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年12月20日)	1,088,135	1,088,135	1.0881	1.0881
第2計算期間末 (2018年12月20日)	43,412,324	43,412,324	0.9867	0.9867
第3計算期間末 (2019年12月20日)	264,521,692	264,521,692	1.1346	1.1346
2019年6月末日	157,483,035	-	1.0432	-
7月末日	184,881,541	-	1.0565	-
8月末日	192,442,211	-	1.0276	-
9月末日	204,580,129	-	1.0630	-
10月末日	226,667,525	-	1.0992	-
11月末日	247,583,772	-	1.1209	-
12月末日	266,526,542	-	1.1384	-
2020年1月末日	290,767,557	-	1.1298	-
2月末日	277,236,677	-	1.0556	-
3月末日	267,150,519	-	0.9807	-
4月末日	293,663,365	-	1.0260	-
5月末日	322,913,303	-	1.0703	-
6月末日	454,216,298	-	1.0779	-

## 「DCニッセイターゲットデットファンド2050」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年12月20日)	25,150,378	25,150,378	1.1540	1.1540
2019年6月末日	11,367,806	-	1.0585	-
7月末日	14,144,315	-	1.0723	-
8月末日	16,897,227	-	1.0417	-
9月末日	18,248,951	-	1.0789	-
10月末日	23,040,009	-	1.1168	-
11月末日	22,715,814	-	1.1395	-
12月末日	25,375,501	-	1.1578	-
2020年1月末日	32,588,300	-	1.1488	-
2月末日	29,264,909	-	1.0711	-
3月末日	32,315,743	-	0.9929	-
4月末日	35,030,382	-	1.0401	-
5月末日	42,019,944	-	1.0864	-
6月末日	80,779,742	-	1.0943	-



## 「DCニッセイターゲットデットファンド2055」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2016年12月20日)	1,141,342	1,141,342	1.1413	1.1413
第2計算期間末 (2017年12月20日)	2,854,940	2,854,940	1.3107	1.3107
第3計算期間末 (2018年12月20日)	71,901,230	71,901,230	1.1820	1.1820
第4計算期間末 (2019年12月20日)	359,193,901	359,193,901	1.3682	1.3682
2019年6月末日	212,326,710	-	1.2519	-
7月末日	240,214,073	-	1.2687	-
8月末日	266,676,591	-	1.2311	-
9月末日	280,825,874	-	1.2765	-
10月末日	323,127,909	-	1.3226	-
11月末日	345,118,038	-	1.3503	-
12月末日	376,772,887	-	1.3727	-
2020年1月末日	385,186,967	-	1.3615	-
2月末日	362,855,333	-	1.2665	-
3月末日	344,031,693	-	1.1712	-
4月末日	371,870,509	-	1.2283	-
5月末日	402,672,987	-	1.2846	-
6月末日	445,142,056	-	1.2944	-

## 「DCニッセイターゲットデットファンド2060」

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年12月20日)	32,944,282	32,944,282	1.1609	1.1609
2019年6月末日	14,461,074	-	1.0604	-
7月末日	13,572,843	-	1.0748	-
8月末日	15,666,487	-	1.0420	-
9月末日	15,299,672	-	1.0814	-
10月末日	20,615,341	-	1.1213	-
11月末日	25,902,331	-	1.1453	-
12月末日	33,432,180	-	1.1647	-
2020年1月末日	39,183,350	-	1.1549	-
2月末日	36,764,569	-	1.0723	-
3月末日	32,992,008	-	0.9900	-
4月末日	39,375,406	-	1.0394	-
5月末日	56,661,746	-	1.0881	-
6月末日	87,268,170	-	1.0966	-

## 【分配の推移】

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2025」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2030」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2035」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2040」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2045」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2050」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2055」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2060」

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2019年12月21日～ 2020年6月20日	-

## 【収益率の推移】

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2025」

	収益率(%)
第1計算期間	4.3
第2計算期間	3.4
第3計算期間	5.5
2019年12月21日～ 2020年6月20日	1.0

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2030」

	収益率(%)
第1計算期間	10.5
2019年12月21日～ 2020年6月20日	2.4

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2035」

	収益率(%)
第1計算期間	8.2
第2計算期間	8.6
第3計算期間	13.7
2019年12月21日～ 2020年6月20日	3.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2040」

	収益率(%)
第1計算期間	14.6
2019年12月21日～ 2020年6月20日	4.3

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2045」

	収益率(%)
第1計算期間	8.8
第2計算期間	9.3
第3計算期間	15.0
2019年12月21日～ 2020年6月20日	4.3

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2050」

	収益率(%)
第1計算期間	15.4
2019年12月21日～ 2020年6月20日	4.5

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2055」

	収益率(%)
第1計算期間	14.1
第2計算期間	14.8
第3計算期間	9.8
第4計算期間	15.8
2019年12月21日～ 2020年6月20日	4.7

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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。）。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2060」

	収益率(%)
第1計算期間	16.1
2019年12月21日～ 2020年6月20日	4.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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】

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2025」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	86,246,774	12,050,899	75,195,875
第3計算期間	387,560,915	31,880,755	430,876,035
2019年12月21日～ 2020年6月20日	453,892,677	89,133,530	795,635,182

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2030」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	73,774,281	7,147,035	66,627,246
2019年12月21日～ 2020年6月20日	620,810,230	10,310,930	677,126,546

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2035」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	75,898,281	6,116,182	70,782,099
第3計算期間	472,272,256	40,931,452	502,122,903
2019年12月21日～ 2020年6月20日	695,488,282	86,528,353	1,111,082,832

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2040」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	43,349,876	2,715,954	40,633,922
2019年12月21日～ 2020年6月20日	277,836,945	6,591,080	311,879,787

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2045」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	45,814,915	2,817,018	43,997,897
第3計算期間	215,465,288	26,325,617	233,137,568
2019年12月21日～ 2020年6月20日	216,329,381	37,946,695	411,520,254

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2050」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	25,368,600	3,574,381	21,794,219
2019年12月21日～ 2020年6月20日	59,441,145	8,261,562	72,973,802

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2055」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,000,000	0	1,000,000
第2計算期間	2,178,145	1,000,000	2,178,145
第3計算期間	67,199,823	8,549,894	60,828,074
第4計算期間	228,564,856	26,865,852	262,527,078
2019年12月21日～ 2020年6月20日	138,413,474	61,573,248	339,367,304

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「DCニッセイターゲットデートファンド2060」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	37,713,552	9,335,463	28,378,089
2019年12月21日～ 2020年6月20日	73,099,728	22,724,620	78,753,197

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;

# 3.運用実績

2020年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

### ●基準価額・純資産の推移



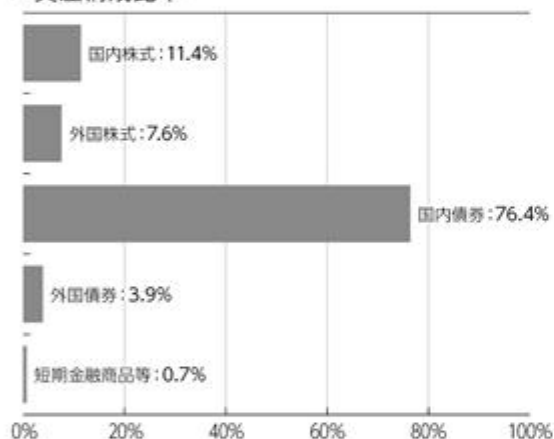
基準価額	10,494円
純資産総額	846百万円

### ●分配の推移 1万口当り(税引前)

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

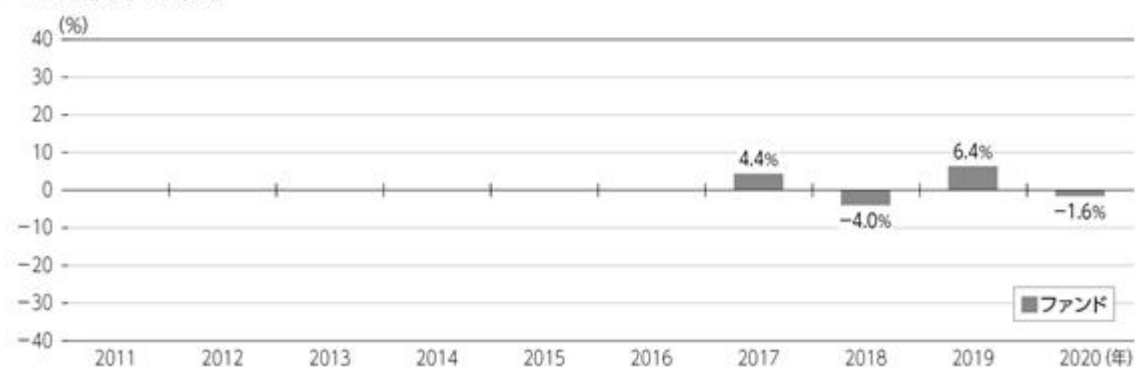
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

### ●資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

### ●年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2017年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

2020年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

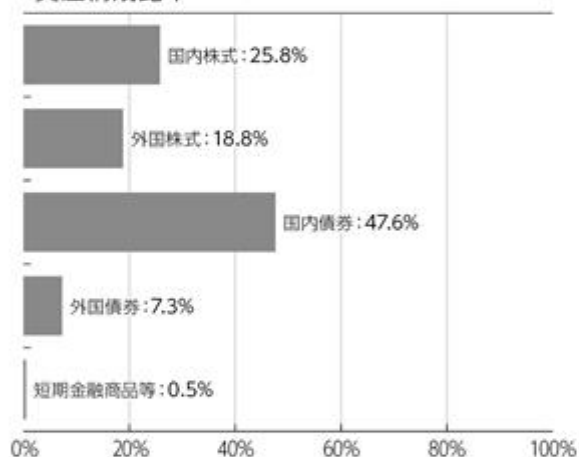
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	10,728円
純資産総額	734百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

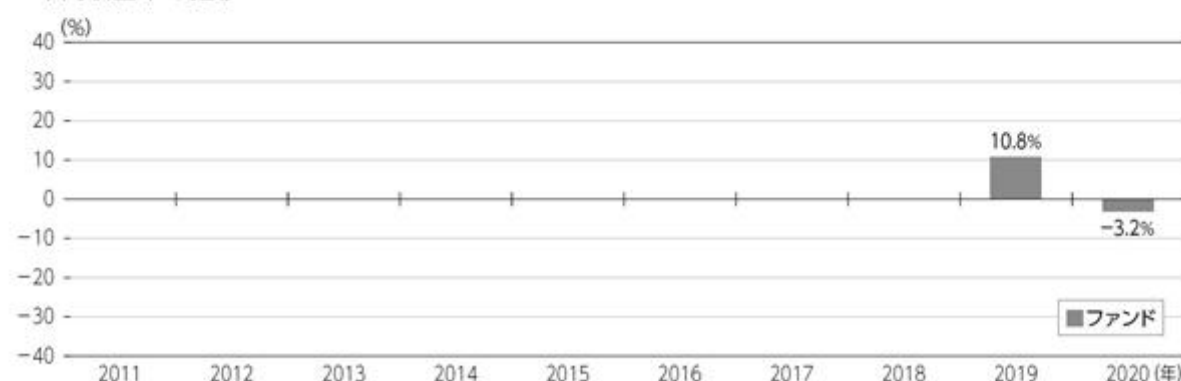
2019年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2019年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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



## 3.運用実績

2020年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,753円
純資産総額	11億円

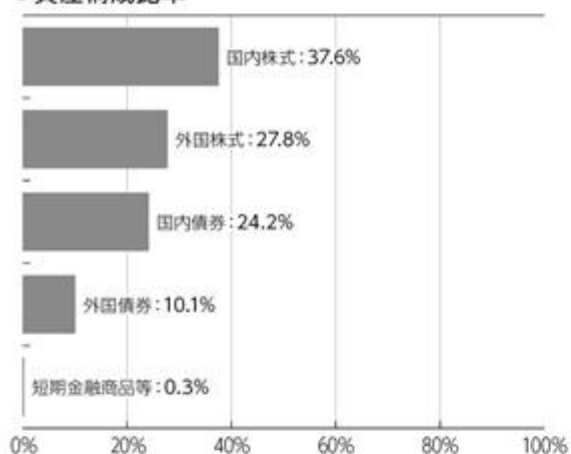
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

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

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

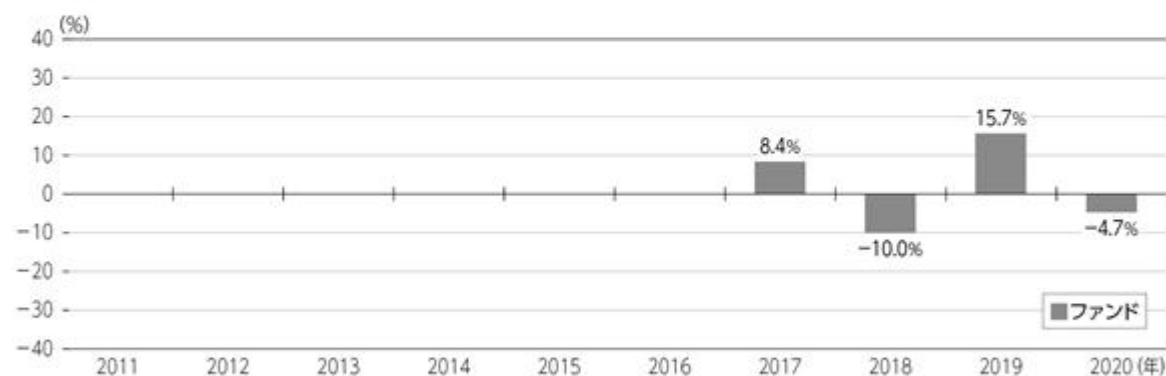
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2017年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

2020年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,894円
純資産総額	341百万円

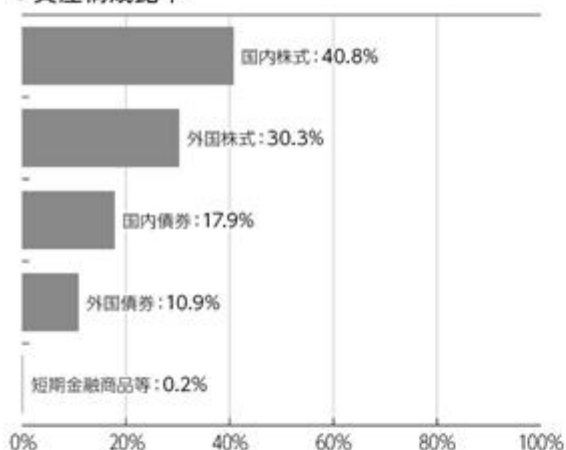
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

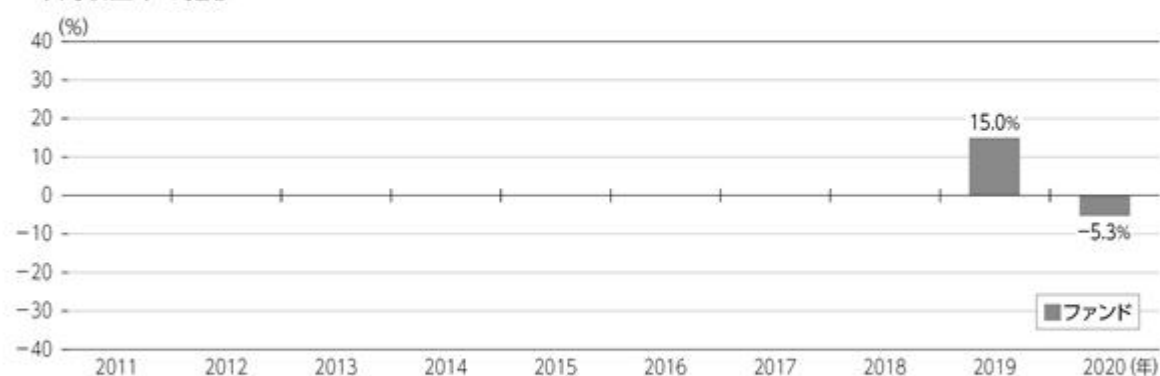
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

・2019年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

## 3.運用実績

2020年6月末現在

## DCニッセイターゲットデットファンド2045

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,779円
純資産総額	454百万円

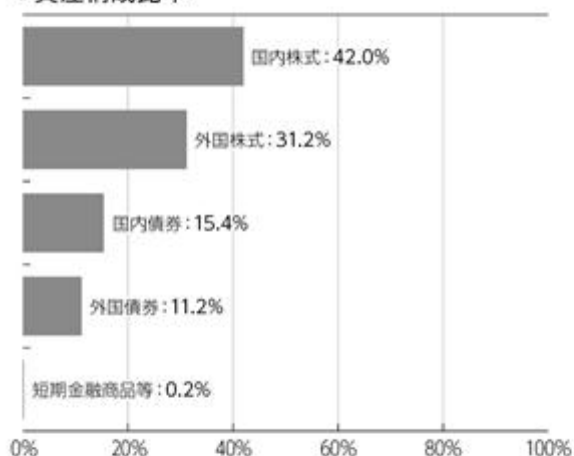
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

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

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

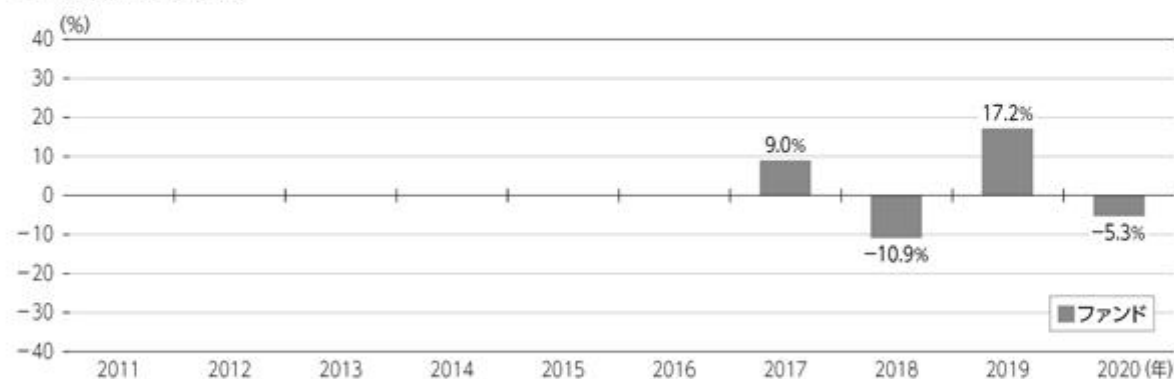
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2017年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

2020年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

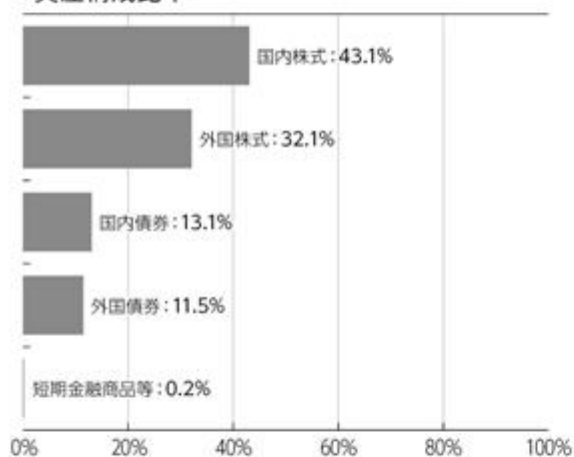
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	10,943円
純資産総額	80百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

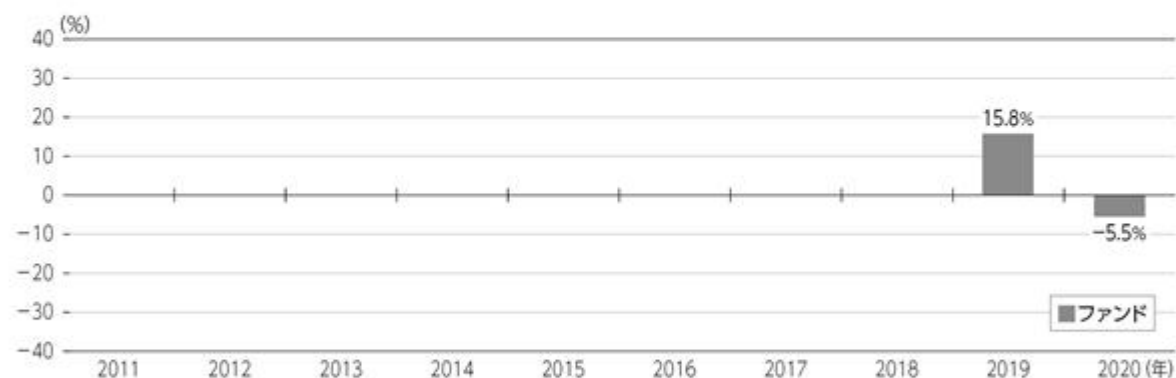
2019年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2019年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

## 3.運用実績

2020年6月末現在

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

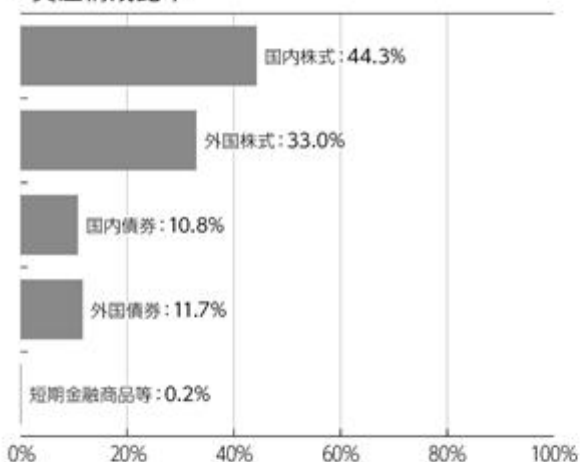
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	12,944円
純資産総額	445百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

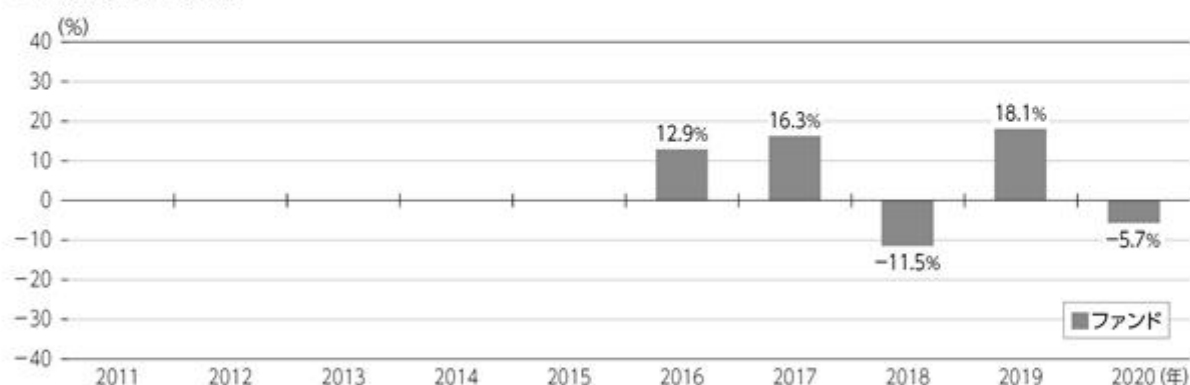
2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2016年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

2020年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

## ●基準価額・純資産の推移



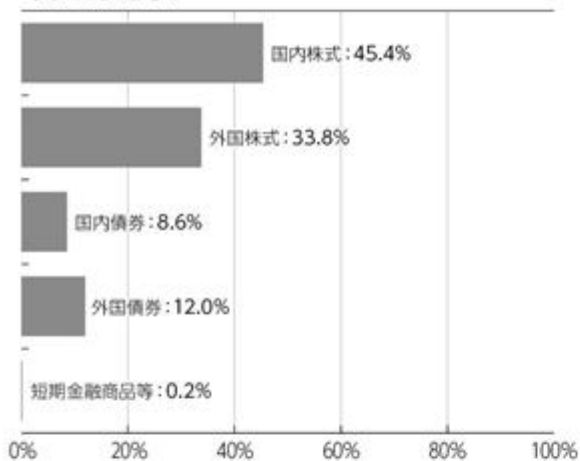
基準価額	10,966円
純資産総額	87百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

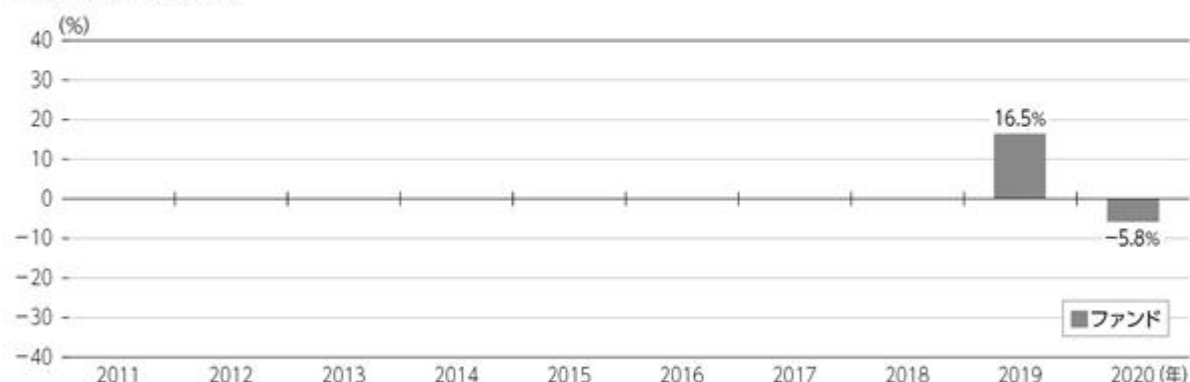
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2019年はファンド設定時から年末まで、2020年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

## 3.運用実績

2020年6月末現在

## ●マザーファンドの状況

## 1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.4%
2	ソニー	2.1%
3	ソフトバンクグループ	1.9%
4	キーエンス	1.9%
5	日本電信電話	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	15.1%
2	情報・通信業	10.0%
3	化学	7.3%
4	輸送用機器	7.3%
5	医薬品	6.9%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2.ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	4.2%
2	マイクロソフト	情報技術	3.8%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	3.0%
4	フェイスブック	コミュニケーション・サービス	1.4%
5	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.1%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	71.0%
2	イギリス	4.9%
3	フランス	3.8%
4	スイス	3.5%
5	カナダ	3.4%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 3.ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	2023/05/19	0.828%	1.3%
2	第350回 利付国債(10年)	2028/03/20	0.100%	1.0%
3	第349回 利付国債(10年)	2027/12/20	0.100%	0.8%
4	第351回 利付国債(10年)	2028/06/20	0.100%	0.8%
5	第334回 利付国債(10年)	2024/06/20	0.600%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入債券種別

	種別	比率
	日本国債	73.9%
	その他	26.1%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 4.ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	2021/11/15	2.000%	0.9%
2	アメリカ国債	2024/05/15	2.500%	0.9%
3	アメリカ国債	2021/08/15	2.125%	0.8%
4	アメリカ国債	2022/05/15	1.750%	0.8%
5	アメリカ国債	2023/05/15	1.750%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	45.4%
2	フランス	10.1%
3	イタリア	9.2%
4	ドイツ	7.6%
5	イギリス	6.5%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入債券評価額比です。

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

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

## 第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）

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

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

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）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

「ターゲットデート2025」

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

「ターゲットデート2030」

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

「ターゲットデート2035」

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

「ターゲットデート2040」

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

「ターゲットデート2045」

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

「ターゲットデート2050」

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

「ターゲットデート2055」

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

「ターゲットデート2060」

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

#### (4) 【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

#### (5) 【その他】

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10億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発送します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 前記2.から4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記2.から4.までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
6. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「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.の変更事項にあつ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、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、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。

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

##### (2) 償還金に対する請求権

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

##### (3) 解約請求権

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

##### (4) 帳簿閲覧権

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

##### (5) 書面決議における議決権

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

#### DCニッセイターゲットデートファンド2025

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年12月21日から2019年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2030

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2019年1月10日から2019年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2035

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年12月21日から2019年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイターゲットデートファンド2040

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2019年1月10日から2019年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年12月21日から2019年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2050

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年1月10日から2019年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2055

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2018年12月21日から2019年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2060

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2019年1月10日を期首としております。

3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年1月10日から2019年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。



## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイターゲットデットファンド2025】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2018年12月20日現在)	第3期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	29,769	5,863
コール・ローン	49,378	537,548
親投資信託受益証券	75,726,081	457,916,156
未収入金	3,609	108,423
流動資産合計	75,808,837	458,567,990
資産合計	75,808,837	458,567,990
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	96,859
未払受託者報酬	7,801	59,863
未払委託者報酬	73,152	479,108
その他未払費用	2,522	19,874
流動負債合計	83,475	655,704
負債合計	83,475	655,704
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	75,195,875	430,876,035
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	529,487	27,036,251
純資産合計	75,725,362	457,912,286
負債純資産合計	75,808,837	458,567,990

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 (自2017年12月21日 至2018年12月20日)	第3期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	1,997,278	12,747,233
営業収益合計	1,997,278	12,747,235
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	37
受託者報酬	8,962	81,492
委託者報酬	84,323	654,191
その他費用	2,831	27,077
営業費用合計	96,116	762,797
営業利益又は営業損失（ ）	2,093,394	11,984,438
経常利益又は経常損失（ ）	2,093,394	11,984,438
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,093,394	11,984,438
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（ ）	85,735	527,174
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	42,745	529,487
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,141,200	15,898,729
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	3,141,200	15,898,729
剰余金減少額又は欠損金増加額	475,329	849,229
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	475,329	849,229
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（ ）	529,487	27,036,251

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期 2018年12月20日現在	第3期 2019年12月20日現在
1 . 受益権総口数	75,195,875口	430,876,035口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0070円 (10,070円)	1.0627円 (10,627円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,184,768円)及び分配準備積立金(29,433円)より分配対象収益は3,214,201円(1口当たり0.042744円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(9,572,095円)、収益調整金(18,392,035円)及び分配準備積立金(25,457円)より分配対象収益は27,989,587円(1口当たり0.064960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2期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12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	2,073,681	11,279,881
合計	2,073,681	11,279,881

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円	75,195,875円
期中追加設定元本額	86,246,774円	387,560,915円
期中一部解約元本額	12,050,899円	31,880,755円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	36,314,500	67,544,970	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	24,284,062	47,781,320	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	325,714,099	321,544,958	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15,164,223	21,044,908	
親投資信託受益証券 合計		401,476,884	457,916,156	
合計		401,476,884	457,916,156	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2030】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		747
コール・ローン		68,498
親投資信託受益証券		73,588,451
未収入金		2,166,291
流動資産合計		75,823,987
資産合計		75,823,987
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		2,164,317
未払受託者報酬		7,410
未払委託者報酬		62,045
その他未払費用		2,407
流動負債合計		2,236,179
負債合計		2,236,179
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		66,627,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		6,960,562
純資産合計		73,587,808
負債純資産合計		75,823,987

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 (自2019年1月10日 至2019年12月20日)
営業収益	
有価証券売買等損益	3,260,221
営業収益合計	3,260,221
営業費用	
支払利息	2
受託者報酬	8,893
委託者報酬	74,441
その他費用	2,837
営業費用合計	86,173
営業利益又は営業損失( )	3,174,048
経常利益又は経常損失( )	3,174,048
当期純利益又は当期純損失( )	3,174,048
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( )	182,640
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,308,833
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	4,308,833
剰余金減少額又は欠損金増加額	339,679
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	339,679
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( )	6,960,562



## (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1期 2019年12月20日現在
1. 受益権総口数	66,627,246口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1045円 (11,045円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,991,410円)、収益調整金(3,969,154円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は6,960,564円(1口当たり0.104470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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 2019年12月20日現在
	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	2,958,214
合計	2,958,214

(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1期 2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	72,774,281円
期中一部解約元本額	7,147,035円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	11,550,827	21,484,538	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	8,138,279	16,012,877	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	30,717,529	30,324,344	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	4,155,276	5,766,692	
親投資信託受益証券	合計	54,561,911	73,588,451	
合計		54,561,911	73,588,451	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2035】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2018年12月20日現在)	第3期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	28,744	7,697
コール・ローン	47,677	705,672
親投資信託受益証券	70,055,926	564,974,439
未収入金	3,600	631,935
流動資産合計	70,135,947	566,319,743
資産合計	70,135,947	566,319,743
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	616,614
未払受託者報酬	7,096	73,353
未払委託者報酬	71,355	636,063
その他未払費用	2,280	24,381
流動負債合計	80,731	1,350,411
負債合計	80,731	1,350,411
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	70,782,099	502,122,903
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	726,883	62,846,429
純資産合計	70,055,216	564,969,332
負債純資産合計	70,135,947	566,319,743

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 (自2017年12月21日 至2018年12月20日)	第3期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	4,846,988	42,179,531
営業収益合計	4,846,988	42,179,533
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	39
受託者報酬	7,819	98,566
委託者報酬	78,837	856,589
その他費用	2,442	32,709
営業費用合計	89,098	987,903
営業利益又は営業損失（ ）	4,936,086	41,191,630
経常利益又は経常損失（ ）	4,936,086	41,191,630
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,936,086	41,191,630
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（ ）	124,616	1,138,685
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	82,306	726,883
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,654,615	24,845,558
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	4,654,615	24,845,558
剰余金減少額又は欠損金増加額	403,102	1,325,191
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	403,102	1,325,191
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（ ）	726,883	62,846,429

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期 2018年12月20日現在	第3期 2019年12月20日現在
1 . 受益権総口数	70,782,099口	502,122,903口
2 . 投資信託財産の計算に関する規則 第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	726,883円	
3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9897円 (9,897円)	1.1252円 (11,252円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(5,768,352円)及び分配準備積立金(57,423円)より分配対象収益は5,825,775円(1口当たり0.082306円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(35,591,124円)、収益調整金(41,276,792円)及び分配準備積立金(50,632円)より分配対象収益は76,918,548円(1口当たり0.153187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2期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12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	4,966,634	39,659,119
合計	4,966,634	39,659,119

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円	70,782,099円
期中追加設定元本額	75,898,281円	472,272,256円
期中一部解約元本額	6,116,182円	40,931,452円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	117,671,498	218,868,986	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	83,849,166	164,981,619	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	125,831,324	124,220,683	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	41,002,415	56,903,151	
親投資信託受益証券 合計		368,354,403	564,974,439	
合計		368,354,403	564,974,439	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2040】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	511
コール・ローン	46,894
親投資信託受益証券	46,572,808
未収入金	1,263
流動資産合計	46,621,476
資産合計	46,621,476
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	4,884
未払委託者報酬	42,651
その他未払費用	1,554
流動負債合計	49,089
負債合計	49,089
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	40,633,922
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,938,465
純資産合計	46,572,387
負債純資産合計	46,621,476

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第1期 (自2019年 1月10日 至2019年12月20日)
営業収益	
有価証券売買等損益	3,244,199
営業収益合計	3,244,199
営業費用	
支払利息	1
受託者報酬	5,672
委託者報酬	49,656
その他費用	1,746
営業費用合計	57,075
営業利益又は営業損失( )	3,187,124
経常利益又は経常損失( )	3,187,124
当期純利益又は当期純損失( )	3,187,124
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( )	74,615
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,975,448
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	2,975,448
剰余金減少額又は欠損金増加額	149,492
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	149,492
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( )	5,938,465

## (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1期 2019年12月20日現在
1. 受益権総口数	40,633,922口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1461円 (11,461円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,112,510円)、収益調整金(2,825,956円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は5,938,466円(1口当たり0.146146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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期
	2019年12月20日現在
	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	3,098,467
合計	3,098,467

## (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1期
	2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	42,349,876円
期中一部解約元本額	2,715,954円

## (4) 【附属明細表】(2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	10,336,705	19,226,271	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	7,410,424	14,580,750	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	7,907,384	7,806,169	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	3,573,727	4,959,618	
親投資信託受益証券 合計		29,228,240	46,572,808	
合計		29,228,240	46,572,808	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2045】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2018年12月20日現在)	第3期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	18,184	3,517
コール・ローン	30,160	322,477
親投資信託受益証券	43,412,766	264,524,096
未収入金	2,225	1,149,288
流動資産合計	43,463,335	265,999,378
資産合計	43,463,335	265,999,378
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,142,158
未払受託者報酬	4,460	33,526
未払委託者報酬	45,132	290,905
その他未払費用	1,419	11,097
流動負債合計	51,011	1,477,686
負債合計	51,011	1,477,686
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	43,997,897	233,137,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	585,573	31,384,124
純資産合計	43,412,324	264,521,692
負債純資産合計	43,463,335	265,999,378



## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 (自2017年12月21日 至2018年12月20日)	第3期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	3,127,549	22,124,412
営業収益合計	3,127,549	22,124,412
営業費用		
支払利息	-	7
受託者報酬	4,767	46,674
委託者報酬	48,303	406,100
その他費用	1,438	15,400
営業費用合計	54,508	468,181
営業利益又は営業損失（ ）	3,182,057	21,656,231
経常利益又は経常損失（ ）	3,182,057	21,656,231
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,182,057	21,656,231
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（ ）	60,716	933,869
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	88,135	585,573
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,756,151	11,941,789
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	2,756,151	11,941,789
剰余金減少額又は欠損金増加額	187,086	694,454
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	187,086	694,454
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（ ）	585,573	31,384,124

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期 2018年12月20日現在	第3期 2019年12月20日現在
1 . 受益権総口数	43,997,897口	233,137,568口
2 . 投資信託財産の計算に関する規則 第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	585,573円	
3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9867円 (9,867円)	1.1346円 (11,346円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,828,526円)及び分配準備積立金(49,208円)より分配対象収益は3,877,734円(1口当たり0.088135円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(18,002,575円)、収益調整金(20,506,159円)及び分配準備積立金(41,273円)より分配対象収益は38,550,007円(1口当たり0.165353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2期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第3期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12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	3,192,526	20,576,520
合計	3,192,526	20,576,520

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第2期	第3期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円	43,997,897円
期中追加設定元本額	45,814,915円	215,465,288円
期中一部解約元本額	2,817,018円	26,325,617円

## ( 4 ) 【附属明細表】 ( 2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	60,519,729	112,566,695	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	43,154,714	84,911,215	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	38,861,533	38,364,105	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	20,667,302	28,682,081	
親投資信託受益証券 合計		163,203,278	264,524,096	
合計		163,203,278	264,524,096	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2050】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	291
コール・ローン	26,647
親投資信託受益証券	25,150,604
未収入金	677
流動資産合計	25,178,219
資産合計	25,178,219
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	2,752
未払委託者報酬	24,251
その他未払費用	838
流動負債合計	27,841
負債合計	27,841
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	21,794,219
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,356,159
純資産合計	25,150,378
負債純資産合計	25,178,219

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 (自2019年 1月10日 至2019年12月20日)
営業収益	
有価証券売買等損益	1,989,457
営業収益合計	1,989,457
営業費用	
受託者報酬	3,302
委託者報酬	29,186
その他費用	947
営業費用合計	33,435
営業利益又は営業損失（ ）	1,956,022
経常利益又は経常損失（ ）	1,956,022
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,956,022
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（ ）	180,474
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,791,183
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	1,791,183
剰余金減少額又は欠損金増加額	210,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	210,572
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,356,159

## ( 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1期 2019年12月20日現在
1 . 受益権総口数	21,794,219口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1540円 (11,540円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,775,548円)、収益調整金(1,580,611円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は3,356,159円(1口当たり0.153993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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 . 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期
	2019年12月20日現在
	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	1,773,104
合計	1,773,104

## (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1期
	2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	24,368,600円
期中一部解約元本額	3,574,381円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	5,898,975	10,972,093	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	4,218,552	8,300,422	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	3,118,191	3,078,278	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	2,017,446	2,799,811	
親投資信託受益証券 合計		15,253,164	25,150,604	
合計		15,253,164	25,150,604	

## 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。

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2055】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2018年12月20日現在)	第4期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	34,221	4,815
コール・ローン	56,762	441,484
親投資信託受益証券	71,901,960	359,197,149
未収入金	3,722	372,838
流動資産合計	71,996,665	360,016,286
資産合計	71,996,665	360,016,286
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	363,097
未払受託者報酬	8,397	45,896
未払委託者報酬	84,318	398,175
その他未払費用	2,720	15,217
流動負債合計	95,435	822,385
負債合計	95,435	822,385
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	60,828,074	262,527,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	11,073,156	96,666,823
純資産合計	71,901,230	359,193,901
負債純資産合計	71,996,665	360,016,286

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期 (自2017年12月21日 至2018年12月20日)	第4期 (自2018年12月21日 至2019年12月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	6,566,115	33,720,631
営業収益合計	6,566,115	33,720,631
営業費用		
支払利息	-	12
受託者報酬	11,001	65,335
委託者報酬	110,792	568,571
その他費用	3,518	21,635
営業費用合計	125,311	655,553
営業利益又は営業損失( )	6,691,426	33,065,078
経常利益又は経常損失( )	6,691,426	33,065,078
当期純利益又は当期純損失( )	6,691,426	33,065,078
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( )	189,722	1,338,766
期首剰余金又は期首欠損金( )	676,795	11,073,156
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,464,424	59,837,509
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	19,464,424	59,837,509
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,566,359	5,970,154
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,566,359	5,970,154
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( )	11,073,156	96,666,823

## ( 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3期 2018年12月20日現在	第4期 2019年12月20日現在
1 . 受益権総口数	60,828,074口	262,527,078口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1820円 (11,820円)	1.3682円 (13,682円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第3期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第4期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(13,434,151円)及び分配準備積立金(203,027円)より分配対象収益は13,637,178円(1口当たり0.224192円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(26,368,896円)、収益調整金(70,130,640円)及び分配準備積立金(167,299円)より分配対象収益は96,666,835円(1口当たり0.368217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3期 自2017年12月21日 至2018年12月20日	第4期 自2018年12月21日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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3期	第4期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	2018年12月20日現在	2019年12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	6,362,498	31,537,108
合計	6,362,498	31,537,108

(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3期	第4期
	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
期首元本額	2,178,145円	60,828,074円
期中追加設定元本額	67,199,823円	228,564,856円
期中一部解約元本額	8,549,894円	26,865,852円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	86,317,623	160,550,778	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	61,886,852	121,768,569	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	36,321,282	35,856,369	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	29,558,606	41,021,433	
親投資信託受益証券 合計		214,084,363	359,197,149	
合計		214,084,363	359,197,149	

## 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。



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2060】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 (2019年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		283
コール・ローン		25,975
親投資信託受益証券		32,944,568
未収入金		711,338
流動資産合計		33,682,164
資産合計		33,682,164
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		710,480
未払受託者報酬		2,710
未払委託者報酬		23,843
その他未払費用		849
流動負債合計		737,882
負債合計		737,882
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		28,378,089
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,566,193
純資産合計		32,944,282
負債純資産合計		33,682,164

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 (自2019年 1月10日 至2019年12月20日)
営業収益	
有価証券売買等損益	1,911,501
営業収益合計	1,911,501
営業費用	
受託者報酬	3,571
委託者報酬	31,548
その他費用	1,078
営業費用合計	36,197
営業利益又は営業損失（ ）	1,875,304
経常利益又は経常損失（ ）	1,875,304
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,875,304
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（ ）	164,123
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,499,744
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	3,499,744
剰余金減少額又は欠損金増加額	644,732
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	644,732
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（ ）	4,566,193

## (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1期 2019年12月20日現在
1. 受益権総口数	28,378,089口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1609円 (11,609円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,711,181円)、収益調整金(2,855,012円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は4,566,193円(1口当たり0.160906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1期 自2019年1月10日 至2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期
	2019年12月20日現在
	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	1,721,409
合計	1,721,409

## (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1期
	2019年12月20日現在
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	36,713,552円
期中一部解約元本額	9,335,463円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2019年12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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	8,055,589	14,983,395	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	5,788,980	11,390,397	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	2,777,513	2,741,960	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	2,758,911	3,828,816	
親投資信託受益証券 合計		19,380,993	32,944,568	
合計		19,380,993	32,944,568	

## 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（DCニッセイターゲットデットファンド2060）は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券バッシブマザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	393,407,360	16,982,489
コール・ローン	652,534,414	1,557,058,854
株式	52,334,129,150	67,651,741,100
派生商品評価勘定	-	7,334,900
未収配当金	7,063,965	7,814,340
前払金	12,865,000	-
差入委託証拠金	27,540,000	39,360,000
流動資産合計	53,427,539,889	69,280,291,683
資産合計	53,427,539,889	69,280,291,683
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	38,544,160	-
前受金	-	13,940,000
未払解約金	217,273,150	282,184,177
その他未払費用	26,220	2,094
流動負債合計	255,843,530	296,126,271
負債合計	255,843,530	296,126,271
純資産の部		
元本等		
元本	33,490,455,341	37,088,154,099
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	19,681,241,018	31,896,011,313
純資産合計	53,171,696,359	68,984,165,412
負債純資産合計	53,427,539,889	69,280,291,683



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1 . 受益権総口数	33,490,455,341口	37,088,154,099口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5877円 (15,877円)	1.8600円 (18,600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 2017年12月21日 至 2018年12月20日	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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	2018年12月20日現在	2019年12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	7,924,602,611	4,893,505,549
合計	7,924,602,611	4,893,505,549

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	2018年12月20日 現在			2019年12月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	851,755,000	-	813,240,000	38,515,000	1,407,940,000	-	1,415,320,000	7,380,000
合計	851,755,000	-	813,240,000	38,515,000	1,407,940,000	-	1,415,320,000	7,380,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」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	2018年12月20日現在	2019年12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	26,023,308,686円	33,490,455,341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	15,823,436,651円	14,453,233,240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	8,356,289,996円	10,855,534,482円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	7,076,444,559円	6,419,327,977円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	5,141,452,103円	4,490,244,383円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,113,117円	-円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,107,496円	4,061,985円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,141,587,869円	1,468,992,924円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,053,764,212円	5,189,906,169円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,831,559,949円	3,475,361,436円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	11,966,669円	8,365,927円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	42,409,351円	35,197,323円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	50,371,437円	43,310,499円
DCニッセイ国内株式インデックス	146,525,871円	305,067,072円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	12,437,235,173円	14,513,159,469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)	429,645,866円	646,384,003円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	19,980,234円	86,317,623円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	10,448,135円	77,339,395円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	11,443,729円	60,519,729円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	16,971,449円	117,671,498円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	7,913,221円	36,314,500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)	15,847,882円	43,386,870円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,346,188円	6,618,040円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,851,600円	3,610,276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)	618,605円	1,046,984円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	1,004,913円	3,084,499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)	9,845,713円	17,023,422円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	8,055,589円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	5,898,975円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	10,336,705円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	11,550,827円
計	33,490,455,341円	37,088,154,099円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12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	34,374,685,386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	13,002,541,137円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,289,072,424円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	6,419,327,977円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	4,490,244,383円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,061,985円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,468,992,924円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,189,906,169円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,475,361,436円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	8,365,927円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	35,197,323円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	43,310,499円
DCニッセイ国内株式インデックス	305,067,072円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	14,513,159,469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)	646,384,003円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	86,317,623円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	77,339,395円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	60,519,729円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	117,671,498円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	36,314,500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)	43,386,870円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,618,040円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,610,276円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,046,984円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	3,084,499円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	17,023,422円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	8,055,589円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,898,975円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	10,336,705円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	11,550,827円
計	37,088,154,099円

## 附属明細表(2019年12月20日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,300	2,835.00	3,685,500	
日本水産	37,600	641.00	24,101,600	
マルハニチロ	5,400	2,800.00	15,120,000	
カネコ種苗	1,200	1,484.00	1,780,800	
サカタのタネ	4,500	3,825.00	17,212,500	
ホクト	2,900	2,000.00	5,800,000	
ヒノキヤグループ	900	2,269.00	2,042,100	
ショーボンドホールディングス	5,400	4,530.00	24,462,000	
ミライト・ホールディングス	11,200	1,677.00	18,782,400	
タマホーム	1,800	1,690.00	3,042,000	
ファーストコーポレーション	2,500	619.00	1,547,500	
スペースバリューホールディングス	4,600	521.00	2,396,600	
住石ホールディングス	6,200	153.00	948,600	
日鉄鉱業	900	4,955.00	4,459,500	
三井松島ホールディングス	1,500	1,235.00	1,852,500	
国際石油開発帝石	150,600	1,168.50	175,976,100	
石油資源開発	4,900	3,085.00	15,116,500	
K&Oエナジーグループ	1,800	1,672.00	3,009,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	1,042.00	1,979,800	
安藤・間	22,400	966.00	21,638,400	
東急建設	11,000	775.00	8,525,000	
コムシスホールディングス	13,300	3,150.00	41,895,000	
ミサワホーム	2,600	1,199.00	3,117,400	
ピーアールホールディングス	4,100	487.00	1,996,700	
高松コンストラクショングループ	2,300	2,818.00	6,481,400	
東建コーポレーション	1,200	7,490.00	8,988,000	
ヤマウラ	2,000	899.00	1,798,000	
大成建設	28,900	4,465.00	129,038,500	
大林組	86,700	1,236.00	107,161,200	
清水建設	88,000	1,130.00	99,440,000	
飛鳥建設	2,500	1,514.00	3,785,000	
長谷工コーポレーション	33,600	1,480.00	49,728,000	
松井建設	3,400	816.00	2,774,400	
銭高組	400	3,990.00	1,596,000	
鹿島建設	68,100	1,471.00	100,175,100	
不動テトラ	2,300	1,700.00	3,910,000	
大末建設	1,100	995.00	1,094,500	
鉄建建設	1,900	2,865.00	5,443,500	
西松建設	6,700	2,480.00	16,616,000	
三井住友建設	20,900	637.00	13,313,300	
大豊建設	1,900	2,931.00	5,568,900	
前田建設工業	21,700	1,071.00	23,240,700	
佐田建設	4,200	468.00	1,965,600	
ナカノフドー建設	3,500	469.00	1,641,500	
奥村組	4,700	3,005.00	14,123,500	
東鉄工業	3,700	3,255.00	12,043,500	
浅沼組	1,000	4,590.00	4,590,000	
戸田建設	36,000	723.00	26,028,000	
熊谷組	4,000	3,320.00	13,280,000	
北野建設	600	2,646.00	1,587,600	
植木組	700	2,584.00	1,808,800	
矢作建設工業	3,800	848.00	3,222,400	
ピーエス三菱	2,900	734.00	2,128,600	
日本ハウスホールディングス	5,900	504.00	2,973,600	

大東建託	10,400	13,695.00	142,428,000
新日本建設	3,700	970.00	3,589,000
N I P P O	7,200	2,365.00	17,028,000
東亜道路工業	500	3,640.00	1,820,000
前田道路	9,200	2,679.00	24,646,800
日本道路	800	7,100.00	5,680,000
東亜建設工業	2,700	1,666.00	4,498,200
日本国土開発	5,100	659.00	3,360,900
若築建設	1,600	1,747.00	2,795,200
東洋建設	9,700	526.00	5,102,200
五洋建設	34,400	682.00	23,460,800
世紀東急工業	4,200	902.00	3,788,400
福田組	1,000	5,160.00	5,160,000
住友林業	22,000	1,614.00	35,508,000
日本基礎技術	4,600	417.00	1,918,200
巴コーポレーション	4,100	469.00	1,922,900
大和ハウス工業	85,800	3,391.00	290,947,800
ライト工業	5,000	1,571.00	7,855,000
積水ハウス	94,800	2,373.00	224,960,400
日特建設	2,500	859.00	2,147,500
ユアテック	5,000	715.00	3,575,000
四電工	600	2,843.00	1,705,800
中電工	3,500	2,584.00	9,044,000
関電工	12,300	1,065.00	13,099,500
きんでん	20,600	1,717.00	35,370,200
東京エネシス	2,900	958.00	2,778,200
トーエネック	900	3,885.00	3,496,500
住友電設	2,400	2,865.00	6,876,000
日本電設工業	4,800	2,292.00	11,001,600
協和エクシオ	13,100	2,790.00	36,549,000
新日本空調	2,300	2,240.00	5,152,000
日本工営	1,800	3,815.00	6,867,000
九電工	6,100	3,320.00	20,252,000
三機工業	6,200	1,540.00	9,548,000
日揮ホールディングス	26,700	1,805.00	48,193,500
中外炉工業	1,000	1,866.00	1,866,000
ヤマト	2,800	776.00	2,172,800
太平電業	2,100	2,324.00	4,880,400
高砂熱学工業	7,500	1,978.00	14,835,000
三晃金属工業	700	2,651.00	1,855,700
N E C ネットエスアイ	2,600	3,580.00	9,308,000
朝日工業社	600	3,425.00	2,055,000
明星工業	5,600	988.00	5,532,800
大気社	4,200	4,025.00	16,905,000
ダイダン	2,100	2,829.00	5,940,900
日比谷総合設備	2,800	2,035.00	5,698,000
東芝プラントシステム	6,700	2,667.00	17,868,900
日本製粉	8,100	1,713.00	13,875,300
日清製粉グループ本社	31,300	1,955.00	61,191,500
昭和産業	2,500	3,210.00	8,025,000
鳥越製粉	2,500	902.00	2,255,000
中部飼料	3,400	1,653.00	5,620,200
フィード・ワン	18,600	189.00	3,515,400
東洋精糖	1,500	1,175.00	1,762,500
日本甜菜製糖	1,400	2,010.00	2,814,000
三井製糖	2,400	2,329.00	5,589,600
塩水港精糖	8,100	219.00	1,773,900
日新製糖	1,300	2,015.00	2,619,500
L I F U L L	9,200	563.00	5,179,600
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	2,029.00	3,652,200

日本M&Aセンター	19,900	3,680.00	73,232,000
メンバーズ	800	2,324.00	1,859,200
タケエイ	2,500	1,268.00	3,170,000
トラスト・テック	2,900	1,278.00	3,706,200
コシダカホールディングス	6,400	1,573.00	10,067,200
パソナグループ	3,200	1,616.00	5,171,200
C D S	1,200	1,607.00	1,928,400
リンクアンドモチベーション	5,800	617.00	3,578,600
G C A	3,200	972.00	3,110,400
エス・エム・エス	8,200	3,010.00	24,682,000
サニーサイドアップ	1,800	1,108.00	1,994,400
パーソルホールディングス	26,400	1,969.00	51,981,600
リニカル	1,800	1,113.00	2,003,400
クックパッド	9,200	363.00	3,339,600
アイ・ケイ・ケイ	2,500	719.00	1,797,500
森永製菓	6,600	5,440.00	35,904,000
中村屋	700	4,440.00	3,108,000
江崎グリコ	8,200	5,050.00	41,410,000
名糖産業	1,400	1,324.00	1,853,600
井村屋グループ	1,200	2,007.00	2,408,400
不二家	1,500	2,202.00	3,303,000
山崎製パン	20,800	1,954.00	40,643,200
モロゾフ	500	5,080.00	2,540,000
亀田製菓	1,600	4,950.00	7,920,000
寿スピリッツ	2,700	8,070.00	21,789,000
カルビー	12,600	3,665.00	46,179,000
森永乳業	5,100	4,390.00	22,389,000
六甲バター	1,800	1,791.00	3,223,800
ヤクルト本社	19,100	5,980.00	114,218,000
明治ホールディングス	18,300	7,360.00	134,688,000
雪印メグミルク	6,700	2,515.00	16,850,500
プリマハム	4,300	2,576.00	11,076,800
日本ハム	10,600	4,540.00	48,124,000
林兼産業	2,800	728.00	2,038,400
丸大食品	3,000	2,328.00	6,984,000
S F o o d s	2,200	2,804.00	6,168,800
伊藤ハム米久ホールディングス	17,900	717.00	12,834,300
スタジオアリス	1,300	1,908.00	2,480,400
シミックホールディングス	1,500	1,853.00	2,779,500
システナ	9,700	1,796.00	17,421,200
N J S	1,000	1,848.00	1,848,000
デジタルアーツ	1,300	5,570.00	7,241,000
日鉄ソリューションズ	4,100	3,705.00	15,190,500
総合警備保障	10,500	6,070.00	63,735,000
いちご	34,700	464.00	16,100,800
日本駐車場開発	29,900	159.00	4,754,100
コア	1,300	1,403.00	1,823,900
カカクコム	19,800	2,801.00	55,459,800
セントケア・ホールディング	3,400	478.00	1,625,200
ルネサンス	1,500	1,729.00	2,593,500
ディップ	3,700	3,240.00	11,988,000
S B Sホールディングス	2,400	1,946.00	4,670,400
オプトホールディング	1,400	1,669.00	2,336,600
新日本科学	2,900	637.00	1,847,300
ツクイ	6,200	571.00	3,540,200
ベネフィット・ワン	7,200	2,249.00	16,192,800
エムスリー	58,200	3,195.00	185,949,000
ツカダ・グローバルホールディング	2,900	611.00	1,771,900
アウトソーシング	15,100	1,201.00	18,135,100
ウェルネット	2,500	755.00	1,887,500



ワールドホールディングス	1,000	2,072.00	2,072,000
ディー・エヌ・エー	12,900	1,763.00	22,742,700
博報堂DYホールディングス	36,700	1,752.00	64,298,400
ぐるなび	4,600	1,022.00	4,701,200
タカミヤ	2,800	698.00	1,954,400
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	1,140.00	2,052,000
ファンコミュニケーションズ	7,300	500.00	3,650,000
ライク	1,000	1,594.00	1,594,000
ビジネス・ブレークスルー	4,900	346.00	1,695,400
エスプール	5,100	794.00	4,049,400
WDBホールディングス	1,200	2,550.00	3,060,000
パリュコマース	1,500	2,345.00	3,517,500
インフォマート	14,500	1,941.00	28,144,500
サッポロホールディングス	9,500	2,725.00	25,887,500
アサヒグループホールディングス	58,100	5,129.00	297,994,900
麒麟ホールディングス	117,700	2,488.00	292,837,600
宝ホールディングス	20,800	1,011.00	21,028,800
オエノンホールディングス	7,400	401.00	2,967,400
養命酒製造	900	1,985.00	1,786,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	19,500	2,824.00	55,068,000
サントリー食品インターナショナル	18,600	4,640.00	86,304,000
ダイドグループホールディングス	1,400	4,570.00	6,398,000
伊藤園	8,400	5,550.00	46,620,000
キーコーヒー	2,700	2,306.00	6,226,200
日清オイリオグループ	3,600	3,895.00	14,022,000
不二製油グループ本社	6,800	2,998.00	20,386,400
かどや製油	500	3,780.00	1,890,000
J-オイルミルズ	1,400	4,500.00	6,300,000
ローソン	6,900	6,240.00	43,056,000
サンエー	2,300	4,905.00	11,281,500
カワチ薬品	2,100	2,189.00	4,596,900
エービーシー・マート	4,300	7,520.00	32,336,000
ハードオフコーポレーション	2,200	817.00	1,797,400
高千穂交易	1,600	1,123.00	1,796,800
アスクル	2,800	3,350.00	9,380,000
ゲオホールディングス	4,900	1,388.00	6,801,200
アダストリア	3,800	2,615.00	9,937,000
ジーフット	2,800	622.00	1,741,600
伊藤忠食品	700	5,280.00	3,696,000
くら寿司	1,400	5,010.00	7,014,000
キャンドウ	1,300	1,653.00	2,148,900
エレマテック	2,500	1,184.00	2,960,000
パルグループホールディングス	1,400	3,690.00	5,166,000
JALUX	800	2,499.00	1,999,200
エディオン	12,500	1,228.00	15,350,000
あらた	2,200	4,660.00	10,252,000
サーラコーポレーション	5,500	646.00	3,553,000
トーメンデバイス	700	3,235.00	2,264,500
ハローズ	1,000	2,765.00	2,765,000
JPホールディングス	8,300	330.00	2,739,000
フジオフードシステム	1,100	3,765.00	4,141,500
あみやき亭	600	3,700.00	2,220,000
東京エレクトロン デバイス	1,000	2,623.00	2,623,000
ひらまつ	5,500	293.00	1,611,500
フィールズ	3,500	579.00	2,026,500
双日	150,400	355.00	53,392,000
アルフレッサ ホールディングス	30,300	2,270.00	68,781,000
大黒天物産	700	3,305.00	2,313,500
ハニーズホールディングス	2,400	1,642.00	3,940,800

キッコーマン	20,000	5,370.00	107,400,000
味の素	61,300	1,825.50	111,903,150
キューピー	15,400	2,466.00	37,976,400
ハウス食品グループ本社	10,400	3,790.00	39,416,000
カゴメ	10,500	2,660.00	27,930,000
アリアケジャパン	2,500	7,880.00	19,700,000
ピエトロ	1,100	1,639.00	1,802,900
エバラ食品工業	800	2,211.00	1,768,800
ニチレイ	13,200	2,523.00	33,303,600
横浜冷凍	7,600	1,012.00	7,691,200
東洋水産	14,300	4,700.00	67,210,000
イトアンド	1,000	1,789.00	1,789,000
大冷	900	1,961.00	1,764,900
日清食品ホールディングス	11,800	8,170.00	96,406,000
永谷園ホールディングス	1,400	2,169.00	3,036,600
一正蒲鉾	1,600	1,037.00	1,659,200
フジッコ	3,000	1,958.00	5,874,000
ロック・フィールド	3,000	1,541.00	4,623,000
日本たばこ産業	160,200	2,522.50	404,104,500
ケンコーマヨネーズ	1,600	2,493.00	3,988,800
わらべや日洋ホールディングス	1,800	1,720.00	3,096,000
なとり	1,500	1,709.00	2,563,500
北の達人コーポレーション	9,700	697.00	6,760,900
ユーグレナ	11,800	779.00	9,192,200
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,697.00	2,375,800
片倉工業	3,900	1,375.00	5,362,500
ゲンゼ	2,000	4,935.00	9,870,000
ヒューリック	58,200	1,337.00	77,813,400
ラサ商事	2,000	981.00	1,962,000
アルペン	2,100	1,842.00	3,868,200
クオールホールディングス	4,000	1,545.00	6,180,000
アルコニックス	2,900	1,442.00	4,181,800
神戸物産	9,400	3,710.00	34,874,000
ジinzホールディングス	1,400	7,330.00	10,262,000
ビックカメラ	16,100	1,259.00	20,269,900
D C Mホールディングス	14,700	1,077.00	15,831,900
ペッパーフードサービス	2,200	1,360.00	2,992,000
Monotaro	19,400	2,884.00	55,949,600
東京一番フーズ	2,900	627.00	1,818,300
DDホールディングス	1,200	1,547.00	1,856,400
あいホールディングス	3,900	1,987.00	7,749,300
ディー・ビー・エックス	1,900	874.00	1,660,600
きちりホールディングス	2,100	849.00	1,782,900
アークランドサービスホールディングス	2,000	1,887.00	3,774,000
J・フロントリテイリング	32,500	1,470.00	47,775,000
ドトール・日レスホールディングス	4,300	2,189.00	9,412,700
マツモトキヨシホールディングス	11,300	4,315.00	48,759,500
ブロンコビリー	1,400	2,847.00	3,985,800
ZOZO	26,700	2,139.00	57,111,300
物語コーポレーション	700	8,570.00	5,999,000
ココカラファイン	2,800	6,560.00	18,368,000
三越伊勢丹ホールディングス	47,600	1,002.00	47,695,200
東洋紡	10,700	1,631.00	17,451,700
ユニチカ	7,900	391.00	3,088,900
富士紡ホールディングス	1,300	3,595.00	4,673,500
日清紡ホールディングス	18,400	1,053.00	19,375,200
倉敷紡績	2,800	2,566.00	7,184,800
ダイワボウホールディングス	2,300	6,520.00	14,996,000
シキボウ	1,800	1,013.00	1,823,400
日東紡績	4,100	4,430.00	18,163,000

トヨタ紡織	8,100	1,801.00	14,588,100
マクニカ・富士エレホールディングス	6,500	1,964.00	12,766,000
H a m e e	1,500	1,412.00	2,118,000
ラクト・ジャパン	1,000	3,580.00	3,580,000
ウエルシアホールディングス	8,100	6,850.00	55,485,000
クリエイトSDホールディングス	4,000	2,773.00	11,092,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,100	1,065.00	5,431,500
八洲電機	2,100	912.00	1,915,200
レスターホールディングス	2,800	2,015.00	5,642,000
ジューテックホールディングス	1,600	1,178.00	1,884,800
丸善CHIホールディングス	4,700	376.00	1,767,200
OCHIホールディングス	1,300	1,463.00	1,901,900
TOKAIホールディングス	14,400	1,135.00	16,344,000
ミサワ	1,900	779.00	1,480,100
ティーライフ	2,000	904.00	1,808,000
C o m i n i x	2,200	823.00	1,810,600
三洋貿易	1,400	2,439.00	3,414,600
チムニー	800	2,304.00	1,843,200
シュッピン	1,900	1,176.00	2,234,400
ビューティガレージ	1,100	2,503.00	2,753,300
ウイン・パートナーズ	2,000	1,516.00	3,032,000
ネクステージ	3,900	1,260.00	4,914,000
ジョイフル本田	8,000	1,445.00	11,560,000
鳥貴族	900	2,186.00	1,967,400
キリン堂ホールディングス	1,100	2,095.00	2,304,500
ホットランド	1,800	1,380.00	2,484,000
すかいらくホールディングス	30,500	2,214.00	67,527,000
SFPホールディングス	1,200	2,268.00	2,721,600
綿半ホールディングス	1,000	1,935.00	1,935,000
日本毛織	8,900	1,140.00	10,146,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,900	969.00	7,655,100
三栄建築設計	1,100	1,648.00	1,812,800
野村不動産ホールディングス	16,500	2,691.00	44,401,500
三重交通グループホールディングス	5,500	624.00	3,432,000
サムティ	3,900	2,241.00	8,739,900
ディア・ライフ	3,500	580.00	2,030,000
コーセーアールイー	2,200	819.00	1,801,800
日本商業開発	1,700	1,619.00	2,752,300
プレサンスコーポレーション	4,300	1,214.00	5,220,200
ユニゾホールディングス	4,100	4,900.00	20,090,000
T H E グローバル社	3,700	480.00	1,776,000
日本管理センター	1,800	1,283.00	2,309,400
サンセイランディック	1,900	944.00	1,793,600
エストラスト	2,200	807.00	1,775,400
フージャースホールディングス	5,400	731.00	3,947,400
オープンハウス	7,900	3,165.00	25,003,500
東急不動産ホールディングス	74,100	777.00	57,575,700
飯田グループホールディングス	22,700	1,957.00	44,423,900
イーグランド	2,200	865.00	1,903,000
ムゲンエステート	2,500	808.00	2,020,000
帝国繊維	3,000	2,182.00	6,546,000
日本コークス工業	23,300	80.00	1,864,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,500	689.00	1,722,500
B E E N O S	1,300	1,416.00	1,840,800
あさひ	2,000	1,327.00	2,654,000
日本調剤	800	3,755.00	3,004,000
コスモス薬品	1,200	22,500.00	27,000,000
シップヘルスケアホールディングス	4,400	5,140.00	22,616,000

ソフトクリエイトホールディングス	1,200	1,846.00	2,215,200
オンリー	2,200	808.00	1,777,600
セブン&アイ・ホールディングス	106,500	4,035.00	429,727,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,300	1,826.00	13,329,800
明治電機工業	1,100	1,732.00	1,905,200
ツルハホールディングス	5,900	13,940.00	82,246,000
サンマルクホールディングス	2,200	2,349.00	5,167,800
フェリシモ	1,700	1,040.00	1,768,000
トリドールホールディングス	3,400	2,720.00	9,248,000
帝人	22,100	2,093.00	46,255,300
東レ	196,000	753.70	147,725,200
クラレ	42,600	1,365.00	58,149,000
旭化成	180,600	1,254.00	226,472,400
サカイオーベックス	900	1,907.00	1,716,300
T O K Y O B A S E	2,500	631.00	1,577,500
稲葉製作所	1,500	1,437.00	2,155,500
宮地エンジニアリンググループ	800	2,093.00	1,674,400
トーカロ	7,600	1,140.00	8,664,000
アルファ	1,300	1,303.00	1,693,900
S U M C O	32,700	1,841.00	60,200,700
川田テクノロジーズ	600	6,730.00	4,038,000
R S T e c h n o l o g i e s	800	3,945.00	3,156,000
ハウズドゥ	1,500	1,494.00	2,241,000
アグレ都市デザイン	3,500	551.00	1,928,500
ジェイ・エス・ビー	400	5,100.00	2,040,000
テンポイノベーション	2,200	1,029.00	2,263,800
住江織物	800	2,918.00	2,334,400
日本フェルト	3,600	498.00	1,792,800
イチカワ	1,100	1,535.00	1,688,500
芦森工業	1,100	1,397.00	1,536,700
アツギ	2,200	853.00	1,876,600
ジャパンミート	1,400	2,227.00	3,117,800
コメダホールディングス	5,900	2,093.00	12,348,700
サツドラホールディングス	1,000	1,770.00	1,770,000
パロックジャパンリミテッド	1,900	952.00	1,808,800
クスリのアオキホールディングス	2,700	6,800.00	18,360,000
スシローグローバルホールディングス	3,000	9,020.00	27,060,000
L I X I L ビバ	2,700	2,046.00	5,524,200
セーレン	6,700	1,602.00	10,733,400
ソトー	1,800	974.00	1,753,200
東海染工	1,600	1,134.00	1,814,400
小松マテーレ	4,400	817.00	3,594,800
ワコールホールディングス	7,100	2,948.00	20,930,800
ホギメディカル	3,100	3,685.00	11,423,500
クラウドシアホールディングス	3,600	486.00	1,749,600
T S I ホールディングス	9,100	564.00	5,132,400
マツオカコーポレーション	400	2,498.00	999,200
ワールド	3,800	2,871.00	10,909,800
T I S	9,000	6,600.00	59,400,000
電算システム	1,000	3,045.00	3,045,000
グリー	18,700	501.00	9,368,700
コーエーテクモホールディングス	5,500	2,878.00	15,829,000
三菱総合研究所	1,200	4,175.00	5,010,000
ボルテージ	3,300	717.00	2,366,100
電算	800	2,242.00	1,793,600
A G S	2,300	811.00	1,865,300
ファインデックス	2,300	1,436.00	3,302,800
ブレインパッド	500	5,740.00	2,870,000
K L a b	5,200	844.00	4,388,800

ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,300	959.00	3,164,700
ネクソン	77,200	1,475.00	113,870,000
アイスタイル	7,000	680.00	4,760,000
エムアップ	900	2,542.00	2,287,800
エイチーム	1,900	1,153.00	2,190,700
エニグモ	1,900	942.00	1,789,800
テクノスジャパン	3,600	489.00	1,760,400
コロブラ	8,900	1,288.00	11,463,200
ブロードリーフ	13,400	691.00	9,259,400
クロス・マーケティンググループ	4,700	367.00	1,724,900
デジタルハーツホールディングス	2,000	1,021.00	2,042,000
システム情報	1,800	1,051.00	1,891,800
メディアドゥホールディングス	900	4,105.00	3,694,500
じげん	6,700	537.00	3,597,900
フィックスターズ	2,900	1,513.00	4,387,700
CARTA HOLDINGS	1,400	1,207.00	1,689,800
オブティム	700	3,305.00	2,313,500
セレス	1,500	1,277.00	1,915,500
特種東海製紙	1,700	4,150.00	7,055,000
ティーガイア	2,400	2,702.00	6,484,800
セック	600	3,800.00	2,280,000
豆腐ホールディングス	1,800	1,460.00	2,628,000
テクマトリックス	1,900	2,413.00	4,584,700
プロシップ	1,400	1,467.00	2,053,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,500	2,396.00	15,574,000
GMOペイメントゲートウェイ	4,500	7,400.00	33,300,000
ザッパラス	4,600	419.00	1,927,400
インターネットイニシアティブ	4,000	2,890.00	11,560,000
さくらインターネット	2,900	701.00	2,032,900
GMOクラウド	600	2,603.00	1,561,800
SRAホールディングス	1,400	2,652.00	3,712,800
朝日ネット	2,800	642.00	1,797,600
eBASE	1,600	1,132.00	1,811,200
アバント	2,000	1,025.00	2,050,000
アドソル日進	1,000	2,326.00	2,326,000
フリービット	2,100	964.00	2,024,400
コムチュア	3,000	2,433.00	7,299,000
サイバーコム	900	2,256.00	2,030,400
アステリア	2,700	633.00	1,709,100
王子ホールディングス	113,200	617.00	69,844,400
日本製紙	12,000	1,866.00	22,392,000
三菱製紙	1,900	495.00	940,500
北越コーポレーション	18,000	568.00	10,224,000
中越パルプ工業	1,100	1,665.00	1,831,500
大王製紙	11,900	1,494.00	17,778,600
阿波製紙	4,200	572.00	2,402,400
マークライNZ	1,400	2,024.00	2,833,600
メディカル・データ・ビジョン	2,100	847.00	1,778,700
gumi	3,500	884.00	3,094,000
モバイルファクトリー	1,200	1,361.00	1,633,200
テラスカイ	1,000	2,406.00	2,406,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,200	1,694.00	2,032,800
PCIホールディングス	800	2,147.00	1,717,600
ランドコンピュータ	1,600	1,122.00	1,795,200
ダブルスタンダード	300	4,855.00	1,456,500
オーブンドア	1,300	1,608.00	2,090,400
アカツキ	1,000	5,820.00	5,820,000

LINE	6,200	5,260.00	32,612,000
レンゴー	25,600	835.00	21,376,000
トーモク	1,700	1,884.00	3,202,800
ザ・パック	2,000	4,210.00	8,420,000
チェンジ	900	2,642.00	2,377,800
シンクロ・フード	3,400	555.00	1,887,000
オークネット	1,700	1,380.00	2,346,000
AOI TYO HOLDINGS	2,700	721.00	1,946,700
マクロミル	4,800	1,016.00	4,876,800
ビーグリー	1,800	1,307.00	2,352,600
オロ	700	3,735.00	2,614,500
昭和電工	19,300	2,975.00	57,417,500
住友化学	198,900	505.00	100,444,500
住友精化	1,200	3,580.00	4,296,000
日産化学	15,100	4,770.00	72,027,000
クレハ	2,300	6,700.00	15,410,000
多木化学	800	4,595.00	3,676,000
テイカ	2,000	2,037.00	4,074,000
石原産業	4,900	1,075.00	5,267,500
片倉コープアグリ	1,500	1,200.00	1,800,000
日本曹達	4,000	2,999.00	11,996,000
東ソー	41,800	1,712.00	71,561,600
トクヤマ	7,800	2,962.00	23,103,600
セントラル硝子	5,500	2,719.00	14,954,500
東亜合成	17,000	1,318.00	22,406,000
大阪ソーダ	2,800	3,180.00	8,904,000
関東電化工業	6,400	1,010.00	6,464,000
デンカ	9,900	3,315.00	32,818,500
イビデン	16,900	2,659.00	44,937,100
信越化学工業	47,700	12,025.00	573,592,500
日本カーバイド工業	1,200	1,485.00	1,782,000
堺化学工業	1,800	2,594.00	4,669,200
第一稀元素化学工業	2,900	893.00	2,589,700
エア・ウォーター	22,200	1,616.00	35,875,200
大陽日酸	26,000	2,436.00	63,336,000
日本化学工業	800	3,495.00	2,796,000
日本パーカライジング	13,700	1,208.00	16,549,600
高压ガス工業	4,300	881.00	3,788,300
四国化成工業	4,200	1,350.00	5,670,000
戸田工業	800	2,182.00	1,745,600
ステラ ケミファ	1,500	3,325.00	4,987,500
保土谷化学工業	1,000	4,180.00	4,180,000
日本触媒	4,200	6,820.00	28,644,000
大日精化工業	2,400	3,270.00	7,848,000
カネカ	7,000	3,635.00	25,445,000
協和キリン	27,800	2,475.00	68,805,000
三菱瓦斯化学	25,600	1,691.00	43,289,600
三井化学	24,600	2,696.00	66,321,600
JSR	25,200	2,069.00	52,138,800
東京応化工業	4,600	4,355.00	20,033,000
大阪有機化学工業	2,500	1,498.00	3,745,000
三菱ケミカルホールディングス	181,000	826.50	149,596,500
KHネオケム	4,800	2,402.00	11,529,600
ダイセル	37,000	1,053.00	38,961,000
住友ベークライト	4,300	4,235.00	18,210,500
積水化学工業	58,200	1,924.00	111,976,800
日本ゼオン	24,400	1,370.00	33,428,000
アイカ工業	8,100	3,605.00	29,200,500
宇部興産	13,700	2,432.00	33,318,400
積水樹脂	4,900	2,308.00	11,309,200

タキロンシーアイ	5,900	731.00	4,312,900
旭有機材	1,500	1,749.00	2,623,500
日立化成	12,500	4,570.00	57,125,000
ニチバン	1,400	1,938.00	2,713,200
リケンテクノス	6,800	518.00	3,522,400
大倉工業	1,300	2,017.00	2,622,100
積水化成成品工業	3,600	836.00	3,009,600
群栄化学工業	700	2,642.00	1,849,400
タイガースポリマー	3,000	620.00	1,860,000
ダイキョーニシカワ	5,700	876.00	4,993,200
竹本容器	1,800	996.00	1,792,800
森六ホールディングス	1,500	2,399.00	3,598,500
日本化薬	16,800	1,366.00	22,948,800
カーリットホールディングス	2,900	649.00	1,882,100
E P Sホールディングス	4,000	1,431.00	5,724,000
プレステージ・インターナショナル	9,900	1,008.00	9,979,200
プロトコーポレーション	2,400	1,193.00	2,863,200
アミューズ	1,400	3,005.00	4,207,000
野村総合研究所	45,300	2,417.00	109,490,100
クイック	1,600	1,681.00	2,689,600
T A C	7,800	231.00	1,801,800
C Eホールディングス	3,800	465.00	1,767,000
ケネディクス	25,100	579.00	14,532,900
電通	27,200	3,720.00	101,184,000
インテージホールディングス	3,400	924.00	3,141,600
東邦システムサイエンス	1,900	932.00	1,770,800
ぴあ	800	4,810.00	3,848,000
イオンファンタジー	1,000	2,919.00	2,919,000
ソースネクスト	12,900	450.00	5,805,000
シーティーエス	3,000	804.00	2,412,000
ネクシィーズグループ	900	1,826.00	1,643,400
インフォコム	3,000	2,540.00	7,620,000
メディカルシステムネットワーク	3,100	532.00	1,649,200
日本精化	2,200	1,286.00	2,829,200
扶桑化学工業	2,700	3,130.00	8,451,000
トリケミカル研究所	700	8,590.00	6,013,000
ラクスル	1,400	3,550.00	4,970,000
F I G	5,500	312.00	1,716,000
A D E K A	12,500	1,669.00	20,862,500
日油	10,200	3,685.00	37,587,000
ミヨシ油脂	1,400	1,315.00	1,841,000
新日本理化	8,600	208.00	1,788,800
ハリマ化成グループ	2,200	1,199.00	2,637,800
アルテリア・ネットワークス	3,000	1,696.00	5,088,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,100	1,501.00	1,651,100
花王	66,200	9,078.00	600,963,600
第一工業製薬	1,000	4,595.00	4,595,000
日華化学	1,900	938.00	1,782,200
ニイタカ	1,000	1,805.00	1,805,000
三洋化成工業	1,600	5,450.00	8,720,000
武田薬品工業	230,000	4,405.00	1,013,150,000
アステラス製薬	243,200	1,857.50	451,744,000
大日本住友製薬	20,500	2,109.00	43,234,500
塩野義製薬	35,300	6,901.00	243,605,300
田辺三菱製薬	33,700	2,006.00	67,602,200
わかもと製薬	6,400	273.00	1,747,200
あすか製薬	3,200	1,291.00	4,131,200
日本新薬	7,200	9,330.00	67,176,000
ビオフェルミン製薬	800	2,410.00	1,928,000

中外製薬	28,800	9,960.00	286,848,000
科研製薬	4,700	6,100.00	28,670,000
エーザイ	33,100	8,155.00	269,930,500
理研ビタミン	1,300	4,095.00	5,323,500
ロート製薬	14,200	3,345.00	47,499,000
小野薬品工業	65,300	2,456.50	160,409,450
久光製薬	8,200	5,510.00	45,182,000
有機合成薬品工業	6,200	303.00	1,878,600
持田製薬	3,800	4,600.00	17,480,000
参天製薬	51,500	2,050.00	105,575,000
扶桑薬品工業	1,000	2,113.00	2,113,000
ツムラ	8,600	3,230.00	27,778,000
日医工	7,800	1,375.00	10,725,000
テルモ	78,200	3,922.00	306,700,400
みらかホールディングス	7,400	2,656.00	19,654,400
キッセイ薬品工業	4,900	3,145.00	15,410,500
生化学工業	5,400	1,245.00	6,723,000
栄研化学	4,900	2,055.00	10,069,500
日水製薬	1,400	1,300.00	1,820,000
鳥居薬品	1,700	3,020.00	5,134,000
JCRファーマ	1,900	8,620.00	16,378,000
東和薬品	3,500	2,912.00	10,192,000
富士製薬工業	1,900	1,346.00	2,557,400
沢井製薬	5,700	6,900.00	39,330,000
ゼリア新薬工業	5,000	2,078.00	10,390,000
第一三共	79,100	7,044.00	557,180,400
キョーリン製薬ホールディングス	6,100	1,919.00	11,705,900
大幸薬品	1,100	3,280.00	3,608,000
ダイト	1,600	3,235.00	5,176,000
大塚ホールディングス	52,700	4,969.00	261,866,300
大正製薬ホールディングス	5,800	8,320.00	48,256,000
ペプチドリーム	14,000	5,450.00	76,300,000
大日本塗料	3,100	1,198.00	3,713,800
日本ペイントホールディングス	22,300	5,600.00	124,880,000
関西ペイント	30,400	2,638.00	80,195,200
中国塗料	7,700	1,046.00	8,054,200
日本特殊塗料	2,000	1,628.00	3,256,000
藤倉化成	3,700	588.00	2,175,600
太陽ホールディングス	2,000	4,380.00	8,760,000
DIC	11,400	3,065.00	34,941,000
サカタインクス	5,900	1,200.00	7,080,000
東洋インキSCホールディングス	5,700	2,685.00	15,304,500
T&K TOKA	2,100	1,042.00	2,188,200
アルプス技研	2,300	2,055.00	4,726,500
サニックス	4,600	354.00	1,628,400
日本空調サービス	2,800	864.00	2,419,200
オリエンタルランド	28,100	14,875.00	417,987,500
フォーカスシステムズ	2,000	895.00	1,790,000
ダスキン	6,800	3,070.00	20,876,000
パーク24	14,600	2,650.00	38,690,000
明光ネットワークジャパン	3,100	1,023.00	3,171,300
ファルコホールディングス	1,500	1,851.00	2,776,500
クレスコ	800	3,580.00	2,864,000
フジ・メディア・ホールディングス	26,100	1,551.00	40,481,100
秀英予備校	4,000	458.00	1,832,000
ラウンドワン	7,400	1,082.00	8,006,800
リゾートトラスト	12,100	1,860.00	22,506,000
オービック	9,400	14,610.00	137,334,000
ジャストシステム	4,400	6,160.00	27,104,000
TDCCソフト	2,400	967.00	2,320,800



Zホールディングス	372,500	434.00	161,665,000
ビー・エム・エル	3,400	3,130.00	10,642,000
トレンドマイクロ	12,100	5,770.00	69,817,000
りらいあコミュニケーションズ	4,800	1,410.00	6,768,000
IDホールディングス	1,300	1,509.00	1,961,700
リソー教育	12,100	382.00	4,622,200
日本オラクル	5,500	10,130.00	55,715,000
アルファシステムズ	800	2,878.00	2,302,400
フューチャー	3,300	1,844.00	6,085,200
CAC Holdings	1,800	1,656.00	2,980,800
SBテクノロジー	1,000	1,945.00	1,945,000
トーセ	2,000	906.00	1,812,000
ユー・エス・エス	29,600	2,059.00	60,946,400
オービックビジネスコンサルタント	2,800	5,090.00	14,252,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,400	3,090.00	38,316,000
アイティフォー	3,300	875.00	2,887,500
東計電算	500	3,685.00	1,842,500
サイバーエージェント	15,200	3,840.00	58,368,000
楽天	123,100	963.00	118,545,300
エクスネット	1,800	972.00	1,749,600
クリーク・アンド・リバー社	1,600	1,118.00	1,788,800
テー・オー・ダブリュー	2,300	909.00	2,090,700
大塚商会	14,700	4,560.00	67,032,000
サイボウズ	3,200	1,221.00	3,907,200
山田コンサルティンググループ	1,300	1,655.00	2,151,500
セントラルスポーツ	1,000	3,270.00	3,270,000
電通国際情報サービス	1,700	4,280.00	7,276,000
デジタルガレージ	4,900	4,490.00	22,001,000
イーエムシステムズ	1,900	2,043.00	3,881,700
ウェザーニューズ	900	3,470.00	3,123,000
C I J	2,000	971.00	1,942,000
ビジネスエンジニアリング	600	3,180.00	1,908,000
日本エンタープライズ	7,700	236.00	1,817,200
WOWOW	1,300	2,825.00	3,672,500
スカラ	2,100	787.00	1,652,700
フルキャストホールディングス	2,600	2,373.00	6,169,800
エン・ジャパン	4,700	5,020.00	23,594,000
富士フイルムホールディングス	53,000	5,295.00	280,635,000
コニカミノルタ	60,400	712.00	43,004,800
資生堂	54,900	7,814.00	428,988,600
ライオン	35,900	2,139.00	76,790,100
高砂香料工業	1,700	2,581.00	4,387,700
マンダム	6,200	3,020.00	18,724,000
ミルボン	3,700	6,220.00	23,014,000
ファンケル	11,200	2,986.00	33,443,200
コーセー	5,200	16,100.00	83,720,000
コタ	1,400	1,521.00	2,129,400
シーボン	700	2,509.00	1,756,300
ポーラ・オルビスホールディングス	11,800	2,684.00	31,671,200
ノエビアホールディングス	2,600	5,900.00	15,340,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	950.00	1,805,000
エステー	1,800	1,736.00	3,124,800
アグロ カネショウ	1,100	1,558.00	1,713,800
コニシ	4,500	1,529.00	6,880,500
長谷川香料	3,700	2,044.00	7,562,800
星光PMC	2,000	1,007.00	2,014,000
小林製薬	7,700	9,360.00	72,072,000
荒川化学工業	2,500	1,648.00	4,120,000
メック	1,900	1,602.00	3,043,800
日本高純度化学	800	2,657.00	2,125,600

タカラバイオ	7,200	2,093.00	15,069,600
JCU	3,300	3,270.00	10,791,000
新田ゼラチン	2,500	690.00	1,725,000
デクセリアルズ	7,100	1,069.00	7,589,900
アース製薬	2,100	5,810.00	12,201,000
北興化学工業	2,800	594.00	1,663,200
大成ラミック	900	2,964.00	2,667,600
クミアイ化学工業	11,400	993.00	11,320,200
日本農薬	4,900	580.00	2,842,000
富士興産	2,400	696.00	1,670,400
ニチレキ	3,300	1,350.00	4,455,000
ユシロ化学工業	1,600	1,466.00	2,345,600
ピーピー・カストロール	1,200	1,597.00	1,916,400
富士石油	7,300	247.00	1,803,100
MORESCO	700	1,412.00	988,400
出光興産	31,100	3,045.00	94,699,500
JXTGホールディングス	428,700	503.70	215,936,190
コスモエネルギーホールディングス	8,000	2,567.00	20,536,000
横浜ゴム	16,000	2,230.00	35,680,000
TOYO TIRE	15,900	1,636.00	26,012,400
ブリヂストン	85,000	4,225.00	359,125,000
住友ゴム工業	24,900	1,401.00	34,884,900
オカモト	1,700	4,130.00	7,021,000
アキレス	1,900	1,836.00	3,488,400
フコク	2,400	730.00	1,752,000
ニッタ	3,100	3,380.00	10,478,000
クリエートメディック	1,700	1,107.00	1,881,900
住友理工	5,400	1,038.00	5,605,200
三ツ星ベルト	3,600	2,153.00	7,750,800
バンドー化学	4,900	926.00	4,537,400
AGC	27,300	3,990.00	108,927,000
日本板硝子	13,200	748.00	9,873,600
石塚硝子	800	2,521.00	2,016,800
有沢製作所	4,400	1,005.00	4,422,000
日本山村硝子	1,300	1,368.00	1,778,400
日本電気硝子	11,100	2,511.00	27,872,100
オハラ	1,200	1,432.00	1,718,400
住友大阪セメント	5,200	4,915.00	25,558,000
太平洋セメント	17,500	3,360.00	58,800,000
リソルホールディングス	400	4,085.00	1,634,000
日本ヒューム	2,800	878.00	2,458,400
日本コンクリート工業	6,000	284.00	1,704,000
三谷セキサン	1,300	3,575.00	4,647,500
アジアパイルホールディングス	3,900	608.00	2,371,200
東海カーボン	29,000	1,125.00	32,625,000
日本カーボン	1,400	4,380.00	6,132,000
東洋炭素	1,600	2,345.00	3,752,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,500	4,725.00	7,087,500
TOTO	19,700	4,660.00	91,802,000
日本碍子	33,700	1,912.00	64,434,400
日本特殊陶業	21,500	2,190.00	47,085,000
MARUWA	1,100	8,340.00	9,174,000
品川リフラクトリーズ	700	3,565.00	2,495,500
黒崎播磨	500	6,600.00	3,300,000
ヨータイ	2,500	759.00	1,897,500
イソライト工業	1,800	688.00	1,238,400
ニッカトー	2,200	823.00	1,810,600
フジミインコーポレーテッド	2,500	2,958.00	7,395,000
クニミネ工業	1,500	1,419.00	2,128,500
ニチアス	7,600	2,768.00	21,036,800

日本製鉄	122,300	1,696.00	207,420,800
神戸製鋼所	50,000	594.00	29,700,000
中山製鋼所	3,800	559.00	2,124,200
合同製鐵	1,500	2,799.00	4,198,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	73,800	1,445.00	106,641,000
東京製鐵	13,300	799.00	10,626,700
共英製鋼	3,100	2,166.00	6,714,600
大和工業	5,800	2,721.00	15,781,800
東京鐵鋼	1,100	1,580.00	1,738,000
大阪製鐵	1,500	1,392.00	2,088,000
淀川製鋼所	3,700	2,095.00	7,751,500
丸一鋼管	8,900	3,115.00	27,723,500
モリ工業	800	2,536.00	2,028,800
大同特殊鋼	4,500	4,865.00	21,892,500
日本高周波鋼業	4,000	432.00	1,728,000
日本冶金工業	2,300	2,353.00	5,411,900
山陽特殊製鋼	2,000	1,591.00	3,182,000
愛知製鋼	1,500	3,885.00	5,827,500
日立金属	29,400	1,604.00	47,157,600
日本金属	1,700	943.00	1,603,100
大平洋金属	1,800	2,599.00	4,678,200
新日本電工	17,600	179.00	3,150,400
栗本鐵工所	1,400	2,159.00	3,022,600
日本製鋼所	8,300	2,166.00	17,977,800
三菱製鋼	2,000	1,104.00	2,208,000
日垂鋼業	3,600	346.00	1,245,600
日本精線	600	3,250.00	1,950,000
大紀アルミニウム工業所	4,500	775.00	3,487,500
日本輕金属ホールディングス	69,200	234.00	16,192,800
三井金属鋁業	7,400	2,838.00	21,001,200
東邦亜鉛	1,400	2,103.00	2,944,200
三菱マテリアル	18,100	3,050.00	55,205,000
住友金属鋁山	34,900	3,546.00	123,755,400
DOWAホールディングス	6,900	4,170.00	28,773,000
古河機械金属	4,900	1,468.00	7,193,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	1,536.00	4,300,800
東邦チタニウム	4,900	929.00	4,552,100
UACJ	4,100	2,561.00	10,500,100
古河電気工業	8,500	2,863.00	24,335,500
住友電気工業	102,200	1,663.00	169,958,600
フジクラ	33,000	465.00	15,345,000
昭和電線ホールディングス	3,200	1,408.00	4,505,600
東京特殊電線	800	2,275.00	1,820,000
タツタ電線	5,500	608.00	3,344,000
カナレ電気	900	1,887.00	1,698,300
平河ヒューテック	1,400	1,564.00	2,189,600
リョービ	3,400	2,104.00	7,153,600
アーレスティ	3,600	568.00	2,044,800
アサヒホールディングス	4,800	2,662.00	12,777,600
東洋製罐グループホールディングス	17,400	1,909.00	33,216,600
ホッカンホールディングス	1,500	2,045.00	3,067,500
コロナ	1,500	1,101.00	1,651,500
横河ブリッジホールディングス	5,100	1,998.00	10,189,800
OSJBホールディングス	13,700	270.00	3,699,000
三和ホールディングス	26,200	1,237.00	32,409,400
文化シャッター	8,100	983.00	7,962,300
三協立山	3,800	1,279.00	4,860,200
アルインコ	2,000	1,291.00	2,582,000
LIXILグループ	40,300	1,971.00	79,431,300
日本フィルコン	3,300	516.00	1,702,800

ノーリツ	5,700	1,507.00	8,589,900
長府製作所	2,800	2,482.00	6,949,600
リンナイ	5,300	8,690.00	46,057,000
ユニプレス	5,400	1,595.00	8,613,000
ダイニチ工業	2,600	694.00	1,804,400
日東精工	3,800	646.00	2,454,800
三洋工業	900	2,025.00	1,822,500
岡部	5,500	969.00	5,329,500
ジーテクト	3,400	1,882.00	6,398,800
東プレ	5,100	1,809.00	9,225,900
高周波熱錬	5,300	904.00	4,791,200
東京製綱	2,000	1,324.00	2,648,000
サンコール	3,500	583.00	2,040,500
モリテックスチール	3,900	410.00	1,599,000
パイオラックス	4,000	2,205.00	8,820,000
エイチワン	2,700	846.00	2,284,200
日本発条	29,300	1,030.00	30,179,000
三浦工業	11,800	3,765.00	44,427,000
タクマ	9,300	1,317.00	12,248,100
テクノプロ・ホールディングス	5,300	7,890.00	41,817,000
インターワークス	3,500	528.00	1,848,000
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	4,955.00	5,450,500
Keeper 技研	1,200	1,345.00	1,614,000
三機サービス	1,800	1,099.00	1,978,200
Gunosy	1,800	1,568.00	2,822,400
イー・ガーディアン	1,300	2,002.00	2,602,600
リブセンス	4,800	304.00	1,459,200
ジャパンマテリアル	8,100	1,749.00	14,166,900
ベクトル	3,300	1,052.00	3,471,600
ウチヤマホールディングス	3,300	548.00	1,808,400
チャーム・ケア・コーポレーション	800	1,930.00	1,544,000
キャリアリンク	3,100	612.00	1,897,200
IBJ	1,800	1,159.00	2,086,200
アサンテ	1,100	2,029.00	2,231,900
N・フィールド	2,700	669.00	1,806,300
バリューHR	500	3,550.00	1,775,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	4,115.00	7,407,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,300	2,047.00	2,661,100
ERIホールディングス	2,200	780.00	1,716,000
アピスト	700	2,634.00	1,843,800
シグマクス	1,800	2,296.00	4,132,800
ウィルグループ	1,700	1,195.00	2,031,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,800	227.00	1,770,600
リクルートホールディングス	189,200	4,049.00	766,070,800
エラン	1,600	1,616.00	2,585,600
ツガミ	5,700	1,109.00	6,321,300
オークマ	3,200	5,930.00	18,976,000
東芝機械	3,100	2,932.00	9,089,200
アマダホールディングス	34,800	1,278.00	44,474,400
アイダエンジニアリング	7,400	1,013.00	7,496,200
滝澤鉄工所	1,300	1,408.00	1,830,400
FUJI	11,800	1,998.00	23,576,400
牧野フライス製作所	3,200	5,040.00	16,128,000
オーエスジー	12,600	2,154.00	27,140,400
ダイジェット工業	1,100	1,499.00	1,648,900
旭ダイヤモンド工業	7,200	657.00	4,730,400
DMG森精機	17,300	1,725.00	29,842,500
ソディック	6,400	1,001.00	6,406,400
ディスコ	3,700	26,240.00	97,088,000

日東工器	1,500	2,415.00	3,622,500
日進工具	800	2,664.00	2,131,200
パンチ工業	3,200	559.00	1,788,800
日本郵政	216,500	1,039.00	224,943,500
ベルシステム24ホールディングス	4,400	1,678.00	7,383,200
鎌倉新書	2,000	1,698.00	3,396,000
一蔵	2,500	755.00	1,887,500
LITALICO	900	2,288.00	2,059,200
エボラブルアジア	1,200	2,100.00	2,520,000
アトラエ	700	3,685.00	2,579,500
ストライク	1,000	4,465.00	4,465,000
ソラスト	7,300	1,243.00	9,073,900
セラク	2,400	816.00	1,958,400
インソース	1,300	3,440.00	4,472,000
豊田自動織機	22,400	6,560.00	146,944,000
豊和工業	2,400	857.00	2,056,800
OKK	2,300	675.00	1,552,500
東洋機械金属	3,000	562.00	1,686,000
島精機製作所	4,400	2,714.00	11,941,600
オプトラン	3,000	3,035.00	9,105,000
NCホールディングス	3,600	686.00	2,469,600
イワキ	1,700	1,191.00	2,024,700
フリー	2,700	1,064.00	2,872,800
ヤマシンフィルタ	5,900	872.00	5,144,800
日阪製作所	3,400	1,032.00	3,508,800
やまびこ	5,300	1,231.00	6,524,300
平田機工	1,300	7,240.00	9,412,000
ペガサスミシン製造	3,400	509.00	1,730,600
ナブテスコ	16,100	3,355.00	54,015,500
三井海洋開発	2,900	2,701.00	7,832,900
レオン自動機	2,700	1,600.00	4,320,000
SMC	8,700	50,700.00	441,090,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	3,100	637.00	1,974,700
ホソカワミクロン	1,000	4,655.00	4,655,000
ユニオンツール	1,000	3,200.00	3,200,000
オイレス工業	3,500	1,675.00	5,862,500
日精エー・エス・ピー機械	900	4,720.00	4,248,000
サトーホールディングス	3,900	3,435.00	13,396,500
技研製作所	2,400	4,920.00	11,808,000
日本エアテック	2,500	741.00	1,852,500
カワタ	1,100	1,183.00	1,301,300
日精樹脂工業	2,300	1,028.00	2,364,400
オカダアイヨン	1,300	1,319.00	1,714,700
小松製作所	125,200	2,652.00	332,030,400
住友重機械工業	15,800	3,160.00	49,928,000
日立建機	11,100	3,315.00	36,796,500
日工	3,800	886.00	3,366,800
巴工業	1,200	2,320.00	2,784,000
井関農機	2,800	1,685.00	4,718,000
TOWA	2,800	1,184.00	3,315,200
丸山製作所	1,400	1,245.00	1,743,000
北川鉄工所	1,200	2,441.00	2,929,200
シンニッタン	4,200	432.00	1,814,400
ローツェ	1,200	4,290.00	5,148,000
タカキタ	3,100	631.00	1,956,100
クボタ	146,700	1,738.50	255,037,950
荏原実業	800	2,267.00	1,813,600
東洋エンジニアリング	3,600	735.00	2,646,000
三菱化工機	1,000	1,948.00	1,948,000

月島機械	5,100	1,662.00	8,476,200
帝国電機製作所	2,300	1,426.00	3,279,800
新東工業	6,600	1,056.00	6,969,600
澁谷工業	2,400	3,190.00	7,656,000
アイチコーポレーション	4,800	750.00	3,600,000
小森コーポレーション	7,000	1,136.00	7,952,000
鶴見製作所	2,100	2,100.00	4,410,000
荏原製作所	12,300	3,355.00	41,266,500
西島製作所	2,800	921.00	2,578,800
北越工業	2,800	1,351.00	3,782,800
ダイキン工業	35,200	15,470.00	544,544,000
オルガノ	1,000	6,590.00	6,590,000
トーヨーカネツ	1,200	2,422.00	2,906,400
栗田工業	15,000	3,230.00	48,450,000
椿本チエイン	3,900	3,965.00	15,463,500
日機装	7,100	1,452.00	10,309,200
木村化工機	100	710.00	71,000
レイズネクスト	4,600	1,354.00	6,228,400
アネスト岩田	4,300	1,069.00	4,596,700
ダイフク	14,100	6,480.00	91,368,000
サムコ	1,600	1,427.00	2,283,200
加藤製作所	1,500	1,768.00	2,652,000
油研工業	1,100	1,770.00	1,947,000
タダノ	13,300	994.00	13,220,200
フジテック	10,000	1,754.00	17,540,000
C K D	7,700	1,831.00	14,098,700
キトー	2,100	1,722.00	3,616,200
平和	7,700	2,238.00	17,232,600
理想科学工業	2,400	1,916.00	4,598,400
S A N K Y O	6,200	3,575.00	22,165,000
日本金銭機械	3,100	920.00	2,852,000
マースグループホールディングス	1,800	2,075.00	3,735,000
フクシマガリレイ	1,700	4,130.00	7,021,000
ダイコク電機	1,300	1,716.00	2,230,800
竹内製作所	4,600	1,694.00	7,792,400
アマノ	7,200	3,375.00	24,300,000
J U K I	3,800	896.00	3,404,800
サンデンホールディングス	3,600	915.00	3,294,000
蛇の目ミシン工業	4,300	415.00	1,784,500
ブラザー工業	33,800	2,270.00	76,726,000
マックス	4,200	2,136.00	8,971,200
モリタホールディングス	4,800	1,784.00	8,563,200
グローリー	7,700	3,370.00	25,949,000
新晃工業	2,600	1,999.00	5,197,400
大和冷機工業	4,000	1,240.00	4,960,000
セガサミーホールディングス	27,400	1,607.00	44,031,800
日本ピストンリング	1,300	1,565.00	2,034,500
リケン	1,300	4,225.00	5,492,500
T P R	3,700	2,183.00	8,077,100
ツバキ・ナカシマ	5,600	1,659.00	9,290,400
ホシザキ	8,100	10,010.00	81,081,000
大豊工業	2,300	896.00	2,060,800
日本精工	52,000	1,063.00	55,276,000
N T N	64,000	350.00	22,400,000
ジェイテクト	26,500	1,342.00	35,563,000
不二越	2,600	4,880.00	12,688,000
ミネベアミツミ	51,300	2,315.00	118,759,500
日本トムソン	8,200	505.00	4,141,000
T H K	16,100	2,988.00	48,106,800
ユーシン精機	2,100	1,025.00	2,152,500

前澤給装工業	1,000	2,201.00	2,201,000
イーグル工業	3,400	1,142.00	3,882,800
日本ピラー工業	2,800	1,554.00	4,351,200
キット	11,200	772.00	8,646,400
日立製作所	132,800	4,676.00	620,972,800
三菱電機	276,400	1,527.00	422,062,800
富士電機	16,700	3,385.00	56,529,500
東洋電機製造	1,100	1,579.00	1,736,900
安川電機	29,800	4,175.00	124,415,000
シンフォニア テクノロジー	3,600	1,391.00	5,007,600
明電舎	5,100	2,338.00	11,923,800
オリジン	1,100	1,508.00	1,658,800
山洋電気	1,300	5,550.00	7,215,000
デンヨー	2,400	2,098.00	5,035,200
ベイカレント・コンサルティング	1,600	5,470.00	8,752,000
MS - J a p a n	1,300	1,558.00	2,025,400
グレイステクノロジー	1,200	2,697.00	3,236,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,800	2,773.00	7,764,400
フルテック	1,300	1,419.00	1,844,700
日総工産	1,700	1,045.00	1,776,500
キュービーネットホールディングス	1,600	2,449.00	3,918,400
R P Aホールディングス	1,500	1,147.00	1,720,500
三櫻工業	3,500	1,352.00	4,732,000
マキタ	36,000	3,760.00	135,360,000
東芝テック	3,500	4,610.00	16,135,000
芝浦メカトロニクス	500	3,840.00	1,920,000
マブチモーター	7,600	4,290.00	32,604,000
日本電産	33,300	15,210.00	506,493,000
トレックス・セミコンダクター	1,600	1,696.00	2,713,600
東光高岳	1,500	1,179.00	1,768,500
ダブル・スコープ	4,000	1,041.00	4,164,000
ダイヘン	3,000	3,630.00	10,890,000
ヤーマン	4,000	761.00	3,044,000
J V Cケンウッド	22,500	265.00	5,962,500
ミマキエンジニアリング	3,000	520.00	1,560,000
第一精工	1,000	2,530.00	2,530,000
日新電機	6,500	1,368.00	8,892,000
大崎電気工業	5,500	716.00	3,938,000
オムロン	25,700	6,530.00	167,821,000
日東工業	4,100	2,597.00	10,647,700
I D E C	4,000	2,247.00	8,988,000
不二電機工業	1,400	1,299.00	1,818,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,200	2,409.00	22,162,800
サクサホールディングス	900	1,958.00	1,762,200
メルコホールディングス	1,000	3,145.00	3,145,000
日本電気	33,500	4,495.00	150,582,500
富士通	26,600	10,410.00	276,906,000
沖電気工業	11,200	1,548.00	17,337,600
電気興業	1,300	3,445.00	4,478,500
サンケン電気	3,000	3,420.00	10,260,000
アイホン	1,600	1,867.00	2,987,200
ルネサスエレクトロニクス	131,800	766.00	100,958,800
セイコーエプソン	34,300	1,707.00	58,550,100
ワコム	18,600	474.00	8,816,400
アルバック	5,500	4,320.00	23,760,000
E I Z O	2,100	3,985.00	8,368,500
ジャパンディスプレイ	79,900	77.00	6,152,300
日本信号	7,000	1,438.00	10,066,000
京三製作所	6,500	615.00	3,997,500

能美防災	3,700	2,430.00	8,991,000
ホーチキ	2,000	1,806.00	3,612,000
エレコム	3,000	4,315.00	12,945,000
パナソニック	315,800	1,016.50	321,010,700
シャープ	32,000	1,716.00	54,912,000
アンリツ	17,800	2,122.00	37,771,600
富士通ゼネラル	7,500	2,431.00	18,232,500
ソニー	174,700	7,326.00	1,279,852,200
T D K	13,300	12,380.00	164,654,000
帝国通信工業	1,500	1,221.00	1,831,500
タムラ製作所	9,200	711.00	6,541,200
アルプスアルパイン	24,500	2,522.00	61,789,000
池上通信機	1,600	1,066.00	1,705,600
日本電波工業	3,800	534.00	2,029,200
鈴木	2,200	809.00	1,779,800
日本トリム	400	4,585.00	1,834,000
ローランド ディー・ジー	1,500	2,266.00	3,399,000
フォスター電機	2,900	2,051.00	5,947,900
S M K	700	3,055.00	2,138,500
ヨコオ	1,800	3,300.00	5,940,000
ホシデン	7,600	1,420.00	10,792,000
ヒロセ電機	4,300	13,910.00	59,813,000
日本航空電子工業	6,300	2,291.00	14,433,300
T O A	3,000	1,138.00	3,414,000
マクセルホールディングス	6,000	1,510.00	9,060,000
古野電気	3,600	1,374.00	4,946,400
ユニデンホールディングス	900	1,897.00	1,707,300
スミダコーポレーション	2,100	1,312.00	2,755,200
アイコム	1,500	2,740.00	4,110,000
リオン	1,200	3,165.00	3,798,000
船井電機	2,800	687.00	1,923,600
横河電機	25,400	1,952.00	49,580,800
新電元工業	1,000	3,945.00	3,945,000
アズビル	17,400	3,185.00	55,419,000
東亜ディーケーケー	2,000	1,068.00	2,136,000
日本光電工業	11,400	2,969.00	33,846,600
共和電業	4,100	450.00	1,845,000
日本電子材料	2,400	856.00	2,054,400
堀場製作所	5,500	7,520.00	41,360,000
アドバンテスト	20,600	6,150.00	126,690,000
小野測器	3,400	558.00	1,897,200
エスベック	2,400	2,244.00	5,385,600
キーエンス	25,000	38,740.00	968,500,000
日置電機	1,400	3,965.00	5,551,000
シスメックス	19,700	7,496.00	147,671,200
日本マイクロニクス	4,800	1,213.00	5,822,400
メガチップス	2,600	1,934.00	5,028,400
O B A R A G R O U P	1,400	3,815.00	5,341,000
I M A G I C A G R O U P	2,700	599.00	1,617,300
澤藤電機	1,000	2,156.00	2,156,000
デンソー	60,900	5,074.00	309,006,600
原田工業	1,900	1,021.00	1,939,900
コーセル	3,400	1,256.00	4,270,400
イリソ電子工業	2,300	5,000.00	11,500,000
オブテックグループ	4,500	1,595.00	7,177,500
千代田インテグレ	1,300	2,466.00	3,205,800
アイ・オー・データ機器	1,900	1,064.00	2,021,600
レーザーテック	5,700	10,830.00	61,731,000
スタンレー電気	19,500	3,200.00	62,400,000
岩崎電気	1,200	1,522.00	1,826,400



ウシオ電機	16,100	1,625.00	26,162,500
岡谷電機産業	4,400	395.00	1,738,000
ヘリオス テクノ ホールディング	3,600	474.00	1,706,400
日本セラミック	2,800	2,808.00	7,862,400
遠藤照明	2,600	716.00	1,861,600
古河電池	2,300	845.00	1,943,500
山一電機	2,000	1,676.00	3,352,000
図研	1,800	2,481.00	4,465,800
日本電子	5,500	3,210.00	17,655,000
カシオ計算機	24,500	2,206.00	54,047,000
ファナック	26,300	20,570.00	540,991,000
日本シイエムケイ	6,500	669.00	4,348,500
エンプラス	1,400	3,570.00	4,998,000
ローム	12,300	8,720.00	107,256,000
浜松ホトニクス	19,800	4,575.00	90,585,000
三井ハイテック	3,000	1,637.00	4,911,000
新光電気工業	9,300	1,287.00	11,969,100
京セラ	38,900	7,494.00	291,516,600
協栄産業	1,200	1,600.00	1,920,000
太陽誘電	12,300	3,160.00	38,868,000
村田製作所	81,200	6,564.00	532,996,800
双葉電子工業	4,400	1,402.00	6,168,800
日東電工	19,100	6,230.00	118,993,000
北陸電気工業	1,500	1,153.00	1,729,500
東海理化電機製作所	7,300	2,227.00	16,257,100
ニチコン	9,400	1,143.00	10,744,200
日本ケミコン	2,100	2,150.00	4,515,000
K O A	4,200	1,405.00	5,901,000
三井E & Sホールディングス	10,000	956.00	9,560,000
日立造船	21,900	424.00	9,285,600
三菱重工業	46,300	4,278.00	198,071,400
川崎重工業	21,500	2,476.00	53,234,000
I H I	19,900	2,555.00	50,844,500
名村造船所	8,900	263.00	2,340,700
スプリックス	1,100	1,142.00	1,256,200
日本車輛製造	1,000	3,205.00	3,205,000
三菱ロジスネクスト	3,700	1,339.00	4,954,300
近畿車輛	1,100	1,549.00	1,703,900
F P G	8,600	1,032.00	8,875,200
島根銀行	2,500	667.00	1,667,500
じもとホールディングス	18,400	115.00	2,116,000
全国保証	7,700	4,670.00	35,959,000
めぶきフィナンシャルグループ	141,700	282.00	39,959,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,700	1,538.00	5,690,600
九州フィナンシャルグループ	44,700	481.00	21,500,700
かんぽ生命保険	9,700	1,907.00	18,497,900
ゆうちょ銀行	77,200	1,054.00	81,368,800
富山第一銀行	6,500	352.00	2,288,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	160,400	454.00	72,821,600
西日本フィナンシャルホールディングス	18,600	879.00	16,349,400
日本モーゲージサービス	1,300	1,555.00	2,021,500
アルヒ	4,300	2,292.00	9,855,600
プレミアグループ	1,500	2,358.00	3,537,000
日産自動車	326,000	664.10	216,496,600
いすゞ自動車	80,100	1,335.00	106,933,500
トヨタ自動車	308,000	7,744.00	2,385,152,000
日野自動車	34,500	1,170.00	40,365,000
三菱自動車工業	102,300	476.00	48,694,800
エフテック	2,400	843.00	2,023,200

武蔵精密工業	6,200	1,542.00	9,560,400
日産車体	5,400	1,015.00	5,481,000
新明和工業	7,400	1,507.00	11,151,800
極東開発工業	5,100	1,643.00	8,379,300
日信工業	5,600	2,216.00	12,409,600
トビー工業	2,300	2,036.00	4,682,800
ティラド	1,000	2,025.00	2,025,000
曙ブレーキ工業	15,200	252.00	3,830,400
タチエス	4,500	1,506.00	6,777,000
N O K	14,900	1,714.00	25,538,600
フタバ産業	7,700	782.00	6,021,400
K Y B	3,100	3,365.00	10,431,500
市光工業	4,100	828.00	3,394,800
大同メタル工業	5,300	791.00	4,192,300
プレス工業	13,700	449.00	6,151,300
ミクニ	4,800	361.00	1,732,800
太平洋工業	5,800	1,504.00	8,723,200
ケーヒン	6,300	2,559.00	16,121,700
河西工業	3,700	899.00	3,326,300
アイシン精機	22,800	4,180.00	95,304,000
マツダ	81,300	953.00	77,478,900
今仙電機製作所	2,600	983.00	2,555,800
本田技研工業	217,700	3,170.00	690,109,000
スズキ	54,800	4,710.00	258,108,000
S U B A R U	85,800	2,802.50	240,454,500
安永	1,300	1,276.00	1,658,800
ヤマハ発動機	36,000	2,293.00	82,548,000
ショーワ	6,500	2,262.00	14,703,000
小糸製作所	16,600	5,600.00	92,960,000
T B K	3,800	480.00	1,824,000
エクセディ	3,800	2,522.00	9,583,600
ミツバ	5,100	799.00	4,074,900
豊田合成	8,900	2,790.00	24,831,000
愛三工業	4,300	839.00	3,607,700
日本プラスト	2,400	753.00	1,807,200
ヨロズ	2,600	1,470.00	3,822,000
エフ・シー・シー	4,500	2,418.00	10,881,000
シマノ	10,300	17,560.00	180,868,000
テイ・エス テック	6,400	3,505.00	22,432,000
関西みらいフィナンシャルグループ	16,000	722.00	11,552,000
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,768.00	4,420,000
第四北越フィナンシャルグループ	4,700	3,100.00	14,570,000
ジャムコ	1,400	1,460.00	2,044,000
小野建	2,400	1,424.00	3,417,600
ノジマ	4,800	2,292.00	11,001,600
佐島電機	2,000	931.00	1,862,000
カップ・クリエイト	3,800	1,510.00	5,738,000
伯東	1,700	1,391.00	2,364,700
コンドーテック	2,100	1,169.00	2,454,900
ライトオン	3,100	612.00	1,897,200
ナガイレーベン	3,900	2,577.00	10,050,300
三菱食品	3,000	3,100.00	9,300,000
良品計画	36,100	2,533.00	91,441,300
松田産業	2,000	1,621.00	3,242,000
第一興商	4,100	5,680.00	23,288,000
メディカルホールディングス	29,400	2,413.00	70,942,200
アドヴァン	4,200	1,318.00	5,535,600
S P K	100	2,925.00	292,500
萩原電気ホールディングス	1,000	2,932.00	2,932,000
アルビス	1,000	2,265.00	2,265,000

アズワン	1,800	10,040.00	18,072,000
スズデン	1,200	1,510.00	1,812,000
シモジマ	1,700	1,238.00	2,104,600
ドウシシャ	2,600	1,769.00	4,599,400
小津産業	1,000	1,782.00	1,782,000
コナカ	4,300	423.00	1,818,900
高速	1,600	1,279.00	2,046,400
G-7ホールディングス	800	4,705.00	3,764,000
イオン北海道	2,700	791.00	2,135,700
コジマ	4,700	526.00	2,472,200
ヒマラヤ	2,100	837.00	1,757,700
コーナン商事	3,900	2,591.00	10,104,900
ネットワンシステムズ	10,300	2,750.00	28,325,000
エコス	1,100	1,720.00	1,892,000
ワタミ	3,200	1,306.00	4,179,200
マルシェ	2,300	780.00	1,794,000
システムソフト	15,800	106.00	1,674,800
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	65,200	1,839.00	119,902,800
丸文	2,900	625.00	1,812,500
西松屋チェーン	6,000	943.00	5,658,000
ゼンショーホールディングス	13,000	2,453.00	31,889,000
ハビネット	2,300	1,433.00	3,295,900
幸楽苑ホールディングス	1,700	2,045.00	3,476,500
日本ライフライン	8,100	1,497.00	12,125,700
サイゼリヤ	4,500	2,653.00	11,938,500
エクセル	1,400	1,590.00	2,226,000
V Tホールディングス	11,300	470.00	5,311,000
マルカ	1,000	2,379.00	2,379,000
アルゴグラフィックス	2,300	3,380.00	7,774,000
I D O M	7,300	633.00	4,620,900
日本エム・ディ・エム	1,600	2,310.00	3,696,000
ユナイテッドアローズ	2,900	3,215.00	9,323,500
進和	1,600	2,422.00	3,875,200
ダイトロン	1,200	1,962.00	2,354,400
ハイデイ日高	3,900	2,185.00	8,521,500
シークス	3,500	1,614.00	5,649,000
京都きもの友禅	4,800	350.00	1,680,000
コロワイド	9,000	2,220.00	19,980,000
ピーシーデボコーポレーション	3,600	565.00	2,034,000
田中商事	2,600	705.00	1,833,000
オーハシテクニカ	1,500	1,523.00	2,284,500
壱番屋	1,900	5,560.00	10,564,000
白銅	1,300	1,543.00	2,005,900
P L A N T	2,600	650.00	1,690,000
スギホールディングス	5,400	6,230.00	33,642,000
薬王堂ホールディングス	1,200	2,494.00	2,992,800
島津製作所	33,000	3,460.00	114,180,000
J M S	2,600	836.00	2,173,600
長野計器	400	892.00	356,800
ブイ・テクノロジー	1,300	5,670.00	7,371,000
スター精密	4,300	1,596.00	6,862,800
東京計器	1,800	1,024.00	1,843,200
インターアクション	1,500	2,914.00	4,371,000
オーバル	6,900	252.00	1,738,800
東京精密	5,000	4,300.00	21,500,000
マニー	11,000	3,050.00	33,550,000
ニコン	44,700	1,359.00	60,747,300
トプコン	13,900	1,443.00	20,057,700
オリンパス	152,900	1,658.00	253,508,200

理研計器	2,400	2,316.00	5,558,400
S C R E E Nホールディングス	4,800	7,530.00	36,144,000
キヤノン電子	2,900	2,128.00	6,171,200
タムロン	2,200	2,597.00	5,713,400
H O Y A	55,700	10,225.00	569,532,500
シード	2,000	1,104.00	2,208,000
ノーリツ鋼機	1,900	1,609.00	3,057,100
エー・アンド・デイ	2,500	1,047.00	2,617,500
朝日インテック	23,500	3,180.00	74,730,000
キヤノン	148,800	3,086.00	459,196,800
リコー	70,300	1,159.00	81,477,700
シチズン時計	32,400	609.00	19,731,600
リズム時計工業	1,800	939.00	1,690,200
大研医器	3,300	642.00	2,118,600
メニコン	3,800	4,540.00	17,252,000
スノーピーク	1,700	1,122.00	1,907,400
パラマウントベッドホールディングス	2,900	4,680.00	13,572,000
トランザクション	1,900	977.00	1,856,300
S H O B I	4,200	398.00	1,671,600
ニホンフラッシュ	1,300	2,913.00	3,786,900
前田工織	3,000	2,177.00	6,531,000
永大産業	4,900	351.00	1,719,900
アートネイチャー	3,000	856.00	2,568,000
バンダイナムコホールディングス	28,600	6,530.00	186,758,000
共立印刷	100	169.00	16,900
S H O E I	1,300	5,380.00	6,994,000
フランスベッドホールディングス	3,900	982.00	3,829,800
マーベラス	4,100	742.00	3,042,200
パイロットコーポレーション	4,800	4,545.00	21,816,000
萩原工業	1,500	1,764.00	2,646,000
エイベックス	4,700	1,255.00	5,898,500
トップパン・フォームズ	5,900	1,208.00	7,127,200
フジシールインターナショナル	6,200	2,483.00	15,394,600
タカラトミー	12,400	1,417.00	17,570,800
廣済堂	2,500	815.00	2,037,500
アーク	18,800	97.00	1,823,600
レック	2,900	1,357.00	3,935,300
三光合成	4,400	436.00	1,918,400
プロネクサス	2,400	1,265.00	3,036,000
ホクシン	10,500	167.00	1,753,500
大建工業	1,900	1,958.00	3,720,200
凸版印刷	39,000	2,297.00	89,583,000
大日本印刷	36,200	3,000.00	108,600,000
共同印刷	900	2,937.00	2,643,300
N I S S H A	5,700	1,133.00	6,458,100
光村印刷	1,000	1,790.00	1,790,000
藤森工業	2,500	3,520.00	8,800,000
ヴィア・ホールディングス	3,300	676.00	2,230,800
T A K A R A & C O M P A N Y	1,300	1,747.00	2,271,100
前澤化成工業	1,800	1,228.00	2,210,400
未来工業	1,500	2,210.00	3,315,000
アシックス	22,800	1,859.00	42,385,200
ツツミ	900	2,119.00	1,907,100
J S P	1,600	1,972.00	3,155,200
ニチハ	3,800	2,696.00	10,244,800
エフピコ	3,000	6,700.00	20,100,000
小松ウオール工業	800	2,383.00	1,906,400
ヤマハ	16,400	6,090.00	99,876,000
河合楽器製作所	900	3,815.00	3,433,500
ピジョン	16,700	4,145.00	69,221,500

天馬	1,800	2,001.00	3,601,800
キングジム	2,300	882.00	2,028,600
象印マホービン	8,100	1,849.00	14,976,900
リンテック	6,600	2,473.00	16,321,800
信越ポリマー	5,000	1,030.00	5,150,000
東リ	6,900	331.00	2,283,900
イトーキ	5,900	572.00	3,374,800
任天堂	17,000	43,200.00	734,400,000
三菱鉛筆	4,600	1,702.00	7,829,200
松風	1,200	1,715.00	2,058,000
タカラスタANDARD	5,700	1,994.00	11,365,800
コクヨ	13,300	1,672.00	22,237,600
ニフコ	10,100	3,060.00	30,906,000
立川ブラインド工業	1,200	1,409.00	1,690,800
グロープライド	1,200	2,617.00	3,140,400
オカムラ	9,600	1,060.00	10,176,000
バルカー	2,200	2,672.00	5,878,400
伊藤忠商事	190,400	2,539.00	483,425,600
丸紅	283,400	816.00	231,254,400
スクロール	5,200	364.00	1,892,800
ヨンドシーホールディングス	2,800	2,630.00	7,364,000
三陽商会	1,400	1,361.00	1,905,400
長瀬産業	15,300	1,650.00	25,245,000
蝶理	1,700	2,230.00	3,791,000
豊田通商	30,400	3,930.00	119,472,000
オンワードホールディングス	16,300	654.00	10,660,200
三共生興	4,100	595.00	2,439,500
兼松	10,200	1,479.00	15,085,800
美津濃	2,500	2,782.00	6,955,000
ファミリーマート	21,700	2,648.00	57,461,600
三井物産	239,300	1,983.50	474,651,550
日本紙パルプ商事	1,500	4,265.00	6,397,500
東京エレクトロン	18,400	23,950.00	440,680,000
日立ハイテクノロジー	9,500	7,790.00	74,005,000
カメイ	3,500	1,369.00	4,791,500
東都水産	700	2,725.00	1,907,500
OUGホールディングス	700	2,679.00	1,875,300
スターゼン	1,000	4,325.00	4,325,000
セイコーホールディングス	3,900	2,866.00	11,177,400
山善	10,600	1,117.00	11,840,200
椿本興業	500	4,255.00	2,127,500
住友商事	171,800	1,649.50	283,384,100
日本ユニシス	8,500	3,480.00	29,580,000
内田洋行	1,200	7,280.00	8,736,000
三菱商事	191,000	2,913.00	556,383,000
第一実業	1,300	3,830.00	4,979,000
キヤノンマーケティングジャパン	7,800	2,612.00	20,373,600
西華産業	1,500	1,370.00	2,055,000
佐藤商事	2,200	1,003.00	2,206,600
菱洋エレクトロ	2,800	2,024.00	5,667,200
東京産業	3,100	611.00	1,894,100
ユアサ商事	2,600	3,710.00	9,646,000
神鋼商事	700	2,827.00	1,978,900
阪和興業	5,100	2,896.00	14,769,600
正栄食品工業	1,800	3,970.00	7,146,000
カナデン	2,200	1,351.00	2,972,200
菱電商事	2,000	1,660.00	3,320,000
ニプロ	19,100	1,320.00	25,212,000
フルサト工業	1,500	1,778.00	2,667,000
岩谷産業	6,000	3,765.00	22,590,000

昭光通商	2,700	718.00	1,938,600
イワキ	3,800	464.00	1,763,200
兼松エレクトロニクス	1,500	3,590.00	5,385,000
三愛石油	6,700	1,175.00	7,872,500
稲畑産業	6,000	1,677.00	10,062,000
ゴールドウイン	4,900	7,950.00	38,955,000
ユニ・チャーム	53,300	3,707.00	197,583,100
デサント	5,300	2,059.00	10,912,700
ワキタ	5,800	1,126.00	6,530,800
ヤマトインターナショナル	4,400	408.00	1,795,200
東邦ホールディングス	8,700	2,413.00	20,993,100
サンゲツ	7,500	2,104.00	15,780,000
ミツウロコグループホールディングス	4,000	1,427.00	5,708,000
シナネンホールディングス	1,100	2,011.00	2,212,100
伊藤忠エネクス	6,000	949.00	5,694,000
サンリオ	7,600	2,184.00	16,598,400
サンワテクノス	1,900	1,166.00	2,215,400
リョーサン	3,000	2,835.00	8,505,000
新光商事	4,300	897.00	3,857,100
トーヨー	1,200	1,842.00	2,210,400
三信電気	1,500	1,796.00	2,694,000
東陽テクニカ	3,100	1,206.00	3,738,600
モスフードサービス	3,600	3,055.00	10,998,000
加賀電子	2,700	2,652.00	7,160,400
三益半導体工業	2,400	2,168.00	5,203,200
ソーダニッカ	2,800	636.00	1,780,800
立花エレテック	2,000	1,855.00	3,710,000
木曽路	3,600	2,990.00	10,764,000
SRSホールディングス	3,200	1,042.00	3,334,400
千趣会	4,900	504.00	2,469,600
ケーヨー	5,600	555.00	3,108,000
上新電機	3,200	2,606.00	8,339,200
日本瓦斯	4,300	3,645.00	15,673,500
ロイヤルホールディングス	4,800	2,543.00	12,206,400
東天紅	1,400	1,262.00	1,766,800
いなげや	3,400	1,474.00	5,011,600
島忠	5,800	3,020.00	17,516,000
チヨダ	2,900	1,628.00	4,721,200
ライフコーポレーション	2,100	2,573.00	5,403,300
リンガーハット	3,400	2,529.00	8,598,600
MrMaxHD	3,700	497.00	1,838,900
テンアライド	4,000	439.00	1,756,000
AOKIホールディングス	5,400	1,148.00	6,199,200
オークワ	4,300	1,406.00	6,045,800
コメリ	4,200	2,397.00	10,067,400
青山商事	5,600	1,584.00	8,870,400
しまむら	3,200	9,290.00	29,728,000
はせがわ	4,300	399.00	1,715,700
高島屋	19,800	1,249.00	24,730,200
松屋	5,500	879.00	4,834,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	12,900	1,278.00	16,486,200
近鉄百貨店	1,000	3,790.00	3,790,000
パルコ	2,600	1,345.00	3,497,000
丸井グループ	25,000	2,605.00	65,125,000
クレディセゾン	19,100	1,886.00	36,022,600
アクシアルリテイリング	2,300	3,890.00	8,947,000
イオン	104,800	2,240.00	234,752,000
イズミ	5,500	4,030.00	22,165,000
平和堂	5,500	2,111.00	11,610,500
フジ	3,300	1,982.00	6,540,600

ヤオコー	3,100	5,490.00	17,019,000
ゼビオホールディングス	3,300	1,341.00	4,425,300
ケーズホールディングス	26,300	1,450.00	38,135,000
PALTAC	4,400	5,520.00	24,288,000
三谷産業	5,300	343.00	1,817,900
新生銀行	20,000	1,658.00	33,160,000
あおぞら銀行	16,200	2,944.00	47,692,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,876,800	599.20	1,124,578,560
りそなホールディングス	299,200	484.80	145,052,160
三井住友トラスト・ホールディングス	51,600	4,366.00	225,285,600
三井住友フィナンシャルグループ	188,600	4,100.00	773,260,000
千葉銀行	93,800	638.00	59,844,400
群馬銀行	53,600	385.00	20,636,000
武蔵野銀行	4,100	1,921.00	7,876,100
千葉興業銀行	7,500	384.00	2,880,000
筑波銀行	11,300	251.00	2,836,300
七十七銀行	9,300	1,844.00	17,149,200
青森銀行	2,200	2,949.00	6,487,800
秋田銀行	1,700	2,211.00	3,758,700
山形銀行	3,100	1,583.00	4,907,300
岩手銀行	1,800	2,982.00	5,367,600
東邦銀行	24,400	275.00	6,710,000
みちのく銀行	1,800	1,539.00	2,770,200
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	2,133.00	49,059,000
静岡銀行	67,500	832.00	56,160,000
十六銀行	3,400	2,592.00	8,812,800
スルガ銀行	27,900	523.00	14,591,700
八十二銀行	65,800	495.00	32,571,000
山梨中央銀行	3,200	1,189.00	3,804,800
大垣共立銀行	5,400	2,406.00	12,992,400
福井銀行	2,300	1,933.00	4,445,900
北國銀行	2,900	3,725.00	10,802,500
清水銀行	1,100	2,176.00	2,393,600
富山銀行	700	2,425.00	1,697,500
滋賀銀行	5,500	2,784.00	15,312,000
南都銀行	4,500	2,815.00	12,667,500
百五銀行	24,500	355.00	8,697,500
京都銀行	9,800	4,740.00	46,452,000
紀陽銀行	9,700	1,671.00	16,208,700
ほくほくフィナンシャルグループ	18,100	1,160.00	20,996,000
広島銀行	40,200	542.00	21,788,400
山陰合同銀行	16,200	674.00	10,918,800
中国銀行	23,500	1,104.00	25,944,000
鳥取銀行	1,300	1,379.00	1,792,700
伊予銀行	38,900	614.00	23,884,600
百十四銀行	2,900	2,156.00	6,252,400
四国銀行	4,100	1,056.00	4,329,600
阿波銀行	4,500	2,528.00	11,376,000
大分銀行	1,600	2,881.00	4,609,600
宮崎銀行	1,800	2,688.00	4,838,400
佐賀銀行	1,700	1,842.00	3,131,400
沖縄銀行	2,500	3,665.00	9,162,500
琉球銀行	6,300	1,238.00	7,799,400
セブン銀行	91,100	360.00	32,796,000
みずほフィナンシャルグループ	3,704,700	169.20	626,835,240
山口フィナンシャルグループ	34,000	761.00	25,874,000
芙蓉総合リース	2,900	7,410.00	21,489,000
みずほリース	4,200	3,460.00	14,532,000
東京センチュリー	5,500	5,880.00	32,340,000
SBIホールディングス	30,500	2,300.00	70,150,000

日本証券金融	12,000	535.00	6,420,000
アイフル	41,600	240.00	9,984,000
長野銀行	1,100	1,704.00	1,874,400
名古屋銀行	2,300	3,440.00	7,912,000
北洋銀行	41,100	249.00	10,233,900
愛知銀行	1,000	3,715.00	3,715,000
中京銀行	1,100	2,233.00	2,456,300
大光銀行	1,000	1,720.00	1,720,000
愛媛銀行	3,800	1,205.00	4,579,000
京葉銀行	11,600	632.00	7,331,200
栃木銀行	13,200	238.00	3,141,600
北日本銀行	900	2,300.00	2,070,000
東和銀行	4,800	892.00	4,281,600
リコーリース	2,200	4,075.00	8,965,000
イオンフィナンシャルサービス	16,700	1,711.00	28,573,700
アコム	54,800	494.00	27,071,200
ジャックス	3,000	2,767.00	8,301,000
オリエントコーポレーション	73,800	163.00	12,029,400
日立キャピタル	6,400	2,904.00	18,585,600
アプラスフィナンシャル	18,100	91.00	1,647,100
オリックス	170,500	1,843.50	314,316,750
三菱UFJリース	69,200	724.00	50,100,800
ジャフコ	4,200	4,365.00	18,333,000
トモニホールディングス	21,100	424.00	8,946,400
大和証券グループ本社	218,800	562.70	123,118,760
野村ホールディングス	479,700	561.70	269,447,490
岡三証券グループ	23,200	398.00	9,233,600
丸三証券	8,100	508.00	4,114,800
東洋証券	10,200	151.00	1,540,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	31,300	330.00	10,329,000
光世証券	2,300	670.00	1,541,000
水戸証券	7,900	228.00	1,801,200
いちよし証券	5,100	653.00	3,330,300
松井証券	15,600	877.00	13,681,200
SOMP Oホールディングス	51,300	4,393.00	225,360,900
だいがう証券ビジネス	3,000	683.00	2,049,000
日本取引所グループ	78,300	1,937.00	151,667,100
マネックスグループ	20,600	274.00	5,644,400
極東証券	3,700	760.00	2,812,000
岩井コスモホールディングス	2,600	1,286.00	3,343,600
藍澤證券	4,900	747.00	3,660,300
フィデアホールディングス	26,500	140.00	3,710,000
池田泉州ホールディングス	31,400	217.00	6,813,800
アニコム ホールディングス	2,300	3,635.00	8,360,500
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	71,300	3,640.00	259,532,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	22,400	2,700.00	60,480,000
スパークス・グループ	9,400	262.00	2,462,800
第一生命ホールディングス	154,300	1,861.00	287,152,300
東京海上ホールディングス	97,500	6,190.00	603,525,000
イー・ギャランティ	2,900	1,316.00	3,816,400
アサックス	2,800	696.00	1,948,800
NECキャピタルソリューション	1,100	2,537.00	2,790,700
T & Dホールディングス	84,300	1,433.00	120,801,900
アドバンスクリエイト	400	1,897.00	758,800
三井不動産	136,100	2,746.00	373,730,600
三菱地所	191,000	2,127.00	406,257,000
平和不動産	5,000	3,005.00	15,025,000
東京建物	29,800	1,714.00	51,077,200



ダイビル	7,000	1,217.00	8,519,000
京阪神ビルディング	4,400	1,470.00	6,468,000
住友不動産	61,300	3,878.00	237,721,400
テーオーシー	5,300	907.00	4,807,100
東京楽天地	400	6,410.00	2,564,000
レオパレス21	35,700	352.00	12,566,400
スターツコーポレーション	3,700	2,785.00	10,304,500
フジ住宅	3,200	699.00	2,236,800
空港施設	3,100	552.00	1,711,200
明和地所	3,000	624.00	1,872,000
ゴールドクレスト	2,100	2,111.00	4,433,100
リログループ	14,400	2,879.00	41,457,600
エスリード	1,100	2,237.00	2,460,700
日神不動産	4,100	560.00	2,296,000
日本エスコン	4,900	1,002.00	4,909,800
タカラレーベン	12,500	513.00	6,412,500
サンヨーハウジング名古屋	1,800	1,081.00	1,945,800
イオンモール	13,700	1,937.00	26,536,900
毎日コムネット	2,200	870.00	1,914,000
ファースト住建	1,300	1,280.00	1,664,000
カチタス	3,400	4,740.00	16,116,000
東祥	1,600	2,482.00	3,971,200
トーセイ	3,800	1,512.00	5,745,600
穴吹興産	600	3,575.00	2,145,000
サンフロンティア不動産	3,800	1,354.00	5,145,200
エフ・ジェー・ネクスト	2,400	1,151.00	2,762,400
グランディハウス	3,500	486.00	1,701,000
東武鉄道	29,200	3,980.00	116,216,000
相鉄ホールディングス	8,800	2,960.00	26,048,000
東急	69,700	2,031.00	141,560,700
京浜急行電鉄	35,500	2,094.00	74,337,000
小田急電鉄	41,100	2,575.00	105,832,500
京王電鉄	14,300	6,680.00	95,524,000
京成電鉄	19,200	4,240.00	81,408,000
富士急行	3,800	4,240.00	16,112,000
新京成電鉄	400	2,366.00	946,400
東日本旅客鉄道	48,700	9,849.00	479,646,300
西日本旅客鉄道	24,600	9,514.00	234,044,400
東海旅客鉄道	23,000	22,435.00	516,005,000
西武ホールディングス	37,100	1,818.00	67,447,800
鴻池運輸	4,400	1,665.00	7,326,000
西日本鉄道	7,700	2,555.00	19,673,500
ハマキョウレックス	2,100	3,595.00	7,549,500
サカイ引越センター	1,500	7,130.00	10,695,000
近鉄グループホールディングス	26,200	5,920.00	155,104,000
阪急阪神ホールディングス	34,900	4,730.00	165,077,000
南海電気鉄道	12,400	2,977.00	36,914,800
京阪ホールディングス	11,700	5,290.00	61,893,000
神戸電鉄	600	3,975.00	2,385,000
名古屋鉄道	21,500	3,375.00	72,562,500
山陽電気鉄道	1,900	2,186.00	4,153,400
トランコム	700	8,250.00	5,775,000
日本通運	9,300	6,510.00	60,543,000
ヤマトホールディングス	45,900	1,856.00	85,190,400
山九	7,300	5,580.00	40,734,000
日新	2,300	1,926.00	4,429,800
丸全昭和運輸	2,100	3,205.00	6,730,500
センコーグループホールディングス	14,400	949.00	13,665,600
トナミホールディングス	600	5,510.00	3,306,000
ニッコンホールディングス	9,400	2,749.00	25,840,600

福山通運	3,400	4,085.00	13,889,000
セイノーホールディングス	19,600	1,495.00	29,302,000
エスライン	1,800	1,051.00	1,891,800
神奈川中央交通	600	4,070.00	2,442,000
日立物流	4,800	3,060.00	14,688,000
丸和運輸機関	2,800	2,510.00	7,028,000
C & F ロジホールディングス	2,600	1,460.00	3,796,000
日本郵船	21,900	1,982.00	43,405,800
商船三井	16,600	2,955.00	49,053,000
川崎汽船	8,100	1,883.00	15,252,300
NSユナイテッド海運	1,500	2,302.00	3,453,000
飯野海運	12,400	369.00	4,575,600
九州旅客鉄道	23,300	3,675.00	85,627,500
S Gホールディングス	27,500	2,578.00	70,895,000
日本航空	47,900	3,407.00	163,195,300
A N Aホールディングス	47,900	3,642.00	174,451,800
パスコ	400	2,057.00	822,800
西本Wismettacホールディングス	500	3,780.00	1,890,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,523.00	1,827,600
Genky DrugStores	1,300	2,307.00	2,999,100
国際紙バルブ商事	6,400	316.00	2,022,400
総合メディカルホールディングス	2,400	2,019.00	4,845,600
ブックオフグループホールディングス	1,600	1,051.00	1,681,600
三菱倉庫	8,300	2,895.00	24,028,500
三井倉庫ホールディングス	3,000	1,998.00	5,994,000
住友倉庫	9,600	1,501.00	14,409,600
澁澤倉庫	1,400	2,285.00	3,199,000
ヤマタネ	1,400	1,574.00	2,203,600
東陽倉庫	5,200	344.00	1,788,800
乾汽船	1,600	1,147.00	1,835,200
日本トランスシティ	5,800	560.00	3,248,000
ケイヒン	500	1,365.00	682,500
中央倉庫	1,600	1,247.00	1,995,200
安田倉庫	2,100	1,029.00	2,160,900
東洋埠頭	1,200	1,403.00	1,683,600
宇徳	3,300	544.00	1,795,200
上組	15,000	2,428.00	36,420,000
キューソー流通システム	900	1,912.00	1,720,800
近鉄エクスプレス	5,600	1,892.00	10,595,200
東海運	6,200	291.00	1,804,200
エーアイティー	1,900	988.00	1,877,200
日本コンセプト	1,200	1,504.00	1,804,800
東京放送ホールディングス	16,500	1,881.00	31,036,500
日本テレビホールディングス	22,600	1,450.00	32,770,000
朝日放送グループホールディングス	2,700	783.00	2,114,100
テレビ朝日ホールディングス	7,500	2,030.00	15,225,000
スカパーJ S A Tホールディングス	17,800	494.00	8,793,200
テレビ東京ホールディングス	2,200	2,490.00	5,478,000
日本BS放送	1,600	1,173.00	1,876,800
ビジョン	2,500	1,739.00	4,347,500
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	1,405.00	2,388,500
コネクシオ	1,500	1,607.00	2,410,500
日本通信	21,000	244.00	5,124,000
日本電信電話	181,300	5,588.00	1,013,104,400
KDDI	202,100	3,287.00	664,302,700
ソフトバンク	246,500	1,449.00	357,178,500
光通信	2,800	28,110.00	78,708,000
NTTドコモ	200,400	3,048.00	610,819,200
エムティーアイ	2,600	718.00	1,866,800

GMOインターネット	10,700	2,133.00	22,823,100
KADOKAWA	7,300	2,002.00	14,614,600
学研ホールディングス	900	7,560.00	6,804,000
ゼンリン	5,400	1,932.00	10,432,800
インプレスホールディングス	11,200	194.00	2,172,800
東京電力ホールディングス	220,700	476.00	105,053,200
中部電力	84,600	1,567.50	132,610,500
関西電力	104,700	1,288.50	134,905,950
中国電力	38,200	1,453.00	55,504,600
北陸電力	25,300	810.00	20,493,000
東北電力	69,100	1,107.00	76,493,700
四国電力	24,900	1,109.00	27,614,100
九州電力	57,000	958.00	54,606,000
北海道電力	25,900	545.00	14,115,500
沖縄電力	5,100	2,103.00	10,725,300
電源開発	22,000	2,698.00	59,356,000
エフオン	1,300	760.00	988,000
イーレックス	3,900	1,879.00	7,328,100
レノバ	4,600	1,203.00	5,533,800
東京瓦斯	53,200	2,684.50	142,815,400
大阪瓦斯	53,600	2,157.00	115,615,200
東邦瓦斯	13,700	4,525.00	61,992,500
北海道瓦斯	1,500	1,634.00	2,451,000
広島ガス	5,700	363.00	2,069,100
西部瓦斯	3,100	2,609.00	8,087,900
静岡ガス	7,800	1,002.00	7,815,600
メタウォーター	1,300	4,350.00	5,655,000
アイネット	1,400	1,547.00	2,165,800
松竹	1,800	16,640.00	29,952,000
東宝	16,200	4,560.00	73,872,000
エイチ・アイ・エス	4,100	3,130.00	12,833,000
東映	1,000	16,640.00	16,640,000
ラックランド	700	2,329.00	1,630,300
エヌ・ティ・ティ・データ	72,200	1,468.00	105,989,600
共立メンテナンス	4,400	5,050.00	22,220,000
イチネンホールディングス	3,000	1,582.00	4,746,000
建設技術研究所	1,800	2,242.00	4,035,600
スペース	1,700	1,351.00	2,296,700
アインホールディングス	3,600	6,680.00	24,048,000
燦ホールディングス	1,400	1,502.00	2,102,800
東京テアトル	1,200	1,417.00	1,700,400
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,292.00	1,604,400
ナガワ	900	8,060.00	7,254,000
よみうりランド	600	4,585.00	2,751,000
東京都競馬	1,700	3,535.00	6,009,500
常磐興産	1,100	1,669.00	1,835,900
カナモト	4,300	2,880.00	12,384,000
東京ドーム	10,700	1,098.00	11,748,600
D T S	6,100	2,522.00	15,384,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,600	5,540.00	64,264,000
シーイーシー	2,900	2,121.00	6,150,900
カブコン	12,800	3,080.00	39,424,000
西尾レントオール	2,700	3,145.00	8,491,500
アイ・エス・ピー	900	1,944.00	1,749,600
日本空港ビルデング	8,700	6,170.00	53,679,000
トランス・コスモス	2,500	2,929.00	7,322,500
乃村工藝社	11,300	1,436.00	16,226,800
ジャステック	1,700	1,125.00	1,912,500
S C S K	6,300	5,720.00	36,036,000

藤田観光	1,200	2,893.00	3,471,600
KNT-CTホールディングス	1,600	1,494.00	2,390,400
日本管財	2,800	1,976.00	5,532,800
トーカイ	2,600	2,927.00	7,610,200
白洋舎	600	2,916.00	1,749,600
セコム	28,000	9,768.00	273,504,000
日本システムウエア	900	2,477.00	2,229,300
セントラル警備保障	1,300	6,190.00	8,047,000
アイネス	2,700	1,376.00	3,715,200
丹青社	5,000	1,292.00	6,460,000
メイテック	3,300	6,130.00	20,229,000
TKC	2,300	5,240.00	12,052,000
富士ソフト	3,500	4,270.00	14,945,000
応用地質	2,800	1,505.00	4,214,000
船井総研ホールディングス	5,500	2,504.00	13,772,000
NSD	4,500	3,595.00	16,177,500
進学会ホールディングス	3,200	528.00	1,689,600
丸紅建材リース	1,000	1,781.00	1,781,000
コナミホールディングス	9,900	4,500.00	44,550,000
学究社	1,400	1,400.00	1,960,000
ベネッセホールディングス	8,800	2,904.00	25,555,200
イオンディライト	3,300	4,000.00	13,200,000
ナック	1,600	1,010.00	1,616,000
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,695.00	4,064,500
ニチイ学館	3,800	1,547.00	5,878,600
ダイセキ	4,400	3,175.00	13,970,000
ステップ	1,200	1,578.00	1,893,600
日鉄物産	1,900	5,310.00	10,089,000
泉州電業	800	3,425.00	2,740,000
元気寿司	700	2,920.00	2,044,000
トラスコ中山	5,700	2,872.00	16,370,400
ヤマダ電機	82,900	570.00	47,253,000
オートバックスセブン	10,100	1,733.00	17,503,300
モリト	2,200	807.00	1,775,400
アークランドサカモト	4,300	1,278.00	5,495,400
ニトリホールディングス	11,800	17,155.00	202,429,000
グルメ杵屋	1,900	1,219.00	2,316,100
愛眼	6,900	240.00	1,656,000
吉野家ホールディングス	8,900	2,786.00	24,795,400
加藤産業	4,300	3,680.00	15,824,000
イノテック	1,700	1,133.00	1,926,100
イエローハット	5,100	2,019.00	10,296,900
松屋フーズホールディングス	1,300	4,540.00	5,902,000
JBCホールディングス	1,800	1,857.00	3,342,600
JKホールディングス	2,900	687.00	1,992,300
サガミホールディングス	3,600	1,362.00	4,903,200
日伝	2,500	2,088.00	5,220,000
関西スーパーマーケット	2,300	1,062.00	2,442,600
ミロク情報サービス	2,400	3,425.00	8,220,000
北沢産業	6,400	280.00	1,792,000
杉本商事	1,500	2,082.00	3,123,000
因幡電機産業	7,800	2,809.00	21,910,200
王将フードサービス	2,000	6,510.00	13,020,000
プレナス	3,000	1,954.00	5,862,000
ミニストップ	2,000	1,466.00	2,932,000
アークス	5,600	2,317.00	12,975,200
パローホールディングス	6,000	2,139.00	12,834,000
東テク	900	2,695.00	2,425,500
ミスミグループ本社	34,100	2,655.00	90,535,500
ベルク	1,300	5,720.00	7,436,000

大 庄	1,500	1,648.00	2,472,000	
タキヒヨー	900	1,961.00	1,764,900	
ファーストリテイリング	3,600	66,650.00	239,940,000	
ソフトバンクグループ	215,200	4,674.00	1,005,844,800	
蔵王産業	1,200	1,494.00	1,792,800	
スズケン	11,500	4,530.00	52,095,000	
サンドラッグ	10,200	4,010.00	40,902,000	
サックスパー ホールディングス	2,300	931.00	2,141,300	
ジェコス	1,900	1,082.00	2,055,800	
やまや	800	2,261.00	1,808,800	
ベルーナ	5,800	722.00	4,187,600	
合計	32,401,100		67,651,741,100	

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表  
該当事項はありません。

第5 商品明細表  
該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表  
該当事項はありません。

第8 借入金明細表  
該当事項はありません。

## 「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,566,341,624	503,769,850
金銭信託	546,138,984	64,589,250
コール・ローン	905,866,332	5,921,938,811
株式	138,038,131,511	208,192,680,647
投資証券	3,681,012,846	5,627,632,097
派生商品評価勘定	4,646,477	57,222,541
未収入金	253,870	2,196,503
未収配当金	174,153,377	201,755,393
差入委託証拠金	1,259,387,237	2,253,270,280
流動資産合計	148,175,932,258	222,825,055,372
資産合計	148,175,932,258	222,825,055,372
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	70,044,269	10,598,250
未払金	3,119,926,763	-
未払解約金	274,869,017	977,642,318
その他未払費用	46,925	4,485
流動負債合計	3,464,886,974	988,245,053
負債合計	3,464,886,974	988,245,053
純資産の部		
元本等		
元本	91,047,657,387	112,742,781,870
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	53,663,387,897	109,094,028,449
純資産合計	144,711,045,284	221,836,810,319
負債純資産合計	148,175,932,258	222,825,055,372

## 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	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 受益権総口数	91,047,657,387口	112,742,781,870口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5894円 (15,894円)	1.9676円 (19,676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 2017年12月21日 至 2018年12月20日	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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	2018年12月20日現在	2019年12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	8,341,526,253	4,927,550,423
投資証券	107,565,036	106,773,841
合計	8,449,091,289	4,820,776,582

## (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	2018年12月20日 現在				2019年12月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	2,877,766,729	-	2,881,687,540	3,920,811	-	-	-	-
アメリカ・ドル	2,187,210,497	-	2,190,480,600	3,270,103	-	-	-	-
イギリス・ポンド	197,404,680	-	197,099,100	305,580	-	-	-	-
ユーロ	493,151,552	-	494,107,840	956,288	-	-	-	-
買 建	3,886,512,399	-	3,863,193,760	23,318,639	4,610,641,799	-	4,636,541,870	25,900,071
アメリカ・ドル	2,830,970,425	-	2,810,273,400	20,697,025	3,331,033,077	-	3,355,360,080	24,327,003
イギリス・ポンド	310,616,564	-	310,477,200	139,364	368,569,867	-	365,053,070	3,516,797
ユーロ	744,925,410	-	742,443,160	2,482,250	911,038,855	-	916,128,720	5,089,865
合計	6,764,279,128	-	6,744,881,300	27,239,450	4,610,641,799	-	4,636,541,870	25,900,071

## (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	2018年12月20日 現在				2019年12月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	2,833,204,833	-	2,795,046,491	38,158,342	7,531,780,502	-	7,552,504,722	20,724,220
合計	2,833,204,833	-	2,795,046,491	38,158,342	7,531,780,502	-	7,552,504,722	20,724,220

## (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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」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	2018年12月20日現在	2019年12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	65,030,762,779円	91,047,657,387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	39,416,596,515円	43,722,320,193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	13,399,701,907円	22,027,195,710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)	576,620,502円	710,084,786円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,717,581,899円	3,303,464,505円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,134,626,190円	2,489,520,821円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	- 円	1,491,869,965円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	4,043,768円
ニッセイインデックスバランス(標準型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	22,684,869円
ニッセイインデックスバランス(成長型)S A(適格機関投資家限定)	- 円	31,332,640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)	11,706,030,050円	11,368,150,601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	62,086,766,121円	76,690,722,917円
DCニッセイ外国株式インデックス	11,287,574,263円	15,623,093,548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)	434,020,514円	624,880,559円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	14,991,603円	61,886,852円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	10,553,816円	74,770,417円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	8,566,244円	43,154,714円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	12,639,134円	83,849,166円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,630,838円	24,284,062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)	16,008,326円	41,935,568円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,925,308円	6,437,499円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,820,607円	3,507,322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)	608,141円	1,017,232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)	9,693,831円	16,533,824円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	- 円	5,788,980円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	- 円	4,218,552円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	- 円	7,410,424円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	- 円	8,138,279円
計	91,047,657,387円	112,742,781,870円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12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	92,598,912,036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	41,205,321,117円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	21,061,451,283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)	710,084,786円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,303,464,505円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,489,520,821円
ニッセイ外国株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	1,491,869,965円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,043,768円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	22,684,869円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	31,332,640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)	11,368,150,601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	76,690,722,917円
DCニッセイ外国株式インデックス	15,623,093,548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)	624,880,559円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	61,886,852円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	74,770,417円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	43,154,714円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	83,849,166円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	24,284,062円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	41,935,568円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,437,499円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,507,322円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,017,232円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	16,533,824円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,788,980円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,218,552円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,410,424円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	8,138,279円
計	112,742,781,870円

## 附属明細表（2019年12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	27,616	172.15	4,754,094.40	
	ABBOTT LABORATORIES	84,937	87.35	7,419,246.95	
	ABBVIE INC	71,079	88.77	6,309,682.83	
	ABIOMED INC	2,176	169.43	368,679.68	
	ACCENTURE PLC	30,560	208.30	6,365,648.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	36,834	59.13	2,177,994.42	
	ACUITY BRANDS INC	1,893	136.48	258,356.64	
	ADOBE INC	23,310	327.63	7,637,055.30	
	ADVANCE AUTO PARTS	3,423	156.48	535,631.04	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	49,589	42.83	2,123,896.87	
	AERCAP HOLDINGS NV	5,884	61.46	361,630.64	
	AES CORP	31,923	19.55	624,094.65	
	AFLAC INC	35,475	52.99	1,879,820.25	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,780	84.51	1,249,057.80	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,614	233.06	2,473,698.84	
	AKAMAII TECHNOLOGIES INC	7,897	84.51	667,375.47	
	ALBEMARLE CORP	5,075	69.45	352,458.75	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,735	111.24	1,194,161.40	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	3,642	273.75	996,997.50	
	ALLEGHANY CORP	704	801.48	564,241.92	
	ALLEGION PLC	4,513	123.68	558,167.84	
	ALLERGAN PLC	15,776	189.61	2,991,287.36	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,094	110.08	230,507.52	
	ALLIANT ENERGY CORP	11,440	54.22	620,276.80	
	ALLSTATE CORP	15,770	111.21	1,753,781.70	
	ALLY FINANCIAL INC	18,773	31.36	588,721.28	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,354	117.85	630,968.90	
	ALPHABET INC-CL A	14,320	1,356.44	19,424,220.80	
	ALPHABET INC-CL C	15,092	1,356.04	20,465,355.68	
	ALTICE USA INC- A	6,968	26.95	187,787.60	
	ALTRIA GROUP INC	89,831	50.79	4,562,516.49	
	AMAZON.COM INC	20,206	1,792.28	36,214,809.68	
	AMCOR PLC	78,776	10.80	850,780.80	
	AMERCO	473	371.12	175,539.76	
	AMEREN CORPORATION	11,752	75.45	886,688.40	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,236	28.55	149,487.80	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	23,781	93.97	2,234,700.57	
	AMERICAN EXPRESS CO	33,879	124.83	4,229,115.57	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,661	110.70	405,272.70	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,907	51.93	2,176,230.51	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,761	121.66	1,065,863.26	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,231	167.28	1,042,321.68	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,533	83.80	631,265.40	
AMERITRADE HOLDING CORP	13,138	50.08	657,951.04	
AMETEK INC	10,924	99.56	1,087,593.44	
AMGEN INC	28,821	241.84	6,970,070.64	
AMPHENOL CORP-CL A	14,272	107.05	1,527,817.60	
ANALOG DEVICES INC	17,808	118.70	2,113,809.60	
ANSYS INC	4,010	255.75	1,025,557.50	
ANTHEM INC	12,288	298.22	3,664,527.36	
AON PLC	11,319	209.73	2,373,933.87	
APACHE CORP	18,087	22.71	410,755.77	
APPLE INC	217,162	280.02	60,809,703.24	
APPLIED MATERIALS INC	44,336	60.67	2,689,865.12	
APTIV PLC	12,326	97.85	1,206,099.10	
AQUA AMERICA INC	10,461	46.12	482,461.32	
ARAMARK	11,899	43.70	519,986.30	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,396	42.43	822,972.28	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,583	45.64	1,213,248.12	
ARCONIC INC	19,035	31.00	590,085.00	
ARISTA NETWORKS INC	2,571	203.75	523,841.25	
ARROW ELECTRONICS INC	3,888	84.43	328,263.84	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,964	95.31	854,358.84	
ASSURANT INC	2,930	131.60	385,588.00	
AT&T INC	351,497	38.93	13,683,778.21	
ATHENE HOLDING LTD- CLASS A	7,109	47.31	336,326.79	
ATMOS ENERGY CORP	5,627	110.81	623,527.87	
AUTODESK INC	10,566	183.78	1,941,819.48	
AUTOLIV INC	4,021	86.46	347,655.66	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	20,871	168.74	3,521,772.54	
AUTOZONE INC	1,179	1,219.08	1,437,295.32	
AVERY DENNISON CORP	4,056	131.95	535,189.20	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	19,976	24.97	498,800.72	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,191	30.20	307,768.20	
BAKER HUGHES COMPANY	30,437	24.97	760,011.89	
BALL CORP	15,279	63.72	973,577.88	
BANK OF AMERICA CORP	424,709	34.95	14,843,579.55	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	40,734	50.85	2,071,323.90	
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,305	82.22	1,916,137.10	
BECTON DICKINSON & CO	12,978	267.87	3,476,416.86	
BEIGENE LTD-ADR	1,750	168.47	294,822.50	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	63,259	225.21	14,246,559.39	
BEST BUY CO INC	11,483	88.64	1,017,853.12	
BIO-RAD LABORATORIES- CL A	1,068	360.02	384,501.36	
BIOGEN INC	8,845	297.58	2,632,095.10	

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,614	84.99	732,103.86	
BLACK KNIGHT INC	7,221	63.08	455,500.68	
BLACKROCK INC	5,551	502.34	2,788,489.34	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	31,831	55.75	1,774,578.25	
BOEING CO	25,697	333.50	8,569,949.50	
BOOKING HOLDINGS INC	2,040	2,003.12	4,086,364.80	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,795	70.86	481,493.70	
BORGWARNER INC	9,901	44.90	444,554.90	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,946	44.83	3,001,189.18	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	112,679	62.85	7,081,875.15	
BROADCOM INC	19,151	324.10	6,206,839.10	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,519	122.54	676,298.26	
BROWN & BROWN INC	11,422	39.52	451,397.44	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	14,807	65.36	967,785.52	
BUNGE LIMITED	6,857	55.98	383,854.86	
BURLINGTON STORES INC	3,190	227.49	725,693.10	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,799	76.73	521,687.27	
CABOT OIL & GAS CORP	20,173	17.01	343,142.73	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	13,362	69.68	931,064.16	
CAMPBELL SOUP CO	8,012	48.22	386,338.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,528	103.38	2,328,944.64	
CAPRI HOLDINGS LIMITED	7,214	38.41	277,089.74	
CARDINAL HEALTH INC	14,384	50.61	727,974.24	
CARMAX INC	7,989	98.79	789,233.31	
CARNIVAL CORP	20,136	46.65	939,344.40	
CATERPILLAR INC	27,015	145.02	3,917,715.30	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,395	117.56	634,236.20	
CBRE GROUP INC	15,274	59.82	913,690.68	
CDK GLOBAL INC	5,837	54.94	320,684.78	
CDW CORP/DE	6,980	142.25	992,905.00	
CELANESE CORP-SERIES A	5,931	122.48	726,428.88	
CENTENE CORP	19,877	61.87	1,229,789.99	
CENTERPOINT ENERGY INC	24,254	26.78	649,522.12	
CENTURYLINK INC	47,851	13.33	637,853.83	
CERNER CORP	15,254	71.96	1,097,677.84	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,664	46.38	494,596.32	
CHARLES SCHWAB CORP	56,475	48.20	2,722,095.00	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	7,490	475.67	3,562,768.30	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,809	112.68	654,558.12	
CHENIERE ENERGY INC	11,279	61.48	693,432.92	
CHEVRON CORP	91,187	118.13	10,771,920.31	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,269	833.92	1,058,244.48	
CHUBB LTD	21,902	154.50	3,383,859.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,919	69.49	828,251.31	
CIGNA CORP	18,146	198.72	3,605,973.12	



CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,470	103.29	771,576.30	
CINTAS CORP	4,193	268.01	1,123,765.93	
CISCO SYSTEMS INC	205,558	47.88	9,842,117.04	
CITIGROUP INC	108,492	78.20	8,484,074.40	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,384	40.31	861,989.04	
CITRIX SYSTEMS INC	6,235	111.82	697,197.70	
CLOROX CO	6,052	151.48	916,756.96	
CME GROUP INC	17,235	204.72	3,528,349.20	
CMS ENERGY CORP	13,854	62.40	864,489.60	
COCA-COLA CO	195,290	54.32	10,608,152.80	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,196	50.01	559,911.96	
COGNEX CORP	8,161	56.14	458,158.54	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	26,428	62.71	1,657,299.88	
COLGATE-PALMOLIVE CO	39,170	68.34	2,676,877.80	
COMCAST CORP	218,203	43.64	9,522,378.92	
COMERICA INC	7,100	71.56	508,076.00	
CONAGRA BRANDS INC	23,405	33.66	787,812.30	
CONCHO RESOURCES INC	9,613	82.45	792,591.85	
CONOCOPHILLIPS	53,198	63.19	3,361,581.62	
CONSOLIDATED EDISON INC	15,992	89.70	1,434,482.40	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,034	185.82	1,492,877.88	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,371	33.92	148,264.32	
COOPER COS INC/THE	2,375	319.67	759,216.25	
COPART INC	9,914	89.40	886,311.60	
CORNING INC	37,459	28.92	1,083,314.28	
CORTEVA INC	36,127	27.71	1,001,079.17	
COSTAR GROUP INC	1,761	591.53	1,041,684.33	
COSTCO WHOLESALE CORP	21,118	293.71	6,202,567.78	
COTY INC-CL A	14,803	11.47	169,790.41	
CROWN HOLDINGS INC	6,540	70.69	462,312.60	
CSX CORP	36,790	72.59	2,670,586.10	
CUMMINS INC	7,190	179.30	1,289,167.00	
CVS HEALTH CORP	62,512	74.10	4,632,139.20	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,831	121.29	222,081.99	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	16,800	5.74	96,432.00	
DANAHER CORP	31,017	150.44	4,666,197.48	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,905	109.03	643,822.15	
DAVITA INC	4,971	73.75	366,611.25	
DEERE & CO	14,389	172.76	2,485,843.64	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,607	49.89	379,513.23	
DELTA AIR LINES INC	7,765	59.14	459,222.10	
DENTSPLY SIRONA INC	10,833	57.47	622,572.51	
DEVON ENERGY CORPORATION	19,046	25.11	478,245.06	
DEXCOM INC	4,409	216.33	953,798.97	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,430	87.48	649,976.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,276	86.32	1,318,624.32	
DISCOVERY INC-A	8,634	32.76	282,849.84	
DISCOVERY INC-C	16,869	30.39	512,648.91	

DISH NETWORK CORP	11,611	35.80	415,673.80	
DOCUSIGN INC	5,054	73.38	370,862.52	
DOLLAR GENERAL CORP	12,356	157.00	1,939,892.00	
DOLLAR TREE INC	11,392	92.10	1,049,203.20	
DOMINION ENERGY INC	39,634	81.80	3,242,061.20	
DOMINO'S PIZZA INC	1,884	292.00	550,128.00	
DOVER CORP	6,989	113.47	793,041.83	
DOW INC	35,781	54.52	1,950,780.12	
DR HORTON INC	16,937	52.35	886,651.95	
DROPBOX INC-CLASS A	11,466	18.16	208,222.56	
DTE ENERGY COMPANY	8,845	129.66	1,146,842.70	
DUKE ENERGY CORP	35,090	89.95	3,156,345.50	
DUPONT DE NEMOURS INC	35,801	63.95	2,289,473.95	
DXC TECHNOLOGY CO	12,575	37.76	474,832.00	
E*TRADE FINANCIAL	11,323	45.93	520,065.39	
EAST WEST BANCORP INC	6,795	48.85	331,935.75	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,539	79.91	522,531.49	
EATON CORP PLC	20,198	94.24	1,903,459.52	
EATON VANCE CORP	5,230	47.20	246,856.00	
EBAY INC	38,214	36.04	1,377,232.56	
ECOLAB INC	12,466	191.78	2,390,729.48	
EDISON INTERNATIONAL	17,254	73.42	1,266,788.68	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,993	233.22	2,330,567.46	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,082	28.95	494,523.90	
ELECTRONIC ARTS INC	14,133	107.34	1,517,036.22	
ELI LILLY & CO	41,768	130.85	5,465,342.80	
EMERSON ELECTRIC CO	29,454	76.09	2,241,154.86	
ENTERGY CORP	9,675	119.51	1,156,259.25	
EOG RESOURCES INC	27,790	81.25	2,257,937.50	
EPAM SYSTEMS INC	2,630	211.17	555,377.10	
EQUIFAX INC	5,828	137.78	802,981.84	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,233	168.79	208,118.07	
ESTEE LAUDER COS INC	10,626	204.29	2,170,785.54	
EVEREST RE GROUP LTD	1,982	275.55	546,140.10	
EVERGY INC	11,390	63.70	725,543.00	
EVERSOURCE ENERGY	15,626	83.78	1,309,146.28	
EXACT SCIENCES CORP	7,050	95.92	676,236.00	
EXELON CORP	46,646	44.98	2,098,137.08	
EXPEDIA GROUP INC	6,747	109.10	736,097.70	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	8,557	76.56	655,123.92	
EXXON MOBIL CORP	203,209	69.39	14,100,672.51	
F5 NETWORKS INC	2,805	143.69	403,050.45	
FACEBOOK INC-A	115,601	206.06	23,820,742.06	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,825	269.82	492,421.50	
FASTENAL CO	27,514	36.79	1,012,377.63	
FEDEX CORP	12,013	147.02	1,766,151.26	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,190	45.53	600,540.70	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,503	138.08	4,073,774.24	
FIFTH THIRD BANCORP	34,848	31.00	1,080,288.00	

FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,080	117.43	948,834.40	
FIRSTENERGY CORP	25,964	48.71	1,264,706.44	
FISERV INC	27,821	116.50	3,241,146.50	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,166	288.87	1,203,432.42	
FLEX LTD	24,770	12.80	317,056.00	
FLIR SYSTEMS INC	6,437	52.42	337,459.72	
FLOWSERVE CORP	6,283	49.06	308,243.98	
FMC CORP	6,265	98.37	616,288.05	
FORD MOTOR CO	188,790	9.41	1,776,513.90	
FORTINET INC	6,993	109.53	765,943.29	
FORTIVE CORP	14,450	76.65	1,107,592.50	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,742	65.26	439,982.92	
FOX CORP - CLASS A	16,744	37.00	619,528.00	
FOX CORP- CLASS B	8,699	36.05	313,598.95	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,072	26.14	367,842.08	
FREEPORT-MCMORAN INC	69,521	13.00	903,773.00	
GAP INC	10,607	17.80	188,804.60	
GARMIN LTD	6,396	97.64	624,505.44	
GARTNER INC	4,340	154.23	669,358.20	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,774	178.65	2,103,425.10	
GENERAL ELECTRIC CO	419,591	11.04	4,632,284.64	
GENERAL MILLS INC	29,062	53.20	1,546,098.40	
GENERAL MOTORS CO	61,745	37.26	2,300,618.70	
GENUINE PARTS CO	7,010	105.19	737,381.90	
GILEAD SCIENCES INC	60,791	65.29	3,969,044.39	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,437	183.39	2,647,601.43	
GLOBE LIFE INC	4,855	105.76	513,464.80	
GODADDY INC - CLASS A	8,597	68.48	588,722.56	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,522	229.94	3,569,128.68	
GRUBHUB INC	4,351	48.50	211,023.50	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,952	106.77	421,955.04	
HALLIBURTON CO	41,777	24.48	1,022,700.96	
HANESBRANDS INC	17,429	14.51	252,894.79	
HARLEY-DAVIDSON INC	7,569	37.36	282,777.84	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	17,335	60.78	1,053,621.30	
HASBRO INC	6,207	104.38	647,886.66	
HCA HEALTHCARE INC	13,092	145.39	1,903,445.88	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,031	40.01	321,320.31	
HEICO CORP	2,089	115.62	241,530.18	
HEICO CORP-CLASS A	3,661	89.62	328,098.82	
HENRY SCHEIN INC	7,065	69.06	487,908.90	
HERSHEY CO/THE	7,205	146.67	1,056,757.35	
HESS CORP	13,143	63.69	837,077.67	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	62,483	15.74	983,482.42	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,093	110.34	1,444,681.62	
HOLLYFRONTIER CORP	7,400	50.95	377,030.00	
HOLOGIC INC	12,857	52.23	671,521.11	
HOME DEPOT INC	52,615	220.22	11,586,875.30	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	34,560	176.50	6,099,840.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	57,100	5.61	320,331.00	

HORMEL FOODS CORP	14,015	44.70	626,470.50	
HP INC	70,963	20.30	1,440,548.90	
HUMANA INC	6,485	365.60	2,370,916.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,861	15.16	755,892.76	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,958	254.24	497,801.92	
IAC/INTERACTIVECORP	3,789	238.41	903,335.49	
IDEX CORP	3,625	168.00	609,000.00	
IDEXX LABORATORIES INC	4,145	256.19	1,061,907.55	
IHS MARKIT LTD	18,386	74.73	1,373,985.78	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	15,561	178.46	2,777,016.06	
ILLUMINA INC	7,058	325.20	2,295,261.60	
INCYTE CORP	8,817	91.14	803,581.38	
INGERSOLL-RAND PLC	11,628	133.55	1,552,919.40	
INGREDION INC	3,155	90.65	286,000.75	
INSULET CORP	2,923	170.53	498,459.19	
INTEL CORP	212,847	57.96	12,336,612.12	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	26,982	93.49	2,522,547.18	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	42,564	134.56	5,727,411.84	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	4,890	123.34	603,132.60	
INTERNATIONAL PAPER CO	17,930	45.97	824,242.10	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,889	22.79	430,480.31	
INTUIT INC	12,469	264.05	3,292,439.45	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,526	588.71	3,253,211.46	
INVESCO LTD	19,066	18.43	351,386.38	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,463	61.58	397,991.54	
IPG PHOTONICS CORP	1,767	146.29	258,494.43	
IQVIA HOLDINGS INC	8,066	149.69	1,207,399.54	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,666	146.09	535,565.94	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,513	88.54	576,661.02	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,800	55.05	594,540.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	10,800	30.56	330,048.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,695	152.27	410,367.65	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,295	115.52	496,158.40	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,107	21.28	257,636.96	
JM SMUCKER CO	5,484	104.51	573,132.84	
JOHNSON & JOHNSON	126,816	145.35	18,432,705.60	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	38,357	40.76	1,563,431.32	
JONES LANG LASALLE INC	2,454	170.62	418,701.48	
JPMORGAN CHASE & CO	153,623	137.35	21,100,119.05	
JUNIPER NETWORKS INC	16,446	24.43	401,775.78	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,991	153.04	763,822.64	
KELLOGG CO	12,312	66.78	822,195.36	
KEYCORP	48,152	20.22	973,633.44	

KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,037	103.86	938,582.82	
KIMBERLY-CLARK CORP	16,598	136.74	2,269,610.52	
KINDER MORGAN INC	98,259	20.84	2,047,717.56	
KKR & CO INC -A	23,589	29.78	702,480.42	
KLA CORPORATION	7,662	175.46	1,344,374.52	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,499	35.77	232,469.23	
KOHL'S CORP	7,774	50.48	392,431.52	
KRAFT HEINZ CO/THE	32,376	31.90	1,032,794.40	
KROGER CO	38,301	28.76	1,101,536.76	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,753	197.41	2,122,749.73	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	4,686	169.10	792,402.60	
LAM RESEARCH CORP	6,941	293.29	2,035,725.89	
LAMB WESTON HOLDING INC	7,023	84.20	591,336.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	16,583	69.18	1,147,211.94	
LEAR CORP	2,764	141.58	391,327.12	
LEGGETT & PLATT INC	6,387	51.26	327,397.62	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,601	96.28	635,544.28	
LENNAR CORP-CL A	13,712	55.24	757,450.88	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,689	238.36	402,590.04	
LIBERTY BROADBAND-C	5,192	122.59	636,487.28	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,493	22.77	170,615.61	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	20,637	21.79	449,680.23	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	4,167	47.69	198,724.23	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	7,970	47.30	376,981.00	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	9,893	46.17	456,759.81	
LINCOLN NATIONAL CORP	9,400	60.13	565,222.00	
LINDE PLC	26,006	209.40	5,445,656.40	
LIVE NATION INC	7,293	69.83	509,270.19	
LKQ CORP	14,759	35.75	527,634.25	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,236	383.15	4,688,223.40	
LOEWS CORP	12,963	51.17	663,316.71	
LOWE'S COS INC	37,291	120.21	4,482,751.11	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,322	224.13	1,192,819.86	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,849	95.33	1,224,895.17	
M&T BANK CORP	6,084	168.40	1,024,545.60	
MANPOWER GROUP	2,780	95.88	266,546.40	
MARATHON OIL CORP	38,287	13.18	504,622.66	
MARATHON PETROLEUM CORP	31,596	61.13	1,931,463.48	
MARKEL CORP	661	1,141.68	754,650.48	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,822	377.57	687,932.54	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	13,421	150.04	2,013,686.84	
MARSH & MCLENNAN COS INC	24,336	112.21	2,730,742.56	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,014	272.96	822,701.44	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,326	26.05	789,992.30
MASCO CORP	13,949	47.17	657,974.33
MASTERCARD INC-CLASS A	43,373	297.53	12,904,768.69
MATCH GROUP INC	2,761	77.35	213,563.35
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,018	61.29	797,873.22
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,930	168.31	998,078.30
MCDONALD'S CORP	36,521	197.06	7,196,828.26
MCKESSON CORP	8,900	135.61	1,206,929.00
MEDTRONIC PLC	64,496	113.49	7,319,651.04
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	10,158	24.33	247,144.14
MERCADOLIBRE INC	2,156	582.55	1,255,977.80
MERCK & CO INC	123,075	89.99	11,075,519.25
METLIFE INC	37,971	50.80	1,928,926.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,176	786.59	925,029.84
MGM MIRAGE	23,842	33.26	792,984.92
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,487	102.37	1,175,924.19
MICRON TECHNOLOGY INC	53,014	54.53	2,890,853.42
MICROSOFT CORP	348,545	155.71	54,271,941.95
MIDDLEBY CORP	2,684	111.36	298,890.24
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,939	136.02	399,762.78
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,123	53.25	485,799.75
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	69,218	55.15	3,817,372.70
MONGODB INC	2,039	130.96	267,027.44
MONSTER BEVERAGE CORP	19,554	63.47	1,241,092.38
MOODY'S CORP	8,188	238.20	1,950,381.60
MORGAN STANLEY	59,433	50.86	3,022,762.38
MOSAIC CO/THE	17,410	20.60	358,646.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,993	161.11	1,287,752.23
MSCI INC	4,079	259.78	1,059,642.62
MYLAN NV	24,611	19.38	476,961.18
NASDAQ INC	5,544	107.02	593,318.88
NATIONAL-OILWELL INC	18,339	24.34	446,371.26
NETAPP INC	11,395	63.23	720,505.85
NETFLIX INC	21,054	332.22	6,994,559.88
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,209	106.25	447,206.25
NEWELL BRANDS INC	19,454	18.95	368,653.30
NEWMONT GOLD CORP	39,237	40.88	1,604,008.56
NEWS CORP - CLASS A	18,704	13.92	260,359.68
NEXTERA ENERGY INC	23,054	240.65	5,547,945.10
NIELSEN HOLDINGS PLC	17,307	20.09	347,697.63
NIKE INC	60,144	101.15	6,083,565.60
NISOURCE INC	17,996	27.61	496,869.56
NOBLE ENERGY INC	22,966	23.35	536,256.10
NORDSTROM INC	5,221	40.74	212,703.54
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,830	191.92	2,462,333.60
NORTHERN TRUST CORP	9,789	107.17	1,049,087.13
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,734	342.21	2,646,652.14
NORTONLIFELOCK INC	29,673	26.02	772,091.46

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,255	55.34	567,511.70	
NRG ENERGY INC	12,030	40.31	484,929.30	
NUCOR CORP	14,380	56.53	812,901.40	
NVIDIA CORP	27,793	235.46	6,544,139.78	
NVR INC	168	3,705.49	622,522.32	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,430	125.95	1,691,508.50	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,680	442.65	1,628,952.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,017	38.70	1,664,757.90	
OGE ENERGY CORP	9,509	44.17	420,012.53	
OKTA INC	5,154	115.75	596,575.50	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,190	185.85	592,861.50	
OMNICOM GROUP	10,589	79.61	842,990.29	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	19,666	23.88	469,624.08	
ONEOK INC	19,901	73.98	1,472,275.98	
ORACLE CORP	112,170	53.24	5,971,930.80	
OWENS CORNING	5,244	65.47	343,324.68	
PACCAR INC	16,648	79.69	1,326,679.12	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,520	111.67	504,748.40	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,629	229.10	1,060,503.90	
PARKER HANNIFIN CORP	6,156	206.27	1,269,798.12	
PAYCHEX INC	15,528	85.00	1,319,880.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,404	261.76	629,271.04	
PAYPAL HOLDINGS INC	53,735	108.88	5,850,666.80	
PENTAIR PLC	7,561	45.45	343,647.45	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	21,115	16.90	356,843.50	
PEPSICO INC	67,187	136.47	9,169,009.89	
PERKINELMER INC	5,300	95.70	507,210.00	
PERRIGO CO PLC	6,212	54.46	338,305.52	
PFIZER INC	265,742	38.97	10,355,965.74	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	74,778	85.99	6,430,160.22	
PHILLIPS 66	21,480	112.81	2,423,158.80	
PINNACLE WEST CAPITAL	5,377	89.25	479,897.25	
PINTEREST INC- CLASS A	7,145	19.09	136,398.05	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,035	147.21	1,182,832.35	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,399	159.53	3,413,782.47	
POLARIS INC	2,796	98.97	276,720.12	
PPG INDUSTRIES INC	11,363	132.42	1,504,688.46	
PPL CORPORATION	34,708	35.72	1,239,769.76	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,338	55.10	734,923.80	
PROCTER & GAMBLE CO	120,322	124.92	15,030,624.24	
PROGRESSIVE CORP	28,026	71.11	1,992,928.86	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,216	94.24	1,810,915.84	
PTC INC	5,253	74.48	391,243.44	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,275	58.65	1,423,728.75	
PULTE GROUP INC	12,604	38.60	486,514.40	
PVH CORP	3,554	104.66	371,961.64	

QORVO INC	5,689	117.28	667,205.92	
QUALCOMM INC	58,445	88.49	5,171,798.05	
QUEST DIAGNOSTICS	6,457	107.99	697,291.43	
RALPH LAUREN CORP	2,472	117.53	290,534.16	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,890	91.05	536,284.50	
RAYTHEON CO	13,380	216.11	2,891,551.80	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,878	372.55	1,444,748.90	
REGIONS FINANCIAL CORP	47,643	17.30	824,223.90	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,967	164.18	487,122.06	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,152	197.79	425,644.08	
REPUBLIC SERVICES INC	10,930	88.81	970,693.30	
RESMED INC	6,944	156.04	1,083,541.76	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,472	167.49	581,525.28	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	5,448	61.95	337,503.60	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,629	202.84	1,141,786.36	
ROKU INC	4,120	137.73	567,447.60	
ROLLINS INC	7,024	32.75	230,036.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,994	351.98	1,757,788.12	
ROSS STORES INC	17,470	115.16	2,011,845.20	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,518	126.85	1,080,508.30	
RPM INTERNATIONAL INC	6,286	74.68	469,438.48	
S&P GLOBAL INC	11,840	272.48	3,226,163.20	
SABRE CORP	13,234	22.71	300,544.14	
SALESFORCE.COM INC	40,033	163.33	6,538,589.89	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,594	125.31	450,364.14	
SCHLUMBERGER LTD	66,597	39.61	2,637,907.17	
SEAGATE TECHNOLOGY	11,640	58.45	680,358.00	
SEALED AIR CORP	7,513	39.85	299,393.05	
SEATTLE GENETICS INC	5,695	114.84	654,013.80	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,942	66.97	397,935.74	
SEMPRA ENERGY	13,232	152.03	2,011,660.96	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,717	53.59	413,554.03	
SERVICENOW INC	9,025	278.48	2,513,282.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,000	577.85	2,311,400.00	
SIGNATURE BANK	2,655	135.15	358,823.25	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	76,121	7.08	538,936.68	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,249	117.85	972,144.65	
SMITH (A.O.) CORP	6,641	47.35	314,451.35	
SNAP INC - A	34,706	15.46	536,554.76	
SNAP-ON INC	2,624	167.75	440,176.00	
SOUTHERN CO	50,438	63.07	3,181,124.66	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,368	54.08	344,381.44	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	4,948	75.32	372,683.36	
SPLUNK INC	7,235	150.14	1,086,262.90	
SPRINT CORP	40,396	5.29	213,694.84	
SQUARE INC - A	16,484	64.55	1,064,042.20	



SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,026	60.97	672,255.22	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,286	165.87	1,208,528.82	
STARBUCKS CORP	57,545	88.52	5,093,883.40	
STATE STREET CORP	17,853	79.64	1,421,812.92	
STEEL DYNAMICS INC	10,377	34.59	358,940.43	
STERIS PLC	4,073	148.39	604,392.47	
STRYKER CORP	16,188	208.08	3,368,399.04	
SVB FINANCIAL GROUP	2,440	250.12	610,292.80	
SYNCHRONY FINANCIAL	28,692	36.44	1,045,536.48	
SYNOPSIS INC	7,184	139.50	1,002,168.00	
SYSCO CORP	23,430	84.49	1,979,600.70	
T ROWE PRICE GROUP INC	11,156	122.52	1,366,833.12	
T-MOBILE US INC	16,582	77.22	1,280,462.04	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,447	121.82	663,553.54	
TAPESTRY INC	13,796	26.39	364,076.44	
TARGA RESOURCES CORP	11,482	39.17	449,749.94	
TARGET CORP	24,565	128.70	3,161,515.50	
TE CONNECTIVITY LTD	16,090	95.41	1,535,146.90	
TECHNIPFMC PLC	20,630	20.48	422,502.40	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,742	339.89	592,088.38	
TELEFLEX INC	2,230	373.41	832,704.30	
TERADYNE INC	8,142	68.56	558,215.52	
TESLA, INC.	6,469	404.04	2,613,734.76	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	52,534	9.97	523,763.98	
TEXAS INSTRUMENTS INC	44,870	126.40	5,671,568.00	
TEXTRON INC	10,883	44.67	486,143.61	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,241	323.25	6,219,653.25	
TIFFANY & CO	5,220	133.45	696,609.00	
TJX COS INC	57,997	60.25	3,494,319.25	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,705	91.81	523,776.05	
TRANSDIGM GROUP INC	2,316	574.96	1,331,607.36	
TRANSUNION	9,074	85.32	774,193.68	
TRAVELERS COS INC/THE	12,491	136.47	1,704,646.77	
TRIMBLE INC	11,986	40.94	490,706.84	
TRIPADVISOR INC	5,100	30.34	154,734.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	64,489	56.14	3,620,412.46	
TWILIO INC - A	5,567	99.88	556,031.96	
TWITTER INC	35,309	32.03	1,130,947.27	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,867	296.43	553,434.81	
TYSON FOODS INC-CL A	14,172	89.74	1,271,795.28	
UBER TECHNOLOGIES INC	9,494	29.99	284,725.06	
UGI CORP	10,017	45.20	452,768.40	
ULTA BEAUTY INC	2,685	250.69	673,102.65	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,921	21.16	188,768.36	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	9,573	19.01	181,982.73	
UNION PACIFIC CORP	34,057	177.47	6,044,095.79	
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	2,994	89.22	267,124.68	
UNITED PARCEL SERVICE INC	33,657	118.56	3,990,373.92	
UNITED RENTALS INC	3,684	165.69	610,401.96	

UNITED TECHNOLOGIES CORP	39,383	148.71	5,856,645.93	
UNITEDHEALTH GROUP INC	45,536	294.62	13,415,816.32	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3,874	144.03	557,972.22	
UNUM GROUP	9,560	29.34	280,490.40	
US BANCORP	71,932	60.01	4,316,639.32	
VAIL RESORTS INC	1,935	245.05	474,171.75	
VALERO ENERGY CORP	19,863	94.59	1,878,841.17	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,341	141.86	615,814.26	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,257	139.77	874,540.89	
VERISIGN INC	5,097	190.20	969,449.40	
VERISK ANALYTICS INC	7,493	148.19	1,110,387.67	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	199,083	60.80	12,104,246.40	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,363	217.78	2,692,414.14	
VF CORP	16,254	96.90	1,575,012.60	
VIACOMCBS INC	26,280	41.95	1,102,446.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	82,953	186.54	15,474,052.62	
VISTRA ENERGY CORP	17,782	24.23	430,857.86	
VMWARE INC-CLASS A	3,930	148.68	584,312.40	
VOYA FINANCIAL INC	6,660	61.54	409,856.40	
VULCAN MATERIALS CO	6,381	141.71	904,251.51	
WABCO HOLDINGS INC	2,476	135.30	335,002.80	
WABTEC CORP	8,764	76.10	666,940.40	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,779	57.75	2,123,987.25	
WALMART INC	68,546	120.08	8,231,003.68	
WALT DISNEY CO	86,583	146.15	12,654,105.45	
WASTE CONNECTIONS INC	12,752	90.02	1,147,935.04	
WASTE MANAGEMENT INC	20,483	112.48	2,303,927.84	
WATERS CORP	3,184	231.87	738,274.08	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,984	85.81	256,057.04	
WEC ENERGY GROUP INC	15,306	92.18	1,410,907.08	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,416	326.93	789,862.88	
WELLS FARGO & CO	201,162	53.63	10,788,318.06	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,538	149.44	528,718.72	
WESTERN DIGITAL CORP	14,262	58.77	838,177.74	
WESTERN UNION CO	20,534	27.17	557,908.78	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,845	69.38	128,006.10	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	12,345	42.24	521,452.80	
WEYERHAEUSER CO	35,578	30.01	1,067,695.78	
WHIRLPOOL CORP	3,057	143.90	439,902.30	
WILLIAMS COS INC	58,525	23.50	1,375,337.50	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,186	203.85	1,261,016.10	
WIX.COM LTD	2,318	121.16	280,848.88	
WORKDAY INC-CLASS A	7,901	161.57	1,276,564.57	
WR BERKLEY CORP	7,077	68.74	486,472.98	
WW GRAINGER INC	2,225	334.84	745,019.00	
WYNN RESORTS LTD	4,645	139.84	649,556.80	
XCEL ENERGY INC	24,818	63.85	1,584,629.30	

	XEROX HOLDINGS CORP	9,549	37.03	353,599.47	
	XILINX INC	12,132	96.29	1,168,190.28	
	XPO LOGISTICS INC	4,571	78.21	357,497.91	
	XYLEM INC	8,657	77.59	671,696.63	
	YUM! BRANDS INC	14,645	99.82	1,461,863.90	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,697	34.56	404,248.32	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,603	253.13	658,897.39	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	6,160	44.94	276,830.40	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,874	148.80	1,469,251.20	
	ZIONS BANCORP, N.A.	8,339	51.49	429,375.11	
	ZOETIS INC	22,988	128.74	2,959,475.12	
アメリカ・ドル	小計	14,468,522		1,312,962,707.82 (143,677,509,117)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	46,393	11.25	521,921.25	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,121	22.62	206,317.02	
	ANGLO AMERICAN PLC	49,415	21.73	1,074,035.02	
	ANTOFAGASTA PLC	18,455	9.28	171,262.40	
	ASHTREAD GROUP PLC	22,126	24.10	533,236.60	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,987	26.04	442,341.48	
	ASTRAZENECA PLC	63,111	76.34	4,817,893.74	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	44,544	6.01	268,065.79	
	AVEVA GROUP PLC	3,118	46.42	144,737.56	
	AVIVA PLC	187,332	4.21	789,229.71	
	BAE SYSTEMS PLC	153,922	5.69	876,431.86	
	BARCLAYS PLC	828,903	1.83	1,519,379.19	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	49,144	7.36	361,994.70	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	5,722	49.60	283,811.20	
	BHP GROUP PLC	101,156	17.99	1,820,201.06	
	BP PLC	980,008	4.83	4,739,318.68	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	110,262	32.55	3,589,579.41	
	BT GROUP PLC	406,773	2.04	831,850.78	
	BUNZL PLC	16,190	20.42	330,599.80	
	BURBERRY GROUP PLC	19,701	21.51	423,768.51	
	CARNIVAL PLC	7,571	33.58	254,234.18	
	CENTRICA PLC	283,470	0.89	253,705.65	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	9,539	25.39	242,195.21	
	COMPASS GROUP PLC	76,311	18.69	1,426,252.59	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,135	48.66	298,529.10	
	DCC PLC	4,692	65.56	307,607.52	
	DIAGEO PLC	113,711	31.56	3,588,719.16	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	64,449	3.11	200,629.73	
	EASYJET PLC	7,710	14.30	110,253.00	
	EVRAZ PLC	24,924	4.00	99,920.31	
	EXPERIAN PLC	43,833	25.35	1,111,166.55	
	FERGUSON PLC	11,000	68.80	756,800.00	
	G4S PLC	75,412	2.12	160,401.32	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	240,049	18.06	4,336,245.13	

GLENCORE PLC	518,947	2.39	1,243,397.01	
GVC HOLDINGS PLC	28,002	8.66	242,665.33	
HALMA PLC	18,180	21.25	386,325.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,563	19.58	265,631.35	
HSBC HOLDINGS PLC	971,409	6.00	5,828,454.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	45,892	18.25	837,896.13	
INFORMA PLC	60,681	8.37	507,899.97	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,312	51.24	425,906.88	
INTERTEK GROUP PLC	7,774	57.80	449,337.20	
ITV PLC	175,218	1.50	263,878.30	
JD SPORTS FASHION PLC	21,048	8.16	171,793.77	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,129	30.45	277,978.05	
KINGFISHER PLC	99,898	2.19	219,675.70	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	285,995	3.08	881,436.59	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,373,392	0.63	2,155,597.48	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	15,197	74.60	1,133,696.20	
M&G PLC	121,977	2.36	288,841.53	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	93,200	2.19	204,108.00	
MEGGITT PLC	37,278	6.38	237,833.64	
MELROSE INDUSTRIES PLC	234,279	2.34	548,447.13	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	16,391	10.64	174,531.36	
MONDI PLC/WI	23,001	17.36	399,297.36	
MORRISON WM SUPERMARKETS	114,107	2.02	230,610.24	
NATIONAL GRID PLC	167,455	9.52	1,595,343.78	
NEXT PLC	6,396	71.32	456,162.72	
NMC HEALTH PLC	4,551	15.36	69,926.11	
OCADO GROUP PLC	22,269	12.37	275,467.53	
PEARSON PLC	37,331	6.15	229,585.65	
PERSIMMON PLC	15,312	26.64	407,911.68	
PRUDENTIAL PLC	124,445	14.40	1,792,630.22	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,106	59.69	2,035,787.14	
RELX PLC	93,608	19.02	1,780,892.20	
RENTOKIL INITIAL PLC	90,089	4.52	408,013.08	
RIO TINTO PLC	54,145	44.96	2,434,629.92	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	83,813	6.95	583,170.85	
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	3,778,394	0.00	3,778.39	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	232,989	2.47	576,414.78	
ROYAL DUTCH SHELL PLC- A SHS	204,447	22.69	4,638,902.43	
ROYAL DUTCH SHELL PLC- B SHS	180,530	22.72	4,102,544.25	
RSA INSURANCE GROUP PLC	49,317	5.56	274,202.52	
SAGE GROUP PLC	52,083	7.45	388,122.51	
SAINSBURY (J) PLC	84,652	2.33	197,662.42	
SCHRODERS PLC	5,889	33.87	199,460.43	
SEVERN TRENT PLC	11,511	25.16	289,616.76	

	SMITH & NEPHEW PLC	42,096	18.37	773,514.00	
	SMITHS GROUP PLC	18,917	17.06	322,724.02	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,545	90.00	319,050.00	
	SSE PLC	49,477	14.55	720,137.73	
	ST JAMES'S PLACE PLC	25,974	11.76	305,454.24	
	STANDARD CHARTERED PLC	131,200	7.38	969,043.20	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	115,206	3.29	379,603.77	
	TAYLOR WIMPEY PLC	158,276	1.91	303,256.81	
	TESCO PLC	470,700	2.52	1,186,634.70	
	TUI AG-DI	21,223	9.48	201,236.48	
	UNILEVER PLC	53,363	43.36	2,313,819.68	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,953	9.40	309,824.10	
	VODAFONE GROUP PLC	1,293,074	1.51	1,955,127.88	
	WEIR GROUP PLC/THE	12,404	15.49	192,199.98	
	WHITBREAD PLC	6,342	48.92	310,250.64	
	WPP PLC	61,034	10.48	639,941.49	
イギリス・ポンド 小計		18,223,175		88,209,917.52 (12,558,445,957)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	2,114	256.30	541,818.20	
	BANK HAPOLIM BM	54,832	27.75	1,521,588.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	71,275	24.54	1,749,088.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,178	555.30	654,143.40	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	33,606	16.06	539,712.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	55,944	15.96	892,866.24	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7,023	90.55	635,932.65	
	NICE LTD	2,999	542.90	1,628,157.10	
イスラエル・シュケル 小計		228,971		8,163,306.45 (256,654,355)	
オーストラリ ア・ドル	AGL ENERGY LTD	33,745	21.06	710,669.70	
	ALUMINA LTD	131,419	2.36	310,148.84	
	AMP LTD	170,145	1.91	324,976.95	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	28,469	34.83	991,575.27	
	ASX LTD	10,480	81.26	851,604.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	111,736	5.44	607,843.84	
	AUSNET SERVICES	131,873	1.76	232,755.84	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	138,878	24.89	3,456,673.42	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	28,490	9.98	284,330.20	
	BHP GROUP LIMITED	143,762	39.79	5,720,289.98	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,577	15.33	392,095.41	
	BORAL LTD	61,876	4.50	278,442.00	
	BRAMBLES LTD	79,151	12.22	967,225.22	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,118	34.30	449,947.40	
	CHALLENGER LTD	28,131	8.42	236,863.02	
	CIMIC GROUP LIMITED	5,500	33.54	184,470.00	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	28,233	11.38	321,291.54	
	COCHLEAR LTD	2,916	233.61	681,206.76	
	COLES GROUP LTD	56,283	15.37	865,069.71	

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	86,305	81.73	7,053,707.65		
COMPUTERSHARE LIMITED	25,938	17.30	448,727.40		
CROWN RESORTS LTD	21,671	12.31	266,770.01		
CSL LIMITED	21,997	282.56	6,215,472.32		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,006	44.30	133,165.80		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	68,440	10.95	749,418.00		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	32,781	4.14	135,713.34		
INCITEC PIVOT LTD	87,952	3.27	287,603.04		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	116,945	7.84	916,848.80		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	22,226	28.58	635,219.08		
MACQUARIE GROUP LTD	16,159	140.01	2,262,421.59		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,458	57.79	373,207.82		
MEDIBANK PRIVATE LTD	140,880	3.30	464,904.00		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	141,944	25.02	3,551,438.88		
NEWCREST MINING LIMITED	37,830	28.21	1,067,184.30		
OIL SEARCH LTD	71,938	7.44	535,218.72		
ORICA LTD	20,646	23.48	484,768.08		
ORIGIN ENERGY LIMITED	88,287	8.78	775,159.86		
QANTAS AIRWAYS LTD	39,683	7.40	293,654.20		
QBE INSURANCE GROUP LTD	66,820	13.15	878,683.00		
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	8,451	73.74	623,176.74		
REA GROUP LTD	2,822	108.19	305,312.18		
RIO TINTO LTD	18,325	102.26	1,873,914.50		
SANTOS LTD	89,373	8.41	751,626.93		
SEEK LTD	17,708	23.49	415,960.92		
SONIC HEALTHCARE LTD	24,221	29.41	712,339.61		
SOUTH32 LTD	246,744	2.86	705,687.84		
SUNCORP GROUP LTD	66,030	13.24	874,237.20		
TABCORP HOLDINGS LTD	107,982	4.78	516,153.96		
TELSTRA CORP LTD	215,460	3.69	795,047.40		
TPG TELECOM LTD	21,271	6.98	148,471.58		
TREASURY WINE ESTATES LTD	35,694	16.80	599,659.20		
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,108	22.30	158,508.40		
WESFARMERS LIMITED	56,213	41.90	2,355,324.70		
WESTPAC BANKING CORP	171,073	24.39	4,172,470.47		
WISETECH GLOBAL LTD	7,234	24.75	179,041.50		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,801	35.27	1,650,671.27		
WOOLWORTHS GROUP LTD	62,298	37.84	2,357,356.32		
WORLEY LIMITED	17,532	15.52	272,096.64		
オーストラリア・ドル 小計	3,570,028		64,863,823.15 (4,893,975,456)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,495	77.10	886,264.50	
	AIR CANADA	6,397	49.35	315,691.95	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,183	18.47	483,600.01	

ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	42,026	42.09	1,768,874.34	
ALTAGAS LTD	13,554	19.66	266,471.64	
ATCO LTD -CL 'I'	3,777	49.59	187,301.43	
AURORA CANNABIS INC	35,047	2.97	104,089.59	
BANK OF MONTREAL	30,704	101.71	3,122,903.84	
BANK OF NOVA SCOTIA	58,692	73.31	4,302,710.52	
BARRICK GOLD CORP	85,489	23.24	1,986,764.36	
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	15,226	39.27	597,925.02	
BCE INC	8,026	60.87	488,542.62	
BLACKBERRY LTD	24,837	7.63	189,506.31	
BOMBARDIER INC	103,269	1.95	201,374.55	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	43,024	76.60	3,295,638.40	
CAE INC	13,034	34.13	444,850.42	
CAMECO CORP	18,953	11.55	218,907.15	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	21,403	110.15	2,357,540.45	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	34,956	118.33	4,136,343.48	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	57,028	41.56	2,370,083.68	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,788	330.47	2,243,230.36	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,794	142.26	397,474.44	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,549	38.81	254,166.69	
CANOPY GROWTH CORP	10,159	26.35	267,689.65	
CCL INDUSTRIES INC -CL B	7,293	56.11	409,210.23	
CENOVUS ENERGY INC	50,024	13.00	650,312.00	
CGI INC	11,443	110.27	1,261,819.61	
CI FINANCIAL CORP	10,686	21.77	232,634.22	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	970	1,289.25	1,250,572.50	
CRONOS GROUP INC	9,001	9.08	81,729.08	
DOLLARAMA INC	14,456	44.28	640,111.68	
EMERA INC	11,914	54.53	649,670.42	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,415	30.72	258,508.80	
ENBRIDGE INC	97,391	51.35	5,001,027.85	
ENCANA CORP	61,694	5.89	363,377.66	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,296	604.82	783,846.72	
FIRST CAPITAL REALTY INC	9,289	21.05	195,533.45	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,131	13.38	443,292.78	
FORTIS INC	21,453	54.00	1,158,462.00	
FRANCO-NEVADA CORP	8,993	128.04	1,151,463.72	
GEORGE WESTON LTD	3,748	103.90	389,417.20	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,936	38.00	377,568.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	13,669	33.64	459,825.16	
HUSKY ENERGY INC	16,650	10.22	170,163.00	
HYDRO ONE LTD	16,488	25.27	416,651.76	
IA FINANCIAL CORP INC	5,140	70.44	362,061.60	
IGM FINANCIAL INC	4,327	38.22	165,377.94	
IMPERIAL OIL LTD	12,520	34.14	427,432.80	

INTACT FINANCIAL CORP	6,775	139.20	943,080.00	
INTER PIPELINE LTD	20,125	22.46	452,007.50	
KEYERA CORP	10,371	33.86	351,162.06	
KINROSS GOLD CORP	59,221	5.64	334,006.44	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,562	54.56	521,702.72	
LOBLAW COS LTD	8,811	67.66	596,152.26	
LUNDIN MINING CORP	31,980	7.78	248,804.40	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,238	73.33	1,044,072.54	
MANULIFE FINANCIAL CORP	93,904	26.02	2,443,382.08	
METHANEX CORP	3,145	51.60	162,282.00	
METRO INC	12,237	54.60	668,140.20	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,439	72.55	1,192,649.45	
NUTRIEN LTD	27,678	63.42	1,755,338.76	
ONEX CORPORATION	4,208	83.01	349,306.08	
OPEN TEXT CORP	12,966	57.28	742,692.48	
PARKLAND FUEL CORP	7,183	47.75	342,988.25	
PEMBINA PIPELINE CORP	24,667	48.37	1,193,142.79	
POWER CORP OF CANADA	14,845	33.65	499,534.25	
POWER FINANCIAL CORP	13,251	35.23	466,832.73	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	10,287	15.33	157,699.71	
QUEBECOR INC -CL B	9,082	33.40	303,338.80	
RESTAURANT BRANDS INTERN	12,913	85.28	1,101,220.64	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	17,695	64.84	1,147,343.80	
ROYAL BANK OF CANADA	68,925	103.83	7,156,482.75	
SAPUTO INC	11,295	39.77	449,202.15	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,312	26.45	616,602.40	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,845	516.06	2,500,310.70	
STARS GROUP INC/THE	11,082	33.04	366,149.28	
SUN LIFE FINANCIAL INC	28,425	59.31	1,685,886.75	
SUNCOR ENERGY INC	74,717	42.80	3,197,887.60	
TC ENERGY CORP	44,845	68.98	3,093,408.10	
TECK RESOURCES LTD-CL B	23,416	22.44	525,455.04	
THOMSON REUTERS CORP	9,962	94.24	938,818.88	
TORONTO-DOMINION BANK	87,430	73.59	6,433,973.70	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,587	57.32	148,286.84	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	21,511	36.83	792,250.13	
WSP GLOBAL INC	5,161	89.98	464,386.78	
カナダ・ドル 小計	1,978,433		93,573,996.62 (7,801,264,099)	
シンガポール・ ドル				
CAPITALAND LTD	127,800	3.72	475,416.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	10.86	228,060.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	108,900	2.38	259,182.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	86,000	25.94	2,230,840.00	
GENTING SINGAPORE LTD	284,400	0.93	265,914.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	30.61	143,867.00	
KEPPEL CORP LTD	70,000	6.75	472,500.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	155,200	10.95	1,699,440.00	



	SATS LTD	36,500	5.05	184,325.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	45,900	2.26	103,734.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,800	9.05	242,540.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	38,700	9.04	349,848.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	80,500	2.19	176,295.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	77,800	3.90	303,420.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	399,600	3.28	1,310,688.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	60,400	26.60	1,606,640.00	
	UOL Group Limited	22,600	8.12	183,512.00	
	VENTURE CORP LTD	13,100	16.00	209,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	93,000	4.09	380,370.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	112,400	1.08	121,392.00	
	シンガポール・ドル 小計	1,865,300		10,947,583.00 (884,236,279)	
スイス・フラン	ABB LTD	88,765	23.60	2,094,854.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,367	61.58	453,659.86	
	ALCON INC	19,934	55.80	1,112,317.20	
	BALOISE HOLDING AG	2,347	174.90	410,490.30	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	146	2,120.00	309,520.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	51	7,285.00	371,535.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	83,600.00	418,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	25,056	75.34	1,887,719.04	
	CLARIANT AG	9,461	21.34	201,897.74	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	122,566	13.32	1,633,191.95	
	DUFREY AG-REG	1,947	96.06	187,028.82	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	390	629.50	245,505.00	
	GEBERIT AG-REG	1,784	542.80	968,355.20	
	GIVAUDAN-REG	447	3,007.00	1,344,129.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,750	49.77	535,027.50	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,649	162.25	429,800.25	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	23,637	53.16	1,256,542.92	
	LONZA GROUP AG	3,576	350.70	1,254,103.20	
	NESTLE SA	143,027	104.12	14,891,971.24	
	NOVARTIS AG	103,241	92.15	9,513,658.15	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,850	80.30	148,555.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	896	870.60	780,057.60	
	ROCHE HOLDING AG	33,750	307.30	10,371,375.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,040	236.40	245,856.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,883	245.90	463,029.70	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	252	2,627.00	662,004.00	
	SIKA AG-BEARER	6,164	178.95	1,103,047.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,676	220.00	588,720.00	
	STRAUMANN HOLDING AG	492	939.60	462,283.20	

	SWATCH GROUP AG	1,304	270.20	352,340.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,608	490.90	789,367.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,823	111.30	425,499.90	
	SWISS RE AG	14,363	109.00	1,565,567.00	
	SWISSCOM AG	1,284	520.00	667,680.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,140	151.10	474,454.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,832	51.45	145,706.40	
	UBS GROUP AG	185,544	12.23	2,269,203.12	
	VIFOR PHARMA AG	2,189	178.50	390,736.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,205	398.40	2,870,472.00	
スイス・フラン	小計	839,441		64,295,261.59 (7,190,139,104)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	15,144	240.80	3,646,675.20	
	ASSA ABLOY AB	48,455	222.30	10,771,546.50	
	ATLAS COPCO AB	18,647	333.00	6,209,451.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	32,294	381.80	12,329,849.20	
	BOLIDEN AB	12,940	249.00	3,222,060.00	
	ELECTROLUX AB	10,942	233.60	2,556,051.20	
	EPIROC AB-A	32,061	116.40	3,731,900.40	
	EPIROC AB-B	18,692	113.40	2,119,672.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,418	300.60	8,843,050.80	
	HENNES & MAURITZ AB	38,730	192.70	7,463,271.00	
	HEXAGON AB-B SHS	12,600	531.20	6,693,120.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	20,182	75.60	1,525,759.20	
	ICA GRUPPEN AB	4,594	429.50	1,973,123.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,840	225.10	1,764,784.00	
	INVESTOR AB	21,936	515.00	11,297,040.00	
	KINNEVIK AB - B	11,741	227.00	2,665,207.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,584	403.00	1,444,352.00	
	LUNDIN PETROLEUM AB	9,189	314.10	2,886,264.90	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,610	453.00	729,330.00	
	NORDEA BANK ABP	156,892	75.55	11,853,190.60	
	SANDVIK AB	54,124	184.95	10,010,233.80	
	SECURITAS AB	15,190	161.90	2,459,261.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	79,325	87.42	6,934,591.50	
	SKANSKA AB-B SHS	16,602	210.50	3,494,721.00	
	SKF AB	18,219	193.45	3,524,465.55	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	74,822	100.80	7,542,057.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,850	136.00	5,963,600.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,185	481.20	3,938,622.00	
	TELE2 AB	25,288	137.15	3,468,249.20	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	148,446	83.00	12,321,018.00	
	TELIA CO AB	136,438	40.72	5,555,755.36	
	VOLVO AB	71,323	156.00	11,126,388.00	
スウェーデン・クローナ	小計	1,199,303		180,064,661.81 (2,092,351,370)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	200	9,070.00	1,814,000.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	307	9,622.00	2,953,954.00	
	CARLSBERG AS-B	5,150	984.00	5,067,600.00	

	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,072	527.00	2,672,944.00	
	COLOPLAST-B	5,686	813.60	4,626,129.60	
	DANSKE BANK A/S	31,204	105.75	3,299,823.00	
	DEMANT A/S	5,185	211.40	1,096,109.00	
	DSV PANALPINA A/S	10,573	756.00	7,993,188.00	
	GENMAB A/S	3,121	1,466.50	4,576,946.50	
	H LUNDBECK A/S	3,350	257.60	862,960.00	
	ISS A/S	7,637	158.25	1,208,555.25	
	NOVO-NORDISK A/S	84,946	384.95	32,699,962.70	
	NOVOZYMES A/S	10,182	319.10	3,249,076.20	
	ORSTED A/S	9,093	665.80	6,054,119.40	
	PANDORA A/S	4,816	281.50	1,355,704.00	
	TRYGVESTA AS	6,069	194.80	1,182,241.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,086	678.00	6,160,308.00	
デンマーク・クローネ 小計		201,677		86,873,620.85 (1,414,302,547)	
ニュージーランド・ドル	A2 MILK CO LTD	35,286	15.49	546,580.14	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,102	8.99	441,426.98	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	27,634	23.15	639,727.10	
	FLETCHER BUILDING LTD	41,511	5.27	218,762.97	
	MERCURY NZ LTD	34,676	4.91	170,259.16	
	MERIDIAN ENERGY LTD	63,597	4.83	307,173.51	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	19,792	16.00	316,672.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	93,158	4.40	409,895.20	
ニュージーランド・ドル 小計		364,756		3,050,497.06 (220,642,452)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	5,246	280.30	1,470,453.80	
	DNB ASA	45,847	161.30	7,395,121.10	
	EQUINOR ASA	47,770	173.50	8,288,095.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,995	182.50	1,824,087.50	
	MOWI ASA	21,285	227.20	4,835,952.00	
	NORSK HYDRO ASA	64,182	32.53	2,087,840.46	
	ORKLA ASA	36,525	89.18	3,257,299.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,854	247.80	1,202,821.20	
	TELENOR ASA	35,992	158.70	5,711,930.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,648	361.50	3,126,252.00	
ノルウェー・クローネ 小計		280,344		39,199,852.96 (478,238,206)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	20,395	16.26	331,622.70	
	ACCOR	8,400	41.35	347,340.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,663	34.79	440,545.77	
	ADIDAS AG	8,673	288.35	2,500,859.55	
	ADP	1,486	173.70	258,118.20	
	ADYEN NV	502	734.80	368,869.60	
	AEGON NV	84,785	4.19	355,418.72	
	AENA SME SA	3,352	171.25	574,030.00	
	AGEAS	8,530	53.46	456,013.80	
	AIB GROUP PLC	38,546	3.19	123,115.92	
	AIR LIQUIDE	22,720	125.10	2,842,272.00	
	AIRBUS SE	28,065	130.82	3,671,463.30	
	AKZO NOBEL NV	11,026	89.73	989,362.98	
	ALLIANZ SE	20,348	218.95	4,455,194.60	

ALSTOM RGPT	9,244	42.07	388,895.08
ALTICE NV - A-W/I	32,895	5.71	187,830.45
AMADEUS IT GROUP SA	20,651	72.48	1,496,784.48
AMUNDI SA	2,919	69.40	202,578.60
ANDRITZ AG	3,545	38.40	136,128.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,617	72.17	2,642,648.89
ARCELORMITTAL	31,319	16.51	517,264.60
ARKEMA	3,256	94.40	307,366.40
AROUNDTOWN SA	45,383	7.91	359,251.82
ASML HOLDING NV	20,440	261.10	5,336,884.00
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	52,620	18.49	973,206.90
ATLANTIA SPA	24,299	22.14	537,979.86
ATOS SE	4,695	75.82	355,974.90
AXA	92,840	25.04	2,324,713.60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	318,840	5.15	1,643,301.36
BANCO DE SABADELL SA	267,829	1.10	295,415.38
BANCO SANTANDER SA	795,556	3.79	3,019,930.57
BANK OF IRELAND GROUP PLC	45,924	4.87	223,925.42
BANKIA SA	59,124	1.93	114,345.81
BANKINTER SA	32,276	6.68	215,603.68
BASF SE	43,964	67.29	2,958,337.56
BAYER AG	44,811	71.01	3,182,029.11
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,765	74.10	1,168,186.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,803	55.95	156,827.85
BEIERSDORF AG	4,815	105.05	505,815.75
BIOMERIEUX	1,993	80.15	159,738.95
BNP PARIBAS	54,011	53.51	2,890,128.61
BOLLORE	47,069	3.86	182,062.89
BOUYGUES	10,872	38.02	413,353.44
BRENTAG AG	7,309	48.85	357,044.65
BUREAU VERITAS SA	14,256	23.59	336,299.04
CAIXABANK	172,153	2.86	492,529.73
CAPGEMINI SA	7,605	111.00	844,155.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,942	115.60	224,495.20
CARREFOUR SA	29,004	15.07	437,090.28
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,664	42.44	113,060.16
CELLNEX TELECOM SAU	12,308	37.05	456,011.40
CIE DE SAINT-GOBAIN	23,694	37.20	881,416.80
CNH INDUSTRIAL NV	48,779	9.76	476,375.71
CNP ASSURANCES	8,253	17.39	143,519.67
COLRUYT NV	2,599	47.34	123,036.66
COMMERZBANK AG	46,902	5.63	264,105.16
CONTINENTAL AG	5,268	116.64	614,459.52
COVESTRO AG	8,187	41.85	342,625.95
CREDIT AGRICOLE SA	55,551	13.15	730,495.65
CRH PLC	38,206	35.53	1,357,459.18
DAIMLER AG	43,812	49.91	2,186,656.92
DANONE	29,716	73.98	2,198,389.68
DASSAULT AVIATION SA	120	1,160.00	139,200.00
DASSAULT SYSTEMES SA	6,312	146.50	924,708.00

DAVIDE CAMPARI -MILANO SPA	27,778	8.14	226,112.92	
DELIVERY HERO SE	5,485	68.04	373,199.40	
DEUTSCHE BANK AG	94,340	7.12	671,700.80	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,173	137.75	1,263,580.75	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	11,259	16.64	187,349.76	
DEUTSCHE POST AG	47,829	34.24	1,637,664.96	
DEUTSCHE TELEKOM AG	161,801	14.73	2,383,975.93	
DEUTSCHE WOHNEN SE	17,422	35.94	626,146.68	
E.ON SE	107,799	9.57	1,031,744.22	
EDENRED	11,859	45.77	542,786.43	
EDF	29,439	9.85	290,033.02	
EIFFAGE	3,847	101.60	390,855.20	
ELISA OYJ	7,032	49.24	346,255.68	
ENAGAS SA	10,997	22.47	247,102.59	
ENDESA SA	15,459	24.50	378,745.50	
ENEL SPA	391,584	7.00	2,741,479.58	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	123,945	3.83	475,453.02	
ENGIE	87,968	14.50	1,275,536.00	
ENI -ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	121,705	13.84	1,685,127.43	
ERSTE GROUP BANK AG	14,461	34.14	493,698.54	
ESSILORLUXOTTICA	13,653	138.40	1,889,575.20	
EURAZEO	1,954	62.00	121,148.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	560	497.20	278,432.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,686	14.80	128,552.80	
EVONIK INDUSTRIES AG	8,663	26.82	232,341.66	
EXOR NV	5,140	70.22	360,930.80	
FAURECIA	3,652	49.65	181,321.80	
FERRARI NV	5,806	149.85	870,029.10	
FERROVIAL S.A.	24,045	26.80	644,406.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	51,999	13.60	707,290.39	
FINCOBANK SPA	29,077	10.92	317,666.22	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	3,735	106.55	397,964.25	
FORTUM OYJ	21,426	22.27	477,157.02	
FRAPORT AG	2,079	75.00	155,925.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,187	64.94	661,543.78	
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,033	49.52	992,034.16	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	3,230	43.30	139,859.00	
GALAPAGOS NV	2,090	186.50	389,785.00	
GALP ENERGIA SGPS SA	23,826	15.04	358,462.17	
GEA GROUP AG	7,434	29.33	218,039.22	
GETLINK SE - REGR	22,671	15.62	354,121.02	
GRIFOLS SA	14,348	31.42	450,814.16	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,812	93.66	357,031.92	
HANNOVER RUECK SE	2,883	173.50	500,200.50	
HEIDELBERGCEMENT AG	7,081	65.26	462,106.06	
HEINEKEN HOLDING NV	5,518	85.95	474,272.10	
HEINEKEN NV	12,427	94.52	1,174,600.04	
HENKEL AG & CO KGAA	5,054	83.60	422,514.40	
HENKEL KGAA -VORZUG	8,449	91.04	769,196.96	
HERMES INTERNATIONAL	1,518	664.80	1,009,166.40	
HOCHTIEF AG	1,202	114.80	137,989.60	

IBERDROLA SA	290,760	9.12	2,651,731.20
ILIAD SA	1,311	115.45	151,354.95
INDITEX SA	52,354	31.27	1,637,109.58
INFINEON TECHNOLOGIES AG	59,880	20.60	1,233,528.00
ING GROEP NV-CVA	186,733	10.89	2,034,269.30
INGENICO GROUP	2,930	97.48	285,616.40
INTESA SANPAOLO	716,643	2.38	1,705,610.34
IPSEN	1,798	80.10	144,019.80
JC DECAUX SA	4,241	27.22	115,440.02
JERONIMO MARTINS	11,830	14.58	172,481.40
KBC GROEP NV	11,921	67.88	809,197.48
KERING	3,640	577.80	2,103,192.00
KERRY GROUP PLC-A	7,613	112.40	855,701.20
KINGSPAN GROUP PLC	7,394	52.05	384,857.70
KION GROUP AG	3,098	62.46	193,501.08
KNORR-BREMSE AG	2,337	91.00	212,667.00
KONE OYJ	16,350	58.32	953,532.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	56,777	22.72	1,289,973.44
KONINKLIJKE DSM NV	8,707	115.30	1,003,917.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	43,482	43.31	1,883,205.42
L'OREAL SA	12,123	258.90	3,138,644.70
LANXESS	3,928	59.84	235,051.52
LEGRAND SA	12,844	73.70	946,602.80
LEONARDO SPA	19,162	10.63	203,692.06
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	13,351	402.25	5,370,439.75
MAPFRE SA	49,582	2.35	116,963.93
MEDIOBANCA SPA	29,956	9.98	299,140.61
MERCK KGAA	6,204	104.10	645,836.40
METRO AG	8,704	14.00	121,856.00
METSO OYJ	4,998	35.65	178,178.70
MICHELIN (C.G.D.E.)	8,229	111.05	913,830.45
MONCLER SPA	8,624	40.32	347,719.68
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	2,499	252.60	631,247.40
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	6,924	265.90	1,841,091.60
NATIXIS	46,052	3.97	182,918.54
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,438	22.74	328,320.12
NESTE OYJ	20,251	29.88	605,099.88
NN GROUP NV	14,673	34.20	501,816.60
NOKIA OYJ	271,486	3.25	882,329.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,950	25.83	153,688.50
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	3,271	47.02	153,802.42
OMV AG	7,004	50.58	354,262.32
ORANGE S.A.	97,549	13.25	1,293,011.99
ORION OYJ-CLASS B	4,995	42.06	210,089.70
PERNOD-RICARD	10,210	159.00	1,623,390.00
PEUGEOT SA	28,285	22.30	630,755.50
PIRELLI & C SPA	19,516	5.13	100,195.14
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	7,209	67.62	487,472.58
POSTE ITALIANE SPA	26,410	10.29	271,890.95
PROSUS	23,407	65.50	1,533,158.50
PROXIMUS	7,768	25.99	201,890.32

PRYSMIAN SPA	11,750	21.77	255,797.50	
PUBLICIS GROUPE	10,550	40.26	424,743.00	
PUMA AG	4,025	66.85	269,071.25	
QIAGEN NV	10,924	36.86	402,658.64	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	7,054	22.83	161,042.82	
RANDSTAD NV	5,608	54.88	307,767.04	
RECORDATI SPA	5,045	37.58	189,591.10	
RED ELECTRICA DE ESPANA	20,662	17.83	368,403.46	
REMY COINTREAU	1,080	108.00	116,640.00	
RENAULT SA	9,239	43.43	401,249.77	
REPSOL SA	68,933	13.98	963,683.34	
REPSOL SA-RTS	68,933	0.42	29,158.65	
ROYAL KPN NV	179,489	2.67	479,235.63	
RWE AG	28,186	26.62	750,311.32	
SAFRAN SA	15,741	139.85	2,201,378.85	
SAMPO OYJ	21,358	38.99	832,748.42	
SANOFI	54,183	90.09	4,881,346.47	
SAP SE	47,202	119.56	5,643,471.12	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,710	191.60	327,636.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,335	145.30	193,975.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,552	91.60	2,432,163.20	
SCOR REGROUPE	7,710	37.40	288,354.00	
SEB SA	1,087	136.00	147,832.00	
SIEMENS AG	36,731	117.44	4,313,688.64	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,555	15.72	181,702.37	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,193	42.22	303,724.42	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,848	33.80	366,662.40	
SNAM SPA	98,991	4.62	457,338.42	
SOCIETE GENERALE	38,925	31.07	1,209,594.37	
SODEXO	4,274	105.30	450,052.20	
SOLVAY SA	3,547	104.30	369,952.10	
STMICROELECTRONICS NV	32,805	24.08	789,944.40	
STORA ENSO OYJ	27,199	12.49	339,715.51	
SUEZ	16,830	13.77	231,833.25	
SYMRISE AG	6,212	91.28	567,031.36	
TELECOM ITALIA SPA	723,372	0.55	404,364.94	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	47,174	2.62	124,020.44	
TELEFONICA SA	226,560	6.47	1,467,655.68	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,388	39.36	93,991.68	
TELEPERFORMANCE	2,841	215.80	613,087.80	
TENARIS SA	22,020	10.11	222,622.20	
TERNA SPA	68,081	5.89	401,405.57	
THALES SA	5,114	91.82	469,567.48	
THYSSENKRUPP AG	19,636	12.11	237,791.96	
TOTAL SA	115,174	49.00	5,643,526.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,067	60.44	245,809.48	
UCB SA	6,023	72.84	438,715.32	
UMICORE	9,439	43.03	406,160.17	
UNICREDIT SPA	95,692	13.49	1,291,267.84	
UNILEVER NV	70,548	51.18	3,610,646.64	
UNIPER SE	9,645	29.93	288,674.85	

	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,973	29.27	174,829.71	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,308	30.64	775,437.12	
	VALEO SA	11,678	32.47	379,184.66	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,051	23.82	620,534.82	
	VINCI SA	24,657	97.38	2,401,098.66	
	VIVENDI SA	41,425	25.40	1,052,195.00	
	VOESTALPINE AG	5,492	25.02	137,409.84	
	VOLKSWAGEN AG	1,737	175.10	304,148.70	
	VOLKSWAGEN AG	8,788	177.10	1,556,354.80	
	VONOVIA SE	25,062	47.13	1,181,172.06	
	VOPAK	3,378	48.36	163,360.08	
	WARTSILA OYJ	21,154	9.93	210,186.14	
	WENDEL	1,385	118.90	164,676.50	
	WIRECARD AG	5,651	105.00	593,355.00	
	WOLTERS KLUWER NV	13,500	64.00	864,000.00	
	WORLDLINE SA	4,826	62.40	301,142.40	
	ZALANDO SE	6,686	44.58	298,061.88	
ユーロ	小計	9,443,318		200,268,144.61 (24,368,627,836)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	582,075	80.15	46,653,311.25	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	14,800	108.00	1,598,400.00	
	BANK OF EAST ASIA	63,600	17.84	1,134,624.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	178,039	27.35	4,869,366.65	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	64,500	28.00	1,806,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	124,909	54.00	6,745,086.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	131,409	73.60	9,671,702.40	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	32,500	55.50	1,803,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	79,643	82.60	6,578,511.80	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	102,810	56.70	5,829,327.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	100,157	16.62	1,664,609.34	
	HANG SENG BANK LTD	37,012	160.80	5,951,529.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	71,641	37.85	2,711,611.85	
	HONG KONG & CHINA GAS	491,048	15.08	7,405,003.84	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	57,511	255.00	14,665,305.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	34,000	24.80	843,200.00	
	MTR CORP	78,755	46.20	3,638,481.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	304,669	10.40	3,168,557.60	
	NWS HOLDINGS LTD	79,000	11.24	887,960.00	
	PCCW LTD	253,000	4.66	1,178,980.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	67,087	56.55	3,793,769.85	
	SANDS CHINA LTD	116,980	40.05	4,685,049.00	
	SINO LAND CO	156,000	11.30	1,762,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	8.74	830,300.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	77,023	117.00	9,011,691.00	
	SWIRE PACIFIC LTD	24,366	71.40	1,739,732.40	
	SWIRE PROPERTIES LTD	58,800	25.15	1,478,820.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	66,000	62.60	4,131,600.00	



VITASOY INTL HOLDINGS LTD	36,000	28.70	1,033,200.00	
WH GROUP LTD	460,000	7.73	3,555,800.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	59,733	44.70	2,670,065.10	
WHEELOCK & CO LTD	41,000	50.75	2,080,750.00	
WYNN MACAU LTD	75,303	18.66	1,405,153.98	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	36,500	23.10	843,150.00	
香港・ドル 小計	4,250,870		167,827,198.66 (2,356,293,869)	
合計	56,914,138		208,192,680,647 (208,192,680,647)	

## 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	27,252.00	482,087.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,418.00	865,904.76	
		AMERICAN TOWER REIT INC	21,330.00	4,782,186.00	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	72,440.00	690,353.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,664.00	1,384,379.36	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,356.00	998,135.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,567.00	481,453.14	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	20,049.00	2,805,256.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,015.00	1,191,785.00	
		DUKE REALTY CORP	17,049.00	584,439.72	
		EQUINIX INC	4,087.00	2,353,785.04	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,369.00	574,531.85	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,731.00	1,424,863.16	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,160.00	943,828.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,238.00	647,816.30	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,531.00	451,508.97	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23,542.00	774,296.38	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,468.00	642,483.52	
		INVITATION HOMES INC	23,699.00	692,721.77	
		IRON MOUNTAIN INC	13,926.00	444,378.66	
		KIMCO REALTY CORP	20,141.00	413,696.14	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	7,472.00	441,968.80	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,802.00	484,132.68	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,454.00	705,311.28	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,779.00	406,219.38	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,563.00	436,885.68	
		PROLOGIS INC	30,265.00	2,642,437.15	
		PUBLIC STORAGE	7,553.00	1,587,036.36	
		REALTY INCOME CORP	15,213.00	1,100,660.55	
		REGENCY CENTERS CORP	7,907.00	494,503.78	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,465.00	1,301,489.75			
SIMON PROPERTY GROUP INC	14,790.00	2,149,726.50			
SL GREEN REALTY CORP	3,871.00	350,441.63			
SUN COMMUNITIES INC	4,396.00	651,531.16			

	UDR INC	14,086.00	650,491.48	
	VENTAS INC	17,914.00	1,014,290.68	
	VEREIT	51,214.00	471,680.94	
	VICI PROPERTIES INC	22,413.00	567,497.16	
	VORNADO REALTY TRUST	7,959.00	535,401.93	
	WELLTOWER INC	19,489.00	1,540,605.45	
	WP CAREY INC	8,219.00	640,095.72	
アメリカ・ドル 小計		636,856.00	41,802,299.43 (4,574,425,627)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,298.00	259,455.93	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	33,624.00	323,731.87	
	SEGRO PLC	51,479.00	454,456.61	
イギリス・ポンド 小計		127,401.00	1,037,644.41 (147,729,435)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	57,705.00	685,535.40	
	GOODMAN GROUP	82,265.00	1,142,660.85	
	GPT GROUP	104,375.00	606,418.75	
	MIRVAC GROUP	205,513.00	661,751.86	
	SCENTRE GROUP	270,107.00	1,048,015.16	
	STOCKLAND	123,540.00	595,462.80	
	VICINITY CENTRES	177,891.00	458,958.78	
オーストラリア・ドル 小計		1,021,396.00	5,198,803.60 (392,249,732)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,640.00	195,540.80	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	7,057.00	147,985.29	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,338.00	197,612.34	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,497.00	109,840.77	
カナダ・ドル 小計		21,532.00	650,979.20 (54,272,136)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	140,600.00	409,146.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	126,700.00	249,599.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	124,000.00	298,840.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	97,100.00	227,214.00	
	SUNTEC REIT	92,400.00	168,168.00	
シンガポール・ドル 小計		580,800.00	1,352,967.00 (109,279,145)	
ユーロ	COVIVIO	2,328.00	234,196.80	
	GECINA SA	2,159.00	340,042.50	
	ICADE	1,486.00	139,981.20	
	KLEPIERRE	9,475.00	311,443.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,653.00	929,756.75	
ユーロ 小計		22,101.00	1,955,420.50 (237,935,567)	
香港・ドル	LINK REIT	100,871.00	7,958,721.90	
香港・ドル 小計		100,871.00	7,958,721.90 (111,740,455)	
投資証券 合計			5,627,632,097 (5,627,632,097)	
合計			5,627,632,097 (5,627,632,097)	

(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 610銘柄	64.77%	-%	69.33%
	投資証券 41銘柄	-%	2.06%	
イギリス・ポンド	株式 94銘柄	5.66%	-%	5.94%
	投資証券 3銘柄	-%	0.07%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12%	-%	0.12%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	2.21%	-%	2.47%
	投資証券 7銘柄	-%	0.18%	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.52%	-%	3.67%
	投資証券 4銘柄	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.40%	-%	0.46%
	投資証券 5銘柄	-%	0.05%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.24%	-%	3.36%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.94%	-%	0.98%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64%	-%	0.66%
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	0.10%	-%	0.10%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.22%	-%	0.22%
ユーロ	株式 234銘柄	10.98%	-%	11.51%
	投資証券 5銘柄	-%	0.11%	
香港・ドル	株式 34銘柄	1.06%	-%	1.15%
	投資証券 1銘柄	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	254,388,776	8,747,143
コール・ローン	421,947,955	801,991,714
国債証券	62,523,268,620	57,556,949,870
地方債証券	8,969,579,880	7,194,972,966
特殊債券	10,322,494,916	8,297,600,981
社債券	7,230,301,400	5,727,607,300
未収利息	145,371,024	117,745,701
前払費用	2,061,148	1,039,911
流動資産合計	89,869,413,719	79,706,655,586
資産合計	89,869,413,719	79,706,655,586
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,216,515	59,199,520
その他未払費用	7,921	873
流動負債合計	2,224,436	59,200,393
負債合計	2,224,436	59,200,393
純資産の部		
元本等		
元本	92,267,281,358	80,678,394,417
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,400,092,075	1,030,939,224
純資産合計	89,867,189,283	79,647,455,193
負債純資産合計	89,869,413,719	79,706,655,586

## 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	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の 利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価してありま す。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法 によっております。
--------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 受益権総口数	92,267,281,358口	80,678,394,417口
2. 投資信託財産の計算に関する規 則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	2,400,092,075円	1,030,939,224円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9740円 (9,740円)	0.9872円 (9,872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 2017年12月21日 至 2018年12月20日	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	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	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年12月20日現在	2019年12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)
国債証券	71,852,250	56,035,160
地方債証券	40,935,354	58,907,611
特殊債券	29,399,296	69,443,080
社債券	35,409,400	44,495,000
合計	177,596,300	228,880,851

(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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」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	2018年12月20日現在	2019年12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	133,118,904,527円	92,267,281,358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	3,784,155,877円	6,791,748,562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	44,635,779,046円	18,380,635,503円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	90,670,986,568円	76,301,963,543円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,236,642,704円	1,941,715,464円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	7,680,484円	36,321,282円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	221,701,666円	1,720,704,118円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	6,696,798円	38,861,533円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	15,824,776円	125,831,324円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	51,438,642円	325,714,099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)	27,837,167円	79,888,009円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	2,745,823円	4,828,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	8,286,471円	26,641,035円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	17,440,259円	31,405,110円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	2,777,513円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	3,118,191円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	7,907,384円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	30,717,529円
計	92,267,281,358円	80,678,394,417円



「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12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	92,029,121,671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	6,631,883,889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	17,982,611,143円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	76,301,963,543円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,941,715,464円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	36,321,282円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,720,704,118円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	38,861,533円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	125,831,324円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	325,714,099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)	79,888,009円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	4,828,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	26,641,035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)	31,405,110円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,777,513円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3,118,191円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,907,384円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	30,717,529円
計	80,678,394,417円

### 附属明細表(2019年12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
国債証券	第396回 利付国債(2年)	528,000,000	529,188,000	
	第397回 利付国債(2年)	460,000,000	461,094,800	
	第398回 利付国債(2年)	448,000,000	449,142,400	
	第399回 利付国債(2年)	520,000,000	521,419,600	
	第400回 利付国債(2年)	492,000,000	493,397,280	
	第401回 利付国債(2年)	501,000,000	502,513,020	
	第402回 利付国債(2年)	140,000,000	140,446,600	
	第403回 利付国債(2年)	53,000,000	53,174,370	
	第404回 利付国債(2年)	341,000,000	342,183,270	
	第406回 利付国債(2年)	151,000,000	151,575,310	
	第127回 利付国債(5年)	491,000,000	492,335,520	
	第128回 利付国債(5年)	350,000,000	351,095,500	
	第129回 利付国債(5年)	278,000,000	278,992,460	
	第130回 利付国債(5年)	272,000,000	273,085,280	
	第131回 利付国債(5年)	516,000,000	518,368,440	
	第132回 利付国債(5年)	221,000,000	222,129,310	
	第133回 利付国債(5年)	322,000,000	323,857,940	
	第134回 利付国債(5年)	270,000,000	271,660,500	
	第135回 利付国債(5年)	324,000,000	326,209,680	

第137回 利付国債(5年)	229,000,000	230,719,790
第138回 利付国債(5年)	539,000,000	543,101,790
第1回 利付国債(40年)	110,000,000	167,949,100
第2回 利付国債(40年)	142,000,000	211,118,500
第3回 利付国債(40年)	133,000,000	199,191,440
第4回 利付国債(40年)	182,000,000	275,262,260
第5回 利付国債(40年)	182,000,000	267,061,340
第6回 利付国債(40年)	163,000,000	236,115,280
第7回 利付国債(40年)	184,000,000	256,805,120
第8回 利付国債(40年)	169,000,000	221,195,650
第9回 利付国債(40年)	176,000,000	172,719,360
第10回 利付国債(40年)	269,000,000	309,581,340
第11回 利付国債(40年)	162,000,000	181,384,920
第313回 利付国債(10年)	291,000,000	296,124,510
第314回 利付国債(10年)	106,000,000	107,603,780
第315回 利付国債(10年)	109,000,000	111,130,950
第316回 利付国債(10年)	91,000,000	92,643,460
第318回 利付国債(10年)	55,000,000	56,060,400
第320回 利付国債(10年)	65,000,000	66,420,250
第321回 利付国債(10年)	69,000,000	70,702,230
第323回 利付国債(10年)	32,000,000	32,798,720
第324回 利付国債(10年)	99,000,000	101,223,540
第325回 利付国債(10年)	116,000,000	118,853,600
第327回 利付国債(10年)	28,000,000	28,751,800
第328回 利付国債(10年)	24,000,000	24,545,760
第329回 利付国債(10年)	105,000,000	108,309,600
第330回 利付国債(10年)	3,000,000	3,100,260
第332回 利付国債(10年)	196,000,000	201,417,440
第333回 利付国債(10年)	193,000,000	198,664,550
第334回 利付国債(10年)	257,000,000	264,933,590
第335回 利付国債(10年)	289,000,000	297,048,650
第336回 利付国債(10年)	53,000,000	54,567,740
第337回 利付国債(10年)	303,000,000	308,923,650
第338回 利付国債(10年)	491,000,000	503,657,980
第339回 利付国債(10年)	536,000,000	550,488,080
第340回 利付国債(10年)	566,000,000	581,836,680
第341回 利付国債(10年)	552,000,000	564,795,360
第342回 利付国債(10年)	613,000,000	620,110,800
第343回 利付国債(10年)	620,000,000	627,278,800
第344回 利付国債(10年)	672,000,000	679,963,200
第345回 利付国債(10年)	593,000,000	600,293,900
第346回 利付国債(10年)	647,000,000	655,236,310
第347回 利付国債(10年)	616,000,000	624,118,880
第348回 利付国債(10年)	624,000,000	632,255,520
第349回 利付国債(10年)	646,000,000	654,559,500
第350回 利付国債(10年)	814,000,000	824,435,480
第351回 利付国債(10年)	650,000,000	658,027,500
第352回 利付国債(10年)	616,000,000	623,287,280
第353回 利付国債(10年)	576,000,000	582,485,760
第354回 利付国債(10年)	508,000,000	513,400,040
第355回 利付国債(10年)	518,000,000	523,159,280
第356回 利付国債(10年)	326,000,000	329,015,500
第1回 利付国債(30年)	10,000,000	12,709,300
第2回 利付国債(30年)	83,000,000	103,084,340
第3回 利付国債(30年)	17,000,000	21,013,870
第4回 利付国債(30年)	54,000,000	70,736,760
第5回 利付国債(30年)	33,000,000	40,976,430
第6回 利付国債(30年)	47,000,000	59,863,430
第7回 利付国債(30年)	45,000,000	57,200,850
第8回 利付国債(30年)	40,000,000	48,639,200

第9回 利付国債(30年)	37,000,000	43,113,510	
第10回 利付国債(30年)	59,000,000	66,534,300	
第11回 利付国債(30年)	50,000,000	60,447,500	
第12回 利付国債(30年)	57,000,000	72,111,840	
第13回 利付国債(30年)	61,000,000	76,569,640	
第14回 利付国債(30年)	63,000,000	82,818,540	
第15回 利付国債(30年)	78,000,000	103,995,840	
第16回 利付国債(30年)	69,000,000	92,320,620	
第17回 利付国債(30年)	68,000,000	90,233,960	
第18回 利付国債(30年)	108,000,000	142,169,040	
第19回 利付国債(30年)	89,000,000	117,522,720	
第20回 利付国債(30年)	93,000,000	126,029,880	
第21回 利付国債(30年)	93,000,000	123,550,500	
第22回 利付国債(30年)	104,000,000	141,842,480	
第23回 利付国債(30年)	122,000,000	166,927,720	
第24回 利付国債(30年)	99,000,000	135,776,520	
第25回 利付国債(30年)	112,000,000	150,403,680	
第26回 利付国債(30年)	192,000,000	261,732,480	
第27回 利付国債(30年)	187,000,000	259,361,520	
第28回 利付国債(30年)	229,000,000	319,432,100	
第29回 利付国債(30年)	233,000,000	322,397,440	
第30回 利付国債(30年)	232,000,000	318,420,000	
第31回 利付国債(30年)	215,000,000	292,774,100	
第32回 利付国債(30年)	260,000,000	361,283,000	
第33回 利付国債(30年)	288,000,000	385,107,840	
第34回 利付国債(30年)	259,000,000	358,683,920	
第35回 利付国債(30年)	276,000,000	372,528,240	
第36回 利付国債(30年)	314,000,000	425,727,480	
第37回 利付国債(30年)	327,000,000	438,386,010	
第38回 利付国債(30年)	220,000,000	291,055,600	
第39回 利付国債(30年)	184,000,000	248,057,760	
第40回 利付国債(30年)	164,000,000	217,798,560	
第41回 利付国債(30年)	172,000,000	224,886,560	
第42回 利付国債(30年)	186,000,000	243,736,260	
第43回 利付国債(30年)	180,000,000	236,143,800	
第44回 利付国債(30年)	178,000,000	234,048,640	
第45回 利付国債(30年)	200,000,000	253,732,000	
第46回 利付国債(30年)	230,000,000	292,353,000	
第47回 利付国債(30年)	220,000,000	285,357,600	
第48回 利付国債(30年)	227,000,000	283,620,610	
第49回 利付国債(30年)	226,000,000	282,870,640	
第50回 利付国債(30年)	241,000,000	265,784,440	
第51回 利付国債(30年)	236,000,000	230,621,560	
第52回 利付国債(30年)	243,000,000	249,471,090	
第53回 利付国債(30年)	222,000,000	233,384,160	
第54回 利付国債(30年)	240,000,000	264,554,400	
第55回 利付国債(30年)	232,000,000	255,933,120	
第56回 利付国債(30年)	220,000,000	242,578,600	
第57回 利付国債(30年)	227,000,000	250,169,890	
第58回 利付国債(30年)	282,000,000	310,617,360	
第59回 利付国債(30年)	214,000,000	230,124,900	
第60回 利付国債(30年)	186,000,000	209,973,540	
第61回 利付国債(30年)	192,000,000	206,160,000	
第62回 利付国債(30年)	184,000,000	187,588,000	
第63回 利付国債(30年)	196,000,000	194,206,600	
第64回 利付国債(30年)	135,000,000	133,578,450	
第49回 利付国債(20年)	35,000,000	35,967,750	
第50回 利付国債(20年)	45,000,000	46,132,200	
第52回 利付国債(20年)	4,000,000	4,154,200	
第53回 利付国債(20年)	4,000,000	4,175,600	

第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,045,900
第56回	利付国債(20年)	2,000,000	2,104,840
第68回	利付国債(20年)	109,000,000	119,593,710
第70回	利付国債(20年)	40,000,000	44,470,400
第72回	利付国債(20年)	64,000,000	70,641,280
第73回	利付国債(20年)	30,000,000	33,135,600
第76回	利付国債(20年)	8,000,000	8,835,520
第78回	利付国債(20年)	13,000,000	14,423,370
第80回	利付国債(20年)	13,000,000	14,566,760
第81回	利付国債(20年)	64,000,000	71,679,360
第82回	利付国債(20年)	104,000,000	117,079,040
第83回	利付国債(20年)	69,000,000	78,055,560
第84回	利付国債(20年)	124,000,000	139,527,280
第85回	利付国債(20年)	89,000,000	101,163,630
第86回	利付国債(20年)	74,000,000	85,041,540
第87回	利付国債(20年)	71,000,000	81,148,740
第88回	利付国債(20年)	129,000,000	148,982,100
第89回	利付国債(20年)	73,000,000	83,831,010
第90回	利付国債(20年)	237,000,000	273,443,490
第91回	利付国債(20年)	167,000,000	193,811,850
第92回	利付国債(20年)	297,000,000	342,280,620
第93回	利付国債(20年)	189,000,000	217,461,510
第94回	利付国債(20年)	237,000,000	274,415,190
第95回	利付国債(20年)	242,000,000	285,184,900
第96回	利付国債(20年)	169,000,000	196,612,910
第97回	利付国債(20年)	233,000,000	274,066,250
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	200,976,840
第99回	利付国債(20年)	306,000,000	359,075,700
第100回	利付国債(20年)	250,000,000	296,530,000
第101回	利付国債(20年)	182,000,000	218,885,940
第102回	利付国債(20年)	181,000,000	218,716,780
第103回	利付国債(20年)	169,000,000	202,776,340
第104回	利付国債(20年)	135,000,000	159,679,350
第105回	利付国債(20年)	223,000,000	264,750,060
第106回	利付国債(20年)	152,000,000	181,790,480
第107回	利付国債(20年)	152,000,000	181,108,000
第108回	利付国債(20年)	202,000,000	237,042,960
第109回	利付国債(20年)	161,000,000	189,522,760
第110回	利付国債(20年)	184,000,000	220,001,440
第111回	利付国債(20年)	176,000,000	212,847,360
第112回	利付国債(20年)	249,000,000	298,765,140
第113回	利付国債(20年)	389,000,000	468,585,510
第114回	利付国債(20年)	200,000,000	241,722,000
第115回	利付国債(20年)	172,000,000	209,599,200
第116回	利付国債(20年)	194,000,000	237,211,560
第117回	利付国債(20年)	266,000,000	322,530,320
第118回	利付国債(20年)	188,000,000	226,729,880
第119回	利付国債(20年)	103,000,000	122,064,270
第120回	利付国債(20年)	88,000,000	102,447,840
第121回	利付国債(20年)	181,000,000	217,009,950
第122回	利付国債(20年)	117,000,000	139,025,250
第123回	利付国債(20年)	193,000,000	236,249,370
第124回	利付国債(20年)	115,000,000	139,513,400
第125回	利付国債(20年)	125,000,000	154,860,000
第126回	利付国債(20年)	114,000,000	138,687,840
第127回	利付国債(20年)	108,000,000	130,183,200
第128回	利付国債(20年)	187,000,000	226,006,330
第129回	利付国債(20年)	108,000,000	129,296,520
第130回	利付国債(20年)	180,000,000	216,140,400
第131回	利付国債(20年)	95,000,000	112,968,300

第132回	利付国債(20年)	126,000,000	150,155,460
第133回	利付国債(20年)	165,000,000	198,590,700
第134回	利付国債(20年)	145,000,000	175,013,550
第135回	利付国債(20年)	89,000,000	106,345,210
第136回	利付国債(20年)	93,000,000	109,998,540
第137回	利付国債(20年)	103,000,000	123,406,360
第138回	利付国債(20年)	112,000,000	131,424,160
第139回	利付国債(20年)	121,000,000	143,478,170
第140回	利付国債(20年)	292,000,000	350,560,600
第141回	利付国債(20年)	213,000,000	256,377,450
第142回	利付国債(20年)	134,000,000	163,005,640
第143回	利付国債(20年)	209,000,000	249,307,740
第144回	利付国債(20年)	139,000,000	163,996,370
第145回	利付国債(20年)	309,000,000	373,565,550
第146回	利付国債(20年)	249,000,000	301,576,350
第147回	利付国債(20年)	277,000,000	332,269,810
第148回	利付国債(20年)	259,000,000	307,741,210
第149回	利付国債(20年)	283,000,000	336,704,910
第150回	利付国債(20年)	301,000,000	354,499,740
第151回	利付国債(20年)	297,000,000	341,469,810
第152回	利付国債(20年)	290,000,000	333,871,200
第153回	利付国債(20年)	300,000,000	350,370,000
第154回	利付国債(20年)	272,000,000	313,991,360
第155回	利付国債(20年)	299,000,000	336,064,040
第156回	利付国債(20年)	255,000,000	262,400,100
第157回	利付国債(20年)	266,000,000	264,941,320
第158回	利付国債(20年)	279,000,000	291,142,080
第159回	利付国債(20年)	296,000,000	313,650,480
第160回	利付国債(20年)	261,000,000	280,872,540
第161回	利付国債(20年)	268,000,000	283,718,200
第162回	利付国債(20年)	262,000,000	277,106,920
第163回	利付国債(20年)	269,000,000	284,472,880
第164回	利付国債(20年)	353,000,000	366,791,710
第165回	利付国債(20年)	284,000,000	294,982,280
第166回	利付国債(20年)	289,000,000	310,336,870
第167回	利付国債(20年)	305,000,000	316,242,300
第168回	利付国債(20年)	253,000,000	257,599,540
第169回	利付国債(20年)	246,000,000	245,773,680
第170回	利付国債(20年)	180,000,000	179,663,400
国債証券 合計		51,422,000,000	57,556,949,870
地方債証券	第707回 東京都公募公債	200,000,000	203,335,200
	第708回 東京都公募公債	300,000,000	305,708,700
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	306,800,100
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	304,562,700
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,627,600
	第360回 大阪府公募公債(10年)	300,000,000	305,620,800
	第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	147,199,824
	第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	115,861,800
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	306,162,300
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	116,872,200
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	305,652,900
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	305,026,200
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,890,400
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	121,685,592
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	305,243,400
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	305,930,100
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	306,319,200
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	306,332,100
	第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,561,400
	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,010,900

	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,272,300	
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	153,693,450	
	第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	99,958,000	
	第1回 名古屋市公募公債	100,000,000	132,609,400	
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	330,053,400	
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	102,325,300	
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	203,518,600	
	第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,828,500	
	第4回 川崎市30年公募公債	100,000,000	134,934,600	
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	153,596,250	
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	152,404,650	
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	203,279,600	
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	101,919,800	
	平成29年度第1回 仙台市公募公債(20年)	100,000,000	104,175,700	
地方債証券 合計		6,913,000,000	7,194,972,966	
特殊債券	第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	203,805,400	
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	322,168,200	
	第139回 政保道路機構債券	500,000,000	508,478,500	
	第155回 政保道路機構債券	300,000,000	305,230,800	
	第163回 政保道路機構債券	300,000,000	305,955,000	
	第190回 政保道路機構債券	500,000,000	508,908,500	
	第212回 政保道路機構債券	100,000,000	117,468,300	
	第218回 政保道路機構債券	500,000,000	512,115,500	
	第233回 政府道路機構債券	100,000,000	115,376,600	
	第249回 政保道路機構債券	179,000,000	182,602,733	
	第278回 政保道路機構債券	100,000,000	99,064,100	
	第316回 政保道路機構債券	100,000,000	104,166,800	
	第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,931,000	
	第48回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,249,400	
	第48回 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	409,621,600	
	第72回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,212,800	
	第83回 政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,260,460	
	第35回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,684,200	
	第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	198,551,200	
	第133回 住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,023,995,000	
	第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,909,000	33,001,539	
	第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	84,134,000	89,434,442	
	第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	100,185,000	107,919,282	
	第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	81,746,000	86,945,045	
	第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	90,498,000	96,117,925	
	第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	91,862,000	97,291,044	
	第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,425,000	46,855,047	
	第62回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	377,144,000	396,981,774	
	第63回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	236,230,000	247,380,056	
	第73回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	151,506,000	160,187,293	
	第78回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	135,888,000	141,880,660	
	第109回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	252,096,000	253,885,881	
	い第822号 利付農林債券	100,000,000	99,333,600	
	第333回 利付しんきん中金債券	100,000,000	99,834,300	
	第335回 利付しんきん中金債券	100,000,000	99,852,300	
	第336回 利付しんきん中金債券	100,000,000	99,851,100	
	第45回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	203,715,000	
	第55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,288,600	
特殊債券 合計		8,058,623,000	8,297,600,981	
社債券	第26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	200,000,000	200,752,200	

第3回	ノルデア・バンク	200,000,000	207,680,400	
第5回	スヴェンスカ・ハンデルスパンケン	200,000,000	203,546,400	
第33回	中日本高速道路債券	300,000,000	305,097,000	
第56回	中日本高速道路債券	200,000,000	204,737,000	
第60回	中日本高速道路債券	100,000,000	101,803,800	
第20回	西日本高速道路債券	100,000,000	102,233,200	
第25回	西日本高速道路債券	200,000,000	203,429,400	
第26回	西日本高速道路債券	200,000,000	204,537,800	
第14回	森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,670,200	
第12回	オリエンタルランド	100,000,000	100,538,900	
第3回	富士フィルムホールディングス	300,000,000	306,477,900	
第68回	新日本製鐵	200,000,000	203,297,600	
第19回	豊田自動織機	200,000,000	203,318,800	
第24回	豊田自動織機	100,000,000	102,184,200	
第71回	伊藤忠商事	200,000,000	204,340,000	
第39回	住友商事	100,000,000	103,474,400	
第45回	住友商事	100,000,000	102,234,800	
第46回	住友商事	100,000,000	102,118,600	
第79回	三菱商事	100,000,000	102,133,900	
第1回	三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	101,595,800	
第127回	三菱東京UFJ銀行	200,000,000	203,827,800	
第1回	三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	101,602,800	
第20回	みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	102,961,700	
第46回	三井不動産	100,000,000	102,180,600	
第66回	三井不動産	100,000,000	99,718,000	
第111回	三菱地所	100,000,000	102,140,700	
第75回	東京急行電鉄	100,000,000	102,084,200	
第77回	東京急行電鉄	100,000,000	102,949,300	
第26回	東日本旅客鉄道	100,000,000	103,167,600	
第82回	東日本旅客鉄道	100,000,000	102,088,600	
第87回	東日本旅客鉄道	200,000,000	204,101,600	
第381回	中国電力	200,000,000	206,247,600	
第304回	北陸電力	100,000,000	102,980,300	
第306回	北陸電力	100,000,000	102,827,800	
第253回	四国電力	200,000,000	205,903,800	
第429回	九州電力	200,000,000	206,145,200	
第13回	電源開発	100,000,000	109,477,400	
社債券 合計		5,600,000,000	5,727,607,300	
合計		71,993,623,000	78,777,131,117	

## 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。



## 「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	40,851,273	20,171,353
金銭信託	26,888,151	1,751,943
コール・ローン	44,598,666	160,628,921
国債証券	18,091,951,159	25,337,125,462
未収利息	126,316,075	159,445,352
前払費用	8,013,467	15,350,586
流動資産合計	18,338,618,791	25,694,473,617
資産合計	18,338,618,791	25,694,473,617
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	246,104	74,972
未払金	56,083,200	22,852,130
未払解約金	24,507,717	100,051,340
その他未払費用	1,235	158
流動負債合計	80,838,256	122,978,600
負債合計	80,838,256	122,978,600
純資産の部		
元本等		
元本	13,614,520,319	18,425,435,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,643,260,216	7,146,059,863
純資産合計	18,257,780,535	25,571,495,017
負債純資産合計	18,338,618,791	25,694,473,617

## 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>国債証券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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. 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	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 受益権総口数	13,614,520,319口	18,425,435,154口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3411円 (13,411円)	1.3878円 (13,878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 2017年12月21日 至 2018年12月20日	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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	2018年12月20日現在	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (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	2018年12月20日現在	2019年12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)
国債証券	295,614,192	173,580,696
合計	295,614,192	173,580,696

(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	2018年12月20日 現在				2019年12月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	59,229,434	-	58,983,330	246,104	56,498,263	-	56,423,291	74,972
アメリカ・ドル	46,015,434	-	45,769,672	245,762	44,954,755	-	44,910,973	43,782
イギリス・ポンド	1,509,284	-	1,509,260	24	1,437,523	-	1,425,924	11,599
カナダ・ドル	1,715,655	-	1,715,540	115	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	1,221,373	-	1,218,379	2,994
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	1,986,620	-	1,984,900	1,720
ユーロ	9,989,061	-	9,988,858	203	6,897,992	-	6,883,115	14,877
合計	59,229,434	-	58,983,330	246,104	56,498,263	-	56,423,291	74,972

(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。

(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)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」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	2018年12月20日現在	2019年12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	9,986,477,873円	13,614,520,319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	6,312,338,400円	7,848,485,042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	2,684,295,954円	3,037,570,207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)	1,470,356,256円	1,946,967,139円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,598,682,942円	3,396,628,027円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	907,233,509円	1,137,700,596円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	-円	703,528,953円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	-円	5,543,732円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	-円	15,541,267円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	-円	15,333,036円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	7,377,173,618円	8,724,136,622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)	552,980,160円	856,773,731円
DCニッセイ外国債券インデックス	586,707,489円	908,433,502円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	6,614,644円	29,558,606円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	67,211,019円	512,517,884円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	3,807,091円	20,667,302円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	5,673,244円	41,002,415円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	3,065,671円	15,164,223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)	20,372,593円	57,507,116円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,991,115円	3,455,001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)	12,650,968円	22,470,642円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	-円	2,758,911円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	-円	2,017,446円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	-円	3,573,727円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	-円	4,155,276円
計	13,614,520,319円	18,425,435,154円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12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	13,507,570,734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	7,552,683,269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	2,634,818,849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)	1,946,967,139円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,396,628,027円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,137,700,596円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	703,528,953円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	5,543,732円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	15,541,267円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	15,333,036円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	8,724,136,622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)	856,773,731円
DCニッセイ外国債券インデックス	908,433,502円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	29,558,606円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	512,517,884円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	20,667,302円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	41,002,415円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	15,164,223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)	57,507,116円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,455,001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)	22,470,642円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,758,911円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,017,446円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	3,573,727円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,155,276円
計	18,425,435,154円

### 附属明細表(2019年12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	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	100,000.00	127,515.00	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	70,000.00	89,703.60	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	160,000.00	215,131.20	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	80,000.00	103,074.40	

US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	100,000.00	124,363.00	
US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	120,000.00	157,729.20	
US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	60,000.00	78,175.80	
US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	2,160,000.00	2,153,152.80	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	1,050,000.00	1,038,880.50	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	1,290,000.00	1,274,881.20	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	1,030,000.00	1,024,479.20	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	1,270,000.00	1,243,558.60	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,490,000.00	1,489,359.30	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/31	1,190,000.00	1,189,250.30	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,660,000.00	1,658,688.60	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	1,350,000.00	1,335,177.00	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	1,230,000.00	1,215,338.40	
US TREASURY N/B 1.625 2026/09/30	680,000.00	670,860.80	
US TREASURY N/B 1.625 2029/08/15	930,000.00	906,601.20	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	1,200,000.00	1,202,856.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,470,000.00	1,473,719.10	
US TREASURY N/B 1.75 2022/06/15	1,180,000.00	1,183,174.20	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	1,560,000.00	1,564,009.20	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	1,910,000.00	1,914,240.20	
US TREASURY N/B 1.75 2029/11/15	340,000.00	335,138.00	
US TREASURY N/B 1.875 2020/12/15	1,440,000.00	1,443,024.00	
US TREASURY N/B 1.875 2026/06/30	680,000.00	682,176.00	
US TREASURY N/B 2 2021/02/28	1,530,000.00	1,535,844.60	
US TREASURY N/B 2 2021/05/31	1,600,000.00	1,607,616.00	
US TREASURY N/B 2 2021/08/31	1,670,000.00	1,679,318.60	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	2,340,000.00	2,355,888.60	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,630,000.00	1,641,703.40	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,880,000.00	1,899,006.80	
US TREASURY N/B 2 2024/06/30	1,180,000.00	1,193,782.40	



US TREASURY N/B 2 2025/02/15	1,210,000.00	1,224,786.20	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	1,360,000.00	1,375,721.60	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	1,220,000.00	1,232,761.20	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	1,550,000.00	1,560,896.50	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	2,180,000.00	2,196,175.60	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	1,770,000.00	1,784,160.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	1,320,000.00	1,332,421.20	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	1,180,000.00	1,193,959.40	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	1,010,000.00	1,023,847.10	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	1,260,000.00	1,281,016.80	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	1,150,000.00	1,170,527.50	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	1,280,000.00	1,303,398.40	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	1,690,000.00	1,702,269.40	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	1,280,000.00	1,306,892.80	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	2,080,000.00	2,129,628.80	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	670,000.00	686,327.90	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	1,360,000.00	1,394,204.00	
US TREASURY N/B 2.25 2026/03/31	760,000.00	779,623.20	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	770,000.00	790,990.20	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	760,000.00	781,196.40	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	770,000.00	791,683.20	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	480,000.00	470,208.00	
US TREASURY N/B 2.25 2049/08/15	620,000.00	607,668.20	
US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	1,510,000.00	1,521,083.40	
US TREASURY N/B 2.375 2022/03/15	1,180,000.00	1,199,080.60	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	2,170,000.00	2,231,866.70	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	790,000.00	818,882.40	
US TREASURY N/B 2.375 2029/05/15	940,000.00	977,966.60	
US TREASURY N/B 2.375 2049/11/15	250,000.00	251,677.50	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	1,940,000.00	1,995,387.00	

US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	2,100,000.00	2,168,649.00	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	520,000.00	534,866.80	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	490,000.00	504,219.80	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	490,000.00	504,278.60	
US TREASURY N/B 2.625 2021/12/15	1,230,000.00	1,253,542.20	
US TREASURY N/B 2.625 2025/03/31	640,000.00	668,044.80	
US TREASURY N/B 2.625 2025/12/31	680,000.00	711,817.20	
US TREASURY N/B 2.625 2029/02/15	900,000.00	954,666.00	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	1,910,000.00	1,985,043.90	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	1,870,000.00	1,947,062.70	
US TREASURY N/B 2.75 2025/06/30	570,000.00	599,189.70	
US TREASURY N/B 2.75 2028/02/15	820,000.00	874,259.40	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	290,000.00	311,964.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	350,000.00	376,302.50	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	480,000.00	519,168.00	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	460,000.00	497,641.80	
US TREASURY N/B 2.875 2028/05/15	860,000.00	926,306.00	
US TREASURY N/B 2.875 2028/08/15	880,000.00	949,264.80	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	510,000.00	559,842.30	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	510,000.00	561,872.10	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	470,000.00	519,749.50	
US TREASURY N/B 2.875 2049/05/15	630,000.00	701,120.70	
US TREASURY N/B 3 2025/09/30	570,000.00	607,825.20	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	200,000.00	223,968.00	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	520,000.00	584,308.40	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	530,000.00	596,477.90	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	520,000.00	586,440.40	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	480,000.00	543,614.40	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	490,000.00	554,925.00	
US TREASURY N/B 3 2048/02/15	520,000.00	589,893.20	

US TREASURY N/B 3 2048/08/15	600,000.00	681,864.00	
US TREASURY N/B 3 2049/02/15	630,000.00	717,160.50	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	1,910,000.00	1,948,562.90	
US TREASURY N/B 3.125 2028/11/15	920,000.00	1,012,460.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	170,000.00	194,104.30	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	220,000.00	251,169.60	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	370,000.00	422,680.60	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	520,000.00	596,310.00	
US TREASURY N/B 3.125 2048/05/15	550,000.00	638,880.00	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	520,000.00	620,282.00	
US TREASURY N/B 3.375 2048/11/15	620,000.00	754,701.20	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	150,000.00	180,679.50	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	430,000.00	531,166.10	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	510,000.00	631,359.60	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	490,000.00	617,150.10	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	200,000.00	253,522.00	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	140,000.00	185,231.20	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	220,000.00	292,881.60	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	80,000.00	106,915.20	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	170,000.00	228,821.70	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	180,000.00	239,617.80	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	90,000.00	122,184.90	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	160,000.00	218,449.60	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	270,000.00	375,499.80	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	230,000.00	326,319.40	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	90,000.00	127,968.30	
US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	100,000.00	140,859.00	
WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	210,000.00	262,311.00	
WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	220,000.00	297,204.60	
WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	180,000.00	243,990.00	
アメリカ・ドル 小計	106,780,000.00	111,060,356.40	

イギリス・ボンド	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	180,000.00	189,810.00	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	200,000.00	293,652.00	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	240,000.00	393,852.00	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	230,000.00	336,315.20	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	220,000.00	367,334.00	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	160,000.00	204,521.60	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	190,000.00	263,357.10	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	180,000.00	275,563.80	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	210,000.00	325,857.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	220,000.00	413,514.20	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	170,000.00	239,660.90	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	160,000.00	172,240.00	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	190,000.00	359,556.00	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	190,000.00	305,178.00	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	200,000.00	245,054.00	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	160,000.00	177,337.60	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	130,000.00	189,566.00	
	UK TSY 0 5/8% 2025 0.625 2025/06/07	150,000.00	149,902.50	
	UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	320,000.00	323,100.80	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	200,000.00	211,494.00	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	270,000.00	282,198.60	
	UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	190,000.00	198,230.80	
	UK TSY 1 5/8% 2028 1.625 2028/10/22	340,000.00	366,146.00	
	UK TSY 1 5/8% 2054 1.625 2054/10/22	120,000.00	132,764.40	
	UK TSY 1 5/8% 2071 1.625 2071/10/22	120,000.00	141,657.60	
	UK TSY 1% 2024 1 2024/04/22	340,000.00	345,803.80	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	300,000.00	309,858.00	
	UK TSY 1.75% 2049 1.75 2049/01/22	120,000.00	132,830.40	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	200,000.00	232,778.00	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	210,000.00	223,001.10	

	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	140,000.00	154,000.00	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	110,000.00	118,847.30	
	UK TSY 2029 0.875 2029/10/22	190,000.00	191,121.00	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	210,000.00	388,485.30	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	290,000.00	406,400.20	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	200,000.00	333,354.00	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	280,000.00	411,213.60	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	180,000.00	312,125.40	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	310,000.00	309,820.20	
	UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	330,000.00	332,046.00	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	310,000.00	336,694.10	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	230,000.00	335,779.30	
	イギリス・ポンド 小計	8,890,000.00	11,432,021.80 (1,627,576,944)	
オーストラリア・ ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.5 2031/06/21	170,000.00	173,435.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	220,000.00	225,033.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	190,000.00	197,898.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	350,000.00	378,976.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.5 2030/05/21	320,000.00	357,875.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	340,000.00	366,890.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	340,000.00	380,300.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	320,000.00	360,713.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	310,000.00	352,711.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	100,000.00	117,082.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2041/05/21	60,000.00	70,443.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	160,000.00	198,209.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	350,000.00	391,716.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	370,000.00	434,646.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	110,000.00	138,503.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	150,000.00	198,777.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	390,000.00	466,599.90	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	170,000.00	234,515.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	380,000.00	476,656.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	320,000.00	368,940.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	330,000.00	352,436.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	310,000.00	348,830.60	
オーストラリア・ドル 小計		5,760,000.00	6,591,193.00 (497,305,512)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	60,000.00	79,843.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	230,000.00	224,100.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	310,000.00	306,382.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	240,000.00	236,176.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	300,000.00	294,555.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	180,000.00	171,541.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2021/11/01	150,000.00	148,770.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2025/03/01	110,000.00	107,736.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2030/06/01	80,000.00	76,827.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2021/08/01	150,000.00	149,490.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2022/02/01	80,000.00	79,676.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	180,000.00	178,896.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2024/09/01	190,000.00	188,518.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	160,000.00	158,283.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2021/05/01	140,000.00	140,026.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	240,000.00	240,441.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2023/09/01	150,000.00	151,690.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	170,000.00	174,338.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2051/12/01	130,000.00	139,631.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2021/02/01	150,000.00	150,826.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2024/03/01	150,000.00	153,450.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	170,000.00	175,101.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2029/06/01	140,000.00	147,259.00	
CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	160,000.00	165,628.80		

	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	170,000.00	174,275.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	180,000.00	222,570.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	140,000.00	143,005.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	200,000.00	274,014.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	180,000.00	252,714.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	150,000.00	223,699.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	140,000.00	189,308.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	150,000.00	222,501.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	60,000.00	86,210.40	
カナダ・ドル 小計		5,390,000.00	5,827,491.20 (485,837,941)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.25 2021/10/01	100,000.00	99,469.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	70,000.00	72,114.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	100,000.00	100,940.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	50,000.00	52,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	50,000.00	52,010.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2039/07/01	20,000.00	21,561.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.625 2028/05/01	60,000.00	64,410.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	150,000.00	155,955.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	60,000.00	68,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	80,000.00	91,175.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	60,000.00	66,110.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	50,000.00	55,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	130,000.00	138,370.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	100,000.00	104,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	80,000.00	94,967.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	90,000.00	101,223.00	
シンガポール・ドル 小計		1,250,000.00	1,338,765.50 (108,132,089)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	530,000.00	564,253.90	
	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2029/11/12	540,000.00	575,197.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	720,000.00	775,065.60	

	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	980,000.00	1,048,149.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	880,000.00	1,009,078.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	1,300,000.00	1,422,408.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	600,000.00	934,452.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	1,140,000.00	1,197,296.40	
スウェーデン・クローナ 小計		6,690,000.00	7,525,900.70 (87,450,966)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2022/11/15	260,000.00	266,832.80	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	1,110,000.00	1,184,114.70	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2029/11/15	610,000.00	652,449.90	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	770,000.00	832,862.80	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	760,000.00	859,886.80	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	870,000.00	931,413.30	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,600,000.00	3,012,864.00	
デンマーク・クローネ 小計		5,980,000.00	7,740,424.30 (126,014,108)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	420,000.00	423,536.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	390,000.00	398,026.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	440,000.00	449,930.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2029/09/06	480,000.00	490,483.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	1,140,000.00	1,164,669.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2028/04/26	430,000.00	447,931.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	560,000.00	598,309.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	1,020,000.00	1,055,292.00	
ノルウェー・クローネ 小計		4,880,000.00	5,028,178.80 (61,343,781)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 2 2021/04/25	310,000.00	312,895.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.25 2022/04/25	130,000.00	132,098.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2023/01/25	160,000.00	163,982.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2024/04/25	660,000.00	679,522.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	450,000.00	464,161.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	410,000.00	422,984.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2028/04/25	350,000.00	368,007.50	



	POLAND GOVERNMENT BOND 2.75 2029/10/25	210,000.00	222,568.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	330,000.00	353,350.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	550,000.00	596,695.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	770,000.00	829,790.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	470,000.00	522,123.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	130,000.00	172,406.00	
ポーランド・ズロチ	小計	4,930,000.00	5,240,586.30 (149,566,333)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	390,000.00	393,315.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	330,000.00	333,610.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.62 2021/11/30	200,000.00	202,190.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	140,000.00	143,096.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	280,000.00	283,897.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.885 2029/08/15	140,000.00	145,426.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	300,000.00	309,936.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	240,000.00	248,052.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	260,000.00	269,185.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	100,000.00	104,191.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	310,000.00	315,301.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	370,000.00	384,781.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	150,000.00	157,554.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	70,000.00	74,099.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	140,000.00	148,542.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	150,000.00	161,644.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	130,000.00	141,629.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	140,000.00	157,067.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.893 2038/06/08	130,000.00	148,352.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.921 2048/07/06	120,000.00	135,390.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	113,579.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	68,083.20	
マレーシア・リンギット	小計	4,250,000.00	4,438,925.30 (117,320,796)	

メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	4,570,000.00	5,204,453.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	1,100,000.00	1,414,688.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	2,240,000.00	2,125,670.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	3,800,000.00	3,791,374.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	3,550,000.00	3,537,220.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.25 2021/12/09	1,850,000.00	1,870,960.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	3,340,000.00	3,471,896.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,750,000.00	1,862,612.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	1,220,000.00	1,301,142.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	2,230,000.00	2,354,857.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	3,840,000.00	4,010,995.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	1,690,000.00	1,842,235.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	3,340,000.00	3,715,816.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	1,960,000.00	2,229,656.80	
	メキシコ・ペソ 小計		36,480,000.00	38,733,579.00 (223,880,087)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	120,000.00	123,111.60	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	130,000.00	135,466.50	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	200,000.00	212,226.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	160,000.00	171,107.20	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	180,000.00	192,879.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.9 2029/06/22	180,000.00	194,706.00	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	190,000.00	205,162.00	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	150,000.00	164,131.50	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2033/04/22	90,000.00	101,581.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	60,000.00	69,397.80	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	140,000.00	168,578.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.7 2050/06/22	70,000.00	85,688.40	
	BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	100,000.00	123,844.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	70,000.00	98,356.30	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	160,000.00	175,769.60	

BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	60,000.00	84,077.40	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	180,000.00	204,618.60	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	100,000.00	137,843.00	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	120,000.00	204,670.80	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	180,000.00	199,002.60	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	100,000.00	146,221.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	200,000.00	217,396.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	200,000.00	227,088.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	210,000.00	361,004.70	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	130,000.00	168,975.30	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	240,000.00	404,284.80	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	240,000.00	351,631.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	230,000.00	231,294.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/10/31	240,000.00	241,999.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2024/07/30	170,000.00	172,516.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.35 2023/07/30	240,000.00	244,795.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	270,000.00	274,914.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	240,000.00	245,311.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.6 2029/10/31	230,000.00	233,406.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	280,000.00	285,364.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	270,000.00	290,887.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/04/30	250,000.00	272,380.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2028/07/30	260,000.00	283,270.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	280,000.00	305,754.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2029/04/30	270,000.00	295,636.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	240,000.00	262,365.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	270,000.00	292,966.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.85 2035/07/30	150,000.00	171,963.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	250,000.00	278,895.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	290,000.00	332,980.90	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	260,000.00	291,691.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	220,000.00	266,668.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.7 2048/10/31	160,000.00	213,232.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	300,000.00	340,959.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	210,000.00	287,733.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	150,000.00	238,921.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	250,000.00	292,395.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	250,000.00	382,247.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	260,000.00	305,905.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	290,000.00	364,672.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	250,000.00	424,442.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	230,000.00	276,639.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	230,000.00	395,353.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	240,000.00	340,077.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	180,000.00	333,316.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	260,000.00	305,981.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	300,000.00	324,177.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	280,000.00	454,885.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	270,000.00	305,658.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	280,000.00	385,526.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	310,000.00	466,199.70	
BUNDESobligation 0 2021/04/09	250,000.00	252,162.50	
BUNDESobligation 0 2021/10/08	240,000.00	242,769.60	
BUNDESobligation 0 2022/04/08	230,000.00	233,408.60	
BUNDESobligation 0 2022/10/07	210,000.00	213,742.20	
BUNDESobligation 0 2023/10/13	190,000.00	194,311.10	
BUNDESobligation 0 2024/10/18	220,000.00	225,533.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	310,000.00	319,045.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2029/08/15	230,000.00	235,241.70	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2050/08/15	70,000.00	64,085.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	330,000.00	345,651.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2028/08/15	260,000.00	272,851.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2029/02/15	270,000.00	283,108.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	280,000.00	294,758.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	310,000.00	328,584.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	320,000.00	341,824.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	260,000.00	278,226.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	210,000.00	225,220.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	290,000.00	314,673.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	220,000.00	280,174.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	310,000.00	328,088.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	220,000.00	234,874.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	420,000.00	450,416.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	460,000.00	502,076.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	210,000.00	222,795.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	380,000.00	416,871.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	250,000.00	263,697.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	220,000.00	241,113.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2021/09/04	210,000.00	220,405.50	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	230,000.00	237,836.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	340,000.00	528,336.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	340,000.00	539,617.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	220,000.00	233,204.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	180,000.00	304,264.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	280,000.00	470,248.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	170,000.00	308,165.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	250,000.00	426,780.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	210,000.00	409,718.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	110,000.00	182,810.10	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2020/12/11	150,000.00	150,994.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/03/12	160,000.00	161,364.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/06/11	180,000.00	181,771.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/09/10	160,000.00	161,779.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2021/12/10	60,000.00	60,753.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2021/04/15	190,000.00	190,562.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.35 2021/11/01	30,000.00	30,234.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	220,000.00	221,931.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	430,000.00	435,486.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	420,000.00	429,630.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1 2022/07/15	210,000.00	214,754.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	280,000.00	286,185.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	690,000.00	710,099.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2030/04/01	140,000.00	139,525.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	430,000.00	445,230.60	

BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	440,000.00	457,947.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	440,000.00	460,618.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	270,000.00	273,550.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	400,000.00	423,612.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	450,000.00	481,423.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2028/02/01	280,000.00	299,628.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	240,000.00	257,289.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	390,000.00	406,801.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	220,000.00	238,196.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	180,000.00	189,271.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.3 2021/10/15	190,000.00	198,095.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	200,000.00	218,248.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	430,000.00	469,069.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	210,000.00	227,537.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2028/12/01	240,000.00	272,157.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	120,000.00	125,893.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	180,000.00	204,474.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3 2029/08/01	250,000.00	288,577.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.1 2040/03/01	90,000.00	103,446.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	200,000.00	237,490.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.35 2035/03/01	180,000.00	215,524.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	210,000.00	257,121.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	310,000.00	372,533.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	300,000.00	314,316.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	200,000.00	210,664.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	340,000.00	361,073.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	250,000.00	286,602.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.85 2049/09/01	160,000.00	208,100.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	350,000.00	451,433.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	260,000.00	296,444.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	290,000.00	338,392.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	270,000.00	329,796.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2021/09/01	320,000.00	346,169.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	290,000.00	336,075.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	300,000.00	388,008.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	210,000.00	305,552.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	360,000.00	439,480.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	300,000.00	422,463.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	290,000.00	423,249.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	270,000.00	394,343.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	360,000.00	489,866.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	240,000.00	274,548.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	360,000.00	414,655.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	260,000.00	384,183.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	360,000.00	529,599.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	330,000.00	463,923.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	150,000.00	199,557.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	140,000.00	201,387.20	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	210,000.00	343,973.70	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	180,000.00	267,769.80	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	130,000.00	198,429.40	
FINNISH GOVERNMENT 0 2022/04/15	50,000.00	50,698.00	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	70,000.00	71,325.10	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	70,000.00	73,367.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	60,000.00	62,972.40	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2029/09/15	50,000.00	52,453.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	60,000.00	64,420.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	60,000.00	64,101.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2034/04/15	60,000.00	67,450.20	
FINNISH GOVERNMENT 1.375 2047/04/15	40,000.00	48,968.80	



FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	70,000.00	74,779.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	70,000.00	74,249.00	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	90,000.00	99,600.30	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	50,000.00	74,223.50	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	100,000.00	124,284.00	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	80,000.00	84,368.80	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	70,000.00	87,115.70	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	380,000.00	382,777.80	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	360,000.00	363,189.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/02/25	350,000.00	354,399.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	390,000.00	395,768.10	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	430,000.00	437,950.70	
FRANCE (GOVT OF) 0 2024/03/25	430,000.00	438,539.80	
FRANCE (GOVT OF) 0 2025/03/25	350,000.00	356,223.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2029/11/25	160,000.00	158,937.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	400,000.00	412,416.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	470,000.00	491,742.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	450,000.00	471,465.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2029/05/25	420,000.00	438,778.20	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	400,000.00	427,548.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/11/25	430,000.00	459,523.80	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	410,000.00	441,545.40	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	400,000.00	434,348.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2034/05/25	320,000.00	361,350.40	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	390,000.00	439,853.70	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	570,000.00	656,736.90	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2050/05/25	310,000.00	363,341.70	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	670,000.00	723,318.60	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	450,000.00	497,965.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	270,000.00	330,239.70	

FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	140,000.00	178,406.20	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	320,000.00	417,558.40	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	470,000.00	508,337.90	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	430,000.00	482,017.10	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	520,000.00	650,327.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	500,000.00	613,945.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	580,000.00	629,566.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	480,000.00	514,641.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	320,000.00	508,009.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	480,000.00	595,382.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	470,000.00	497,762.90	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	320,000.00	521,977.60	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	210,000.00	406,686.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	160,000.00	323,540.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	560,000.00	663,751.20	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	440,000.00	785,606.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	360,000.00	596,804.40	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	430,000.00	652,150.90	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	400,000.00	681,856.00	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	370,000.00	507,288.50	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	90,000.00	92,595.60	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	140,000.00	150,313.80	
IRISH TSY 1.10% 2029 1.1 2029/05/15	100,000.00	109,524.00	
IRISH TSY 1.3% 2033 1.3 2033/05/15	50,000.00	56,069.00	
IRISH TSY 1.35% 2031 1.35 2031/03/18	70,000.00	78,760.50	
IRISH TSY 1.5% 2050 1.5 2050/05/15	50,000.00	58,015.00	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	70,000.00	83,466.60	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	110,000.00	141,823.00	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	110,000.00	135,502.40	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	70,000.00	70,912.10	

IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	100,000.00	107,587.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	100,000.00	116,057.00	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	80,000.00	91,337.60	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	150,000.00	212,643.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	190,000.00	192,405.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	190,000.00	193,929.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	190,000.00	196,796.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2029/07/15	160,000.00	165,483.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	190,000.00	200,413.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2040/01/15	70,000.00	73,418.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	190,000.00	204,445.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2028/07/15	150,000.00	162,126.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	210,000.00	227,543.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	200,000.00	222,786.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	190,000.00	204,153.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	170,000.00	224,755.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	190,000.00	311,662.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	210,000.00	222,839.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	170,000.00	192,961.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	200,000.00	352,322.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	190,000.00	313,775.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	150,000.00	219,690.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	80,000.00	81,279.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2023/07/15	70,000.00	71,297.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	100,000.00	104,982.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2029/02/20	120,000.00	125,712.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	140,000.00	149,489.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2028/02/20	120,000.00	128,346.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	120,000.00	130,665.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	80,000.00	98,640.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	40,000.00	51,237.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	180,000.00	197,974.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	210,000.00	228,255.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	70,000.00	114,607.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	100,000.00	130,468.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	80,000.00	129,244.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	130,000.00	145,177.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	200,000.00	214,310.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	110,000.00	120,978.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	50,000.00	105,863.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	170,000.00	279,134.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	110,000.00	145,495.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	110,000.00	163,729.50	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	140,000.00	181,553.40	
	ユーロ 小計	65,880,000.00	78,460,280.50 (9,547,046,931)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	2,940,000.00	3,284,274.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	1,440,000.00	1,030,104.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	1,160,000.00	804,112.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	600,000.00	600,540.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	1,220,000.00	1,030,656.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	1,490,000.00	1,512,499.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	2,070,000.00	1,929,591.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	1,660,000.00	1,519,232.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	1,560,000.00	1,377,183.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	1,760,000.00	1,540,880.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	3,050,000.00	2,662,955.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	1,510,000.00	1,405,236.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	1,220,000.00	1,109,651.00	
	南アフリカ・ランド 小計	21,680,000.00	19,806,914.70 (152,315,174)	
国債証券 合計		25,337,125,462 (25,337,125,462)		

合計		25,337,125,462 (25,337,125,462)	
----	--	------------------------------------	--

- (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	組入債券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 124銘柄	47.53%	47.97%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	6.36%	6.42%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	1.94%	1.96%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	1.90%	1.92%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.42%	0.43%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.34%	0.35%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.49%	0.50%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.24%	0.24%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.58%	0.59%
マレーシア・リングギット	国債証券 22銘柄	0.46%	0.46%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.88%	0.88%
ユーロ	国債証券 283銘柄	37.33%	37.68%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.60%	0.60%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 第5 商品明細表

該当事項はありません。

## 第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 第8 借入金明細表

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## DCニッセイターゲットデートファンド2025

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2030

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2035

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデートファンド2045

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデットファンド2050

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2019年12月21日から2020年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデットファンド2055

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2019年12月21日から2020年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイターゲットデットファンド2060

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2019年12月21日から2020年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2025】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2019年12月20日現在)	第4期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,863	3,625
コール・ローン	537,548	772,517
親投資信託受益証券	457,916,156	837,379,471
未収入金	108,423	150,783
流動資産合計	458,567,990	838,306,396
資産合計	458,567,990	838,306,396
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	96,859	129,903
未払受託者報酬	59,863	86,126
未払委託者報酬	479,108	689,293
その他未払費用	19,874	28,629
流動負債合計	655,704	933,951
負債合計	655,704	933,951
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	430,876,035	795,635,182
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	27,036,251	41,737,263
純資産合計	457,912,286	837,372,445
負債純資産合計	458,567,990	838,306,396

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 (自2018年12月21日 至2019年6月20日)	第4期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	4
有価証券売買等損益	4,843,384	3,409,927
営業収益合計	4,843,384	3,409,923
<b>営業費用</b>		
支払利息	14	48
受託者報酬	21,629	86,126
委託者報酬	175,083	689,293
その他費用	7,196	28,629
営業費用合計	203,922	804,096
営業利益又は営業損失( )	4,639,462	4,214,019
経常利益又は経常損失( )	4,639,462	4,214,019
中間純利益又は中間純損失( )	4,639,462	4,214,019
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	59,542	1,807,862
期首剰余金又は期首欠損金( )	529,487	27,036,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,314,349	22,560,080
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,314,349	22,560,080
剰余金減少額又は欠損金増加額	124,327	5,452,911
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	124,327	5,452,911
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,299,429	41,737,263

## (3) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 2019年12月20日現在	第4期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	430,876,035口	795,635,182口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0627円 (10,627円)	1.0525円 (10,525円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2019年12月20日現在	第4期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	75,195,875円	430,876,035円
期中追加設定元本額	387,560,915円	453,892,677円
期中一部解約元本額	31,880,755円	89,133,530円

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2030】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	747	980
コール・ローン	68,498	208,758
親投資信託受益証券	73,588,451	730,086,807
未収入金	2,166,291	130,029
流動資産合計	75,823,987	730,426,574
資産合計	75,823,987	730,426,574
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,164,317	111,069
未払受託者報酬	7,410	24,293
未払委託者報酬	62,045	202,739
その他未払費用	2,407	8,017
流動負債合計	2,236,179	346,118
負債合計	2,236,179	346,118
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,627,246	677,126,546
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,960,562	52,953,910
純資産合計	73,587,808	730,080,456
負債純資産合計	75,823,987	730,426,574

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 (自2019年1月10日 至2019年7月9日)	第2期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	591,619	4,034,827
<b>営業収益合計</b>	<b>591,619</b>	<b>4,034,827</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,483	24,293
委託者報酬	12,396	202,739
その他費用	429	8,017
<b>営業費用合計</b>	<b>14,308</b>	<b>235,049</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>577,311</b>	<b>3,799,778</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>577,311</b>	<b>3,799,778</b>
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>577,311</b>	<b>3,799,778</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	181	458,982
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>-</b>	<b>6,960,562</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>1,566,044</b>	<b>42,731,789</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,566,044	42,731,789
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>34,862</b>	<b>997,201</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,862	997,201
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>2,108,312</b>	<b>52,953,910</b>

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 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。
---------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1 . 受益権総口数	66,627,246口	677,126,546口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1045円 (11,045円)	1.0782円 (10,782円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1 . 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## ( 有価証券に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	1,000,000円	66,627,246円
期中追加設定元本額	72,774,281円	620,810,230円
期中一部解約元本額	7,147,035円	10,310,930円



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2035】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2019年12月20日現在)	第4期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	7,697	4,732
コール・ローン	705,672	1,008,449
親投資信託受益証券	564,974,439	1,202,792,166
未収入金	631,935	298,102
流動資産合計	566,319,743	1,204,103,449
資産合計	566,319,743	1,204,103,449
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	616,614	265,925
未払受託者報酬	73,353	105,624
未払委託者報酬	636,063	915,753
その他未払費用	24,381	34,807
流動負債合計	1,350,411	1,322,109
負債合計	1,350,411	1,322,109
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	502,122,903	1,111,082,832
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	62,846,429	91,698,508
純資産合計	564,969,332	1,202,781,340
負債純資産合計	566,319,743	1,204,103,449

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 (自2018年12月21日 至2019年6月20日)	第4期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	6
有価証券売買等損益	5,187,954	11,155,853
営業収益合計	5,187,954	11,155,847
<b>営業費用</b>		
支払利息	1	87
受託者報酬	25,213	105,624
委託者報酬	220,526	915,753
その他費用	8,318	34,807
営業費用合計	254,058	1,056,271
営業利益又は営業損失( )	4,933,896	12,212,118
経常利益又は経常損失( )	4,933,896	12,212,118
中間純利益又は中間純損失( )	4,933,896	12,212,118
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	168,318	5,592,352
期首剰余金又は期首欠損金( )	726,883	62,846,429
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,997,715	45,326,849
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,997,715	45,326,849
剰余金減少額又は欠損金増加額	181,449	9,855,004
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	181,449	9,855,004
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	12,854,961	91,698,508

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 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。
---------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第3期 2019年12月20日現在	第4期中間計算期間 2020年6月20日現在
1 . 受益権総口数	502,122,903口	1,111,082,832口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1252円 (11,252円)	1.0825円 (10,825円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2019年12月20日現在	第4期中間計算期間 2020年6月20日現在
1 . 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## ( 有価証券に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	70,782,099円	502,122,903円
期中追加設定元本額	472,272,256円	695,488,282円
期中一部解約元本額	40,931,452円	86,528,353円

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2040】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	511	585
コール・ローン	46,894	124,751
親投資信託受益証券	46,572,808	342,226,719
未収入金	1,263	26,623
流動資産合計	46,621,476	342,378,678
資産合計	46,621,476	342,378,678
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	17,424
未払受託者報酬	4,884	13,735
未払委託者報酬	42,651	119,380
その他未払費用	1,554	4,505
流動負債合計	49,089	155,044
負債合計	49,089	155,044
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	40,633,922	311,879,787
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,938,465	30,343,847
純資産合計	46,572,387	342,223,634
負債純資産合計	46,621,476	342,378,678

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 (自2019年1月10日 至2019年7月9日)	第2期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	453,114	3,145,229
営業収益合計	453,114	3,145,229
営業費用		
受託者報酬	788	13,735
委託者報酬	7,005	119,380
その他費用	192	4,505
営業費用合計	7,985	137,620
営業利益又は営業損失( )	445,129	3,007,609
経常利益又は経常損失( )	445,129	3,007,609
中間純利益又は中間純損失( )	445,129	3,007,609
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	437	578,755
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	5,938,465
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,051,785	21,682,848
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,051,785	21,682,848
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,523	863,830
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,523	863,830
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,478,954	30,343,847

## (3) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	40,633,922口	311,879,787口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1461円 (11,461円)	1.0973円 (10,973円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	1,000,000円	40,633,922円
期中追加設定元本額	42,349,876円	277,836,945円
期中一部解約元本額	2,715,954円	6,591,080円



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2045】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2019年12月20日現在)	第4期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,517	2,216
コール・ローン	322,477	472,212
親投資信託受益証券	264,524,096	446,860,765
未収入金	1,149,288	151,133
流動資産合計	265,999,378	447,486,326
資産合計	265,999,378	447,486,326
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,142,158	139,198
未払受託者報酬	33,526	49,012
未払委託者報酬	290,905	425,112
その他未払費用	11,097	16,269
流動負債合計	1,477,686	629,591
負債合計	1,477,686	629,591
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	233,137,568	411,520,254
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	31,384,124	35,336,481
純資産合計	264,521,692	446,856,735
負債純資産合計	265,999,378	447,486,326

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 (自2018年12月21日 至2019年6月20日)	第4期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	3,396,912	7,765,737
営業収益合計	3,396,912	7,765,735
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	4
受託者報酬	13,148	49,012
委託者報酬	115,195	425,112
その他費用	4,300	16,269
営業費用合計	132,643	490,397
営業利益又は営業損失( )	3,264,269	8,256,132
経常利益又は経常損失( )	3,264,269	8,256,132
中間純利益又は中間純損失( )	3,264,269	8,256,132
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	173,854	1,905,487
期首剰余金又は期首欠損金( )	585,573	31,384,124
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,924,009	15,245,943
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,924,009	15,245,943
剰余金減少額又は欠損金増加額	87,226	4,942,941
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	87,226	4,942,941
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,341,625	35,336,481

## (3) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 2019年12月20日現在	第4期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	233,137,568口	411,520,254口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1346円 (11,346円)	1.0859円 (10,859円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2019年12月20日現在	第4期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第3期	第4期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	43,997,897円	233,137,568円
期中追加設定元本額	215,465,288円	216,329,381円
期中一部解約元本額	26,325,617円	37,946,695円

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2050】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	291	269
コール・ローン	26,647	57,238
親投資信託受益証券	25,150,604	80,456,838
未収入金	677	61,370
流動資産合計	25,178,219	80,575,715
資産合計	25,178,219	80,575,715
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	59,230
未払受託者報酬	2,752	6,013
未払委託者報酬	24,251	52,421
その他未払費用	838	1,938
流動負債合計	27,841	119,602
負債合計	27,841	119,602
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	21,794,219	72,973,802
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,356,159	7,482,311
純資産合計	25,150,378	80,456,113
負債純資産合計	25,178,219	80,575,715

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 (自2019年1月10日 至2019年7月9日)	第2期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	287,248	16,882
<b>営業収益合計</b>	<b>287,248</b>	<b>16,882</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	550	6,013
委託者報酬	4,935	52,421
その他費用	109	1,938
<b>営業費用合計</b>	<b>5,594</b>	<b>60,372</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>281,654</b>	<b>43,490</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>281,654</b>	<b>43,490</b>
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>281,654</b>	<b>43,490</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	9,508	428,298
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>-</b>	<b>3,356,159</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>643,074</b>	<b>4,892,716</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	643,074	4,892,716
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>28,739</b>	<b>1,151,372</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,739	1,151,372
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>886,481</b>	<b>7,482,311</b>

## ( 3 ) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	21,794,219口	72,973,802口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1540円 (11,540円)	1.1025円 (11,025円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	1,000,000円	21,794,219円
期中追加設定元本額	24,368,600円	59,441,145円
期中一部解約元本額	3,574,381円	8,261,562円



## 【DCニッセイターゲットデートファンド2055】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月20日現在)	第5期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,815	2,787
コール・ローン	441,484	594,021
親投資信託受益証券	359,197,149	442,674,269
未収入金	372,838	326,719
流動資産合計	360,016,286	443,597,796
資産合計	360,016,286	443,597,796
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	363,097	314,935
未払受託者報酬	45,896	61,231
未払委託者報酬	398,175	531,014
その他未払費用	15,217	20,334
流動負債合計	822,385	927,514
負債合計	822,385	927,514
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	262,527,078	339,367,304
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	96,666,823	103,302,978
純資産合計	359,193,901	442,670,282
負債純資産合計	360,016,286	443,597,796

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 (自2018年12月21日 至2019年6月20日)	第5期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	3
有価証券売買等損益	5,138,327	14,881,866
営業収益合計	5,138,327	14,881,863
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	28
受託者報酬	19,439	61,231
委託者報酬	170,396	531,014
その他費用	6,415	20,334
営業費用合計	196,250	612,607
営業利益又は営業損失( )	4,942,077	15,494,470
経常利益又は経常損失( )	4,942,077	15,494,470
中間純利益又は中間純損失( )	4,942,077	15,494,470
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	269,475	4,126,687
期首剰余金又は期首欠損金( )	11,073,156	96,666,823
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,952,451	40,086,074
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,952,451	40,086,074
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,810,140	22,082,136
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,810,140	22,082,136
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	39,888,069	103,302,978

## (3) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期 2019年12月20日現在	第5期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	262,527,078口	339,367,304口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3682円 (13,682円)	1.3044円 (13,044円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2019年12月20日現在	第5期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第4期	第5期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	60,828,074円	262,527,078円
期中追加設定元本額	228,564,856円	138,413,474円
期中一部解約元本額	26,865,852円	61,573,248円

## 【DCニッセイターゲットデートファンド2060】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2019年12月20日現在)	第2期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	283	310
コール・ローン	25,975	66,026
親投資信託受益証券	32,944,568	87,040,208
未収入金	711,338	1,338,305
流動資産合計	33,682,164	88,444,849
資産合計	33,682,164	88,444,849
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	710,480	1,336,029
未払受託者報酬	2,710	6,909
未払委託者報酬	23,843	60,245
その他未払費用	849	2,230
流動負債合計	737,882	1,405,413
負債合計	737,882	1,405,413
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	28,378,089	78,753,197
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,566,193	8,286,239
純資産合計	32,944,282	87,039,436
負債純資産合計	33,682,164	88,444,849

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 (自2019年1月10日 至2019年7月9日)	第2期中間計算期間 (自2019年12月21日 至2020年6月20日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	198,578	470,188
<b>営業収益合計</b>	<b>198,578</b>	<b>470,188</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	861	6,909
委託者報酬	7,705	60,245
その他費用	229	2,230
<b>営業費用合計</b>	<b>8,795</b>	<b>69,384</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>189,783</b>	<b>539,572</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>189,783</b>	<b>539,572</b>
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>189,783</b>	<b>539,572</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	25,165	1,207,468
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>-</b>	<b>4,566,193</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>1,009,756</b>	<b>6,224,131</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,009,756	6,224,131
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>193,378</b>	<b>3,171,981</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	193,378	3,171,981
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>980,996</b>	<b>8,286,239</b>

## (3) 【中間注記表】

## (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。
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	28,378,089口	78,753,197口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1609円 (11,609円)	1.1052円 (11,052円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2019年12月20日現在	第2期中間計算期間 2020年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

(その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
期首元本額	1,000,000円	28,378,089円
期中追加設定元本額	36,713,552円	73,099,728円
期中一部解約元本額	9,335,463円	22,724,620円





## &lt; 参考 &gt;

開示対象ファンド（DCニッセイターゲットデートファンド2060）は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券バッシブ マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

## 「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,982,489	5,156,461
コール・ローン	1,557,058,854	1,098,868,876
株式	67,651,741,100	136,110,553,620
派生商品評価勘定	7,334,900	-
未収入金	-	3,404,000
未収配当金	7,814,340	927,791,234
前払金	-	57,810,000
差入委託証拠金	39,360,000	90,405,000
流動資産合計	69,280,291,683	138,293,989,191
資産合計	69,280,291,683	138,293,989,191
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	40,657,650
前受金	13,940,000	-
未払解約金	282,184,177	106,406,625
その他未払費用	2,094	2,694
流動負債合計	296,126,271	147,066,969
負債合計	296,126,271	147,066,969
純資産の部		
元本等		
元本	37,088,154,099	80,206,971,055
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,896,011,313	57,939,951,167
純資産合計	68,984,165,412	138,146,922,222
負債純資産合計	69,280,291,683	138,293,989,191

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	37,088,154,099口	80,206,971,055口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8600円 (18,600円)	1.7224円 (17,224円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

## 株式関連

種類	2019年12月20日 現在				2020年6月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	1,407,940,000	-	1,415,320,000	7,380,000	1,991,370,000	-	1,950,780,000	40,590,000
合計	1,407,940,000	-	1,415,320,000	7,380,000	1,991,370,000	-	1,950,780,000	40,590,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(その他の注記)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	33,490,455,341円	37,088,154,099円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	14,453,233,240円	52,492,124,150円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,855,534,482円	9,373,307,194円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,419,327,977円	6,226,455,849円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	4,490,244,383円	4,207,926,526円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,061,985円	4,141,759円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,468,992,924円	1,693,768,976円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,189,906,169円	5,838,766,341円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,475,361,436円	3,877,427,216円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	8,365,927円	6,502,946円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	35,197,323円	31,071,667円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	43,310,499円	34,085,033円
DCニッセイ国内株式インデックス	305,067,072円	364,406,047円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	14,513,159,469円	16,753,628,681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)	646,384,003円	873,140,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	86,317,623円	114,730,338円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	77,339,395円	125,647,107円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	60,519,729円	109,748,984円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	117,671,498円	264,268,740円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	36,314,500円	56,043,197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)	43,386,870円	56,365,685円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,618,040円	6,454,916円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,610,276円	5,048,011円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,046,984円	1,354,232円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	3,084,499円	4,259,372円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	17,023,422円	19,639,386円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	8,055,589円	23,070,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,898,975円	20,284,945円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	10,336,705円	81,628,275円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	11,550,827円	110,483,856円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	-円	39,296,621,820円
計	37,088,154,099円	80,206,971,055円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	34,374,685,386円	37,088,154,099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	13,002,541,137円	52,492,124,150円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	10,289,072,424円	9,373,307,194円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,419,327,977円	6,226,455,849円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	4,490,244,383円	4,207,926,526円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,061,985円	4,141,759円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,468,992,924円	1,693,768,976円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,189,906,169円	5,838,766,341円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,475,361,436円	3,877,427,216円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	8,365,927円	6,502,946円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	35,197,323円	31,071,667円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	43,310,499円	34,085,033円
DCニッセイ国内株式インデックス	305,067,072円	364,406,047円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	14,513,159,469円	16,753,628,681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)	646,384,003円	873,140,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	86,317,623円	114,730,338円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	77,339,395円	125,647,107円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	60,519,729円	109,748,984円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	117,671,498円	264,268,740円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	36,314,500円	56,043,197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)	43,386,870円	56,365,685円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,618,040円	6,454,916円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,610,276円	5,048,011円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,046,984円	1,354,232円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	3,084,499円	4,259,372円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	17,023,422円	19,639,386円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	8,055,589円	23,070,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	5,898,975円	20,284,945円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	10,336,705円	81,628,275円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	11,550,827円	110,483,856円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	-円	39,296,621,820円
計	37,088,154,099円	80,206,971,055円

## 「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	503,769,850	1,235,095,419
金銭信託	64,589,250	21,858,546
コール・ローン	5,921,938,811	4,658,171,085
株式	208,192,680,647	233,505,494,004
投資証券	5,627,632,097	5,984,088,138
派生商品評価勘定	57,222,541	102,703,902
未収入金	2,196,503	72,762,601
未収配当金	201,755,393	246,684,193
差入委託証拠金	2,253,270,280	3,913,376,186
流動資産合計	222,825,055,372	249,740,234,074
資産合計	222,825,055,372	249,740,234,074
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,598,250	11,200,072
未払金	-	80,323,038
未払解約金	977,642,318	479,140,995
その他未払費用	4,485	3,750
流動負債合計	988,245,053	570,667,855
負債合計	988,245,053	570,667,855
純資産の部		
元本等		
元本	112,742,781,870	135,405,565,447
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	109,094,028,449	113,764,000,772
純資産合計	221,836,810,319	249,169,566,219
負債純資産合計	222,825,055,372	249,740,234,074



## 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	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	112,742,781,870口	135,405,565,447口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9676円 (19,676円)	1.8402円 (18,402円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年12月20日 現在				2020年6月20日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	4,610,641,799	-	4,636,541,870	25,900,071	3,738,448,928	-	3,730,855,280	7,593,648
アメリカ・ドル	3,331,033,077	-	3,355,360,080	24,327,003	2,518,631,823	-	2,519,611,080	979,257
イギリス・ポンド	368,569,867	-	365,053,070	3,516,797	409,131,383	-	405,133,100	3,998,283
ユーロ	911,038,855	-	916,128,720	5,089,865	810,685,722	-	806,111,100	4,574,622
合計	4,610,641,799	-	4,636,541,870	25,900,071	3,738,448,928	-	3,730,855,280	7,593,648

## （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。

## 株式関連

種類	2019年12月20日 現在				2020年6月20日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	7,531,780,502	-	7,552,504,722	20,724,220	9,307,705,915	-	9,406,803,394	99,097,479
合計	7,531,780,502	-	7,552,504,722	20,724,220	9,307,705,915	-	9,406,803,394	99,097,479

## （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。

(その他の注記)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	91,047,657,387円	112,742,781,870円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	43,722,320,193円	39,974,527,090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	22,027,195,710円	17,311,743,513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)	710,084,786円	790,629,833円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,303,464,505円	3,592,855,637円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,489,520,821円	2,687,148,187円
ニッセイ外国株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	1,491,869,965円	1,637,489,992円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,043,768円	3,036,168円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	22,684,869円	19,342,781円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	31,332,640円	23,728,686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)	11,368,150,601円	11,140,934,785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	76,690,722,917円	94,479,393,434円
DCニッセイ外国株式インデックス	15,623,093,548円	18,910,573,463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)	624,880,559円	814,966,819円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	61,886,852円	79,526,108円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	74,770,417円	117,308,944円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	43,154,714円	75,852,869円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	83,849,166円	182,434,767円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	24,284,062円	34,893,305円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	41,935,568円	52,612,434円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,437,499円	5,992,880円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,507,322円	4,687,266円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,017,232円	1,256,420円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	16,533,824円	18,237,954円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,788,980円	16,023,716円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,218,552円	14,059,244円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,410,424円	56,407,168円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	8,138,279円	74,900,131円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	-円	265,844,009円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定)	-円	305,428,447円
計	112,742,781,870円	135,405,565,447円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	92,598,912,036円	112,742,781,870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	41,205,321,117円	39,974,527,090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	21,061,451,283円	17,311,743,513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)	710,084,786円	790,629,833円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,303,464,505円	3,592,855,637円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,489,520,821円	2,687,148,187円
ニッセイ外国株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	1,491,869,965円	1,637,489,992円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,043,768円	3,036,168円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	22,684,869円	19,342,781円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	31,332,640円	23,728,686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)	11,368,150,601円	11,140,934,785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	76,690,722,917円	94,479,393,434円
DCニッセイ外国株式インデックス	15,623,093,548円	18,910,573,463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)	624,880,559円	814,966,819円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	61,886,852円	79,526,108円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	74,770,417円	117,308,944円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	43,154,714円	75,852,869円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	83,849,166円	182,434,767円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	24,284,062円	34,893,305円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	41,935,568円	52,612,434円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,437,499円	5,992,880円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,507,322円	4,687,266円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,017,232円	1,256,420円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	16,533,824円	18,237,954円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	5,788,980円	16,023,716円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	4,218,552円	14,059,244円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,410,424円	56,407,168円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	8,138,279円	74,900,131円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	-円	265,844,009円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定)	-円	305,428,447円
計	112,742,781,870円	135,405,565,447円

## 「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,747,143	2,628,296
コール・ローン	801,991,714	560,103,651
国債証券	57,556,949,870	59,754,101,730
地方債証券	7,194,972,966	7,179,971,436
特殊債券	8,297,600,981	8,203,465,592
社債券	5,727,607,300	5,707,215,300
未収利息	117,745,701	222,480,991
前払費用	1,039,911	11,577,981
流動資産合計	79,706,655,586	81,641,544,977
資産合計	79,706,655,586	81,641,544,977
負債の部		
流動負債		
未払解約金	59,199,520	4,486,761
その他未払費用	873	548
流動負債合計	59,200,393	4,487,309
負債合計	59,200,393	4,487,309
純資産の部		
元本等		
元本	80,678,394,417	83,009,770,614
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,030,939,224	1,372,712,946
純資産合計	79,647,455,193	81,637,057,668
負債純資産合計	79,706,655,586	81,641,544,977

## 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>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までには個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
--------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	80,678,394,417口	83,009,770,614口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額元本の欠損	1,030,939,224円	1,372,712,946円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9872円 (9,872円)	0.9835円 (9,835円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (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。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

(その他の注記)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	92,267,281,358円	80,678,394,417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	6,791,748,562円	5,650,353,079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	18,380,635,503円	3,318,976,882円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	76,301,963,543円	76,519,957,362円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,941,715,464円	2,110,742,425円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	36,321,282円	48,598,806円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,720,704,118円	2,695,970,918円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	38,861,533円	70,279,647円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	125,831,324円	296,880,287円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	325,714,099円	655,264,879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)	79,888,009円	100,064,561円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リー ト/債券)	4,828,283円	6,005,775円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リー ト/債券)	26,641,035円	35,510,564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)	31,405,110円	34,829,813円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,777,513円	7,664,551円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3,118,191円	10,739,108円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,907,384円	62,302,076円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	30,717,529円	354,959,842円
計	80,678,394,417円	83,009,770,614円



「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	92,029,121,671円	80,678,394,417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	6,631,883,889円	5,650,353,079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	17,982,611,143円	3,318,976,882円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	76,301,963,543円	76,519,957,362円
DCニッセイ日本債券インデックス	1,941,715,464円	2,110,742,425円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	36,321,282円	48,598,806円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,720,704,118円	2,695,970,918円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	38,861,533円	70,279,647円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	125,831,324円	296,880,287円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	325,714,099円	655,264,879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)	79,888,009円	100,064,561円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	4,828,283円	6,005,775円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	26,641,035円	35,510,564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)	31,405,110円	34,829,813円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,777,513円	7,664,551円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3,118,191円	10,739,108円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	7,907,384円	62,302,076円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	30,717,529円	354,959,842円
計	80,678,394,417円	83,009,770,614円

## 「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	20,171,353	58,228,332
金銭信託	1,751,943	426,338
コール・ローン	160,628,921	90,854,895
国債証券	25,337,125,462	28,311,247,857
派生商品評価勘定	-	5,454
未収入金	-	42,570
未収利息	159,445,352	155,409,573
前払費用	15,350,586	20,593,769
流動資産合計	25,694,473,617	28,636,808,788
資産合計	25,694,473,617	28,636,808,788
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,972	101,690
未払金	22,852,130	52,824,747
未払解約金	100,051,340	46,468,644
その他未払費用	158	182
流動負債合計	122,978,600	99,395,263
負債合計	122,978,600	99,395,263
純資産の部		
元本等		
元本	18,425,435,154	20,033,397,504
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,146,059,863	8,504,016,021
純資産合計	25,571,495,017	28,537,413,525
負債純資産合計	25,694,473,617	28,636,808,788

## 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>国債証券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価して 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>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. 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	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 受益権総口数	18,425,435,154口	20,033,397,504口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3878円 (13,878円)	1.4245円 (14,245円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年12月20日現在	2020年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2019年12月20日 現在				2020年6月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	56,498,263	-	56,423,291	74,972	54,392,268	-	54,296,032	96,236
アメリカ・ドル	44,954,755	-	44,910,973	43,782	41,550,824	-	41,450,919	99,905
イギリス・ポンド	1,437,523	-	1,425,924	11,599	1,369,715	-	1,369,983	268
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,571,965	-	1,571,565	400
デンマーク・クローネ	1,221,373	-	1,218,379	2,994	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	1,986,620	-	1,984,900	1,720	-	-	-	-
ユーロ	6,897,992	-	6,883,115	14,877	9,899,764	-	9,903,565	3,801
合計	56,498,263	-	56,423,291	74,972	54,392,268	-	54,296,032	96,236

(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。

(その他の注記)

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」、「DCニッセイターゲットデートファンド2035」、「DCニッセイターゲットデートファンド2045」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2055」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	13,614,520,319円	18,425,435,154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	7,848,485,042円	5,200,549,165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	3,037,570,207円	3,592,586,815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)	1,946,967,139円	2,048,922,019円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,396,628,027円	3,493,960,646円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,137,700,596円	1,162,050,709円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	703,528,953円	716,375,275円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	5,543,732円	3,934,811円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	15,541,267円	12,538,380円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	15,333,036円	10,989,199円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	8,724,136,622円	9,365,664,965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)	856,773,731円	1,056,850,242円
DCニッセイ外国債券インデックス	908,433,502円	1,052,978,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	29,558,606円	35,747,187円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	512,517,884円	759,660,149円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	20,667,302円	34,485,528円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	41,002,415円	84,182,148円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	15,164,223円	22,595,298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)	57,507,116円	68,240,405円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,455,001円	4,096,031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)	22,470,642円	23,766,759円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,758,911円	7,215,531円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,017,446円	6,377,197円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	3,573,727円	25,662,070円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,155,276円	37,104,380円
計	18,425,435,154円	20,033,397,504円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」、「DCニッセイターゲットデートファンド2040」、「DCニッセイターゲットデートファンド2050」及び「DCニッセイターゲットデートファンド2060」の開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年12月20日現在	2020年6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	13,507,570,734円	18,425,435,154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	7,552,683,269円	5,200,549,165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	2,634,818,849円	3,592,586,815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)	1,946,967,139円	2,048,922,019円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,396,628,027円	3,493,960,646円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,137,700,596円	1,162,050,709円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	703,528,953円	716,375,275円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	5,543,732円	3,934,811円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	15,541,267円	12,538,380円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	15,333,036円	10,989,199円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	8,724,136,622円	9,365,664,965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)	856,773,731円	1,056,850,242円
DCニッセイ外国債券インデックス	908,433,502円	1,052,978,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	29,558,606円	35,747,187円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	512,517,884円	759,660,149円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	20,667,302円	34,485,528円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	41,002,415円	84,182,148円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	15,164,223円	22,595,298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)	57,507,116円	68,240,405円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,455,001円	4,096,031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)	22,470,642円	23,766,759円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	2,758,911円	7,215,531円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	2,017,446円	6,377,197円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	3,573,727円	25,662,070円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,155,276円	37,104,380円
計	18,425,435,154円	20,033,397,504円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

「DCニッセイターゲットデートファンド2025」 (2020年6月30日現在)

資産総額	848,071,837円
負債総額	1,349,500円
純資産総額( - )	846,722,337円
発行済数量	806,878,306口
1口当たり純資産額( / )	1.0494円

「DCニッセイターゲットデートファンド2030」 (2020年6月30日現在)

資産総額	734,511,257円
負債総額	137,957円
純資産総額( - )	734,373,300円
発行済数量	684,539,124口
1口当たり純資産額( / )	1.0728円

「DCニッセイターゲットデートファンド2035」 (2020年6月30日現在)

資産総額	1,195,982,640円
負債総額	2,524,329円
純資産総額( - )	1,193,458,311円
発行済数量	1,109,911,234口
1口当たり純資産額( / )	1.0753円

「DCニッセイターゲットデートファンド2040」 (2020年6月30日現在)

資産総額	341,805,522円
負債総額	29,258円
純資産総額( - )	341,776,264円
発行済数量	313,721,262口
1口当たり純資産額( / )	1.0894円

「DCニッセイターゲットデートファンド2045」 (2020年6月30日現在)

資産総額	456,169,610円
負債総額	1,953,312円
純資産総額( - )	454,216,298円
発行済数量	421,389,730口
1口当たり純資産額( / )	1.0779円

「DCニッセイターゲットデートファンド2050」 (2020年6月30日現在)

資産総額	80,789,718円
負債総額	9,976円
純資産総額( - )	80,779,742円
発行済数量	73,820,863口
1口当たり純資産額( / )	1.0943円

「DCニッセイターゲットデートファンド2055」 (2020年6月30日現在)

資産総額	445,326,580円
負債総額	184,524円
純資産総額( - )	445,142,056円
発行済数量	343,903,401口
1口当たり純資産額( / )	1.2944円



## 「DCニッセイターゲットデートファンド2060」

(2020年6月30日現在)

資産総額	88,155,632円
負債総額	887,462円
純資産総額( - )	87,268,170円
発行済数量	79,582,278口
1口当たり純資産額( / )	1.0966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

2020年6月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に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。

2020年6月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	403	64,192
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	128	26,198
単位型公社債投資信託	0	0
合計	531	90,391

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第25期事業年度（自2019年4月1日 至 2020年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		18,401,863		28,674,230
有価証券		8,008,550		6,301,326
前払費用		608,442		546,666
未収委託者報酬		4,705,229		4,882,250
未収運用受託報酬		1,911,554		2,039,974
未収投資助言報酬		168,445		174,892
その他		31,744		50,572
流動資産合計		33,835,830		42,669,914
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	72,641	1	98,471
車両	1	3,268	1	2,180
器具備品	1	95,277	1	142,866
有形固定資産合計		171,187		243,517
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		968,052		969,528
ソフトウェア仮勘定		24,478		216,033
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		1,000,545		1,193,575
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		36,902,679		33,634,499
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		167,886		-
差入保証金		293,513		303,875
繰延税金資産		1,066,925		1,292,446
その他		87,940		17,821
投資その他の資産合計		38,585,168		35,314,867
固定資産合計		39,756,901		36,751,960
資産合計		73,592,732		79,421,875

## 負債の部

## 流動負債

預り金	65,641	45,856
未払収益分配金	6,368	5,643
未払手数料	1,736,084	1,633,415
未払運用委託報酬	702,648	810,981
未払投資助言報酬	723,039	852,782
その他未払金	461,392	3,591,122
未払費用	113,233	146,706
未払法人税等	1,996,248	686,983
賞与引当金	853,083	975,373
その他	289,152	544,366
流動負債合計	6,946,893	9,293,232

## 固定負債

退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
役員退職慰労引当金	22,500	22,700
固定負債合計	1,824,248	1,973,446

## 負債合計

負債合計	8,771,142	11,266,679
------	-----------	------------

## 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	45,192,421	48,745,315
利益剰余金合計	45,872,228	49,425,122
株主資本合計	64,154,068	67,706,962

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	711,399	512,183
繰延ヘッジ損益	43,878	63,949
評価・換算差額等合計	667,521	448,234

## 純資産合計

純資産合計	64,821,590	68,155,196
-------	------------	------------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計	73,592,732	79,421,875
----------	------------	------------

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,471,631	27,088,982
運用受託報酬	11,784,292	13,165,624
投資助言報酬	610,372	677,248
その他営業収益	16,907	2,000
営業収益計	38,883,204	40,933,856
営業費用		
支払手数料	11,518,158	11,090,478
広告宣伝費	23,965	25,032
公告費	130	-
調査費	5,954,296	6,466,222
支払運用委託報酬	1,695,119	1,866,932
支払投資助言報酬	3,019,717	3,238,306
委託調査費	106,467	125,262
調査費	1,132,991	1,235,721
委託計算費	229,936	249,653
営業雑経費	812,655	929,200
通信費	49,932	47,749
印刷費	190,576	189,820
協会費	34,445	38,958
その他営業雑経費	537,701	652,672
営業費用計	18,539,142	18,760,587
一般管理費		
役員報酬	137,828	142,108
給料・手当	3,685,286	3,934,995
賞与引当金繰入額	851,086	974,031
賞与	279,376	285,503
福利厚生費	710,135	762,163
退職給付費用	311,969	307,637
役員退職慰労引当金繰入額	8,350	7,000
役員退職慰労金	150	30
その他人件費	151,765	172,763
不動産賃借料	673,220	682,105
その他不動産経費	30,378	31,283
交際費	29,832	28,014
旅費交通費	209,373	170,993
固定資産減価償却費	405,606	442,697
租税公課	325,740	341,195
業務委託費	261,111	291,579
器具備品費	332,440	354,221
保険料	52,393	46,549
諸経費	189,822	225,408
一般管理費計	8,645,865	9,200,283
営業利益	11,698,196	12,972,984
営業外収益		
受取利息	573	1,176
有価証券利息	24,008	12,651
受取配当金	124,674	200,028

金融派生商品収益	35,286		14,042
為替差益	22,977		-
その他営業外収益	14,395		13,606
営業外収益計	221,915		241,504
営業外費用			
為替差損	-		27,288
金融派生商品費用	20,127		9,593
控除対象外消費税	17,501		5,453
その他営業外費用	1,080		8,493
営業外費用計	38,709		50,829
経常利益	11,881,403		13,163,659
特別利益			
投資有価証券売却益	655,395		4,459
投資有価証券償還益	46,876		1,744
特別利益計	702,272		6,204
特別損失			
投資有価証券売却損	81,265		72,045
投資有価証券償還損	68,047		4,115
固定資産除却損	1	1,089	1
事故損失賠償金	2	511	2
特別損失計	150,913		88,934
税引前当期純利益	12,432,761		13,080,929
法人税、住民税及び事業税	3,862,523		4,134,957
法人税等調整額	43,320		106,970
法人税等合計	3,905,844		4,027,986
当期純利益	8,526,917		9,052,942



## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,067,603	5,067,603	5,067,603
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,526,917	8,526,917	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,459,314	3,459,314	3,459,314
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,067,603
当期純利益	-	-	-	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	68,039	48,515	116,554	116,554
当期変動額合計	68,039	48,515	116,554	3,342,759
当期末残高	711,399	43,878	667,521	64,821,590

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余 金合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,500,048	5,500,048	5,500,048
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	9,052,942	9,052,942	9,052,942
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,552,893	3,552,893	3,552,893
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	48,745,315	49,425,122	67,706,962

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

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
5. 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。
8. 連結納税	日本生命保険相互会社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(2020年3月31日 企業会計基準委員会 実務対応報告第39号)に基づき、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいて計上しております。

(会計上の見積りの変更)

(退職給付債務の計算方法に係る見積りの変更)

年俸制適用者について、退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法へ変更しております。この変更は、従業員数が増加したことに伴い、退職給付債務の金額の算定の精度を高め、退職給付費用の期間損益計算を適正化するために行ったものであります。

この変更に伴い、当事業年度末における退職給付引当金が54,100千円減少し、同額を一般管理費の退職給付費用より減額しております。

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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。

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

#### (1) 概要

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

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

#### (2) 適用年月日

2021年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物附属設備	325,809千円	310,385千円
車両	3,460	4,549
器具備品	474,339	394,258
計	803,609	709,193

## （損益計算書関係）

1．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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
建物附属設備	- 千円	4,181千円
器具備品	623	4,240
ソフトウェア	465	-
計	1,089	8,422

2．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2018年4月1日 至2019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

2018年6月22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	5,000,103千円
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

2019年3月19日開催の臨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
配当財産の種類	投資有価証券
配当財産の帳簿価額	67,500千円
譲渡株数	1,350株
1株当たり配当額	-

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

2019年6月28日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

2020年6月29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	5,500,048千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	50,716円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月29日

## (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(2019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	18,401,863	18,401,863	-
有価証券			
満期保有目的の債券	2,199,830	2,205,940	6,109
その他有価証券	5,808,720	5,808,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,649,504	17,681,300	31,795
その他有価証券	19,253,174	19,253,174	-
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	47,244	47,244	-

( )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。



当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	28,674,230	28,674,230	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,301,326	6,307,330	6,003
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,547,229	11,546,970	259
その他有価証券	22,087,270	22,087,270	-
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用され ているもの	10,218	10,218	-

( ) デリバティブ取引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 示してあります。

(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

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

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
関係会社株式	66,222	66,222

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

(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(2019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	18,401,863	-	-	-
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	2,200,000	17,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	7,033,352	15,714,537	2,156,988	138,951
合計	27,635,215	33,364,537	2,156,988	138,951

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2020年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券、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（2019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	18,749,335	18,787,460	38,124
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	18,749,335	18,787,460	38,124
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	1,100,000	1,099,780	220
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,100,000	1,099,780	220
合計		19,849,335	19,887,240	37,904

当事業年度（2020年3月31日）

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

## 2. その他有価証券

前事業年度（2019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	5,808,720	5,801,046	7,673
	国債・地方債等	5,808,720	5,801,046	7,673
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	13,421,370	12,553,359	868,010
	小計	19,230,090	18,354,406	875,684
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）	5,831,804	5,981,670	149,865
	小計	5,831,804	5,981,670	149,865
	合計	25,061,894	24,336,076	725,818

当事業年度（2020年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自2018年4月1日 至2019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	2,232,532	655,395	81,265
合計	2,232,532	655,395	81,265

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

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

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度(2019年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,909,028	-	47,244
合計			1,909,028	-	47,244

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2020年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職及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、従来まで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したが、対象従業員が300人を超えたため、当事業年度末より原則法に変更しております。

## 2. 確定給付制度

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

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	- 千円	- 千円
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	1,887,492
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	-	54,100
退職給付債務の期末残高	-	1,833,391

## (2) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,682,532 千円	1,801,748 千円
退職給付費用	229,805	274,595
退職給付の支払額	110,589	71,495
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	1,887,492
退職給付引当金の期末残高	1,801,748	117,355

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

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,801,748 千円	1,950,746 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,801,748	1,950,746
退職給付引当金	1,801,748	1,950,746
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,801,748	1,950,746



## (4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	229,805 千円	274,595 千円
簡便法から原則法への変更に伴う減少額	-	54,100
確定給付制度に係る退職給付費用	229,805	220,494

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

	前事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
割引率	- %	0.32 %

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において58,788千円、当事業年度において62,535千円であり、退職給付費用に計上しております。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	261,214 千円	298,659 千円
未払事業税	119,420	130,502
退職給付引当金	551,695	597,318
税務上の繰延資産償却超過額	6,126	4,337
役員退職慰労引当金	6,889	6,950
投資有価証券評価差額	88,160	254,174
その他	62,896	82,112
小計	1,096,402	1,374,055
評価性引当額	9	19
繰延税金資産合計	1,096,393	1,374,036
繰延税金負債		
特別分配金否認	5,022	3,682
投資有価証券評価差額	24,444	77,906
繰延税金負債合計	29,467	81,589
繰延税金資産(は負債)の純額	1,066,925	1,292,446

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2018年4月1日 至2019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2019年4月1日 至2020年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

[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2018年4月1日 至2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,299,726	未収運用受託報酬	762,239
								投資助言報酬の受取	130,542	未収投資助言報酬	11,530

当事業年度(自2019年4月1日 至2020年3月31日)

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

(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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
1株当たり純資産額	597,720円47銭	628,459円68銭
1株当たり当期純利益金額	78,626円78銭	83,477円26銭

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

	前事業年度 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,526,917千円	9,052,942千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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)。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ）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

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 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

2020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

2020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：2020年3月末現在)

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

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

2020年3月末現在、450百万円

##### c. 事業の内容

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

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

### (3) 投資助言会社(参考情報)

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

## 3【資本関係】

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

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

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



### 第3【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

2020年5月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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DCニッセイターゲットデートファンド2025の2018年12月21日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2025の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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DCニッセイターゲットデートファンド2030の2019年1月10日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2030の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2035の2018年12月21日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2035の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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DCニッセイターゲットデートファンド2040の2019年1月10日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2040の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2045の2018年12月21日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2045の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。



# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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DCニッセイターゲットデートファンド2050の2019年1月10日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2050の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイターゲットデートファンド2055の2018年12月21日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2055の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

# 独立監査人の監査報告書

2020年1月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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DCニッセイターゲットデートファンド2060の2019年1月10日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2060の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2025の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2025の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2030の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2030の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2035の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2035の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2040の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2040の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2045の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2045の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2050の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2050の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2055の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2055の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2020年7月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 百瀬和政印

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DCニッセイターゲットデートファンド2060の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 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、DCニッセイターゲットデートファンド2060の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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