

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年5月21日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 啓介
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	当初設定額 1百万円 継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2017年6月28日をもって提出した有価証券届出書（2017年10月10日をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み、以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、有価証券報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

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】

<訂正前>

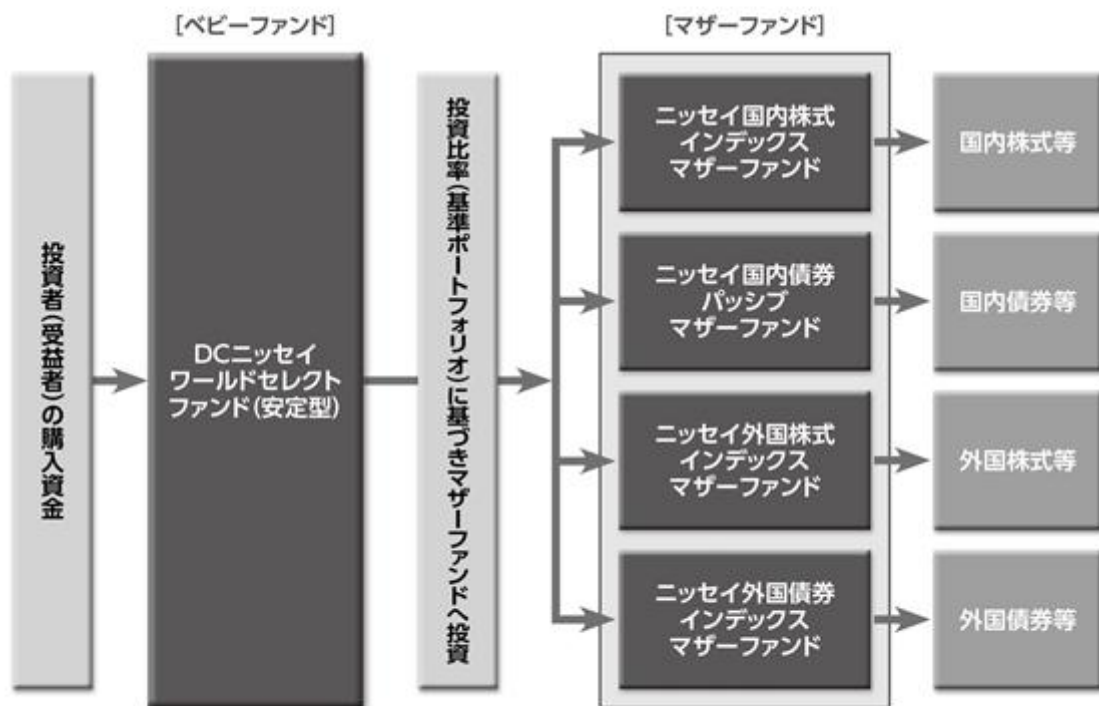
基本方針

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。

ファンドの特色

1 マザーファンドを通じて、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券に投資します。

- 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。



1 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。

2 主要投資対象とする4つのマザーファンドを通じて、バランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることをめざします。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド(以下「国内株式インデックス」ということがあります)

国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)^{*1}(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド(以下「国内債券パッシブ」ということがあります)

国内の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合^{*2}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(以下「外国株式インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の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)^{*3}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド(以下「外国債券インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の主要国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)^{*4}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

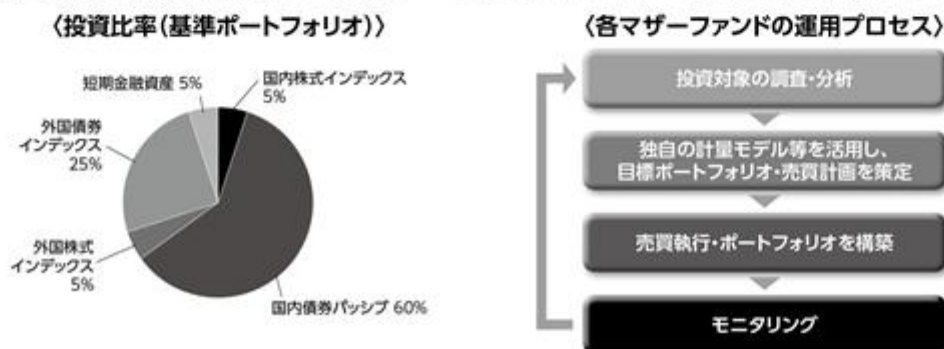
※1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または標章に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行うことができます。

※2 NOMURA-BPI総合とは、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。

※3 MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース)とは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。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。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。

※4 シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、日本を除く世界の主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均し、指数化したものです。シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLCは当ファンドとは何ら関係なく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

●運用にあたっては、以下の各マザーファンドへの投資比率(基準ポートフォリオ)を基本とします。



●基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、ファンドの購入または換金等にもなう資金フローの影響により、一時的に基準ポートフォリオの配分から乖離する場合があります。

＜MSCI 指数にかかる免責条項等＞

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

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

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

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す）。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	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	年 1 回	グローバル (日本含む)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	日 本 北 米 欧 州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あ り ()
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・債券) 資産配分固定型))	日 々 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)資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等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（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

<訂正後>

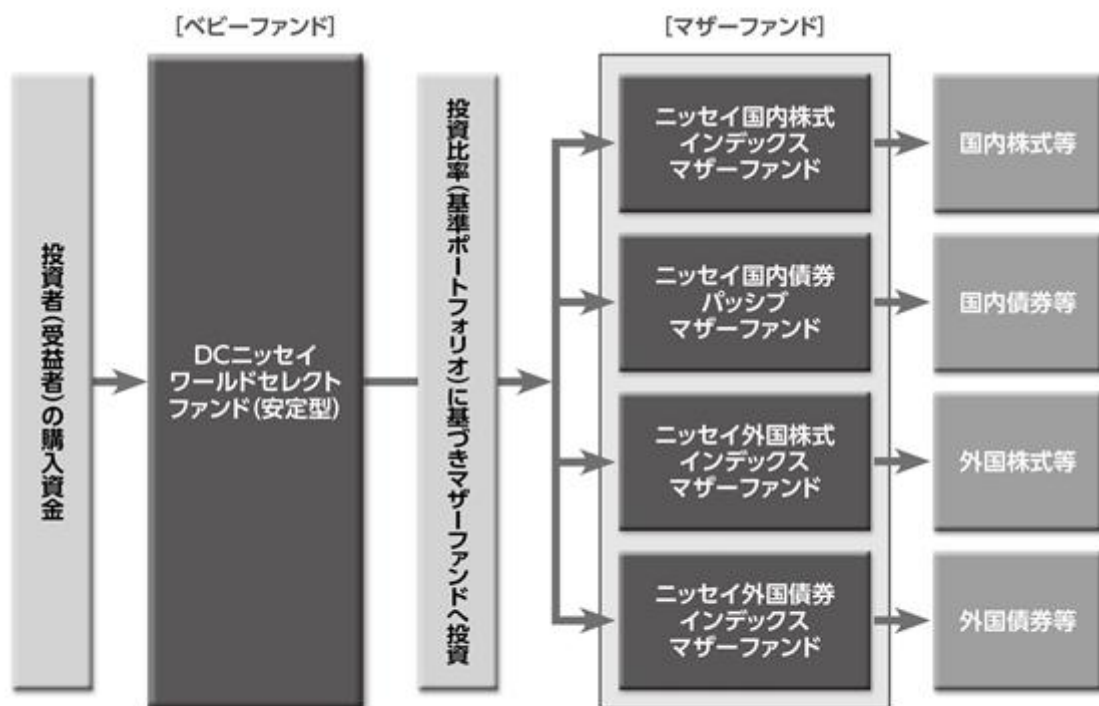
基本方針

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。

ファンドの特色

1 マザーファンドを通じて、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券に投資します。

- 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。



1 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。

2 主要投資対象とする4つのマザーファンドを通じて、バランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることをめざします。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド(以下「国内株式インデックス」ということがあります)

国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)^{*1}(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド(以下「国内債券パッシブ」ということがあります)

国内の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合^{*2}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(以下「外国株式インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の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)^{*3}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド(以下「外国債券インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)^{*4}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

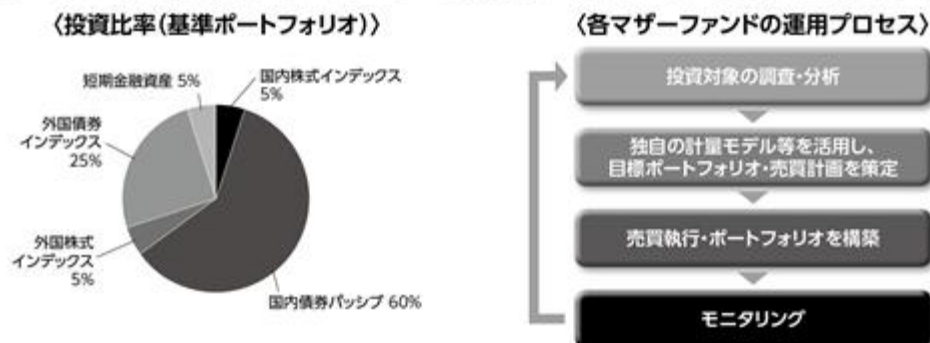
※1 TOPIX(東証株価指数)は、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または標章に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行うことができます。

※2 NOMURA-BPI総合は、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。

※3 MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。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。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。

※4 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。

●運用にあたっては、以下の各マザーファンドへの投資比率(基準ポートフォリオ)を基本とします。



●基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、ファンドの購入または換金等にもなう資金フローの影響により、一時的に基準ポートフォリオの配分から乖離する場合があります。

＜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. との関係は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

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す）。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	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	年1回	グローバル (日本含む)		
債券 一般	年2回	日 本	ファミリー ファンド	あ り ()
公債	年4回	北 米		
社債	年6回 (隔月)	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア		
不動産投信	日 々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式・債券) 資産配分固定型))	その他 ()	中近東 (中東)	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
資産複合 ()		エマー ジング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
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。

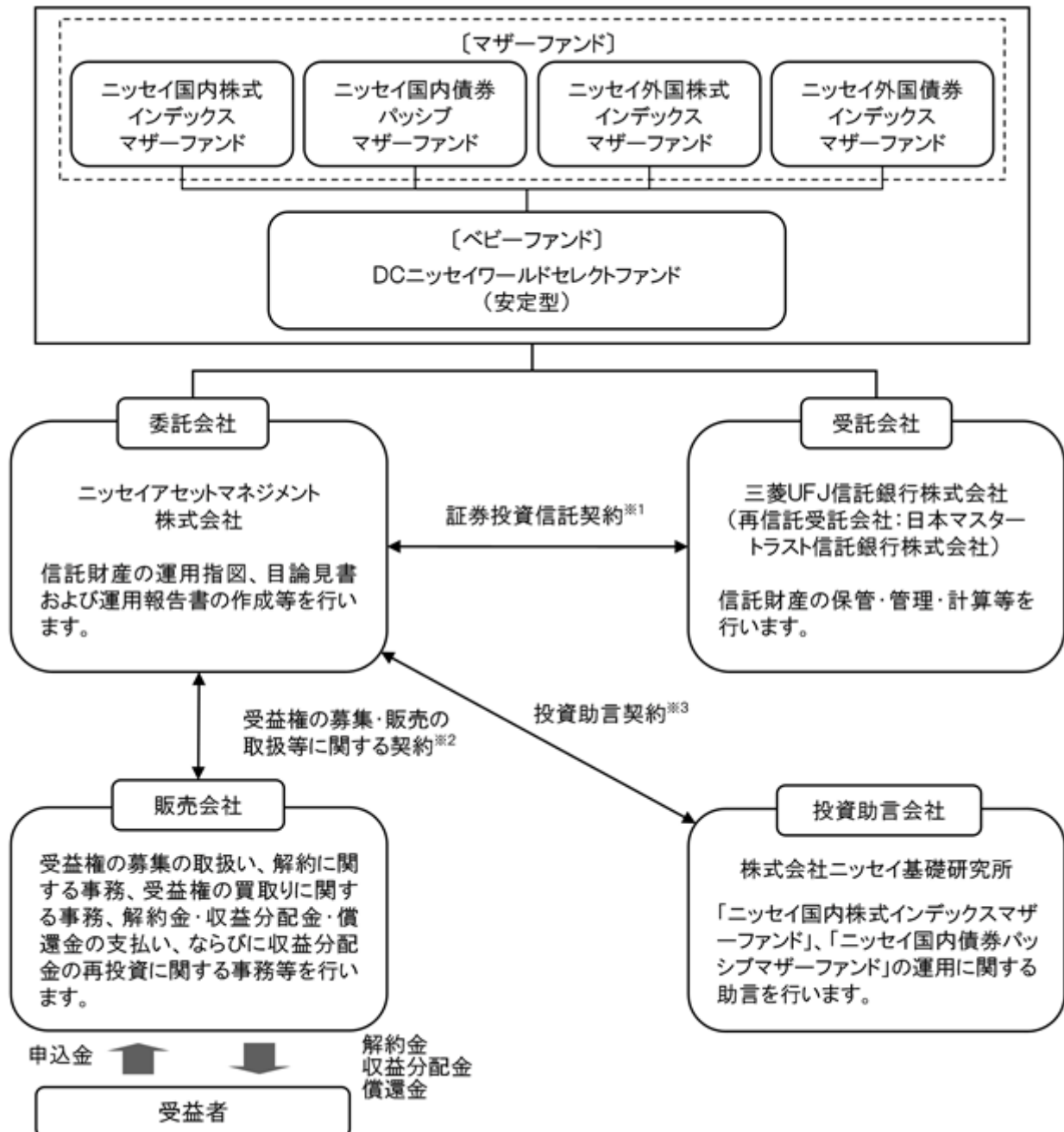
属性区分表

その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等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。

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>



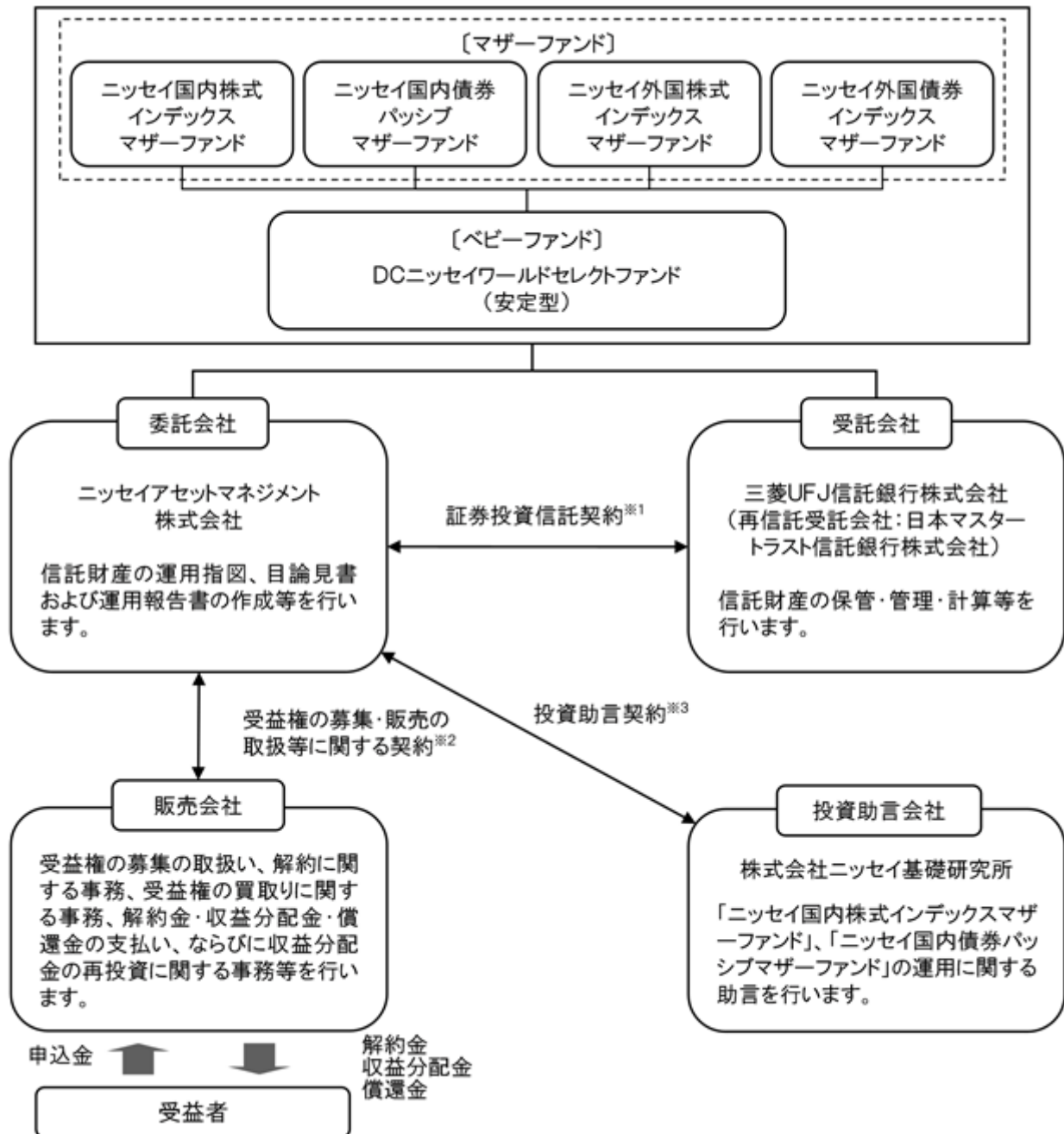
- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（2017年3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 赤林 富二
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	<u>97,604株</u>	<u>90.00%</u>
<u>パトナム・ユーエス・ホールディングス</u> ・ <u>エルエルシー</u>	<u>アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア</u>	<u>10,844株</u>	<u>10.00%</u>

< 訂正後 >



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 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（2018年3月25日現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 西 啓介
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 1995年4月4日
7. 沿革

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

8. 大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<訂正前>

下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	投資比率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5%
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	60%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25%
短期金融資産	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

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。

（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(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

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、シティ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、シティ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。

<訂正後>

下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	投資比率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5%
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	60%

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25%
短期金融資産	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

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。

（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(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

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。

(2)【投資対象】

<訂正前>

a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。また、各マザーファンドはそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

...TOPIX(東証株価指数)(配当込み)

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

...NOMURA-BPI総合

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

...MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

...シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 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)

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

- 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「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」(以下「マザーファンド」といいます)のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます)に投資します。

- 株券または新株引受権証券

- 国債証券

- 地方債証券

- 特別の法律により法人の発行する債券

- 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)

- 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)

- 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)

- 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)

- 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)

- コマーシャル・ペーパー

- 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

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

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます)
14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
 なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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。

<訂正後>

a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。また、各マザーファンドはそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

- ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド
 ...TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド
 ...NOMURA-BPI総合
- ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド
 ...MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
- ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド
 ...FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券

主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「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」(以下「マザーファンド」といいます)のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます)に投資します。

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます)

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り)

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。

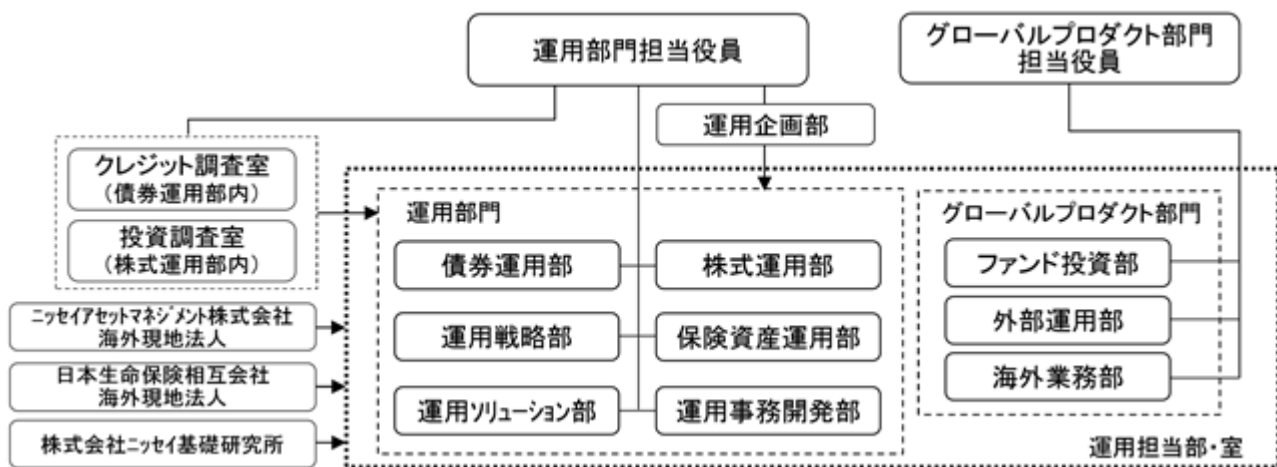
- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で5．の権利の性質を有するもの

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】

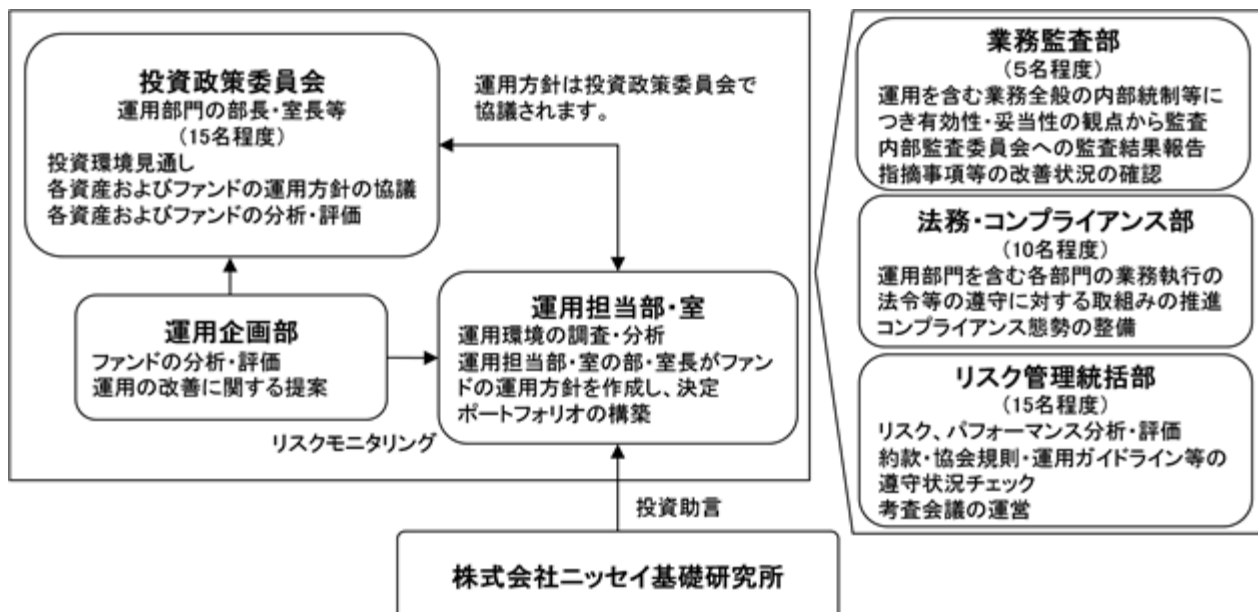
< 訂正前 >

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



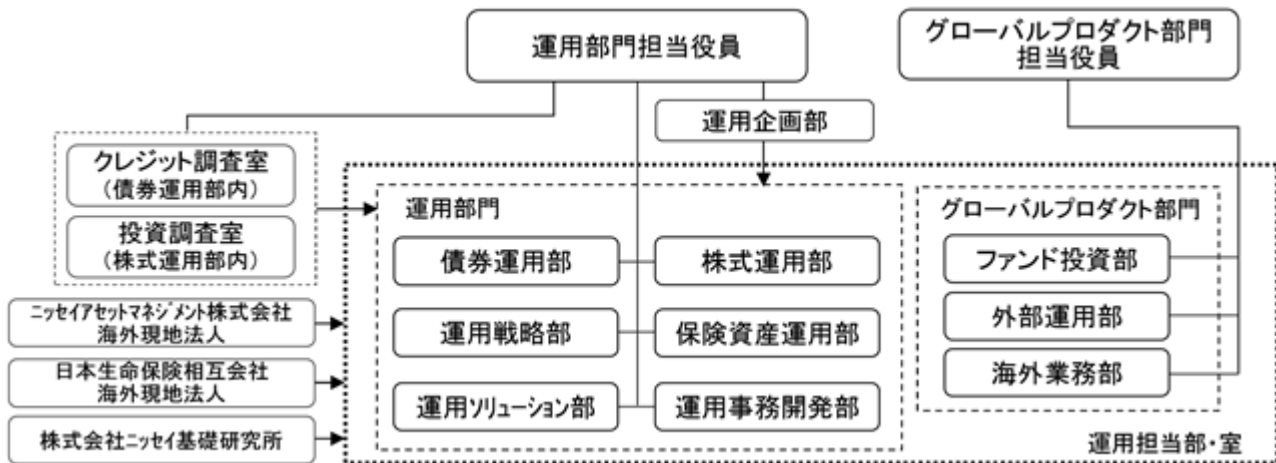
< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

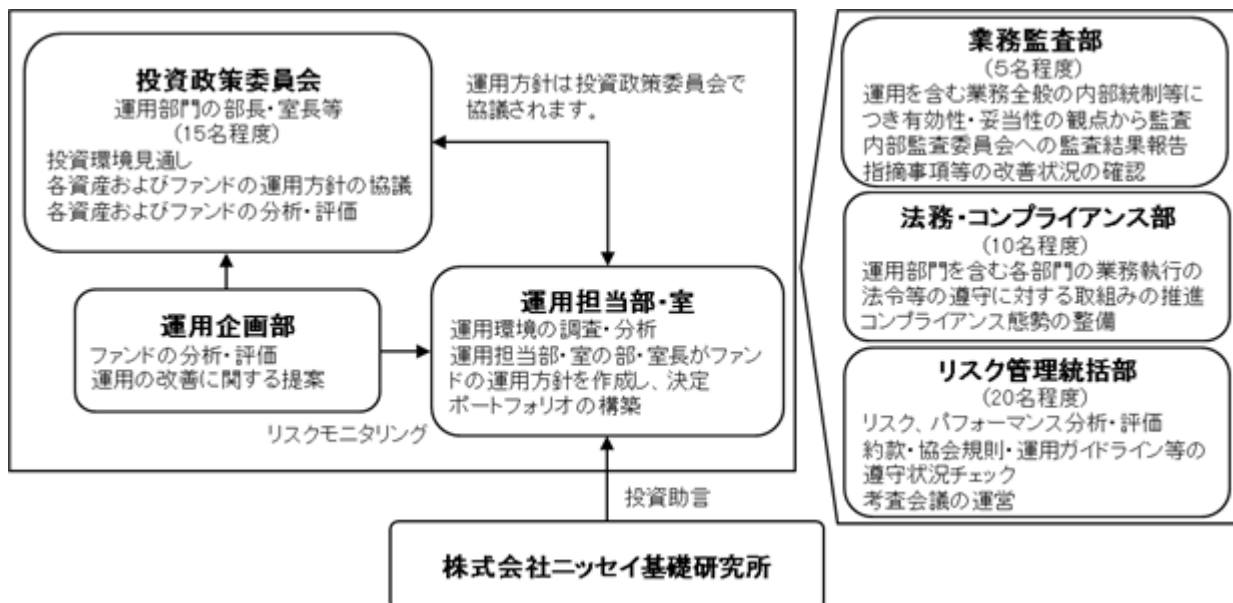
< 訂正後 >

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

< 訂正前 >

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。

・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。

・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

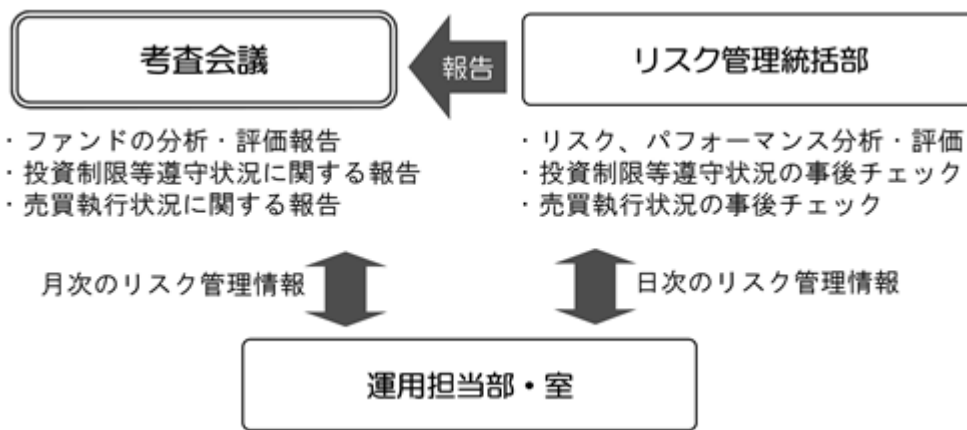
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・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

設定日におけるファンドの信託財産(1百万円(受益権口数1百万口))は、委託会社の資金によるものです。また、委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は2017年3月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に23.8%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。

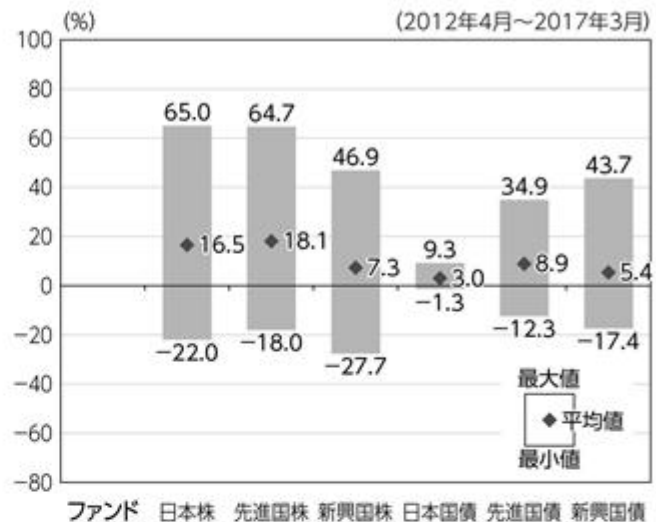
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

(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。

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

該当事項はありません。

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②は、ファンドおよび代表的な資産クラスにおいて、過去5年の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。ただし、ファンドについては2017年7月14日から運用を開始する予定のため、記載すべき事項はありません。

<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 … MSCIE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 … シティ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・ディバースファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIE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。
- ・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

<訂正後>

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。

・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。

・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

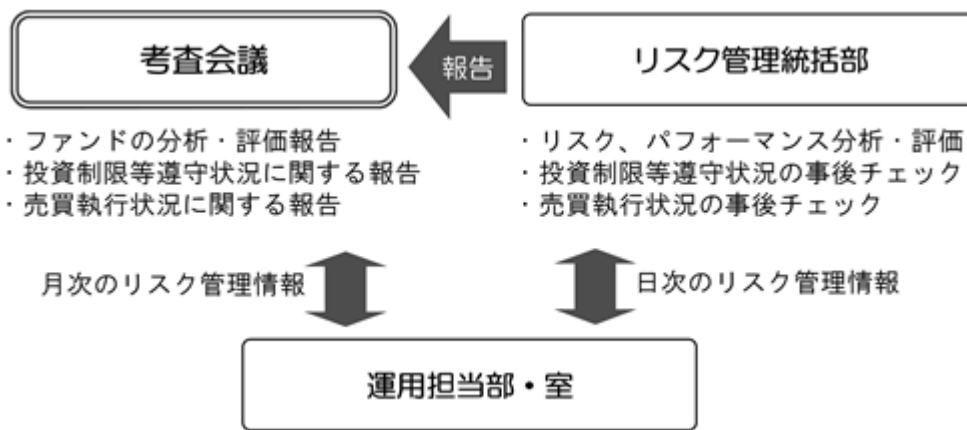
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・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2018年2月21日現在、ファンドを1百万円(受益権口数1百万口、ファンド全体の3.7%)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2018年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に17.2%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。

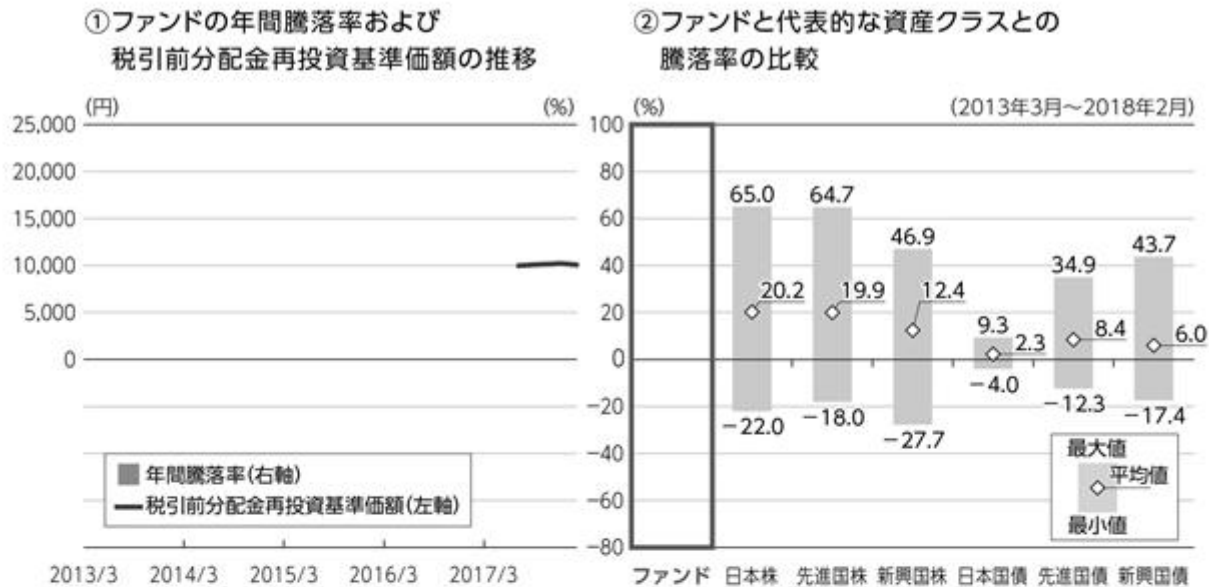
(2) 投資リスク管理体制



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。



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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・ディバースィファイドは、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。

5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

（2018年2月28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	29,833,762	94.95
内 日本	29,833,762	94.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,585,283	5.05
純資産総額	31,419,045	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」

（2018年2月28日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	50,101,358,720	97.57
内 日本	50,101,358,720	97.57
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,246,360,458	2.43
純資産総額	51,347,719,178	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）	1,255,280,000	2.44
内 日本	1,255,280,000	2.44

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

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

（2018年2月28日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	90,470,932,400	71.61
内 日本	90,470,932,400	71.61
地方債証券	12,227,813,104	9.68
内 日本	12,227,813,104	9.68
特殊債券	13,569,942,451	10.74
内 日本	13,569,942,451	10.74
社債券	8,915,045,600	7.06
内 日本	8,298,014,600	6.57
内 スウェーデン	416,391,600	0.33
内 オーストラリア	200,639,400	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,153,821,667	0.91
純資産総額	126,337,555,222	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

(2018年2月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	113,483,014,531	94.48
内 アメリカ	71,113,613,230	59.21
内 イギリス	7,481,398,220	6.23
内 フランス	4,599,725,067	3.83
内 ドイツ	4,438,148,173	3.70
内 カナダ	4,264,360,935	3.55
内 スイス	4,143,246,790	3.45
内 オーストラリア	2,894,133,785	2.41
内 オランダ	2,788,486,994	2.32
内 アイルランド	1,642,791,900	1.37
内 スペイン	1,511,326,152	1.26
内 香港	1,335,153,190	1.11
内 スウェーデン	1,305,991,484	1.09
内 イタリア	936,723,787	0.78
内 シンガポール	932,470,901	0.78
内 デンマーク	863,377,902	0.72
内 ベルギー	520,390,590	0.43
内 フィンランド	479,439,059	0.40
内 ジャージー	442,666,112	0.37
内 バミューダ	332,499,211	0.28
内 ノルウェー	320,330,775	0.27
内 オランダ領キュラソー	289,161,099	0.24
内 ケイマン諸島	216,850,084	0.18
内 イスラエル	173,248,616	0.14
内 オーストリア	122,988,272	0.10
内 ルクセンブルグ	108,157,923	0.09
内 ニュージーランド	78,104,445	0.07
内 ポルトガル	69,345,007	0.06
内 イギリス領バージン 諸島	29,926,082	0.02
内 パプアニューギニア	26,755,342	0.02
内 マン島	16,560,379	0.01
内 モーリシャス	5,643,025	0.00
投資証券	2,544,352,267	2.12
内 アメリカ	1,914,878,700	1.59
内 オーストラリア	256,599,301	0.21
内 フランス	148,054,595	0.12
内 イギリス	96,015,929	0.08
内 香港	60,033,245	0.05
内 シンガポール	48,255,223	0.04
内 カナダ	20,515,274	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,083,656,694	3.40
純資産総額	120,111,023,492	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）	3,912,705,586	3.26
内 アメリカ	2,905,740,888	2.42
内 ドイツ	725,085,696	0.60
内 イギリス	281,879,002	0.23

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

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

（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」

（2018年2月28日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	14,613,458,440	98.83
内 アメリカ	6,155,726,754	41.63
内 フランス	1,530,263,907	10.35
内 イタリア	1,485,065,222	10.04
内 イギリス	1,055,311,271	7.14
内 ドイツ	1,055,246,284	7.14
内 スペイン	882,563,916	5.97
内 ベルギー	381,244,185	2.58
内 オーストラリア	325,226,550	2.20
内 カナダ	314,844,436	2.13
内 オランダ	314,816,574	2.13
内 オーストリア	235,358,616	1.59
内 アイルランド	122,308,842	0.83
内 メキシコ	115,580,418	0.78
内 ポーランド	97,588,018	0.66
内 南アフリカ	96,871,712	0.66
内 フィンランド	93,967,472	0.64
内 デンマーク	87,968,501	0.59
内 マレーシア	69,462,427	0.47
内 スウェーデン	68,558,703	0.46
内 シンガポール	55,102,128	0.37
内 ノルウェー	45,135,999	0.31
内 スイス	25,246,505	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	172,619,454	1.17
純資産総額	14,786,077,894	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】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

【投資有価証券の主要銘柄】

(2018年2月28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	19,492,268	0.9667 18,844,211	0.9681 18,870,464	- -	60.06%
2	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	5,931,218	1.3129 7,787,563	1.3069 7,751,508	- -	24.67%
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	963,389	1.6678 1,606,783	1.6763 1,614,928	- -	5.14%
4	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	880,299	1.8077 1,591,337	1.8140 1,596,862	- -	5.08%

(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	94.95
	小計		94.95
合計(対純資産総額比)			94.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	240,800	7,291.00 1,755,672,800	7,235.00 1,742,188,000	- -	3.39%
2	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	1,380,500	784.60 1,083,140,300	762.30 1,052,355,150	- -	2.05%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	88,000	8,922.00 785,136,000	8,895.00 782,760,000	- -	1.52%
4	ソニー 日本	株式 電気機器	132,300	5,296.00 700,660,800	5,442.00 719,976,600	- -	1.40%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	139,500	4,795.00 668,902,500	4,982.00 694,989,000	- -	1.35%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	147,900	4,773.00 705,926,700	4,686.00 693,059,400	- -	1.35%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	178,300	3,785.00 674,865,500	3,885.00 692,695,500	- -	1.35%

8	キーエンス 日本	株式 電気機器	9,700	62,880.00 609,936,000	65,270.00 633,119,000	- -	1.23%
9	任天堂 日本	株式 その他製品	12,200	46,960.00 572,912,000	49,080.00 598,776,000	- -	1.17%
10	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,655,000	201.60 535,248,000	199.40 529,407,000	- -	1.03%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	18,800	27,465.00 516,342,000	27,310.00 513,428,000	- -	1.00%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	175,100	2,639.50 462,176,450	2,635.50 461,476,050	- -	0.90%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	73,000	5,910.00 431,430,000	6,112.00 446,176,000	- -	0.87%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	106,700	3,953.00 421,785,100	4,096.00 437,043,200	- -	0.85%
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	136,900	3,054.00 418,092,600	3,016.00 412,890,400	- -	0.80%
16	日本電産 日本	株式 電気機器	23,800	16,255.00 386,869,000	17,260.00 410,788,000	- -	0.80%
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	143,900	2,733.00 393,278,700	2,745.00 395,005,500	- -	0.77%
18	信越化学工業 日本	株式 化学	34,600	11,320.00 391,672,000	11,375.00 393,575,000	- -	0.77%
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	476,000	830.20 395,175,200	818.00 389,368,000	- -	0.76%
20	花王 日本	株式 化学	48,700	7,889.00 384,194,300	7,852.00 382,392,400	- -	0.74%
21	パナソニック 日本	株式 電気機器	226,300	1,651.50 373,734,450	1,677.50 379,618,250	- -	0.74%
22	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	146,000	2,651.50 387,119,000	2,592.00 378,432,000	- -	0.74%
23	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	123,100	3,140.00 386,534,000	3,048.00 375,208,800	- -	0.73%
24	小松製作所 日本	株式 機械	95,700	4,006.00 383,374,200	3,916.00 374,761,200	- -	0.73%
25	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	73,600	5,038.00 370,796,800	4,966.00 365,497,600	- -	0.71%
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	81,800	4,500.00 368,100,000	4,461.00 364,909,800	- -	0.71%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	198,100	1,829.50 362,423,950	1,817.00 359,947,700	- -	0.70%
28	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	35,600	10,375.00 369,350,000	10,060.00 358,136,000	- -	0.70%
29	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	17,700	20,110.00 355,947,000	19,950.00 353,115,000	- -	0.69%
30	ダイキン工業 日本	株式 機械	27,000	12,690.00 342,630,000	12,650.00 341,550,000	- -	0.67%

(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	13.74
		輸送用機器	8.79
		情報・通信業	7.11
		銀行業	7.09
		化学	7.09
		機械	5.50
		卸売業	4.67
		小売業	4.59
		医薬品	4.53
		サービス業	4.13
		食料品	4.09
		陸運業	3.79
		建設業	3.03
		不動産業	2.27
		その他製品	2.19
		保険業	2.13
		精密機器	1.62
		電気・ガス業	1.48
		その他金融業	1.18
		鉄鋼	1.10
		証券、商品先物取引業	0.98
		ガラス・土石製品	0.96
		非鉄金属	0.93
		ゴム製品	0.90
		繊維製品	0.68
		金属製品	0.67
		石油・石炭製品	0.65
		空運業	0.59
		鉱業	0.31
		パルプ・紙	0.27
海運業	0.21		
倉庫・運輸関連業	0.18		
水産・農林業	0.10		
	小計		97.57
合 計（対純資産総額比）			97.57

（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

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数 先物取引	大阪取引所	TOPIX 先 物 3003月	買建	71	1,253,179,180	1,255,280,000	2.44%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28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339回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,112,000,000	103.18 1,147,395,550	103.29 1,148,662,640	0.400000 2025/6/20	0.91%
2	第343回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,138,000,000	100.64 1,145,298,440	100.91 1,148,389,940	0.100000 2026/6/20	0.91%
3	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,133,000,000	100.69 1,140,927,060	100.96 1,143,956,110	0.100000 2026/3/20	0.91%
4	第344回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,113,000,000	100.53 1,118,929,440	100.85 1,122,516,150	0.100000 2026/9/20	0.89%
5	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,057,000,000	103.26 1,091,555,220	103.33 1,092,229,810	0.400000 2025/9/20	0.86%
6	第312回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,051,000,000	105.11 1,104,706,100	103.77 1,090,622,700	1.200000 2020/12/20	0.86%
7	第349回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,072,000,000	100.53 1,077,717,480	100.53 1,077,745,920	0.100000 2027/12/20	0.85%
8	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,058,000,000	100.67 1,065,088,600	100.76 1,066,125,440	0.100000 2027/3/20	0.84%
9	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,052,000,000	100.67 1,059,048,400	100.79 1,060,321,320	0.100000 2026/12/20	0.84%
10	第341回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,028,000,000	102.59 1,054,625,200	102.58 1,054,522,400	0.300000 2025/12/20	0.83%
11	第133回 住宅金融支援 機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	104.60 1,046,054,000	103.88 1,038,855,000	0.828000 2023/5/19	0.82%
12	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,001,000,000	103.16 1,032,700,570	103.25 1,033,592,560	0.400000 2025/3/20	0.82%
13	第347回 利付国債(10年) 日本	国債証券	991,000,000	100.66 997,540,600	100.69 997,887,450	0.100000 2027/6/20	0.79%
14	第127回 利付国債(5年) 日本	国債証券	855,000,000	100.96 863,208,000	100.71 861,147,450	0.100000 2021/3/20	0.68%
15	第122回 利付国債(5年) 日本	国債証券	843,000,000	100.83 849,996,900	100.43 846,650,190	0.100000 2019/12/20	0.67%
16	第126回 利付国債(5年) 日本	国債証券	806,000,000	100.85 812,861,690	100.67 811,440,500	0.100000 2020/12/20	0.64%
17	第123回 利付国債(5年) 日本	国債証券	794,000,000	100.84 800,669,600	100.50 797,993,820	0.100000 2020/3/20	0.63%

18	第128回 利付国債（5年） 日本	国債証券	788,000,000	100.90 795,126,840	100.77 794,138,520	0.100000 2021/6/20	0.63%
19	第124回 利付国債（5年） 日本	国債証券	784,000,000	100.88 790,899,200	100.56 788,429,600	0.100000 2020/6/20	0.62%
20	第381回 利付国債（2年） 日本	国債証券	750,000,000	100.51 753,855,000	100.43 753,225,000	0.100000 2019/10/15	0.60%
21	第125回 利付国債（5年） 日本	国債証券	745,000,000	100.73 750,438,500	100.61 749,581,750	0.100000 2020/9/20	0.59%
22	第131回 利付国債（5年） 日本	国債証券	705,000,000	101.16 713,178,000	100.89 711,309,750	0.100000 2022/3/20	0.56%
23	第305回 利付国債（10年） 日本	国債証券	693,000,000	104.17 721,898,100	102.61 711,094,230	1.300000 2019/12/20	0.56%
24	第37回 利付国債（30年） 日本	国債証券	550,000,000	125.57 690,635,000	128.09 704,517,000	1.900000 2042/9/20	0.56%
25	第348回 利付国債（10年） 日本	国債証券	690,000,000	100.32 692,208,000	100.61 694,264,200	0.100000 2027/9/20	0.55%
26	第334回 利付国債（10年） 日本	国債証券	664,000,000	104.51 693,946,400	104.27 692,372,720	0.600000 2024/6/20	0.55%
27	第35回 利付国債（30年） 日本	国債証券	527,000,000	127.34 671,081,800	129.69 683,487,380	2.000000 2041/9/20	0.54%
28	第33回 利付国債（30年） 日本	国債証券	515,000,000	126.63 652,144,500	128.96 664,164,600	2.000000 2040/9/20	0.53%
29	第147回 利付国債（20年） 日本	国債証券	554,000,000	117.96 653,498,400	119.43 661,658,820	1.600000 2033/12/20	0.52%
30	第36回 利付国債（30年） 日本	国債証券	509,000,000	127.53 649,127,700	129.96 661,542,210	2.000000 2042/3/20	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	71.61
		地方債証券	9.68
		特殊債券	10.74
		社債券	6.57
	小計	98.60	
	外国	社債券	0.49
小計	0.49		
合計（対純資産総額比）			99.09

（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
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28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	149,560	18,307.89 2,738,128,893	19,153.73 2,864,632,501	- -	2.38%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	211,861	8,925.95 1,891,061,914	10,114.25 2,142,815,966	- -	1.78%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	11,823	123,306.38 1,457,851,363	162,341.29 1,919,361,102	- -	1.60%
4	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	68,656	19,228.29 1,320,137,793	19,483.36 1,337,649,577	- -	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	101,849	10,687.77 1,088,539,161	12,600.94 1,283,393,463	- -	1.07%
6	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	77,705	14,845.70 1,153,585,183	14,137.40 1,098,547,280	- -	0.91%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	9,065	110,332.53 1,000,164,440	120,070.79 1,088,441,777	- -	0.91%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	8,628	112,023.15 966,535,812	119,987.04 1,035,248,256	- -	0.86%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	122,637	8,655.64 1,061,501,929	8,321.17 1,020,483,938	- -	0.85%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	290,064	2,908.57 843,673,802	3,471.27 1,006,891,070	- -	0.84%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	136,482	5,899.63 805,193,827	6,357.37 867,667,623	- -	0.72%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	36,671	19,732.71 723,618,330	22,511.19 825,508,002	- -	0.69%
13	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	90,079	9,613.90 866,011,179	8,678.41 781,742,962	- -	0.65%
14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製 造装置	136,000	4,795.96 652,251,603	5,358.83 728,801,791	- -	0.61%
15	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	178,093	3,740.82 666,214,120	3,958.73 705,022,440	- -	0.59%
16	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	52,977	11,896.10 630,219,784	13,246.23 701,745,892	- -	0.58%
17	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	144,848	3,913.35 566,841,967	4,835.94 700,476,932	- -	0.58%

18	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	27,994	22,768.61 637,384,482	24,965.67 698,889,033	- -	0.58%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	172,132	3,811.95 656,160,202	3,951.21 680,130,712	- -	0.57%
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	34,138	18,289.28 624,359,714	19,861.30 678,025,148	- -	0.56%
21	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	54,869	12,425.46 681,772,672	12,198.30 669,308,835	- -	0.56%
22	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	78,833	7,718.07 608,438,668	8,200.92 646,503,173	- -	0.54%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソ ナル用品	73,788	9,496.64 700,738,522	8,647.57 638,087,618	- -	0.53%
24	BOEING CO アメリカ	株式 資本財	16,262	28,864.11 469,388,317	39,151.39 636,680,014	- -	0.53%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	581,735	1,098.49 639,033,795	1,073.47 624,479,677	- -	0.52%
26	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	118,426	4,957.54 587,102,769	5,158.05 610,847,797	- -	0.51%
27	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	64,384	9,523.26 613,145,712	9,126.51 587,601,245	- -	0.49%
28	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	46,159	10,177.27 469,772,900	12,697.57 586,107,419	- -	0.49%
29	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	117,282	4,913.04 576,211,248	4,683.47 549,287,830	- -	0.46%
30	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア	136,342	3,937.59 536,858,963	3,936.18 536,667,226	- -	0.45%

(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	10.53
		銀行	9.69
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.73
		資本財	7.40
		エネルギー	6.16
		素材	4.90
		食品・飲料・タバコ	4.89
		各種金融	4.61
		小売	4.23
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.11
		ヘルスケア機器・サービス	4.09
		保険	3.95
		半導体・半導体製造装置	3.00
		公益事業	2.79
		電気通信サービス	2.30
		メディア	2.19
		運輸	1.92
		家庭用品・パーソナル用品	1.81
		消費者サービス	1.78
		耐久消費財・アパレル	1.70
		食品・生活必需品小売り	1.59
自動車・自動車部品	1.53		
商業・専門サービス	0.96		
不動産	0.60		
	小計		94.48
投資証券	外国	投資証券	2.12
	小計		2.12
合計（対純資産総額比）			96.60

（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。

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先 物取引	シカゴ商品 取引所	S & P 500 EMIN I FUTURE 201 803	買建	197	2,892,583,232	2,905,740,888	2.42%
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 201803	買建	160	716,127,148	725,085,696	0.60%
	ICE-EU	FTSE 100 IND EX FUTURE 20 1803	買建	26	279,563,681	281,879,002	0.23%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

(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」

投資有価証券の主要銘柄

(2018年2月28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	128,844,000	97.74 125,944,988	95.46 123,004,789	1.625000 2022/11/15	0.83%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	124,549,200	100.09 124,668,477	98.07 122,150,382	2.000000 2021/11/15	0.83%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	120,254,400	102.19 122,893,221	100.57 120,944,660	2.625000 2020/11/15	0.82%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	122,401,800	98.31 120,342,937	97.01 118,748,106	1.375000 2021/1/31	0.80%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	123,475,500	97.99 120,998,721	95.80 118,294,468	1.625000 2022/8/15	0.80%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	117,033,300	99.04 115,915,138	98.40 115,163,107	1.250000 2019/10/31	0.78%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	117,033,300	98.59 115,388,209	98.17 114,892,760	0.875000 2019/7/31	0.78%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	115,959,600	99.93 115,888,746	97.84 113,458,351	2.000000 2022/2/15	0.77%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	114,885,900	100.51 115,476,735	98.66 113,355,619	2.125000 2021/8/15	0.77%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	110,591,100	98.80 109,272,478	96.62 106,858,650	1.750000 2022/5/15	0.72%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	104,148,900	103.90 108,211,931	101.94 106,170,430	3.125000 2021/5/15	0.72%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	108,443,700	98.87 107,222,108	96.86 105,041,821	2.000000 2023/2/15	0.71%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	102,001,500	104.07 106,160,852	102.51 104,562,757	3.500000 2020/5/15	0.71%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	102,001,500	102.07 104,119,405	100.60 102,622,689	2.625000 2020/8/15	0.69%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	100,927,800	102.04 102,990,764	101.13 102,078,376	3.125000 2019/5/15	0.69%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	97,706,700	99.16 96,891,579	98.33 96,079,883	1.375000 2020/1/31	0.65%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	95,559,300	100.72 96,247,412	97.40 93,084,314	2.375000 2024/8/15	0.63%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	92,338,200	101.55 93,769,774	98.33 90,800,768	2.500000 2024/5/15	0.61%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	91,264,500	99.85 91,131,801	99.47 90,782,623	1.625000 2019/3/31	0.61%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	93,411,900	99.68 93,120,959	96.43 90,079,897	2.250000 2024/11/15	0.61%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	91,264,500	98.64 90,031,301	98.12 89,553,290	1.000000 2019/9/30	0.61%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	89,117,100	99.49 88,668,100	98.86 88,103,838	1.625000 2019/12/31	0.60%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	89,117,100	99.17 88,383,677	98.46 87,751,826	1.375000 2019/12/15	0.59%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	88,043,400	99.77 87,848,695	99.14 87,289,748	1.625000 2019/8/31	0.59%

25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	88,043,400	99.10 87,257,655	98.86 87,045,868	1.000000 2019/3/15	0.59%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	86,969,700	102.98 89,562,352	100.04 87,007,096	2.750000 2023/11/15	0.59%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	82,674,900	101.32 83,769,515	100.62 83,194,098	2.750000 2019/2/15	0.56%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	83,748,600	99.72 83,514,941	98.56 82,550,995	1.875000 2020/12/15	0.56%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	80,527,500	100.46 80,904,315	98.56 79,372,735	2.125000 2021/9/30	0.54%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	79,453,800	101.38 80,551,830	99.88 79,360,044	2.375000 2020/12/31	0.54%

(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	98.83
	小計		98.83
合 計 (対純資産総額比)			98.83

(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

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」

【純資産の推移】

2018年2月28日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年2月21日)	27,072,959	27,072,959	1.0066	1.0066
2017年7月末日	997,695	-	0.9977	-
8月末日	1,003,913	-	1.0039	-
9月末日	1,008,909	-	1.0089	-
10月末日	2,235,149	-	1.0128	-
11月末日	6,407,869	-	1.0155	-
12月末日	11,564,951	-	1.0213	-
2018年1月末日	23,230,837	-	1.0150	-
2月末日	31,419,045	-	1.0067	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じ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ニッセイワールドセレクトファンド（安定型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1計算期間	32,130,976	5,235,210	26,895,766

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >



3.運用実績

2018年2月末現在

● 基準価額・純資産の推移



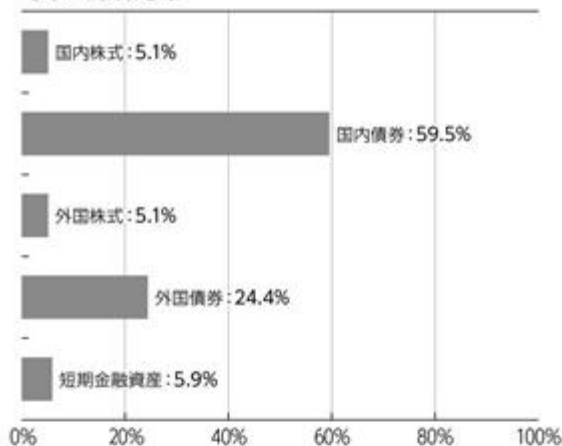
基準価額	10,067円
純資産総額	31百万円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2018年2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

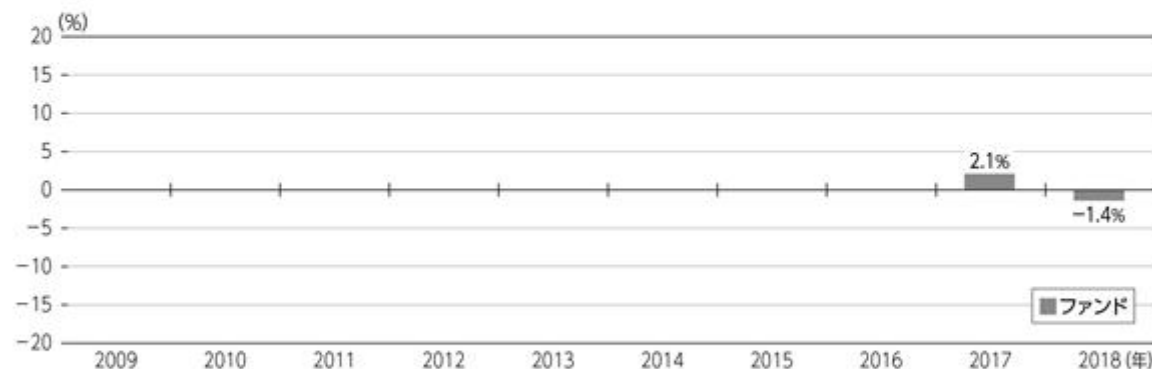
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実買組入比率)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、2018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。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

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

約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前記1.の事項（前記1.の変更事項にあ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賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1.から7.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

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

公告

電子公告により行い、委託会社のホームページ(<http://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れている受益者に交付します。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<http://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。

<訂正後>

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。
 - ・ この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「 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であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1. から7. までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知れている受益者に交付します。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)に掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付します。

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。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

- 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2017年7月14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(2017年7月14日から2018年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2018年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		35,757
コール・ローン		1,336,506
親投資信託受益証券		25,704,751
未収入金		6,742
流動資産合計		27,083,756
資産合計		27,083,756
負債の部		
流動負債		
未払解約金		6,580
未払受託者報酬		492
未払委託者報酬		3,496
その他未払費用		229
流動負債合計		10,797
負債合計		10,797
純資産の部		
元本等		
元本		26,895,766
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		177,193
純資産合計		27,072,959
負債純資産合計		27,083,756

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 (自2017年7月14日 至2018年2月21日)
営業収益	
有価証券売買等損益	295,674
営業収益合計	295,674
営業費用	
支払利息	83
受託者報酬	828
委託者報酬	6,447
その他費用	372
営業費用合計	7,730
営業利益又は営業損失()	303,404
経常利益又は経常損失()	303,404
当期純利益又は当期純損失()	303,404
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()	315
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	557,619
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	557,619
剰余金減少額又は欠損金増加額	77,337
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	77,337
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()	177,193

(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 (2018年2月21日現在)
1. 受益権総口数	26,895,766口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0066円 (10,066円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 (自2017年7月14日 至2018年2月21日)
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(177,300円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は177,300円(1口当たり0.006592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2017年7月14日 至2018年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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 (2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載していません。 (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 (2018年2月21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	297,712
合計	297,712

(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 (2018年2月21日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	31,130,976円
期中一部解約元本額	5,235,210円

(4) 【附属明細表】 (2018年2月21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	760,570	1,374,197	
	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	16,798,213	16,238,832	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	833,478	1,389,657	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	5,103,614	6,702,065	
親投資信託受益証券 合計		23,495,875	25,704,751	
合計		23,495,875	25,704,751	

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ニッセイワールドセレクトファンド（安定型））は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券バッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ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2月21日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	58,384,850
コール・ローン	2,182,308,482
株式	49,912,570,510
派生商品評価勘定	12,928,800
未収入金	36,702,090
未収配当金	66,199,765
差入委託証拠金	33,210,000
流動資産合計	52,302,304,497
資産合計	52,302,304,497
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,652,960
前受金	10,575,000
未払金	1,310,006,690
未払解約金	66,428,452
その他未払費用	4,169
流動負債合計	1,389,667,271
負債合計	1,389,667,271
純資産の部	
元本等	
元本	28,178,885,286
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,733,751,940
純資産合計	50,912,637,226
負債純資産合計	52,302,304,497

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2月21日現在)
1. 受益権総口数	28,178,885,286口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8068円 (18,068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7月14日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（2018年2月21日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	24,555,600	
合計	24,555,600	

（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2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち	時価 （円）	評価損益 （円）
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買 建	941,445,000	-	951,750,000	10,305,000
合計	941,445,000	-	951,750,000	10,305,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 2．株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 3．評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	26,129,457,793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	8,479,307,701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	6,429,880,208円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	7,166,753,242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)	5,442,163,554円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,462,634円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,114,792円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	902,241,656円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,416,510,058円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,426,134,995円
ニッセイ/パナゴラ・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)	15,427,793円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格 機関投資家限定)	52,427,695円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格 機関投資家限定)	65,691,986円
DCニッセイ国内株式インデックス	69,513,538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	8,325,872,380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)	269,192,835円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	3,727,551円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	760,570円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	273,300円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	417,228円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	647,891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)	6,943,387円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	3,535,483円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	543,295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)	587,583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)	249,893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)	1,691,947円
計	28,178,885,286円

附属明細表(2018年2月21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	900	3,915.00	3,523,500	
日本水産	25,000	544.00	13,600,000	
マルハニチロ	4,200	3,310.00	13,902,000	
カネコ種苗	900	1,604.00	1,443,600	
サカタのタネ	3,300	3,710.00	12,243,000	
ホクト	2,300	2,084.00	4,793,200	
ショーボンドホールディングス	2,100	7,640.00	16,044,000	
ミライト・ホールディングス	6,800	1,670.00	11,356,000	
タマホーム	1,700	1,183.00	2,011,100	
ベステラ	800	1,871.00	1,496,800	
インベスターズクラウド	1,900	2,134.00	4,054,600	
住石ホールディングス	7,000	157.00	1,099,000	
日鉄鉱業	600	7,210.00	4,326,000	
三井松島産業	1,100	1,508.00	1,658,800	
国際石油開発帝石	107,900	1,319.00	142,320,100	
日本海洋掘削	800	2,286.00	1,828,800	
石油資源開発	3,500	2,585.00	9,047,500	
K&Oエナジーグループ	1,300	1,700.00	2,210,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,200	1,188.00	1,425,600	
安藤・間	17,100	795.00	13,594,500	
東急建設	8,500	1,250.00	10,625,000	
コムシスホールディングス	7,800	2,817.00	21,972,600	
ミサワホーム	1,900	898.00	1,706,200	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,948.00	4,127,200	
東建コーポレーション	800	12,020.00	9,616,000	
ソネック	1,800	779.00	1,402,200	
ヤマウラ	1,400	959.00	1,342,600	
大成建設	22,100	5,410.00	119,561,000	
大林組	66,600	1,199.00	79,853,400	
清水建設	67,900	1,015.00	68,918,500	
飛鳥建設	20,200	187.00	3,777,400	
長谷工コーポレーション	25,900	1,572.00	40,714,800	
松井建設	2,400	842.00	2,020,800	
銭高組	300	5,710.00	1,713,000	
鹿島建設	98,000	1,033.00	101,234,000	
不動テトラ	16,800	194.00	3,259,200	
大末建設	700	1,065.00	745,500	
鉄建建設	1,300	3,155.00	4,101,500	
西松建設	5,100	2,759.00	14,070,900	
三井住友建設	16,000	638.00	10,208,000	
大豊建設	8,000	634.00	5,072,000	
前田建設工業	15,800	1,272.00	20,097,600	
佐田建設	2,900	486.00	1,409,400	
ナカノフドー建設	2,200	634.00	1,394,800	
奥村組	3,700	4,740.00	17,538,000	
東鉄工業	2,700	3,280.00	8,856,000	
浅沼組	8,000	463.00	3,704,000	
戸田建設	26,000	824.00	21,424,000	
熊谷組	3,500	3,240.00	11,340,000	
青木あすなる建設	1,500	1,019.00	1,528,500	
北野建設	5,000	451.00	2,255,000	
植木組	500	2,707.00	1,353,500	
三井ホーム	3,000	686.00	2,058,000	
矢作建設工業	3,000	850.00	2,550,000	

ピーエス三菱	2,600	869.00	2,259,400
日本ハウスホールディングス	4,200	644.00	2,704,800
大東建託	8,000	17,675.00	141,400,000
新日本建設	2,600	1,040.00	2,704,000
N I P P O	5,100	2,540.00	12,954,000
東亜道路工業	400	4,235.00	1,694,000
前田道路	7,000	2,379.00	16,653,000
日本道路	600	5,890.00	3,534,000
東亜建設工業	1,800	2,268.00	4,082,400
若築建設	1,200	1,724.00	2,068,800
東洋建設	7,000	550.00	3,850,000
五洋建設	26,400	784.00	20,697,600
世紀東急工業	3,000	711.00	2,133,000
福田組	700	6,710.00	4,697,000
日本ドライケミカル	600	2,522.00	1,513,200
住友林業	14,200	1,847.00	26,227,400
日本基礎技術	3,400	406.00	1,380,400
日成ビルド工業	3,300	1,276.00	4,210,800
巴コーポレーション	2,800	580.00	1,624,000
大和ハウス工業	65,600	3,942.00	258,595,200
ライト工業	4,300	1,176.00	5,056,800
積水ハウス	72,200	1,883.50	135,988,700
日特建設	2,200	662.00	1,456,400
北陸電気工事	1,200	1,150.00	1,380,000
ユアテック	3,500	862.00	3,017,000
四電工	500	2,777.00	1,388,500
中電工	2,900	3,010.00	8,729,000
関電工	8,800	1,222.00	10,753,600
きんでん	14,800	1,744.00	25,811,200
東京エネシス	2,500	1,203.00	3,007,500
トーエネック	600	3,150.00	1,890,000
住友電設	1,800	2,316.00	4,168,800
日本電設工業	3,400	2,191.00	7,449,400
協和エクシオ	8,000	2,864.00	22,912,000
新日本空調	1,700	1,625.00	2,762,500
日本工営	1,300	2,963.00	3,851,900
N D S	300	4,540.00	1,362,000
九電工	4,400	5,020.00	22,088,000
三機工業	4,700	1,189.00	5,588,300
日揮	19,100	2,410.00	46,031,000
中外炉工業	700	2,346.00	1,642,200
ヤマト	1,800	833.00	1,499,400
太平電業	1,500	2,633.00	3,949,500
高砂熱学工業	6,100	1,969.00	12,010,900
三晃金属工業	300	4,175.00	1,252,500
N E C ネットズエスアイ	2,100	2,763.00	5,802,300
朝日工業社	500	3,525.00	1,762,500
明星工業	4,000	776.00	3,104,000
大気社	2,900	3,735.00	10,831,500
ダイダン	1,500	2,423.00	3,634,500
日比谷総合設備	2,500	2,061.00	5,152,500
東芝プラントシステム	4,800	2,136.00	10,252,800
日本製粉	6,600	1,645.00	10,857,000
日清製粉グループ本社	24,300	2,112.00	51,321,600
昭和産業	1,800	2,760.00	4,968,000
鳥越製粉	1,800	978.00	1,760,400
中部飼料	2,400	2,025.00	4,860,000
フィード・ワン	13,400	238.00	3,189,200
東洋精糖	1,100	1,225.00	1,347,500
日本甜菜製糖	1,100	2,378.00	2,615,800

三井製糖	1,600	4,265.00	6,824,000
塩水港精糖	5,100	283.00	1,443,300
日新製糖	900	2,201.00	1,980,900
L I F U L L	6,600	1,081.00	7,134,600
ジェイエイシーリクルートメント	1,500	2,239.00	3,358,500
日本M&Aセンター	6,500	6,850.00	44,525,000
メンバーズ	1,700	865.00	1,470,500
タケエイ	2,000	1,256.00	2,512,000
トラスト・テック	800	3,250.00	2,600,000
コシダカホールディングス	1,000	6,670.00	6,670,000
パソナグループ	1,800	2,368.00	4,262,400
C D S	1,100	1,366.00	1,502,600
リンクアンドモチベーション	3,500	1,101.00	3,853,500
G C A	2,200	939.00	2,065,800
エス・エム・エス	3,700	4,350.00	16,095,000
パーソルホールディングス	17,500	2,793.00	48,877,500
リニカル	1,200	1,467.00	1,760,400
クックパッド	5,900	606.00	3,575,400
アイ・ケイ・ケイ	1,900	754.00	1,432,600
森永製菓	4,700	5,100.00	23,970,000
中村屋	500	4,785.00	2,392,500
江崎グリコ	5,600	5,220.00	29,232,000
名糖産業	1,000	1,589.00	1,589,000
井村屋グループ	800	4,105.00	3,284,000
不二家	1,300	2,523.00	3,279,900
山崎製パン	16,300	2,080.00	33,904,000
モロゾフ	300	6,800.00	2,040,000
亀田製菓	1,200	5,150.00	6,180,000
寿スピリッツ	1,900	6,190.00	11,761,000
カルビー	9,100	3,675.00	33,442,500
森永乳業	4,000	4,385.00	17,540,000
六甲バター	1,000	2,317.00	2,317,000
ヤクルト本社	11,900	7,900.00	94,010,000
明治ホールディングス	13,100	7,940.00	104,014,000
雪印メグミルク	4,800	2,803.00	13,454,400
プリマハム	14,000	668.00	9,352,000
日本ハム	17,000	2,439.00	41,463,000
丸大食品	11,000	498.00	5,478,000
S F o o d s	1,400	4,295.00	6,013,000
伊藤ハム米久ホールディングス	12,800	923.00	11,814,400
学情	900	1,624.00	1,461,600
スタジオアリス	1,000	2,707.00	2,707,000
シミックホールディングス	1,000	2,695.00	2,695,000
システナ	1,600	4,495.00	7,192,000
N J S	900	1,646.00	1,481,400
デジタルアーツ	1,000	3,845.00	3,845,000
新日鉄住金ソリューションズ	3,100	2,906.00	9,008,600
総合警備保障	7,500	5,210.00	39,075,000
いちご	27,900	455.00	12,694,500
日本駐車場開発	23,500	185.00	4,347,500
コア	1,000	1,309.00	1,309,000
カカクコム	14,500	1,933.00	28,028,500
アイロムグループ	600	3,005.00	1,803,000
セントケア・ホールディング	1,900	731.00	1,388,900
ルネサンス	900	1,776.00	1,598,400
ディップ	2,700	3,345.00	9,031,500
S B S ホールディングス	2,000	1,299.00	2,598,000
オプトホールディング	1,300	1,163.00	1,511,900
新日本科学	2,700	535.00	1,444,500
ツクイ	4,500	851.00	3,829,500

エムスリー	19,900	4,370.00	86,963,000
ツカダ・グローバルホールディング	2,300	618.00	1,421,400
アウトソーシング	5,600	2,068.00	11,580,800
ウェルネット	1,900	1,152.00	2,188,800
ワールドホールディングス	600	3,905.00	2,343,000
ディー・エヌ・エー	10,200	1,923.00	19,614,600
博報堂DYホールディングス	26,300	1,577.00	41,475,100
ぐるなび	3,000	1,445.00	4,335,000
エスアールジータカミヤ	2,200	670.00	1,474,000
ジャパンベストレスキューシステム	2,300	844.00	1,941,200
ファンコミュニケーションズ	5,300	749.00	3,969,700
ライク	700	2,014.00	1,409,800
ビジネス・ブレークスルー	3,000	484.00	1,452,000
WDBホールディングス	900	4,260.00	3,834,000
バリューコマース	1,700	1,354.00	2,301,800
インフォマート	9,600	901.00	8,649,600
サッポロホールディングス	7,300	3,205.00	23,396,500
アサヒグループホールディングス	41,600	5,505.00	229,008,000
麒麟ホールディングス	95,600	2,788.50	266,580,600
宝ホールディングス	14,900	1,335.00	19,891,500
オエノンホールディングス	5,700	407.00	2,319,900
養命酒製造	600	2,304.00	1,382,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホ ールディングス	14,000	4,005.00	56,070,000
サントリー食品インターナショナル	15,200	5,000.00	76,000,000
ダイドーグループホールディングス	1,000	6,590.00	6,590,000
伊藤園	6,600	4,560.00	30,096,000
キーコーヒー	2,000	2,123.00	4,246,000
日清オイリオグループ	2,300	3,015.00	6,934,500
不二製油グループ本社	5,400	3,190.00	17,226,000
かどや製油	200	6,680.00	1,336,000
J・オイルミルズ	1,000	3,700.00	3,700,000
ローソン	4,900	7,280.00	35,672,000
サンエー	1,500	5,500.00	8,250,000
カワチ薬品	1,500	2,615.00	3,922,500
エービーシー・マート	3,600	6,860.00	24,696,000
ハードオフコーポレーション	1,200	1,166.00	1,399,200
高千穂交易	1,300	1,275.00	1,657,500
アスクル	1,700	3,965.00	6,740,500
ゲオホールディングス	3,600	2,061.00	7,419,600
アダストリア	3,000	2,241.00	6,723,000
ジーフット	1,800	791.00	1,423,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,900	732.00	1,390,800
伊藤忠食品	500	5,880.00	2,940,000
くらコーポレーション	1,100	6,550.00	7,205,000
キャンドゥ	900	1,750.00	1,575,000
エレマテック	900	2,357.00	2,121,300
パルグループホールディングス	1,000	3,090.00	3,090,000
JALUX	600	3,105.00	1,863,000
エディオン	7,600	1,339.00	10,176,400
あらた	1,000	5,050.00	5,050,000
サーラコーポレーション	3,400	680.00	2,312,000
トーメンデバイス	500	2,898.00	1,449,000
ハローズ	700	2,534.00	1,773,800
J Pホールディングス	5,900	328.00	1,935,200
あみやき亭	400	5,270.00	2,108,000
東京エレクトロン デバイス	700	2,153.00	1,507,100
ひらまつ	2,700	549.00	1,482,300
フィールズ	1,500	1,132.00	1,698,000
双日	115,500	344.00	39,732,000

アルフレッサ ホールディングス	21,700	2,374.00	51,515,800
大黒天物産	500	5,290.00	2,645,000
ハニーズホールディングス	1,900	1,024.00	1,945,600
ファーマライズホールディングス	2,300	620.00	1,426,000
キッコーマン	15,500	4,270.00	66,185,000
味の素	45,700	1,968.00	89,937,600
キュービー	11,100	2,978.00	33,055,800
ハウス食品グループ本社	7,600	3,705.00	28,158,000
カゴメ	8,000	3,690.00	29,520,000
焼津水産化学工業	1,200	1,190.00	1,428,000
アリアケジャパン	1,800	8,230.00	14,814,000
ピエトロ	800	1,669.00	1,335,200
エバラ食品工業	700	2,142.00	1,499,400
ニチレイ	9,500	2,681.00	25,469,500
横浜冷凍	4,700	1,104.00	5,188,800
東洋水産	10,900	4,200.00	45,780,000
日清食品ホールディングス	8,700	7,480.00	65,076,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,562.00	3,124,000
一正蒲鉾	1,200	1,257.00	1,508,400
フジッコ	2,200	2,340.00	5,148,000
ロック・フィールド	2,100	2,154.00	4,523,400
日本たばこ産業	123,100	3,106.00	382,348,600
ケンコーマヨネーズ	1,300	3,635.00	4,725,500
わらべや日洋ホールディングス	1,300	2,577.00	3,350,100
なとり	1,100	1,942.00	2,136,200
ピクルスコーポレーション	800	1,822.00	1,457,600
北の達人コーポレーション	5,700	740.00	4,218,000
ユーグレナ	7,700	972.00	7,484,400
片倉工業	2,400	1,369.00	3,285,600
グンゼ	1,500	5,860.00	8,790,000
ヒューリック	40,800	1,204.00	49,123,200
ラサ商事	1,500	934.00	1,401,000
アルペン	1,500	2,503.00	3,754,500
クオール	2,200	2,281.00	5,018,200
アルコニックス	2,100	2,422.00	5,086,200
神戸物産	1,300	4,220.00	5,486,000
ジーンズ	1,300	5,240.00	6,812,000
ビックカメラ	11,300	1,646.00	18,599,800
D C Mホールディングス	10,500	1,080.00	11,340,000
ペッパーフードサービス	1,000	4,770.00	4,770,000
Monotaro	6,900	3,540.00	24,426,000
DDホールディングス	400	3,745.00	1,498,000
あいホールディングス	3,100	3,015.00	9,346,500
ディー・ブイエックス	1,100	1,251.00	1,376,100
きちり	1,900	745.00	1,415,500
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,244.00	3,590,400
J.フロント リテイリング	23,300	1,947.00	45,365,100
ドトール・日レスホールディングス	3,400	2,579.00	8,768,600
マツモトキヨシホールディングス	8,100	4,480.00	36,288,000
ブロンコビリー	1,000	3,335.00	3,335,000
スタートトゥデイ	19,200	2,967.00	56,966,400
物語コーポレーション	600	10,050.00	6,030,000
ココカラファイン	2,000	7,000.00	14,000,000
三越伊勢丹ホールディングス	36,500	1,266.00	46,209,000
東洋紡	7,700	2,069.00	15,931,300
ユニチカ	6,000	706.00	4,236,000
富士紡ホールディングス	1,200	4,310.00	5,172,000
日清紡ホールディングス	12,100	1,623.00	19,638,300
倉敷紡績	21,000	344.00	7,224,000
ダイワボウホールディングス	1,700	4,320.00	7,344,000

シキボウ	1,000	1,400.00	1,400,000
日東紡績	2,900	2,550.00	7,395,000
トヨタ紡織	5,800	2,299.00	13,334,200
マクニカ・富士エレホールディングス	3,600	2,916.00	10,497,600
H a m e e	700	1,890.00	1,323,000
ウエルシアホールディングス	5,200	4,730.00	24,596,000
クリエイトSDホールディングス	2,900	2,701.00	7,832,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,700	1,030.00	3,811,000
八洲電機	1,600	867.00	1,387,200
U K C ホールディングス	1,300	2,305.00	2,996,500
ジュテックホールディングス	1,100	1,267.00	1,393,700
大光	1,500	928.00	1,392,000
O C H I ホールディングス	1,000	1,450.00	1,450,000
T O K A I ホールディングス	10,300	1,172.00	12,071,600
三洋貿易	1,100	2,353.00	2,588,300
チムニー	600	2,889.00	1,733,400
シュッピン	1,200	1,263.00	1,515,600
ビューティガレージ	600	2,238.00	1,342,800
ウイン・パートナーズ	1,400	1,706.00	2,388,400
ネクステージ	2,100	1,105.00	2,320,500
ジョイフル本田	2,900	3,485.00	10,106,500
鳥貴族	700	2,991.00	2,093,700
キリン堂ホールディングス	700	1,896.00	1,327,200
ホットランド	1,100	1,297.00	1,426,700
すかいらーく	12,100	1,470.00	17,787,000
綿半ホールディングス	700	3,910.00	2,737,000
日本毛織	5,900	1,087.00	6,413,300
ダイドーリミテッド	3,000	472.00	1,416,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,500	1,130.00	7,345,000
三栄建築設計	800	2,149.00	1,719,200
スター・マイカ	700	1,885.00	1,319,500
野村不動産ホールディングス	13,000	2,658.00	34,554,000
三重交通グループホールディングス	4,000	522.00	2,088,000
サムティ	1,700	1,867.00	3,173,900
日本商業開発	1,100	1,910.00	2,101,000
プレサンスコーポレーション	2,700	1,657.00	4,473,900
ユニゾホールディングス	2,300	2,963.00	6,814,900
T H E グローバル社	1,500	915.00	1,372,500
日本管理センター	1,300	1,769.00	2,299,700
サンセイランディック	1,000	1,413.00	1,413,000
フージャースホールディングス	4,700	778.00	3,656,600
オープンハウス	3,200	6,670.00	21,344,000
東急不動産ホールディングス	47,300	816.00	38,596,800
飯田グループホールディングス	16,300	1,990.00	32,437,000
ムゲンエステート	1,200	1,321.00	1,585,200
帝国繊維	2,200	2,016.00	4,435,200
ブックオフコーポレーション	1,700	845.00	1,436,500
日本コークス工業	16,800	112.00	1,881,600
あさひ	1,500	1,316.00	1,974,000
日本調剤	700	3,425.00	2,397,500
コスモス薬品	1,000	19,820.00	19,820,000
シップヘルスケアホールディングス	4,100	3,800.00	15,580,000
ソフトクリエイトホールディングス	900	1,492.00	1,342,800
セブン&アイ・ホールディングス	81,800	4,488.00	367,118,400
薬王堂	800	3,530.00	2,824,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5,200	1,250.00	6,500,000
ツルハホールディングス	4,200	15,470.00	64,974,000

サンマルクホールディングス	1,400	3,175.00	4,445,000
フェリシモ	1,100	1,234.00	1,357,400
トリドールホールディングス	2,400	3,640.00	8,736,000
帝人	17,000	2,167.00	36,839,000
東レ	150,500	1,100.00	165,550,000
クラレ	34,900	1,892.00	66,030,800
旭化成	129,400	1,351.50	174,884,100
サカイオーベックス	500	2,813.00	1,406,500
TOKYO BASE	400	4,270.00	1,708,000
稲葉製作所	1,100	1,341.00	1,475,100
宮地エンジニアリンググループ	600	2,433.00	1,459,800
トーカロ	1,400	5,630.00	7,882,000
アルファ	700	1,870.00	1,309,000
SUMCO	18,000	2,755.00	49,590,000
川田テクノロジーズ	400	6,050.00	2,420,000
RS Technologies	300	7,210.00	2,163,000
ハウスドゥ	500	2,895.00	1,447,500
シーアールイー	900	1,652.00	1,486,800
ケイアイスター不動産	700	2,837.00	1,985,900
住江織物	500	2,948.00	1,474,000
日本フェルト	2,700	523.00	1,412,100
イチカワ	4,000	379.00	1,516,000
芦森工業	600	2,400.00	1,440,000
アツギ	1,400	1,199.00	1,678,600
コメダホールディングス	3,600	2,162.00	7,783,200
サツドラホールディングス	700	1,973.00	1,381,100
パロックジャパンリミテッド	1,600	908.00	1,452,800
クスリのアオキホールディングス	1,500	5,960.00	8,940,000
共和レザー	1,400	985.00	1,379,000
スシローグローバルホールディングス	1,900	4,535.00	8,616,500
LIXILビバ	1,900	2,154.00	4,092,600
セーレン	4,800	2,074.00	9,955,200
ソトー	1,300	1,078.00	1,401,400
東海染工	900	1,550.00	1,395,000
小松精練	3,200	957.00	3,062,400
ワコールホールディングス	5,700	3,155.00	17,983,500
ホギメディカル	1,300	8,400.00	10,920,000
クラウドシアホールディングス	2,500	564.00	1,410,000
TSIホールディングス	7,800	752.00	5,865,600
マツオカコーポレーション	400	3,735.00	1,494,000
TIS	6,500	3,900.00	25,350,000
電算システム	700	1,937.00	1,355,900
グリー	10,400	666.00	6,926,400
コーエーテクモホールディングス	3,300	2,254.00	7,438,200
三菱総合研究所	800	3,540.00	2,832,000
ポルテージ	1,500	982.00	1,473,000
電算	600	2,562.00	1,537,200
ファインデックス	2,000	732.00	1,464,000
ヒト・コミュニケーションズ	700	1,940.00	1,358,000
KLab	3,800	1,626.00	6,178,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,400	2,327.00	3,257,800
ネクソン	21,700	3,850.00	83,545,000
アイスタイル	4,900	1,528.00	7,487,200
エムアップ	1,300	1,131.00	1,470,300
エイチーム	1,300	2,661.00	3,459,300
テクノスジャパン	1,800	940.00	1,692,000
コロプラ	6,300	990.00	6,237,000
モバイルクリエイト	3,900	372.00	1,450,800
ブロードリーフ	4,800	1,262.00	6,057,600

ハーツユニテッドグループ	1,000	1,567.00	1,567,000
メディアドゥホールディングス	700	1,960.00	1,372,000
サイバーリンクス	1,100	1,325.00	1,457,500
フィックスターズ	400	7,850.00	3,140,000
VOYAGE GROUP	1,100	1,248.00	1,372,800
オブティム	600	2,414.00	1,448,400
特種東海製紙	1,100	4,200.00	4,620,000
ティーガイア	1,900	2,984.00	5,669,600
豆蔵ホールディングス	1,400	1,224.00	1,713,600
テクマトリックス	1,100	1,870.00	2,057,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52,700	367.00	19,340,900
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	9,140.00	12,796,000
ザッパラス	3,600	391.00	1,407,600
インターネットイニシアティブ	3,200	2,344.00	7,500,800
さくらインターネット	2,300	764.00	1,757,200
GMOクラウド	600	2,303.00	1,381,800
SRAホールディングス	1,000	3,420.00	3,420,000
朝日ネット	2,700	517.00	1,395,900
フリービット	1,500	908.00	1,362,000
コムチュア	1,000	3,650.00	3,650,000
サイバーコム	1,100	1,324.00	1,456,400
王子ホールディングス	87,000	714.00	62,118,000
日本製紙	9,300	2,155.00	20,041,500
三菱製紙	3,000	702.00	2,106,000
北越紀州製紙	11,600	703.00	8,154,800
中越パルプ工業	800	1,956.00	1,564,800
大王製紙	8,300	1,530.00	12,699,000
阿波製紙	2,200	656.00	1,443,200
メディカル・データ・ビジョン	700	2,835.00	1,984,500
gumi	2,200	1,097.00	2,413,400
モバイルファクトリー	1,100	1,286.00	1,414,600
PCIホールディングス	400	3,190.00	1,276,000
パイブドHD	1,000	1,438.00	1,438,000
オープンドア	800	2,177.00	1,741,600
アカツキ	400	6,220.00	2,488,000
LINE	5,900	4,495.00	26,520,500
レンゴー	20,100	916.00	18,411,600
トーモク	1,200	2,084.00	2,500,800
ザ・バック	1,500	3,705.00	5,557,500
シンクロ・フード	300	5,020.00	1,506,000
AOI TYO HOLDINGS	1,600	1,260.00	2,016,000
マクロミル	1,800	2,907.00	5,232,600
昭和電工	13,800	5,210.00	71,898,000
住友化学	153,000	673.00	102,969,000
住友精化	900	5,500.00	4,950,000
日産化学工業	12,100	4,050.00	49,005,000
ラサ工業	700	2,453.00	1,717,100
クレハ	1,800	7,660.00	13,788,000
多木化学	300	4,380.00	1,314,000
テイカ	1,600	2,802.00	4,483,200
石原産業	3,700	1,490.00	5,513,000
片倉コープアグリ	1,100	1,244.00	1,368,400
日東エフシー	100	796.00	79,600
日本曹達	14,000	664.00	9,296,000
東ソー	30,000	2,276.00	68,280,000
トクヤマ	6,000	3,140.00	18,840,000
セントラル硝子	4,200	2,448.00	10,281,600
東亜合成	12,200	1,222.00	14,908,400
大阪ソーダ	1,900	2,811.00	5,340,900

関東電化工業	5,000	1,230.00	6,150,000
デンカ	7,600	3,915.00	29,754,000
イビデン	12,100	1,791.00	21,671,100
信越化学工業	34,600	11,390.00	394,094,000
日本カーバイド工業	700	2,286.00	1,600,200
堺化学工業	1,400	3,105.00	4,347,000
エア・ウォーター	17,100	2,147.00	36,713,700
大陽日酸	16,000	1,577.00	25,232,000
日本化学工業	800	3,260.00	2,608,000
日本パーカラライジング	10,600	1,911.00	20,256,600
高压ガス工業	3,100	882.00	2,734,200
四国化成工業	3,000	1,507.00	4,521,000
戸田工業	400	3,695.00	1,478,000
ステラ ケミファ	1,100	2,699.00	2,968,900
保土谷化学工業	700	4,960.00	3,472,000
日本触媒	3,300	7,480.00	24,684,000
大日精化工業	1,600	4,655.00	7,448,000
カネカ	28,000	1,081.00	30,268,000
協和発酵キリン	24,800	2,267.00	56,221,600
三菱瓦斯化学	17,100	2,648.00	45,280,800
三井化学	18,900	3,315.00	62,653,500
J S R	20,900	2,400.00	50,160,000
東京応化工業	3,600	4,025.00	14,490,000
大阪有機化学工業	1,300	1,559.00	2,026,700
三菱ケミカルホールディングス	139,000	1,104.00	153,456,000
K Hネオケム	3,200	3,050.00	9,760,000
ダイセル	28,000	1,213.00	33,964,000
住友ベークライト	17,000	901.00	15,317,000
積水化学工業	43,100	1,973.00	85,036,300
日本ゼオン	17,500	1,592.00	27,860,000
アイカ工業	5,800	4,115.00	23,867,000
宇部興産	10,500	3,420.00	35,910,000
積水樹脂	3,200	2,466.00	7,891,200
タキロンシーアイ	4,200	714.00	2,998,800
旭有機材	1,200	2,113.00	2,535,600
日立化成	10,300	2,386.00	24,575,800
ニチバン	1,000	3,240.00	3,240,000
リケンテクノス	4,500	524.00	2,358,000
大倉工業	5,000	573.00	2,865,000
積水化成品工業	2,600	1,168.00	3,036,800
群栄化学工業	500	3,500.00	1,750,000
ミライアル	700	2,052.00	1,436,400
ダイキョーニシカワ	4,100	1,880.00	7,708,000
森六ホールディングス	800	3,030.00	2,424,000
日本化薬	13,500	1,376.00	18,576,000
カーリットホールディングス	1,900	1,181.00	2,243,900
E P Sホールディングス	2,800	2,385.00	6,678,000
プレステージ・インターナショナル	3,900	1,421.00	5,541,900
アミューズ	1,300	3,905.00	5,076,500
野村総合研究所	13,000	4,650.00	60,450,000
ドリームインキュベータ	600	2,800.00	1,680,000
サイバネットシステム	1,900	758.00	1,440,200
クイック	1,200	2,110.00	2,532,000
T A C	4,400	318.00	1,399,200
C Eホールディングス	1,600	890.00	1,424,000
ケネディクス	25,100	707.00	17,745,700
電通	23,100	4,970.00	114,807,000
インテージホールディングス	2,200	1,200.00	2,640,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,500	1,002.00	1,503,000
東邦システムサイエンス	1,700	811.00	1,378,700

ぴあ	600	5,540.00	3,324,000
イオンファンタジー	600	5,000.00	3,000,000
ソースネクスト	2,700	677.00	1,827,900
シーティーエス	1,900	804.00	1,527,600
ネクシィーズグループ	800	1,720.00	1,376,000
メディカルシステムネットワーク	2,400	581.00	1,394,400
日本精化	1,700	1,250.00	2,125,000
扶桑化学工業	1,500	2,875.00	4,312,500
A D E K A	8,900	1,947.00	17,328,300
日油	8,000	2,954.00	23,632,000
ミヨシ油脂	1,000	1,422.00	1,422,000
新日本理化	5,700	262.00	1,493,400
ハリマ化成グループ	1,600	892.00	1,427,200
花王	48,700	7,895.00	384,486,500
第一工業製薬	4,000	800.00	3,200,000
ニイタカ	500	1,842.00	921,000
三洋化成工業	1,300	5,420.00	7,046,000
武田薬品工業	73,000	5,923.00	432,379,000
アステラス製薬	203,600	1,508.50	307,130,600
大日本住友製薬	14,700	1,599.00	23,505,300
塩野義製薬	28,300	5,530.00	156,499,000
田辺三菱製薬	24,200	2,252.00	54,498,400
わかもと製薬	5,000	276.00	1,380,000
あすか製薬	2,300	2,167.00	4,984,100
日本新薬	5,200	6,180.00	32,136,000
バイオフェルミン製薬	500	2,875.00	1,437,500
中外製薬	20,700	5,470.00	113,229,000
科研製薬	3,600	6,070.00	21,852,000
エーザイ	23,700	5,610.00	132,957,000
理研ビタミン	800	4,035.00	3,228,000
ロート製薬	10,900	3,005.00	32,754,500
小野薬品工業	46,800	3,003.00	140,540,400
久光製薬	5,900	7,390.00	43,601,000
有機合成薬品工業	4,800	296.00	1,420,800
持田製薬	1,400	7,730.00	10,822,000
参天製薬	37,500	1,723.00	64,612,500
扶桑薬品工業	700	2,788.00	1,951,600
ツムラ	7,100	3,555.00	25,240,500
日医工	5,200	1,698.00	8,829,600
テルモ	30,400	5,520.00	167,808,000
みらかホールディングス	5,600	4,205.00	23,548,000
キッセイ薬品工業	3,700	2,869.00	10,615,300
生化学工業	3,800	2,136.00	8,116,800
栄研化学	1,600	5,060.00	8,096,000
鳥居薬品	1,200	2,815.00	3,378,000
J C R ファーマ	1,400	5,360.00	7,504,000
東和薬品	1,000	6,970.00	6,970,000
富士製薬工業	700	4,605.00	3,223,500
沢井製薬	4,000	4,995.00	19,980,000
ゼリア新薬工業	4,200	2,110.00	8,862,000
第一三共	56,700	3,867.00	219,258,900
キョーリン製薬ホールディングス	5,500	2,066.00	11,363,000
大幸薬品	1,000	2,093.00	2,093,000
ダイト	1,200	3,470.00	4,164,000
大塚ホールディングス	41,200	4,989.00	205,546,800
大正製薬ホールディングス	4,400	9,930.00	43,692,000
ペプチドリーム	8,900	4,710.00	41,919,000
大日本塗料	2,400	1,582.00	3,796,800
日本ペイントホールディングス	16,000	3,750.00	60,000,000
関西ペイント	21,800	2,632.00	57,377,600

中国塗料	5,900	1,113.00	6,566,700
日本特殊塗料	1,300	2,058.00	2,675,400
藤倉化成	2,600	673.00	1,749,800
太陽ホールディングス	1,600	4,875.00	7,800,000
D I C	8,200	3,895.00	31,939,000
サカタイクス	4,200	1,387.00	5,825,400
東洋インキ S C ホールディングス	21,000	668.00	14,028,000
T & K T O K A	1,400	1,379.00	1,930,600
アルプス技研	1,700	2,272.00	3,862,400
日本空調サービス	2,000	772.00	1,544,000
オリエンタルランド	22,400	10,740.00	240,576,000
フォーカスシステムズ	1,500	947.00	1,420,500
ダスキン	5,100	2,668.00	13,606,800
パーク 2 4	10,800	2,555.00	27,594,000
明光ネットワークジャパン	2,400	1,285.00	3,084,000
ファルコホールディングス	1,000	1,741.00	1,741,000
クレスコ	400	3,835.00	1,534,000
フジ・メディア・ホールディングス	20,400	1,839.00	37,515,600
秀英予備校	2,900	492.00	1,426,800
ラウンドワン	5,900	1,845.00	10,885,500
リゾートトラスト	8,000	2,431.00	19,448,000
オービック	6,100	8,660.00	52,826,000
ジャストシステム	3,200	2,462.00	7,878,400
T D C ソフト	1,200	1,169.00	1,402,800
ヤフー	140,200	512.00	71,782,400
ビー・エム・エル	2,400	2,661.00	6,386,400
ワタベウエディング	2,300	607.00	1,396,100
トレンドマイクロ	9,500	6,160.00	58,520,000
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,312.00	3,936,000
リソー教育	3,200	822.00	2,630,400
日本オラクル	3,100	8,430.00	26,133,000
早稲田アカデミー	800	1,718.00	1,374,400
アルファシステムズ	600	2,327.00	1,396,200
フューチャー	2,600	1,246.00	3,239,600
C A C H o l d i n g s	1,500	1,121.00	1,681,500
ソフトバンク・テクノロジー	800	1,974.00	1,579,200
トーセ	700	2,030.00	1,421,000
ユー・エス・エス	23,100	2,209.00	51,027,900
オービックビジネスコンサルタント	1,000	6,380.00	6,380,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,400	4,350.00	19,140,000
アイティフォー	2,400	751.00	1,802,400
東計電算	400	3,360.00	1,344,000
サイバーエージェント	12,400	4,525.00	56,110,000
楽天	97,100	924.60	89,778,660
エクスネット	1,600	887.00	1,419,200
クリーク・アンド・リバー社	1,400	979.00	1,370,600
テー・オー・ダブリュー	1,800	921.00	1,657,800
大塚商会	5,800	9,600.00	55,680,000
総合メディカル	800	6,130.00	4,904,000
サイボウズ	2,600	547.00	1,422,200
セントラルスポーツ	700	3,950.00	2,765,000
パラカ	600	2,427.00	1,456,200
電通国際情報サービス	1,200	2,696.00	3,235,200
デジタルガレージ	3,500	3,215.00	11,252,500
イーエムシステムズ	700	2,511.00	1,757,700
ウェザーニューズ	700	3,250.00	2,275,000
C I J	2,000	689.00	1,378,000
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,749.00	1,399,200
日本エンタープライズ	6,200	227.00	1,407,400
WOWOW	900	3,365.00	3,028,500

スカラ	1,600	911.00	1,457,600
フルキャストホールディングス	1,700	2,547.00	4,329,900
富士フィルムホールディングス	41,200	4,358.00	179,549,600
コニカミノルタ	46,400	977.00	45,332,800
資生堂	36,900	6,289.00	232,064,100
ライオン	27,600	2,105.00	58,098,000
高砂香料工業	1,200	3,215.00	3,858,000
マンダム	3,900	3,770.00	14,703,000
ミルボン	2,600	4,360.00	11,336,000
ファンケル	4,800	3,430.00	16,464,000
コーセー	3,400	20,310.00	69,054,000
コタ	900	1,961.00	1,764,900
シーズ・ホールディングス	2,700	6,060.00	16,362,000
シーボン	400	3,410.00	1,364,000
ポーラ・オルビスホールディングス	8,500	4,515.00	38,377,500
ノエビアホールディングス	1,300	8,010.00	10,413,000
アジュバンコスメジャパン	1,300	1,103.00	1,433,900
エステー	1,400	2,366.00	3,312,400
アグロ カネショウ	800	2,273.00	1,818,400
コニシ	3,300	1,854.00	6,118,200
長谷川香料	2,600	2,012.00	5,231,200
星光PMC	1,300	1,082.00	1,406,600
小林製薬	5,600	7,020.00	39,312,000
荒川化学工業	1,800	1,933.00	3,479,400
メック	1,400	1,695.00	2,373,000
日本高純度化学	600	2,583.00	1,549,800
タカラバイオ	5,200	1,985.00	10,322,000
JCU	1,200	4,810.00	5,772,000
デクセリアルズ	5,100	1,403.00	7,155,300
アース製薬	1,500	5,180.00	7,770,000
北興化学工業	2,000	770.00	1,540,000
大成ラミック	600	3,140.00	1,884,000
クマイ化学工業	9,000	659.00	5,931,000
日本農薬	5,200	617.00	3,208,400
昭和シェル石油	18,500	1,387.00	25,659,500
富士興産	2,200	630.00	1,386,000
ニチレキ	2,500	1,402.00	3,505,000
ユシロ化学工業	1,100	1,907.00	2,097,700
ビービー・カストロール	800	1,746.00	1,396,800
富士石油	4,900	446.00	2,185,400
MORESCO	700	1,950.00	1,365,000
出光興産	16,600	4,010.00	66,566,000
JXTGホールディングス	316,200	657.50	207,901,500
コスモエネルギーホールディングス	5,800	3,860.00	22,388,000
横浜ゴム	11,500	2,685.00	30,877,500
東洋ゴム工業	11,700	1,957.00	22,896,900
ブリヂストン	70,000	4,789.00	335,230,000
住友ゴム工業	20,400	2,127.00	43,390,800
藤倉ゴム工業	1,700	826.00	1,404,200
オカモト	7,000	1,115.00	7,805,000
アキレス	1,500	2,172.00	3,258,000
フコク	900	1,052.00	946,800
ニッタ	2,000	4,145.00	8,290,000
クリエートメディック	1,200	1,151.00	1,381,200
住友理工	3,800	1,073.00	4,077,400
三ツ星ベルト	5,000	1,177.00	5,885,000
バンドー化学	3,800	1,226.00	4,658,800
旭硝子	20,300	4,495.00	91,248,500
日本板硝子	10,000	886.00	8,860,000
有沢製作所	3,300	967.00	3,191,100

日本山村硝子	8,000	184.00	1,472,000
日本電気硝子	8,600	3,360.00	28,896,000
オハラ	800	3,060.00	2,448,000
住友大阪セメント	39,000	487.00	18,993,000
太平洋セメント	12,500	4,030.00	50,375,000
日本ヒューム	2,000	810.00	1,620,000
日本コンクリート工業	4,300	459.00	1,973,700
三谷セキサン	1,000	2,550.00	2,550,000
アジアパイルホールディングス	2,500	670.00	1,675,000
東海カーボン	18,000	1,983.00	35,694,000
日本カーボン	1,000	6,370.00	6,370,000
東洋炭素	1,300	3,605.00	4,686,500
ノリタケカンパニーリミテド	1,200	5,390.00	6,468,000
TOTO	15,200	5,800.00	88,160,000
日本碍子	24,200	2,024.00	48,980,800
日本特殊陶業	17,000	2,700.00	45,900,000
MARUWA	700	8,570.00	5,999,000
品川リフラクトリーズ	500	3,105.00	1,552,500
黒崎播磨	400	5,080.00	2,032,000
ヨータイ	500	915.00	457,500
東京窯業	3,100	454.00	1,407,400
ニッカトー	1,300	1,109.00	1,441,700
フジインコーポレーテッド	1,800	2,592.00	4,665,600
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,241.00	1,365,100
ニチアス	11,000	1,435.00	15,785,000
新日鐵住金	87,700	2,577.00	226,002,900
神戸製鋼所	35,900	1,212.00	43,510,800
中山製鋼所	2,700	711.00	1,919,700
合同製鐵	1,100	2,015.00	2,216,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	52,900	2,539.00	134,313,100
日新製鋼	5,400	1,548.00	8,359,200
東京製鐵	10,500	863.00	9,061,500
共英製鋼	2,200	1,922.00	4,228,400
大和工業	4,200	3,135.00	13,167,000
東京鐵鋼	800	1,715.00	1,372,000
大阪製鐵	1,300	2,139.00	2,780,700
淀川製鋼所	2,900	3,100.00	8,990,000
東洋鋼鈹	5,000	713.00	3,565,000
丸一鋼管	6,900	3,355.00	23,149,500
モリ工業	600	3,845.00	2,307,000
大同特殊鋼	3,500	5,900.00	20,650,000
日本高周波鋼業	1,700	804.00	1,366,800
日本冶金工業	16,200	337.00	5,459,400
山陽特殊製鋼	2,300	2,405.00	5,531,500
愛知製鋼	1,100	4,720.00	5,192,000
日立金属	21,100	1,427.00	30,109,700
日本金属	500	2,720.00	1,360,000
大平洋金属	1,200	3,220.00	3,864,000
新日本電工	11,700	383.00	4,481,100
栗本鐵工所	1,000	2,126.00	2,126,000
日本製鋼所	6,400	3,410.00	21,824,000
三菱製鋼	1,400	2,661.00	3,725,400
日亜鋼業	3,900	358.00	1,396,200
日本精線	300	4,965.00	1,489,500
大紀アルミニウム工業所	3,200	809.00	2,588,800
日本軽金属ホールディングス	57,200	289.00	16,530,800
三井金属鉱業	5,300	5,120.00	27,136,000
東邦亜鉛	1,100	5,880.00	6,468,000
三菱マテリアル	12,900	3,360.00	43,344,000
住友金属鉱山	25,000	5,020.00	125,500,000

DOWAホールディングス	5,000	3,955.00	19,775,000
古河機械金属	3,200	2,305.00	7,376,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	2,861.00	5,722,000
東邦チタニウム	3,500	1,526.00	5,341,000
UACJ	3,000	2,590.00	7,770,000
古河電気工業	6,500	5,870.00	38,155,000
住友電気工業	73,300	1,684.00	123,437,200
フジクラ	23,700	769.00	18,225,300
昭和電線ホールディングス	2,500	1,002.00	2,505,000
東京特殊電線	300	3,195.00	958,500
タツタ電線	3,900	715.00	2,788,500
カナレ電気	600	2,194.00	1,316,400
平河ヒューテック	1,200	1,208.00	1,449,600
リョービ	2,400	2,878.00	6,907,200
アーレスティ	2,400	971.00	2,330,400
アサヒホールディングス	3,400	2,040.00	6,936,000
東洋製罐グループホールディングス	13,400	1,558.00	20,877,200
ホッカンホールディングス	5,000	384.00	1,920,000
コロナ	1,100	1,354.00	1,489,400
横河ブリッジホールディングス	3,600	2,590.00	9,324,000
OSJBホールディングス	9,800	310.00	3,038,000
高田機工	300	4,520.00	1,356,000
三和ホールディングス	18,800	1,464.00	27,523,200
文化シャッター	5,800	996.00	5,776,800
三協立山	2,700	1,551.00	4,187,700
アルインコ	1,400	1,151.00	1,611,400
LIXILグループ	28,900	2,665.00	77,018,500
日本フィルコン	2,200	657.00	1,445,400
ノーリツ	4,400	1,971.00	8,672,400
長府製作所	2,200	2,454.00	5,398,800
リンナイ	3,500	9,770.00	34,195,000
ユニプレス	3,800	2,578.00	9,796,400
ダイニチ工業	1,600	875.00	1,400,000
日東精工	2,700	614.00	1,657,800
三洋工業	500	2,139.00	1,069,500
岡部	4,000	997.00	3,988,000
ジーテクト	2,200	2,144.00	4,716,800
東プレ	3,700	3,180.00	11,766,000
高周波熱錬	3,800	1,092.00	4,149,600
東京製綱	1,400	2,030.00	2,842,000
サンコール	1,800	796.00	1,432,800
モリテックスチール	1,500	1,033.00	1,549,500
パイオラックス	2,900	2,950.00	8,555,000
エイチワン	1,400	1,443.00	2,020,200
日本発条	19,500	1,067.00	20,806,500
三浦工業	8,500	3,035.00	25,797,500
タクマ	6,600	1,311.00	8,652,600
テクノプロ・ホールディングス	3,400	6,230.00	21,182,000
インターワークス	1,300	1,134.00	1,474,200
Keeper 技研	1,000	1,383.00	1,383,000
ファーストロジック	1,500	932.00	1,398,000
Gunosy	900	2,599.00	2,339,100
イー・ガーディアン	1,000	3,225.00	3,225,000
リブセンス	2,600	552.00	1,435,200
ジャパンマテリアル	1,700	4,255.00	7,233,500
ベクトル	2,300	2,097.00	4,823,100
ウチヤマホールディングス	2,300	669.00	1,538,700
キャリアリンク	2,400	571.00	1,370,400
IBJ	1,500	1,141.00	1,711,500
アサンテ	500	1,890.00	945,000

N・フィールド	1,100	2,104.00	2,314,400
M&Aキャピタルパートナーズ	400	8,010.00	3,204,000
E R Iホールディングス	1,500	962.00	1,443,000
アビスト	300	4,905.00	1,471,500
ウィルグループ	900	1,640.00	1,476,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	498.00	1,444,200
日本ビューホテル	900	1,507.00	1,356,300
リクルートホールディングス	146,000	2,660.00	388,360,000
ツガミ	5,000	1,535.00	7,675,000
オークマ	2,300	6,630.00	15,249,000
東芝機械	11,000	772.00	8,492,000
アマダホールディングス	30,200	1,428.00	43,125,600
アイダエンジニアリング	5,000	1,438.00	7,190,000
滝澤鉄工所	600	2,168.00	1,300,800
富士機械製造	5,900	2,186.00	12,897,400
牧野フライス製作所	10,000	1,089.00	10,890,000
オーエスジー	9,000	2,501.00	22,509,000
ダイジェット工業	700	2,152.00	1,506,400
旭ダイヤモンド工業	5,800	1,283.00	7,441,400
D M G森精機	10,800	2,166.00	23,392,800
ソディック	4,300	1,425.00	6,127,500
ディスコ	2,700	24,260.00	65,502,000
日東工器	1,200	2,887.00	3,464,400
日進工具	500	3,355.00	1,677,500
パンチ工業	1,600	1,267.00	2,027,200
土木管理総合試験所	2,300	612.00	1,407,600
日本郵政	107,400	1,299.00	139,512,600
ベルシステム24ホールディングス	3,200	1,496.00	4,787,200
一蔵	1,300	1,067.00	1,387,100
ソラスト	1,100	2,753.00	3,028,300
豊田自動織機	16,000	6,810.00	108,960,000
豊和工業	1,100	1,671.00	1,838,100
OKK	1,200	1,171.00	1,405,200
石川製作所	500	3,120.00	1,560,000
東洋機械金属	1,500	949.00	1,423,500
津田駒工業	5,000	268.00	1,340,000
島精機製作所	2,500	6,830.00	17,075,000
オプトラン	1,400	3,860.00	5,404,000
NCホールディングス	1,800	761.00	1,369,800
フリーー	1,400	1,051.00	1,471,400
ヤマシンフィルタ	2,700	1,354.00	3,655,800
日阪製作所	2,800	1,094.00	3,063,200
やまびこ	3,800	1,680.00	6,384,000
平田機工	500	10,330.00	5,165,000
ペガサスミシン製造	1,900	751.00	1,426,900
ナブテスコ	10,800	4,495.00	48,546,000
三井海洋開発	2,100	2,689.00	5,646,900
レオン自動機	1,700	2,332.00	3,964,400
S M C	6,200	46,400.00	287,680,000
新川	1,600	1,148.00	1,836,800
ホソカワミクロン	700	7,750.00	5,425,000
ユニオンツール	900	3,965.00	3,568,500
オイレス工業	2,500	2,363.00	5,907,500
日精エー・エス・ピー機械	700	7,770.00	5,439,000
サトーホールディングス	2,600	3,575.00	9,295,000
技研製作所	1,000	2,836.00	2,836,000
日本エアテック	1,400	980.00	1,372,000
日精樹脂工業	1,600	1,739.00	2,782,400
オカダアイヨン	800	1,655.00	1,324,000
小松製作所	95,700	3,999.00	382,704,300

住友重機械工業	11,300	4,295.00	48,533,500
日立建機	9,300	4,545.00	42,268,500
日工	500	2,462.00	1,231,000
巴工業	800	1,960.00	1,568,000
井関農機	2,000	2,205.00	4,410,000
T O W A	1,500	1,638.00	2,457,000
丸山製作所	800	1,807.00	1,445,600
北川鉄工所	900	2,809.00	2,528,100
シンニッタ	700	840.00	588,000
ローツェ	1,000	2,374.00	2,374,000
タカキタ	1,600	821.00	1,313,600
クボタ	106,300	1,979.50	210,420,850
荏原実業	700	2,184.00	1,528,800
東洋エンジニアリング	2,600	1,005.00	2,613,000
三菱化工機	700	2,223.00	1,556,100
月島機械	3,900	1,436.00	5,600,400
帝国電機製作所	1,400	1,653.00	2,314,200
新東工業	4,700	1,227.00	5,766,900
澁谷工業	1,700	4,380.00	7,446,000
アイチコーポレーション	3,400	731.00	2,485,400
小森コーポレーション	5,000	1,400.00	7,000,000
鶴見製作所	1,700	1,943.00	3,303,100
酒井重工業	400	4,515.00	1,806,000
荏原製作所	8,100	3,970.00	32,157,000
石井鐵工所	700	2,024.00	1,416,800
西島製作所	2,000	999.00	1,998,000
北越工業	2,200	1,175.00	2,585,000
千代田化工建設	14,400	1,065.00	15,336,000
ダイキン工業	27,000	12,775.00	344,925,000
オルガノ	700	3,290.00	2,303,000
トーヨーカネツ	800	3,515.00	2,812,000
栗田工業	10,700	3,210.00	34,347,000
椿本チエイン	12,000	898.00	10,776,000
日機装	6,900	1,220.00	8,418,000
木村化工機	2,400	505.00	1,212,000
新興プランテック	4,300	1,023.00	4,398,900
アネスト岩田	3,300	1,133.00	3,738,900
ダイフク	10,100	6,890.00	69,589,000
サムコ	1,100	1,260.00	1,386,000
加藤製作所	900	2,606.00	2,345,400
油研工業	500	3,055.00	1,527,500
タダノ	9,600	1,704.00	16,358,400
フジテック	6,300	1,424.00	8,971,200
C K D	5,500	2,688.00	14,784,000
キトー	1,500	2,085.00	3,127,500
平和	6,100	2,116.00	12,907,600
理想科学工業	2,000	2,171.00	4,342,000
S A N K Y O	5,000	3,920.00	19,600,000
日本金銭機械	1,800	1,299.00	2,338,200
マースエンジニアリング	1,300	2,447.00	3,181,100
福島工業	1,200	4,825.00	5,790,000
ダイコク電機	900	1,713.00	1,541,700
竹内製作所	3,300	2,482.00	8,190,600
アマノ	6,100	2,926.00	17,848,600
J U K I	2,900	1,686.00	4,889,400
サンデンホールディングス	2,400	1,650.00	3,960,000
蛇の目マシン工業	1,800	772.00	1,389,600
ブラザー工業	24,200	2,650.00	64,130,000
マックス	3,000	1,502.00	4,506,000
モリタホールディングス	3,200	1,992.00	6,374,400

グローリー	5,900	4,020.00	23,718,000
新晃工業	2,000	1,999.00	3,998,000
大和冷機工業	3,200	1,225.00	3,920,000
セガサミーホールディングス	19,700	1,572.00	30,968,400
日本ピストンリング	700	2,384.00	1,668,800
リケン	900	6,080.00	5,472,000
T P R	2,200	3,035.00	6,677,000
ツバキ・ナカシマ	2,000	3,070.00	6,140,000
ホシザキ	6,200	9,800.00	60,760,000
大豊工業	1,600	1,571.00	2,513,600
日本精工	40,700	1,622.00	66,015,400
N T N	45,900	481.00	22,077,900
ジェイテクト	21,100	1,702.00	35,912,200
不二越	18,000	676.00	12,168,000
ミネベアミツミ	36,800	2,439.00	89,755,200
日本トムソン	6,300	782.00	4,926,600
T H K	12,400	4,695.00	58,218,000
ユーシン精機	900	3,585.00	3,226,500
前澤給装工業	800	1,909.00	1,527,200
イーグル工業	2,400	1,965.00	4,716,000
日本ピラー工業	2,000	1,707.00	3,414,000
キッツ	8,800	881.00	7,752,800
日立製作所	476,000	822.70	391,605,200
三菱電機	198,100	1,827.50	362,027,750
富士電機	60,000	815.00	48,900,000
東洋電機製造	800	1,706.00	1,364,800
安川電機	23,000	4,975.00	114,425,000
シンフォニア テクノロジー	13,000	370.00	4,810,000
明電舎	17,000	414.00	7,038,000
オリジン電気	800	1,900.00	1,520,000
山洋電気	1,000	8,190.00	8,190,000
デンヨー	1,800	1,834.00	3,301,200
三櫻工業	2,500	769.00	1,922,500
マキタ	25,800	5,060.00	130,548,000
東芝テック	14,000	651.00	9,114,000
芝浦メカトロニクス	3,000	495.00	1,485,000
マブチモーター	5,500	5,370.00	29,535,000
日本電産	23,800	16,410.00	390,558,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	2,852.00	1,996,400
東光高岳	1,000	1,625.00	1,625,000
ダブル・スコープ	2,900	1,537.00	4,457,300
ダイヘン	11,000	836.00	9,196,000
ヤーマン	2,900	1,733.00	5,025,700
J V C ケンウッド	14,500	365.00	5,292,500
ミマキエンジニアリング	1,800	918.00	1,652,400
第一精工	900	2,827.00	2,544,300
日新電機	4,600	1,074.00	4,940,400
大崎電気工業	4,200	793.00	3,330,600
オムロン	21,100	6,270.00	132,297,000
日東工業	3,200	1,868.00	5,977,600
I D E C	2,500	2,865.00	7,162,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,000	600.00	21,600,000
メルコホールディングス	1,000	3,595.00	3,595,000
日本電気	25,600	3,225.00	82,560,000
富士通	204,000	642.30	131,029,200
沖電気工業	8,000	1,456.00	11,648,000
岩崎通信機	1,800	771.00	1,387,800
電気興業	1,100	3,290.00	3,619,000
サンケン電気	12,000	862.00	10,344,000
アイホン	1,100	1,705.00	1,875,500

ルネサスエレクトロニクス	10,300	1,181.00	12,164,300
セイコーエプソン	29,500	2,073.00	61,153,500
ワコム	15,400	552.00	8,500,800
アルバック	4,600	6,420.00	29,532,000
E I Z O	1,800	5,180.00	9,324,000
ジャパンディスプレイ	40,700	218.00	8,872,600
日本信号	5,500	1,077.00	5,923,500
京三製作所	5,000	773.00	3,865,000
能美防災	2,600	2,331.00	6,060,600
ホーチキ	1,400	2,014.00	2,819,600
エレコム	1,700	2,354.00	4,001,800
パナソニック	226,300	1,647.50	372,829,250
シャープ	13,800	3,565.00	49,197,000
アンリツ	14,400	1,350.00	19,440,000
富士通ゼネラル	6,000	2,059.00	12,354,000
ソニー	132,300	5,378.00	711,509,400
T D K	10,400	9,410.00	97,864,000
帝国通信工業	1,000	1,378.00	1,378,000
タムラ製作所	7,600	810.00	6,156,000
アルプス電気	17,100	2,775.00	47,452,500
池上通信機	9,000	166.00	1,494,000
パイオニア	33,100	199.00	6,586,900
日本電波工業	2,000	703.00	1,406,000
鈴木	1,100	1,289.00	1,417,900
日本トリム	400	6,040.00	2,416,000
ローランド ディー・ジー	1,000	2,688.00	2,688,000
フォスター電機	2,300	2,942.00	6,766,600
クラリオン	10,000	339.00	3,390,000
S M K	6,000	464.00	2,784,000
ヨコオ	1,300	2,255.00	2,931,500
ホシデン	5,000	1,530.00	7,650,000
ヒロセ電機	3,200	15,370.00	49,184,000
日本航空電子工業	5,000	1,585.00	7,925,000
T O A	2,100	1,427.00	2,996,700
マクセルホールディングス	3,900	2,118.00	8,260,200
古野電気	2,400	745.00	1,788,000
ユニデンホールディングス	5,000	301.00	1,505,000
アルパイン	4,700	2,133.00	10,025,100
スミダコーポレーション	2,000	1,616.00	3,232,000
アイコム	1,100	2,765.00	3,041,500
リオン	800	2,974.00	2,379,200
本多通信工業	1,500	1,244.00	1,866,000
船井電機	2,000	772.00	1,544,000
横河電機	19,800	2,255.00	44,649,000
新電元工業	700	8,330.00	5,831,000
アズビル	5,900	4,720.00	27,848,000
東亜ディーケーケー	1,300	1,141.00	1,483,300
日本光電工業	8,300	2,974.00	24,684,200
チノー	800	1,634.00	1,307,200
共和電業	3,100	452.00	1,401,200
日本電子材料	2,000	730.00	1,460,000
堀場製作所	3,900	7,740.00	30,186,000
アドバンテスト	11,000	2,233.00	24,563,000
小野測器	1,700	802.00	1,363,400
エスベック	1,800	2,621.00	4,717,800
キーエンス	9,700	63,900.00	619,830,000
日置電機	1,000	3,535.00	3,535,000
シスメックス	15,400	8,680.00	133,672,000
日本マイクロニクス	3,400	1,103.00	3,750,200
メガチップス	1,600	3,760.00	6,016,000

OBARA GROUP	1,200	6,580.00	7,896,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,600	1,179.00	1,886,400
澤藤電機	700	2,201.00	1,540,700
デンソー	44,000	6,251.00	275,044,000
コーセル	2,700	1,633.00	4,409,100
イリソ電子工業	1,700	6,950.00	11,815,000
新日本無線	1,600	878.00	1,404,800
オブテックスグループ	1,600	5,870.00	9,392,000
千代田インテグレ	1,000	2,425.00	2,425,000
アイ・オー・データ機器	1,300	1,123.00	1,459,900
レーザーテック	4,100	4,395.00	18,019,500
スタンレー電気	15,200	4,155.00	63,156,000
岩崎電気	900	1,653.00	1,487,700
ウシオ電機	12,000	1,470.00	17,640,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	1,008.00	1,713,600
日本セラミック	2,000	2,947.00	5,894,000
遠藤照明	1,300	1,150.00	1,495,000
古河電池	1,400	1,050.00	1,470,000
山一電機	1,400	1,869.00	2,616,600
図研	1,300	1,774.00	2,306,200
日本電子	7,000	835.00	5,845,000
カシオ計算機	15,900	1,513.00	24,056,700
ファナック	18,800	27,575.00	518,410,000
日本シイエムケイ	3,500	967.00	3,384,500
エンプラス	900	3,670.00	3,303,000
大真空	1,000	1,367.00	1,367,000
ローム	8,900	11,070.00	98,523,000
浜松ホトニクス	14,400	4,210.00	60,624,000
三井ハイテック	2,600	2,041.00	5,306,600
新光電気工業	7,500	892.00	6,690,000
京セラ	32,500	6,249.00	203,092,500
協栄産業	700	1,997.00	1,397,900
太陽誘電	8,900	1,789.00	15,922,100
村田製作所	20,800	15,040.00	312,832,000
ユーシン	3,000	753.00	2,259,000
双葉電子工業	3,200	2,225.00	7,120,000
日東電工	15,000	8,505.00	127,575,000
北陸電気工業	800	1,669.00	1,335,200
東海理化電機製作所	5,200	2,305.00	11,986,000
ニチコン	6,200	1,338.00	8,295,600
日本ケミコン	1,600	2,819.00	4,510,400
KOA	2,700	2,328.00	6,285,600
三井造船	7,200	1,984.00	14,284,800
日立造船	15,700	553.00	8,682,100
三菱重工業	33,200	4,377.00	145,316,400
川崎重工業	15,400	4,020.00	61,908,000
IHI	15,200	3,520.00	53,504,000
名村造船所	5,900	638.00	3,764,200
日本車輛製造	7,000	306.00	2,142,000
三菱ロジスネクスト	2,400	929.00	2,229,600
近畿車輛	500	2,689.00	1,344,500
FPG	6,800	1,419.00	9,649,200
島根銀行	1,000	1,403.00	1,403,000
じもとホールディングス	13,200	187.00	2,468,400
全国保証	5,600	4,795.00	26,852,000
めぶきフィナンシャルグループ	101,500	441.00	44,761,500
東京TYフィナンシャルグループ	2,600	2,783.00	7,235,800
九州フィナンシャルグループ	32,100	611.00	19,613,100
かんぽ生命保険	7,400	2,744.00	20,305,600
ゆうちょ銀行	55,400	1,461.00	80,939,400

富山第一銀行	5,000	509.00	2,545,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	118,800	617.00	73,299,600
西日本フィナンシャルホールディングス	13,300	1,328.00	17,662,400
アルヒ	1,700	1,469.00	2,497,300
日産自動車	233,700	1,121.50	262,094,550
いすゞ自動車	57,400	1,748.50	100,363,900
トヨタ自動車	240,800	7,300.00	1,757,840,000
日野自動車	28,300	1,441.00	40,780,300
三菱自動車工業	73,300	838.00	61,425,400
エフテック	1,300	1,315.00	1,709,500
レシップホールディングス	900	897.00	807,300
武蔵精密工業	2,100	3,735.00	7,843,500
日産車体	7,700	1,022.00	7,869,400
新明和工業	8,600	948.00	8,152,800
極東開発工業	3,700	1,688.00	6,245,600
日信工業	4,000	1,870.00	7,480,000
トピー工業	1,600	3,235.00	5,176,000
ティラド	700	4,075.00	2,852,500
曙ブレーキ工業	9,200	308.00	2,833,600
タチエス	3,400	1,894.00	6,439,600
NOK	10,600	2,280.00	24,168,000
フタバ産業	6,100	947.00	5,776,700
KYB	2,100	5,570.00	11,697,000
市光工業	3,000	1,148.00	3,444,000
大同メタル工業	2,500	1,315.00	3,287,500
プレス工業	10,500	672.00	7,056,000
ミクニ	2,500	699.00	1,747,500
太平洋工業	4,100	1,490.00	6,109,000
ケーヒン	4,600	2,148.00	9,880,800
河西工業	2,400	1,462.00	3,508,800
アイシン精機	16,300	6,190.00	100,897,000
マツダ	62,200	1,498.50	93,206,700
今仙電機製作所	1,800	1,193.00	2,147,400
本田技研工業	178,300	3,847.00	685,920,100
スズキ	39,300	5,996.00	235,642,800
SUBARU	61,500	3,729.00	229,333,500
安永	1,000	2,528.00	2,528,000
ヤマハ発動機	28,000	3,440.00	96,320,000
ショーワ	5,100	1,704.00	8,690,400
小糸製作所	11,900	7,530.00	89,607,000
TBK	2,600	541.00	1,406,600
エクセディ	2,400	3,415.00	8,196,000
ミツバ	3,600	1,368.00	4,924,800
豊田合成	7,200	2,611.00	18,799,200
愛三工業	3,500	1,246.00	4,361,000
盟和産業	1,000	1,368.00	1,368,000
ヨロズ	2,000	1,889.00	3,778,000
エフ・シー・シー	3,200	3,120.00	9,984,000
新家工業	600	2,490.00	1,494,000
シマノ	8,000	15,670.00	125,360,000
テイ・エス テック	4,600	4,210.00	19,366,000
ジャムコ	1,000	2,515.00	2,515,000
小野建	1,700	1,947.00	3,309,900
ノジマ	3,400	2,548.00	8,663,200
佐鳥電機	1,400	1,080.00	1,512,000
カッパ・クリエイト	2,400	1,276.00	3,062,400
エコートレーディング	1,900	743.00	1,411,700
伯東	1,200	1,632.00	1,958,400
コンドーテック	1,500	982.00	1,473,000

ライトオン	1,600	910.00	1,456,000
ナガイレーベン	2,600	2,762.00	7,181,200
三菱食品	2,100	3,095.00	6,499,500
良品計画	2,600	36,000.00	93,600,000
三城ホールディングス	800	530.00	424,000
松田産業	1,400	1,958.00	2,741,200
第一興商	2,900	5,530.00	16,037,000
メディバルホールディングス	19,600	2,142.00	41,983,200
アドヴァン	2,000	1,086.00	2,172,000
萩原電気	700	3,490.00	2,443,000
アルビス	400	3,005.00	1,202,000
アズワン	1,500	6,980.00	10,470,000
尾家産業	1,100	1,303.00	1,433,300
シモジマ	1,200	1,123.00	1,347,600
ドウシシャ	2,100	2,440.00	5,124,000
小津産業	600	2,224.00	1,334,400
コナカ	2,500	585.00	1,462,500
高速	1,200	1,226.00	1,471,200
ハウス オブ ローゼ	800	1,780.00	1,424,000
G-7ホールディングス	600	2,436.00	1,461,600
イオン北海道	2,000	821.00	1,642,000
コジマ	4,000	357.00	1,428,000
ヒマラヤ	1,100	1,276.00	1,403,600
コーナン商事	2,800	2,606.00	7,296,800
ネットワークシステムズ	7,900	1,590.00	12,561,000
エコス	1,100	1,304.00	1,434,400
ワタミ	2,300	1,345.00	3,093,500
マルシェ	1,700	815.00	1,385,500
ドンキホーテホールディングス	12,600	5,940.00	74,844,000
丸文	1,700	1,061.00	1,803,700
西松屋チェーン	4,300	1,229.00	5,284,700
ゼンショーホールディングス	10,100	2,240.00	22,624,000
ハビネット	1,300	1,711.00	2,224,300
幸楽苑ホールディングス	1,200	1,885.00	2,262,000
橋本総業ホールディングス	800	1,864.00	1,491,200
日本ライフライン	5,600	3,445.00	19,292,000
サイゼリヤ	2,900	3,070.00	8,903,000
エクセル	800	2,798.00	2,238,400
V Tホールディングス	6,600	570.00	3,762,000
マルカキカイ	700	2,145.00	1,501,500
アルゴグラフィックス	900	3,485.00	3,136,500
魚力	1,200	1,191.00	1,429,200
I D O M	5,900	716.00	4,224,400
日本エム・ディ・エム	1,400	983.00	1,376,200
ユナイテッドアローズ	2,400	4,175.00	10,020,000
進和	1,200	2,275.00	2,730,000
ダイトロン	900	2,408.00	2,167,200
ハイデイ日高	2,100	3,370.00	7,077,000
シークス	1,200	4,805.00	5,766,000
京都きもの友禅	1,800	784.00	1,411,200
コロワイド	6,500	2,465.00	16,022,500
ピーシーデポコーポレーション	2,900	778.00	2,256,200
田中商事	1,800	800.00	1,440,000
オーハシテクニカ	1,100	1,793.00	1,972,300
壱番屋	1,400	4,580.00	6,412,000
白銅	700	2,476.00	1,733,200
トップカルチャー	2,900	492.00	1,426,800
P L A N T	1,000	1,393.00	1,393,000
スギホールディングス	4,300	5,820.00	25,026,000
島津製作所	23,700	2,681.00	63,539,700

JMS	100	629.00	62,900
長野計器	1,600	1,236.00	1,977,600
バイ・テクノロジー	500	25,100.00	12,550,000
スター精密	3,200	2,161.00	6,915,200
東京計器	1,300	1,222.00	1,588,600
オーバル	4,900	297.00	1,455,300
東京精密	3,600	4,450.00	16,020,000
マニー	2,400	3,990.00	9,576,000
ニコン	34,500	2,183.00	75,313,500
トプコン	10,600	2,368.00	25,100,800
オリンパス	29,500	4,185.00	123,457,500
理研計器	1,900	2,277.00	4,326,300
SCREENホールディングス	3,700	9,630.00	35,631,000
キヤノン電子	1,800	2,574.00	4,633,200
タムロン	1,600	2,461.00	3,937,600
HOYA	40,300	5,535.00	223,060,500
シード	300	4,620.00	1,386,000
ノーリツ鋼機	2,000	2,442.00	4,884,000
エー・アンド・デイ	2,100	691.00	1,451,100
キヤノン	106,700	4,002.00	427,013,400
リコー	59,600	1,198.00	71,400,800
シチズン時計	23,600	836.00	19,729,600
リズム時計工業	800	2,216.00	1,772,800
大研医器	1,900	751.00	1,426,900
メニコン	2,700	2,568.00	6,933,600
スノーピーク	1,200	1,187.00	1,424,400
パラマウントベッドホールディングス	2,100	5,720.00	12,012,000
SHOBI	3,600	413.00	1,486,800
ニホンフラッシュ	900	2,698.00	2,428,200
前田工織	2,000	2,018.00	4,036,000
永大産業	3,000	569.00	1,707,000
アートネイチャー	2,100	774.00	1,625,400
バンダイナムコホールディングス	20,500	3,575.00	73,287,500
SHOEI	900	4,490.00	4,041,000
フランスベッドホールディングス	2,300	1,038.00	2,387,400
マーベラス	3,300	925.00	3,052,500
パイロットコーポレーション	3,500	5,510.00	19,285,000
萩原工業	1,100	1,780.00	1,958,000
エイベックス	3,600	1,622.00	5,839,200
トッパン・フォームズ	4,200	1,232.00	5,174,400
フジシールインターナショナル	4,400	3,525.00	15,510,000
タカラトミー	8,300	1,129.00	9,370,700
廣済堂	2,700	521.00	1,406,700
アーク	11,300	126.00	1,423,800
レック	1,200	3,130.00	3,756,000
タカノ	1,500	966.00	1,449,000
プロネクス	1,900	1,309.00	2,487,100
ホクシン	7,300	193.00	1,408,900
ウッドワン	1,000	1,456.00	1,456,000
大建工業	1,500	2,703.00	4,054,500
凸版印刷	56,000	934.00	52,304,000
大日本印刷	25,900	2,255.00	58,404,500
図書印刷	1,500	1,003.00	1,504,500
共同印刷	600	3,145.00	1,887,000
NISSHA	4,100	2,986.00	12,242,600
藤森工業	1,700	3,655.00	6,213,500
宝印刷	1,000	1,833.00	1,833,000
前澤化成工業	1,400	1,165.00	1,631,000
アシックス	19,700	1,658.00	32,662,600
ツツミ	700	2,125.00	1,487,500

JSP	1,200	3,295.00	3,954,000
ニチハ	3,000	4,340.00	13,020,000
エフピコ	1,600	5,890.00	9,424,000
小松ウオール工業	700	2,591.00	1,813,700
ヤマハ	13,300	4,715.00	62,709,500
河合楽器製作所	700	3,845.00	2,691,500
クリナップ	1,800	846.00	1,522,800
ビジョン	12,000	4,285.00	51,420,000
天馬	1,500	2,200.00	3,300,000
キングジム	1,600	986.00	1,577,600
リンテック	4,700	3,065.00	14,405,500
信越ポリマー	4,100	1,238.00	5,075,800
東リ	4,900	385.00	1,886,500
イトーキ	4,100	719.00	2,947,900
任天堂	12,200	47,770.00	582,794,000
三菱鉛筆	3,300	2,453.00	8,094,900
松風	1,000	1,436.00	1,436,000
タカラスタンダード	4,100	1,836.00	7,527,600
コクヨ	9,500	1,980.00	18,810,000
ニフコ	3,600	7,600.00	27,360,000
立川ブラインド工業	1,000	1,447.00	1,447,000
グローブライド	900	2,339.00	2,105,100
岡村製作所	6,900	1,475.00	10,177,500
日本バルカー工業	1,600	3,175.00	5,080,000
MUTOHホールディングス	600	2,539.00	1,523,400
伊藤忠商事	143,200	2,038.50	291,913,200
丸紅	160,400	807.10	129,458,840
スクロール	3,100	459.00	1,422,900
ヨンドシーホールディングス	2,000	2,691.00	5,382,000
三陽商会	1,100	2,384.00	2,622,400
長瀬産業	11,800	1,831.00	21,605,800
蝶理	1,200	1,907.00	2,288,400
豊田通商	21,800	4,090.00	89,162,000
オンワードホールディングス	12,400	912.00	11,308,800
三共生興	3,300	514.00	1,696,200
兼松	8,300	1,432.00	11,885,600
美津濃	2,000	3,185.00	6,370,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,200	8,060.00	49,972,000
三井物産	165,800	1,922.50	318,750,500
日本紙パルプ商事	1,000	4,295.00	4,295,000
東京エレクトロン	13,200	20,635.00	272,382,000
日立ハイテクノロジーズ	6,800	5,080.00	34,544,000
カメイ	2,500	1,647.00	4,117,500
東都水産	700	1,987.00	1,390,900
OUGホールディングス	500	2,704.00	1,352,000
スターゼン	800	5,170.00	4,136,000
セイコーホールディングス	3,100	2,897.00	8,980,700
山善	7,600	1,206.00	9,165,600
椿本興業	400	3,305.00	1,322,000
住友商事	123,100	1,828.50	225,088,350
日本ユニシス	5,400	2,222.00	11,998,800
内田洋行	900	3,200.00	2,880,000
三菱商事	136,900	2,976.00	407,414,400
第一実業	900	3,230.00	2,907,000
キヤノンマーケティングジャパン	5,600	2,934.00	16,430,400
西華産業	1,200	2,674.00	3,208,800
佐藤商事	1,700	1,151.00	1,956,700
菱洋エレクトロ	1,800	1,875.00	3,375,000
東京産業	2,400	599.00	1,437,600

ユアサ商事	1,900	3,765.00	7,153,500
神鋼商事	400	3,705.00	1,482,000
小林産業	4,000	350.00	1,400,000
阪和興業	3,600	4,950.00	17,820,000
正栄食品工業	1,100	4,045.00	4,449,500
カナデン	1,900	1,344.00	2,553,600
菱電商事	1,400	1,861.00	2,605,400
ニプロ	13,700	1,587.00	21,741,900
フルサト工業	1,100	1,778.00	1,955,800
岩谷産業	4,300	4,130.00	17,759,000
すてきナイスグループ	1,000	1,446.00	1,446,000
昭光通商	12,000	122.00	1,464,000
極東貿易	3,000	465.00	1,395,000
イワキ	3,000	415.00	1,245,000
兼松エレクトロニクス	1,200	3,230.00	3,876,000
三愛石油	5,200	1,475.00	7,670,000
稲畑産業	4,700	1,577.00	7,411,900
明和産業	2,800	505.00	1,414,000
ゴールドウイン	600	11,830.00	7,098,000
ユニ・チャーム	42,000	3,008.00	126,336,000
デサント	4,700	1,748.00	8,215,600
キング	100	674.00	67,400
ワキタ	4,200	1,281.00	5,380,200
ヤマトインターナショナル	2,900	480.00	1,392,000
東邦ホールディングス	5,800	2,573.00	14,923,400
サンゲツ	6,600	2,253.00	14,869,800
ミツウロコグループホールディングス	2,800	770.00	2,156,000
シナネンホールディングス	900	2,722.00	2,449,800
伊藤忠エネクス	4,300	1,020.00	4,386,000
サンリオ	5,500	1,972.00	10,846,000
サンワテクノス	1,200	2,153.00	2,583,600
リョーサン	2,500	3,945.00	9,862,500
新光商事	2,100	1,945.00	4,084,500
トーヨー	900	2,518.00	2,266,200
三信電気	1,800	1,932.00	3,477,600
東陽テクニカ	2,200	967.00	2,127,400
モスフードサービス	2,600	3,240.00	8,424,000
加賀電子	1,800	2,752.00	4,953,600
三益半導体工業	1,500	1,977.00	2,965,500
ソーダニッカ	2,000	695.00	1,390,000
立花エレテック	1,300	2,196.00	2,854,800
木曽路	2,400	2,739.00	6,573,600
SRSホールディングス	2,300	956.00	2,198,800
千趣会	3,500	623.00	2,180,500
タカキュー	6,200	222.00	1,376,400
ケーヨー	3,600	626.00	2,253,600
上新電機	2,300	3,880.00	8,924,000
日本瓦斯	3,600	4,505.00	16,218,000
ロイヤルホールディングス	3,500	2,857.00	9,999,500
東天紅	700	1,890.00	1,323,000
いなげや	2,200	1,815.00	3,993,000
島忠	4,700	3,525.00	16,567,500
チヨダ	2,300	2,738.00	6,297,400
ライフコーポレーション	1,500	2,885.00	4,327,500
リンガーハット	2,400	2,451.00	5,882,400
MrMaxHD	2,400	760.00	1,824,000
テンアライド	2,900	478.00	1,386,200
AOKIホールディングス	3,900	1,697.00	6,618,300
オークワ	3,000	1,114.00	3,342,000
コメリ	3,000	3,070.00	9,210,000

青山商事	3,700	4,435.00	16,409,500
しまむら	2,300	13,040.00	29,992,000
はせがわ	2,900	487.00	1,412,300
高島屋	31,000	1,099.00	34,069,000
松屋	3,900	1,563.00	6,095,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,200	2,083.00	19,163,600
近鉄百貨店	700	4,020.00	2,814,000
パルコ	1,900	1,478.00	2,808,200
丸井グループ	18,700	2,012.00	37,624,400
クレディセゾン	14,800	1,892.00	28,001,600
アクシアル リテイリング	1,600	4,310.00	6,896,000
イオン	75,100	1,865.50	140,099,050
イズミ	3,500	7,180.00	25,130,000
平和堂	4,000	2,446.00	9,784,000
フジ	2,300	2,283.00	5,250,900
ヤオコー	2,200	5,850.00	12,870,000
ゼビオホールディングス	2,700	2,194.00	5,923,800
ケーズホールディングス	8,300	3,045.00	25,273,500
PALTAC	2,700	5,330.00	14,391,000
三谷産業	3,200	443.00	1,417,600
Olympicグループ	2,400	599.00	1,437,600
新生銀行	16,900	1,683.00	28,442,700
あおぞら銀行	11,600	4,435.00	51,446,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,380,500	769.10	1,061,742,550
りそなホールディングス	214,400	618.90	132,692,160
三井住友トラスト・ホールディングス	38,400	4,358.00	167,347,200
三井住友フィナンシャルグループ	147,900	4,717.00	697,644,300
第四銀行	2,400	4,915.00	11,796,000
北越銀行	2,000	2,401.00	4,802,000
千葉銀行	70,000	882.00	61,740,000
群馬銀行	39,700	654.00	25,963,800
武蔵野銀行	3,100	3,605.00	11,175,500
千葉興業銀行	5,400	505.00	2,727,000
筑波銀行	8,100	368.00	2,980,800
七十七銀行	6,100	2,683.00	16,366,300
青森銀行	1,500	3,375.00	5,062,500
秋田銀行	1,300	2,906.00	3,777,800
山形銀行	2,200	2,392.00	5,262,400
岩手銀行	1,400	4,325.00	6,055,000
東邦銀行	17,500	394.00	6,895,000
東北銀行	1,000	1,473.00	1,473,000
みちのく銀行	1,300	1,800.00	2,340,000
ふくおかフィナンシャルグループ	79,000	562.00	44,398,000
静岡銀行	52,000	1,094.00	56,888,000
十六銀行	2,600	2,918.00	7,586,800
スルガ銀行	20,000	1,880.00	37,600,000
八十二銀行	35,400	640.00	22,656,000
山梨中央銀行	12,000	434.00	5,208,000
大垣共立銀行	3,100	2,802.00	8,686,200
福井銀行	1,700	2,606.00	4,430,200
北國銀行	2,200	4,405.00	9,691,000
清水銀行	700	2,991.00	2,093,700
富山銀行	400	3,930.00	1,572,000
滋賀銀行	18,000	562.00	10,116,000
南都銀行	2,300	3,000.00	6,900,000
百五銀行	18,800	532.00	10,001,600
京都銀行	7,500	5,980.00	44,850,000
紀陽銀行	7,400	1,768.00	13,083,200
三重銀行	900	2,338.00	2,104,200
ほくほくフィナンシャルグループ	13,000	1,551.00	20,163,000

広島銀行	28,800	844.00	24,307,200
山陰合同銀行	11,600	1,036.00	12,017,600
中国銀行	13,500	1,343.00	18,130,500
鳥取銀行	800	1,745.00	1,396,000
伊予銀行	27,900	866.00	24,161,400
百十四銀行	21,000	359.00	7,539,000
四国銀行	3,000	1,538.00	4,614,000
阿波銀行	16,000	669.00	10,704,000
大分銀行	1,100	4,120.00	4,532,000
宮崎銀行	1,300	3,465.00	4,504,500
佐賀銀行	1,200	2,541.00	3,049,200
十八銀行	12,000	282.00	3,384,000
沖縄銀行	1,900	4,355.00	8,274,500
琉球銀行	3,800	1,629.00	6,190,200
セブン銀行	73,300	378.00	27,707,400
みずほフィナンシャルグループ	2,655,000	199.40	529,407,000
山口フィナンシャルグループ	19,000	1,284.00	24,396,000
アクリーティブ	4,000	340.00	1,360,000
芙蓉総合リース	2,200	7,180.00	15,796,000
興銀リース	3,700	2,781.00	10,289,700
東京センチュリー	3,900	6,070.00	23,673,000
SBIホールディングス	22,100	2,498.00	55,205,800
日本証券金融	8,000	669.00	5,352,000
アイフル	32,800	374.00	12,267,200
長野銀行	700	1,892.00	1,324,400
名古屋銀行	1,600	4,000.00	6,400,000
北洋銀行	29,500	371.00	10,944,500
愛知銀行	700	5,390.00	3,773,000
第三銀行	1,100	1,660.00	1,826,000
中京銀行	900	2,318.00	2,086,200
大光銀行	700	2,370.00	1,659,000
愛媛銀行	2,700	1,274.00	3,439,800
みなと銀行	1,800	2,103.00	3,785,400
京葉銀行	17,000	496.00	8,432,000
関西アーバン銀行	2,700	1,419.00	3,831,300
栃木銀行	10,100	426.00	4,302,600
北日本銀行	600	3,010.00	1,806,000
東和銀行	3,400	1,392.00	4,732,800
福島銀行	1,800	803.00	1,445,400
リコーリース	1,500	3,605.00	5,407,500
イオンフィナンシャルサービス	13,900	2,536.00	35,250,400
アコム	39,300	479.00	18,824,700
ジャックス	2,400	2,526.00	6,062,400
オリエントコーポレーション	42,300	172.00	7,275,600
日立キャピタル	5,400	2,825.00	15,255,000
アプラスフィナンシャル	13,200	108.00	1,425,600
オリックス	130,300	1,919.50	250,110,850
三菱UFJリース	49,600	672.00	33,331,200
ジャフコ	2,800	5,510.00	15,428,000
トモニホールディングス	16,100	486.00	7,824,600
大和証券グループ本社	167,000	717.60	119,839,200
野村ホールディングス	336,200	653.00	219,538,600
岡三証券グループ	17,000	686.00	11,662,000
丸三証券	6,200	1,032.00	6,398,400
東洋証券	7,000	307.00	2,149,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,600	783.00	16,912,800
光世証券	1,000	1,401.00	1,401,000
水戸証券	6,100	387.00	2,360,700
いちよし証券	4,100	1,276.00	5,231,600

松井証券	9,600	1,065.00	10,224,000
S O M P Oホールディングス	38,300	4,070.00	155,881,000
だいがう証券ビジネス	2,100	673.00	1,413,300
日本取引所グループ	57,400	1,861.00	106,821,400
マネックスグループ	20,700	382.00	7,907,400
カブドットコム証券	12,500	376.00	4,700,000
極東証券	2,600	1,565.00	4,069,000
岩井コスモホールディングス	2,000	1,375.00	2,750,000
藍澤証券	3,700	802.00	2,967,400
フィデアホールディングス	19,000	198.00	3,762,000
池田泉州ホールディングス	20,700	423.00	8,756,100
アニコム ホールディングス	1,400	3,480.00	4,872,000
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	51,100	3,361.00	171,747,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	16,100	1,966.00	31,652,600
マネーパートナーズグループ	1,800	389.00	700,200
第一生命ホールディングス	110,500	2,142.00	236,691,000
東京海上ホールディングス	73,600	4,982.00	366,675,200
イー・ギャランティ	500	4,110.00	2,055,000
N E Cキャピタルソリューション	800	2,120.00	1,696,000
T & Dホールディングス	60,400	1,776.00	107,270,400
アドバンスクリエイト	700	1,967.00	1,376,900
三井不動産	97,600	2,578.50	251,661,600
三菱地所	145,400	1,896.50	275,751,100
平和不動産	3,400	2,026.00	6,888,400
東京建物	21,400	1,707.00	36,529,800
ダイビル	5,000	1,354.00	6,770,000
京阪神ビルディング	3,200	869.00	2,780,800
住友不動産	47,000	3,932.00	184,804,000
大京	3,100	2,231.00	6,916,100
テーオーシー	6,700	846.00	5,668,200
東京楽天地	300	5,120.00	1,536,000
レオパレス 2 1	23,300	806.00	18,779,800
スターツコーポレーション	2,700	2,868.00	7,743,600
フジ住宅	2,500	879.00	2,197,500
空港施設	2,200	633.00	1,392,600
明和地所	1,700	811.00	1,378,700
ゴールドクレスト	1,500	2,214.00	3,321,000
リログループ	10,300	2,993.00	30,827,900
日本エスリード	800	2,195.00	1,756,000
日神不動産	2,600	803.00	2,087,800
日本エスコン	3,500	1,058.00	3,703,000
タカラレーベン	9,200	488.00	4,489,600
サンヨーハウジング名古屋	1,100	1,245.00	1,369,500
イオンモール	12,600	2,220.00	27,972,000
ファースト住建	800	1,748.00	1,398,400
カチタス	2,000	3,220.00	6,440,000
東祥	1,200	3,875.00	4,650,000
トーセイ	2,400	1,351.00	3,242,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	12,100	1,313.00	15,887,300
サンフロンティア不動産	2,400	1,241.00	2,978,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,600	862.00	1,379,200
ランドビジネス	4,300	333.00	1,431,900
グランディハウス	2,900	478.00	1,386,200
東武鉄道	21,200	3,335.00	70,702,000
相鉄ホールディングス	6,300	2,879.00	18,137,700
東京急行電鉄	53,800	1,736.00	93,396,800
京浜急行電鉄	27,100	1,963.00	53,197,300
小田急電鉄	29,500	2,233.00	65,873,500
京王電鉄	11,100	4,740.00	52,614,000

京成電鉄	13,800	3,535.00	48,783,000
富士急行	2,700	2,862.00	7,727,400
新京成電鉄	300	2,272.00	681,600
東日本旅客鉄道	35,600	10,310.00	367,036,000
西日本旅客鉄道	17,900	7,545.00	135,055,500
東海旅客鉄道	17,700	20,010.00	354,177,000
西武ホールディングス	25,300	1,881.00	47,589,300
鴻池運輸	2,800	1,935.00	5,418,000
西日本鉄道	5,500	2,911.00	16,010,500
ハマキョウレックス	1,400	3,500.00	4,900,000
サカイ引越センター	1,000	5,420.00	5,420,000
近鉄グループホールディングス	18,800	4,185.00	78,678,000
阪急阪神ホールディングス	25,000	3,995.00	99,875,000
南海電気鉄道	8,900	2,756.00	24,528,400
京阪ホールディングス	8,400	3,395.00	28,518,000
神戸電鉄	400	3,955.00	1,582,000
名古屋鉄道	14,600	2,749.00	40,135,400
山陽電気鉄道	1,400	2,787.00	3,901,800
トランコム	500	7,120.00	3,560,000
日本通運	7,400	7,120.00	52,688,000
ヤマトホールディングス	32,900	2,707.00	89,060,300
山九	4,800	5,230.00	25,104,000
日新	1,600	2,793.00	4,468,800
丸運	4,000	352.00	1,408,000
丸全昭和運輸	7,000	519.00	3,633,000
センコーグループホールディングス	11,300	742.00	8,384,600
トナミホールディングス	500	5,340.00	2,670,000
ニッコンホールディングス	7,100	2,739.00	19,446,900
福山通運	2,700	4,585.00	12,379,500
セイノーホールディングス	14,100	1,779.00	25,083,900
神奈川中央交通	500	3,690.00	1,845,000
日立物流	4,100	2,639.00	10,819,900
丸和運輸機関	1,000	3,745.00	3,745,000
C & F ロジホールディングス	2,100	1,580.00	3,318,000
日本郵船	15,700	2,322.00	36,455,400
商船三井	11,900	3,395.00	40,400,500
川崎汽船	8,700	2,638.00	22,950,600
N S ユナイテッド海運	900	2,288.00	2,059,200
飯野海運	9,600	567.00	5,443,200
九州旅客鉄道	15,700	3,355.00	52,673,500
S G ホールディングス	13,300	2,290.00	30,457,000
日本航空	34,800	4,031.00	140,278,800
A N A ホールディングス	36,800	4,334.00	159,491,200
パスコ	2,000	337.00	674,000
西本W i s m e t t a c ホールディングス	400	4,290.00	1,716,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,490.00	1,341,000
Genky Drug Stores	800	3,360.00	2,688,000
三菱倉庫	6,500	2,521.00	16,386,500
三井倉庫ホールディングス	11,000	357.00	3,927,000
住友倉庫	13,000	734.00	9,542,000
澁澤倉庫	1,000	1,888.00	1,888,000
ヤマタネ	1,000	1,974.00	1,974,000
東陽倉庫	4,000	348.00	1,392,000
乾汽船	1,700	825.00	1,402,500
日本トランスシティ	5,000	439.00	2,195,000
ケイヒン	800	1,744.00	1,395,200
中央倉庫	1,300	1,094.00	1,422,200
安田倉庫	1,700	982.00	1,669,400
東洋埠頭	800	1,756.00	1,404,800

宇徳	3,000	509.00	1,527,000
上組	11,800	2,364.00	27,895,200
キムラユニティー	1,300	1,126.00	1,463,800
キューソー流通システム	500	2,575.00	1,287,500
近鉄エクスプレス	3,500	2,105.00	7,367,500
エーアイテイー	1,300	1,150.00	1,495,000
日本コンセプト	300	1,516.00	454,800
東京放送ホールディングス	11,700	2,325.00	27,202,500
日本テレビホールディングス	17,900	2,020.00	36,158,000
朝日放送	1,900	892.00	1,694,800
テレビ朝日ホールディングス	5,300	2,269.00	12,025,700
スカパーJ S A Tホールディングス	14,800	490.00	7,252,000
テレビ東京ホールディングス	1,600	2,667.00	4,267,200
日本BS放送	1,000	1,352.00	1,352,000
ビジョン	500	2,789.00	1,394,500
USEN-NEXT HOLDINGS	1,400	1,034.00	1,447,600
ワイヤレスゲート	1,200	1,153.00	1,383,600
コネクシオ	1,400	2,311.00	3,235,400
日本通信	17,500	119.00	2,082,500
日本電信電話	139,500	4,754.00	663,183,000
KDDI	175,100	2,623.50	459,374,850
光通信	2,300	15,500.00	35,650,000
NTTドコモ	143,900	2,701.50	388,745,850
エムティーアイ	2,600	641.00	1,666,600
GMOインターネット	7,100	1,872.00	13,291,200
カドカワ	5,700	1,197.00	6,822,900
学研ホールディングス	700	5,090.00	3,563,000
ゼンリン	2,300	3,495.00	8,038,500
昭文社	1,800	769.00	1,384,200
インプレスホールディングス	6,000	232.00	1,392,000
東京電力ホールディングス	158,200	412.00	65,178,400
中部電力	60,600	1,433.00	86,839,800
関西電力	80,800	1,292.50	104,434,000
中国電力	27,400	1,249.00	34,222,600
北陸電力	19,400	842.00	16,334,800
東北電力	46,400	1,391.00	64,542,400
四国電力	17,800	1,223.00	21,769,400
九州電力	43,800	1,216.00	53,260,800
北海道電力	19,900	647.00	12,875,300
沖縄電力	3,200	2,894.00	9,260,800
電源開発	15,800	2,795.00	44,161,000
エフオン	1,100	1,168.00	1,284,800
イーレックス	3,100	801.00	2,483,100
東京瓦斯	42,300	2,683.50	113,512,050
大阪瓦斯	38,400	2,157.00	82,828,800
東邦瓦斯	9,800	3,255.00	31,899,000
北海道瓦斯	5,000	298.00	1,490,000
広島ガス	4,100	406.00	1,664,600
西部瓦斯	2,400	2,839.00	6,813,600
静岡ガス	5,600	916.00	5,129,600
メタウォーター	1,100	3,100.00	3,410,000
アイネット	1,100	1,590.00	1,749,000
松竹	1,300	15,330.00	19,929,000
東宝	12,800	3,495.00	44,736,000
エイチ・アイ・エス	3,000	4,010.00	12,030,000
東映	700	11,550.00	8,085,000
ラックランド	700	2,124.00	1,486,800
エヌ・ティ・ティ・データ	60,400	1,113.00	67,225,200
共立メンテナンス	3,400	4,605.00	15,657,000
イチネンホールディングス	2,100	1,545.00	3,244,500

建設技術研究所	1,300	1,322.00	1,718,600
スペース	1,200	1,385.00	1,662,000
アインホールディングス	2,600	6,800.00	17,680,000
燦ホールディングス	500	2,645.00	1,322,500
東京テアトル	1,000	1,467.00	1,467,000
ビジネスブレイン太田昭和	800	1,958.00	1,566,400
ナガワ	400	4,295.00	1,718,000
よみうりランド	400	4,740.00	1,896,000
東京都競馬	1,400	3,745.00	5,243,000
常磐興産	800	1,898.00	1,518,400
カナモト	2,900	3,390.00	9,831,000
東京ドーム	7,700	991.00	7,630,700
D T S	2,000	3,820.00	7,640,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,000	4,440.00	39,960,000
シーイーシー	1,200	3,245.00	3,894,000
カブコン	4,200	4,470.00	18,774,000
西尾レントオール	1,700	3,330.00	5,661,000
アイ・エス・ビー	1,100	1,345.00	1,479,500
日本空港ビルデング	5,700	4,030.00	22,971,000
トランス・コスモス	2,100	2,921.00	6,134,100
乃村工藝社	4,400	2,171.00	9,552,400
ジャステック	1,100	1,310.00	1,441,000
S C S K	4,500	4,275.00	19,237,500
藤田観光	800	3,230.00	2,584,000
K N T - C Tホールディングス	1,200	1,797.00	2,156,400
日本管財	2,000	2,123.00	4,246,000
トーカイ	1,800	2,695.00	4,851,000
白洋舎	400	3,360.00	1,344,000
セコム	20,100	7,889.00	158,568,900
日本システムウエア	600	2,587.00	1,552,200
セントラル警備保障	900	2,517.00	2,265,300
アイネス	2,500	1,075.00	2,687,500
丹青社	3,900	1,057.00	4,122,300
メイテック	2,200	6,140.00	13,508,000
T K C	1,800	4,615.00	8,307,000
富士ソフト	2,700	4,010.00	10,827,000
応用地質	2,100	1,452.00	3,049,200
船井総研ホールディングス	3,900	2,152.00	8,392,800
N S D	3,200	2,174.00	6,956,800
進学会ホールディングス	2,400	598.00	1,435,200
丸紅建材リース	6,000	233.00	1,398,000
コナミホールディングス	7,900	5,740.00	45,346,000
いであ	1,300	1,118.00	1,453,400
学究社	900	1,637.00	1,473,300
ベネッセホールディングス	6,900	3,975.00	27,427,500
イオンディライト	2,300	3,820.00	8,786,000
ナック	1,500	952.00	1,428,000
福井コンピュータホールディングス	600	2,462.00	1,477,200
ニチイ学館	3,600	1,220.00	4,392,000
ダイセキ	3,200	3,100.00	9,920,000
ステップ	800	1,813.00	1,450,400
日鉄住金物産	1,500	6,140.00	9,210,000
泉州電業	600	2,888.00	1,732,800
元気寿司	500	2,762.00	1,381,000
トラスコ中山	4,100	2,857.00	11,713,700
ヤマダ電機	65,400	675.00	44,145,000
オートバックスセブン	7,800	2,105.00	16,419,000
モリト	1,600	958.00	1,532,800
アークランドサカモト	3,300	1,779.00	5,870,700

ニトリホールディングス	7,700	17,540.00	135,058,000
グルメ杵屋	1,000	1,158.00	1,158,000
愛眼	2,900	475.00	1,377,500
吉野家ホールディングス	6,400	1,972.00	12,620,800
加藤産業	3,100	3,715.00	11,516,500
イノテック	1,700	1,267.00	2,153,900
イエローハット	1,800	3,285.00	5,913,000
松屋フーズ	900	3,920.00	3,528,000
JBC Cホールディングス	1,500	1,076.00	1,614,000
JKホールディングス	2,000	888.00	1,776,000
サガミチェーン	2,600	1,383.00	3,595,800
日伝	1,600	2,182.00	3,491,200
関西スーパーマーケット	1,500	1,136.00	1,704,000
ミロク情報サービス	1,700	3,255.00	5,533,500
北沢産業	5,000	284.00	1,420,000
杉本商事	1,100	1,847.00	2,031,700
因幡電機産業	2,600	5,000.00	13,000,000
王将フードサービス	1,400	5,040.00	7,056,000
プレナス	2,200	2,121.00	4,666,200
ミニストップ	1,400	2,176.00	3,046,400
アークス	3,700	2,617.00	9,682,900
パローホールディングス	4,500	2,968.00	13,356,000
バイテックホールディングス	900	1,680.00	1,512,000
東テク	600	2,428.00	1,456,800
ミスミグループ本社	22,700	3,150.00	71,505,000
藤久	800	1,670.00	1,336,000
ベルク	900	6,130.00	5,517,000
大 庄	1,000	1,727.00	1,727,000
タキヒヨー	600	2,301.00	1,380,600
ファーストリテイリング	3,300	42,940.00	141,702,000
ソフトバンクグループ	88,000	8,873.00	780,824,000
蔵王産業	800	1,873.00	1,498,400
スズケン	8,900	4,305.00	38,314,500
サンドラッグ	8,300	4,895.00	40,628,500
サックスパー ホールディングス	1,800	1,151.00	2,071,800
ジェコス	1,300	1,259.00	1,636,700
ルネサスイーストン	1,900	740.00	1,406,000
ペルーナ	4,800	1,279.00	6,139,200
合計	23,939,100		49,912,570,510

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2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	23,305,026
コール・ローン	871,095,081
国債証券	90,298,001,520
地方債証券	12,224,423,731
特殊債券	13,565,701,225
社債券	8,910,746,900
未収利息	388,333,877
前払費用	5,563,316
流動資産合計	126,287,170,676
資産合計	126,287,170,676
負債の部	
流動負債	
未払解約金	15,430,835
その他未払費用	2,132
流動負債合計	15,432,967
負債合計	15,432,967
純資産の部	
元本等	
元本	130,621,929,148
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	4,350,191,439
純資産合計	126,271,737,709
負債純資産合計	126,287,170,676

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おります。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。
--------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2018年2月21日現在）
1. 受益権総口数	130,621,929,148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	4,350,191,439円
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9667円 (9,667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7月14日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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	(2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2018年2月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	218,703,770
地方債証券	93,859,836
特殊債券	96,116,374
社債券	87,740,900
合計	59,013,340

(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)

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

項目	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	146,589,047,181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	3,064,590,439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	19,031,708,472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）	129,889,409,735円
DCニッセイ日本債券インデックス	687,095,998円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	1,491,858円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	16,798,213円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	167,240円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	406,102円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	4,389,059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）	13,911,689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）	2,799,893円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式/リート/債券）	2,344,092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）	3,115,269円
計	130,621,929,148円

附属明細表（2018年2月21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374回 利付国債(2年)	14,000,000	14,037,660	
	第375回 利付国債(2年)	14,000,000	14,040,740	
	第376回 利付国債(2年)	14,000,000	14,043,680	
	第377回 利付国債(2年)	332,000,000	333,105,560	
	第378回 利付国債(2年)	375,000,000	376,327,500	
	第379回 利付国債(2年)	750,000,000	752,820,000	
	第380回 利付国債(2年)	750,000,000	752,985,000	
	第381回 利付国債(2年)	750,000,000	753,142,500	
	第382回 利付国債(2年)	299,000,000	300,318,590	
	第383回 利付国債(2年)	279,000,000	280,288,980	
	第384回 利付国債(2年)	500,000,000	502,420,000	
	第117回 利付国債(5年)	659,000,000	661,464,660	
	第118回 利付国債(5年)	463,000,000	465,078,870	
	第119回 利付国債(5年)	44,000,000	44,139,480	
	第120回 利付国債(5年)	473,000,000	475,530,550	
	第121回 利付国債(5年)	85,000,000	85,321,300	
	第122回 利付国債(5年)	843,000,000	846,540,600	
	第123回 利付国債(5年)	794,000,000	797,787,380	
	第124回 利付国債(5年)	784,000,000	788,100,320	
	第125回 利付国債(5年)	745,000,000	749,224,150	
	第126回 利付国債(5年)	806,000,000	811,013,320	
	第127回 利付国債(5年)	855,000,000	860,788,350	
	第128回 利付国債(5年)	788,000,000	793,776,040	
	第129回 利付国債(5年)	577,000,000	581,448,670	
	第130回 利付国債(5年)	500,000,000	504,025,000	

第131回	利付国債(5年)	705,000,000	711,048,900
第132回	利付国債(5年)	114,000,000	115,038,540
第133回	利付国債(5年)	300,000,000	302,823,000
第1回	利付国債(40年)	144,000,000	206,346,240
第2回	利付国債(40年)	187,000,000	259,239,970
第3回	利付国債(40年)	171,000,000	238,175,640
第4回	利付国債(40年)	240,000,000	335,767,200
第5回	利付国債(40年)	233,000,000	313,305,780
第6回	利付国債(40年)	244,000,000	321,462,680
第7回	利付国債(40年)	258,000,000	324,357,600
第8回	利付国債(40年)	285,000,000	331,990,800
第9回	利付国債(40年)	382,000,000	321,013,700
第10回	利付国債(40年)	190,000,000	189,450,900
第299回	利付国債(10年)	206,000,000	209,195,060
第300回	利付国債(10年)	122,000,000	124,153,300
第301回	利付国債(10年)	324,000,000	331,027,560
第302回	利付国債(10年)	47,000,000	47,960,680
第303回	利付国債(10年)	365,000,000	373,858,550
第304回	利付国債(10年)	67,000,000	68,520,230
第305回	利付国債(10年)	693,000,000	711,156,600
第306回	利付国債(10年)	393,000,000	405,469,890
第307回	利付国債(10年)	57,000,000	58,690,050
第308回	利付国債(10年)	161,000,000	166,358,080
第309回	利付国債(10年)	385,000,000	396,018,700
第310回	利付国債(10年)	434,000,000	446,599,020
第311回	利付国債(10年)	175,000,000	179,177,250
第312回	利付国債(10年)	1,051,000,000	1,090,275,870
第313回	利付国債(10年)	572,000,000	597,105,080
第314回	利付国債(10年)	220,000,000	228,300,600
第315回	利付国債(10年)	538,000,000	561,768,840
第316回	利付国債(10年)	240,000,000	249,801,600
第317回	利付国債(10年)	188,000,000	196,228,760
第318回	利付国債(10年)	482,000,000	501,366,760
第319回	利付国債(10年)	238,000,000	249,147,920
第320回	利付国債(10年)	491,000,000	512,113,000
第321回	利付国債(10年)	505,000,000	528,012,850
第322回	利付国債(10年)	174,000,000	181,217,520
第323回	利付国債(10年)	167,000,000	174,321,280
第324回	利付国債(10年)	477,000,000	495,841,500
第325回	利付国債(10年)	444,000,000	462,354,960
第326回	利付国債(10年)	9,000,000	9,351,090
第327回	利付国債(10年)	211,000,000	220,254,460
第328回	利付国債(10年)	122,000,000	126,350,520
第329回	利付国債(10年)	49,000,000	51,331,420
第330回	利付国債(10年)	16,000,000	16,788,000
第331回	利付国債(10年)	11,000,000	11,418,660
第332回	利付国債(10年)	419,000,000	435,537,930
第333回	利付国債(10年)	608,000,000	632,630,080
第334回	利付国債(10年)	664,000,000	691,801,680
第335回	利付国債(10年)	405,000,000	419,827,050
第336回	利付国債(10年)	53,000,000	54,994,920
第337回	利付国債(10年)	336,000,000	344,047,200
第338回	利付国債(10年)	1,001,000,000	1,032,581,550
第339回	利付国債(10年)	1,112,000,000	1,147,495,040
第340回	利付国債(10年)	1,057,000,000	1,091,077,680
第341回	利付国債(10年)	1,028,000,000	1,053,350,480
第342回	利付国債(10年)	1,133,000,000	1,142,596,510
第343回	利付国債(10年)	1,138,000,000	1,146,990,200
第344回	利付国債(10年)	1,113,000,000	1,121,091,510
第345回	利付国債(10年)	1,052,000,000	1,058,943,200

第346回 利付国債(10年)	1,058,000,000	1,064,210,460
第347回 利付国債(10年)	991,000,000	996,519,870
第348回 利付国債(10年)	690,000,000	693,615,600
第349回 利付国債(10年)	237,000,000	238,156,560
第1回 利付国債(30年)	33,000,000	43,119,120
第2回 利付国債(30年)	44,000,000	55,760,320
第3回 利付国債(30年)	48,000,000	60,435,840
第4回 利付国債(30年)	79,000,000	105,893,180
第5回 利付国債(30年)	53,000,000	66,710,570
第6回 利付国債(30年)	81,000,000	104,618,790
第7回 利付国債(30年)	85,000,000	109,177,400
第8回 利付国債(30年)	77,000,000	93,772,140
第9回 利付国債(30年)	69,000,000	80,054,490
第10回 利付国債(30年)	118,000,000	131,798,920
第11回 利付国債(30年)	86,000,000	103,710,840
第12回 利付国債(30年)	89,000,000	112,833,310
第13回 利付国債(30年)	108,000,000	135,425,520
第14回 利付国債(30年)	144,000,000	189,773,280
第15回 利付国債(30年)	157,000,000	209,759,850
第16回 利付国債(30年)	133,000,000	178,209,360
第17回 利付国債(30年)	134,000,000	177,499,080
第18回 利付国債(30年)	161,000,000	210,716,800
第19回 利付国債(30年)	121,000,000	158,753,210
第20回 利付国債(30年)	127,000,000	171,208,700
第21回 利付国債(30年)	124,000,000	163,057,520
第22回 利付国債(30年)	151,000,000	204,088,580
第23回 利付国債(30年)	155,000,000	209,666,950
第24回 利付国債(30年)	159,000,000	215,421,150
第25回 利付国債(30年)	172,000,000	227,213,720
第26回 利付国債(30年)	372,000,000	498,078,240
第27回 利付国債(30年)	323,000,000	439,735,430
第28回 利付国債(30年)	368,000,000	502,231,680
第29回 利付国債(30年)	370,000,000	499,736,800
第30回 利付国債(30年)	399,000,000	533,351,280
第31回 利付国債(30年)	361,000,000	476,325,060
第32回 利付国債(30年)	449,000,000	603,631,110
第33回 利付国債(30年)	515,000,000	662,284,850
第34回 利付国債(30年)	473,000,000	630,182,630
第35回 利付国債(30年)	527,000,000	680,773,330
第36回 利付国債(30年)	509,000,000	659,562,200
第37回 利付国債(30年)	550,000,000	701,613,000
第38回 利付国債(30年)	354,000,000	444,146,100
第39回 利付国債(30年)	319,000,000	407,911,680
第40回 利付国債(30年)	285,000,000	358,045,500
第41回 利付国債(30年)	302,000,000	372,523,040
第42回 利付国債(30年)	324,000,000	399,832,200
第43回 利付国債(30年)	323,000,000	398,775,800
第44回 利付国債(30年)	318,000,000	392,764,980
第45回 利付国債(30年)	315,000,000	374,015,250
第46回 利付国債(30年)	374,000,000	444,106,300
第47回 利付国債(30年)	405,000,000	491,410,800
第48回 利付国債(30年)	355,000,000	413,386,850
第49回 利付国債(30年)	350,000,000	407,526,000
第50回 利付国債(30年)	341,000,000	345,351,160
第51回 利付国債(30年)	339,000,000	299,862,450
第52回 利付国債(30年)	359,000,000	335,510,630
第53回 利付国債(30年)	319,000,000	305,847,630
第54回 利付国債(30年)	330,000,000	333,141,600
第55回 利付国債(30年)	317,000,000	319,656,460
第56回 利付国債(30年)	312,000,000	314,252,640

第57回	利付国債(30年)	13,000,000	13,078,650
第41回	利付国債(20年)	3,000,000	3,052,950
第42回	利付国債(20年)	65,000,000	66,912,950
第43回	利付国債(20年)	12,000,000	12,574,920
第44回	利付国債(20年)	5,000,000	5,272,150
第45回	利付国債(20年)	11,000,000	11,575,960
第46回	利付国債(20年)	10,000,000	10,543,600
第47回	利付国債(20年)	13,000,000	13,779,090
第48回	利付国債(20年)	81,000,000	87,014,250
第49回	利付国債(20年)	88,000,000	94,041,200
第50回	利付国債(20年)	66,000,000	70,123,680
第51回	利付国債(20年)	13,000,000	13,919,490
第52回	利付国債(20年)	10,000,000	10,793,200
第53回	利付国債(20年)	10,000,000	10,848,200
第54回	利付国債(20年)	1,000,000	1,088,650
第55回	利付国債(20年)	8,000,000	8,692,080
第56回	利付国債(20年)	13,000,000	14,187,680
第57回	利付国債(20年)	11,000,000	11,957,220
第58回	利付国債(20年)	3,000,000	3,276,360
第59回	利付国債(20年)	9,000,000	9,787,230
第60回	利付国債(20年)	9,000,000	9,656,370
第61回	利付国債(20年)	9,000,000	9,504,270
第62回	利付国債(20年)	9,000,000	9,428,220
第63回	利付国債(20年)	6,000,000	6,606,240
第64回	利付国債(20年)	11,000,000	12,222,540
第65回	利付国債(20年)	10,000,000	11,154,800
第66回	利付国債(20年)	11,000,000	12,205,930
第68回	利付国債(20年)	11,000,000	12,517,890
第69回	利付国債(20年)	9,000,000	10,187,100
第70回	利付国債(20年)	180,000,000	208,027,800
第71回	利付国債(20年)	90,000,000	102,871,800
第72回	利付国債(20年)	265,000,000	302,569,050
第73回	利付国債(20年)	129,000,000	147,050,970
第74回	利付国債(20年)	96,000,000	110,090,880
第75回	利付国債(20年)	96,000,000	110,562,240
第76回	利付国債(20年)	143,000,000	162,663,930
第77回	利付国債(20年)	103,000,000	117,893,800
第78回	利付国債(20年)	113,000,000	128,952,210
第79回	利付国債(20年)	93,000,000	106,811,430
第80回	利付国債(20年)	121,000,000	139,856,640
第81回	利付国債(20年)	146,000,000	168,302,960
第82回	利付国債(20年)	211,000,000	244,924,580
第83回	利付国債(20年)	225,000,000	262,163,250
第84回	利付国債(20年)	329,000,000	380,764,860
第85回	利付国債(20年)	253,000,000	295,987,230
第86回	利付国債(20年)	227,000,000	269,233,350
第87回	利付国債(20年)	211,000,000	248,553,780
第88回	利付国債(20年)	350,000,000	416,804,500
第89回	利付国債(20年)	225,000,000	266,076,000
第90回	利付国債(20年)	363,000,000	430,906,410
第91回	利付国債(20年)	209,000,000	249,886,670
第92回	利付国債(20年)	468,000,000	553,480,200
第93回	利付国債(20年)	230,000,000	270,976,800
第94回	利付国債(20年)	348,000,000	413,145,600
第95回	利付国債(20年)	305,000,000	369,178,100
第96回	利付国債(20年)	174,000,000	207,380,160
第97回	利付国債(20年)	236,000,000	284,608,920
第98回	利付国債(20年)	172,000,000	205,787,680
第99回	利付国債(20年)	426,000,000	511,353,360
第100回	利付国債(20年)	277,000,000	336,156,120

第101回	利付国債(20年)	174,000,000	214,641,180
第102回	利付国債(20年)	201,000,000	248,858,100
第103回	利付国債(20年)	188,000,000	230,837,680
第104回	利付国債(20年)	158,000,000	190,766,040
第105回	利付国債(20年)	286,000,000	346,386,040
第106回	利付国債(20年)	174,000,000	212,560,140
第107回	利付国債(20年)	192,000,000	233,235,840
第108回	利付国債(20年)	317,000,000	378,288,780
第109回	利付国債(20年)	209,000,000	250,045,510
第110回	利付国債(20年)	260,000,000	316,750,200
第111回	利付国債(20年)	180,000,000	221,940,000
第112回	利付国債(20年)	297,000,000	362,880,540
第113回	利付国債(20年)	456,000,000	558,732,240
第114回	利付国債(20年)	315,000,000	387,024,750
第115回	利付国債(20年)	189,000,000	234,412,920
第116回	利付国債(20年)	216,000,000	268,647,840
第117回	利付国債(20年)	346,000,000	426,230,480
第118回	利付国債(20年)	201,000,000	245,684,310
第119回	利付国債(20年)	182,000,000	218,063,300
第120回	利付国債(20年)	223,000,000	261,797,540
第121回	利付国債(20年)	323,000,000	391,782,850
第122回	利付国債(20年)	207,000,000	248,532,480
第123回	利付国債(20年)	344,000,000	426,773,280
第124回	利付国債(20年)	201,000,000	246,846,090
第125回	利付国債(20年)	222,000,000	278,900,820
第126回	利付国債(20年)	196,000,000	241,236,800
第127回	利付国債(20年)	182,000,000	221,685,100
第128回	利付国債(20年)	319,000,000	389,361,830
第129回	利付国債(20年)	185,000,000	223,404,150
第130回	利付国債(20年)	334,000,000	404,079,880
第131回	利付国債(20年)	182,000,000	217,784,840
第132回	利付国債(20年)	237,000,000	283,859,640
第133回	利付国債(20年)	317,000,000	383,925,040
第134回	利付国債(20年)	237,000,000	287,509,440
第135回	利付国債(20年)	169,000,000	202,715,500
第136回	利付国債(20年)	178,000,000	210,944,240
第137回	利付国債(20年)	192,000,000	230,490,240
第138回	利付国債(20年)	198,000,000	232,216,380
第139回	利付国債(20年)	178,000,000	211,221,920
第140回	利付国債(20年)	511,000,000	614,313,980
第141回	利付国債(20年)	371,000,000	446,606,090
第142回	利付国債(20年)	225,000,000	274,059,000
第143回	利付国債(20年)	350,000,000	416,496,500
第144回	利付国債(20年)	223,000,000	262,145,420
第145回	利付国債(20年)	522,000,000	629,500,680
第146回	利付国債(20年)	506,000,000	610,483,940
第147回	利付国債(20年)	554,000,000	660,789,040
第148回	利付国債(20年)	481,000,000	566,007,130
第149回	利付国債(20年)	521,000,000	613,498,340
第150回	利付国債(20年)	515,000,000	598,296,100
第151回	利付国債(20年)	511,000,000	576,791,250
第152回	利付国債(20年)	544,000,000	614,023,680
第153回	利付国債(20年)	542,000,000	620,508,700
第154回	利付国債(20年)	522,000,000	588,628,080
第155回	利付国債(20年)	559,000,000	610,729,860
第156回	利付国債(20年)	468,000,000	462,154,680
第157回	利付国債(20年)	487,000,000	462,864,280
第158回	利付国債(20年)	478,000,000	478,406,300
第159回	利付国債(20年)	505,000,000	513,241,600
第160回	利付国債(20年)	495,000,000	510,899,400

	第161回 利付国債(20年)	501,000,000	506,701,380
	第162回 利付国債(20年)	487,000,000	491,733,640
国債証券 合計		81,327,000,000	90,298,001,520
地方債証券	第682回 東京都公募公債	300,000,000	308,125,200
	第697回 東京都公募公債	200,000,000	207,308,200
	第707回 東京都公募公債	200,000,000	206,844,200
	第708回 東京都公募公債	300,000,000	311,200,200
	第730回 東京都公募公債	300,000,000	310,529,100
	平成22年度第12回 北海道公募公債	200,000,000	207,388,400
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	306,564,900
	第205回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,435,200
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,093,300
	第360回 大阪府公募公債(10年)	300,000,000	310,964,700
	第378回 大阪府公募公債(10年)	144,000,000	149,099,472
	第384回 大阪府公募公債(10年)	118,000,000	122,125,634
	平成25年度第9回 京都府公募公債	300,000,000	310,555,800
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	300,000,000	312,141,600
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	115,855,900
	平成21年度第1回 静岡県公募公債	150,000,000	152,966,550
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	300,000,000	311,109,000
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	300,000,000	309,140,100
	平成21年度第2回 埼玉県公募公債	300,000,000	305,934,300
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	104,685,800
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	119,000,000	123,173,925
	平成21年度第1回 福岡県公募公債	100,000,000	102,208,700
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	300,000,000	309,721,500
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	300,000,000	311,844,900
	平成21年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	308,169,900
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	300,000,000	311,276,700
	第10回 群馬県公募公債	300,000,000	310,390,500
	平成21年度第1回 岐阜県公募公債	300,000,000	306,781,800
	第110回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,930,200
	第123回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,102,200
	第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,047,800
	平成22年度第1回 福島県公募公債	200,000,000	205,657,400
	平成25年度第1回 熊本市公募公債	300,000,000	310,174,200
	平成21年度第1回 新潟市公募公債	300,000,000	307,372,800
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	156,184,200
	平成25年度第6回 大阪市公募公債	200,000,000	207,207,400
	第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	95,661,300
	第1回 京都市公募公債	300,000,000	341,778,300
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	103,618,400
	平成22年度第1回 横浜市公募公債	300,000,000	309,087,900
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	207,603,000
	第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,210,900
	平成22年度第7回 札幌市公募公債	200,000,000	205,276,200
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	155,758,800
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	153,656,250
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	207,196,400
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	103,561,400
	平成22年度第6回 広島市公募公債	200,000,000	207,820,400
	平成25年度第1回 高知県公募公債	100,000,000	103,362,700
	平成22年度第1回 相模原市公募公債	100,000,000	103,567,200
	平成21年度第1回 福井県公募公債	300,000,000	307,372,800
	平成19年度第1回 山梨県公募公債	300,000,000	306,900,300
	平成22年度第1回 岡山県公募公債	200,000,000	205,679,800
地方債証券 合計		11,781,000,000	12,224,423,731
特殊債券	第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	207,228,000
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	335,042,700
	第80回 政保道路機構債券	200,000,000	203,875,000

第93回	政保道路機構債券	233,000,000	238,852,727	
第100回	政保道路機構債券	200,000,000	205,691,000	
第107回	政保道路機構債券	315,000,000	324,344,160	
第137回	政保道路機構債券	400,000,000	416,262,400	
第139回	政保道路機構債券	500,000,000	519,067,000	
第155回	政保道路機構債券	300,000,000	310,701,000	
第163回	政保道路機構債券	300,000,000	311,596,800	
第190回	政保道路機構債券	500,000,000	515,823,000	
第211回	政保道路機構債券	500,000,000	518,801,500	
第212回	政保道路機構債券	100,000,000	116,503,800	
第218回	政保道路機構債券	500,000,000	519,421,000	
第278回	政保道路機構債券	100,000,000	94,599,800	
第8回	政保地方公営企業等金融機構債券	124,000,000	126,364,556	
第4回	地方公営企業等金融機構債券	400,000,000	407,953,600	
第5回	地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,621,000	
第8回	地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,756,700	
第12回	政保地方公共団体金融機構債券	313,000,000	322,191,871	
第12回	地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,096,600	
第25回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,036,600	
第36回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,671,400	
第48回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,431,100	
第48回	地方公共団体金融機構債券	400,000,000	415,663,600	
第72回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,547,200	
第5回	政保阪神高速道路債券	140,000,000	143,788,400	
第35回	日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,774,100	
第56回	政保関西国際空港債券	108,000,000	111,062,880	
第37回	住宅金融支援機構債券	500,000,000	510,933,500	
第133回	住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,038,169,000	
第37回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,865,000	41,422,317	
第42回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	104,554,000	110,628,587	
第46回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	129,993,000	139,833,470	
第54回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	103,034,000	109,277,860	
第55回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	110,814,000	117,285,537	
第60回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	113,334,000	119,544,702	
第61回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,536,000	57,279,160	
第62回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	463,656,000	485,911,488	
第63回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	286,030,000	298,214,878	
第73回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	187,347,000	197,238,921	
第78回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	170,055,000	176,891,211	
第9回	私学振興債券	100,000,000	102,138,000	
第19回	沖縄振興開発金融公庫債券	300,000,000	312,388,200	
い第778号	利付農林債券	300,000,000	301,443,600	
い第779号	利付農林債券	300,000,000	301,560,900	
第300回	利付しんきん中金債券	300,000,000	301,130,700	
第4回	広島高速道路債券	200,000,000	208,161,000	
第24回	国際協力機構債券	300,000,000	309,726,600	
第98回	名古屋高速道路債券	100,000,000	102,137,000	
第45回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,759,200	
第55回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,855,900	
特殊債券 合計		13,095,218,000	13,565,701,225	
社債券	第3回	ノルデア・バンク	200,000,000	212,642,000
	第5回	スヴェンスカ・ハンデルスバンク	200,000,000	203,658,200
	第8回	オーストラリア・コモンウェルス銀行	200,000,000	200,622,200
	第16回	中日本高速道路債券	500,000,000	514,644,000
	第33回	中日本高速道路債券	300,000,000	310,946,400
	第56回	中日本高速道路債券	200,000,000	207,227,800

第20回	西日本高速道路債券	100,000,000	103,471,800	
第22回	西日本高速道路債券	300,000,000	310,590,300	
第8回	旭化成	200,000,000	204,871,000	
第14回	武田薬品	100,000,000	100,701,200	
第12回	オリエンタルランド	100,000,000	101,151,600	
第3回	富士フイルムホールディングス	300,000,000	310,548,900	
第68回	新日本製鐵	200,000,000	207,099,400	
第19回	豊田自動織機	200,000,000	207,461,000	
第24回	豊田自動織機	100,000,000	103,517,000	
第71回	伊藤忠商事	200,000,000	206,847,000	
第39回	住友商事	100,000,000	106,370,000	
第45回	住友商事	100,000,000	104,055,200	
第46回	住友商事	100,000,000	103,444,700	
第79回	三菱商事	100,000,000	103,903,800	
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	102,624,200	
第7回	みずほコーポレート銀行劣後特約付	200,000,000	206,251,200	
第127回	三菱東京UFJ銀行	200,000,000	208,368,400	
第7回	三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	207,487,800	
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	102,773,200	
第9回	三菱UFJ信託銀行劣後特約付	200,000,000	209,581,600	
第20回	三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	103,066,300	
第23回	三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	104,227,400	
第14回	みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	103,215,800	
第20回	みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	105,366,300	
第139回	オリックス	100,000,000	103,215,700	
第173回	オリックス	100,000,000	101,598,900	
第27回	三菱UFJリース	100,000,000	101,161,700	
第21回	野村ホールディングス	100,000,000	103,536,400	
第46回	三井不動産	100,000,000	103,654,900	
第111回	三菱地所	100,000,000	103,604,400	
第75回	東京急行電鉄	100,000,000	103,680,200	
第77回	東京急行電鉄	100,000,000	104,370,400	
第13回	東日本旅客鉄道	300,000,000	315,374,700	
第26回	東日本旅客鉄道	100,000,000	105,211,300	
第82回	東日本旅客鉄道	100,000,000	104,137,900	
第87回	東日本旅客鉄道	200,000,000	207,006,000	
第16回	西日本旅客鉄道	100,000,000	104,005,500	
第27回	西日本旅客鉄道	100,000,000	103,008,900	
第19回	KDDI	100,000,000	102,450,300	
第483回	関西電力	200,000,000	205,757,800	
第381回	中国電力	200,000,000	208,330,200	
第304回	北陸電力	100,000,000	104,321,100	
第306回	北陸電力	100,000,000	103,722,800	
第448回	東北電力	300,000,000	306,080,400	
第253回	四国電力	200,000,000	208,652,800	
第290回	北海道電力	200,000,000	212,517,000	
第13回	電源開発	100,000,000	112,448,900	
第31回	東京瓦斯	100,000,000	102,486,500	
第19回	大阪瓦斯	100,000,000	103,676,500	
社債券	合計	8,600,000,000	8,910,746,900	
合計		114,803,218,000	124,998,873,376	

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2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	2,506,798,630
金銭信託	25,199,972
コール・ローン	941,924,381
株式	112,897,598,099
投資証券	2,567,665,403
派生商品評価勘定	29,048,909
未収入金	28,614
未収配当金	152,728,671
差入委託証拠金	1,187,028,384
流動資産合計	120,308,021,063
資産合計	120,308,021,063
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,682,443
未払金	2,031,088,863
未払解約金	79,401,209
その他未払費用	6,700
流動負債合計	2,180,179,215
負債合計	2,180,179,215
純資産の部	
元本等	
元本	70,849,080,074
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	47,278,761,774
純資産合計	118,127,841,848
負債純資産合計	120,308,021,063

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2月21日現在)
1. 受益権総口数	70,849,080,074口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6673円 (16,673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7月14日 至 2018年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。 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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2018年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載し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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（2018年2月21日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	2,983,569,311	
投資証券	239,515,875	
合計	2,744,053,436	

（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2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	2,221,179,076	-	2,244,277,310	23,098,234
アメリカ・ドル	1,658,732,021	-	1,678,456,780	19,724,759
イギリス・ポンド	161,391,769	-	162,841,000	1,449,231
ユーロ	401,055,286	-	402,979,530	1,924,244
買 建	3,573,870,368	-	3,562,222,609	11,647,759
アメリカ・ドル	2,559,463,683	-	2,550,444,542	9,019,141
イギリス・ポンド	308,075,691	-	307,170,500	905,191
シンガポール・ドル	15,145,615	-	15,208,463	62,848
ユーロ	653,973,880	-	652,171,350	1,802,530
香港・ドル	37,211,499	-	37,227,754	16,255
合計	5,795,049,444	-	5,806,499,919	34,745,993

（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2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	2,542,378,757	-	2,536,491,218	5,887,539
合計	2,542,378,757	-	2,536,491,218	5,887,539

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	55,288,522,570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	25,443,319,702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	9,882,762,198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)	495,246,552円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,487,198,234円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,986,286,663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)	11,998,588,461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	47,177,054,577円
DCニッセイ外国株式インデックス	6,391,706,768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)	293,662,765円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	3,038,935円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	833,478円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	222,445円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	337,631円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	500,567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)	7,561,367円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	3,797,240円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	587,649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)	635,751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)	1,820,991円
計	70,849,080,074円

附属明細表(2018年2月21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	17,273	235.07	4,060,364.11	
	ABBOTT LABORATORIES	50,296	59.12	2,973,499.52	
	ABBVIE INC	46,159	117.98	5,445,838.82	
	ACCENTURE PLC	17,878	161.44	2,886,224.32	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	20,766	70.84	1,471,063.44	
	ACUITY BRANDS INC	1,197	148.81	178,125.57	
	ADOBE SYSTEMS INC	14,292	202.98	2,900,990.16	
	ADVANCE AUTO PARTS	2,092	105.35	220,392.20	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	23,295	12.02	280,005.90	
	AERCAP HOLDINGS NV	3,964	51.58	204,463.12	
	AES CORP	19,054	10.40	198,161.60	
	AETNA INC	9,602	178.03	1,709,444.06	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,614	187.30	302,302.20	
	AFLAC INC	11,404	88.92	1,014,043.68	
	AGCO CORP	1,807	66.40	119,984.80	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,298	71.08	660,901.84	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,296	162.91	1,025,681.36	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	4,967	66.77	331,646.59	
	ALBEMARLE CORP	3,197	114.58	366,312.26	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,460	118.85	767,771.00	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	2,206	255.45	563,522.70	
	ALKERMES PLC	4,439	64.75	287,425.25	
	ALLEGHANY CORP	442	589.09	260,377.78	
	ALLEGION PLC	2,726	85.66	233,509.16	
	ALLERGAN PLC	9,680	160.59	1,554,511.20	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,455	244.57	355,849.35	
	ALLIANT ENERGY CORP	6,782	39.14	265,447.48	
	ALLSTATE CORP	10,446	93.65	978,267.90	
	ALLY FINANCIAL INC	12,983	28.70	372,612.10	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,558	120.83	309,083.14	
	ALPHABET INC-CL A	8,628	1,103.59	9,521,774.52	
	ALPHABET INC-CL C	9,065	1,102.46	9,993,799.90	
	ALTRIA GROUP INC	55,521	64.19	3,563,892.99	
	AMAZON.COM INC	11,823	1,468.35	17,360,302.05	
	AMERCO	216	354.50	76,572.00	
	AMEREN CORPORATION	7,079	55.08	389,911.32	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,576	51.72	184,950.72	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	14,272	66.37	947,232.64	
	AMERICAN EXPRESS CO	21,750	97.19	2,113,882.50	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,093	111.81	234,018.33	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	26,088	60.04	1,566,323.52	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,214	79.85	416,337.90	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,333	158.76	687,907.08	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,758	99.94	475,514.52	
AMERITRADE HOLDING CORP	7,364	56.04	412,678.56	
AMETEK INC	6,668	75.72	504,900.96	
AMGEN INC	21,112	182.98	3,863,073.76	
AMPHENOL CORP-CL A	8,850	90.36	799,686.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	16,203	59.25	960,027.75	
ANALOG DEVICES INC	10,636	88.41	940,328.76	
ANDEAVOR	4,324	94.18	407,234.32	
ANSYS INC	2,450	167.81	411,134.50	
ANTERO RESOURCES CORP	6,270	18.56	116,371.20	
ANTHEM INC	7,600	232.22	1,764,872.00	
AON PLC	7,592	140.72	1,068,346.24	
APACHE CORP	10,961	38.30	419,806.30	
APPLE INC	149,560	171.85	25,701,886.00	
APPLIED MATERIALS INC	30,877	56.66	1,749,490.82	
APTIV PLC	7,732	92.34	713,972.88	
ARAMARK	7,080	41.42	293,253.60	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,786	88.71	335,856.06	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	16,243	42.57	691,464.51	
ARCONIC INC	11,515	24.86	286,262.90	
ARISTA NETWORKS INC	1,370	249.65	342,020.50	
ARROW ELECTRONICS INC	2,500	81.95	204,875.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,208	69.31	360,966.48	
ASSURANT INC	1,524	88.58	134,995.92	
AT&T INC	178,093	36.77	6,548,479.61	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	3,019	48.45	146,270.55	
ATMOS ENERGY CORP	3,113	82.07	255,483.91	
AUTODESK INC	5,731	114.27	654,881.37	
AUTOLIV INC	2,518	144.78	364,556.04	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	12,857	115.41	1,483,826.37	
AUTONATION INC	1,800	51.98	93,564.00	
AUTOZONE INC	812	713.23	579,142.76	
AVERY DENNISON CORP	2,558	117.08	299,490.64	
AVNET INC	3,474	42.23	146,707.02	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,249	30.99	193,656.51	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,300	50.80	116,840.00	
BAKER HUGHES A GE CO	11,719	26.44	309,850.36	
BALL CORP	9,717	39.21	381,003.57	
BANK OF AMERICA CORP	290,064	31.93	9,261,743.52	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,856	56.42	1,684,475.52	
BAXTER INTERNATIONAL INC	14,200	67.04	951,968.00	
BB&T CORPORATION	23,302	54.60	1,272,289.20	
BECTON DICKINSON & CO	7,659	219.82	1,683,601.38	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	36,671	203.05	7,446,046.55	
BEST BUY CO INC	7,928	71.92	570,181.76	
BIOGEN INC	6,119	287.45	1,758,906.55	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,079	83.85	425,874.15	
BLACKROCK INC	3,488	542.60	1,892,588.80	
BOEING CO	16,262	353.35	5,746,177.70	
BORGWARNER INC	6,103	52.26	318,942.78	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	39,753	26.83	1,066,572.99	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,370	57.66	136,654.20	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	47,475	67.35	3,197,441.25	
BROADCOM LTD	11,768	249.62	2,937,528.16	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,386	98.59	333,825.74	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	5,914	68.31	403,985.34	
BUNGE LIMITED	4,058	76.07	308,692.06	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,219	89.97	379,583.43	
CA Inc	9,100	35.06	319,046.00	
CABOT OIL & GAS CORP	13,377	23.92	319,977.84	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	8,108	40.17	325,698.36	
CAMPBELL SOUP CO	5,245	46.08	241,689.60	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,982	98.46	1,376,667.72	
CARDINAL HEALTH INC	9,157	68.84	630,367.88	
CARMAX INC	5,318	63.31	336,682.58	
CARNIVAL CORP	10,021	69.45	695,958.45	
CATERPILLAR INC	17,126	155.56	2,664,120.56	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,918	110.78	323,256.04	
CBRE GROUP INC	8,794	44.90	394,850.60	
CBS CORP-CL B	10,098	56.25	568,012.50	
CDK GLOBAL INC	3,688	69.06	254,693.28	
CDW CORP/DE	4,495	70.91	318,740.45	
CELANESE CORP-SERIES A	3,975	102.38	406,960.50	
CELGENE CORP	22,652	93.85	2,125,890.20	
CENTENE CORP	4,995	100.26	500,798.70	
CENTERPOINT ENERGY INC	12,000	26.73	320,760.00	
CENTURYLINK INC	27,935	18.47	515,959.45	
CERNER CORP	8,640	63.00	544,320.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,780	41.82	283,539.60	
CHARLES SCHWAB CORP	34,868	52.34	1,824,991.12	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	5,621	358.77	2,016,646.17	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	3,768	102.21	385,127.28	
CHEMOURS CO/THE - W/I	5,342	50.08	267,527.36	
CHENIERE ENERGY INC	5,906	58.03	342,725.18	
CHEVRON CORP	54,869	110.98	6,089,361.62	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	726	317.57	230,555.82	
CHUBB LTD	13,444	145.44	1,955,295.36	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,204	48.38	348,529.52	

CIGNA CORP	7,287	192.60	1,403,476.20
CIMAREX ENERGY CO	2,731	98.37	268,648.47
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,467	75.69	338,107.23
CINTAS CORP	2,595	166.65	432,456.75
CISCO SYSTEMS INC	144,848	44.06	6,382,002.88
CIT GROUP INC	3,853	53.84	207,445.52
CITIGROUP INC	78,833	76.46	6,027,571.18
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,446	46.09	665,816.14
CITRIX SYSTEMS INC	4,375	91.78	401,537.50
CLOROX CO	3,737	128.78	481,250.86
CME GROUP INC	9,810	163.35	1,602,463.50
CMS ENERGY CORP	8,290	43.36	359,454.40
COCA-COLA CO	117,282	43.99	5,159,235.18
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,346	38.51	244,384.46
COGNEX CORP	5,010	56.44	282,764.40
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	17,089	81.54	1,393,437.06
COLGATE-PALMOLIVE CO	24,243	70.03	1,697,737.29
COMCAST CORP	136,342	39.47	5,381,418.74
COMERICA INC	5,084	97.20	494,164.80
COMMSCOPE HOLDING CO INC	5,538	38.78	214,763.64
CONAGRA BRANDS INC	12,003	36.08	433,068.24
CONCHO RESOURCES INC	4,277	147.15	629,360.55
CONOCOPHILLIPS	35,137	54.84	1,926,913.08
CONSOLIDATED EDISON INC	9,005	76.36	687,621.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,979	217.33	1,082,086.07
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,639	54.73	144,432.47
COOPER COS INC/THE	1,414	230.37	325,743.18
CORNING INC	26,104	29.65	773,983.60
COSTAR GROUP INC	1,037	351.84	364,858.08
COSTCO WHOLESALE CORP	12,687	188.12	2,386,678.44
COTY INC-CL A	14,096	21.19	298,694.24
CROWN HOLDINGS INC	3,888	50.58	196,655.04
CSX CORP	26,632	54.59	1,453,840.88
CUMMINS INC	4,595	166.82	766,537.90
CVS HEALTH CORP	29,411	70.66	2,078,181.26
DANAHER CORP	18,093	96.85	1,752,307.05
DARDEN RESTAURANTS INC	3,590	94.90	340,691.00
DAVITA INC	4,446	72.77	323,535.42
DEERE & CO	7,925	164.77	1,305,802.25
DELL TECHNOLOGIES INC- CL V	5,866	69.82	409,564.12
DELTA AIR LINES INC	5,388	52.47	282,708.36
DENTSPLY SIRONA INC	6,629	58.15	385,476.35
DEVON ENERGY CORPORATION	14,409	34.65	499,271.85
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,541	122.81	312,060.21
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,776	79.63	858,092.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,102	24.31	99,719.62

DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,236	23.04	143,677.44	
DISH NETWORK CORP	6,634	44.57	295,677.38	
DOLLAR GENERAL CORP	7,897	94.56	746,740.32	
DOLLAR TREE INC	6,854	106.81	732,075.74	
DOMINION ENERGY INC	18,667	74.75	1,395,358.25	
DOMINO'S PIZZA INC	1,400	221.49	310,086.00	
DOVER CORP	4,507	100.21	451,646.47	
DOWDUPONT INC	67,522	71.62	4,835,925.64	
DR HORTON INC	10,298	45.16	465,057.68	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	5,269	116.06	611,520.14	
DTE ENERGY COMPANY	5,229	103.20	539,632.80	
DUKE ENERGY CORP	20,304	75.69	1,536,809.76	
DXC TECHNOLOGY CO	8,254	100.67	830,930.18	
E*TRADE FINANCIAL	7,925	52.01	412,179.25	
EAST WEST BANCORP INC	4,128	66.38	274,016.64	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,189	100.29	420,114.81	
EATON CORP PLC	12,846	81.71	1,049,646.66	
EATON VANCE CORP	3,277	55.84	182,987.68	
EBAY INC	29,439	43.39	1,277,358.21	
ECOLAB INC	7,552	131.72	994,749.44	
EDISON INTERNATIONAL	9,470	60.31	571,135.70	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,118	134.32	821,769.76	
ELECTRONIC ARTS INC	8,935	126.34	1,128,847.90	
ELI LILLY & CO	28,688	77.55	2,224,754.40	
EMERSON ELECTRIC CO	18,500	71.07	1,314,795.00	
ENERGY CORP	5,213	75.43	393,216.59	
ENVISION HEALTHCARE CORP	3,444	37.39	128,771.16	
EOG RESOURCES INC	16,652	107.96	1,797,749.92	
EQT CORP	7,288	51.40	374,603.20	
EQUIFAX INC	3,483	115.55	402,460.65	
ESTEE LAUDER COS INC	6,471	139.35	901,733.85	
EVEREST RE GROUP LTD	1,168	243.26	284,127.68	
EVERSOURCE ENERGY	9,227	58.17	536,734.59	
EXELON CORP	27,835	37.68	1,048,822.80	
EXPEDIA INC	3,616	104.10	376,425.60	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	5,506	61.93	340,986.58	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	16,709	76.05	1,270,719.45	
EXXON MOBIL CORP	122,637	75.75	9,289,752.75	
F5 NETWORKS INC	1,851	143.04	264,767.04	
FACEBOOK INC-A	68,656	176.01	12,084,142.56	
FASTENAL CO	8,316	54.24	451,059.84	
FEDEX CORP	7,456	240.98	1,796,746.88	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	9,639	97.32	938,067.48	
FIFTH THIRD BANCORP	21,229	33.21	705,015.09	
FIRST DATA CORP- CLASS A	12,612	15.82	199,521.84	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,559	95.29	434,427.11	
FIRSTENERGY CORP	12,936	32.80	424,300.80	
FISERV INC	6,111	141.71	865,989.81	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,662	199.45	530,935.90	
FLEX LTD	15,446	17.91	276,637.86	
FLIR SYSTEMS INC	3,903	48.82	190,544.46	
FLOWSERVE CORP	3,713	43.70	162,258.10	
FLUOR CORP	3,959	58.04	229,780.36	
FMC CORP	3,876	83.55	323,839.80	
FNF GROUP	7,455	38.38	286,122.90	
FORD MOTOR CO	107,261	10.63	1,140,184.43	
FORTINET INC	4,251	49.06	208,554.06	
FORTIVE CORP	9,038	75.85	685,532.30	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	4,448	63.83	283,915.84	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,561	38.86	371,540.46	
FREEPORT-MCMORAN INC	39,752	18.43	732,629.36	
GAP INC	6,644	31.61	210,016.84	
GARMIN LTD	3,454	64.86	224,026.44	
GARTNER INC	2,646	115.97	306,856.62	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,356	221.83	1,631,781.48	
GENERAL ELECTRIC CO	250,646	14.74	3,694,522.04	
GENERAL MILLS INC	16,689	55.95	933,749.55	
GENERAL MOTORS CO	37,949	40.77	1,547,180.73	
GENUINE PARTS CO	4,230	94.67	400,454.10	
GILEAD SCIENCES INC	37,770	80.94	3,057,103.80	
GLOBAL PAYMENTS INC	4,432	114.73	508,483.36	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,645	264.89	2,819,754.05	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	7,140	29.48	210,487.20	
H&R BLOCK INC	5,912	27.17	160,629.04	
HALLIBURTON CO	25,144	47.16	1,185,791.04	
HANESBRANDS INC	10,407	19.93	207,411.51	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,958	46.64	231,241.12	
HARRIS CORP	3,509	157.01	550,948.09	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	10,489	53.82	564,517.98	
HASBRO INC	3,260	97.77	318,730.20	
HCA HEALTHCARE INC	8,399	101.00	848,299.00	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,787	36.16	209,257.92	
HELMERICH & PAYNE	3,049	64.51	196,690.99	
HENRY SCHEIN INC	4,572	67.97	310,758.84	
HERSHEY CO/THE	4,176	99.90	417,182.40	
HESS CORP	8,252	45.84	378,271.68	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	46,799	16.52	773,119.48	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,658	84.31	477,025.98	
HOLLYFRONTIER CORP	4,829	45.98	222,037.42	
HOLOGIC INC	8,134	38.87	316,168.58	
HOME DEPOT INC	34,138	186.71	6,373,905.98	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,903	154.34	3,226,169.02	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,300	7.00	240,100.00	
HORMEL FOODS CORP	8,359	33.80	282,534.20	
HP INC	48,727	21.39	1,042,270.53	
HUMANA INC	4,183	267.33	1,118,241.39	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,366	15.90	498,719.40	

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,310	266.11	348,604.10	
IAC/INTERACTIVECORP	2,144	149.83	321,235.52	
IDEX CORP	2,217	136.83	303,352.11	
IDEX LABORATORIES INC	2,540	183.16	465,226.40	
IHS MARKIT LTD	11,544	46.60	537,950.40	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	8,963	161.34	1,446,090.42	
ILLUMINA INC	4,229	226.57	958,164.53	
INCYTE CORP	5,067	85.51	433,279.17	
INGERSOLL-RAND PLC	7,331	90.04	660,083.24	
INGREDION INC	2,068	129.25	267,289.00	
INTEL CORP	136,000	46.32	6,299,520.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	17,005	72.86	1,238,984.30	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	25,618	155.16	3,974,888.88	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	2,286	142.38	325,480.68	
INTERNATIONAL PAPER CO	11,365	58.00	659,170.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,475	24.70	283,432.50	
INTUIT INC	7,042	173.57	1,222,279.94	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,236	421.76	1,364,815.36	
INVESCO LTD	11,741	33.21	389,918.61	
IPG PHOTONICS CORP	1,070	239.09	255,826.30	
IQVIA HOLDINGS INC	4,080	100.26	409,060.80	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,240	121.01	271,062.40	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,393	62.47	211,960.71	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,300	62.59	394,317.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,500	38.08	247,520.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,742	144.78	252,206.76	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	2,646	118.20	312,757.20	
JM SMUCKER CO	3,272	123.87	405,302.64	
JOHNSON & JOHNSON	77,705	130.87	10,169,253.35	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	26,982	37.87	1,021,808.34	
JONES LANG LASALLE INC	1,283	159.44	204,561.52	
JPMORGAN CHASE & CO	101,849	114.71	11,683,098.79	
JUNIPER NETWORKS INC	11,055	26.23	289,972.65	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,149	107.35	338,045.15	
KELLOGG CO	7,497	69.68	522,390.96	
KEYCORP	31,348	20.95	656,740.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,240	114.45	1,171,968.00	
KINDER MORGAN INC	58,191	17.00	989,247.00	
KLA-TENCOR CORP	4,542	110.55	502,118.10	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,004	47.76	191,231.04	
KOHL'S CORP	4,911	64.37	316,121.07	
KRAFT HEINZ CO/THE	17,614	68.69	1,209,905.66	
KROGER CO	25,940	27.49	713,090.60	
L BRANDS INC	7,055	47.41	334,477.55	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,254	210.98	475,548.92	

LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	2,948	174.41	514,160.68	
LAM RESEARCH CORP	4,698	193.44	908,781.12	
LAS VEGAS SANDS CORP	11,420	75.04	856,956.80	
LEAR CORP	1,969	189.70	373,519.30	
LEGGETT & PLATT INC	3,744	44.37	166,121.28	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,145	66.23	274,523.35	
LENNAR CORP-CL A	5,892	59.15	348,511.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,087	203.16	220,834.92	
LEUCADIA NATIONAL CORP	9,304	25.10	233,530.40	
LIBERTY BROADBAND-C	3,127	91.12	284,932.24	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,737	32.34	185,534.58	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	16,507	31.46	519,310.22	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	12,187	27.84	339,286.08	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,553	42.02	107,277.06	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,197	41.58	216,091.26	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	5,770	35.18	202,988.60	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,373	78.03	497,285.19	
LIVE NATION INC	4,195	46.86	196,577.70	
LKQ CORP	8,963	41.46	371,605.98	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,511	358.69	2,694,120.59	
LOEWS CORP	8,255	49.89	411,841.95	
LOWE'S COS INC	24,230	95.65	2,317,599.50	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,886	80.58	232,553.88	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,722	108.59	1,055,711.98	
M&T BANK CORP	3,929	190.64	749,024.56	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	2,389	64.37	153,779.93	
MACY'S INC	8,630	25.65	221,359.50	
MANPOWER GROUP	1,922	121.76	234,022.72	
MARATHON OIL CORP	24,477	15.85	387,960.45	
MARATHON PETROLEUM CORP	14,643	66.25	970,098.75	
MARKEL CORP	405	1,108.00	448,740.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	9,150	140.44	1,285,026.00	
MARSH & MCLENNAN COS INC	14,829	83.51	1,238,369.79	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,821	214.09	389,857.89	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	11,602	23.20	269,166.40	
MASCO CORP	9,278	42.52	394,500.56	
MASTERCARD INC-CLASS A	27,349	175.35	4,795,647.15	
MATTEL INC	9,745	16.47	160,500.15	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,149	62.12	506,215.88	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,455	104.60	361,393.00	
MCDONALD'S CORP	23,440	157.16	3,683,830.40	
MCKESSON CORP	6,082	148.85	905,305.70	
MEDTRONIC PLC	39,319	81.61	3,208,823.59	

MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	7,025	28.13	197,613.25	
MERCADOLIBRE INC	1,220	375.78	458,451.60	
MERCK & CO INC	78,939	54.98	4,340,066.22	
METLIFE INC	26,086	46.89	1,223,172.54	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	745	624.22	465,043.90	
MGM MIRAGE	13,316	34.71	462,198.36	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,381	63.97	280,252.57	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,740	84.86	571,956.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	30,613	44.90	1,374,523.70	
MICROSOFT CORP	211,861	92.72	19,643,751.92	
MIDDLEBY CORP	1,634	133.72	218,498.48	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,831	247.07	452,385.17	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,464	79.75	435,754.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	43,618	43.76	1,908,723.68	
MONSANTO CO	12,725	120.31	1,530,944.75	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,517	64.60	743,998.20	
MOODY'S CORP	4,984	168.13	837,959.92	
MORGAN STANLEY	39,900	55.06	2,196,894.00	
MOSAIC CO/THE	9,633	26.76	257,779.08	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,759	105.75	503,264.25	
MSCI INC	2,629	144.38	379,575.02	
MYLAN NV	13,189	41.34	545,233.26	
NASDAQ INC	3,354	78.80	264,295.20	
NATIONAL-OILWELL INC	10,932	35.38	386,774.16	
NETAPP INC	7,802	58.08	453,140.16	
NETFLIX INC	12,504	278.55	3,482,989.20	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	13,746	14.09	193,681.14	
NEWELL BRANDS INC	14,205	27.39	389,074.95	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,647	25.73	145,297.31	
NEWMONT MINING CORP	15,288	38.39	586,906.32	
NEWS CORP - CLASS A	10,977	15.95	175,083.15	
NEXTERA ENERGY INC	13,610	153.81	2,093,354.10	
NIELSEN HOLDINGS PLC	10,333	33.11	342,125.63	
NIKE INC	37,996	67.49	2,564,350.04	
NISOURCE INC	9,624	23.02	221,544.48	
NOBLE ENERGY INC	13,308	29.12	387,528.96	
NORDSTROM INC	3,535	50.49	178,482.15	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,443	140.03	1,182,273.29	
NORTHERN TRUST CORP	6,262	104.72	655,756.64	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,786	350.36	1,676,822.96	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,264	58.95	310,312.80	
NUCOR CORP	9,226	67.56	623,308.56	
NVIDIA CORP	17,369	249.08	4,326,270.52	
NVR INC	102	3,194.63	325,852.26	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,028	125.56	1,259,115.68	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,547	252.38	642,811.86	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,055	67.99	1,499,519.45	

OGE ENERGY CORP	5,742	31.21	179,207.82	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,866	135.23	252,339.18	
OMNICOM GROUP	6,742	78.36	528,303.12	
ONEOK INC	11,005	57.02	627,505.10	
ORACLE CORP	89,800	49.89	4,480,122.00	
OWENS CORNING	3,211	87.23	280,095.53	
PACCAR INC	10,144	68.99	699,834.56	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,733	118.86	324,844.38	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,669	162.92	434,833.48	
PARKER HANNIFIN CORP	3,853	181.61	699,743.33	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,313	23.29	147,029.77	
PAYCHEX INC	9,341	65.41	610,994.81	
PAYPAL HOLDINGS INC	33,074	77.06	2,548,682.44	
PENTAIR PLC	4,985	70.59	351,891.15	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	9,472	19.62	185,840.64	
PEPSICO INC	41,271	109.48	4,518,349.08	
PERRIGO CO PLC	3,720	87.04	323,788.80	
PFIZER INC	172,132	36.01	6,198,473.32	
PG&E CORP	14,855	40.01	594,348.55	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,986	102.85	4,626,810.10	
PHILLIPS 66	12,496	90.99	1,137,011.04	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,265	77.20	252,058.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,906	178.25	874,494.50	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,052	21.96	88,981.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,840	159.13	2,202,359.20	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,693	115.43	195,422.99	
PPG INDUSTRIES INC	7,420	115.40	856,268.00	
PPL CORPORATION	19,944	30.83	614,873.52	
PRAXAIR INC	8,284	153.60	1,272,422.40	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,421	1,894.62	2,692,255.02	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,319	62.70	521,601.30	
PROCTER & GAMBLE CO	73,788	81.34	6,001,915.92	
PROGRESSIVE CORP	16,858	56.54	953,151.32	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,323	108.48	1,336,799.04	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,671	49.29	723,133.59	
PULTE GROUP INC	7,880	29.47	232,223.60	
PVH CORP	2,246	146.68	329,443.28	
QORVO INC	3,680	80.17	295,025.60	
QUALCOMM INC	42,723	63.99	2,733,844.77	
QUEST DIAGNOSTICS	3,941	102.26	403,006.66	
RALPH LAUREN CORP	1,566	105.39	165,040.74	
RANGE RESOURCES CORP	6,989	13.08	91,416.12	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,744	92.23	345,309.12	
RAYTHEON CO	8,392	216.54	1,817,203.68	
RED HAT INC	5,143	144.32	742,237.76	

REGENERON PHARMACEUTICALS	2,266	323.04	732,008.64	
REGIONS FINANCIAL CORP	34,425	19.40	667,845.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,857	155.39	288,559.23	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,131	130.89	148,036.59	
REPUBLIC SERVICES INC	6,831	64.86	443,058.66	
RESMED INC	4,116	92.83	382,088.28	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	3,556	56.32	200,273.92	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,710	184.67	685,125.70	
ROCKWELL COLLINS INC.	4,691	135.26	634,504.66	
ROLLINS INC	2,781	49.95	138,910.95	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,962	276.74	819,703.88	
ROSS STORES INC	11,245	77.98	876,885.10	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,967	131.56	653,458.52	
S&P GLOBAL INC	7,451	187.90	1,400,042.90	
SABRE CORP	5,993	23.11	138,498.23	
SALESFORCE.COM INC	19,793	114.35	2,263,329.55	
SCANA CORP	3,893	36.94	143,807.42	
SCHLUMBERGER LTD	40,250	65.61	2,640,802.50	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,485	88.16	219,077.60	
SEAGATE TECHNOLOGY	8,338	52.12	434,576.56	
SEALED AIR CORP	5,559	42.07	233,867.13	
SEATTLE GENETICS INC	2,839	54.16	153,760.24	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,872	72.73	281,610.56	
SEMPRA ENERGY	6,942	107.54	746,542.68	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,964	53.50	265,574.00	
SERVICENOW INC	4,930	156.76	772,826.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,435	396.67	965,891.45	
SIGNATURE BANK	1,550	151.08	234,174.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	48,121	6.11	294,019.31	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,311	106.41	565,143.51	
SMITH (A.O.) CORP	4,216	65.44	275,895.04	
SNAP-ON INC	1,662	160.94	267,482.28	
SOUTHERN CO	29,037	43.47	1,262,238.39	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,456	57.73	257,244.88	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	730	101.90	74,387.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	3,416	90.66	309,694.56	
SPLUNK INC	4,017	93.68	376,312.56	
SPRINT CORP	23,178	5.45	126,320.10	
SQUARE INC - A	7,289	44.93	327,494.77	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,973	50.45	250,887.85	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,427	159.21	704,822.67	
STARBUCKS CORP	41,747	55.97	2,336,579.59	
STATE STREET CORP	10,808	103.79	1,121,762.32	
STEEL DYNAMICS INC	6,925	48.86	338,355.50	
STERICYCLE INC	2,425	75.22	182,408.50	

STRYKER CORP	9,746	158.74	1,547,080.04
SUNTRUST BANKS INC	13,806	71.52	987,405.12
SVB FINANCIAL GROUP	1,517	249.41	378,354.97
SYMANTEC CORP	17,759	27.02	479,848.18
SYNCHRONY FINANCIAL	22,995	36.56	840,697.20
SYNOPSIS INC	4,332	89.76	388,840.32
SYSCO CORP	14,524	58.88	855,173.12
T ROWE PRICE GROUP INC	6,921	109.91	760,687.11
T-MOBILE US INC	8,585	60.51	519,478.35
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,064	107.48	329,318.72
TAPESTRY INC	8,176	49.41	403,976.16
TARGA RESOURCES CORP	6,234	47.75	297,673.50
TARGET CORP	14,984	72.86	1,091,734.24
TE CONNECTIVITY LTD	10,220	102.51	1,047,652.20
TECHNIPFMC PLC	12,722	29.38	373,772.36
TELEFLEX INC	1,306	269.07	351,405.42
TESARO INC	1,029	62.30	64,106.70
TESLA, INC.	3,868	334.77	1,294,890.36
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	26,420	19.98	527,871.60
TEXAS INSTRUMENTS INC	28,637	105.29	3,015,189.73
TEXTRON INC	7,646	60.06	459,218.76
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,588	207.84	2,408,449.92
TIFFANY & CO	3,593	100.70	361,815.10
TIME WARNER INC	22,572	95.07	2,145,920.04
TJX COS INC	18,396	76.37	1,404,902.52
TOLL BROTHERS INC	4,432	46.78	207,328.96
TORCHMARK CORP	3,174	86.38	274,170.12
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,812	87.01	418,692.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,653	67.22	245,554.66
TRANSDIGM GROUP INC	1,509	298.75	450,813.75
TRANSUNION	4,482	58.23	260,986.86
TRAVELERS COS INC/THE	7,943	139.07	1,104,633.01
TRIMBLE INC	7,320	38.96	285,187.20
TRIPADVISOR INC	3,199	42.65	136,437.35
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	12,928	36.61	473,294.08
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	30,387	37.13	1,128,269.31
TWITTER INC	18,169	32.84	596,669.96
TYSON FOODS INC-CL A	8,358	76.13	636,294.54
UGI CORP	5,096	43.22	220,249.12
ULTA BEAUTY INC	1,704	201.13	342,725.52
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,160	17.14	88,442.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	5,101	15.41	78,606.41
UNION PACIFIC CORP	23,328	130.23	3,038,005.44
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,222	66.59	147,962.98
UNITED PARCEL SERVICE INC	20,215	104.71	2,116,712.65
UNITED RENTALS INC	2,451	172.25	422,184.75
UNITED TECHNOLOGIES CORP	21,944	126.46	2,775,038.24

UNITED THERAPEUTICS CORP	1,220	134.96	164,651.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	27,994	226.66	6,345,120.04	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	2,557	117.18	299,629.26	
UNUM GROUP	6,474	52.34	338,849.16	
US BANCORP	48,315	54.91	2,652,976.65	
VAIL RESORTS INC	1,151	216.00	248,616.00	
VALERO ENERGY CORP	12,764	91.58	1,168,927.12	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,656	120.17	319,171.52	
VEEVA SYSTEMS INC- CLASS A	3,097	60.34	186,872.98	
VERISIGN INC	2,641	116.34	307,253.94	
VERISK ANALYTICS INC	4,535	97.04	440,076.40	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	118,426	48.92	5,793,399.92	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,301	160.98	1,175,314.98	
VF CORP	9,688	73.57	712,746.16	
VIACOM INC-CLASS B	10,246	33.98	348,159.08	
VISA INC-CLASS A SHARES	52,977	122.01	6,463,723.77	
VISTRA ENERGY CORP	7,478	18.88	141,184.64	
VMWARE INC-CLASS A	2,052	123.60	253,627.20	
VOYA FINANCIAL INC	5,159	50.44	260,219.96	
VULCAN MATERIALS CO	3,835	124.47	477,342.45	
WABCO HOLDINGS INC	1,447	140.71	203,607.37	
WABTEC CORP	2,450	80.00	196,000.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26,311	70.91	1,865,713.01	
WALMART INC	43,209	94.11	4,066,398.99	
WALT DISNEY CO	44,735	105.98	4,741,015.30	
WASTE CONNECTIONS INC	7,645	70.47	538,743.15	
WASTE MANAGEMENT INC	12,748	84.87	1,081,922.76	
WATERS CORP	2,313	203.87	471,551.31	
WEC ENERGY GROUP INC	9,193	60.90	559,853.70	
WELLS FARGO & CO	136,482	59.95	8,182,095.90	
WESTAR ENERGY INC	4,192	49.65	208,132.80	
WESTERN DIGITAL CORP	8,536	86.46	738,022.56	
WESTERN UNION CO	13,417	20.25	271,694.25	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	7,342	65.11	478,037.62	
WEYERHAEUSER CO	21,764	34.94	760,434.16	
WHIRLPOOL CORP	2,113	168.50	356,040.50	
WILLIAMS COS INC	23,949	29.09	696,676.41	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,692	159.65	589,427.80	
WORKDAY INC-CLASS A	3,880	126.02	488,957.60	
WORLDPAY INC	4,716	75.94	358,133.04	
WR BERKLEY CORP	2,725	68.73	187,289.25	
WR GRACE & CO	1,961	67.26	131,896.86	
WW GRAINGER INC	1,584	263.61	417,558.24	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,972	120.77	358,928.44	
WYNN RESORTS LTD	2,372	164.92	391,190.24	
XCEL ENERGY INC	14,791	44.12	652,578.92	
XEROX CORP	6,136	31.03	190,400.08	
XILINX INC	7,181	69.19	496,853.39	
XL GROUP LTD	7,475	43.00	321,425.00	

	XYLEM INC	5,192	74.73	387,998.16	
	YUM! BRANDS INC	9,482	78.08	740,354.56	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,504	37.23	204,913.92	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	3,019	47.42	143,160.98	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,854	118.72	694,986.88	
	ZIONS BANCORPORATION	5,790	54.97	318,276.30	
	ZOETIS INC	14,196	80.35	1,140,648.60	
アメリカ・ドル	小計	8,865,176		690,120,175.50 (74,215,523,674)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	27,687	9.17	253,945.16	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,685	18.94	107,702.32	
	ANGLO AMERICAN PLC	38,487	17.39	669,596.82	
	ANTOFAGASTA PLC	10,979	8.93	98,086.38	
	ASHTREAD GROUP PLC	14,485	20.65	299,115.25	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,305	26.51	273,185.55	
	ASTRAZENECA PLC	36,649	47.22	1,730,565.78	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	28,163	3.64	102,710.46	
	AVIVA PLC	116,467	5.00	582,800.86	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	6,780	6.46	43,812.36	
	BAE SYSTEMS PLC	92,213	5.95	549,405.05	
	BARCLAYS PLC	493,204	2.01	991,340.04	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	29,157	5.62	163,920.65	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	3,656	38.49	140,719.44	
	BHP BILLITON PLC	61,035	14.90	909,665.64	
	BP PLC	572,105	4.75	2,717,498.75	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	66,384	44.93	2,982,633.12	
	BT GROUP PLC	245,898	2.30	567,532.58	
	BUNZL PLC	9,772	20.00	195,440.00	
	BURBERRY GROUP PLC	12,489	15.60	194,890.84	
	CAPITA PLC	18,578	1.80	33,514.71	
	CARNIVAL PLC	5,407	48.70	263,320.90	
	CENTRICA PLC	162,739	1.30	212,699.87	
	COBHAM PLC	68,288	1.24	84,950.27	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	5,182	24.64	127,684.48	
	COMPASS GROUP PLC	45,698	15.52	709,232.96	
	CONVATEC GROUP PLC	38,982	2.14	83,733.33	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,755	44.66	167,698.30	
	DCC PLC	2,596	66.85	173,542.60	
	DIAGEO PLC	72,926	24.93	1,818,045.18	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	39,002	3.88	151,327.76	
	EASYJET PLC	4,666	16.75	78,178.83	
	EXPERIAN PLC	27,003	15.59	420,976.77	
	FERGUSON PLC	7,336	52.36	384,112.96	
	FRESNILLO PLC	6,249	13.40	83,767.84	
	G4S PLC	44,388	2.60	115,675.12	
	GKN PLC	48,611	4.18	203,485.64	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	142,517	13.25	1,888,350.25	
	GLENCORE PLC	353,553	3.84	1,359,057.73	

HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,396	17.02	125,916.90	
HSBC HOLDINGS PLC	581,735	7.37	4,287,386.95	
IMI PLC	7,723	12.63	97,541.49	
IMPERIAL BRANDS PLC	27,781	26.75	743,280.65	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,224	45.68	238,632.32	
INTERTEK GROUP PLC	4,689	49.73	233,183.97	
INVESTEC PLC	18,998	6.19	117,711.60	
ITV PLC	106,049	1.71	181,661.93	
JOHNSON MATTHEY PLC	5,494	31.71	174,214.74	
KINGFISHER PLC	62,807	3.61	226,984.49	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	171,964	2.57	441,947.48	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,082,584	0.67	1,411,991.95	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,047	40.05	362,332.35	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	45,871	3.00	137,796.48	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	10,399	5.88	61,146.12	
MEGGITT PLC	21,959	4.80	105,403.20	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	19,550	3.53	69,050.60	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	12,599	20.66	260,295.34	
MONDI PLC/WI	10,601	19.17	203,221.17	
MORRISON WM SUPERMARKETS	63,101	2.23	140,904.53	
NATIONAL GRID PLC	99,611	7.48	745,090.28	
NEXT PLC	4,247	49.92	212,010.24	
OLD MUTUAL PLC	142,513	2.48	354,572.34	
PEARSON PLC	23,915	6.96	166,591.89	
PERSIMMON PLC	8,924	24.65	219,976.60	
PRUDENTIAL PLC	74,873	18.44	1,380,658.12	
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,697	61.50	165,865.50	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	19,335	59.28	1,146,178.80	
RELX PLC	31,013	14.93	463,024.09	
RIO TINTO PLC	35,588	39.90	1,420,139.14	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	48,042	8.40	403,841.05	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	103,389	2.74	284,216.36	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	130,101	22.56	2,935,078.56	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	108,915	22.81	2,484,351.15	
ROYAL MAIL PLC	27,455	5.56	152,869.44	
RSA INSURANCE GROUP PLC	29,516	6.12	180,637.92	
SAGE GROUP PLC	31,399	7.02	220,672.17	
SAINSBURY (J) PLC	46,055	2.54	117,209.97	
SCHRODERS PLC	3,477	34.77	120,895.29	
SEVERN TRENT PLC	6,953	17.11	119,000.59	
SHIRE PLC	26,285	30.72	807,606.62	
SKY PLC	30,186	11.06	333,857.16	
SMITH & NEPHEW PLC	25,333	12.69	321,475.77	

	SMITHS GROUP PLC	11,241	15.96	179,406.36	
	SSE PLC	29,166	12.13	353,783.58	
	ST JAMES'S PLACE PLC	15,381	11.33	174,343.63	
	STANDARD CHARTERED PLC	95,404	8.20	782,503.60	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	77,150	3.81	294,558.70	
	TAYLOR WIMPEY PLC	94,497	1.91	180,489.27	
	TESCO PLC	237,367	2.06	490,162.85	
	TRAVIS PERKINS PLC	7,082	14.17	100,387.35	
	TUI AG-DI	12,645	15.42	195,049.12	
	UNILEVER PLC	36,558	37.44	1,368,731.52	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,073	6.64	133,365.01	
	VODAFONE GROUP PLC	777,374	2.03	1,578,069.22	
	WEIR GROUP PLC/THE	6,370	20.36	129,693.20	
	WHITBREAD PLC	5,259	39.18	206,047.62	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	19,013	6.27	119,325.58	
	WORLDPAY INC-CLASS A	3,741	54.76	204,857.16	
	WPP PLC	36,964	14.00	517,496.00	
イギリス・ポンド 小計		8,799,754		53,318,615.63 (8,029,250,328)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	1,112	168.30	187,149.60	
	BANK HAPOLIM BM	29,972	24.39	731,017.08	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	40,867	20.47	836,547.49	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	57,724	5.24	302,473.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	644	515.80	332,175.20	
	FRUTAROM	1,078	312.40	336,767.20	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	13,776	14.81	204,022.56	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,848	63.21	243,232.08	
	NICE LTD	1,707	324.30	553,580.10	
イスラエル・シュケル 小計		150,728		3,726,965.07 (114,492,366)	
オーストラリア・ ドル	AGL ENERGY LTD	20,093	22.68	455,709.24	
	ALUMINA LTD	74,197	2.32	172,137.04	
	AMCOR LTD	35,557	14.16	503,487.12	
	AMP LTD	89,619	5.37	481,254.03	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	16,424	24.23	397,953.52	
	ASX LTD	6,351	56.88	361,244.88	
	AURIZON HOLDINGS LTD	66,818	4.57	305,358.26	
	AUSNET SERVICES	73,701	1.68	123,817.68	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	86,148	27.98	2,410,421.04	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	12,681	12.37	156,863.97	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	15,066	11.14	167,835.24	
	BHP BILLITON LTD	93,865	31.30	2,937,974.50	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,390	16.00	262,240.00	
	BORAL LTD	35,486	7.77	275,726.22	
	BRAMBLES LTD	47,874	9.64	461,505.36	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,065	33.63	271,225.95	
	CHALLENGER LTD	17,714	12.33	218,413.62	
	CIMIC GROUP LIMITED	3,063	45.74	140,101.62	

	COCA-COLA AMATIL LIMITED	17,873	8.69	155,316.37	
	COCHLEAR LTD	1,799	176.20	316,983.80	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	50,704	74.26	3,765,279.04	
	COMPUTERSHARE LIMITED	14,356	17.92	257,259.52	
	CROWN RESORTS LTD	11,787	12.50	147,337.50	
	CSL LIMITED	13,244	156.00	2,066,064.00	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,856	42.50	78,880.00	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,694	48.30	81,820.20	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	45,444	5.36	243,579.84	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	17,554	4.38	76,886.52	
	HEALTHSCOPE LTD	52,703	1.88	99,345.15	
	INCITEC PIVOT LTD	51,633	3.67	189,493.11	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	72,874	7.73	563,316.02	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13,646	23.00	313,858.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	9,631	103.35	995,363.85	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	83,796	3.20	268,147.20	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,048	29.30	2,316,106.40	
	NEWCREST MINING LIMITED	22,800	22.36	509,808.00	
	OIL SEARCH LTD	42,359	7.55	319,810.45	
	ORICA LTD	11,737	18.96	222,533.52	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	52,180	9.22	481,099.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	41,118	10.53	432,972.54	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	4,400	68.69	302,236.00	
	REA GROUP LTD	1,809	78.00	141,102.00	
	RIO TINTO LTD	12,570	81.60	1,025,712.00	
	SANTOS LTD	55,039	5.18	285,102.02	
	SEEK LTD	10,406	19.68	204,790.08	
	SONIC HEALTHCARE LTD	12,341	24.08	297,171.28	
	SOUTH32 LTD	152,921	3.21	490,876.41	
	SUNCORP GROUP LTD	39,577	13.46	532,706.42	
	TABCORP HOLDINGS LTD	59,585	4.72	281,241.20	
	TELSTRA CORP LTD	129,363	3.44	445,008.72	
	TPG TELECOM LTD	12,220	6.18	75,519.60	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	22,403	17.60	394,292.80	
	WESFARMERS LIMITED	33,469	40.76	1,364,196.44	
	WESTPAC BANKING CORP	99,514	30.11	2,996,366.54	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	24,527	29.10	713,735.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,725	1.53	4,169.25	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	38,354	27.39	1,050,516.06	
	オーストラリア・ドル 小計	2,140,171		34,609,272.44 (2,936,942,859)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	6,675	52.70	351,772.50	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	12,203	62.47	762,321.41	
	ALTAGAS LTD	5,025	26.45	132,911.25	
	ARC RESOURCES LTD	9,974	12.90	128,664.60	

ATCO LTD -CL 'I'	2,315	43.24	100,100.60	
BANK OF MONTREAL	18,738	97.62	1,829,203.56	
BANK OF NOVA SCOTIA	34,641	77.10	2,670,821.10	
BARRICK GOLD CORP	33,575	16.22	544,586.50	
BCE INC	4,919	55.80	274,480.20	
BLACKBERRY LTD	14,345	15.31	219,621.95	
BOMBARDIER INC	55,244	3.92	216,556.48	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	24,531	50.80	1,246,174.80	
CAE INC	7,804	23.26	181,521.04	
CAMECO CORP	11,073	11.48	127,118.04	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	12,574	114.85	1,444,123.90	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	22,064	95.33	2,103,361.12	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	31,614	39.52	1,249,385.28	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,325	230.17	995,485.25	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,885	177.80	335,153.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,904	35.00	136,640.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,043	57.31	231,704.33	
CENOVUS ENERGY INC	30,199	9.40	283,870.60	
CGI GROUP INC	6,127	74.17	454,439.59	
CI FINANCIAL CORP	7,408	28.39	210,313.12	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	588	840.00	493,920.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	15,339	9.09	139,431.51	
DOLLARAMA INC	3,111	157.00	488,427.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	10,948	4.40	48,171.20	
EMERA INC	1,809	41.43	74,946.87	
EMPIRE CO LTD 'A'	4,854	23.35	113,340.90	
ENBRIDGE INC	47,779	43.06	2,057,363.74	
ENCANA CORP	28,226	13.75	388,107.50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	817	645.43	527,316.31	
FINNING INTERNATIONAL INC	4,829	33.59	162,206.11	
FIRST CAPITAL REALTY INC	4,671	19.70	92,018.70	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,939	20.59	410,544.01	
FORTIS INC	12,401	41.71	517,245.71	
FRANCO-NEVADA CORP	5,343	91.42	488,457.06	
GEORGE WESTON LTD	1,489	104.81	156,062.09	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,464	38.63	249,704.32	
GOLDCORP INC	24,929	16.60	413,821.40	
GREAT-WEST LIFECO INC	7,140	33.61	239,975.40	
HUSKY ENERGY INC	9,976	16.56	165,202.56	
HYDRO ONE LTD	9,057	20.89	189,200.73	
IGM FINANCIAL INC	2,458	39.12	96,156.96	
IMPERIAL OIL LTD	8,717	34.26	298,644.42	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,050	57.07	174,063.50	

INTACT FINANCIAL CORP	4,087	97.10	396,847.70	
INTER PIPELINE LTD	10,914	22.41	244,582.74	
JEAN COUTU GROUP INC- CLASS A	2,168	24.27	52,617.36	
KEYERA CORP	5,401	33.61	181,527.61	
KINROSS GOLD CORP	35,118	4.79	168,215.22	
LINAMAR CORP	1,383	70.06	96,892.98	
LOBLAW COS LTD	6,320	65.76	415,603.20	
LUNDIN MINING CORP	18,522	8.62	159,659.64	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,160	68.66	697,585.60	
MANULIFE FINANCIAL CORP	57,292	24.68	1,413,966.56	
METHANEX CORP	2,454	72.46	177,816.84	
METRO INC	6,488	39.78	258,092.64	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,834	61.69	606,659.46	
NUTRIEN LTD	18,307	56.92	1,042,034.44	
ONEX CORPORATION	2,435	90.27	219,807.45	
OPEN TEXT CORP	7,749	44.24	342,815.76	
PEMBINA PIPELINE CORP	14,677	41.28	605,866.56	
POWER CORP OF CANADA	10,405	30.01	312,254.05	
POWER FINANCIAL CORP	5,649	32.98	186,304.02	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,106	29.04	177,318.24	
RESTAURANT BRANDS INTERN	6,523	74.90	488,572.70	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	10,853	57.68	626,001.04	
ROYAL BANK OF CANADA	42,178	100.49	4,238,467.22	
SAPUTO INC	6,106	40.83	249,307.98	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	6,920	15.69	108,574.80	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12,578	25.26	317,720.28	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,356	180.68	425,682.08	
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,051	53.17	268,561.67	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,803	53.75	956,911.25	
SUNCOR ENERGY INC	48,062	43.84	2,107,038.08	
TECK RESOURCES LTD-CL B	16,441	36.64	602,398.24	
THOMSON REUTERS CORP	8,361	50.28	420,391.08	
TORONTO-DOMINION BANK	53,359	72.49	3,867,993.91	
TOURMALINE OIL CORP	6,499	19.30	125,430.70	
TRANSCANADA CORP	25,356	56.89	1,442,502.84	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	28,315	3.58	101,367.70	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	9,409	23.48	220,923.32	
VERMILION ENERGY INC	3,284	42.51	139,602.84	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,940	86.80	168,392.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,706	24.43	310,407.58	
カナダ・ドル 小計	1,158,708		49,157,373.60 (4,179,851,477)	
シンガポール・ ドル				
CAPITALAND LTD	73,600	3.56	262,016.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	11,300	12.51	141,363.00	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	65,200	2.04	133,008.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	51,800	28.66	1,484,588.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	171,700	1.29	221,493.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	193,400	0.35	68,657.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,900	37.90	109,910.00	
	KEPPEL CORP LTD	42,200	8.09	341,398.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	90,800	12.83	1,164,964.00	
	SATS LTD	22,800	5.18	118,104.00	
	SEBICORP INDUSTRIES LTD	27,700	3.28	90,856.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,200	11.20	192,640.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,900	7.54	172,666.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	46,400	2.65	122,960.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	43,900	3.36	147,504.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	242,800	3.38	820,664.00	
	STARHUB LTD	20,600	2.58	53,148.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	38,500	27.22	1,047,970.00	
	UOL Group Limited	13,500	8.33	112,455.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,400	3.05	135,420.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	61,700	1.45	89,465.00	
シンガポール・ドル	小計	1,305,300		7,031,249.00 (573,468,669)	
スイス・フラン	ABB LTD	53,313	23.74	1,265,650.62	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,683	75.24	352,348.92	
	BALOISE HOLDING AG	1,370	149.60	204,952.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	63	1,895.00	119,385.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	30	5,640.00	169,200.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	67,500.00	202,500.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	15,129	84.82	1,283,241.78	
	CLARIANT AG	6,634	23.82	158,021.88	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	70,186	17.55	1,231,764.30	
	DUFREY AG-REG	1,003	138.05	138,464.15	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	236	625.50	147,618.00	
	GEBERIT AG-REG	1,076	428.30	460,850.80	
	GIVAUDAN-REG	268	2,156.00	577,808.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,512	61.74	402,050.88	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,711	164.30	281,117.30	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	13,175	55.34	729,104.50	
	LONZA GROUP AG	2,162	246.90	533,797.80	
	NESTLE SA	90,079	75.20	6,773,940.80	
	NOVARTIS AG	64,384	80.46	5,180,336.64	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,136	82.15	93,322.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	503	683.50	343,800.50	
	ROCHE HOLDING AG	20,342	223.90	4,554,573.80	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	602	219.20	131,958.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,150	225.00	258,750.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	155	2,408.00	373,240.00	
	SIKA AG-BEARER	61	7,755.00	473,055.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,523	145.25	221,215.75	
	STRAUMANN HOLDING AG	295	664.50	196,027.50	
	SWATCH GROUP AG	912	410.60	374,467.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	930	342.60	318,618.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,072	88.25	182,854.00	
	SWISS RE AG	9,033	96.38	870,600.54	
	SWISSCOM AG	784	510.40	400,153.60	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,480	78.35	115,958.00	
	UBS GROUP AG	106,031	17.98	1,906,967.53	
	VIFOR PHARMA AG	1,390	135.10	187,789.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,369	310.80	1,357,885.20	
スイス・フラン	小計	484,785		32,573,389.79 (3,743,333,954)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	8,468	201.70	1,707,995.60	
	ASSA ABLOY AB	29,205	180.80	5,280,264.00	
	ATLAS COPCO AB	11,300	314.00	3,548,200.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,543	353.60	6,910,404.80	
	BOLIDEN AB	7,841	287.70	2,255,855.70	
	ELECTROLUX AB	6,917	266.00	1,839,922.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	17,663	226.00	3,991,838.00	
	GETINGE AB-B SHS	6,499	102.00	662,898.00	
	HENNES & MAURITZ AB	27,522	140.90	3,877,849.80	
	HEXAGON AB-B SHS	7,594	488.80	3,711,947.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,206	87.70	1,070,466.20	
	ICA GRUPPEN AB	2,249	298.20	670,651.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,722	201.50	951,483.00	
	INVESTOR AB	13,203	368.20	4,861,344.60	
	KINNEVIK AB - B	6,627	292.30	1,937,072.10	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,087	621.50	675,570.50	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,525	191.60	1,058,590.00	
	NORDEA BANK AB	88,278	94.72	8,361,692.16	
	SANDVIK AB	32,898	150.80	4,961,018.40	
	SECURITAS AB	9,095	141.30	1,285,123.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,479	98.40	4,376,733.60	
	SKANSKA AB-B SHS	9,689	162.95	1,578,822.55	
	SKF AB	11,057	174.95	1,934,422.15	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	44,681	116.30	5,196,400.30	
	SWEDBANK AB - A SHARES	26,440	206.40	5,457,216.00	
	SWEDISH MATCH AB	5,312	336.80	1,789,081.60	
	TELE2 AB	11,084	97.84	1,084,458.56	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	89,504	54.74	4,899,448.96	
	TELIA CO AB	78,504	37.45	2,939,974.80	
	VOLVO AB	45,262	158.20	7,160,448.40	
スウェーデン・クローナ	小計	684,454		96,037,194.28 (1,275,373,941)	

デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	98	10,030.00	982,940.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	201	10,565.00	2,123,565.00	
	CARLSBERG AS-B	3,090	729.60	2,254,464.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,899	517.60	1,500,522.40	
	COLOPLAST-B	3,435	518.80	1,782,078.00	
	DANSKE BANK A/S	21,706	245.00	5,317,970.00	
	DSV A/S	5,671	482.00	2,733,422.00	
	GENMAB A/S	1,685	1,050.00	1,769,250.00	
	H LUNDBECK A/S	1,937	321.10	621,970.70	
	ISS A/S	4,757	222.10	1,056,529.70	
	NOVO-NORDISK A/S	53,968	309.55	16,705,794.40	
	NOVOZYMES A/S	6,537	321.10	2,099,030.70	
	ORSTED A/S	5,486	366.10	2,008,424.60	
	PANDORA A/S	3,101	622.00	1,928,822.00	
	TDC A/S	23,875	49.35	1,178,231.25	
	TRYGVESTA AS	3,043	145.10	441,539.30	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,227	447.00	2,783,469.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	3,249	195.10	633,879.90		
デンマーク・クローネ 小計		150,965		47,921,902.95 (853,489,092)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,521	6.50	191,886.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,237	12.98	210,756.26	
	FLETCHER BUILDING LTD	19,315	6.86	132,500.90	
	MERCURY NZ LTD	20,019	3.27	65,462.13	
	MERIDIAN ENERGY LTD	35,135	2.84	99,959.07	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,300	10.58	119,554.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	54,863	3.45	189,551.66	
ニュージーランド・ドル 小計		186,390		1,009,670.52 (79,743,777)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	28,307	156.30	4,424,384.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,569	143.90	801,379.10	
	MARINE HARVEST	11,835	150.50	1,781,167.50	
	NORSK HYDRO ASA	38,531	56.26	2,167,754.06	
	ORKLA ASA	23,648	84.56	1,999,674.88	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,543	201.50	512,414.50	
	STATOIL ASA	33,336	177.70	5,923,807.20	
	TELENOR ASA	22,051	176.50	3,892,001.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,139	353.20	1,815,094.80	
ノルウェー・クローネ 小計		170,959		23,317,677.64 (319,918,536)	
ユーロ	1 AND 1 DRILLISCH AG	1,615	64.50	104,167.50	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	20,912	19.40	405,692.80	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	12,215	25.27	308,673.05	
	ACCOR	5,383	45.45	244,657.35	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,927	29.13	201,783.51	
	ADIDAS AG	5,456	181.80	991,900.80	
	ADP	955	164.50	157,097.50	
	AEGON NV	50,656	5.62	284,686.72	
	AENA SME SA	2,062	166.90	344,147.80	
	AGEAS	5,396	41.85	225,822.60	

AIB GROUP PLC	23,462	5.32	124,817.84
AIR LIQUIDE	12,381	102.10	1,264,100.10
AIRBUS SE	16,849	96.99	1,634,184.51
AKZO NOBEL NV	7,287	78.98	575,527.26
ALLIANZ SE	12,983	191.74	2,489,360.42
ALSTOM RGPT	4,386	33.64	147,545.04
ALTICE NV - A-W/I	15,420	7.84	120,892.80
AMADEUS IT GROUP SA	12,683	59.50	754,638.50
AMUNDI SA	1,717	69.28	118,953.76
ANDRITZ AG	2,072	48.46	100,409.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	22,089	85.40	1,886,400.60
ARCELORMITTAL	19,190	28.83	553,343.65
ARKEMA	1,978	102.45	202,646.10
ASML HOLDING NV	11,248	159.25	1,791,244.00
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	36,076	15.42	556,472.30
ATLANTIA SPA	13,712	25.68	352,124.16
ATOS SE	2,743	121.75	333,960.25
AXA	55,961	25.40	1,421,409.40
AXEL SPRINGER SE	1,433	72.90	104,465.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	192,627	7.02	1,353,397.30
BANCO DE SABADELL SA	153,867	1.82	280,961.14
BANCO SANTANDER SA	467,298	5.67	2,653,785.34
BANK OF IRELAND GROUP PLC	26,730	7.77	207,692.10
BANKIA SA	28,368	3.98	113,159.95
BANKINTER SA	18,779	8.91	167,320.89
BASF SE	26,550	87.09	2,312,239.50
BAYER AG	23,931	98.54	2,358,160.74
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,582	86.63	830,088.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,550	74.35	115,242.50
BEIERSDORF AG	2,883	91.56	263,967.48
BIOMERIEUX	1,161	71.00	82,431.00
BNP PARIBAS	32,479	65.08	2,113,733.32
BOLLORE	27,683	4.58	126,898.87
BOSKALIS WESTMINSTER	2,481	31.19	77,382.39
BOUYGUES	6,207	42.69	264,976.83
BRENTAG AG	4,453	52.18	232,357.54
BUREAU VERITAS SA	7,680	21.72	166,809.60
CAIXABANK	103,615	4.04	419,433.52
CAPGEMINI SA	4,655	103.60	482,258.00
CARREFOUR SA	16,774	19.25	322,899.50
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,537	46.01	70,717.37
CIE DE SAINT-GOBAIN	14,589	44.26	645,709.14
CNH INDUSTRIAL NV	29,804	11.67	347,812.68
CNP ASSURANCES	4,952	19.92	98,643.84
COLRUYT NV	1,598	44.35	70,871.30
COMMERZBANK AG	30,791	12.96	399,112.94
CONTINENTAL AG	3,176	227.80	723,492.80
COVESTRO AG	3,505	93.52	327,787.60
CREDIT AGRICOLE SA	32,990	13.86	457,406.35
CRH PLC	24,557	28.38	696,927.66
DAIMLER AG	27,854	70.38	1,960,364.52
DANONE	17,507	64.51	1,129,376.57

DASSAULT AVIATION SA	70	1,387.00	97,090.00
DASSAULT SYSTEMES SA	3,779	103.50	391,126.50
DAVIDE CAMPARI -MILANO SPA	16,702	6.23	104,053.46
DEUTSCHE BANK AG	49,686	13.34	663,208.72
DEUTSCHE BOERSE AG	5,563	104.85	583,280.55
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	6,949	27.12	188,456.88
DEUTSCHE POST AG	28,500	37.37	1,065,045.00
DEUTSCHE TELEKOM AG	97,381	13.24	1,289,811.34
DEUTSCHE WOHNEN SE	10,264	33.82	347,128.48
E.ON SE	63,806	8.23	525,378.60
EDENRED	6,393	27.40	175,168.20
EDF	16,439	10.43	171,458.77
EIFFAGE	2,182	92.20	201,180.40
ELISA OYJ	4,348	35.15	152,832.20
ENAGAS SA	6,334	20.51	129,910.34
ENDESA SA	8,950	17.29	154,745.50
ENEL SPA	236,234	4.77	1,126,836.18
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	69,309	2.70	187,411.53
ENGIE	52,986	12.61	668,418.39
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	73,352	13.70	1,005,509.21
ERSTE GROUP BANK AG	8,743	38.83	339,490.69
ESSILOR INTERNATIONA	6,016	109.15	656,646.40
EURAZEO	1,244	79.95	99,457.80
EUROFINS SCIENTIFIC	321	486.20	156,070.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	5,066	18.80	95,266.13
EVONIK INDUSTRIES AG	4,570	30.51	139,430.70
EXOR NV	3,095	60.58	187,495.10
FAURECIA	2,167	69.26	150,086.42
FERRARI NV	3,577	104.50	373,796.50
FERROVIAL S.A.	14,260	17.64	251,617.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	31,154	18.04	562,018.16
FORTUM OYJ	12,905	17.91	231,193.07
FRAPORT AG	1,330	89.80	119,434.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	6,236	86.24	537,792.64
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,044	63.30	762,385.20
FUCHS PETROLUB AG -PFD	1,888	45.68	86,243.84
GALP ENERGIA SGPS SA	14,415	14.67	211,540.12
GAS NATURAL SDG SA	9,931	18.34	182,134.54
GEA GROUP AG	5,268	38.43	202,449.24
GETLINK SE - REGR	14,471	10.63	153,899.08
GRIFOLS SA	8,611	23.87	205,544.57
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,287	92.50	211,547.50
HANNOVER RUECK SE	1,656	111.30	184,312.80
HEIDELBERGCEMENT AG	4,303	83.52	359,386.56
HEINEKEN HOLDING NV	3,351	80.90	271,095.90
HEINEKEN NV	7,494	85.00	636,990.00
HENKEL AG & CO KGAA	3,024	97.30	294,235.20
HENKEL KGAA-VORZUG	5,113	106.70	545,557.10
HERMES INTERNATIONAL	924	439.10	405,728.40
HOCHTIEF AG	534	138.10	73,745.40
HUGO BOSS AG	1,797	72.22	129,779.34
IBERDROLA SA	164,517	6.15	1,011,779.55

ILIAD SA	795	198.00	157,410.00
IMERYS SA	1,001	85.20	85,285.20
INDITEX SA	31,489	27.33	860,594.37
INFINEON TECHNOLOGIES AG	32,834	22.43	736,466.62
ING GROEP NV-CVA	112,259	14.71	1,651,329.89
INGENICO GROUP	1,692	92.62	156,713.04
INNOGY SE	4,028	30.47	122,733.16
INTESA SANPAOLO	412,666	3.08	1,274,725.27
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	18,335	6.99	128,308.33
IPSEN	1,080	120.15	129,762.00
JC DECAUX SA	2,167	33.02	71,554.34
JERONIMO MARTINS	7,074	17.62	124,643.88
K+S AG	5,461	22.22	121,343.42
KBC GROEP NV	7,223	72.76	525,545.48
KERING	2,199	390.20	858,049.80
KERRY GROUP PLC-A	4,695	81.80	384,051.00
KION GROUP AG	2,022	71.42	144,411.24
KONE OYJ	9,737	45.00	438,165.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	36,986	17.65	652,802.90
KONINKLIJKE DSM NV	5,245	84.14	441,314.30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	27,217	31.22	849,850.82
L'OREAL SA	7,288	175.60	1,279,772.80
LAGARDERE S.C.A.	3,492	24.80	86,601.60
LANXESS	2,602	68.12	177,248.24
LEGRAND SA	7,711	63.50	489,648.50
LEONARDO SPA	11,536	9.07	104,723.80
LINDE AG - TENDER	5,327	184.25	981,499.75
LUXOTTICA GROUP SPA	4,957	49.55	245,619.35
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	8,082	245.10	1,980,898.20
MAN SE	979	94.80	92,809.20
MAPFRE SA	28,800	2.77	79,776.00
MEDIOBANCA SPA	16,404	9.87	161,973.09
MERCK KGAA	3,729	83.52	311,446.08
METRO AG	4,922	16.40	80,720.80
METSO OYJ	3,220	26.61	85,684.20
MICHELIN (C.G.D.E.)	4,958	126.30	626,195.40
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	1,498	141.50	211,967.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	4,456	184.15	820,572.40
NATIXIS	26,900	7.06	189,967.80
NESTE OYJ	3,603	58.78	211,784.34
NN GROUP NV	8,742	36.26	316,984.92
NOKIA OYJ	169,181	4.66	788,721.82
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,299	37.65	124,207.35
OMV AG	4,250	48.18	204,765.00
ORANGE S.A.	58,688	13.67	802,558.40
ORION OYJ-CLASS B	2,880	27.38	78,854.40
OSRAM LICHT AG	2,874	68.62	197,213.88
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,362	95.35	225,216.70
PERNOD-RICARD	6,149	133.00	817,817.00
PEUGEOT SA	16,992	17.90	304,156.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	4,419	69.20	305,794.80

POSTE ITALIANE SPA	14,971	6.78	101,503.38
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	6,826	31.20	212,971.20
PROXIMUS	4,608	25.85	119,116.80
PRYSMIAN SPA	5,881	26.70	157,022.70
PUBLICIS GROUPE	6,051	61.50	372,136.50
QIAGEN NV	6,151	27.68	170,259.68
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	4,208	31.44	132,299.52
RANDSTAD HOLDINGS NV	3,352	58.96	197,633.92
RECORDATI SPA	3,014	30.02	90,480.28
RED ELECTRICA DE ESPANA	12,588	15.98	201,219.18
RELX NV	27,980	17.01	476,079.70
REMY COINTREAU	633	107.70	68,174.10
RENAULT SA	5,546	86.90	481,947.40
REPSOL SA	34,900	14.12	492,788.00
REXEL SA	8,624	14.83	127,893.92
ROYAL KPN NV	102,777	2.59	266,706.31
RTL GROUP	1,104	70.30	77,611.20
RWE AG	15,061	16.47	248,054.67
SAFRAN SA	9,646	89.86	866,789.56
SAMPO OYJ	12,856	47.15	606,160.40
SANOFI	32,895	64.55	2,123,372.25
SAP SE	28,430	84.50	2,402,335.00
SCHAEFFLER AG	4,598	13.43	61,751.14
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,393	72.52	1,188,820.36
SCOR REGROUPE	4,861	35.89	174,461.29
SEB SA	665	164.70	109,525.50
SIEMENS AG	22,122	112.42	2,486,955.24
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	6,484	12.83	83,222.14
SNAM SPA	66,439	3.62	241,107.13
SOCIETE BIC SA	789	83.90	66,197.10
SOCIETE GENERALE	22,159	46.25	1,024,964.54
SODEXO	2,605	99.30	258,676.50
SOLVAY SA	2,135	113.90	243,176.50
STMICROELECTRONICS NV	18,493	18.45	341,288.31
STORA ENSO OYJ	15,932	14.35	228,703.86
SUEZ	10,819	10.86	117,548.43
SYMRISE AG	3,577	66.34	237,298.18
TELECOM ITALIA SPA	454,410	0.71	326,266.38
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	21,994	4.04	89,009.71
TELEFONICA SA	132,142	7.65	1,011,414.86
TELENET GROUP HOLDING NV	1,625	56.40	91,650.00
TELEPERFORMANCE	1,690	119.90	202,631.00
TENARIS SA	13,317	13.70	182,509.48
TERNA SPA	41,847	4.53	189,734.29
THALES SA	3,070	92.12	282,808.40
THYSSENKRUPP AG	12,634	22.88	289,065.92
TOTAL SA	68,706	46.60	3,201,699.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,816	68.20	123,851.20
UCB SA	3,661	66.56	243,676.16
UMICORE	5,479	46.10	252,581.90
UNICREDIT SPA	58,013	17.56	1,019,172.38
UNILEVER NV	47,148	43.43	2,047,637.64
UNIPER SE	5,552	24.65	136,856.80

	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	26,744	2.02	54,236.83	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,592	55.96	201,008.32	
	UPM-KYMMENE OYJ	15,373	28.11	432,135.03	
	VALEO SA	6,952	60.58	421,152.16	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,078	19.35	272,479.69	
	VINCI SA	14,620	82.78	1,210,243.60	
	VIVENDI SA	30,113	21.30	641,406.90	
	VOESTALPINE AG	3,247	46.38	150,595.86	
	VOLKSWAGEN AG	888	166.50	147,852.00	
	VOLKSWAGEN AG	5,392	163.40	881,052.80	
	VONOVIA SE	14,031	37.33	523,777.23	
	VOPAK	1,903	38.73	73,703.19	
	WARTSILA OYJ	4,273	59.22	253,047.06	
	WENDEL	835	141.70	118,319.50	
	WIRECARD AG	3,403	99.88	339,891.64	
	WOLTERS KLUWER NV	8,734	40.36	352,504.24	
	ZALANDO SE	3,175	47.52	150,876.00	
ユーロ	小計	5,592,134		113,802,103.52 (15,098,125,075)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	350,075	63.25	22,142,243.75	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,800	110.50	861,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	35,400	33.30	1,178,820.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	108,039	38.90	4,202,717.10	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	74,909	68.00	5,093,812.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	78,409	97.85	7,672,320.65	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	20,500	65.10	1,334,550.00	
	CLP HOLDINGS LTD	48,643	76.65	3,728,485.95	
	FIRST PACIFIC CO	66,000	5.20	343,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	66,810	68.00	4,543,080.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	28,000	26.50	742,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,157	18.38	1,050,545.66	
	HANG SENG BANK LTD	22,412	189.20	4,240,350.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	36,217	49.85	1,805,417.45	
	HONG KONG & CHINA GAS	249,346	15.12	3,770,111.52	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34,011	277.80	9,448,255.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	43.50	739,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	19,000	35.00	665,000.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	114,000	5.02	572,280.00	
	LI & FUNG LTD	171,278	3.91	669,696.98	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	26,400	23.40	617,760.00	
	MINTH GROUP LTD	20,000	43.65	873,000.00	
	MTR CORP	48,255	41.25	1,990,518.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,669	11.56	2,007,613.64	
	NWS HOLDINGS LTD	45,000	14.52	653,400.00	
	PCCW LTD	140,000	4.45	623,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	41,087	65.65	2,697,361.55	
	SANDS CHINA LTD	70,980	45.10	3,201,198.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	34,000	17.04	579,360.00	

SINO LAND CO	90,000	13.60	1,224,000.00	
SJM HOLDINGS LTD	53,000	7.61	403,330.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	43,023	126.80	5,455,316.40	
SWIRE PACIFIC LTD	15,366	75.30	1,157,059.80	
SWIRE PROPERTIES LTD	34,400	26.55	913,320.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40,000	48.75	1,950,000.00	
WH GROUP LTD	258,000	9.05	2,334,900.00	
WHARF HOLDINGS LTD	35,733	29.05	1,038,043.65	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	36,733	50.55	1,856,853.15	
WHEELLOCK & CO LTD	22,000	56.60	1,245,200.00	
WYNN MACAU LTD	44,503	27.70	1,232,733.10	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,500	33.35	717,025.00	
香港・ドル 小計	2,898,655		107,575,280.30 (1,478,084,351)	
合計	32,588,179		112,897,598,099 (112,897,598,099)	

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	10,503.00	197,771.49	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,709.00	327,707.73	
		AMERICAN TOWER REIT INC	12,453.00	1,733,955.72	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	32,685.00	338,943.45	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,008.00	642,963.36	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,472.00	533,912.08	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8,759.00	137,078.35	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,690.00	219,773.00	
		COLONY NORTHSTAR INC- CLASS A	14,792.00	122,034.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	11,780.00	1,278,954.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,940.00	591,505.20	
		DUKE REALTY CORP	10,274.00	261,678.78	
		EQUINIX INC	2,257.00	894,765.08	
		EQUITY RESIDENTIAL	10,633.00	612,886.12	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,910.00	430,590.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	3,666.00	296,029.50	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,094.00	239,888.64	
		GGP INC	17,904.00	387,084.48	
		HCP INC	13,582.00	304,915.90	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	21,414.00	417,787.14	
		INVITATION HOMES INC	8,976.00	190,829.76	
		IRON MOUNTAIN INC	7,285.00	233,994.20	
		KIMCO REALTY CORP	12,084.00	184,281.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	4,197.00	166,159.23			
MACERICH CO/THE	3,489.00	207,176.82			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,289.00	290,254.25	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,240.00	158,915.20	
	PROLOGIS INC	15,407.00	943,370.61	
	PUBLIC STORAGE	4,529.00	843,797.99	
	REALTY INCOME CORP	7,942.00	392,334.80	
	REGENCY CENTERS CORP	4,440.00	257,786.40	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	3,507.00	595,208.04	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	9,016.00	1,402,799.44	
	SL GREEN REALTY CORP	2,874.00	276,622.50	
	UDR INC	7,836.00	268,304.64	
	VENTAS INC	10,322.00	518,886.94	
	VEREIT	27,459.00	187,819.56	
	VORNADO REALTY TRUST	4,967.00	334,229.43	
	WELLTOWER INC	10,672.00	584,825.60	
アメリカ・ドル 小計		347,056.00	18,007,821.43 (1,936,561,117)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	28,047.00	181,632.37	
	HAMMERSON PLC	22,610.00	105,317.38	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,390.00	200,745.15	
	SEGRO PLC	28,362.00	164,726.49	
イギリス・ポンド 小計		100,409.00	652,421.39 (98,248,137)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	32,572.00	303,245.32	
	GOODMAN GROUP	55,934.00	462,574.18	
	GPT GROUP	58,614.00	279,002.64	
	MIRVAC GROUP	117,895.00	247,579.50	
	SCENTRE GROUP	162,077.00	619,134.14	
	STOCKLAND	77,433.00	310,506.33	
	VICINITY CENTRES	107,796.00	269,490.00	
	WESTFIELD CORP	60,341.00	517,725.78	
オーストラリア・ドル 小計		672,662.00	3,009,257.89 (255,365,624)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	4,016.00	81,444.48	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,583.00	109,258.72	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,896.00	56,861.04	
カナダ・ドル 小計		10,495.00	247,564.24 (21,050,387)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	71,000.00	185,310.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	69,400.00	122,144.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	70,500.00	141,000.00	
	SUNTEC REIT	73,500.00	141,855.00	
シンガポール・ドル 小計		284,400.00	590,309.00 (48,145,602)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	983.00	85,422.70	
	GECINA SA	1,371.00	209,488.80	
	ICADE	956.00	78,248.60	
	KLEPIERRE	6,372.00	214,545.24	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,893.00	545,619.80	
ユーロ 小計		12,575.00	1,133,325.14 (150,358,246)	

	香港・ドル	LINK REIT	64,871.00	4,216,615.00	
	香港・ドル	小計	64,871.00	4,216,615.00 (57,936,290)	
投資証券	合計			2,567,665,403 (2,567,665,403)	
合計				2,567,665,403 (2,567,665,403)	

(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 602銘柄 投資証券 39銘柄	62.83% -	-% 1.64%	65.95%
イギリス・ポンド	株式 99銘柄 投資証券 4銘柄	6.80% -	-% 0.08%	7.04%
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄 投資証券 8銘柄	2.49% -	-% 0.22%	2.76%
カナダ・ドル	株式 87銘柄 投資証券 3銘柄	3.54% -	-% 0.02%	3.64%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 4銘柄	0.49% -	-% 0.04%	0.54%
スイス・フラン	株式 37銘柄	3.17%	-%	3.24%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.08%	-%	1.10%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.72%	-%	0.74%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.07%	-%	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.27%	-%	0.28%
ユーロ	株式 235銘柄 投資証券 5銘柄	12.78% -	-% 0.13%	13.21%
香港・ドル	株式 41銘柄 投資証券 1銘柄	1.25% -	-% 0.05%	1.33%

(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2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	29,864,159
金銭信託	1,839,635
コール・ローン	68,761,857
国債証券	14,591,334,799
派生商品評価勘定	59
未収利息	101,509,998
前払費用	14,079,326
流動資産合計	14,807,389,833
資産合計	14,807,389,833
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,280
未払金	28,320,985
未払解約金	31,467,602
その他未払費用	340
流動負債合計	59,927,207
負債合計	59,927,207
純資産の部	
元本等	
元本	11,229,834,925
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	3,517,627,701
純資産合計	14,747,462,626
負債純資産合計	14,807,389,833

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2月21日現在)
1. 受益権総口数	11,229,834,925口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3132円 (13,132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7月14日 至 2018年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	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。
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。 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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2018年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載し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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（2018年2月21日現在）	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	313,104,263	
合計	313,104,263	

（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2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	59,270,345	-	59,132,124	138,221
アメリカ・ドル	45,005,524	-	44,867,341	138,183
イギリス・ポンド	1,471,622	-	1,471,681	59
ユーロ	12,793,199	-	12,793,102	97
合計	59,270,345	-	59,132,124	138,221

（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)

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

項目	(2018年2月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	9,112,345,322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	4,476,739,533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	2,359,249,930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)	1,210,082,327円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,277,494,458円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	807,934,874円
ニッセイ外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	786,831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	6,209,806,473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)	386,305,633円
DCニッセイ外国債券インデックス	316,272,279円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	1,283,694円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	5,103,614円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	95,027円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	145,249円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	261,567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)	9,923,633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)	2,037,267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)	2,301,999円
計	11,229,834,925円

附属明細表(2018年2月21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	70,000.00	84,959.70	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	40,000.00	48,707.60	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	110,000.00	138,754.00	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	50,000.00	61,603.50	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	60,000.00	73,542.00	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	80,000.00	101,831.20	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	40,000.00	51,204.40	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/06/15	690,000.00	678,539.10	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	1,090,000.00	1,069,900.40	
		US TREASURY N/B 1 2019/03/15	820,000.00	810,545.40	
		US TREASURY N/B 1 2019/09/30	850,000.00	833,926.50	

US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	1,060,000.00	1,043,061.20	
US TREASURY N/B 1.375 2019/12/15	830,000.00	817,350.80	
US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	910,000.00	894,784.80	
US TREASURY N/B 1.375 2020/02/29	630,000.00	618,678.90	
US TREASURY N/B 1.375 2020/03/31	660,000.00	647,598.60	
US TREASURY N/B 1.375 2020/08/31	700,000.00	683,291.00	
US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	1,140,000.00	1,106,199.00	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	360,000.00	336,304.80	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	320,000.00	297,635.20	
US TREASURY N/B 1.5 2020/05/31	620,000.00	608,685.00	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	320,000.00	302,172.80	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	510,000.00	456,429.60	
US TREASURY N/B 1.625 2019/03/31	850,000.00	845,444.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/06/30	710,000.00	704,895.10	
US TREASURY N/B 1.625 2019/08/31	820,000.00	813,013.60	
US TREASURY N/B 1.625 2019/12/31	830,000.00	820,562.90	
US TREASURY N/B 1.625 2020/06/30	600,000.00	590,178.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	1,150,000.00	1,102,022.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	1,200,000.00	1,146,420.00	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	490,000.00	446,184.20	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	500,000.00	453,750.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	670,000.00	648,432.70	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	1,030,000.00	995,598.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	580,000.00	557,907.80	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	720,000.00	687,009.60	
US TREASURY N/B 1.875 2020/12/15	780,000.00	769,119.00	
US TREASURY N/B 2 2020/09/30	640,000.00	634,048.00	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	1,160,000.00	1,138,064.40	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	1,080,000.00	1,057,125.60	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	1,010,000.00	978,871.80	

US TREASURY N/B 2 2024/06/30	310,000.00	295,709.00	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	520,000.00	492,596.00	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	510,000.00	480,812.70	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	500,000.00	465,000.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	660,000.00	652,291.20	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	1,070,000.00	1,056,325.40	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	700,000.00	690,235.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	710,000.00	698,767.80	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	560,000.00	548,996.00	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	620,000.00	605,175.80	
US TREASURY N/B 2.125 2024/03/31	300,000.00	289,113.00	
US TREASURY N/B 2.125 2024/09/30	320,000.00	306,787.20	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	520,000.00	495,783.60	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	670,000.00	666,020.20	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	320,000.00	311,398.40	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	870,000.00	839,680.50	
US TREASURY N/B 2.25 2024/12/31	300,000.00	289,392.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	520,000.00	497,837.60	
US TREASURY N/B 2.25 2027/02/15	510,000.00	483,260.70	
US TREASURY N/B 2.25 2027/08/15	500,000.00	472,440.00	
US TREASURY N/B 2.25 2027/11/15	480,000.00	452,904.00	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	310,000.00	257,129.50	
US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	710,000.00	709,439.10	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	890,000.00	867,465.20	
US TREASURY N/B 2.375 2027/05/15	500,000.00	478,300.00	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	720,000.00	712,317.60	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	860,000.00	846,257.20	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	340,000.00	299,489.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	320,000.00	280,822.40	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	310,000.00	271,804.90	

US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	950,000.00	956,118.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	1,120,000.00	1,126,865.60	
US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	770,000.00	774,897.20	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	760,000.00	760,919.60	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	730,000.00	729,737.20	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	180,000.00	168,249.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	230,000.00	214,725.70	
US TREASURY N/B 2.75 2047/08/15	320,000.00	294,748.80	
US TREASURY N/B 2.75 2047/11/15	290,000.00	267,206.00	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	340,000.00	324,193.40	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	320,000.00	303,449.60	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	310,000.00	293,275.50	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	130,000.00	127,237.50	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	330,000.00	321,000.90	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	320,000.00	311,110.40	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	330,000.00	320,562.00	
US TREASURY N/B 3 2047/02/15	310,000.00	300,625.60	
US TREASURY N/B 3 2047/05/15	320,000.00	310,147.20	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	860,000.00	870,044.80	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	970,000.00	989,400.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	110,000.00	110,059.40	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	140,000.00	140,064.40	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	220,000.00	219,535.80	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	320,000.00	318,649.60	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	340,000.00	353,810.80	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	950,000.00	974,491.00	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	90,000.00	95,986.80	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	260,000.00	281,936.20	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	350,000.00	379,760.50	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	340,000.00	376,281.40	

	US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	130,000.00	146,285.10	
	US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	100,000.00	118,304.00	
	US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	140,000.00	166,135.20	
	US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	50,000.00	59,917.50	
	US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	110,000.00	132,446.60	
	US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	110,000.00	132,807.40	
	US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	70,000.00	85,320.20	
	US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	100,000.00	122,328.00	
	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	170,000.00	211,661.90	
	US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	160,000.00	203,155.20	
	US TREASURY N/B 5 2037/05/15	60,000.00	77,181.60	
	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	60,000.00	80,338.80	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	120,000.00	132,674.40	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	160,000.00	192,942.40	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	110,000.00	132,996.60	
	アメリカ・ドル 小計	57,870,000.00	56,977,488.60 (6,127,359,124)	
イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	120,000.00	125,692.80	
	TSY 3 3/4% 2020 3.75 2020/09/07	150,000.00	161,145.00	
	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	120,000.00	131,928.00	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	150,000.00	156,094.50	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	170,000.00	233,505.20	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	150,000.00	224,284.50	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	170,000.00	231,035.10	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	130,000.00	195,011.70	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	110,000.00	136,609.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	120,000.00	156,753.60	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	110,000.00	154,398.20	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	130,000.00	184,561.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	140,000.00	232,696.80	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	140,000.00	151,482.80	

	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	110,000.00	147,613.40	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	100,000.00	112,061.00	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	120,000.00	198,720.00	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	120,000.00	177,864.00	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	130,000.00	162,089.20	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	100,000.00	123,075.00	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	80,000.00	114,584.00	
	UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	200,000.00	203,724.00	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	150,000.00	150,385.50	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	160,000.00	143,704.00	
	UK TSY 1 1/4% 2027 1.25 2027/07/22	190,000.00	184,355.10	
	UK TSY 1 3/4% 2019 1.75 2019/07/22	250,000.00	253,847.50	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	180,000.00	185,607.00	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	70,000.00	68,964.70	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	130,000.00	137,475.00	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	120,000.00	131,053.20	
	UK TSY 2% 2020 2 2020/07/22	210,000.00	216,102.60	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	160,000.00	167,342.40	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	140,000.00	222,346.60	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	190,000.00	238,691.30	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	130,000.00	191,545.90	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	180,000.00	236,840.40	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	110,000.00	170,867.40	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	210,000.00	205,109.10	
	UNITED KINGDOM GILT 0.75 2023/07/22	140,000.00	136,731.00	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	90,000.00	87,120.00	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	140,000.00	174,022.80	
	イギリス・ポンド 小計	5,820,000.00	7,017,040.30 (1,056,696,099)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2020/11/21	210,000.00	207,807.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2 2021/12/21	60,000.00	59,335.20	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2022/11/21	50,000.00	49,570.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	170,000.00	160,216.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2019/10/21	180,000.00	182,359.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	210,000.00	211,619.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	210,000.00	207,721.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2028/11/21	170,000.00	167,295.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2029/11/21	70,000.00	68,349.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	50,000.00	46,743.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	90,000.00	81,703.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	210,000.00	217,154.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	160,000.00	164,710.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	50,000.00	49,133.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	100,000.00	106,475.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	250,000.00	276,455.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2020/04/15	230,000.00	241,810.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	110,000.00	128,302.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	240,000.00	276,559.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	140,000.00	144,995.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	180,000.00	206,220.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	300,000.00	332,997.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	210,000.00	239,618.40	
	オーストラリア・ドル 小計	3,650,000.00	3,827,153.60 (324,772,254)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	40,000.00	43,451.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2019/02/01	30,000.00	29,693.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	120,000.00	112,918.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2019/05/01	40,000.00	39,570.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2019/08/01	80,000.00	78,868.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2020/09/01	210,000.00	204,115.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	170,000.00	164,055.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	110,000.00	105,384.40	

	CANADIAN GOVERNMENT 1 2022/09/01	120,000.00	114,414.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	130,000.00	115,700.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2019/11/01	110,000.00	109,049.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2020/02/01	110,000.00	108,795.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2020/03/01	180,000.00	178,826.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	120,000.00	116,227.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	100,000.00	94,043.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/03/01	160,000.00	160,212.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/09/01	210,000.00	209,972.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2023/03/01	90,000.00	88,411.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2 2028/06/01	50,000.00	48,394.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	110,000.00	110,007.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	100,000.00	101,732.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	110,000.00	113,129.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	110,000.00	116,545.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	90,000.00	93,612.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2020/06/01	100,000.00	103,600.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	130,000.00	156,130.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	200,000.00	205,136.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	120,000.00	151,815.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	110,000.00	152,329.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	90,000.00	119,925.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	90,000.00	127,919.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	30,000.00	44,138.70	
	カナダ・ドル 小計	3,570,000.00	3,718,126.50 (316,152,296)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 1.625 2019/10/01	50,000.00	50,025.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	20,000.00	19,730.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	80,000.00	81,104.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2036/08/01	10,000.00	9,301.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	20,000.00	20,120.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT 2.5 2019/06/01	60,000.00	60,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	50,000.00	51,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	40,000.00	39,620.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	20,000.00	19,682.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	10,000.00	10,363.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	40,000.00	41,320.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	50,000.00	52,325.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	60,000.00	63,030.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25 2020/09/01	50,000.00	51,865.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	50,000.00	54,522.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	50,000.00	54,607.50	
シンガポール・ドル	小計	660,000.00	680,005.80 (55,461,273)	
スイス・フラン	SWITZERLAND 2.25 2020/07/06	160,000.00	171,961.60	
	SWITZERLAND 4 2023/02/11	40,000.00	48,858.00	
スイス・フラン	小計	200,000.00	220,819.60 (25,376,588)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 2028/05/12	330,000.00	325,574.70	
	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	520,000.00	533,332.80	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	660,000.00	706,464.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	520,000.00	594,266.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	770,000.00	886,832.10	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	360,000.00	485,179.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25 2019/03/12	750,000.00	789,982.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	800,000.00	921,080.00	
スウェーデン・クローナ	小計	4,710,000.00	5,242,711.70 (69,623,211)	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2020/11/15	260,000.00	264,318.60	
	KINGDOM OF DENMARK 0.5 2027/11/15	420,000.00	408,366.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	400,000.00	428,176.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	660,000.00	720,766.20	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	660,000.00	737,332.20	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	570,000.00	615,240.90	

	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,040,000.00	1,679,901.60	
デンマーク・クローネ 小計		4,010,000.00	4,854,101.50 (86,451,548)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	320,000.00	313,078.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	290,000.00	290,794.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2027/02/17	240,000.00	237,076.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	550,000.00	565,570.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	420,000.00	454,784.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	610,000.00	661,685.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	650,000.00	681,343.00	
ノルウェー・クローネ 小計		3,080,000.00	3,204,333.00 (43,963,449)	
ポーランド・ズロ チ	POLAND GOVERNMENT BOND 0 2019/04/25	170,000.00	167,314.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.5 2020/04/25	120,000.00	119,592.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	350,000.00	329,542.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	230,000.00	213,348.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2019/07/25	60,000.00	61,498.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	180,000.00	180,531.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	330,000.00	349,684.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2020/10/25	280,000.00	304,752.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	260,000.00	277,019.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	540,000.00	605,556.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	350,000.00	398,055.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	70,000.00	85,620.50	
	ポーランド・ズロチ 小計		2,940,000.00	3,092,513.90 (98,867,669)
マレーシア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	240,000.00	236,575.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	140,000.00	137,793.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	80,000.00	77,516.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.759 2019/03/15	50,000.00	50,325.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	60,000.00	55,771.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.889 2020/07/31	230,000.00	232,493.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	200,000.00	194,766.00	

	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	60,000.00	59,176.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	90,000.00	89,550.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	30,000.00	28,646.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	280,000.00	286,036.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	170,000.00	172,040.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	120,000.00	116,880.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	70,000.00	67,270.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.378 2019/11/29	200,000.00	203,568.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	120,000.00	121,809.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	70,000.00	70,130.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	50,000.00	48,904.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.762 2037/04/07	70,000.00	71,204.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	100,000.00	101,779.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248 2028/09/15	60,000.00	64,402.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.734 2019/07/30	50,000.00	51,801.00	
	マレーシア・リンギット 小計	2,540,000.00	2,538,440.10 (69,883,256)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	2,090,000.00	2,347,613.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	700,000.00	846,601.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5 2019/12/11	1,730,000.00	1,652,720.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	1,240,000.00	1,095,589.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	2,450,000.00	2,368,317.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	2,050,000.00	1,963,428.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	1,260,000.00	1,241,364.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	1,050,000.00	1,045,296.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	640,000.00	634,905.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	1,580,000.00	1,556,552.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	2,360,000.00	2,378,266.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	710,000.00	720,770.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2047/11/07	400,000.00	403,712.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	840,000.00	886,225.20	

	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	780,000.00	829,483.20	
メキシコ・ペソ 小計		19,880,000.00	19,970,846.90 (114,832,370)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	40,000.00	39,830.40	
	BELGIUM KINGDOM 0.5 2024/10/22	50,000.00	50,013.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	130,000.00	131,911.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	100,000.00	99,185.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2028/06/22	40,000.00	39,122.80	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	130,000.00	132,589.60	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	80,000.00	77,696.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.45 2037/06/22	20,000.00	19,781.60	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	70,000.00	67,137.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	50,000.00	53,036.50	
	BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	20,000.00	20,835.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	110,000.00	122,089.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2057/06/22	20,000.00	21,703.40	
	BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	120,000.00	136,383.60	
	BELGIUM KINGDOM 3 2019/09/28	100,000.00	105,600.00	
	BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	60,000.00	74,173.80	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	150,000.00	166,038.00	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	80,000.00	116,048.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2019/03/28	100,000.00	105,024.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	110,000.00	128,403.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	60,000.00	81,762.60	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	140,000.00	162,272.60	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	130,000.00	155,197.90	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	140,000.00	212,655.80	
	BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	80,000.00	104,365.60	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	160,000.00	249,035.20	
	BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	150,000.00	216,987.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.05 2021/01/31	80,000.00	80,068.80		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2019/01/31	140,000.00	140,861.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	160,000.00	160,561.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.45 2022/10/31	80,000.00	80,143.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	160,000.00	163,644.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	160,000.00	164,873.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	180,000.00	179,317.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2020/01/31	180,000.00	185,621.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.45 2027/10/31	180,000.00	178,812.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.5 2027/04/30	140,000.00	140,775.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	160,000.00	166,686.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	160,000.00	168,596.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	160,000.00	162,184.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	170,000.00	182,637.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.35 2033/07/30	60,000.00	61,989.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2019/04/30	180,000.00	186,696.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	180,000.00	201,832.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	130,000.00	137,216.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	60,000.00	68,056.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	170,000.00	200,856.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	180,000.00	196,360.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	160,000.00	208,376.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	160,000.00	172,409.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	160,000.00	193,612.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.6 2019/07/30	170,000.00	182,102.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	170,000.00	213,834.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	140,000.00	197,057.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	140,000.00	173,269.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.85 2020/10/31	140,000.00	158,506.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	130,000.00	186,431.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	140,000.00	188,312.60	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	100,000.00	149,992.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	180,000.00	223,246.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	200,000.00	234,650.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	170,000.00	251,970.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	180,000.00	219,738.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	150,000.00	205,381.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	200,000.00	287,052.00	
BUNDES OBLIGATION 0 2020/04/17	150,000.00	151,654.50	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/04/09	170,000.00	171,842.80	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/10/08	170,000.00	171,451.80	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/04/08	140,000.00	140,778.40	
BUNDES OBLIGATION 0 2022/10/07	120,000.00	120,180.00	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2019/10/11	140,000.00	141,964.20	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2020/10/16	150,000.00	152,773.50	
BUNDES OBLIGATION 0.5 2019/04/12	120,000.00	121,610.40	
BUNDES OBLIGATION 1 2019/02/22	140,000.00	142,371.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	200,000.00	190,794.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	210,000.00	203,353.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	180,000.00	181,697.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	200,000.00	200,152.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2027/08/15	210,000.00	206,543.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2028/02/15	30,000.00	29,346.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	160,000.00	167,273.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	180,000.00	187,642.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.25 2048/08/15	40,000.00	38,576.80	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	340,000.00	364,218.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	140,000.00	150,281.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	140,000.00	150,362.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	140,000.00	150,761.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	230,000.00	250,987.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	150,000.00	162,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	160,000.00	176,305.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2020/09/04	60,000.00	64,156.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	150,000.00	162,558.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	170,000.00	213,543.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	180,000.00	228,211.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3 2020/07/04	270,000.00	292,482.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	160,000.00	171,536.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	260,000.00	291,202.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	120,000.00	168,916.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	190,000.00	200,809.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	180,000.00	267,033.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	120,000.00	188,436.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	150,000.00	233,004.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	130,000.00	219,226.80	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	70,000.00	112,924.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/03/15	90,000.00	90,650.70	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/06/14	90,000.00	90,769.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/09/13	100,000.00	100,961.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2019/12/13	100,000.00	101,053.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2019/10/15	120,000.00	120,494.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.1 2019/04/15	180,000.00	180,916.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	150,000.00	150,805.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2020/11/01	130,000.00	131,888.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	120,000.00	117,016.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	260,000.00	264,147.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	120,000.00	120,126.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.05 2019/12/01	120,000.00	122,572.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	140,000.00	132,533.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	460,000.00	473,381.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	250,000.00	257,712.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2019/08/01	130,000.00	133,348.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	160,000.00	158,772.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	140,000.00	137,449.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	170,000.00	153,635.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.85 2024/05/15	110,000.00	113,494.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	140,000.00	142,647.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05 2027/08/01	120,000.00	119,913.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	240,000.00	255,050.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.2 2027/06/01	140,000.00	142,165.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	120,000.00	111,603.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	100,000.00	97,977.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2019/05/01	130,000.00	134,378.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	250,000.00	266,585.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	120,000.00	111,714.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	40,000.00	35,590.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.95 2038/09/01	70,000.00	70,650.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	120,000.00	124,405.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.45 2048/03/01	60,000.00	63,488.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	180,000.00	200,907.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	190,000.00	210,280.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	140,000.00	155,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	430,000.00	479,798.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	170,000.00	194,896.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	260,000.00	285,771.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	220,000.00	260,055.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	210,000.00	219,187.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	170,000.00	181,656.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2020/03/01	190,000.00	206,744.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2019/03/01	90,000.00	94,468.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2020/02/01	180,000.00	196,160.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	160,000.00	188,576.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	190,000.00	225,607.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	180,000.00	216,862.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	190,000.00	227,498.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	180,000.00	222,759.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	140,000.00	182,256.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	200,000.00	246,202.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	200,000.00	262,588.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	180,000.00	239,560.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	180,000.00	238,469.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	220,000.00	286,125.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	160,000.00	193,912.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	170,000.00	206,691.10	

BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	150,000.00	208,825.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	240,000.00	336,007.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	230,000.00	320,095.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	90,000.00	129,081.60	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	90,000.00	125,973.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	150,000.00	233,901.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	110,000.00	161,584.50	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	80,000.00	122,579.20	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	30,000.00	29,546.40	
FINNISH GOVERNMENT 0.375 2020/09/15	40,000.00	40,735.20	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	50,000.00	49,387.50	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2027/09/15	30,000.00	29,073.30	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	30,000.00	28,718.10	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	30,000.00	30,666.60	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	50,000.00	53,385.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	70,000.00	75,061.70	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	40,000.00	43,980.80	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	40,000.00	50,566.80	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	40,000.00	47,470.80	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	60,000.00	64,903.20	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	50,000.00	55,861.50	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	40,000.00	49,996.00	
FINNISH GOVERNMENT 4.375 2019/07/04	40,000.00	42,716.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2019/02/25	130,000.00	130,786.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/02/25	220,000.00	221,969.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/05/25	180,000.00	181,634.40	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/02/25	30,000.00	30,199.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	200,000.00	201,212.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2022/05/25	200,000.00	199,840.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2023/03/25	100,000.00	99,007.00	

FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	180,000.00	182,664.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	230,000.00	219,525.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2019/11/25	200,000.00	203,578.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	270,000.00	269,076.60	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	220,000.00	216,418.40	
FRANCE (GOVT OF) 0.75 2028/05/25	100,000.00	97,605.00	
FRANCE (GOVT OF) 1 2019/05/25	130,000.00	132,594.80	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	220,000.00	226,153.40	
FRANCE (GOVT OF) 1 2027/05/25	250,000.00	252,987.50	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	190,000.00	182,698.30	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	280,000.00	288,932.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	380,000.00	411,008.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	290,000.00	314,745.70	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2039/06/25	80,000.00	82,315.20	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	50,000.00	46,638.50	
FRANCE (GOVT OF) 2 2048/05/25	140,000.00	145,404.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	250,000.00	275,305.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	270,000.00	301,214.70	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2020/10/25	300,000.00	322,782.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	260,000.00	299,912.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	300,000.00	351,519.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	350,000.00	394,296.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	310,000.00	348,585.70	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	200,000.00	265,316.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	310,000.00	336,585.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	290,000.00	356,033.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2019/10/25	380,000.00	407,447.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	310,000.00	349,348.30	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	210,000.00	302,402.10	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	110,000.00	172,055.40	

FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	110,000.00	176,229.90	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	260,000.00	274,830.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	370,000.00	453,512.70	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	260,000.00	406,049.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	210,000.00	318,786.30	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	250,000.00	368,040.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	260,000.00	416,806.00	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	220,000.00	309,914.00	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	50,000.00	51,562.00	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	90,000.00	90,899.10	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	40,000.00	40,166.80	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	60,000.00	61,900.80	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	80,000.00	89,918.40	
IRISH TSY 2022 0 2022/10/18	30,000.00	29,739.90	
IRISH TSY 2028 0.9 2028/05/15	30,000.00	29,241.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	60,000.00	70,552.80	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	50,000.00	59,225.50	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	90,000.00	128,751.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	120,000.00	120,548.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2024/01/15	60,000.00	58,942.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2020/01/15	120,000.00	121,837.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	120,000.00	117,595.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	120,000.00	118,509.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.75 2027/07/15	120,000.00	119,631.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	130,000.00	141,009.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	120,000.00	132,460.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	130,000.00	143,135.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	110,000.00	131,093.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	110,000.00	145,272.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	130,000.00	145,540.20	

NETHERLANDS GOVERNMENT 3.5 2020/07/15	120,000.00	131,470.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	110,000.00	129,827.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	120,000.00	180,187.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	120,000.00	127,796.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	120,000.00	177,210.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	100,000.00	144,952.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0 2022/09/20	30,000.00	29,949.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.25 2019/10/18	50,000.00	50,643.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.5 2027/04/20	60,000.00	58,212.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	90,000.00	90,033.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	80,000.00	83,674.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	30,000.00	29,399.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2086/11/02	20,000.00	17,266.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	80,000.00	86,378.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	130,000.00	140,856.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.95 2019/06/18	70,000.00	72,312.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 2.1 2117/09/20	30,000.00	31,295.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	50,000.00	58,181.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	50,000.00	68,182.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	80,000.00	92,627.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	130,000.00	146,968.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	80,000.00	92,216.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	30,000.00	49,533.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.9 2020/07/15	110,000.00	121,277.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	110,000.00	162,347.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	90,000.00	94,681.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	60,000.00	80,221.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	80,000.00	119,808.80	
TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	90,000.00	99,609.30	
TREASURY 4.4% 2019 4.4 2019/06/18	30,000.00	31,969.80	

	TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	60,000.00	68,611.80	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	90,000.00	119,271.60	
	TREASURY 5.9% 2019 5.9 2019/10/18	70,000.00	77,457.10	
ユーロ 小計		40,370,000.00	46,018,710.50 (6,105,302,322)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	1,580,000.00	1,816,368.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	790,000.00	602,098.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	710,000.00	534,026.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	450,000.00	446,805.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	820,000.00	716,688.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	390,000.00	393,783.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	640,000.00	649,254.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	840,000.00	807,189.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	680,000.00	653,786.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	790,000.00	752,672.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	760,000.00	731,272.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	1,420,000.00	1,367,815.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	610,000.00	606,218.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	460,000.00	455,648.40	
南アフリカ・ランド 小計		10,940,000.00	10,533,625.10 (96,593,342)	
国債証券 合計			14,591,334,799 (14,591,334,799)	
合計			14,591,334,799 (14,591,334,799)	

(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 116銘柄	41.55%	41.99%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	7.17%	7.24%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	2.20%	2.23%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	2.14%	2.17%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.38%	0.38%
スイス・フラン	国債証券 2銘柄	0.17%	0.17%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.47%	0.48%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.59%	0.59%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.30%	0.30%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.67%	0.68%
マレーシア・リングギット	国債証券 22銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.78%	0.79%

ユーロ	国債証券	285銘柄	41.40%	41.84%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	0.65%	0.66%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」 (2018年2月28日現在)

資産総額	31,459,256円
負債総額	40,211円
純資産総額(-)	31,419,045円
発行済数量	31,209,575口
1口当たり純資産額(/)	1.0067円

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】

<訂正前>

(1) 資本金の額

2017年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

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。

<訂正後>

(1) 資本金の額

2018年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「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。

2017年3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	325	53,152
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	57	10,829
単位型公社債投資信託	3	112
合計	385	64,093

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。

<訂正後>

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

2018年2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	348	53,212
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	75	17,552
単位型公社債投資信託	2	81
合計	425	70,846

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】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第22期事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第23期事業年度に係る中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2016年3月31日)		当事業年度 (2017年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		9,619,679		20,957,403
有価証券		7,602,477		6,499,770
前払費用		390,202		511,014
未収委託者報酬		3,426,935		3,687,850
未収運用受託報酬		1,649,081		1,656,206
未収投資助言報酬		208,775		91,351
繰延税金資産		480,820		327,435
その他		19,980		11,984
流動資産合計		23,397,951		33,743,017
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	80,574	1	71,578
車両	1	294	1	0
器具備品	1	114,079	1	92,090
有形固定資産合計		194,948		163,668
無形固定資産				
ソフトウェア		742,019		765,393
ソフトウェア仮勘定		88,417		166,377
その他		8,043		8,013
無形固定資産合計		838,479		939,784
投資その他の資産				
投資有価証券		35,476,609		29,600,256
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		171,056
差入保証金		285,819		285,884
繰延税金資産		170,956		280,043
その他		793		10,177
投資その他の資産合計		36,000,401		30,413,641
固定資産合計		37,033,830		31,517,095
資産合計		60,431,781		65,260,112

負債の部

流動負債

預り金	34,054	34,889
未払収益分配金	1,531	2,498
未払償還金	118,764	27,718
未払手数料	1,204,424	1,269,371
未払運用委託報酬	746,912	659,099
未払投資助言報酬	624,770	566,198
その他未払金	447,074	356,756
未払費用	110,997	104,560
未払法人税等	2,793,014	1,272,113
賞与引当金	864,968	746,320
その他	505,003	217,295
流動負債合計	7,451,515	5,256,823

固定負債

退職給付引当金	1,404,058	1,519,642
役員退職慰労引当金	26,800	15,750
固定負債合計	1,430,858	1,535,392
負債合計	8,882,374	6,792,216

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	31,277,901	38,693,404
利益剰余金合計	31,957,708	39,373,211
株主資本合計	50,239,548	57,655,051

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,309,858	812,844
評価・換算差額等合計	1,309,858	812,844

純資産合計

純資産合計	51,549,407	58,467,896
-------	------------	------------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	60,431,781	65,260,112
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2015年4月1日 至 2016年3月31日)		当事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		23,796,732		24,865,689
運用受託報酬		10,253,108		9,257,111
投資助言報酬		887,392		511,448
営業収益計		34,937,233		34,634,249
営業費用				
支払手数料		10,915,789		11,232,556
広告宣伝費		59,346		25,920
調査費		5,358,400		5,110,928
支払運用委託報酬		2,043,036		1,719,103
支払投資助言報酬		2,189,966		2,287,929
委託調査費		90,937		85,290
調査費		1,034,460		1,018,604
委託計算費		189,969		204,532
営業雑経費		712,706		776,544
通信費		47,397		49,069
印刷費		207,694		191,262
協会費		22,682		26,975
その他営業雑経費		434,931		509,237
営業費用計		17,236,212		17,350,482
一般管理費				
役員報酬	1	69,958	1	80,235
給料・手当		2,984,319		3,191,860
賞与引当金繰入額		864,968		745,410
賞与		245,495		244,745
福利厚生費		581,952		611,979
退職給付費用		298,054		241,990
役員退職慰労引当金繰入額		7,450		7,350
役員退職慰労金		100		630
その他人件費		134,593		128,730
不動産賃借料		544,913		623,115
その他不動産経費		25,766		25,985
交際費		24,568		28,549
旅費交通費		114,715		146,828
固定資産減価償却費		401,740		378,339
租税公課		183,280		280,494
業務委託費		225,301		206,740
器具備品費		173,657		245,657
保険料		57,047		56,210
諸経費		146,268		163,433
一般管理費計		7,084,153		7,408,286
営業利益		10,616,866		9,875,480
営業外収益				
受取利息		747		170
有価証券利息		66,047		50,483
受取配当金		214,632		138,431
為替差益		-		15,249
時効成立償還金		18,330		91,045

その他営業外収益		13,850		10,670
営業外収益計		313,608		306,050
営業外費用				
為替差損		18,136		-
控除対象外消費税		10,447		14,608
その他営業外費用		499		96
営業外費用計		29,083		14,704
経常利益		10,901,391		10,166,826
特別利益				
投資有価証券売却益		100,523		624,481
投資有価証券償還益		17,323		195,321
事故受取保険金	4	5,609		-
特別利益計		123,456		819,803
特別損失				
投資有価証券売却損		726		2,615
投資有価証券償還損		-		16,134
投資有価証券評価損		-		129,060
固定資産除却損	3	6,419	3	1,787
事故損失賠償金		-	2	6,119
特別損失計		7,145		155,717
税引前当期純利益		11,017,702		10,830,912
法人税、住民税及び事業税		3,740,258		3,013,428
法人税等調整額		137,203		274,628
法人税等合計		3,603,055		3,288,057
当期純利益		7,414,647		7,542,855

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2015年4月1日 至2016年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				株主資本合計	
		資本準備金	資本剰余金合計		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
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,087
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,560
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

当事業年度(自2016年4月1日 至2017年3月31日)

(単位：千円)

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017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．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>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。</p>

（会計方針の変更）

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日。以下「回収可能性適用指針」という。）を当期から適用し、繰延税金資産の回収可能性に関する会計処理の方法の一部を見直しております。

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当期の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3) から に該当する定めを適用した場合の繰延税金資産の額と、前期末の繰延税金資産の額との差額を、当期の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

この結果、当期の期首において、繰延税金資産（投資その他の資産）が8,207千円、繰越利益剰余金が8,207千円増加しております。

当期の期首の純資産に影響額が反映されたことにより、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は8,207千円増加しております。

（2016年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当期に適用し、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当期の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ187千円増加しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書の表示方法の変更）

前期において、「営業外収益」の「その他営業外収益」に含めていた「時効成立償還金」は、重要性が増したため、当期より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他営業外収益」に表示していた32,180千円は、「時効成立償還金」18,330千円、「その他営業外収益」13,850千円として組み替えております。

(貸借対照表関係)

	前事業年度 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
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。		
建物附属設備	287,659千円	301,414千円
車両	6,720	7,014
器具備品	453,566	450,664
計	747,946	759,093

(損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	40,000千円	
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。		
3. 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 2015年4月 1日 至 2016年3月31日)	当事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)
器具備品	6,419千円	1,787千円
4. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。		

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2015年4月1日 至2016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

2015年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2015年3月31日
効力発生日	2015年6月25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

2016年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2016年3月31日
効力発生日	2016年6月24日

当事業年度(自2016年4月1日 至2017年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2016年6月24日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	2016年3月31日
効力発生日	2016年6月24日

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

2017年6月23日開催の定時株主総会において、次のとおり決議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	5,278,000千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

(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。

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(2016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	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
その他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

当事業年度(2017年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

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。

(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 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

非上場株式については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2016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	9,619,679	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	7,600,000	22,100,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2017年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	20,957,403	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,500,000	15,600,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	1,543,642	10,698,606	1,611,564	1,136
合計	29,001,045	26,298,606	1,611,564	1,136

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(2016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	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

当事業年度(2017年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	22,112,787	22,246,030	133,242
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	22,112,787	22,246,030	133,242
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		22,112,787	22,246,030	133,242

2. その他有価証券

前事業年度（2016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	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
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）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
	合計	13,290,620	11,398,606	1,892,014

当事業年度（2017年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,850,740	5,806,313	44,426
	国債・地方債等	5,850,740	5,806,313	44,426
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	5,152,625	3,951,939	1,200,685
	小計	11,003,365	9,758,253	1,245,112
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	2,916,373	2,988,610	72,236
	小計	2,916,373	2,988,610	72,236
	合計	13,919,739	12,746,863	1,172,876

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自2015年4月1日 至2016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	2,120,246	100,523	726
合計	2,120,246	100,523	726

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,520,915	624,481	2,615
合計	1,520,915	624,481	2,615

4．減損処理を行った有価証券

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

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

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自2015年4月1日 至2016年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 220,314 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、46,819千円であります。

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 167,807 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、50,618千円であります。

(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 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	266,903 千円	230,314 千円
未払事業税	179,194	63,109
その他	34,722	34,011
繰延税金資産合計	480,820	327,435
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	430,318	465,488
税務上の繰延資産償却超過額	2,980	3,415
役員退職慰労引当金	8,207	4,822
投資有価証券評価損	36,550	39,827
投資有価証券評価差額	39,867	22,140
その他	2,207	3,623
小計	520,132	539,318
評価性引当額	8,246	10
繰延税金資産合計	511,885	539,308
繰延税金負債		
特別分配金否認	68,623	34,979
投資有価証券評価差額	272,306	224,285
繰延税金負債合計	340,929	259,265
繰延税金資産(は負債)の純額	170,956	280,043

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2016年3月31日)	当事業年度 (2017年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06 %	法定実効税率 (調整) 30.86 %
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.07	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.06
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.15	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.06
住民税均等割	0.05	住民税均等割 0.05
税率変更に伴う影響	0.71	税率変更に伴う影響 0.01
特定外国子会社留保金課税	0.16	特定外国子会社留保金課税 0.11
所得拡大促進税制による特別控除額	0.35	所得拡大促進税制による特別控除額 0.64
評価性引当額の増加	0.76	外国税額控除 0.02
外国税額控除	0.08	その他 0.02
その他	0.00	税効果会計適用後の法人税等の負担率 30.36
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.70	

(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2015年4月1日 至2016年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	4,199,085

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[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2015年4月1日 至2016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	200,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,566,369	未収運用受託報酬	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

当事業年度（自2016年4月1日 至2017年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	150,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,036,007	未収運用受託報酬	715,220
								投資助言報酬の受取	218,363	未収投資助言報酬	11,670

(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。

3. 取引条件の変更

一部の投資助言契約について取引条件を変更し、契約内容の一部を投資一任契約に移行しております。これにより、投資助言報酬及び未収投資助言報酬が減少し、運用受託報酬及び未収運用受託報酬が増加しております。

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 2015年4月 1日 至 2016年3月31日)	当事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)
1株当たり純資産額	475,337円55銭	539,133円00銭
1株当たり当期純利益金額	68,370円53銭	69,552円73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 2015年4月 1日 至 2016年3月31日)	当事業年度 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)
当期純利益	7,414,647千円	7,542,855千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	7,414,647千円	7,542,855千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第23期中間会計期間末 (2017年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		17,671,147
有価証券		6,602,399
前払費用		609,445
未収委託者報酬		3,999,420
未収運用受託報酬		2,335,491
未収投資助言報酬		107,292
繰延税金資産		273,657
その他		109,390
流動資産合計		31,708,245
固定資産		
有形固定資産	1	162,927
無形固定資産		943,974
投資その他の資産		
投資有価証券		31,224,218
関係会社株式		66,222
長期前払費用		24,779
差入保証金		285,839
繰延税金資産		285,545
その他		10,144
投資その他の資産合計		31,896,749
固定資産合計		33,003,651
資産合計		64,711,897

負債の部

流動負債

預り金	56,934
未払収益分配金	2,498
未払手数料	1,424,904
未払運用委託報酬	670,029
未払投資助言報酬	704,922
その他未払金	247,977
未払費用	148,596
未払法人税等	1,838,558
前受投資助言報酬	46,905
賞与引当金	469,996
その他	2 251,773
流動負債合計	<u>5,863,096</u>

固定負債

退職給付引当金	1,624,004
役員退職慰労引当金	19,475
固定負債合計	<u>1,643,479</u>

負債合計

7,506,576

純資産の部

株主資本

資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	<u>8,281,840</u>
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	37,387,299
利益剰余金合計	<u>38,067,106</u>
株主資本合計	<u>56,348,946</u>

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	856,374
評価・換算差額等合計	<u>856,374</u>

純資産合計

57,205,320

負債・純資産合計

64,711,897

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第23期中間会計期間	
(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	13,451,780
運用受託報酬	5,105,340
投資助言報酬	245,433
営業収益計	18,802,554
営業費用	9,435,094
一般管理費	1 3,962,305
営業利益	5,405,154
営業外収益	2 156,704
営業外費用	3 19,156
経常利益	5,542,703
特別利益	4 201,622
特別損失	5 1,216
税引前中間純利益	5,743,108
法人税、住民税及び事業税	1,741,273
法人税等調整額	29,939
法人税等合計	1,771,213
中間純利益	3,971,895

(3)中間株主資本等変動計算書

第23期中間会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	38,693,404	39,373,211	57,655,051
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,278,000	5,278,000	5,278,000
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,971,895	3,971,895	3,971,895
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,306,104	1,306,104	1,306,104
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	37,387,299	38,067,106	56,348,946

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	812,844	812,844	58,467,896
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	5,278,000
中間純利益	-	-	3,971,895
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	43,529	43,529	43,529
当中間期変動額合計	43,529	43,529	1,262,575
当中間期末残高	856,374	856,374	57,205,320

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第23期中間会計期間 （自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>其他有価証券 時価のあるもの ...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</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．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>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。</p>

(中間貸借対照表関係)

第23期中間会計期末 (2017年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	766,173千円
2.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第23期中間会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	24,084千円
無形固定資産	161,452千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	108,390千円
時効成立償還金	27,718千円
有価証券利息	18,426千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	9,594千円
為替差損	9,032千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	199,774千円
投資有価証券償還益	1,677千円
5.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	1,110千円
投資有価証券売却損	106千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第23期中間会計期間
 (自 2017年4月1日
 至 2017年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2017年6月23日 定時株主総会	普通株式	5,278,000	48,686	2017年3月31日	2017年6月23日

（金融商品関係）

第23期中間会計期間末（2017年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含まれておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	17,671,147	17,671,147	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,602,399	6,615,380	12,980
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,857,433	14,910,725	53,291
其他有価証券	16,299,285	16,299,285	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間会計期間末日の市場価格等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第23期中間会計期間末(2017年9月30日現在)

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	19,009,833	19,083,320	73,486
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	19,009,833	19,083,320	73,486
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	2,450,000	2,442,785	7,215
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,450,000	2,442,785	7,215
合計		21,459,833	21,526,105	66,271

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,804,993	5,832,950	27,956
	国債・地方債等	5,804,993	5,832,950	27,956
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	5,916,409	7,162,730	1,246,320
小計		11,721,402	12,995,680	1,274,277
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,343,140	3,303,604	39,535
小計		3,343,140	3,303,604	39,535
合計		15,064,542	16,299,285	1,234,742

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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

（デリバティブ取引関係）

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

該当事項はありません。

（ 1株当たり情報）

	第23期中間会計期間 （自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）
1株当たり純資産額	527,490円79銭
1株当たり中間純利益金額	36,624円88銭

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

2．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	3,971,861千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>3,971,861千円</u>
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第23期中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

該当事項はありません。

5【その他】

<訂正前>

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。

<訂正後>

定款の変更等

2017年3月24日に開催された臨時株主総会において、定款の「取締役の責任免除」にかかる条項の追加が決議されました。

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】

<訂正前>

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

2016年9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

2016年9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

(2016年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
日本生命保険相互会社	1,300,000百万円	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

2016年9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97,604株(持株比率90.00%)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。

<訂正後>

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

2017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

2017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

(2017年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
松井証券株式会社	11,945百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
日本生命保険相互会社	1,300,000百万円	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

2017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】

<訂正前>

- (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や、資料のご請求などを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 <http://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。

<訂正後>

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
 - ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

（4）目論見書に以下の内容を記載することがあります。

投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。

（5）目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

（6）目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。

（7）目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2018年3月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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ニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2017年7月14日から2018年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイワールドセレクトファンド（安定型）の2018年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2017年5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
業務執行社員 公認会計士 小暮和敏 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

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2016年4月1日から2017年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2017年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2017年11月27日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小暮和敏

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野あや子

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第23期事業年度の中間会計期間（2017年4月1日から2017年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2017年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2017年4月1日から2017年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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